

博时丰达纯债债券型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会公告

一、召开会议基本情况

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》和《博时丰达纯债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，博时丰达纯债债券型证券投资基金（以下简称博时丰达纯债或本基金）的基金管理人博时基金管理有限公司（以下简称基金管理人）经与本基金的基金托管人平安银行股份有限公司协商一致，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会。本次会议主要审议本基金转型的议案和审议根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改本基金经中国证监会证监许可[2017]1238号文注册的《博时丰达纯债6个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》有关事项的议案。会议的具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式。

2、会议投票表决起止时间：自2018年1月18日起，至2018年2月23日17:00止（送达时间以本基金管理人收到表决票时间为准）。

3、会议计票日：2018年2月27日

4、会议通讯表决票的寄达地点：

基金管理人：博时基金管理有限公司

办公地址：北京市东城区建国门内大街18号恒基中心1座23层

联系人：翟青

联系电话：010-65171166-2126

请在信封表面注明：博时丰达纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用。

二、会议审议事项

博时丰达纯债债券型证券投资基金转型有关事项的议案（见附件一）。

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改《博时丰达纯债6个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》有关事项的议案（见附件二）

上述议案的说明请参见《博时丰达纯债债券型证券投资基金转型方案说明书》（附件五）和《根据〈公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定〉修改〈博时丰达纯债6个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同方案说明书〉》（附件六）

三、基金份额持有人的权益登记日

本次大会的权益登记日为2018年1月18日，即在2018年1月18日交易时间结束后，在本基金注册登记机构登记在册的基金份额持有人均有权参加本次基金份额持有人大会。

四、表决票的填写和寄交方式

1、本次会议表决票见附件二。基金份额持有人可从相关报纸上剪裁、复印附件二或登录本基金管理人网站（<http://www.bosera.com>）下载并打印表决票。

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，其中：

（1）个人投资者自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人身份证件复印件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）正反面；

（2）机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章，并提供加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

合格境外机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章（如有）或由授权代表在表决票上签字

（如无公章），并提供该授权代表的身份证件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证

明)正反面复印件或者护照或其他身份证明文件的复印件,该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件,以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件,以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件;

(3)个人投资者委托他人投票的,应由代理人在表决票上签字或盖章,并提供个人投资者身份证件复印件(包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明)正反面,以及填妥的授权委托书原件(参照附件三)。如代理人为个人,还需提供代理人的身份证件(包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明)正反面复印件;如代理人为机构,还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等);

(4)机构投资者委托他人投票的,应由代理人在表决票上签字或盖章,并提供持有人的加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等),以及填妥的授权委托书原件。如代理人为个人,还需提供代理人的身份证件(包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明)正反面复印件;如代理人为机构,还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等)。合格境外机构投资者委托他人投票的,应由代理人在表决票上签字或盖章,并提供该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件,以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件,以及填妥的授权委托书原件。如代理人为个人,还需提供代理人的身份证件(包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明)正反面复印件;如代理人为机构,还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等)。

(5)以上(2)、(3)、(4)项中的公章、批文、开户证明及登记证书,以基金管理人及公证机关的认可为准。

3、基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的相关文件自2018年1月18日起,至2018年2月23日17:00以前(送达时间以基金管理人收到表决票时间为准)通过专人送交或邮寄的方式送达至本公告第一条第4项所述的寄达地址,并在信封表面注明:博时丰达纯债债券型证券投资基金持有人大会表决专用。

五、计票

1、本次通讯会议的计票方式为:由本基金管理人授权的两名监督员在基金托管人(平安银行股份有限公司)授权代表的监督下于本次通讯会议表决截止日期后2个工作日内进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证。基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的,不影响计票和表决结果。

2、基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。

3、表决票效力的认定如下:

(1)表决票填写完整清晰,所提供文件符合本次会议通知规定,且在截止时间之前送达基金管理人的,为有效表决票;有效表决票按表决意见计入相应的表决结果,其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

(2)如表决票上的表决意见未选、多选或无法辨认或存在其他模糊不清或相互矛盾情形,但其他各项符合会议通知规定的,视为弃权表决,计入有效表决票;并按弃权计入对应的表决结果,其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

(3)如表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的,或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的,或未能在截止时间之前送达基金管理人委托的公证机关的,均为无效表决票;无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

