（上接B11版）

联系人：苏文静

经办律师：陈静茹、苏文静

（六）会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

法定代表人：杨绍信

联系电话：（021）23238888

经办注册会计师：单峰、魏佳亮

联系人：魏佳亮

四、基金的名称

本基金名称：鹏华价值优势混合型证券投资基金（LOF）

五、基金的运作方式及类型

（一）本基金运作方式

上市契约型开放式

（二）本基金类型

混合型证券投资基金

六、基金的投资目标

本基金依托严格的研究流程和投资纪律，强调运用相对估值分析方法，发掘我国资本市场国际接轨趋势下具备相对价值优势的中国企业，谋求基金资产的长期稳定增值。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的各类股票、债券、央行票据、权证、资产证券化产品以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如有投资需要可参与有价值的新股配售和增发。法律法规或中国证监会以后允许本基金投资的其他金融工具或品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

正常市场状况下，股票投资比例为60%～95%，债券投资比例为0%～35%，权证投资比例为0～3%，现金或到期日在1年以内的政府债券投资比例不低于5%。

八、基金的投资策略

（一）投资策略

本基金依托严格的研究流程和投资纪律，强调运用相对估值分析方法，通过广泛的估值比较，重点投资我国资本市场国际接轨趋势下具备相对价值优势并兼具良好成长性的中国企业。具体而言，本基金首先按照既有的研究流程和投资纪律进行行业配置和个股选择，再运用相对估值分析方法，进行广泛的估值比较，分析行业、个股的合理估值区间，深入发掘行业和个股层面由于具备相对价值优势而存在的投资机会，以此作为基金经理的投资线索以及权重调整的重要依据。

（二）投资方法及标准

1、股票投资

基金对于股票投资分为以下三个步骤：

第一步 按照既有的研究流程进行行业景气周期分析并建立股票投资备选库。

第二步 运用P/E、P/B、PEG、EV/EBITDA等相对估值分析方法，选择具有可比性的时段和市场，通过广泛的估值比较，分析行业、个股的合理估值区间，深入发掘行业和个股层面由于具备相对价值优势而存在的投资机会。

第三步 基金经理将行业和个股的相对价值优势作为投资线索以及权重调整的重要依据，对于个股还要结合行业研究员基于实地调研、财务分析等对公司盈利的持续性、稳定性、增长性以及资本回报率方面的研究成果，在股票备选库的基础上选择兼具价值优势与良好成长性的股票建立投资组合。

2、债券投资

在债券投资中，通过降低组合总体波动性从而改善组合风险构成为目的，采取积极主动的投资策略，谋取超额收益。

（三）投资决策依据及程序

1、决策依据

（1）国家有关法律法规和基金合同的规定；

（2）宏观经济环境、国家政策和市场周期分析；

（3）上市公司的估值优势、盈利能力和资产质量。

2、投资决策程序

（1）投资决策委员会首先确定基金投资阶段性的资产配置比例；

（2）行业研究员通过个股的财务评级、所处行业的定位分析、市场和经济环境分析等途径，自下而上地筛选出具有可持续增长前景的上市公司股票加入本基金股票投资备选库；

（3）行业研究小组所有的行业分析以及重点上市公司研究报告，必须应用相对估值分析方法进行估值比较，负责定期提供主要国际市场的当前估值数据，同时根据行业研究员的要求寻找和提供特定时期的历史估值数据作为研究的基础；

（4）基金经理负责将行业和个股的相对价值优势作为投资线索以及权重调整的重要依据，选择兼具价值优势与良好成长性的股票建立投资组合；

（5）固定收益小组与基金经理在投资决策委员会确定的资产配置比例范围内，根据久期决策、收益率曲线配置、类属配置、个券选择等原则构建债券组合；

（6）基金经理负责根据市场的变化，选择适当时机进行投资操作；

（7）金融工程师负责对基金持仓的品种进行风险监控、风险预警以及投资业绩评估；

（8）基金经理对于投资决策委员会和风险管理人员均认为具有较大风险的投资品种必须在规定的时间内进行调整；

（9）监察稽核部对投资交易的合法合规性进行监控。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中信标普A股综合指数收益率×70%+中信标普国债指数收益率×30%

