

# 关于招商可转债分级债券型证券投资基金办理年度份额折算业务的公告

根据《招商可转债分级债券型证券投资基金基金合同》（简称“基金合同”），及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，招商可转债分级债券型证券投资基金（简称“本基金”）将在 2015 年 12 月 15 日办理年度份额折算业务。相关事项公告如下：

## 一、基金份额折算基准日

根据基金合同的规定，年度份额折算基准日为在本基金运作期内的每个会计年度（基金合同生效不足六个月的除外，运作期到期当年除外）的 12 月 15 日（遇节假日顺延）。

本次年度份额折算的基准日为 2015 年 12 月 15 日。

## 二、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的招商转债 A 份额（场内简称：转债优先，交易代码：150188）、招商可转债份额（场内简称：转债分级，基金代码：161719）。

## 三、基金份额折算方式

折算前的招商可转债份额持有人，以每 10 份招商可转债份额，按 7 份招商转债 A 的约定收益，获得新增招商可转债份额的分配。折算不改变招商可转债份额持有人的资产净值。折算前的招商转债 A 持有人，以招商转债 A 的约定收益，获得新增招商可转债份额的份额分配。折算不改变招商转债 A 持有人的资产净值，其持有的招商转债 A 份额净值折算调整为 1.000 元、份额数量不变，相应折算增加招商可转债份额场内份额。折算不改变招商转债 B 持有人的资产净值，其持有的招商转债 B 的份额净值及份额数量不变。持有场外招商可转债份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外招商可转债份额的分配；持有场内招商可转债份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内招商可转债份额的分配。经过上述份额折算，招商转债 A 份额的基金份额参考净值和招商可转债份额的基金份额净值将相应调整。

份额净值折算调整公式如下：

$$NAV_{\text{基础}}^{\text{后}} = \frac{NAV_{\text{基础}}^{\text{前}} \times NUM_{\text{基础}}^{\text{前}} - 0.7 \times (NAV_A^{\text{前}} - 1.000) \times NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}}{NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}}$$

其中：

$NAV_A^{\text{前}}$  为折算前招商转债 A 份额的基金份额参考净值

$NUM_A^{前}$  为折算前招商转债 A 份额的份额数

$NAV_{基础}^{后}$  为折算后招商可转债份额净值

$NUM_{基础}^{前}$  为折算前招商可转债份额的份额数

份额数量调整公式：

1) 招商转债 A 份额

定期份额折算后招商转债 A 份额的份额数 = 定期份额折算前招商转债 A 份额的份额数

2) 招商转债 B 份额

每个会计年度的定期份额折算不改变招商转债 B 份额的基金份额参考净值及其份额数。

3) 招商可转债份额

招商转债 A 份额持有人新增的场内招商可转债份额数量 = 
$$\frac{NUM_A^{前} \times (NAV_A^{前} - 1.000)}{NAV_{基础}^{后}}$$

招商转债份额持有人新增的招商可转债份额数量 = 
$$\frac{0.7 \times NUM_{基础}^{前} \times (NAV_A^{前} - 1.000)}{NAV_{基础}^{后}}$$

定期份额折算后招商可转债份额的份额数 = 定期份额折算前招商可转债份额的份额数  
+ 招商转债 A 份额持有人新增的招商可转债份额的份额数 + 招商转债份额持有人新增的招商可转债份额数量

其中：

$NAV_A^{前}$  为折算前招商转债 A 份额的基金份额参考净值

$NAV_{基础}^{后}$  为折算后招商可转债份额净值

$NUM_{基础}^{前}$  为折算前招商可转债份额的份额数

招商可转债份额的场外份额经折算后的份额数采用截尾法保留到小数点后两位；招商可转债份额的场内份额经折算后的份额数，以及招商转债 A 份额折算成招商可转债份额的场内份额数均取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

四、基金份额折算期间的基金业务办理

1、年度份额折算基准日（即 2015 年 12 月 15 日），本基金暂停办理申购、赎回、转托管（包括场外转托管、跨系统转托管，下同）业务、配对转换业务；招商转债 A 份额、

招商转债 B 份额交易正常。当日晚间，基金管理人计算当日基金份额净值及份额折算比例。

2、年度份额折算基准日后的第一个工作日（即 2015 年 12 月 16 日），本基金暂停办理申购、赎回、转托管、配对转换业务，招商转债 A 份额暂停交易，招商转债 B 份额正常交易。当日，本基金注册登记人及基金管理人为持有人办理份额登记确认。

3、年度份额折算基准日后的第二个工作日（即 2015 年 12 月 17 日），基金管理人将公告份额折算确认结果，持有人可以查询其账户内的基金份额。当日，本基金恢复办理申购、赎回、转托管、配对转换业务，招商转债 A 份额将于 2015 年 12 月 17 日上午开市至 10:30 停牌，并于 2015 年 12 月 17 日上午 10:30 之后复牌，招商转债 B 份额正常交易。

4、根据《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》，2015 年 12 月 17 日招商转债 A 份额即时行情显示的前收盘价将调整为前一交易日（2015 年 12 月 16 日）招商转债 A 份额的基金份额参考净值（四舍五入至 0.001 元）。由于招商转债 A 份额折算前可能存在折溢价交易情形，2015 年 12 月 15 日招商转债 A 份额的收盘价扣除前一期约定收益后的价格与 2015 年 12 月 17 日招商转债 A 份额调整后的前收盘价可能存在较大差异，因此 2015 年 12 月 17 日当日可能出现交易价格大幅波动的情形。

#### 五、重要提示

由于招商转债 A 份额新增份额折算成招商可转债份额的场内份额数和招商可转债份额的场内份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为 1 份），舍去部分计入基金财产，持有较少招商转债 A 份额数或场内招商可转债份额数的份额持有人存在无法获得新增场内招商可转债份额的可能性。因此，上述份额持有人可在基金份额折算基准日之前将原有份额卖出或者增加持有份额的数量来保证自身权益不受损害。

投资者若希望了解基金年度份额折算业务详情，请登陆本公司网站：

[www.cmfchina.com](http://www.cmfchina.com) 或者拨打本公司客服电话：400-887-9555。

本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者投资于基金前应认真阅读基金的基金合同、招募说明书等文件。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

招商基金管理有限公司

2015年12月10日