招商国证生物医药指数分级证券投资基金之生物药A、生物药B上市交易公告书

基金管理人：招商基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
注册登记人：中国证券登记结算有限责任公司
上市地点：深圳证券交易所
上市时间：2015年6月5日
公告时间：2015年6月2日

一、重要声明与提示

招商国证生物医药指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）之生物药A、生物药B上市交易公告书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号<上市交易公告书的内容与格式>》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，本基金管理人的董事会及董事保证本上市交易公告书（以下简称“本公告书”）所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金托管人保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

本公告书第七节“基金财务状况”未经审计。

凡本公告未涉及的有关内容，请投资者详细查阅刊登在2015年5月15日《中国证券报》、《证券时报》及招商基金管理有限公司网站（www.cmfchina.com）上公告的《招商国证生物医药指数分级证券投资基金招募说明书》。

二、基金概览

1、基金名称：招商国证生物医药指数分级证券投资基金
2、基金类型：股票型
3、基金运作方式：契约型开放式
4、本基金的基金份额包括招商国证生物医药指数分级证券投资基金之基础份额（简称“招商国证生物医药份额”，场内简称“生物医药”，基金代码：161726）、招商国证生物医药指数分级证券投资基金之稳健收益类份额（简称“招商国证生物医药A份额”，场内简称“生物药A”，基金代码：150271）与招商国证生物医药指数分级证券投资基金之积极收益类份额（简称“招商国证生物医药B份额”，场内简称“生物药B”，基金代码：150272）。其中，招商国证生物医药A份额、招商国证生物医药B份额的基金份额配比始终保持1：1的比例不变。
5、基金存续期限：不定期
6、招商国证生物医药份额的申购与赎回：本基金合同生效后，投资人可通过场外或场内两种方式对招商国证生物医药份额进行申购与赎回。招商国证生物医药A份额、招商国证生物医药B份额只上市交易，不能受申购与赎回。招商国证生物医药份额的场外申购与赎回的场所包括基金管理人和基金管理人委托的场外代销机构，投资者可使用中国证券登记结算有限责任公司开放式基金账户，通过基金管理人、场外代销机构办理场外申购、赎回业务。招商国证生物医药份额的场内申购与赎回的场所为具有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位，投资者可使用深圳证券账户（即投资者在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的深圳证券交易所人民币普通股票账户或证券投资基金账户）通过深圳证券交易所交易系统办理场内申购、赎回业务。
7、份额配对转换：份额配对转换是指本基金的招商国证生物医药份额与招商国证生物医药A份额、招商国证生物医药B份额之间的配对转换，包括分拆和合并两个方面。分拆是指基金份额持有人将其持有的每两份招商国证生物医药份额的场内份额申请转换成一份招商国证生物医药A份额与一份招商国证生物医药B份额的行为。合并是指基金份额持有人将其持有的每一份招商国证生物医药A份额与一份招商国证生物医药B份额进行配对申请转换成两份招商国证生物医药份额的场内份额的行为。
8、定期份额折算：在存续期内的每个会计年度（基金合同生效不足六个月的除外）的12月15日（遇节假日顺延），招商国证生物医药A份额和招商国证生物医药B份额按照基金合同中规定的净值计算规则进行净值计算。对于招商国证生物医药A份额期末的约定应得收益，即招商国证生物医药A份额每个会计年度基金份额折算基准日的份额净值超出1.000元部分，将折算为场内招商国证生物医药份额分配给招商国证生物医药A份额持有人。招商国证生物医药份额持有人持有的每2份招商国证生物医药份额将按1份招商国证生物医药A份额获得新增招商国证生物医药份额的分配，持有场外招商国证生物医药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国证生物医药份额的分配，持有场内招商国证生物医药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国证生物医药份额的分配。经过上述份额折算，招商国证生物医药A份额的参考净值和招商国证生物医药B份额的基金份额净值将相应调整。在基金份额折算前与折算后，招商国证生物医药A份额和招商国证生物医药B份额的份额配比保持1:1的比例。
9、不定期份额折算：当招商国证生物医药份额的基金份额净值达到 1.500 元后，本基金将分别对招商国证生物医药A份额、招商国证生物医药B份额和招商国证生物医药份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保招商国证生物医药A份额和招商国证生物医药B份额的比例为1:1，份额折算后招商国证生物医药A份额和招商国证生物医药B份额的参考净值为1元。

