关于以通讯方式召开天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告

一、召开会议的基本情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《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《天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）的有关约定，并与基金托管人交通银行股份有限公司协商一致，天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金管理人天治基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“本基金管理人”）决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，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12月26日起至2019年1月28日17:00止（以本基金管理人收到表决票时间为准）。

3、会议计票日：2019年1月29日

4、会议通讯表决票及授权委托书的寄达地点：

基金管理人：天治基金管理有限公司

办公地址：上海市复兴西路159号

会务常设联系人：张亮

会务常设联系人电话：021-60374935

持有人大会专线/客服电话：400-098-4800

邮政编码：200031

请在信封表面注明：“天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

4、投资者如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话400-098-4800咨询。

二、会议审议事项

《关于天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金转型的议案》（见附件一）

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12月26日，即2018年12月26日交易时间结束后，在本基金注册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、表决票的填写和寄交方式

1、本次会议表决票详见附件二。基金份额持有人可从相关报纸上剪裁、复印、登录本基金管理人网站（www.chinanature.com.cn）下载并打印或按以上格式自制表决票。

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正反面复印件；

（2）机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章（或基金管理人认可的其他印章，下同），并提供加盖公章的营业执照复印件（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）；

（3）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有效身份证件正反面复印件，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和取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件；

（4）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正反面复印件，以及填妥的授权委托书原件（详见附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件正反面复印件；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）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，并提供机构投资者的加盖公章的营业执照复印件（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）；

（6）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和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）；

（7）以上各项中的公章、批文、开户证明及登记证书，以基金管理人的认可为准。

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12月26日起，至2019年1月28日17:00以前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，并请在信封表面注明：“天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

送达时间以基金管理人收到表决票时间为准，即：专人送达的以实际递交时间为准；快递送达的，以基金管理人签收时间为准；以邮寄挂号信方式送达的，以挂号信回执上注明的收件日期为送达日期。

本基金管理人的办公地址及联系方式如下：

基金管理人：天治基金管理有限公司

办公地址：上海市复兴西路159号

会务常设联系人：张亮

会务常设联系人电话：021-60374935

邮政编码：200031

4、投资者如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话400-098-4800咨询。

五、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（交通银行股份有限公司）授权代表的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。如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、本基金基金份额持有人的表决权

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

3、表决票效力的认定如下：

（1）表决票填写完整清晰，所提供文件符合本会议通知规定，且在截止时间之前送达指定联系地址的，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出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。如表决票上的表决意见未选、多选、模糊不清或相互矛盾的，视为弃权表决，但应当计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

（2）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指定联系地址的，均为无效表决票；无效表决票不计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

（3）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：

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，视为弃权表决票，但计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数；

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，邮寄的以本基金管理人收到的时间为准。

六、决议生效条件

1、本人直接出具表决意见和授权他人代表出具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总份额的二分之一（含二分之一）；

2、《关于天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金转型的议案》须经参加大会的基金份额持有人（或其代理人）所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过；

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，基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。法律法规另有规定的，从其规定。

七、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《基金法》和基金合同的规定，本次持有人大会需要有效表决票所代表的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（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够成功召开，根据《基金法》的有关规定，本基金管理人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本基金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本基金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：天治基金管理有限公司

持有人大会专线/客服电话：400-098-4800

会务常设联系人：张亮

会务常设联系人电话：021-60374935

传真：021-60374934

电子邮件：hanhan@chinanature.com.cn

网址：www.chinanature.com.cn

2、基金托管人：交通银行股份有限公司

3、公证机构：上海市东方公证处

联系人：林奇

联系方式：021-62178903

4、见证律师事务所：上海市通力律师事务所

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、若本次基金份额持有人大会审议的转型事项获表决通过并生效，则本基金基金合同将按照决议内容进行修订，本基金将转型为天治鑫利纯债债券型证券投资基金。

3、上述基金份额持有人大会有关公告可通过天治基金管理有限公司网站查阅，投资者如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话400-098-4800咨询。

4、本基金管理人将在发布本公告后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。

5、关于本次议案的说明见附件四《天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金转型方案说明书》。

6、本通知的有关内容由天治基金管理有限公司负责解释。

附件一：《关于天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金转型的议案》

附件二：《天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决票》

附件三：《授权委托书》（样本）

附件四：《天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金转型方案说明书》

天治基金管理有限公司

2018年12月25日

附件一：

关于天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金转型的议案

天治鑫利半年定期开放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，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《天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，基金管理人天治基金管理有限公司经与基金托管人交通银行股份有限公司协商一致，提议对天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金实施转型并修改《天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金基金合同》，具体内容详见附件四《天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金转型方案说明书》。