(4)基金份额持有人重复提交表决票的,如各表决票表决意见相同,则视为同一表决票;如各表决票表

决意见不相同，则按如下原则处理：

送达时间不是同一天的，以最后送达的填写有效的表决票为准，先送达的表决票视为被撤回；

送达时间为同一天的，视为在同一表决票上做出了不同表决意见，计入弃权表决票；

送达时间按如下原则确定：专人送达的以实际递交时间为准，邮寄的以基金管理人委托的公证机关收到的时间为准。

六、决议生效条件

1、本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额占在权益登记日基金总份额的二分之一以上（含二分之一）。

2、博时丰达纯债债券型证券投资基金转型的议案应当由提交有效表决票的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过；根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改《博时丰达纯债 6 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》有关事项的议案应当由提交有效表决票的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过。

3、本次基金份额持有人大会决议通过的事项，本基金管理人自通过之日起五日内报中国证监会备案，根据现行《中华人民共和国证券投资基金法》及基金合同的规定，基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。转型和根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改后的基金合同生效时间请见基金管理人发布的相关公告。

七、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时丰达纯债债券型证券投资基金基金合同》的规定，本次持有人大会需要有效表决票所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的二分之一以上（含二分之一）方可举行。如果本次基金份额持有人大会不符合前述要求而不能成功召开，根据 2013 年 6 月 1 日生效的《中华人民共和国证券投资基金法》及《基金合同》的规定，本基金管理人可在规定时间内就同一议案重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见；重新召开基金份额持有人大会时，除非授权文件另有载明，本次基金份额持有人大会授权期间基金份额持有人作出的各类授权依然有效，但如果授权方式发生变化或者基金份额持有人重新作出授权，则以最新方式或最新授权为准，详细说明见届时发布的重新召集基金份额持有人大会的通知。

八、本次大会相关机构

- 1、召集人：博时基金管理有限公司
- 2、基金托管人：平安银行股份有限公司
- 3、公证机关：北京市长安公证处
- 4、律师事务所：上海源泰律师事务所

九、重要提示

- 1、请基金份额持有人在提交表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票。
- 2、基金管理人将在发布本公告后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告，就持有人大会相关情况做必要说明，请予以留意。
- 3、本通知的有关内容由博时基金管理有限公司负责解释。

博时基金管理有限公司

2018 年 1 月 15 日

附件一：《博时丰达纯债债券型证券投资基金转型有关事项的议案》

附件二：《根据〈公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定〉修改〈博时丰达纯债 6 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同〉有关事项的议案》

附件三：《博时丰达纯债债券型证券投资基金份额持有人大会表决票》

附件四：《授权委托书》

附件五：《博时丰达纯债债券型证券投资基金转型方案说明书》

附件六：《根据〈公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定〉修改〈博时丰达纯债 6 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同〉方案说明书》

附件一：

博时丰达纯债债券型证券投资基金转型有关事项的议案

博时丰达纯债债券型证券投资基金基金份额持有人：

根据市场环境和监管政策的变化，为更好地满足投资人需求，维护基金份额持有人利益，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》和《博时丰达纯债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，基金管理人博时基金管理有限公司经与基金托管人平安银行股份有限公司协商一致，提议对博时丰达纯债债券型证券投资基金（以下简称博时丰达纯债）实施转型。《博时丰达纯债债券型证券投资基金转型方案说明书》见附件五。

为实施博时丰达纯债转型方案，提议授权基金管理人办理本次博时丰达纯债转型的有关具体事宜，包括但不限于根据市场情况确定转型的具体时间和方式，根据现时有效的法律法规的要求和《博时丰达纯债债券型证券投资基金转型方案说明书》的有关内容对《博时丰达纯债债券型证券投资基金基金合同》进行必要的修改和补充。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，基金管理人将在转型实施前至少预留二十个开放日供现有基金份额持有人选择赎回或转出，本基金管理人将在此阶段以公司自有资金人民币 1000 万元申购本基金基金份额，并保证上述发起资金申购的基金份额持有期限自本基金转型后的基金合同生效之日起不少于三年。

在选择期间，由于基金需应对赎回等情况，基金份额持有人同意在选择期豁免《博时丰达纯债债券型证券投资基金基金合同》中约定的投资组合比例限制等条款。基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人据此落实相关事项，并授权基金管理人可根据实际情况做相应调整，以及根据实际情况可暂停申购、赎回或调整赎回方式等。关于选择期的具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

转型后的基金合同生效时间届时由基金管理人发布的相关公告。

以上议案，请予审议。

基金管理人：博时基金管理有限公司

2018 年 1 月 15 日

附件二：

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改《博时丰达纯债 6 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》有关事项的议案

