招商可转债分级债券型证券投资基金之转债优先、转债进取上市交易公告书

基金管理人:招商基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
注册登记人:中国证券登记结算有限责任公司
上市地点:深圳证券交易所
上市时间:2014年8月25日
公告时间:2014年8月20日

一、重要声明与提示

招商可转债分级债券型证券投资基金(以下简称"本基金")之转债优先、转债进取上市交易公告书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1 号<上市交易公告书的内容与格式>》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,本基金管理人的董事会及董事保证本上市交易公告书(以下简称"本公告书")所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金托管人保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。

本公告书第七节"基金财务状况"未经审计。

凡本公告未涉及的有关内容,请投资者详细查阅刊登在2014年7月4日《中国证券报》、《证券时报》及招商基金管理有限公司网站(www.cmfchina.com)上公告的《招商可转债分级债券型证券投资基金招募说明书》。

二、基金概览

1、基金名称:招商可转债分级债券型证券投资基金

2、基金类型:债券型

3、基金运作方式:契约型开放式

4、本基金的基金份额包括招商可转债分级债券型证券投资基金之基础份额(简称"招商可转债份额",场内简称"转债分级",基金代码:161719)、招商可转债分级债券型证券投资基金之稳健收益类份额(简称"招商转债A份额",场内简称"转债优先",基金代码:150188)与招商可转债分级债券型证券投资基金之积极收益类份额(简称"招商转债B份额",场内简称"转债进取",基金代码:150189)。其中,招商转债A份额、招商转债B份额的基金份额配比始终保持7∶3的比例不变。

5、基金存续期限:不定期

6、招商可转债份额的申购与赎回:本基金合同生效后,投资人可通过场外或场内两种方式对招商可转债份额进行申购与赎回。招商转债A份额、招商转债B份额只上市交易,不接受申购与赎回。招商可转债份额的场外申购与赎回的场所包括基金管理人和基金管理人委托的场外代销机构,投资者可使用中国证券登记结算有限责任公司开放式基金账户,通过基金管理人、场外代销机构办理场外申购、赎回业务。招商可转债份额的场内申购与赎回的场所为具有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位,投资者可使用深圳证券账户(即投资者在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的深圳证券交易所人民币普通股票账户或证券投资基金账户) 通过深圳证券交易所交易系统办理场内申购、赎回业务。

7、份额配对转换:份额配对转换是指本基金的招商可转债份额与招商转债A份额、招商转债B份额之间的配对转换,包括分拆和合并两个方面。分拆是指基金份额持有人将其持有的每十份招商可转债份额的场内份额申请转换成七份招商转债A份额与三份招商转债B份额的行为。合并是指基金份额持有人将其持有的每七份招商转债A份额与三份招商转债B份额进行配对申请转换成十份招商可转债份额的场内份额的行为。

8、定期份额折算:本基金的定期份额折算包括周期性份额折算及年度份额折算。周期性份额折算是指在每个基金运作期(基金合同生效日起每3年为一个运作期,含基金合同生效日当年)结束的年份进行的份额折算。年度份额折算指在基金运作期内的每个会计年度(基金合同生效不足6个月的除外、运作期到期当年除外)所进行的份额折算。

周期性份额折算:自基金合同生效后每个基金运作期(基金合同生效日起每3年为一个运作期,含基金合同生效日当年)结束年份的12月15日(遇节假日顺延)。本基金将分别对招商可转债份额和招商转债A份额、招商转债B份额进行份额折算,份额折算后招商转债A份额和招商转债B份额的基金份额参考净值、招商可转债份额的基金份额净值均调整为1.000元。其中招商可转债份额的场外份额经折算后的份额数采用截尾法保留到小数点后两位;招商可转债份额的场内份额经折算后的份额数,以及招商转债A份额、招商转债B份额折算成招商可转债份额的场内份额数均取整计算(最小单位为1份),余额计入基金财产。在基金份额折算后,场内招商可转债份额将按照7:3的比例分拆成招商转债A份额、招商转债B份额。届时,分拆后的招商转债A份额、招商转债B份额与招商可转债份额的场内份额和场外份额的净值均为1.000元。

年度份额折算:在本基金运作期内的每个会计年度(基金合同生效不足六个月的除外,运作期到期当年除外)的12月15日(遇节假日顺延)。每个年度份额折算基准日,本基金将对招商转债A份额和招商可转债份额进行应得收益的定期份额折算。折算前的招商可转债份额持有人,以每10份招商可转债份额,按7份招商转债A的约定收益,获得新增招商可转债份额的分配。折算不改变招商可转债份额持有人的资产净值。折算前的招商转债A持有人,以招商转债A的约定收益,获得新增招商可转债份额的份额分配。折算不改变招商转债A持有人的资产净值,其持有的招商转债A份额净值折算调整为1.000 元、份额数量不变,相应折算增加招商可转债份额场内份额。折算不改变招商转债B 持有人的资产净值,其持有的招商转债B 的份额净值及份额数量不变。持有场外招商可转债份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外招商可转债份额的分配;持有场内招商可转债份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内招商可转债份额的分配。经过上述份额折算,招商转债A份额的基金份额参考净值和招商可转债份额的基金份额净值将相应调整。

9、不定期份额折算:当招商可转债份额的基金净值达到1.400元后,本基金将分别对招商转债A份额、招商转债B份额和招商可转债份额进行份额折算,份额折算后本基金将确保招商转债A份额和招商转债B份额的比例为7:3,份额折算后招商转债A份额和招商转债B份额的基金份额参考净值、招商可转债份额的基金份额净值均调整为1元。

