

招商沪深 300 高贝塔指数分级证券投资基金 B 类份额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”)关于基金不定期份额折算的相关约定,当招商沪深 300 高贝塔指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)之 B 类份额——招商沪深 300 高贝塔 B 类份额(场内简称:高贝塔 B;交易代码:150146)的基金份额参考净值达到 0.250 元时,招商沪深 300 高贝塔份额(场内简称:300 高贝,基金代码:161718)、招商沪深 300 高贝塔 A 类份额(场内简称:高贝塔 A,交易代码:150145)、招商沪深 300 高贝塔 B 类份额将进行不定期份额折算。

截至 2018 年 2 月 9 日,招商沪深 300 高贝塔 B 类份额的基金份额参考净值为 0.230 元,达到基金合同规定的不定期份额折算条件。根据基金合同约定,基金管理人决定本基金将以 2018 年 2 月 12 日为折算基准日办理不定期份额折算业务。截至 2018 年 2 月 9 日,招商沪深 300 高贝塔 B 类份额收盘价为 0.367 元,溢价率高达 59.57%。不定期份额折算后,招商沪深 300 高贝塔 B 类份额杠杆倍数将大幅降低,恢复到初始杠杆水平,招商沪深 300 高贝塔 B 类份额的溢价率可能大幅降低。投资者如果在折算基准日(2018 年 2 月 12 日)当天盲目投资,可能遭受重大损失,敬请投资者注意投资风险。

招商基金管理有限公司

2018 年 2 月 12 日