当招商国证生物医药B份额的基金份额参考净值达到0.250元后，本基金将分别对招商国证生物医药A份额、招商国证生物医药B份额和招商国证生物医药份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保招商国证生物医药A份额和招商国证生物医药B份额的比例为1:1，份额折算后招商国证生物医药A份额的基金份额净值、招商国证生物医药A份额和招商国证生物医药B份额的基金份额参考净值均调整为1元。
10、基金份额总额：截至2015年5月29日，本基金的基金份额总额为1,130,152,987.25份，其中，招商国证生物医药份额为948,164,283.25份，招商国证生物医药A份额为 90,994,352.00份，招商国证生物医药B份额为90,994,352.00份。
11、基金份额参考净值：截至2015年5月29日，招商国证生物医药份额的基金份额净值为1.001元，招商国证生物医药A份额的基金份额参考净值为1.000元，招商国证生物医药B份额的基金份额参考净值为1.002元。
12、本次上市交易的基金份额场内简称及其基金代码：生物药A（基金代码：150271）、生物药B（基金代码：150272）
13、本次上市交易的基金份额总额：生物药A为90,994,352.00份；生物药B为90,994,352.00份（截至2015 年5月29日）
14、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
15、上市交易日期：2015年6月5日
16、基金管理人：招商基金管理有限公司
17、基金托管人：中国银行股份有限公司
18、本次上市交易的基金份额注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

三、基金的募集与上市交易

（一）上市前基金募集情况
1、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证券监督管理委员会证监许可【2015】668号
2、基金合同生效日：2015年5月27日
3、基金运作方式：契约型开放式
4、基金合同期限：不定期
5、发售日期：2015年5月19日至2015年5月22日
6、发售价格：1.00元人民币
7、发售方式：场内和场外
8、发售机构：
（1）场内发售机构：
本基金的场内发售机构为具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位（具体名单可在深圳证券交易所网站查询）。
（2）场外发售机构：
①直销机构包括本公司的招商基金官网交易平台、招商基金华东机构理财中心、招商基金华南机构理财中心、招商基金养老金及华北机构理财中心等。
②代销机构：中国银行、招商银行、招商证券、中万宏源证券、财富证券、中航证券、华融证券、华安证券、齐鲁证券、东兴证券、中山证券、东海证券、东吴证券、华龙证券、渤海证券、国都证券、新时代证券、中国民族证券、国泰君安、平安证券、中信证券、中信建投证券、光大证券、海通证券、兴业证券、大同证券、中国国际金融有限公司、太平洋证券、信达证券、中国银河证券、中万宏源西部证券、中信证券（浙江）、中信证券（山东）、万联证券、恒泰证券、第一创业证券、上海天天基金销售有限公司、红塔证券（排名不分先后）。
9、验资机构名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）
10、募集资金总额及入账情况
本基金于2015年5月19日起公开募集，基金募集工作已于2015年5月22日顺利结束。经毕马威华振会计师事务所验资，本次募集的有效认购资金人民币1,130,003,547.81元。基金注册登记机构记录的有效认购资金利息转份额人民币149,439.44元，共计人民币1,130,152,987.25元。上述资金及利息折合1,130,152,987.25份基金份额。有效认购资金人民币元已于2015年5月27日划入本基金在基金托管人中国银行股份有限公司开立的基金托管专户，此外，经中国证券登记结算有限责任公司确认，上述有效认购资金利息转份额中对应的应收利息人民币元将于招商国证生物医药指数分级证券投资基金成立之后的下一银行季度结息日（即2015年6月20日）后结转入相关账户。本次募集有效认购总户数为10,688户。
11、本基金募集备案情况
根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》以及《招商国证生物医药指数分级证券投资基金基金合同》、《招商国证生物医药指数分级证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金募集符合有关条件，本基金管理人已向中国证监会办理基金备案手续，并于2015年5月27日获书面确认，基金合同自该日起正式生效，自基金合同生效之日起，本基金管理人开始正式管理本基金。
12、基金合同生效日的基金份额总额：1,130,152,987.25份
13、本基金管理人及基金从业人员持有基金份额的情况：