当招商转债B份额的基金份额参考净值达到0.450元后,本基金将分别对招商转债A份额、招商转债B份额和招商可转债份额进行份额折算,份额折算后本基金将确保招商转债A份额和招商转债B份额的比例为7:3,份额折算后招商可转债份额的基金份额净值、招商转债A份额和招商转债B份额的基金份额参考净值均调整为1元。

9、基金份额总额:截至2014年8月18日,本基金的基金份额总额为1,369,172,734.07份,其中,招商可转债份额为1,185,684,008.07份,招商转债A份额为128,442,108.00份,招商转债B份额为55,046,618.00份。

10、基金份额参考净值:截至2014年8月18日,招商可转债份额的基金份额净值为1.002元,招商转债A份额的基金份额参考净值为1.002元,招商转债B份额的基金份额参考净值为1.002元。

11、本次上市交易的基金份额场内简称及其基金代码:转债优先(基金代码:150188),转债进取(基金代码:150189)。

12、本次上市交易的基金份额总额:转债优先为128,442,108.00份;转债进取为55,046,618.00份(截至2014 年8月18日)。

13、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所

14、上市交易日期:2014年8月25日

15、基金管理人:招商基金管理有限公司

16、基金托管人:中国农业银行股份有限公司

17、本次上市交易的基金份额注册登记机构:中国证券登记结算有限责任公司

三、基金的募集与上市交易

(一)上市前基金募集情况

1、基金募集申请的核准机构和核准文号:中国证券监督管理委员会证监许可【2013】1420号

2、基金合同生效日:2014年7月31日

3、基金运作方式:契约型开放式

4、基金合同期限:不定期

5、发售日期:2014年7月7日至 2014年7月25日

6、发售价格:1.00元人民币

7、发售方式:场内和场外

8、发售机构:

(1)场内发售机构:

本基金的场内发售机构为具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位 (具体名单可在深圳证券交易所网站查询)。

(2)场外发售机构:

1)直销机构包括本公司的招商基金电子商务网上交易平台、招商基金华东机构理财中心、招商基金华南机构理财中心、招商基金养老金及华北机构理财中心等。

2)代销机构:农业银行、工商银行、招商银行、招商证券、申银万国证券、银河证券、财富证券、长江证券、中航证券、华融证券、华安证券、齐鲁证券、东兴证券、中山证券、东海证券、东吴证券、渤海证券、中投证券、国金证券、国都证券、华鑫证券、新时代证券、民族证券、国泰君安证券、东北证券、广州证券、万联证券、天源证券、平安证券、英大证券、第一创业证券、中信建投证券、宏源证券、光大证券、华宝证券、中信证券、海通证券、中信证券(山东)、中信证券(浙江)、兴业证券、国海证券(排名不分先后)。

9、验资机构名称:毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)

10、募集资金总额及入账情况

本基金于2014年7月7日起公开募集,基金募集工作已于2014年7月25日顺利结束。经毕马威华振会计师事务所验资,本次募集的有效认购资金人民币1,368,770,648.81元,基金注册登记机构记录的有效认购资金利息转份额人民币402,085.26,共计人民币1,369,172,734.07元。上述资金及利息折合1,369,172,734.07份基金份额。有效认购资金人民币1,368,770,648.81元已于2014年7月31日划入本基金在基金托管人中国农业银行股份有限公司开立的基金托管专户。此外,经中国证券登记结算有限责任公司确认,上述有效认购资金利息转份额中对应的应收利息人民币402,085.26元将于招商可转债分级债券型证券投资基金成立之后的下一银行季度结息日(即2014年9月20日)后结转入相关账户。本次募集有效认购总户数为11,556户。

11、本基金募集备案情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》以及《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招募说明书》的有关规定,本基金募集符合有关条件,本基金管理人已向中国证监会办理基金备案手续,并于2014年7月31日获书面确认,基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起,本基金管理人开始正式管理本基金。

12、基金合同生效日的基金份额总额:1,369,172,734.07份

13、本基金管理人及基金从业人员持有基金份额的情况:

份额级别		招商转债A份额	招商转债B份额	招商可转债份额
募集期间基金管理人运用固有资金认购本基金情况	认购的基金份额(单位:份)	–	–	–
	占基金总份额比例	–	–	–
	其他需要说明的事项	–	–	–
募集期间基金管理人的从业人员认购本基金情况	认购的基金份额(单位:份)	–	–	–
	占基金总份额比例	–	–	–

本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、基金经理未持有本基金。

(二)本基金上市交易的主要内容

1、基金上市交易的核准机构和核准文号:深圳证券交易所深证上【2014】300号

2、上市交易日期:2014年8月25日

3、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所。投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。

4、基金简称:招商转债A份额、招商转债B份额

基金场内简称:转债优先、转债进取

5、交易代码:转债优先:150188、转债进取:150189

6、本次上市交易份额:转债优先:128,442,108.00份、转债进取:55,046,618.00份

7、未上市交易份额的流通规定:对于托管在场内的招商可转债份额,基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下,将其分拆为转债优先和转债进取即可上市流通;对于托管在场外的招商可转债份额,基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下,将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后分拆为转债优先和转债进取即可上市流通。

8、基金资产净值的披露:在招商转债A份额、招商转债B份额上市交易前或者开始办理招商可转债份额申购或者赎回后,基金管理人应当在每个开放日的次日,通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介,披露开放日招商可转债份额的基金份额净值和基金份额累计净值、招商转债A份额与招商转债B份额的基金份额参考净值。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况

(一)持有人户数

截至2014年8月18日, 场外招商可转债份额持有人户数为10,228户, 平均每户持有的基金份额为115,925.30份;场内招商可转债份额持有人户数为0户,平均每户持有的基金份额为0份;转债优先为1,328户,平均每户持有的基金份额为96,718.45份;转债进取为1,328户,平均每户持有的基金份额为41,450.77份。

