

## 关于招商可转债分级债券型证券投资基金实施转型的公告

招商基金管理有限公司（以下简称“本公司”）于2020年8月27日至2020年9月28日以通讯方式组织召开了招商可转债分级债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金份额持有人大会，审议了《关于招商可转债分级债券型证券投资基金转型的议案》（以下简称“《议案》”）。《议案》于2020年9月29日获得表决通过，自该日起基金份额持有人大会决议生效，并已报中国证券监督管理委员会备案。本公司已于2020年9月30日发布《关于招商可转债分级债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》（以下简称“《决议公告》”）。根据《决议公告》，现就转型相关事项公告如下：

### 一、关于基金合同等法律文件的修订情况

根据《议案》以及相关法律法规的规定，经与基金托管人协商一致，基金管理人已将《招商可转债分级债券型证券投资基金基金合同》《招商可转债分级债券型证券投资基金托管协议》修订为《招商可转债债券型证券投资基金基金合同》《招商可转债债券型证券投资基金托管协议》，并据此拟定了《招商可转债债券型证券投资基金招募说明书》及《招商可转债债券型证券投资基金产品资料概要》。

上述基金合同等法律文件已经中国证券监督管理委员会证监许可[2020]1806号（《关于准予招商可转债分级债券型证券投资基金变更注册的批复》）准予变更注册。《招商可转债债券型证券投资基金基金合同》及《招商可转债债券型证券投资基金托管协议》将自2020年11月9日起生效。

### 二、转型方案实施的安排

本基金转型实施前的转型选择期为2020年9月30日至2020年11月4日，以供基金份额持有人做出赎回、卖出等选择。

选择期期间，招商可转债份额（即基础份额，基金代码：161719，场内简称“转债分级”）的申购赎回业务，以及招商转债A份额（基金代码：150188，场内简称“转债优先”）、招商转债B份额（基金代码：150189，场内简称“转债进取”）的交易、合并业务照常办理。基金份额持有人在招商可转债分级债券型

证券投资基金正式转型前，可以选择卖出招商转债A份额、招商转债B份额或者赎回招商可转债份额。对于在选择期内未作出选择的基金份额持有人，其持有的招商转债A份额、招商转债B份额和招商可转债份额将最终转换为招商可转债债券型证券投资基金基金份额。

在选择期期间，基金份额持有人选择赎回的，仍适用招商可转债分级债券型证券投资基金的赎回费率和赎回费计入基金财产的比例。

在选择期期间，招商可转债分级债券型证券投资基金豁免基金合同中约定的投资组合比例限制等条款。

### **三、招商转债A份额与招商转债B份额的终止上市**

基金管理人按照深圳证券交易所的业务规则和《招商可转债分级债券型证券投资基金基金合同》等的有关规定向深圳证券交易所申请招商转债A份额与招商转债B份额的终止上市。具体安排详见基金管理人2020年10月30日发布的《关于招商可转债分级债券型证券投资基金之招商转债A份额和招商转债B份额终止上市的公告》。

### **四、招商可转债分级债券型证券投资基金基金份额的转换**

#### **1、份额转换基准日**

选择期结束后，基金管理人将以2020年11月5日为基金份额转换基准日。

自2020年11月5日起，招商可转债分级债券型证券投资基金停止办理申购（含定期定额投资，下同）、赎回、转换、转托管（包括系统内转托管、跨系统转托管，下同）、配对转换等业务。基金转型完毕后，招商可转债债券型证券投资基金于2020年11月9日起开始办理申购、赎回、转换、转托管等业务。

#### **2、份额转换方式**

##### **（1）招商转债A份额及招商转债B份额：**

在份额转换基准日日终，以招商可转债份额的基金份额净值为基准，招商转债A份额、招商转债B份额按照各自的基金份额参考净值转换成招商可转债份额的场内份额，招商可转债份额的场内份额再按照1:1的比例转换为招商可转债债券型证券投资基金的场内份额。招商转债A份额（或招商转债B份额）基金份额

持有人持有的转换后招商可转债债券型证券投资基金的场内份额取整计算（最小单位为1份），余额计入基金财产。

份额转换计算公式：

招商转债 A 份额（或招商转债 B 份额）的转换比例 = 份额转换基准日招商转债 A 份额（或招商转债 B 份额）的基金份额参考净值 / 份额转换基准日招商可转债份额的基金份额净值

招商转债 A 份额（或招商转债 B 份额）基金份额持有人持有的转换后招商可转债债券型证券投资基金的场内份额 = 基金份额持有人持有的转换前招商转债 A 份额（或招商转债 B 份额）的份额数 × 招商转债 A 份额（或招商转债 B 份额）的转换比例

（2）招商可转债份额：

原招商可转债份额的场内份额、场外份额按照 1:1 的比例分别转换为招商可转债债券型证券投资基金的场内份额、场外份额。

3、份额转换后的持有期计算

根据有关业务规则，基金份额持有人持有的招商可转债份额转换为招商可转债债券型证券投资基金份额后，其原基金份额持有期计入招商可转债债券型证券投资基金份额的持有期；基金份额持有人持有的招商转债 A 份额和招商转债 B 份额转换为招商可转债债券型证券投资基金的场内份额后，基金份额持有期自招商可转债债券型证券投资基金的场内份额确认之日起计算，基金份额持有人赎回份额时适用的赎回费率将根据持有期确定，具体持有时间以登记结算机构系统记录为准。如果赎回份额时持有期较短，基金份额持有人将承担较高的赎回费。