份额级别		招商国证生物医药A份额	招商国证生物医药B份额	招商国证生物医药份额
募集期间基金管理人运用固有资金认购本基金情况	认购的基金份额（单位：份）	–	–	–
	占基金总份额比例	–	–	–
	其他需要说明的事项	–	–	–
募集期间基金管理人的从业人员认购本基金情况	认购的基金份额（单位：份）	–	–	49,614.42
	占基金总份额比例	–	–	0.0044%

本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、基金经理未持有本基金。
（二）本基金上市交易的主要内容
1、基金上市交易的核准机构和核准文号：深圳证券交易所深证上[2015]241号
2、上市交易日期：2015年6月5日
3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。
4、基金简称：招商国证生物医药A份额、招商国证生物医药B份额
基金场内简称：生物药A、生物药B
5、交易代码：生物药A：150271、生物药B：150272
6、本次上市交易份额：生物药A：90,994,352.00份、生物药B：90,994,352.00份
7、本上市交易份额的流通规定：对于托管在场内的招商国证生物医药份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其分拆为生物药A和生物药B即可上市流通；对于托管在场外的招商国证生物医药份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后分拆为生物药A和生物药B即可上市流通。
8、基金资产净值的披露：在招商国证生物医药A份额、招商国证生物医药B份额上市交易前或者开始办理招商国证生物医药份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日招商国证生物医药份额的基金份额净值和基金份额累计净值、招商国证生物医药A份额与招商国证生物医药B份额的基金份额参考净值。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况

（一）持有人户数
截至2015年5月29日，场外招商国证生物医药份额持有人户数为9,509 户，平均每户持有的基金份额为99,712.30份；场内招商国证生物医药份额持有人户数为 0.00户，平均每户持有的基金份额0.00份；生物药A为1,179.00户，平均每户持有的基金份额为77,179.26份；生物药B为1,179.00户，平均每户持有的基金份额为77,179.26份。
（二）持有人结构
截至2015年5月29日，机构投资者持有的本次上市交易的生物药A基金份额为13,658,180.00份，占本次生物药A上市交易基金份额比例为15.01%；个人投资者持有的本次上市交易的生物药A基金份额为77,336,172.00份，占本次生物药A上市交易基金份额比例为84.99%。
机构投资者持有的本次上市交易的生物药B基金份额为13,658,185.00份，占本次生物药B上市交易基金份额比例为15.01%；个人投资者持有的本次上市交易的生物药B基金份额为77,336,167.00份，占本次生物药B上市交易基金份额比例为84.99%。
（三）前十名场内基金份额持有人情况（截至2015年5月29日）
子基金生物药A（代码：150271）场内十大持有人情况表如下：

序号	持有人名称（全称）	证券帐户号	持有基金份额	占场内基金份额比例
1	上海大正投资有限公司	0800014578	7,500,510	8.24%
2	西南证券股份有限公司	0899052896	5,000,097	5.49%
3	娄永凤	0110137473	4,959,834	4.45%
4	金平	0138464351	878,059	0.96%
5	杨秀梅	0158865494	772,552	0.85%
6	陈伟	0028952679	750,051	0.82%
7	周琳	0143830211	613,541	0.67%
8	金文祖	0172447210	606,041	0.67%
9	第一创业证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	0689900134	552,534	0.61%
10	李娜	0104568481	501,034	0.55%
合计			22,134,253	23.31%

注：1、截止日期为上市交易公告书公告日前两个工作日；
2、持有基金份额为场内认购份额与利息转份额的合计份数；
3、以上信息依据中国证券登记结算有限公司深圳分公司提供的持有人信息编制。
子基金生物药B（代码：150272）场内十大持有人情况表如下：

