

## 招商可转债分级债券型证券投资基金管理可能产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管理合同》(以下简称“基金合同”)关于不定期份额折算的规定,当本基金转债A份额、招商转债B份额(场内简称:转债进取,交易代码:150189)的基本份额参考净值达到或超过1.45元后,本基金招商转债B份额(场内简称:转债分级,基金代码:161719)的招商转债A份额(场内简称:转债优先,交易代码:150198)及招商转债C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2019年5月10日,招商转债B份额的基本份额净值接近基金合同规定的不定期份额折算的值,在此提请投资者密切关注并及时关注招商转债B份额的净值变化情况。

针对不定期份额折算可能带来的风险,基金管理人特别提示如下:

一、招商转债A份额、招商转债C份额可能存在溢价交易情形,不定期份额折算后,招商转债A份额、招商转债C份额的溢价率可能发生较大变化。特提请投资者关注二级市场交易的投资风险和溢价率变化风险。

二、招商转债B份额表现为低风险、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杠杠水平,相对地,招商转债C份额的参考净值随市场涨跌而增减或者下降的幅度会大幅缩小。

三、由于触发折算阀值日,招商转债B份额的参考净值可能低于面值,而折算基准日在触发阀值日后才能确定,因此投资者在该基准日申购转债C份额时可能有0.45%的一定差异。

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可转债A份额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可转债C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。

五、基金管理人的其他特别提示:

1. 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

入份额,转进买入,交易代码:150189)的基本份额参考净值达到或超过1.45元后,本基金招商转债B份额(场内简称:转债进取,交易代码:150189)及招商

转债C份额将进行不定期份额折算。

六、为保证折算期间本基金的正常运作,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公司的相关业务规则暂停招商转债A份额与招商转债B份额的上市交易并可暂停转债C份额的上市交易。

七、基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也

不保证最低收益。基金管理人提示投资者注意基金投资的“买者自负”原则,在做出投资决策后,基金运营结果及基金净值变化由投资者自行承担。

八、招商转债B份额表现为低风险、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杠杠水平,相对地,招商转债C份额的参考净值随市场涨跌而增减或者下降的幅度会

大幅缩小。

九、由于触发折算阀值日,招商转债B份额的参考净值可能低于面值,而折算基准日在触发阀值

日后才能确定,因此投资者在该基准日申购转债C份额时可能有0.45%的一定差异。

十、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可转债A份额同时持

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可转债C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。

十一、基金管理人的其他特别提示:

十二、为保证折算期间本基金的正常运作,基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结

算有限公司的相关业务规则暂停招商转债A份额与招商转债B份额的上市交易并可暂停招商转债C

份额的上市交易。

十三、基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也

不保证最低收益。基金管理人提示投资者注意基金投资的“买者自负”原则,在做出投资决策后,

基金运营结果及基金净值变化由投资者自行承担。

十四、招商转债B份额表现为低风险、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杠杠水平,相对地,招商转债C份额的参考净值随市场涨跌而增减或者下降的幅度会

大幅缩小。

十五、由于触发折算阀值日,招商转债B份额的参考净值可能低于面值,而折算基准日在触发阀值

日后才能确定,因此投资者在该基准日申购转债C份额时可能有0.45%的一定差异。

十六、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可转债A份额同时持

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可转债C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。

十七、基金管理人的其他特别提示:

十八、为保证折算期间本基金的正常运作,基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结

算有限公司的相关业务规则暂停招商转债A份额与招商转债B份额的上市交易并可暂停招商转债C

份额的上市交易。

十九、基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也

不保证最低收益。基金管理人提示投资者注意基金投资的“买者自负”原则,在做出投资决策后,

基金运营结果及基金净值变化由投资者自行承担。

二十、招商转债B份额表现为低风险、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杠杠水平,相对地,招商转债C份额的参考净值随市场涨跌而增减或者下降的幅度会

大幅缩小。

二十一、由于触发折算阀值日,招商转债B份额的参考净值可能低于面值,而折算基准日在触发阀值

日后才能确定,因此投资者在该基准日申购转债C份额时可能有0.45%的一定差异。

二十二、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可转债A份额同时持

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可转债C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。

