

# 招商基金管理有限公司关于以通讯方式召开招商招乾纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告

招商基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）已于2018年1月26日在《中国证券报》、《证券日报》和基金管理人网站（<http://www.cmfchina.com>）发布了《招商基金管理有限公司关于以通讯方式召开招商招乾纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》。为了使本次基金份额持有人大会顺利召开，现发布关于以通讯方式召开招商招乾纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告。

## 一、会议基本情况

招商基金管理有限公司（以下称“基金管理人”）依据中国证监会证监许可[2016]1875号文注册募集的招商招乾纯债债券型证券投资基金（以下称“本基金”）于2016年10月26日成立。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定和《招商招乾纯债债券型证券投资基金基金合同》（以下称“《基金合同》”或“基金合同”）的约定，本基金管理人决定召开本基金的基金份额持有人大会，审议《关于招商招乾纯债债券型证券投资基金变更有关事项的议案》。

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31日起，至2018年2月26日17:00止（以表决票收件人收到表决票时间为准）。

3、通讯表决票将送达至本基金管理人，具体地址和联系方式如下：

收件人：招商基金管理有限公司基金份额持有人大会投票处

地址：北京市西城区月坛南街1号院3号楼21层

邮政编码：100045

联系电话：010-56937535

## 二、会议审议事项

本次持有人大会审议的事项为《关于招商招乾纯债债券型证券投资基金变更有关事项的议案》（以下称“《议案》”），《议案》详见附件一。

## 三、权益登记日

本次大会的权益登记日为2018年1月31日，即在2018年1月31日在登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人均有权参加本次基金份额持有人大会。

## 四、纸质表决票的填写和寄交方式

1、本次会议表决票见附件四。基金份额持有人可通过剪报、复印或登陆基金管理人网站（<http://www.cmfchina.com/>）下载等方式获取表决票。

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；

（2）机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章或相关的业务专用章，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事业单位法人证书、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机构公章（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、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加盖公章（如有）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) 基金份额持有人可根据本公告“五、授权”的规定授权其他个人或机构代其在本次基金份额持有人大会上投票。代理人接受基金份额持有人书面方式授权代理投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供授权委托书原件以及本公告“五、授权”中所规定的基金份额持有人以及代理人的身份证明文件或机构主体资格证明文件，但下述第(4)项另有规定的除外；

(4) 基金份额持有人使用基金管理人邮寄的专用授权委托书征集信函授权基金管理人、基金托管人或代销机构投票的，接受有效委托的基金管理人、基金托管人或代销机构应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。

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于会议投票表决起止时间内（自2018年1月31日起至2018年2月26日17:00止，以本基金管理人收到表决票的时间为准）通过专人送交或邮寄的方式送达至本基金管理人的办公地址（北京市西城区月坛南街1号院3号楼21层），请在信封表面注明：“招商招乾纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

## 五、授权

个人投资者授权他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供被代理的个人投资者身份证件复印件，以及填妥的授权委托书（见附件三）原件。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件复印件；如代理人为机构，还需提供代理人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事业单位法人证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

如果个人投资者使用其收到的基金管理人邮寄的专用授权委托书征集信函授权时，无需提供身份证明文件复印件，在专用回邮信函上填写个人姓名、身份证明文件号码和具体表决意见，并回寄给基金管理人，该专用回邮信函即视为有效授权，若委托人签署的专用回邮信函没有表示具体表决意见的，视为委托人授权基金管理人按照其意志行使表决权。

机构投资者授权他人投票的，应由代理人在表决票上签字或加盖公章，并提供被代理的机构投资者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事业单位法人证书、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（见附件三）原件。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件复印件；如代理人为机构，还需提供代理人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事业单位法人证书、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加盖公章，并提供该合格境外机构投资者加盖公章（如有）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和填妥的授权委托书（见附件三）原件。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件复印件；如代理人为机构，还需提供代理人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事业单位法人证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

## 六、计票

1、本次通讯会议的计票方式为：由基金管理人授权的两名监督员在基金托管人（中国银行股份有限公司）授权代表的监督下进行计票，并在所通知的表决截止日期后5个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，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、表决票效力的认定规则如下：