序号	持有人名称（全称）	证券帐户号	持有基金份额	占场内基金份额比例
1	上海大正投资有限公司	0800014578	7,500,510	8.24%
2	西南证券股份有限公司	0899052896	5,000,097	5.49%
3	娄永凤	0110137473	4,959,834	4.45%
4	金平	0138464351	878,060	0.96%
5	杨秀梅	0158865494	772,553	0.85%
6	陈伟	0028952679	750,051	0.82%
7	周琳	0143830211	613,542	0.67%
8	金文祖	0172447210	606,041	0.67%
9	第一创业证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	0689900134	552,539	0.61%
10	李娜	0104568481	501,034	0.55%
合计			22,134,261	23.31%

注：1、截止日期为上市交易公告书公告日前两个工作日；
2、持有基金份额为场内认购份额与利息转份额的合计份数；
3、以上信息依据中国证券登记结算有限公司深圳分公司提供的持有人信息编制。

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人
1、公司概况
名称：招商基金管理有限公司
法定代表人：张光华
总经理：金旭
设立日期：2002年12月27日
注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦28楼
注册资本：人民币2.1亿元
办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦28楼
设立批准文号：中国证监会证监基金字[2002]100号
工商登记注册的法人营业执照文号：企合国字第000976
经营范围：基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。
存续期间：持续经营
客服热情：400-887-9555
传真：（0755）83076974
2、股东及其出资比例

管理人股东名称	占注册资本比例
招商银行股份有限公司	55%
招商证券股份有限公司	45%

3、内部组织结构及职能
公司具体经营管理由总经理负责，公司根据经营运作需要设置董事会办公室、投资管理一部、固定收益投资部、交易部、研究部、投资管理二部、投资管理三部、投资管理四部、全球量化投资部、渠道管理部、市场部、互联网金融部、产品研发部、国际业务部、机构理财部、信息技术部、基金核算部、基金事务部、法律合规部、风险管理部、总经理办公室、人力资源部、财务部等23个职能部门，并设有北京分公司、上海分公司、成都分公司等分支机构。
各部门主要职能如下：
董事会办公室：负责公司董事会相关工作。
投资管理一部：根据投资决策委员会制定的原则进行投资股票投资。
固定收益投资部：负责固定收益产品的投资。
交易部：负责公司所有产品的交易管理工作。
研究部：负责宏观、策略、行业和公司研究。
投资管理二部：负责专户产品的投资。
投资管理三部：根据投资决策委员会制定的原则进行投资股票投资。
投资管理四部：根据投资决策委员会制定的原则进行投资股票投资。
全球量化投资部：负责量化产品和指数产品的投资。
渠道管理部：负责基金的渠道销售工作。
市场部：负责营销策划、客户服务、市场推广等工作。
互联网金融部：负责互联网金融平台的搭建、对接与产品的销售等工作。
产品研发部：负责产品研发、申报等工作。
国际业务部：负责海外基金产品的投资研究。
机构理财部：负责机构销售业务。
信息技术部：负责公司电脑信息技术的开发、维护及基金后台运作支持工作。
基金核算部：负责公司基金的会计核算、估值。
基金事务部：负责公司基金的注册登记、资金清算。
法律合规部：负责对公司和基金运作合规性监察、稽核审计、法务支持及日常信息披露事宜。
风险管理部：负责对公司日常营运进行风险管理及风险检查；负责投资业绩评价。
总经理办公室：负责文档、印鉴管理、公司品牌建设、市场调研以及其他行政工作。
人力资源部：负责公司人力资源管理工作。
财务部：负责公司财务管理、会计核算等相关工作。
各分公司：负责所辖区域内销售渠道的开发、维护。
4、人员情况
截至2015年3月31日，公司共有员工252人，其中231人通过中国证券业协会组织的证券从业资格考试，具有基金从业资格。
5、信息披露负责人及咨询电话：
欧志明，（0755）83196401。
6、基金管理业务情况
本基金管理公司目前管理50只基金，其中封闭式基金1只；招商信用添利债券型证券投资基金；开放式基金49只。
7、本基金基金经理简介
王平，男，中国国籍，管理学硕士，FRM。2006年加入招商基金管理有限公司，历任投资风险管理部助理数量分析师、风险管理部数量分析师、高级风控经理、副总监，主要负责公司投资风险管理、金融工程研究等工作，现任全球量化投资部副总监兼招商深证100指数证券投资基金基金经理、上证消费80交易型开放式指数证券投资基金及联接基金基金经理、深证电子信息传媒产业（TMT）50交易型开放式指数证券投资基金及联接基金基金经理、招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金经理、招商央视财经50指数证券投资基金经理、招商中证银行指数分级证券投资基金基金经理、招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金基金经理、招商国证生物医药指数分级证券投资基金基金经理、招商中证白酒指数分级证券投资基金基金经理。
（二）基金托管人
1、基金托管人概况
名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）
住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记日期：1983年10月31日
注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整
法定代表人：田国立
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号
托管业务部总经理：李爱华
托管部门信息披露联系人：王永民
客服电话：95566
传真：（010）66594942
2、主要人员情况
中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。
3、证券投资基金托管情况
截至2015年3月31日，中国银行已托管328只证券投资基金，其中境内基金303只，QDII基金25只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。
（三）基金验资机构
名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）
注册地址：北京市东长安街1号东方广场东二办公楼八层
法定代表人：姚建华
电话：（0755）2547 1000
传真：（0755）8266 8930
经办注册会计师：王国蓓、黄小燚
联系人：蔡正轩