(二)持有人结构

截至2014年8月18日,机构投资者持有的本次上市交易的转债优先基金份额为5,778,944.00份,占本次转债优先上市交易基金份额比例为4.50%; 个人资者持有的本次上市交易的转债优先基金份额为122,663,164.00份,占本次转债优先上市交易基金份额比例为95.50%。

机构投资者持有的本次上市交易的转债进取基金份额为2,476,689.00份,占本次转债进取上市交易基金份额比例为4.50%;个人资者持有的本次上市交易的转债进取基金份额为52,569,929.00份,占本次转债进取上市交易基金份额比例为95.50%。

(三)前十名场内基金份额持有人情况(截至2014年8月18日)

序号	持有人名称(全称)	持有转债优先	占转债优先的比例(%)	持有转债进取	占转债进取的比例(%)
1	刘雯芳	2,450,048.00	1.91%	1,050,020.00	1.91%
2	陈学东	2,100,041.00	1.64%	900,017.00	1.64%
3	陈东明	1,890,084.00	1.47%	810,036.00	1.47%
4	葛珠珍	1,750,153.00	1.36%	750,065.00	1.36%
5	上海铁新地理信息有限公司	1,400,122.00	1.09%	600,052.00	1.09%
6	梅杰	1,190,173.00	0.93%	510,074.00	0.93%
7	李冬娟	1,190,023.00	0.93%	510,010.00	0.93%
8	吴江电子仪器厂	1,085,158.00	0.84%	465,067.00	0.84%
9	深圳市金中钢工贸有限公司	1,050,020.00	0.82%	450,009.00	0.82%
10	王广府	910,141.00	0.71%	390,061.00	0.71%
合计		15,015,963.00	11.70%	6,435,411.00	11.70%

注:以上信息依据中国证券登记结算有限公司深圳分公司提供的持有人信息编制。

五、基金主要当事人简介

(一) 基金管理人

1、公司概况

名称:招商基金管理有限公司
法定代表人:张光华
总经理:许小松
设立日期:2002年12月27日
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦28楼
注册资本:人民币2.1亿元
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦28楼
设立批准文号:中国证监会证监基金字[2002]100号
工商登记注册的法人营业执照文号:100000400009761
经营范围:基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。
存续期间:持续经营
电话:(0755)83196351
传真:(0755)83076974
联系人:曾倩

2、股东及其出资比例

管理人股东名称	占注册资本比例
招商银行股份有限公司	55.0%
招商证券股份有限公司	45.0%

3、内部组织结构及职能

公司具体经营管理由总经理负责,公司根据经营运作需要设置董事会办公室、投资管理一部、固定收益投资部、交易部、研究部、投资管理二部、投资管理三部、投资管理四部、全球量化投资部、渠道管理部、市场部、互联网金融部、产品研发部、国际业务部、机构理财部、信息技术部、基金核算部、基金事务部、法律合规部、风险管理部、总经理办公室、人力资源部、财务部等23个职能部门,并设有北京分公司、上海分公司、成都分公司等分支机构。

各部门主要职能如下:

董事会办公室:负责公司董事会相关工作。
投资管理一部:根据投资决策委员会制定的原则进行投资股票投资。
固定收益投资部:负责固定收益产品的投资。
交易部:负责公司所有产品的交易管理工作。
研究部:负责宏观、策略、行业和公司研究。
投资管理二部:负责专户产品的投资。
投资管理三部:根据投资决策委员会制定的原则进行投资股票投资。
投资管理四部:根据投资决策委员会制定的原则进行投资股票投资。
全球量化投资部:负责量化产品和指数产品的投资。
渠道管理部:负责基金的渠道销售工作。
市场部:负责营销策划、客户服务、市场推广等工作。
互联网金融部:负责互联网金融平台的搭建、对接与产品的销售等工作。
产品研发部:负责产品研发、申报等工作。
国际业务部:负责海外基金产品的投资研究。
机构理财部:负责机构销售业务。
信息技术部:负责公司电脑信息技术的开发、维护及基金后台运作支持工作。
基金核算部:负责公司基金的会计核算、估值。
基金事务部:负责公司基金的注册登记、资金清算。
法律合规部:负责对公司和基金运作合规性监察、稽核审计、法务支持及日常信息披露事宜。
风险管理部:负责对公司日常营运进行风险管理及风险检查;负责投资业绩评价。
总经理办公室:负责文档、印鉴管理,公司品牌建设、市场调研以及其他行政工作。
人力资源部:负责公司人力资源管理工作。
财务部:负责公司财务管理、会计核算等相关工作。
各分公司:负责所辖区域内销售渠道的开发、维护。

4、人员情况

截至2014年8月12日,公司共有员工253人,其中231人通过中国证券业协会组织的证券从业资格考试,具有基金从业资格。

5、信息披露负责人及咨询电话:

欧志明,(0755)83196401。

6、基金管理业务情况

本基金管理公司目前管理40只基金,其中封闭式基金1只:招商信用添利债券型证券投资基金;开放式基金39只。

7、本基金基金经理简介

孙海波,男,中国国籍,经济学硕士。曾任职于南开大学计算中心及泰康人寿保险股份有限公司;1999年加入光大证券股份有限公司,曾任职于投行部、债券投资部及自营部;2004年起先后任职于万家基金管理有限公司 (原天同基金)及中信基金管理有限公司(现华夏基金)的投资管理部,均从事证券投资相关工作;2007年加入中国中投证券有限责任公司,担任证券投资部副总经理,全面负责公司证券投资业务;2012年加入招商基金管理有限公司固定收益投资部, 现任副总监。曾任招商理财7天债券型证券投资基金基金经理(管理时间:2012年12月7日至2014年3月11日),现任招商安心收益债券型证券投资基金基金经理(管理时间:2012年8月30日至今)、招商安盈保本混合型证券投资基金基金经理(管理时间:2012年12月6日至今)、招商安达保本混合型证券投资基金基金经理(管理时间:2013年10月19日至今)、招商可转债分级债券型证券投资基金基金经理(管理时间:2014年7月31日至今)。