4、份额转换结果

基金管理人将于 2020 年 11 月 9 日公告份额转换确认结果，基金份额持有人可以查询其账户内转换后的招商可转债债券型证券投资基金基金份额。

## 五、基金转换的特别风险揭示

1、招商转债 A 份额和招商转债 B 份额转换后风险收益特征发生较大变化的风险

份额转换完成后，招商转债 A 份额持有人原持有的招商转债 A 份额将变为招商

可转债债券型证券投资基金的场内份额，基金份额风险收益特征将因转换而发生较大变化。份额转换完成后，招商转债B份额持有人原持有的招商转债B份额将变为招商可转债债券型证券投资基金的场内份额，基金份额风险收益特征将因转换而发生较大变化。

## 2、招商转债A份额和招商转债B份额的流动性风险

招商转债A份额和招商转债B份额转换为招商可转债债券型证券投资基金的场内份额前，招商转债A份额和招商转债B份额的持有人有两种方式退出：1) 在场内按市价卖出基金份额；2) 在场内买入正整数倍配对申请合并所需的对应份额，合并为招商可转债份额，按照招商可转债份额的基金份额净值申请场内赎回或转托管至场外后申请赎回。

由于招商转债A份额和招商转债B份额的持有人可能选择场内卖出或合并赎回，场内份额数量可能发生较大下降，可能出现场内流动性不足的情况，特提请投资者注意流动性风险。

## 3、转换前存在溢价交易的招商转债A份额和招商转债B份额的持有人因溢价消失而造成损失的风险

基金份额转换基准日前，招商转债A份额和招商转债B份额仍可正常交易。期间，招商转债A份额和招商转债B份额可能存在折溢价交易情形，其折溢价率可能发生较大变化。

由于基金份额转换完成后，招商转债A份额和招商转债B份额均按各自的基金份额参考净值（而不是二级市场价格）转换为招商可转债债券型证券投资基金的场内份额，如果投资者在转换前以溢价买入，转换后可能遭受较大损失。特提请参与二级市场交易的投资者注意折溢价所带来的风险。

投资者应密切关注招商转债A份额和招商转债B份额的基金份额参考净值变化情况，可通过本公司网站（<http://www.cmfchina.com>）等方式进行查询。

## 4、招商转债A份额和招商转债B份额的基金份额持有人持有的基金份额数量将会在转换后发生变化的风险

基金份额转换完成后，招商转债A份额和招商转债B份额均按各自的基金份额参考净值（而不是二级市场价格）转换为招商可转债债券型证券投资基金的场内份额。因此招商转债A份额和招商转债B份额的基金份额持有人持有的基金份额数

量将会在转换后发生变化。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份额的持有人，存在转换后份额因为不足1份而导致相应的资产被强制归入基金资产的风险。

5、招商转债A份额和招商转债B份额转换为招商可转债债券型证券投资基金的场内份额后无法办理场内赎回的风险

招商转债A份额和招商转债B份额转换为招商可转债债券型证券投资基金的场内份额后，投资者可以申请场内赎回基金份额或者转托管至场外后申请赎回基金份额。可以在二级市场办理基金买卖的证券公司并不全部具备中国证监会颁发的基金销售资格，而投资者只能通过具备基金销售资格的证券公司赎回基金份额。如果投资者通过不具备基金销售资格的证券公司在二级市场买入招商转债A份额和招商转债B份额，转换为招商可转债债券型证券投资基金场内份额后可能无法办理场内赎回。对于无法办理场内赎回的投资者，需先转托管至场外后再申请赎回或者先转托管到具有基金销售资格的证券公司后再申请赎回。

6、招商转债A份额和招商转债B份额转换为招商可转债债券型证券投资基金的场内份额后自确认之日起计算及收取赎回费的风险

根据有关业务规则，基金份额持有人持有的招商转债A份额和招商转债B份额转换为招商可转债债券型证券投资基金的场内份额后，基金份额持有期自招商可转债债券型证券投资基金的场内份额确认之日起计算，基金份额持有人赎回份额时适用的赎回费率将根据持有期确定，具体持有时间以登记结算机构系统记录为准。如果赎回份额时持有期较短，基金份额持有人将承担较高的赎回费。

7、在招商可转债债券型证券投资基金开放赎回之前，投资者将无法办理基金赎回业务，存在一定的流动性风险。

## **六、本基金转型后新基金合同的生效**

自2020年11月9日起，招商可转债分级债券型证券投资基金正式变更为招商可转债债券型证券投资基金。《招商可转债债券型证券投资基金基金合同》生效，《招商可转债分级债券型证券投资基金基金合同》同日失效。

投资者欲了解详情，请登陆基金管理人网站：<http://www.cmfchina.com>或拨打客服电话：400-887-9555。

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。销售机构根据法规要求对投资者类别、风险承受能力和基金的风险等级进行划分，并提出适当性匹配意见。投资者在投资基金前应认真阅读基金合同、招募说明书（更新）、产品资料概要等基金法律文件，全面认识基金产品的风险收益特征，在了解产品情况及听取销售机构适当性意见的基础上，根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标，对基金投资作出独立决策，选择合适的基金产品。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

特此公告。

招商基金管理有限公司

2020年10月30日