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七、基金财务状况

（一）基金募集期间费用
本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不从基金资产中支付。
（二）基金上市前重要财务事项
本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。
（三）基金资产负债表
截至公告前两个工作日即2015年5月29日，本基金的资产负债表如下：
资产负债表
会计主体：招商国证生物医药指数分级证券投资基金
报告截止日：2015年5月29日 单位：人民币元

资产	本报告期末 2015年5月29日
资 产：	
银行存款	929,540,107.43
结算备付金	–
存出保证金	–
交易性金融资产	300,045,010.32
其中：股票投资	300,045,010.32
债券投资	–
资产支持证券投资	–
基金投资	–
衍生金融资产	–
买入返售金融资产	600,000,000.00
应收证券清算款	–
应收利息	45,200.14
应收股利	–
应收申购款	–
其他资产	149,439.44
资产合计	1,829,779,757.33
负债和所有者权益	
负债：	
短期借款	–
交易性金融负债	–
衍生金融负债	–
卖出回购金融资产款	–
应付证券清算款	698,444,566.56
应付赎回款	–
应付管理人报酬	61,741.69
应付托管费	13,583.18
应付销售服务费	–
应付交易费用	272,095.53
应付税费	–
应付利息	–
应付利润	–
其他负债	4,180.02
负债合计	698,796,166.98
所有者权益：	
实收基金	1,130,152,987.25
未分配利润	830,603.10
所有者权益合计	1,130,983,590.35
负债与持有人权益总计	1,829,779,757.33

注：截至2015年5月29日，招商国证生物医药份额净值1.001元、招商国证生物医药A份额参考净值1.000元、招商国证生物医药B份额参考净值1.002元，招商国证生物医药份额948,164,283.25份、招商国证生物医药A份额90,994,352.00份、招商国证生物医药B份额90,994,352.00份。

八、基金投资组合

截至公告前两个工作日即2015年5月29日（以下称“报告期末”），本基金的投资组合如下：
（一）报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	300,045,010.32	16.40
	其中：股票	300,045,010.32	16.40
2	固定收益投资	–	–
	其中：债券	–	–
	资产支持证券	–	–
3	金融衍生品投资	–	–
4	买入返售金融资产	600,000,000.00	32.79
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
5	银行存款和结算备付金合计	929,540,107.43	50.80
6	其他资产	194,639.58	0.01
7	合计	1,829,779,757.33	100.00