中信标普A股综合指数是实时调整的全样本指数，作为按流通股本加权的综合指数，其样本股覆盖了上交所和深交所上市的所有A股，并且新股上市次日才计入指数调整，因此在客观上反映了二级市场的真实走势。

中信标普国债指数样本涵盖了上海证券交易所所有的国债品种。交易所的国债交易市场具有参与主体丰富、竞价交易连续的特性，能反映出市场利率的瞬息变化，也使得中信标普国债指数能真实地标示出利率市场整体的收益风险度。

本基金充分考虑本基金各资产投资比例要求从而构建上述业绩比较基准。

十、基金的风险收益特征

本基金为混合型基金，为证券投资基金中的中高风险品种。长期平均的风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票基金。

十一、基金的投资组合报告（未经审计）

本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，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。

本基金的托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，已于2015年7月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告中所列财务数据截至2015年6月30日（未经审计）。

1、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	3,214,633,110.09	83.92
	其中：股票	3,214,633,110.09	83.92
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	301,742,000.00	7.88
	其中：债券	301,742,000.00	7.88
	资产支持证券	–	–
4	贵金属投资	–	–
5	金融衍生品投资	–	–
6	买入返售金融资产	–	–
	其中：买断式逆回购的买入返售金融资产	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	271,666,075.39	7.09
8	其他资产	42,347,724.34	1.11
9	合计	3,830,388,909.82	100.00

2、 报告期末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	102,720,508.10	2.84
B	采矿业	–	–
C	制造业	1,840,716,586.49	50.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	65,003,523.18	1.80
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	145,423,254.88	4.02
G	交通运输、仓储和邮政业	112,430,480.76	3.11
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	202,596,918.96	5.61
J	金融业	149,777,521.92	4.14
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	262,696,194.66	7.27
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	78,594,671.20	2.18
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	173,674,043.94	4.81
R	文化、体育和娱乐业	80,999,406.00	2.24
S	综合	–	–
	合计	3,214,633,110.09	88.96

3、 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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000333	美的集团	8,000,000	298,240,000.00	8.25
2	002400	省广股份	10,399,691	262,696,194.66	7.27
3	600887	伊利股份	10,000,904	189,017,085.60	5.23
4	600690	青岛海尔	6,003,282	182,079,543.06	5.04
5	600036	招商银行	8,000,936	149,777,521.92	4.14
6	000538	云南白药	1,499,964	129,401,894.28	3.58
7	300244	迪安诊断	1,499,961	125,906,726.34	3.48
8	000503	海虹控股	2,349,805	115,140,445.00	3.19
9	601006	大秦铁路	8,007,869	112,430,480.76	3.11
10	600559	老白干酒	1,199,953	100,220,074.56	2.77

4、 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	301,742,000.00	8.35
	其中：政策性金融债	301,742,000.00	8.35
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债	–	–
8	其他	–	–
9	合计	301,742,000.00	8.35

5、 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	130426	13农发26	1,000,000	100,750,000.00	2.79
2	130326	13进出26	900,000	90,585,000.00	2.51
3	140223	14国开23	500,000	50,200,000.00	1.39
4	130420	13农发20	300,000	30,153,000.00	0.83
5	130317	13进出17	300,000	30,054,000.00	0.83

6、 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资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