为实施本基金转型方案，提议授权基金管理人办理本次转型的相关具体事宜，包括但不限于根据市场情况确定转型的具体时间和方式，根据则时有效的法律法规的要求和《天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金转型方案说明书》的有关内容对《天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金基金合同》进行必要的修改和补充，并根据《天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金转型方案说明书》相关内容对本基金实施转型。

以上议案，请予审议。

天治基金管理有限公司

2018年12月25日

附件二：

天治鑫利半年定期开放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/营业执照）		基金账户号	
审议事项	同意	反对	弃权
关于天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金转型的议案			
基金份额持有人/受托人（代理人）签字或盖章 年 月 日			

说明：

1、请以打“√”方式在审议事项后注明表决意见。基金份额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填基金账户号的全部基金份额（以权益登记日所登记的基金份额为准）的表决意见。

2、表决意见未选、多选、模糊不清或相互矛盾的，视为弃权表决。

3、本表决票中“基金账户号”，指持有天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金的基金账户号。同一基金份额持有人拥有多个此类基金账户号且需要按照不同账户持有基金份额分别行使表决权的，应当填写基金账户号，其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的，将被默认为代表此基金份额持有人所持有的天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金所有份额。

（本表决票可剪报、复印或登录基金管理人网站（http://www.chinanature.com.cn/）下载并打印，在填写完整并签字盖章后均为有效。）

附件三：

授权委托书（样本）

兹委托_____代表本人（或本机构）参加投票截止日为2019年1月28日的以通讯方式召开的天治鑫利半年定期开放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。若天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金重新召开审议相同议案的基金份额持有人大会的，本授权继续有效。

委托人（签字/盖章）：_____

委托人证件号码（身份证件/营业执照）：_____

委托人基金账户号：_____

受托人（代理人）（签字/盖章）：_____

受托人（代理人）证件号码（身份证件/营业执照）：_____

委托日期： 年 月 日

授权委托书填写注意事项：

1、本授权委托书中“基金账户号”，指基金份额持有人持有天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金的基金账户号。同一基金份额持有人拥有多个此类基金账户号且需要按照不同账户持有基金份额分别行使表决权的，应当填写基金账户号，其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的，将被默认为代表此基金份额持有人所持有的天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金所有份额。

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：

天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金
转型方案说明书

一、声明

1、天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金基金合同于2016年12月7日生效。为更好地满足投资者需求，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》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《天治鑫利半年定期开放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，天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金基金管理人（天治基金管理有限公司）经与基金托管人（交通银行股份有限公司）协商一致，决定召开基金份额持有人大会，审议《关于天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金转型的议案》。

2、本次天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金转型事项属对基金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、本次天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金转型事项须经参加本次基金份额持有人大会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，存在无法获得基金份额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。

5、中国证监会对本次天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金变更注册所作的任何决定或意见，均不表明其对本次天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金的转型方案或变更注册后基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

二、天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金转型方案要点

转型方案的主要内容如下：

（一）更名

基金名称由“天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金”变更为“天治鑫利纯债债券型证券投资基金”（以下简称“本基金”）。

（二）运作方式

契约型开放式

（三）基金的投资

一、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券（包括国债、央行票据、金融债券、地方政府债券、企业债券、公司债券（含非公开发行公司债券）、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、次级债、证券公司发行的短期公司债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、中小企业私募债券等）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款等）、同业存单、货币市场工具、资产支持证券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）。

本基金不投资于股票、权证等资产。本基金通过可分离交易可转债认购所获得的认股权证，在其可上市交易后10个交易日内全部卖出。本基金所持可转换债券转股获得的股票在其可上市交易后的10个交易日内全部卖出。

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。

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%，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

二、投资策略

本基金充分发挥基金管理人的研究优势，对宏观经济运行趋势、财政以及货币政策变化趋势作出分析和判断，对未来市场利率趋势及市场信用环境变化作出预测，确定本基金债券组合久期、期限结构、债券类别配置策略，在严谨深入的分析和严格的风险控制基础上，综合考虑经济变量的变动对不同券种收益率、信用趋势和风险的潜在影响，深入挖掘价值被低估的标的券种。

（1）利率预期策略

债券积极投资策略的关键是对未来利率走向的预测。通过对利率的科学预测和对债券投资组合久期的正确把握，可以提高投资收益。

久期越长，利率变动所引起价格变化越大，久期越短，利率变动所引起价格变化越小。如果预计利率会下跌，债券价格会上涨，则应该加大长久期债券的比例，以实现收益的最大化。相反，如果预计利率会上涨，债券价格会下跌，则应该增加组合中久期较短债券的比例，以尽可能减少利率上涨带来的损失。