博时丰达纯债债券型证券投资基金基金份额持有人：

本基金于 2017 年 7 月 13 日经中国证监会证监许可[2017]1238 号文变更注册为博时丰达纯债 6 个月定期开放债券型发起式证券投资基金，尚待召开基金份额持有人大会表决。《博时丰达纯债 6 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》已获中国证监会注册，但尚未生效。

中国证券监督管理委员会于 2017 年 8 月 31 日颁布《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》

（证监会公告[2017]12号）（以下简称：《管理规定》）。根据《管理规定》对已经成立或已获核准但尚未完成募集的开放式基金，原基金合同内容不符合本规定的，应当在本规定施行之日起6个月内，修改基金合同并公告。的要求，本基金需要在2017年10月1日起6个月内修改经中国证监会证监许可

[2017]1238号文注册的《博时丰达纯债6个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》。

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》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》和《博时丰达纯债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，基金管理人博时基金管理有限公司经与基金托管人平安银行股份有限公司协商一致，提议对本基金基金合同相应条款进行修订。《根据〈公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定〉修改〈博时丰达纯债6个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同〉方案说明书》见附件六。

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改后的基金合同生效时间届时由基金管理人发布的相关公告。

以上议案，请予审议。

基金管理人：博时基金管理有限公司

2018年1月15日

附件三：

博时丰达纯债债券型证券投资基金份额持有人大会表决票

基金份额持有人名称：

证件号码(身份证件号/营业执照号) 基金账户号

审议事项 同意 反对 弃权

博时丰达纯债债券型证券投资基金转型有关事项的议案

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改《博时丰达纯债6个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》有关事项的议案

基金份额持有人/受托人签名或盖章

年月日

说明：

请以打方式在审议事项后注明表决意见。持有人必须选择一种且只能选择一种表决意见。表决意见代表基金份额持有人所持全部基金份额的表决意见。未填、错填、字迹无法辨认或意愿无法判断的表决票或表决意见空白的表决票均视为投票人放弃表决权，其所持全部基金份额的表决结果均计为弃权。

（本表决票可剪报、复印或登录本基金管理人网站（www.bosera.com）下载并打印，在填写完整并签字

盖章后均为有效。)

附件四：

授权委托书

兹委托代表本人（或本机构）参加投票截止日为年月日的以通讯方式召开的博时丰达纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会，并代为全权行使对所有议案的表决权。授权有效期自签署日起至本次基金份额持有人大会会议结束之日止。若博时丰达纯债债券型证券投资基金重新召开审议相同议案的持有人大会的，本授权继续有效。

委托人（签字/盖章）：

委托人身份证号或营业执照注册号：

委托人基金账户号：

受托人签字/盖章：

受托人身份证明编号：

委托日期： 年 月 日

附注：此授权委托书剪报、复印或按以上格式自制、在填写完整并签字盖章后均为有效。

附件五：

博时丰达纯债债券型证券投资基金转型方案说明书

一、声明

- 1、博时丰达纯债债券型证券投资基金（以下简称博时丰达纯债或本基金）基金合同于 2016 年 11 月 8 日生效。为更好地满足投资人需求，维护基金份额持有人利益，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》和《博时丰达纯债债券型证券投资基金基金合同》（以下简称基金合同）等有关规定，本基金管理人（博时基金管理有限公司）经与基金托管人（平安银行股份有限公司）协商一致，决定召开基金份额持有人大会，审议博时丰达纯债债券型证券投资基金转型有关事项的议案。
- 2、本次博时丰达纯债转型事宜属博时丰达纯债原注册事项的实质性调整，经基金管理人向中国证监会申请，已经中国证监会准予变更注册。
- 3、本次博时丰达纯债转型方案需经参加持有人大会表决的基金份额持有人（或其代理人）所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过，存在无法获得持有人大会表决通过的可能。

4、基金份额持有人大会决议通过的事项，本基金管理人自通过之日起五日内报中国证监会备案，基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。转型后基金合同的生效时间请见基金管理人的相关公告。法律法规另有规定的，从其规定。

