

# 关于招商中证白酒指数分级证券投资基金之招商中证白酒 A 份额和招商中证白酒 B 份额基金份额折算的公告

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》和《招商中证白酒指数分级证券投资基金基金合同》等的有关规定，招商中证白酒指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金管理人招商基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）制定了本基金的分级份额终止运作的实施方案。现将招商中证白酒 A 份额（场内简称：白酒 A，基金代码：150269）和招商中证白酒 B 份额（场内简称：白酒 B，基金代码：150270）折算相关内容公告如下：

## 一、分级份额终止运作的主要内容

根据《招商中证白酒指数分级证券投资基金基金合同》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》等相关规定，基金管理人向深圳证券交易所申请招商中证白酒 A 份额和招商中证白酒 B 份额终止上市，现已获得深圳证券交易所同意（《终止上市通知书》深证上[2020]1133号）。招商中证白酒 A 份额和招商中证白酒 B 份额的终止上市日为 2021 年 1 月 4 日。

招商中证白酒 A 份额和招商中证白酒 B 份额将折算为招商中证白酒份额，折算完成后投资者可以申请场内赎回招商中证白酒份额或将场内招商中证白酒份额转托管至场外后进行赎回。

## 二、基金份额的折算

### 1、份额折算基准日

本次份额折算基准日为 2020 年 12 月 31 日。

## 2、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的招商中证白酒 A 份额和招商中证白酒 B 份额。

## 3、基金份额折算方式

在份额折算基准日日终，以招商中证白酒份额的基金份额净值为基准，招商中证白酒 A 份额、招商中证白酒 B 份额按照各自的基金份额参考净值折算成场内招商中证白酒份额。招商中证白酒 A 份额（或招商中证白酒 B 份额）基金份额持有人持有的折算后场内招商中证白酒份额取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金资产。

份额折算计算公式：

招商中证白酒 A 份额（或招商中证白酒 B 份额）的折算比例 = 份额折算基准日招商中证白酒 A 份额（或招商中证白酒 B 份额）的基金份额参考净值 / 份额折算基准日招商中证白酒份额的基金份额净值

招商中证白酒 A 份额（或招商中证白酒 B 份额）基金份额持有人持有的折算后场内招商中证白酒份额 = 基金份额持有人持有的折算前招商中证白酒 A 份额（或招商中证白酒 B 份额）的份额数 × 招商中证白酒 A 份额（或招商中证白酒 B 份额）的折算比例

## 三、基金份额折算期间的基金业务办理

（一）折算基准日（即 2020 年 12 月 31 日），本基金招商中证白酒份额暂停办理申购（含定期定额投资，下同）、赎回、转换、转托管（包括系统内转托管、跨系统转托管，下同）、配对转换业务；当日晚间，基金管理人计算当日基金份额（参考）净值及份额折算比例。

（二）折算基准日后的第一个工作日（即 2021 年 1 月 4 日），本基金招商中证白酒份额暂停办理申购、赎回、转换、转托管、配对转

换业务，招商中证白酒 A 份额、招商中证白酒 B 份额终止上市。当日，本基金登记机构及基金管理人为基金份额持有人办理份额登记确认。

(三) 折算基准日后的第二个工作日(即 2021 年 1 月 5 日)，基金管理人将公告份额折算确认结果，基金份额持有人可以查询其账户内“招商中证白酒指数证券投资基金”的基金份额。当日，招商中证白酒指数证券投资基金恢复办理申购、赎回、转换、转托管业务。

#### **四、《招商中证白酒指数证券投资基金基金合同》的生效**

根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》等相关规定，经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，并报监管部门备案，招商中证白酒 A 份额和招商中证白酒 B 份额终止运作后，《招商中证白酒指数分级证券投资基金基金合同》将修订为《招商中证白酒指数证券投资基金基金合同》，《招商中证白酒指数分级证券投资基金托管协议》将修订为《招商中证白酒指数证券投资基金托管协议》。

招商中证白酒指数分级证券投资基金折算基准日次日(2021 年 1 月 1 日)《招商中证白酒指数证券投资基金基金合同》生效，《招商中证白酒指数分级证券投资基金基金合同》同时失效。