(二) 基金托管人

1、基金托管人概况

名称:中国农业银行股份有限公司(简称"中国农业银行")
注册地址:北京市东城区建国门内大街69 号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街28 号凯晨世贸中心东座九层
法定代表人:蒋超良
设立日期:2009 年1 月15 日
注册资本:32,479,411.7万元人民币
批准设立机关和批准设立文号:中国银监会银监复【2009】13号
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]23号
电话:(010)63201510
传真:(010)63201816
联系人:李芳菲

2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工140余名,其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家10余名,服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强,高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称,精通国内外证券市场的运作。

3、证券投资基金托管情况

截止2014年6月30日,中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共213只。

(三)基金验资机构

名称:毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
注册地址:北京市东长安街1号东方广场东二办公楼八层
法定代表人:姚建华
电话:(0755)2547 1000
传真:(0755)8266 8930
经办注册会计师:王国蓓、黄小熠
联系人: 蔡正轩

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七、基金财务状况

(一)基金募集期间费用

本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用,不从基金资产中支付。

(二)基金上市前重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

(三)基金资产负债表

截至公告前两个工作日即2014年8月18日,本基金的资产负债表如下:

资产负债表

会计主体:招商可转债分级债券型证券投资基金

报告截止日:2014年8月18日

单位:人民币元

资产	本报告期末 2014年8月18日
资 产:	
银行存款	885,306,779.16
结算备付金	–
存出保证金	–
交易性金融资产	81,757,442.30
其中:股票投资	–
债券投资	81,757,442.30
资产支持证券投资	–
贵金属投资	–
衍生金融资产	–
买入返售金融资产	310,000,000.00
应收证券清算款	122,400,000.00
应收利息	2,430,562.23
应收股利	–
应收申购款	–
其他资产	402,969.74
资产合计	1,402,297,753.43
负债和所有者权益	
负债:	
短期借款	–
交易性金融负债	–
衍生金融负债	–
卖出回购金融资产款	–
应付证券清算款	30,302,769.81
应付赎回款	–
应付管理人报酬	540,575.60
应付托管费	135,143.91
应付销售服务费	–
应付交易费用	–
应付税费	–
应付利息	–
应付利润	–
其他负债	20,974.10
负债合计	30,999,463.42
所有者权益:	
实收基金	1,369,172,734.07
未分配利润	2,125,555.94
所有者权益合计	1,371,298,290.01
负债与持有人权益总计	1,402,297,753.43

注:截至2014年8月18日,招商可转债份额净值1.002元、转债优先份额净值1.002元、转债进取份额净值1.002元,招商可转债份额1,185,684,008.07份、转债优先份额128,442,108.00份、转债进取份额55,046,618.00份。

八、基金投资组合

截至公告前两个工作日即2014年8月18日(以下称"报告期末"),本基金的投资组合如下:

(一)报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	–	–
	其中:股票	–	–
2	固定收益投资	81,757,442.30	5.83
	其中:债券	81,757,442.30	5.83
	资产支持证券	–	–
3	贵金属投资	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
5	买入返售金融资产	310,000,000.00	22.11
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	银行存款和结算备付金合计	885,306,779.16	63.13
7	其他资产	125,233,531.97	8.93
8	合计	1,402,297,753.43	100.00

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

(三)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

(四)报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	29,955,000.00	2.18
2	央行票据	–	–
3	金融债券	–	–
	其中:政策性金融债	–	–
4	企业债券	11,993,587.20	0.87
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债	39,808,855.10	2.90
8	其他	–	–
9	合计	81,757,442.30	5.96

(五)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019414	14国债14	300,000	29,955,000.00	2.18
2	110023	民生转债	270,000	25,099,200.00	1.83
3	124656	14永国投	116,760	11,993,587.20	0.87
4	110027	东方转债	61,110	6,859,597.50	0.50
5	110018	国电转债	60,000	6,498,000.00	0.47

(六)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(七)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

(八)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

(九)投资组合报告附注

1、报告期末基金投资的前十名证券的发行主体本有被监管部门立案调查,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2、本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库,本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

3、其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	–
2	应收证券清算款	122,400,000.00
3	应收股利	–
4	应收利息	2,430,562.23
5	应收申购款	–
6	其他应收款	402,969.74
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	125,233,531.97

(十)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110023	民生转债	25,099,200.00	1.83
2	110018	国电转债	6,498,000.00	0.47
3	110017	中海转债	1,352,057.60	0.10

(十一)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

九、重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出如下承诺:

1、严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

2、真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件,披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息,并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。

3、在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后,将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺:

1、严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,设立专门的基金托管部,配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员负责基金财产托管事宜。

2、根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

3、基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,督促基金管理人改正。

4、基金托管人发现基金管理人有重大违规行为,将立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。

十二、备查文件目录

投资者如果需了解更详细的信息,可向基金管理人、基金托管人或销售代理人申请查阅以下文件:

1、中国证监会批准招商可转债分级债券型证券投资基金募集的文件
2、《招商可转债分级债券型证券投资基金基金合同》
3、《招商可转债分级债券型证券投资基金托管协议》
4、《招商可转债分级债券型证券投资基金代销协议》
5、《律师事务所法律意见书》
6、招商基金管理有限公司业务资格批件、营业执照和公司章程
7、中国农业银行股份有限公司业务资格批件和营业执照