（1）报告期末本基金投资的股指期货持仓和揽品明细

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

（2）本基金投资股指期货的投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

10、 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

（1）本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

（2）报告期末本基金投资的国债期货持仓和揽品明细

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

（3）本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

11、 投资组合报告附注

（1）本基金投资的前十大证券之一云南白药的发行主体云南白药集团股份有限公司的子公司云南白药集团中药资源公司在国家食品药品监督管理局2015年5月19日发布的《关于桂林兴达药业有限公司（以下简称“桂林兴达”）等企业违法生产销售银杏叶药品的通告》（2015 年第15 号）中涉及购买非法银杏叶提取物，正协助药监部门进行此事件的核查工作。

对该股票的投资决策程序的说明：根据云南白药公告的说明，本次涉及的购买非法银杏叶提取物，是响应下游客户要求，从具备银杏叶提取物生产资质的桂林兴达采购五批计6.9吨银杏叶提取物，并销售给客户。该行为系云南白药集团中药资源公司正常的经营贸易业务。除以上业务外，云南白药集团中药资源公司未发生过任何银杏叶提取物的生产、采购和销售业务。因此，我们认为该事件并不会对云南白药的投资价值产生重大影响。该证券的投资已严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

本基金投资的前十名证券中的其它证券本期没有发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

（2） 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

（3） 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,351,869.56
2	应收证券清算款	25,101,339.61
3	应收股利	–
4	应收利息	10,272,608.11
5	应收申购款	4,621,907.06
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	42,347,724.34

（4）报告期未持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

（5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末股票投资前十名股票中不存在流通受限情况。

（6）投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

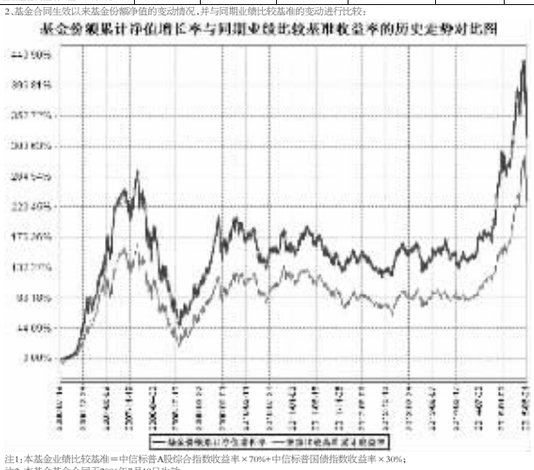
十二、基金的业绩（未经审计）

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财产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1、本基金基金合同生效以来的投资业绩与同期基准的比较如下表所示（本报告中所列财务数据未经审计）：

成立时间	净值增长率1	净值增长率标准差2	业绩比较基准收益率3	业绩比较基准收益率标准差4	1-3	2-4
2006年7月18日 至2006年12月31日	49.93%	0.89%	24.09%	0.93%	25.84%	-0.04%
2007年1月1日至2007年12月31日	131.64%	1.92%	102.06%	1.59%	29.58%	0.33%
2008年1月1日至2008年12月31日	-52.53%	2.41%	-47.68%	2.12%	-4.85%	0.29%
2009年1月1日至2009年12月31日	80.78%	1.61%	68.25%	1.42%	12.53%	0.19%
2010年1月1日至2010年12月31日	-13.43%	1.27%	-1.01%	1.10%	-12.42%	0.17%
2011年1月1日至2011年12月31日	-9.93%	1.12%	-19.28%	0.94%	9.35%	0.18%
2012年1月1日至2012年12月31日	9.37%	0.94%	5.27%	0.93%	4.10%	0.01%
2013年1月1日至2013年12月31日	1.96%	1.08%	2.68%	0.94%	-0.72%	0.14%
2014年1月1日至2014年12月31日	46.15%	1.07%	34.46%	0.78%	11.69%	0.29%
2015年1月1日至2015年6月30日	18.49%	2.13%	33.03%	1.51%	-14.54%	0.62%
自基金合同生效日至2015年6月30日	348.77%	1.53%	240.97%	1.30%	107.80%	0.23%

2、基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注1：本基金业绩比较基准＝中信标普A股综合指数收益率×70%+中信标普国债指数收益率×30%；