5、中国证监会对本次博时丰达纯债变更注册所作的任何决定或意见，均不表明其对本次转型方案或本基金的价值或投资者的收益做出实质性判断或保证。

二、博时丰达纯债转型方案要点

（一）更名

基金名称由博时丰达纯债债券型证券投资基金更名为博时丰达纯债 6 个月定期开放债券型发起式证券投资基金以下简称（博时丰达 6 个月定开债发起式）。

（二）变更基金形式

基金类别由普通证券投资基金变更为发起式证券投资基金。

（三）变更基金运作方式

基金的基金运作方式由契约型开放式变更为契约型定期开放式

（四）缩小投资者的范围

转型前面向个人投资者和机构投资者公开销售，转型后不向个人投资者公开销售。

（五）转型后基金投资范围、投资策略和投资限制相关条款

1、投资范围

本基金的投资范围主要包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、资产支持证券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、同业存单、银行存款等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金不投资于股票、权证等权益类资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。

本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的 80%，但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在每次开放期开始前 10 个工作日、开放期及开放期结束后 10 个工作日的期间内，基金投资不受上述比例限制。开放期内现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

2、投资策略

（1）封闭期投资策略

本基金通过自上而下和自下而上相结合、定性分析和定量分析相补充的方法，确定资产在非信用类固定收益类证券和信用类固定收益类证券之间的配置比例。充分发挥基金管理人长期积累的信用研究成果，利用自主开发的信用分析系统，深入挖掘价值被低估的标的券种，以获取最大化的信用溢价。本基金采用的投资策略包括：期限结构策略、信用策略、互换策略、息差策略等。在谨慎投资的前提下，力争获取高于业绩比较基准的投资收益。

在以上战略性资产配置的基础上，本基金通过自上而下和自下而上相结合、定性分析和定量分析相补充的方法，进行前瞻性的决策。一方面，本基金将分析众多的宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等），并关注国家财政、税收、货币、汇率政策和其它证券市场政策等。另一方面，本基金将对债券市场整体收益率曲线变化进行深入细致分析，从而对市场走势和波动特征进行判断。在此基础上，确定资产在非信用类固定收益类证券（现金、国家债券、中央银行票据等）和信用类固定收益类证券之间的配置比例。

灵活应用各种期限结构策略、信用策略、互换策略、息差策略，在合理管理并控制组合风险的前提下，最大化组合收益。

1) 期限结构策略。通过预测收益率曲线的形状和变化趋势，对各类型债券进行久期配置；当收益率曲线

走势难以判断时，参考基准指数的样本券久期构建组合久期，确保组合收益超过基准收益。具体来看，又分为跟踪收益率曲线的骑乘策略和基于收益率曲线变化的子弹策略、杠铃策略及梯式策略。

骑乘策略是当收益率曲线比较陡峭时，也即相邻期限利差较大时，买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券，通过债券的收益率的下滑，进而获得资本利得收益。

子弹策略是使投资组合中债券久期集中于收益率曲线的一点，适用于收益率曲线较陡时；杠铃策略是使投资组合中债券的久期集中在收益率曲线的两端，适用于收益率曲线两头下降较中间下降更多的蝶式变动；梯式策略是使投资组合中的债券久期均匀分布于收益率曲线，适用于收益率曲线水平移动。

2) 信用策略。信用债收益率等于基准收益率加信用利差，信用利差收益主要受两个方面的影响，一是该信用债对应信用水平的市场平均信用利差曲线走势；二是该信用债本身的信用变化。基于这两方面的因素，我们分别采用以下的分析策略：

基于信用利差曲线变化策略：一是分析经济周期和相关市场变化对信用利差曲线的影响，二是分析信用债市场容量、结构、流动性等变化趋势对信用利差曲线的影响，最后综合各种因素，分析信用利差曲线整体及分行业走势，确定信用债券总的及分行业投资比例。

基于信用债信用变化策略：发行人信用发生变化后，我们将采用变化后债券信用级别所对应的信用利差曲线对公司债、企业债定价。影响信用债信用风险的因素分为行业风险、公司风险、现金流风险、资产负债风险和其他风险等五个方面。我们主要依靠内部评级系统分析信用债的相对信用水平、违约风险及理论信用利差。

3) 互换策略。不同券种在利息、违约风险、久期、流动性、税收和衍生条款等方面存在差别，投资管理人可以同时买入和卖出具有相近特性的两个或两个以上券种，赚取收益级差。互换策略分为两种：

替代互换。判断未来利差曲线走势，比较期限相近的债券的利差水平，选择利差较高的品种，进行价值置换。由于利差水平受流动性和信用水平的影响，因此该策略也可扩展到新老券置换、流动性和信用的置换，即在相同收益率下买入近期发行的债券，或是流动性更好的债券，或在相同外部信用级别和收益率下，买入内部信用评级更高的债券。