招商基金管理有限公司
2014年8月20日

附件:

基金合同摘要

(一)基金合同当事人及其权利义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的权利包括但不限于:

(1)依法募集基金;
(2)自《基金合同》生效之日起,根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产;
(3)依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用;
(4)销售基金份额;
(5)召集基金份额持有人大会;
(6)依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人,如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定,应呈报中国证监会和其他监管部门,并采取必要措施保护基金投资者的利益;
(7)在基金托管人更换时,提名新的基金托管人;

(下转B70版)

关于开放招商可转债分级债券型证券投资基金日常申购、赎回及定期定额投资业务的公告

公告送出日期:2014年8月20日

1公告基本信息

基金名称	招商可转债分级债券型证券投资基金	
基金简称	招商可转债分级债券	
基金主代码	161719	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年7月31日	
基金管理人名称	招商基金管理有限公司	
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司	
基金注册登记机构名称	招商基金管理有限公司	
公告依据	《招商可转债分级债券型证券投资基金基金合同》和《招商可转债分级债券型证券投资基金招募说明书》	
申购起始日	2014年8月25日	
赎回起始日	2014年8月25日	
转换转入起始日	–	
转换转出起始日	–	
定期定额投资起始日	2014年8月25日	
下属分级基金的基金简称	转债优先	转债进取
下属分级基金的交易代码	150188	150189
下属分级基金的前端交易代码	–	–
下属分级基金的后端交易代码	–	–
该分级基金是否开放申购、赎回(转换、定期定额投资)	否	否

注:本基金的基金份额包括基础份额和分级份额。基础份额为"招商可转债份额"(场内简称"转债分级",基金代码"161719"),分为场外和场内两部分;分级份额包括招商转债A份额(场内简称"转债优先",基金代码"150188")和招商转债B份额(场内简称"转债进取",基金代码"150189")。基金合同生效后,投资者可以通过场外或场内方式申购赎回招商可转债份额。招商转债A份额和招商转债B份额不接受投资者的申购赎回。

投资者范围:符合法律法规规定的个人投资者、机构投资者及合格境外机构投资者以及法律法规及中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

2 日常申购、赎回(定期定额投资)业务的办理时间

投资人在开放日办理招商可转债份额的申购和赎回,具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间,但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理招商可转债份额的申购或者赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的,其基金份额申购、赎回或转换价格为下一开放日招商可转债份额申购、赎回或转换的价格。

基金合同生效后,若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况,基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整,但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

3 日常申购业务

3.1 申购金额限制

投资者在办理招商可转债份额场内申购时,单笔申购的最低金额为50,000元人民币。投资人办理招商可转债份额场外申购时,单笔最低金额为1000元人民币(含申购费)。通过直销中心首次申购的最低金额为50万元人民币(含申购费),追加申购单笔最低金额为1000元人民币(含申购费)。通过本公司电子商务网上交易系统办理招商可转债份额申购,最低申购金额为单笔1000元。本基金直销中心及电子商务网上交易系统的单笔申购最低金额可由基金管理人酌情调整。

本基金不对单个投资人累计持有的招商可转债份额上限进行限制。

基金管理人可根据有关法律规定和市场情况,在法律法规允许的情况下,调整上述对申购金额的数量限制,基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案。

3.2 申购费率

–

3.2.1 前端收费

申购金额(M)	申购费率	备注
M<1000000	0.70%	–
1000000<=M<5000000	0.40%	–
5000000<=M	1000元/笔	–

注:招商可转债份额的场外申购费率根据申购金额如上表设定,申购费按申购金额进行分档,投资者在一天之内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。招商可转债份额的场内申购费率由基金代销机构比照场外申购费率执行。

3.2.2 后端收费

持有期限(N)	申购费率	备注

注:–

3.3 其他与申购相关的事项

招商可转债份额申购份额的计算:

基金的申购金额包括申购费用和净申购金额,其中:

净申购金额 = 申购金额/(1+申购费率)
申购费用 = 申购金额–净申购金额
申购份额 = 净申购金额/T日招商可转债份额的份额净值

申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后,以当日招商可转债份额的基金份额净值为基准计算,其中,通过场外方式进行申购的,申购份额计算结果保留到小数点后2位,小数点后两位以后的部分四舍五入,由此误差产生的收益或损失计入基金财产;通过场内方式申购的,申购份额计算结果采用截尾法保留到整数位,整数位后小数部分的份额对应的资金返还投资者。

招商可转债份额的申购费用由基金申购人承担,并应在投资者申购基金份额时收取,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

4 日常赎回业务

4.1 赎回份额限制

基金份额持有人办理招商可转债份额场外赎回时,每笔赎回申请的最低份额为1000份基金份额;基金份额持有人办理招商可转债份额场内赎回时,每笔赎回申请的最低份额为1000份基金份额,同时赎回份额必须是整数份额。招商可转债份额持有人每个交易账户的最低份额余额为1000 份,份额持有人赎回时或赎回后将导致在销售机构(网点)保留的招商可转债份额余额不足1000 份的,需一并全部赎回。

基金管理人可根据有关法律规定和市场情况,在法律法规允许的情况下,调整上述对赎回份额的数量限制,基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案。

4.2 赎回费率

持有期限(N)	赎回费率
N<365天	0.10%
365天<=N<730天	0.05%
730天<=N	0.00%

注: 招商可转债份额的场外赎回费率按基金份额持有人持有该部分基金份额的时间分段如上表设定。招商可转债份额的场内赎回费率为固定0.10%。

招商可转债份额的赎回费用由基金赎回人承担,在投资者赎回基金份额时收取。扣除赎回手续费后的余额归基金财产,赎回费归入基金财产的部分不低于赎回费总额的25%。

基金管理人可以根据基金合同的相关约定调整费率或收费方式,基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前在至少一种指定媒体及基金管理人网站公告。