注2：本基金基金合同于2006年7月18日生效；

注3：本基金业绩截止日为2015年6月30日。

十三、基金的费用

（一）与基金运作有关的费用

1、与基金运作有关的费用的种类

（1）基金管理人的管理费；

（2）基金托管人的托管费；

（3）基金财产拨划支付的银行费用；

（4）基金合同生效后的信息披露费用；

（5）基金份额持有人大会费用；

（6）基金合同生效后的会计师费和律师费；

（7）基金的证券交易费用；

（8）按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

上述基金费用由基金托管人根据有关法规和本基金合同、招募说明书等法律文件的规定，按费用的实际支出金额支付，列入当期基金费用。国家另有规定的从其规定。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

（1）基金管理人的管理费

基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×1.5%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首2个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

（2）基金托管人的托管费

基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.25%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

（3）本条第1款第（3）至第（8）项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规、中国证监会的规章及相关协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

（二）与基金销售有关的费用

1、申购费

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等发生的各项费用。

本基金采取金额申购的方式，场外、场内的申购费率相同。

本基金对通过直销柜台申购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。

养老金客户指基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金，包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围，并按规定向中国证监会备案。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资者。

通过基金管理人的直销柜台申购本基金基金份额的养老金客户特定申购费率如下表：

申购金额M（元）	特定申购费率
M<50万	0.60%
50万≤M <250万	0.60%
250万≤M <500万	0.60%
500万≤M <1000万	0.50%
M≥1000万	每笔1000元

其他投资者申购本基金基金份额的申购费率费率如下表：

申购金额M（元）	申购费率
M<50万	1.50%
50万≤M <250万	1.20%
250万≤M <500万	0.75%
500万≤M <1000万	0.50%
M≥1000万	每笔1000元

投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

场外、场内申购相关计算公式：

净申购金额＝申购金额/（1＋申购费率）

申购费用＝申购金额－净申购金额

申购份数＝净申购金额/T日基金份额净值

场内申购份额保留到整数位，计算所得整数位后小数部分的份额对应的资金返还至投资者资金账户。

2、转换费

具体转换费率、计算公式及转换业务规则等相关规定请查看基金管理人的相关公告。

3、赎回费

本基金的场外赎回费率按持有年限递不递减，具体费率如下：

持有年限（y）	场外赎回费率
Y≥1年	0.5%
1年≤Y<2年	0.25%
Y≥2年	0

本基金的场内赎回费率为固定值0.5%。

场外、场内赎回相关计算公式：

赎回总额＝赎回份数×T日基金份额净值

赎回费用＝赎回总额×赎回费率

赎回金额＝赎回总额－赎回费用

赎回费用由赎回申请人承担，赎回费总额的25%归基金财产，75%用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

4、基金管理人可以在不违反相关法律、法规及中国证监会强制规定以及不违反基金合同约定的前提下调整上述费率及/或收取方式，并应最迟于新的费率实施前3个工作日依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒体上公告。调整后的上述费率还将在最新的招募说明书中列示。

5、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低上述基金申购费率、基金转换费率和基金赎回费率。

（三）其他费用

按照国家有关规定可以列入的其他费用根据相关法律及中国证监会相关规定列支。

（四）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关事项发生的费用等不列入基金费用。募集期间发生的律师费、会计师费、信息披露费以及其他费用不得从基金财产中支付。

（五）费用调整

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前3个工作日在指定媒体上刊登公告。

（六）税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人根据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的规定，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对本基金管理人原公告的本基金招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