(1) 纸面表决票通过专人送交的，表决时间以实际递交时间为准；邮寄送达本公告规定的收件人的，表决时间以收件人收到时间为准。2018年2月26日17:00以后送达收件人的纸面表决票,均为无效表决。

(2) 基金份额持有人重复寄送纸面表决票的，若各表决票之意思相同时，则视为同一表决票；表决之意思相异时，按如下原则处理：

- 1) 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；
- 2) 送达时间为同一天的，视为在同一表决票上作出了不同表决意见，视为弃权表决，计入有效表决票。
- 3) 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，邮寄的以本公告列明的收件人收到的时间为准。

(3) 如表决票有下列情形之一者，该表决票无效，并且不视为该基金份额持有人已参与本次基金份额持有人大会表决，亦不计入参与本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数之内。

- 1) 基金份额持有人未在纸面表决票上签字或未附个人或机构有效身份证明文件复印件的或提供的文件不符合本公告规定的。
- 2) 通过委托代理人表决的，未同时提供代理人有效身份证明文件复印件的或提供的文件不符合本公告规定的。
- 3) 纸面表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的。
- 4) 未能在截止时间之前送达指定地址或指定系统的。

(4) 如纸面表决票有下列情形之一但其他要素符合会议公告规定者，该纸面表决意见视为弃权，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：

- 1) 对同一议案表决超过一项意见或未表示意见的；
- 2) 纸面表决票“表决意见”一栏有涂改的、模糊不清或相互矛盾的；
- 3) 纸面表决票污染或破损，并且无法辨认其表决意见的。

### 七、决议生效条件

- 1、本人直接或委托授权代表出具有效表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额不少于本基金在权益登记日基金份额总数的50%（含50%）；
- 2、《议案》应当由提交有效表决意见的本基金基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的2/3以上（含2/3）通过方为有效；
- 3、本基金份额持有人大会决议自持有人大会表决通过之日起生效，基金管理人依法将决议报中国证监会备案。法律法规另有规定的，从其规定。

### 八、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《基金法》及《基金合同》的规定,本次持有人大会需要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本基金基金份额占权益登记日基金总份额的50%以上（含50%）。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日实施的《基金法》,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。

### 九、本次大会相关机构

1、召集人：招商基金管理有限公司  
地址：深圳市福田区深南大道 7088 号  
联系人：B 赖思斯  
联系电话：（0755）83199596  
邮政编码：518040

网址：<http://www.cmfchina.com>

2、公证机关：北京市中信公证处  
地址：北京市西城区太平桥大街 109 号湘西大厦 6 层  
联系人：甄真  
联系电话：010-66216866  
邮政编码：100032

3、见证律师：上海源泰律师事务所  
注册及办公地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼  
联系电话：（021）51150298

#### 十、重要提示

- 1、请基金份额持有人在邮寄表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票。
- 2、上述基金份额持有人大会有关公告可通过招商基金管理有限公司网站(<http://www.cmfchina.com>)查阅，投资者如有任何疑问，可致电 400-887-9555 咨询。
- 3、本公告的有关内容由招商基金管理有限公司解释。

附件一：《关于招商招乾纯债债券型证券投资基金变更有关事项的议案》

附件二：招商招乾纯债债券型证券投资基金变更方案说明书

附件三：授权委托书（样本）

附件四：招商招乾纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决票

招商基金管理有限公司

2018 年 1 月 29 日

附件一：

关于招商招乾纯债债券型证券投资基金

变更有关事项的议案

招商招乾纯债债券型证券投资基金基金份额持有人：

根据市场环境变化，为更好地满足投资者需求，保护基金份额持有人的利益，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《招商招乾纯债债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”或“基金合同”）的有关规定，本基金管理人经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，决定召开本基金的基金份额持有人大会，将招商招乾纯债债券型证券投资基金变更为招商招乾 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金，同时修订基金合同。《招商招乾纯债债券型证券投资基金变更方案说明书》见附件二。

为实施招商招乾纯债债券型证券投资基金的变更方案，提议授权基金管理人办理本次基金合同变更的有关具体事宜，包括但不限于根据现时有效的法律法规的要求和《招商招乾纯债债券型证券投资基金变更方案说明书》的有关内容对基金合同进行必要的修改和补充。