对特定交易方式(如网上交易、电话交易等),基金管理人履行适当程序后可以调低基金申购费率和基金赎回费率。

基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,针对投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,按相关监管部门要求履行相关手续后基金管理人可以适当调低招商可转债份额的申购费率和基金赎回费率。

4.3 其他与赎回相关的事项

采用"份额赎回"方式,赎回价格以T日的招商可转债份额的份额净值为基准进行计算,计算公式:

赎回总金额=赎回份额(T日招商可转债份额的份额净值
赎回费用=赎回总金额(赎回费率
净赎回金额=赎回总金额(赎回费用

赎回金额计算结果保留到小数点后2位,小数点后两位以后的部分四舍五入,由此产生的误差计入基金财产。

5 日常转换业务

5.1 转换费率

日常转换业务暂时不予开通,若今后开通,请以相关公告为准。

5.2 其他与转换相关的事项

–

6 定期定额投资业务

"定期定额投资业务"是投资者可通过本公司指定的基金销售机构提交申请,约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式,由销售机构于每期约定扣款日在投资者指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式。投资者在办理相关基金"定期定额投资业务"的同时,仍然可以进行日常申购、赎回业务。

投资者可与销售机构就本基金申请定期定额投资业务约定每期固定扣款金额,定期定额申购每期最低扣款金额不少于人民币100元。具体最低扣款金额遵循投资者所开户的销售机构的规定。

定期定额申购业务的申购费率等同于正常申购费率,计费方式等同于正常的申购业务,如有费率优惠以销售机构相关公告为准。

7 基金销售机构

7.1 场外销售机构

7.1.1 直销机构

招商基金客户服务中心电话:400–887–9555(免长途话费)

(1)招商基金电子商务网上交易平台
交易网站:www.cmfchina.com
交易电话:400–887–9555(免长途话费)
电话:(0755)83195018
传真:(0755)83199059
联系人:李涛

(2)招商基金华东机构理财中心
地址:上海市浦东新区陆家嘴东路166号中国保险大厦1601室
电话:(021)58796636
联系人: 王雷

(3)招商基金华南机构理财中心
地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦23楼
电话:(0755)83190452
联系人:刘刚

(4)招商基金养老金及华北机构理财中心
地址:北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦B座2层西侧 207–219单元
电话:(010)66290540
联系人:刘超

(5)招商基金直销交易服务联系方式
地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦23层招商基金市场部客户服务中心
电话:(0755)83196359 83196358
传真:(0755)83196360
备用传真:(0755)83199266
联系人:贺军莉

7.1.2 场外代销机构

开通本基金日常申购、赎回业务的代销机构包括:农业银行、中国银行、工商银行、招商银行、交通银行、中信银行、浦发银行、平安银行、招商证券、银河证券、申银万国证券、财富证券、长江证券、国海证券、中航证券、华融证券、华安证券、齐鲁证券、东兴证券、中山证券、东海证券、东吴证券、渤海证券、中投证券、国金证券、国都证券、华鑫证券、新时代证券、民族证券、国泰君安证券、东北证券、广州证券、万联证券、天源证券、平安证券、英大证券、第一创业证券、中信证券、中信建投证券、宏源证券、光大证券、海通证券、华宝证券、中信证券(浙江)、中信证券(山东)、兴业证券(排名不分先后)。

开通本基金定期定额投资业务的代销机构包括:农业银行、中国银行、工商银行、招商银行、交通银行、中信银行、浦发银行、平安银行、招商证券、银河证券、申银万国证券、国海证券、华融证券、华安证券、齐鲁证券、中山证券、东吴证券、华鑫证券、新时代证券、国泰君安证券、东北证券、广州证券、万联证券、天源证券、平安证券、第一创业证券、中信证券、中信建投证券、海通证券、华宝证券、中信证券(浙江)、中信证券(山东)(排名不分先后)。

各代销网点的地址、营业时间等信息,请参照各代销机构的规定。

基金管理人可以根据情况增加或者减少代销机构,并另行公告。销售机构可以根据情况增加或者减少其销售城市、网点,并另行公告。敬请投资者留意。

7.2 场内销售机构

场内代销机构为具有基金代销业务资格的深圳交易所会员单位。

8 基金份额净值公告/基金收益公告的披露安排

在2014年8月25日开始办理招商可转债份额申购或者赎回后,基金管理人应当在每个开放日的次日,通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介,披露开放日招商可转债份额的基金份额净值和基金份额累计净值、招商转债A份额与招商转债B份额的基金份额参考净值。

9 其他需要提示的事项

(1)本公告仅对本基金开放申购、赎回及开通定期定额投资事项予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况, 请详细阅读刊登在2014年7月4日 《中国证券报》、《证券时报》 以及本基金管理人网站(www.cmfchina.com)上的《招商可转债分级债券型证券投资基金招募说明书》。

(2)未开设销售网点地区的投资者,及希望了解本基金的详细情况和其它有关信息的投资者,可以登录本基金管理人网站(www.cmfchina.com)或拨打本基金管理人的热线电话查询。招商基金客户服务中心电话:400–887–9555(免长途费)。

(3)由于各代销机构系统及业务安排等原因,可能开展上述业务的时间有所不同,投资者应以各代销机构具体规定的时间为准。

(4)有关本基金开放申购、赎回及定期定额投资业务的具体规定若有变化,本公司将另行公告。

(5)上述业务的解释权归本基金管理人。

(6)风险提示:投资人应当充分了解基金定期定额投资和零存整取等储蓄方式的区别。定期定额投资是引导投资人进行长期投资、平均投资成本的一种简单易行的投资方式。但是定期定额投资并不能规避基金投资所固有的风险,不能保证投资人获得收益,也不是替代储蓄的等效理财方式。本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。投资者投资于本基金时应认真阅读本基金的基金合同、招募说明书及最新的招募说明书更新。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