1、因基金名称变更、基金类型由股票型基金变更为混合型基金，对招募书相应部分进行了更新。

2、在“重要提示”部分明确了更新招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。

3、对“二、基金管理人”部分内容进行了更新。

4、对“四、基金托管人”部分内容进行了更新。

5、对“五、相关服务机构”部分内容进行了更新。

6、对“十一、基金的投资”中的相关内容做了更新。

7、对“十二、基金的业绩”中的相关内容做了更新。

8、对“二十四、其他应披露事项”中的相关内容做了更新。

鹏华基金管理有限公司
2015年8月

招商中证白酒指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告

根据《招商中证白酒指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）中关于不定期份额折算的相关规定，当招商中证白酒指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）之招商中证白酒B份额（场内简称：白酒B，交易代码：150270）的基金份额参考净值达到0.250元后，本基金招商中证白酒分级份额（场内简称：白酒分级，基金代码：161725）、招商中证白酒A份额（场内简称：白酒A，交易代码：150269）及招商中证白酒B份额将进行不定期份额折算。

由于近期A股市场波动较大，截至2015年8月26日，招商中证白酒B份额的基金份额参考净值接近基金合同规定的不定期份额折算阀值，因此本基金管理人敬请投资者密切关注招商中证白酒B份额近期的份额参考净值波动情况，并警惕可能出现的风险。

针对不定期折算所带来的风险，本基金管理人特别提示如下：

一、招商中证白酒A份额、招商中证白酒B份额折算前可能存在折溢价交易情形，不定期份额折算后，招商中证白酒A份额、招商中证白酒B份额的折溢价率可能发生较大变化。特提请参与二级市场交易的投资者注意高溢价所带来的风险。

二、招商中证白酒B份额表现为高风险、高收益的特征，不定期份额折算后其杠杆倍数将大幅降低，将恢复到初始的2倍杠杆水平，相应地，招商中证白酒B份额的份额参考净值随市场涨跌而增长或者下降的幅度也会大幅减小。

三、由于触发折算阀值当日，招商中证白酒B份额的份额参考净值可能已低于阀值，而折算基准日在触发阀值日后才能确定，因此折算基准日招商中证白酒B份额的份额净值可能与折算阀值0.250元有一定差异。

四、招商中证白酒A份额表现为低风险、收益相对稳定的特征，但在不定期份额折算后招商中证白酒A份额持有人的风险收益特征将发生较大变化，由持有单一的较低风险收益特征的招商中证白酒A份额变为同时持有较低风险收益特征的招商中证白酒A份额与较高风险收益特征的招商中证白酒分级份额的情况，因此招商中证白酒A份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加。

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，按照基金合同规定的方法折算后本基金招商中证白酒分级份额、招商中证白酒A份额及招商中证白酒B份额的份额数量均会缩减。根据深圳证券交易所的相关业务规则，场内份额数将取整计算（最小单位为1份），舍去部分计入基金资产，持有极小数量招商中证白酒A份额、招商中证白酒B份额和场内招商中证白酒分级份额的持有人，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。

二、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中证白酒A份额与招商中证白酒B份额的上市交易和招商中证白酒分级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，请参阅本基金的基金合同及《招商中证白酒指数分级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）。

三、本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。投资有风险，选择须谨慎。敬请投资者于投资前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8月27日

招商中证白酒指数分级证券投资基金B类份额交易价格波动提示公告

近期，招商基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）旗下招商中证白酒指数分级证券投资基金之B类份额（场内简称：白酒B；交易代码：150270）二级市场交易价格连续大幅下跌， 2015年8月25日，招商中证白酒B类份额在二级市场的收盘价为0.582元，相对于当日0.373元的基金份额参考净值，溢价幅度为56.03%。截止2015年8月26日，招商中证白酒B类份额二级市场的收盘价为0.524元，明显高于基金份额参考净值，投资者如果盲目投资，可能遭受重大损失。

为此，本基金管理人提示如下：

1、招商中证白酒B类份额表现为高风险、高收益的特征。由于招商中证白酒B类份额内含杠杆机制的设计，招商中证白酒B类份额参考净值的变动幅度将大于招商中证白酒份额（场内简称：白酒分级，基金代码：161725）净值和招商中证白酒A类份额（场内简称：白酒A，交易代码：150269）参考净值的变动幅度，因招商中证白酒B类份额的波动性要高于其他两类份额，其承担的风险也较高。招商中证白酒B类份额的持有人会因杠杆倍数的变化而承担不同程度的投资风险。