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合
1、报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	2,619,540.00	0.23
B	采矿业	–	–
C	制造业	295,773,456.32	26.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,652,014.00	0.15
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	–	–
J	金融业	–	–
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	–	–
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	300,045,010.32	26.53

2、报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有积极投资的股票。
（三）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
1、报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

（下转B36版）

招商可转债分级债券型证券投资基金可能发生不定期份额折算的提示公告

根据《招商可转债分级债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）关于不定期份额折算的相关规定，当招商可转债份额的基金份额净值达到1.400元，本基金将进行不定期份额折算。

由于近期可转债市场波动较大，截至2015年6月4日，招商可转债分级债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）之基础份额（招商可转债份额）的基金份额净值接近基金合同规定的不定期份额折算的阈值，在此提请投资者密切关注招商可转债份额近期份额净值的波动情况。

针对不定期折算可能带来的风险，本基金管理人特别提示如下：

一、本基金之招商转债A份额表现为低风险、收益相对稳定的特征。当发生合同规定的不定期份额折算时，基金份额折算基准日折算前招商转债A份额超出 1.000 元的部分将折算为招商可转债份额，即，原招商转债A份额的持有人在不定期份额折算后将持有招商转债A份额和招商可转债份额，因此，持有人的风险收益特征将发生一定的变化，由持有单一的较低风险收益特征份额变为同时持有较低风险收益特征份额与较高风险收益特征份额的情况。

二、本基金之招商转债B份额表现为高风险、高收益的特征，不定期份额折算后将恢复到初始杠杆水平，其杠杆倍数将比折算前高。

三、招商转债A份额、招商转债B份额在折算前可能存在折溢价交易情形，不定期份额折算后，折溢价率可能数之发生变化，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。

四、根据合同规定，折算基准日在触发阈值日后广能确定，因此折算基准日招商可转债份额的净值可能与触发折算阈值的1.400元有一定差异。

本基金管理人的其他重要提示：

一、若本基金发生上述不定期份额折算情形，为保证折算期间本基金的平稳运作，本基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停招商转债A份额与招商转债B份额的上市交易和招商可转债份额的申购及赎回等相关业务。届时本基金管理人将会对相关事项进行公告，敬请投资者予以关注。

投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情，请参阅基金合同及《招商可转债分级债券型证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”）或者拨打本公司客服电话：400—887—9555（免长途话费）。

二、基金管理人承诺以诚实信用、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。本基金管理人提醒投资者知晓基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。敬请投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书等相关法律文件。

特此公告。

招商基金管理有限公司
2015年6月2日

关于开通招商中证白酒指数分级证券投资基金份额配对转换业务的公告

根据《招商中证白酒指数分级证券投资基金基金合同》的约定，招商基金管理有限公司将自2015年6月5日起，开通招商中证白酒指数分级证券投资基金的场内份额配对转换业务。