招商基金管理有限公司
2014年8月20日

关于招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF)2014年境外主要市场节假日暂停申购赎回和定投业务的公告

公告送出日期:2014年8月20日

1 公告基本信息

基金名称		招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF)
基金简称		招商标普金砖四国指数(QDII–LOF)(场内简称:招商金砖)
基金主代码		161714
基金管理人名称		招商基金管理有限公司
公告依据		根据《招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF)基金合同》、《招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF)招募说明书》的相关规定
暂停相关业务的起始日、金额及原因说明	暂停申购起始日	2014年8月25日
	暂停赎回起始日	2014年8月25日
	暂停定期定额投资起始日	2014年8月25日
	暂停(大额)申购(转换转入、赎回、转换转出、定期定额投资)的原因说明	因2014年8月25日为夏季银行假日, 届时境外主要交易所将暂停交易,为了保障基金平稳运作,保护基金持有人利益,暂停本基金的申购、赎回及定期定额申购业务。

注:–

2 其他需要提示的事项

招商基金管理有限公司(以下简称"本公司")决定于北京时间2014年8月25日(夏季银行假日)暂停招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF)(以下简称"本基金")的申购、赎回和定期定额申购业务,并于北京时间2014年8月26日恢复,届时将不再另行公告。暂停期间投资人提交的本基金的申购、赎回及定期定额申购业务将做失败处理。

若境外主要市场节假日或交易清算日发生变化,或根据法律法规和基金合同的约定,本基金需要调整申购、赎回等业务安排的,本公司将另行公告。

敬请广大投资者认真查阅直销机构和各代销机构的具体业务规则,及早做好交易安排,避免因境外主要市场节假日原因带来不便。

如有疑问,请拨打客户服务热线:400–887–9555(免长话费),或登陆网站www.cmfchina.com获取相关信息。

招商基金管理有限公司
2014年8月20日

招商基金管理有限公司关于旗下基金估值变更的公告

招商基金管理有限公司(以下简称"我公司")旗下基金所持有的东方明珠(证券代码:600832)于2014年5月29日起停牌。

根据中国证券监督管理委员会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》(第[2008]38号)和基金合同的相关约定,本公司经与基金托管人、会计师事务所协商一致,决定自2014年8月19日起,对旗下证券投资基金(除上证消费80交易型开放式指数证券投资基金外)所持有的该只股票采用"指数收益法"进行估值。同时,对招商上证消费80交易型开放式指数证券投资基金联接基金持有的上证消费80交易型开放式指数证券投资基金,在当日份额净值的基础上考虑上述股票的调整因素进行估值。

待该股票复牌且其交易体现了活跃市场交易特征后,将恢复按市价估值方法进行估值。同时,对招商上证消费80交易型开放式指数证券投资基金联接基金持有的上证消费80交易型开放式指数证券投资基金恢复按估值日的份额净值进行估值,届时不再另行公告。敬请投资者予以关注。

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。投资者投资于本公司管理的基金时应认真阅读基金合同和招募说明书。

特此公告并提示。

招商基金管理有限公司
2014年8月20日

关于开通招商可转债分级债券型证券投资基金跨系统转托管业务的公告

招商可转债分级债券型证券投资基金(以下简称"本基金")基金合同已于2014年7月31日正式生效。为了保证基金份额持有人的利益,根据《招商可转债分级债券型证券投资基金基金合同》的约定,经本基金管理人向深圳证券交易所提出申请,将自2014年8月25日开通办理招商可转债基础份额(基金代码:161719,场内简称:转债分级)的跨系统转托管业务。

通过场外认购本基金的投资人自2014年8月25日起可以通过认购本基金的销售机构办理招商可转债基础份额跨系统转托管业务。本基金在开放日常申购业务后,投资人可以通过申购本基金的销售机构办理招商可转债基础份额跨系统转托管业务。跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

场外认购/申购的招商可转债基础份额只有在办理跨系统转托管业务成功后方能申请场内赎回或申请分拆为招商转债A份额与招商转债B份额, 分拆后的招商转债A份额与招商转债B份额方可在深圳证券交易所上市交易。在确定上市交易时间后,本基金管理人应依据法律法规规定在指定媒体上刊登招商转债A份额与招商转债B份额上市交易公告书。敬请场外认购本基金的投资人根据自身情况办理跨系统转托管业务,在本基金开放申购后,本公告中跨系统转托管的相关规则将自动适用于在场内、场外申购的基金份额。

如有疑问,请拨打客户服务热线:400–887–9555(免长话费),或登陆网站www.cmfchina.com获取相关信息。

风险提示:基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,不保证投资本基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的最低收益。敬请投资人注意投资风险。

特此公告

招商基金管理有限公司
2014年8月20日

关于开通招商可转债分级债券型证券投资基金份额配对转换业务的公告

根据《招商可转债分级债券型证券投资基金基金合同》的约定,招商基金管理有限公司将自2014年8月25日起,开通招商可转债分级债券型证券投资基金的场内份额配对转换业务。

(一)场内份额配对转换

场内份额配对转换指根据基金合同约定,场内的基础份额与分级份额之间进行转换的行为,即招商可转债基础份额(简称"转债分级",代码"161719")与招商转债A份额(简称"转债优先",代码"150188")和招商转债B份额(简称"转债进取",代码"150189")之间进行转换的行为,包括分拆与合并。