2、招商中证白酒B类份额的交易价格，除了有份额参考净值变化的风险外，还会受到市场的系统性风险、流动性风险等其他风险影响，可能使投资人面临损失。

3、截至2015年8月26日收盘，招商中证白酒B类份额的基金份额参考净值接近基金合同约定的不定期份额折算阀值。不定期份额折算后，招商中证白酒B类份额的溢价率可能发生较大变化。特提请参与二级市场交易的投资者注意高溢价所带来的风险。

4、截至本公告披露日，招商中证白酒指数分级证券投资基金运作正常。本基金管理人仍将严格按照法律法规及基金合同进行投资运作。

5、截至本公告披露日，招商中证白酒指数分级证券投资基金无其他应披露而未披露的重大信息。本基金管理人仍将严格按照有关规定和要求，及时做好信息披露工作。

6、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。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。

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8月27日

关于招商中证全指证券公司指数分级证券投资基金之招商中证证券公司B份额停复牌的公告

根据招商中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金合同，招商中证全指证券公司指数分级证券投资基金已于2015年8月25日触发基金合同规定的不定期份额折算条件，将以2015年8月26日为折算基准日办理不定期份额折算。为加强交易风险警示，招商中证全指证券公司指数分级证券投资基金之招商中证证券公司B份额（证券简称：*券商B，证券编码：150201）于2015年8月26日13：00至14：00停牌，14：00复牌。

请投资者关注风险，谨慎投资。

招商基金管理有限公司
2015年8月26日

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，当招商可转债分级债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）之招商转债B份额（场内简称：转债进取，交易代码：150189）的基金份额参考净值达到0.450元后，本基金招商转债分级（场内简称：转债分级，基金代码：161719）、招商转债A份额（场内简称：转债优先，交易代码：150188）及招商转债B份额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8月26日，招商转债B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阀值，在此提请投资者密切关注招商转债B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、招商转债A份额、招商转债B份额折算前可能存在折溢价交易情形，不定期份额折算后，招商转债A份额、招商转债B份额的折溢价率可能发生较大变化。特提请参与二级市场交易的投资者注意高溢价所带来的风险。

二、招商转债B份额表现为高风险、高收益的特征，不定期份额折算后其杠杆倍数将大幅降低，将恢复到初始的3.33倍杠杆水平，相应地，招商转债B份额的参考净值随市场涨跌而增长或者下降的幅度也会大幅减小。

三、由于触发折算阀值当日，招商转债B份额的份额参考净值可能已低于阀值，而折算基准日在触发阀值日后才能确定，因此折算基准日招商转债B份额的参考净值可能与折算阀值0.450元有一定差异。

四、招商转债A份额表现为低风险、收益相对稳定的特征，但在不定期份额折算后招商转债A份额持有人的风险收益特征将发生较大变化，由持有单一的较低风险收益特征的招商转债A份额变为同时持有较低风险收益特征的招商转债A份额与较高风险收益特征的招商转债分级份额的情况，因此招商转债A份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加。

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，按照基金合同规定的方法折算后本基金招商转债分级份额、招商转债A份额及招商转债B份额的份额数量均会缩减。根据深圳证券交易所的相关业务规则，场内份额数将取整计算（最小单位为1份），舍去部分计入基金资产，持有极小数量招商转债A份额、招商转债B份额和场内招商转债分级份额的持有人，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。

二、招商转债B份额表现为高风险、高收益的特征，不定期份额折算后其杠杆倍数将大幅降低，将恢复到初始的3.33倍杠杆水平，相应地，招商转债B份额的参考净值随市场涨跌而增长或者下降的幅度也会大幅减小。