市场间利差互换。一般在公司信用债和国家信用债之间进行。如果预期信用利差扩大，则用国家信用债替换公司信用债；如果预期信用利差缩小，则用公司信用债替换国家信用债。

4) 息差策略。通过正回购，融资买入收益率高于回购成本的债券，从而获得杠杆放大收益。

5) 个券挖掘策略。本部分策略强调公司价值挖掘的重要性，在行业周期特征、公司基本面风险特征基础上制定绝对收益率目标策略，甄别具有估值优势、基本面改善的公司，采取高度分散策略，重点布局优势债券，争取提高组合超额收益空间。

6) 资产支持证券投资策略。

本基金将通过对资产支持证券基础资产及结构设计的研究，结合多种定价模型，根据基金资产组合情况适度进行资产支持证券的投资。

(2) 开放期投资策略

开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种。

3、投资限制

(1) 组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

1) 本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的 80%，但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在每次开放期开始前 10 个工作日、开放期及开放期结束后 10 个工作日的期间内，基金投资不受上述比例限制；

2) 开放期内，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制；

3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

- 4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券, 不超过该证券的 10%;
- 5) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%; 在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年, 债券回购到期后不展期;
- 6) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例, 不得超过基金资产净值的 10%;
- 7) 本基金持有的全部资产支持证券, 其市值不得超过基金资产净值的 20%;
- 8) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例, 不得超过该资产支持证券规模的 10%;
- 9) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券, 不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%;
- 10) 该基金应投资于信用级别评级为 AA+以上(含 AA+)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间, 如果其信用等级下降、不再符合投资标准, 应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出;
- 11) 开放期内, 本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%; 封闭期内, 本基金资产总值不得超过基金资产净值的 200%;
- 12) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的, 基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整, 但法律法规或中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内, 本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制, 如适用于本基金, 基金管理人在履行适当程序后, 则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行, 但须提前公告。

(2) 禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益, 基金财产不得用于下列投资或者活动:

- 1) 承销证券;
- 2) 违反规定向他人贷款或者提供担保;
- 3) 从事承担无限责任的投资;
- 4) 买卖其他基金份额, 但是中国证监会另有规定的除外;
- 5) 向其基金管理人、基金托管人出资;
- 6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
- 7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销的证券, 或者从事其他重大关联交易的, 应当符合基金的投资目标和投资策略, 遵循基金份额持有人利益优先的原则, 防范利益冲突, 建立健全内部审批机制和评估机制, 按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意, 并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议, 并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定, 如适用于本基金, 基金管理人在履行适当程序后, 则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。

(五) 转型后基金的费用结构与费用水平

本基金的管理费率和托管费率

管理费率 0.30%

托管费率 0.10%

本基金的申购费

金额（M） 申购费率

M<100 万 0.80%

100 万≤M<300 万 0.50%

300 万≤M<500 万 0.30%

M≥500 万 每笔 1000 元

本基金的赎回费

持有时间 赎回费率

在同一开放期内申购后又赎回的份额 0.10%

在非同一开放期申购后赎回 0%

注：赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费总额的 100%应归基金财产。

（六）授权基金管理人修订基金合同

除上述内容的调整需要修改基金合同以外，考虑到自《博时丰达纯债债券型证券投资基金基金合同》生效以来，《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其配套准则等法律法规陆续颁布和实施，基金管理人需要根据现行有效的法律法规要求及转型后的博时丰达纯债 6 个月定期开放债券型发起式证券投资基金的产品特征修订《博时丰达纯债债券型证券投资基金基金合同》的相关内容。综上所述，基金管理人拟提请基金份额持有人大会授权基金管理人按照法律法规的规定及《博时丰达纯债债券型证券投资基金转型方案说明书》以上转型方案要点修订基金合同的内容。

二、基金管理人就方案相关事项的说明

（一）博时丰达纯债的历史沿革

博时丰达纯债债券型证券投资基金经中国证监会证监许可[2016]2240 号文注册，基金管理人为博时基金管理有限公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。博时丰达纯债债券型证券投资基金自 2016 年 10 月 31 日至 2016 年 11 月 4 日公开募集，募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认，《博时丰达纯债债券型证券投资基金基金合同》于 2016 年 11 月 8 日生效。

（二）基金转型有利于保护份额持有人利益

博时丰达纯债债券型证券投资基金转型前是一只面向机构和个人投资者销售的纯开放式基金，机构占比较大，存在一定的流动性风险，如发生巨额赎回，对个人投资者可能造成损失。本次转型具有如下必要性：一是满足大机构投资者的需求，允许单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 50%，二是保护中小个人投资者的权益，避免其因不了解本基金属性而申购不适宜的基金产品。