1)分拆:分拆指基金份额持有人将其持有的每10份招商可转债基础份额按照7∶3的份额配比转换成7份招商转债A份额与3份招商转债B份额的行为。

2)合并:合并指基金份额持有人将其持有的每7份招商转债A份额与3份招商转债B份额按照7∶3的基金份额配比转换成10份招商可转债基础份额的行为。

场外的招商可转债基础份额不进行份额配对转换。在场外的招商可转债基础份额通过跨系统转托管至场内后,可按照场内份额配对转换规则进行操作。

(二)业务办理机构

投资人可以通过依据中国证券登记结算有限责任公司(以下简称"中登")有关规定获得业务办理资格的深圳证券交易所会员单位办理份额配对转换业务,按照中登有关规定获得业务办理资格的深圳证券交易所会员单位名单可向本公司咨询,中登网站2014年8月8日公告的具有配对转换业务资格的深圳证券交易所会员单位为:国泰君安证券、中信建投证券、国信证券、招商证券、广发证券、中信证券、银河证券、海通证券、申银万国证券、兴业证券、长江证券、安信证券、西南证券、中信证券(浙江)、湘财证券、民生证券、国元证券、渤海证券、华泰证券、山西证券、中信万通证券、东兴证券、东吴证券、信达证券、东方证券、方正证券、长城证券、光大证券、广州证券、东北证券、南京证券、上海证券、新时代证券、国联证券、浙商证券、平安证券、华安证券、国海证券、财富证券、东莞证券、中原证券、国都证券、东海证券、中银国际证券、恒泰证券、国盛证券、华西证券、宏源证券、齐鲁证券、世纪证券、第一创业证券、金元证券、中航证券、华林证券、德邦证券、西部证券、广发华福证券、华龙证券、中金公司、财通证券、华鑫证券、瑞银证券、中投资券、中山证券、红塔证券、西藏同信证券、日信证券、联讯证券、江海证券、天源证券、银泰证券、国金证券、民族证券、华宝证券、厦门证券、华融证券、财达证券、天风证券、中天证券、大通证券、华创证券、首创证券、国开证券、川财证券。

(三)业务办理时间

深圳证券交易所交易时间内投资人可提出份额配对转换业务申请(基金管理人公告暂停份额配对转换业务时除外)。

若深圳证券交易所交易时间更改或实际情况需要,基金管理人将对份额配对转换业务的办理时间进行相应调整并公告。

(四)场内份额配对转换的原则

1、投资人以中登深圳分公司A股账户或证券投资基金账户(以下简称"深市证券账户")申报份额配对转换业务中的"分拆"或"合并"指令,申报前需备足对价,即投资人提出"合并"申请时,其所申报的深市证券账户上须有足够的、可交易的转债优先份额与转债进取份额;投资人提出"分拆"申请时,其所申报的深市证券账户上须有足够的、可交易的转债分级份额。

2、投资人通过业务办理机构提出份额配对转换申请的,统一以招商可转债分级份额(场内简称"转债分级")的交易代码"161719"作为申请指令的证券代码,以份额为单位进行"合并"或"分拆"申报。

3、"合并"或"分拆"每笔申请的份额数不得低于10份,且应为10份的整数倍。基金管理人可根据市场情况调整"合并"或"分拆"每笔申报的最低份额数量限制,基金管理人必须在调整生效前依照有关规定进行公告。

4、如果申请场内份额的合并,转债优先份额与转债进取份额必须同时配对申请,且转债优先份额与转债进取份额的份额数必须分别为相关业务公告规定份额的正整数倍、份额数配比为7:3。

5、办理份额配对转换业务的深圳证券交易所会员单位应对投资人每笔"分拆"或"合并"申请的可用份额数量进行检查并对相应基金份额进行预冻结。

6、在交易时间内,份额配对转换业务办理机构通过深证通FDEP消息传输系统将份额配对转换申报指令发送给中登的基金业务系统。正常情况下,中登深圳分公司在T日收市后对投资人T日交易时间内提交的份额配对转换业务申请进行有效性确认,并进行份额变更处理,办理转出基金份额的扣除以及转入基金份额的登记。自T+1日起(包括该日)投资人可查询基金份额配对转换的成交情况。

7、投资人T日提出的M份份额"分拆"申请被确认成功后,中登深圳分公司将在投资人所申报的深市证券账户上扣减M份转债分级份额,同时增加7M/10份转债优先与3M/10份转债进取。正常情况下,自T+1日(含该日)起新增的转债优先与转债进取份额可进行交易。

8、投资人T日提出的N份份额"合并"申请被确认成功后,中登深圳分公司将在投资人所申报的深市证券账户上扣减7N/10份转债优先和3N/10份转债进取,同时增加N份转债分级份额。正常情况下,自T+1日(含该日)起新增的转债分级份额可进行赎回等业务。

9、场外转债分级份额如需申请进行"分拆",须跨系统转托管为场内转债分级份额后方可进行。

10、投资人提出的份额配对转换申请,在当日交易时间结束前可以撤销,交易时间结束后不得撤销。

11、份额配对转换应遵循最新发布的相关业务规则。

(五)份额配对转换的业务办理费用

投资人申请办理份额配对转换业务时,份额配对转换业务办理机构暂不收取业务办理费用。

(六)重要提示

1、基金管理人、注册登记机构或深圳证券交易所可视情况对上述"场内份额配对转换的原则"作出调整,并在正式实施前在至少一家指定媒体公告。

2、投资者可拨打客户服务热线:400–887–9555(免长话费),或登陆网站www.cmfchina.com获取相关信息。

3、风险提示:基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,不保证投资本基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的最低收益。敬请投资人注意投资风险。

特此公告

招商基金管理有限公司
2014年8月20日