三、由于触发折算阀值当日，招商转债B份额的参考净值可能已低于阀值，而折算基准日在触发阀值日后才能确定，因此折算基准日招商转债B份额的参考净值可能与折算阀值0.450元有一定差异。

四、招商转债A份额表现为低风险、收益相对稳定的特征，但在不定期份额折算后招商转债A份额持有人的风险收益特征将发生较大变化，由持有单一的较低风险收益特征的招商转债A份额变为同时持有较低风险收益特征的招商转债A份额与较高风险收益特征的招商转债分级份额的情况，在招商转债A份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加。

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，按照基金合同规定的方法折算后本基金招商转债分级份额、招商转债A份额及招商转债B份额的份额数量均会缩减。根据深圳证券交易所的相关业务规则，场内份额数将取整计算（最小单位为1份），舍去部分计入基金资产，持有极小数量招商转债A份额、招商转债B份额和场内招商转债分级份额的持有人，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。

二、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分级份额与招商转债A份额与招商转债B份额的上市交易和招商转债分级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，请参阅本基金的基金合同及《招商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）。

三、 本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。投资有风险，选择须谨慎。敬请投资者于投资前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8月27日

招商基金管理有限公司关于招商安盈保本混合型证券投资基金增加华龙证券有限责任公司为代销机构的公告

根据招商基金管理有限公司与华龙证券有限责任公司（以下简称“华龙证券”）签署的《招商基金管理有限公司旗下开放式基金销售和服务代理协议》及《开放式证券投资基金代理销售补充协议》，自2015年8月27日起华龙证券代理招商安盈保本混合型证券投资基金（以下简称“本基金”，基金代码：217024）的销售业务，投资者欲了解本基金详细信息请仔细阅读本基金的基金合同和招募说明书等法律文件。

一、办理场所

华龙证券全国各网点均可为投资者办理招商安盈保本混合型证券投资基金的账户开户、申购、赎回等业务。具体办理程序请遵循代销机构的相关规定。

二、投资者可通过以下途径了解或咨询相关情况

1、各销售机构客服电话及网址

渠道	网址	客服电话
华龙证券	www.hlzqgs.com	0931-95368

2、招商基金管理有限公司网站：www.cmfchina.com@3、招商基金管理有限公司客服电话：400－887－9555

三、风险提示

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。投资者投资于上述基金时应认真阅读上述基金的基金合同、招募说明书等资料。敬请投资者留意投资风险。

特此公告。

招商基金管理有限公司
2015年8月27日

招商基金管理有限公司关于旗下基金估值变更的公告

招商基金管理有限公司（以下简称“我公司”）旗下基金持有下列停牌股票：浙报传媒（600633）、东方集团（600811）和威华股份（002240）。

根据中国证券监督管理委员会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》（第[2008]38号）和基金合同的相关约定，本公司经与基金托管人、会计师事务所协商一致，决定自2015年8月26日起，对旗下证券投资基金（除上证消费80交易型开放式指数证券投资基金外）所持有的上述股票采用“指数收益法”进行估值。同时，对招商上证消费80交易型开放式指数证券投资基金联接基金持有的上证消费80交易型开放式指数证券投资基金，在当日份额净值的基础上考虑上述股票的调整因素进行估值。

待上述股票复牌且其交易体现了活跃市场交易特征后，将恢复按市价估值方法进行估值。同时，对招商上证消费80交易型开放式指数证券投资基金联接基金持有的上证消费80交易型开放式指数证券投资基金恢复按估值日的份额净值进行估值，届时不再另行公告。敬请投资者予以关注。

风险提示：

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。投资者投资于本公司管理的基金时应认真阅读基金合同和招募说明书。

特此公告并提示。

招商基金管理有限公司
2015年8月27日

招商沪深300高贝塔指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告

根据《招商沪深300高贝塔指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）中关于不定期份额折算的相关规定，当招商沪深300高贝塔指数分级证券投资基金（以下简称“