《招商中证白酒指数证券投资基金基金合同》生效后，在符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，基金管理人可根据有关规定，申请招商中证白酒指数证券投资基金的基金份额上市交易。

#### **五、重要提示**

**1、招商中证白酒 A 份额和招商中证白酒 B 份额的基金份额持有人持有的基金份额数量将会在折算后发生变化的风险**

在份额折算基准日日终，以招商中证白酒份额的基金份额净值为

基准，招商中证白酒 A 份额、招商中证白酒 B 份额按照各自的**基金份额参考净值（而不是二级市场价格）**折算成场内招商中证白酒份额。招商中证白酒 A 份额和招商中证白酒 B 份额基金份额持有人持有的折算后场内招商中证白酒份额取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金资产，持有极小数量招商中证白酒 A 份额、招商中证白酒 B 份额，存在折算后份额因为不足 1 份而导致相应的资产被强制归入基金资产的风险。

## **2、招商中证白酒 A 份额和招商中证白酒 B 份额折算后风险收益特征发生较大变化的风险**

份额折算后，招商中证白酒 A 份额持有人原持有的招商中证白酒 A 份额将变为招商中证白酒份额，基金份额风险收益特征将因转换而发生较大变化。招商中证白酒份额为跟踪中证白酒指数的基础份额，其份额净值将随标的指数的涨跌而变化，**原招商中证白酒 A 份额持有人将承担因净值下跌而遭受损失的风险。**

份额折算后，招商中证白酒 B 份额持有人原持有的招商中证白酒 B 份额将变为招商中证白酒份额，基金份额风险收益特征将因转换而发生较大变化。招商中证白酒份额为跟踪中证白酒指数的基础份额，没有杠杆特征，其基金份额净值将随标的指数的涨跌而变化，不会形成杠杆性收益或损失，但原招商中证白酒 B 份额持有人仍需承担因净值下跌而遭受损失的风险。

## **3、份额折算前溢价交易的基金份额持有人将会因为溢价的消失而遭受损失的风险**

份额折算基准日（含）前，招商中证白酒 A 份额和招商中证白酒 B 份额仍可正常交易。在此期间，招商中证白酒 A 份额和招商中证白

酒 B 份额可能存在折溢价交易情形，其折溢价率可能发生较大变化。

由于份额折算基准日日终，招商中证白酒 A 份额、招商中证白酒 B 份额按照各自的基金份额参考净值（而不是二级市场价格）折算成场内招商中证白酒份额，存在份额折算前溢价交易的招商中证白酒 A 份额和招商中证白酒 B 份额的持有人将会在折算后因为溢价的消失而遭受损失的风险。溢价率越高，折算后溢价消失而遭受的损失越大。特提请参与二级市场交易的投资者注意折溢价所带来的风险。

#### 4、招商中证白酒 A 份额和招商中证白酒 B 份额折算为招商中证白酒份额后无法直接办理场内赎回的风险

招商中证白酒 A 份额和招商中证白酒 B 份额折算为招商中证白酒份额后，投资者可以申请场内赎回基金份额或者转托管至场外后申请赎回基金份额。部分投资者可能由于所在证券公司不具备基金销售资格或其他原因无法直接办理场内赎回，需先转托管至场外后再申请赎回或者先转托管到具有基金销售资格的证券公司后再申请赎回。

5、份额折算后，在招商中证白酒份额开放赎回之前，投资者将无法办理基金赎回业务；在招商中证白酒份额上市交易之前，投资者将无法进行基金份额的上市交易，存在一定的流动性风险。

#### 6、招商中证白酒 A 份额和招商中证白酒 B 份额合并或折算为招商中证白酒份额后自确认之日起计算持有期及收取赎回费的风险

根据中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则，招商中证白酒 A 份额和招商中证白酒 B 份额合并或折算为招商中证白酒份额后，基金份额持有期自招商中证白酒份额确认之日起计算。基金份额持有人赎回份额时适用的赎回费率将根据持有期确定，具体持有时间以登记结算机构系统记录为准。如果赎回份额时持有期较短，基金份额持

有人将承担较高的赎回费。

投资者若希望了解基金份额折算业务详情,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 (免长途话费)。

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

2020年12月29日