以上提案，请予审议。

招商基金管理有限公司

2018 年 1 月 26 日

附件二：

## 招商招乾纯债债券型证券投资基金变更方案说明书

### 一、声明

- 1、根据市场环境变化，为更好地满足投资者需求，保护基金份额持有人的利益，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《招商招乾纯债债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”或“基金合同”）的有关规定，本基金管理人经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，决定召开本基金的基金份额持有人大会，将招商招乾纯债债券型证券投资基金变更为招商招乾3个月定期开放债券型发起式证券投资基金，同时修订基金合同。
- 2、本次基金合同修改方案须经参加本次持有人大会的本基金基金份额持有人或其代理人所持表决权的2/3以上（含2/3）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。

### 二、变更方案要点

- 1、变更后基金的运作方式、投资策略、投资限制、费率结构、估值方法等进行相应调整，基金合同主要修改如下：

#### 章节

原《招商招乾纯债债券型证券投资基金基金合同》条款

拟修订后《招商招乾3个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同（草案）》条款

内容内容

基金名称

招商招乾纯债债券型证券投资基金招商招乾3个月定期开放债券型发起式证券投资基金

第三部

分基金

的基本情况

情况

无

### 三、基金发起资金来源

本基金发起资金来源于基金管理人的股东资金、基金管理人固有资金以及基金管理人高级管理人员或基金经理等人员的资金。发起资金提供方认购本基金的总金额不少于1000万元。本基金发起资金提供方认购的基金份额持有期限不少于3年。

### 三、基金的运作方式

契约型开放式

### 四、基金的运作方式

契约型、以定期开放方式运作。

本基金以3个月为一个封闭期，每个封闭期为自每个开放期结束之日次日起（包括该日）至3个月后的月度对日（包括该日）的期间。本基金的第一个封闭期为自首个开放期结束之日次日起（包括该日）至3个月后月度对日（包括该日）的期间，以此类推。本基金在封闭期内不接受

申购、赎回、转换转入、转换转出等交易申请。

本基金自基金合同生效日起（包括该日）或每个封闭期结束之后第一个工作日起（包括该日）进入开放期，期间可以办理申购与赎回业务。本基金每个开放期不少于 3 个工作日并且最长不超过 20 个工作日，开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准。如基金合同生效日或封闭期结束之后的第一个工作日因不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购与赎回业务的，开放期自不可抗力或其他情形的影响因素消除之日起的下一个工作日开始。如在开放期内发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购与赎回业务的，开放期时间中止计算，在不可抗力或其他情形影响因素消除之日下一个工作日起，继续计算该开放期时间。

无

#### 六、发起资金的申购金额和申购份额的锁定期

本基金为发起式基金，发起资金提供方申购本基金的总金额不少于 1000 万元，且持有期限不少于 3 年。

无

#### 九、其他事项

本基金单一投资者持有的基金份额或者构成一致行动人的多个投资者持有的基金份额比例可达到或超过 50%，且本基金不向个人投资者销售。

法律法规或监管规则另有规定的，从其规定。

### 第十三

#### 部分基

#### 金的投

#### 资

### 二、投资范围

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，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、中小企业私募债、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、银行存款、同业存单，国债期货，以及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）。

.....

基金的投资组合比例为： 本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%； 本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券， 国债期货的投资比例遵循国家相关法律法规。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。



## 二、投资范围

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，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、超短期融资券、中小企业私募债、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、银行存款、同业存单、国债期货，以及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）。

……

基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%，但在每个开放期的前十个工作日和后十个工作日以及开放期期间不受前述投资组合比例的限制。在开放期内，本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，在封闭期内，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

## 三、投资策略

本基金将在基金合同约定的投资范围内……

1、久期策略：本基金将考察市场利率的动态变化及预期变化，对引起利率变化的相关因素进行跟踪和分析，进而对债券组合的久期和持仓结构制定相应的调整方案，以降低利率变动对组合带来的影响。本基金管理人的固定收益团队将定期对利率期限结构进行预判，制定相应的久期目标，当预期市场利率水平将上升时，适当降低组合的久期……

2、期限结构策略。通过预测收益率曲线的形状和变化趋势……

（1）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。

（2）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；

（3）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；

（4）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。

### 三、投资策略

本基金以封闭期为周期进行投资运作。本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。

#### 1、封闭期投资策略

基金管理人将视债券、银行存款、债券回购等大类资产的市场环境确定债券投资组合管理策略，确定部分债券采取持有到期策略，部分债券将采取积极的投资策略，以获取较高的债券组合投资收益。