（一）场内份额配对转换
场内份额配对转换指根据基金合同约定，场内的基础份额与分级份额之间进行转换的行为，即招商中证白酒基础份额（简称“白酒分级”，代码“161725”）与招商中证白酒A份额（简称“白酒A”，代码“150269”）和招商中证白酒B份额（简称“白酒B”，代码“150270”）之间进行转换的行为，包括分拆与合并。
1）分拆：分拆指基金份额持有人将其持有的每2份招商中证白酒基础份额按照1：1的份额配比转换成1份招商中证白酒A份额与1份招商中证白酒B份额的行为。
2）合并：合并指基金份额持有人将其持有的每1份招商中证白酒A份额与1份招商中证白酒B份额按照1：1的基金份额配比转换成2份招商中证白酒基础份额的行为。
场外的招商中证白酒基础份额不进行份额配对转换，在场外的招商中证白酒基础份额通过跨系统转托管至场内后，可按照场内份额配对转换规则进行操作。
（二）业务办理机构
投资人可以通过依据中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中登”）有关规定获得业务办理资格的深圳证券交易所会员单位办理份额配对转换业务，按照中登有关规定获得业务办理资格的深圳证券交易所会员单位名单可向本公司咨询，中登网站2015年4月22日公告的具有配对转换业务资格的深圳证券交易所会员单位为：国泰君安证券、中信建投证券、国信证券、招商证券、广发证券、中信证券、银河证券、海通证券、中银万国证券、申银万国证券、兴业证券、长江证券、安信证券、西南证券、中信证券（浙江）、湘财证券、万联证券、民生证券、国元证券、渤海证券、华泰证券、山西证券、中信万通证券、东兴证券、东吴证券、信达证券、东方证券、方正证券、长城证券、光大证券、广州证券、东北证券、南京证券、上海证券、新时代证券、大同证券、国联证券、浙商证券、平安证券、华安证券、国海证券、财富证券、东莞证券、中原证券、国都证券、东海证券、中银国际证券、恒泰证券、国盛证券、华西证券、宏源证券、齐鲁证券、世纪证券、第一创业证券、金元证券、中航证券、华林证券、德邦证券、西部证券、广发华福证券、华龙证券、中金公司、财通证券、上海华信证券、华鑫证券、瑞银证券、中投证券、中山证券、红塔证券、西藏同信证券、日信证券、联讯证券、江海证券、天源证券、银泰证券、国金证券、民族证券、华宝证券、厦门证券、爱建证券、英大证券、华融证券、财达证券、天风证券、中天证券、大通证券、华创证券、万和证券、首创证券、国开证券、宏信证券、太平洋证券、开源证券、诚浩证券、川财证券。
（三）业务办理时间
深圳证券交易所交易时间内投资人可提出份额配对转换业务申请（基金管理人公告暂停份额配对转换业务时除外）。
若深圳证券交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人将对份额配对转换业务的办理时间进行相应调整并公告。
（四）场内份额配对转换的原则
1、投资人以中登深圳分公司A股账户或证券投资基金账户（以下简称“深市证券账户”）申报份额配对转换业务中的“分拆”或“合并”指令，申报前需备足对价，即投资人提出“合并”申请时，其所申报的深市证券账户上须有足够的、可交易的生物药A份额与生物药B份额；投资人提出“分拆”申请时，其所申报的深市证券账户上须有足够的、可交易的生物药份额。
2、投资人通过业务办理机构提出份额配对转换申请的，统一以招商国证生物医药分级份额（场内简称“生物医药”）的交易代码“161726”作为申请指令的证券代码，以份额为单位进行“合并”或“分拆”申报。
3、“合并”或“分拆”每笔申请的份额数不得低于2份，且应为2的整数倍。基金管理人可根据市场情况调整“合并”或“分拆”每笔申报的最低份额数量限制。基金管理人必须在调整生效前依照有关规定进行公告。
4、如果申请场内份额的合并，生物药A份额与生物药B份额必须同时配对申请，且生物药A份额与生物药B份额的份额数必须分别为相关业务公告规定份额的正整数倍，份额数配比为1:1。
5、办理份额配对转换业务的深圳证券交易所会员单位应对投资人每笔“分拆”或“合并”申请的可用份额数量进行检查并对相应基金份额进行冻结。
6、在交易时间内，份额配对转换业务办理机构通过深证通FDEP消息传输系统将份额配对转换申报指令发送给中登的基金业务系统。正常情况下，中登深圳分公司在T日收市后对投资人T日交易时间内提交的份额配对转换业务申请进行有效性确认，并进行份额变更处理，办理转出基金份额的扣款以及转入基金份额的登记。自T+1日起（包括该日）投资人可查询基金份额配对转换的成交情况。
7、投资人T日提出的MA份额“分拆”申请被确认成功后，中登深圳分公司将在投资人所申报的深市证券账户上扣减M份白酒分级份额，同时增加1M/2份白酒A与1M/2份白酒B。正常情况下，自T+1日（含该日）起新增的白酒A与白酒B份额可进行交易。
8、投资人T日提出的N份额“合并”申请被确认成功后，中登深圳分公司将在投资人所申报的深市证券账户上扣减1N/2份白酒A和1N/2份白酒B，同时增加N份白酒分级份额。正常情况下，自T+1日（含该日）起新增的白酒分级份额可进行赎回等业务。
9、场外白酒分级份额如需申请进行“分拆”，须将系统转托管为场内白酒分级份额后方可进行。
10、投资人提出的份额配对转换申请，在当日交易时间结束前可以撤销，交易时间结束后不得撤销。
11、份额配对转换应遵循最新发布的相关业务规则。
（五）份额配对转换的业务办理费用
投资人申请办理份额配对转换业务时，份额配对转换业务办理机构暂不收取业务办理费用。
（六）重要提示
1、基金管理人、注册登记机构或深圳证券交易所可视情况对上述“场内份额配对转换的原则”作出调整，并在正式实施前在至少一家指定媒体公告。
2、投资者可拨打客户服务热线：400-887-9555（免长话费），或登陆网站www.cmfchina.com获取相关信息。
3、风险提示：基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益。敬请投资人注意投资风险。