二十三、基金管理人的其他特别提示:

二十四、为保证折算期间本基金的正常运作,基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结

算有限公司的相关业务规则暂停招商转债A份额与招商转债B份额的上市交易并可暂停招商转债C

份额的上市交易。

二十五、基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也

不保证最低收益。基金管理人提示投资者注意基金投资的“买者自负”原则,在做出投资决策后,

基金运营结果及基金净值变化由投资者自行承担。

二十六、招商转债B份额表现为低风险、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杠杠水平,相对地,招商转债C份额的参考净值随市场涨跌而增减或者下降的幅度会

大幅缩小。

二十七、由于触发折算阀值日,招商转债B份额的参考净值可能低于面值,而折算基准日在触发阀值

日后才能确定,因此投资者在该基准日申购转债C份额时可能有0.45%的一定差异。

二十八、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可转债A份额同时持

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可转债C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。

二十九、基金管理人的其他特别提示:

三十、为保证折算期间本基金的正常运作,基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结

算有限公司的相关业务规则暂停招商转债A份额与招商转债B份额的上市交易并可暂停招商转债C

份额的上市交易。

三十一、基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也

不保证最低收益。基金管理人提示投资者注意基金投资的“买者自负”原则,在做出投资决策后,

基金运营结果及基金净值变化由投资者自行承担。

三十二、招商转债B份额表现为低风险、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杠杠水平,相对地,招商转债C份额的参考净值随市场涨跌而增减或者下降的幅度会

大幅缩小。

三十三、由于触发折算阀值日,招商转债B份额的参考净值可能低于面值,而折算基准日在触发阀值

日后才能确定,因此投资者在该基准日申购转债C份额时可能有0.45%的一定差异。

三十四、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可转债A份额同时持

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可转债C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。

三十五、基金管理人的其他特别提示:

三十六、为保证折算期间本基金的正常运作,基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结

算有限公司的相关业务规则暂停招商转债A份额与招商转债B份额的上市交易并可暂停招商转债C

份额的上市交易。

三十七、基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也

不保证最低收益。基金管理人提示投资者注意基金投资的“买者自负”原则,在做出投资决策后,

基金运营结果及基金净值变化由投资者自行承担。

三十八、招商转债B份额表现为低风险、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杠杠水平,相对地,招商转债C份额的参考净值随市场涨跌而增减或者下降的幅度会

大幅缩小。

三十九、由于触发折算阀值日,招商转债B份额的参考净值可能低于面值,而折算基准日在触发阀值

日后才能确定,因此投资者在该基准日申购转债C份额时可能有0.45%的一定差异。

四十、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可转债A份额同时持

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可转债C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。

四十一、基金管理人的其他特别提示:

四十二、为保证折算期间本基金的正常运作,基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结

算有限公司的相关业务规则暂停招商转债A份额与招商转债B份额的上市交易并可暂停招商转债C

份额的上市交易。

四十三、基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也

不保证最低收益。基金管理人提示投资者注意基金投资的“买者自负”原则,在做出投资决策后,

基金运营结果及基金净值变化由投资者自行承担。

四十四、招商转债B份额表现为低风险、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杠杠水平,相对地,招商转债C份额的参考净值随市场涨跌而增减或者下降的幅度会

大幅缩小。

四十五、由于触发折算阀值日,招商转债B份额的参考净值可能低于面值,而折算基准日在触发阀值

日后才能确定,因此投资者在该基准日申购转债C份额时可能有0.45%的一定差异。

四十六、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可转债A份额同时持

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可转债C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。

四十七、基金管理人的其他特别提示:

四十八、为保证折算期间本基金的正常运作,基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结

算有限公司的相关业务规则暂停招商转债A份额与招商转债B份额的上市交易并可暂停招商转债C

份额的上市交易。

四十九、基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也

不保证最低收益。基金管理人提示投资者注意基金投资的“买者自负”原则,在做出投资决策后,

基金运营结果及基金净值变化由投资者自行承担。

五十、招商转债B份额表现为低风险、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