附件六：

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改《博时丰达纯债 6 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》有关事项的议案

一、声明

1、博时丰达纯债债券型证券投资基金（以下简称博时丰达纯债或本基金）基金合同于 2016 年 11 月 8 日生效，并于 2017 年 7 月 13 日经中国证监会证监许可[2017]1238 号文变更注册为博时丰达纯债 6 个月定期开放债券型发起式证券投资基金，尚待召开基金份额持有人大会表决。《博时丰达纯债 6 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》已获中国证监会注册，但尚未生效。中国证券监督管理委员会于 2017 年 8 月 31 日颁布《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（证监会公告[2017]12 号）（以下简称：《管理规定》）。根据《管理规定》对已经成立或已获核准但尚未完成募集的开放式基金，原基金合同内容不符合本规定的，应当在本规定施行之日起 6 个月内，修改基金合同并公告。的要求，本基金需要在 2017 年 10 月 1 日起 6 个月内修改基金合同。本公司决定根据《管理规定》的要求修改经中国证监会证监许可[2017]1238 号文注册的《博时丰达纯债 6 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》相关条款，并对基金份额持有人有实质性影响的条款决定召开基金份额持有人大会进行审议。

2、本次修改基金合同的方案需经参加持有人大会表决的基金份额持有人（或其代理人）所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过，存在无法获得持有人大会表决通过的可能。

3、基金份额持有人大会决议通过的事项，本基金管理人自通过之日起五日内报中国证监会备案，基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。修改后基金合同的生效时间请见基金管理人的发布相关公告。法律法规另有规定的，从其规定。

二、需要基金份额持有人审议的条款

（一）、在释义中增加如下内容：

58、摆动定价机制：指当本基金份额遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待

（二）、在第六部分基金份额的申购与赎回六、申购和赎回的价格、费用及其用途中增加如下内容：

8、当本基金份额发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

（三）、在第六部分基金份额的申购与赎回九、巨额赎回的情形及处理方式中将

2、巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或延缓支付赎回款项。

（1）全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）延缓支付赎回款项：基金管理人符合法律法规及基金合同约定的赎回申请应全部予以接受和确认。但对于已接受的赎回申请，当基金管理人认为支付投资人的赎回款项有困难或认为因支付投资人的赎回款项而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人应对当日全部赎回申请进行确认，当日按比例办理支付的赎回份额不得低于前一工作日基金总份额的 20%，其余赎回申请可以延缓支付赎回款项，但延缓支付的期限最长不超过 20 个工作日。延缓支付的赎回申请以赎回申请当日的基金份额净值为基础计算赎回金额。

修改为：

2、巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回、延缓支付赎回款项或者部分延期赎回。

（1）全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）延缓支付赎回款项：在发生巨额赎回且不存在单一持有人赎回申请超过上一日基金总份额 20% 的情况下，基金管理人可以根据第（1）项办理，亦可在对符合法律法规及基金合同约定的赎回申请全部接受

和确认的基础上，采取延缓支付赎回款项的措施。即对于已接受的赎回申请，当基金管理人认为支付投资人的赎回款项有困难或认为因支付投资人的赎回款项而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，可以对部分赎回申请延缓支付赎回款项，但延缓支付的期限最长不超过 20 个工作日。延缓支付的赎回申请以赎回申请当日的基金份额净值为基础计算赎回金额。

（3）部分延期赎回：开放期内，如果发生巨额赎回且单一持有人赎回申请超过上一日基金总份额 20%的情况下，基金管理人可以延期办理赎回申请。在上述情况下，对于单个基金份额持有人当日赎回申请超过上一日基金总份额 20%的部分，基金管理人可以进行延期办理。对于此类持有人剩余部分申请以及其他持有人的赎回申请，应当按上述第（1）、（2）项规则办理。对于上述持有人被延期办理的部分，如投资人在提交赎回申请时选择取消赎回的，当日未获办理部分将被撤销；如投资人在提交赎回申请时选择延期赎回或未作明确选择的，将自动转入下一个开放日继续赎回直至办理完毕，因此导致延期办理期限超过开放期的，开放期相应延长并公告，延长的开放期内不办理申购亦不接受新的赎回申请。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日某一类别的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

（四）、在第十四部分基金资产估值三、估值方法中增加如下内容：

5、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

（五）、在第十八部分基金的信息披露第十八部分基金的信息披露（五）临时报告中增加如下内容：

27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值时；