特此公告

招商基金管理有限公司
2015年6月2日

关于开通招商中证白酒指数分级证券投资基金跨系统转托管业务的公告

招商中证白酒指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同已于2015年5月27日正式生效。为了保证基金份额持有人的利益，根据《招商中证白酒指数分级证券投资基金基金合同》的约定，将自2015年6月5日开通招商中证白酒指数分级证券投资基金（基金代码：161726，场内简称：生物医药）的跨系统转托管业务。

通过场外认购本基金的投资人自2015年6月5日起可以通过认购本基金的销售机构办理招商国证生物医药基础份额跨系统转托管业务。本基金在开放日常申购业务后，投资人可以通过本基金的销售机构办理招商国证生物医药份额的分配。经过上述份额折算，招商国证生物医药A份额的参考净值和招商国证生物医药B份额的基金份额净值将相应调整。在基金份额折算前与折算后，招商国证生物医药A份额和招商国证生物医药B份额的份额配比保持1:1的比例。

场外认购/申购的招商国证生物医药基础份额只有在办理跨系统转托管业务成功后方能申请场内赎回或申请分拆为招商中证白酒A份额与招商中证白酒B份额，分拆后的招商中证白酒A份额与招商中证白酒B份额方可在深圳证券交易所上市交易。在确定上市交易时间后，本基金管理人应依据法律法规规定在指定媒体上刊登招商中证白酒A份额与招商中证白酒B份额上市交易公告书。敬请场外认购本基金的投资人根据自身情况办理跨系统转托管业务，在本基金开放申购后，本公告中跨系统转托管的相关规则将自动适用于在场内、场外申购的基金份额。

如有疑问，请拨打客户服务热线：400-887-9555（免长话费），或登陆网站www.cmfchina.com获取相关信息。

风险提示：基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益。敬请投资人注意投资风险。

特此公告

招商基金管理有限公司
2015年6月2日

关于开通招商国证生物医药指数分级证券投资基金份额配对转换业务的公告

根据《招商国证生物医药指数分级证券投资基金基金合同》的约定，招商基金管理有限公司将自2015年6月5日起，开通招商国证生物医药指数分级证券投资基金的场内份额配对转换业务。

（一）场内份额配对转换
场内份额配对转换指根据基金合同约定，场内的基础份额与分级份额之间进行转换的行为，即招商国证生物医药基础份额（简称“生物医药”，代码“161726”）与招商国证生物医药A份额（简称“生物药A”，代码“150271”）和招商国证生物医药B份额（简称“生物药B”，代码“150272”）之间进行转换的行为，包括分拆与合并。
1）分拆：分拆指基金份额持有人将其持有的每2份招商国证生物医药基础份额按照1：1份的份额配比转换成1份招商国证生物医药A份额与1份招商国证生物医药B份额的行为。
2）合并：合并指基金份额持有人将其持有的每1份招商国证生物医药A份额与1份招商国证生物医药B份额按照1：1的基金份额配比转换成2份招商国证生物医药基础份额的行为。
场外的招商国证生物医药基础份额不进行份额配对转换，在场外的招商国证生物医药基础份额通过跨系统转托管至场内后，可按照场内份额配