本基金的具体投资策略包括：

##### (1) 资产配置策略

本基金将在基金合同约定的投资范围内……

##### (2) 久期策略

本基金将考察市场利率的动态变化及预期变化，对引起利率变化的相关因素进行跟踪和分析，进而对债券组合的久期和持仓结构制定相应的调整方案，以降低利率变动对组合带来的影响。本基金管理人的固定收益团队将定期对利率期限结构进行预判，当预期市场利率水平将上升时，适当降低组合的久期……

##### (3) 期限结构策略

本基金通过预测收益率曲线的形状和变化趋势……

#### 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，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。

### 五、投资限制

#### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

(1) 本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%；

(2) 本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券；

(11) 本基金投资于中小企业私募债券比例合计不高于基金资产净值的 10%；

(12) 基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

因证券、期货市场波动、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，除上述第

(10) 项外，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但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。……

## 五、投资限制

### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

(1) 本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%，但在每次开放期前十个工作日、开放期及开放期结束后十个工作日的期间内，基金投资不受上述比例限制；

(2) 在开放期内，本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券；在封闭期内，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

(11) 本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的10%；本基金投资中小企业私募债券的剩余期限，不得超过自投资之日起至本次封闭期结束之日的长度；

(12) 本基金在封闭期总资产不得超过基金净资产的200%，在开放期总资产不得超过基金净资产的140%；

(14) 在开放期内，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的15%；

因证券市场波动、证券停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(15) 在开放期内，本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

除上述第(2)、(10)、(14)、(15)项外，因证券、期货市场波动、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1个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。……

## 第十五

### 部分基

### 金资产

### 估值

## 四、估值方法

### 1、交易所市场交易的固定收益品种的估值

(1) 对在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估

值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

(2) 对在交易所市场上市交易的可转换债券，按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含债券应收利息后得到的净价进行估值；

(3) 对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

(4) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的固定收益品种，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

## 2、银行间市场交易的固定收益品种的估值

(1) 银行间市场交易的固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。

(2) 对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的固定收益品种，按成本估值。

3、首次公开发行未上市的债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

6、中小企业私募债券，采用估值技术确定公允价值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

7、银行存款以成本列示，按商定的存款利率以当日银行营业终了的存款余额为基数在实际持有期间内逐日计提应收利息。

## 三、估值方法

### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市实行净价交易的债券，对于存在活跃市场的情况下，按估值日收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，采用估值技术确定公允价值；

(2) 交易所上市未实行净价交易的债券，对于存在活跃市场的情况下，按估值日收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去收盘价或估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去收盘价或估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；如最近交易日后经济环境发生了重大

变化的，采用估值技术确定公允价值；

(3) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券、中小企业私募债，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2、首次公开发行未上市的债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用第三方估值机构提供的估值价格数据进行估值。

5、持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按相应利率逐日计提利息。

6、本基金投资同业存单，采用估值日第三方估值机构提供的估值价格数据进行估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。

7、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。

## 第十六

### 部分基

### 金费用

### 与税收

#### 二、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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

.....

##### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

.....

##### 3、销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.40%。

本基金销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.40%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

#### 二、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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.30%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$

.....

## 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$

.....

## 3、销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.20%。

本基金销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.20% 年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$

## 2、赎回费用调整

本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额均收取赎回费。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。本基金收取的赎回费将全额计入基金财产。

具体费率如下：

持有期限（T） 赎回费率

在同一开放期内申购后又赎回且持有期限少于 7 日的份额 1.50%

在同一开放期内申购后又赎回且持有期限大于等于 7 日的份额 0.25%

在某一开放期申购并在下一个及之后的开放期赎回的份额 0.00%

## 三、变更选择期的相关安排

本次持有人大会决议生效后，招商招乾纯债债券型证券投资基金将安排不少于 20 个工作日的选择期。选择期期间，原基金份额持有人可以将持有的部分基金份额或全部基金份额做出如下选择：（1）赎回基金份额；（2）变更为“招商招乾 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金”基金份额。对于在选择期内未作出选择的基金份额持有人，其持有的招商招乾纯债债券型证券投资基金份额将默认变更为招商招乾 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金份额。

在选择期间，由于招商招乾纯债债券型证券投资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招商招乾纯债债券型证券投资基金合同中约定的投资组合比例限制等条款。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基金份额申购、赎回或调整赎回方式等。

具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

## 四、《招商招乾 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》的生效

自本次持有人大会决议生效后，选择期结束之日的次日起，《招商招乾 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》生效，原《招商招乾纯债债券型证券投资基金基金合同》同日起失效。具体日期以届时发布的公告为准。

综上所述，基金管理人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《招商招乾纯债债券型证券投资基金变更方案说明书》以上变更方案要点修订基金合同并实施变更方案。

## 五、基金管理人就方案相关事项的说明

### 1、招商招乾纯债债券型证券投资基金的历史沿革

招商招乾纯债债券型证券投资基金经中国证监会《关于准予招商招乾纯债债券型证券投资基金注册的批复》（中国证监会证监许可【2016】1875号文）注册公开募集。基金管理人为招商基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

招商招乾纯债债券型证券投资基金于2016年10月24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，《招商招乾纯债债券型证券投资基金基金合同》于2016年10月26日生效。

## 2、基金变更的可行性

### （1）法律层面不存在障碍

依据《招商招乾纯债债券型证券投资基金基金合同》和《基金法》的规定，转换基金运作方式应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的2/3以上（含2/3）通过。

基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效，召集人应当自通过之日起五日内报中国证监会备案。

因此，招商招乾纯债债券型证券投资基金变更的方案符合基金合同和有关法律法规的规定。

### （2）基金变更不存在技术障碍

招商招乾纯债债券型证券投资基金变更后，将进行基金份额变更登记。基金管理人已就变更登记有关事项进行了充分准备，技术可行。基金变更不存在技术障碍。

## 六、基金变更的主要风险及预备措施

（一）变更方案被持有人大会否决的风险，在设计变更方案之前，基金管理人已对部分基金份额持有人进行了走访，认真听取了基金份额持有人意见，拟定议案综合考虑了基金份额持有人的要求。如有必要，基金管理人将根据基金份额持有人意见，对基金变更方案进行适当的修订，并重新公告。基金管理人可在必要情况下，推迟基金份额持有人大会的召开时间。

（二）基金变更后运作过程中的相关运作风险，基金管理人将提前做好充分的内部沟通及外部沟通，避免基金变更后基金运作过程中出现相关操作风险和管理风险。

## 七、基金管理人联系方式

基金份额持有人若对本方案的内容有任何意见和建议，请通过以下方式联系：

基金管理人：招商基金管理有限公司

联系电话：400-887-9555

网址：[www.cmfchina.com](http://www.cmfchina.com)

附件三：

授权委托书

兹全权委托先生/女士或机构代表本人（或本机构）参加以通讯开会方式召开的招商招乾纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会，并代为全权行使所有议案的表决权。表决意见以受托人（代理人）的表决意见为准。本授权不得转授权。若在法定时间内就同一议案重新召开招商招乾纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会，除本人（或本机构）重新作出授权外，本授权继续有效。

委托人（签字/盖章）：

委托人身份证件号或营业执照注册号：

基金账号：

受托人（代理人）（签字/盖章）：

受托人（代理人）身份证件号或营业执照注册号：

委托日期： 年月日

附注：

1、以上授权是基金份额持有人就其持有的本基金全部份额向受托人（代理人）所做授权。

2、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

附件四：招商招乾纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决票

基金份额持有人姓名或名称：

证件号码(身份证件号/营业执照号)B：

基金账号：

审议事项同意反对弃权

关于招商招乾纯债债券型证券投资基金变更有关事项的议案

基金份额持有人（或受托人、代理人）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持有的全部基金份额的表决意见。表决意见未选、多选、字迹无法辨认、意愿模糊不清、无法判断、相互矛盾或表决意见空白的表决票均视为投票人放弃表决权利，该持有人持有的全部基金份额的表决结果均计为“弃权”。签名或盖章部分填写不完整、不清晰的表决票计为无效表决票。表决票应附个人或机构有效身份证明文件复印件。

表决票效力认定的其他规则详见本次持有人大会公告。