（2）收益率曲线配置策略

收益率曲线配置策略是根据对收益率曲线形状变动的预期建立或改变组合期限结构。要运用收益率曲线配置策略，必须先预测收益率曲线变动的方向，然后根据收益率曲线形状变动的情景分析，构建组合的期限结构。

（3）骑乘策略

骑乘策略是一种基于收益率曲线分析对债券组合进行适时调整的债券投资管理策略。该策略是指当收益率曲线比较陡峭时，即相邻期限利差较大时，可以买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券，也即收益率水平相对较高的债券，随着持有期限的延长，债券的剩余期限将会缩短，此时债券的收益率水平将会较投资期初有所下降，通过债券收益率的下滑来获得资本利得收益。

（4）信用债券投资策略

信用债市场整体的信用利差水平和信用债发行主体自身信用状况的变化都会对信用债个券的利差水平产生重要影响，因此，一方面，本基金将从经济周期、国家政策、行业景气度和债券市场的供求状况等多个方面考量信用利差的整体变化趋势；另一方面，本基金还将以内部信用评级为主、外部信用评级为辅，即采用内外结合的信用研究和评级制度，研究债券发行主体企业的基本面，以确定企业主体债的实际信用状况。具体而言，本基金的信用策略主要包括信用债券趋势判断、信用利差分析、持有期收益情景模拟和信用债券精选策略四个方面。本基金信用债券投资遵循以下流程：

① 信用债券趋势判断

本基金将通过着眼于经济走势、资金利率、信用债供求等影响信用债市场趋势的因素来分析未来一段时间内信用债市场中不同品种、不同信用等级债券的收益率变化情况，判断信用债走势。

② 信用利差分析

在信用债券趋势判断的基础上，本基金将进一步分析和判断信用利差未来可能发生的变化。其基本理念是，在历史利差经验数据的基础上，从上述影响因素入手，对比当前状况与历史情况，判断信用利差所处的位置以及合理位置，若最终分析结果认为利差将变动，则积极主动进行债券回购整组合，把握投资机会或规避损失。

③ 持有期收益情景模拟

持有期收益情景模拟是根据信用利差和基准利率的分析，假设数种可能发生的情景并赋予各个情景不同的收益率曲线形态和收益率变化，得出在不同情景下各类信用债的持有期收益，根据该模拟结果挑选较优的组合配置方案，为投资决策提供参考。

④ 信用债精选策略

本基金将借助公司内部的行业研究员的专业研究能力，并综合参考外部权威、专业研究机构的研究成果，采用定量分析与定性分析相结合的分析方法对发债主体企业进行深入的基本面分析，并结合债券的发行条款，确定信用债的实际信用风险状况及其信用利差水平，挖掘并投资于信用风险相对较低、信用利差收益相对较大的优质品种。定量分析主要用于分析财务状况、产销数据、融资能力等方面；定性分析主要用于分析行业前景、竞争地位、股东背景、管理能力、偿债支持等。

（5）息差策略

本基金利用回购等方式融入低成本资金，购买较高收益的债券，以期获取超额收益的操作方式。

（6）资产支持证券投资策略

资产支持证券主要包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等证券品种。本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

（7）中小企业私募债券投资策略

本基金对中小企业私募债券的投资主要围绕久期、流动性和信用风险三方面展开。久期控制方面，根据宏观经济运行状况的分析和预判，灵活调整组合的久期。信用风险控制方面，对个券信用资质进行详尽的分析，对企业性质、所处行业、增信措施以及经营情况进行综合考量，尽可能地避小信用风险暴露。流动性控制方面，要根据中小企业私募债券整体的流动性情况来调整持仓规模，在力求获取较高收益的同时确保整体组合的流动性安全。

三、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的比例不低于基金资产的80%；

（2）本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

（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%；

（6）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%；

（7）本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；

（8）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%；

（9）本基金应投资于信用级别评级为BBB以上（含BBB）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；

（10）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；

（11）本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过本基金资产净值的10%；

（12）本基金总资产不得超过基金净资产的140%；

（13）本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%；

（14）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合上述比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

（15）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本基金合同约定的投资范围保持一致；

（16）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。

除上述第（2）、（9）、（14）、（15）项另有约定外，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，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

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基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，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以变更后的规定为准。

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期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合本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原则，防范和克益冲突，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。

四、业绩比较基准

中证全债指数收益率

（四）收益分配原则

1、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

2、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

3、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；本基金同一基金份额类别内的每份基金份额享有同等分配权；

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

（五）赎回费率

本基金的赎回费率具体如下：

份额持有时间（Y）	赎回费率
Y＜7日	1.50%
7日≤Y＜30日	0.10%
Y≥30日	0.00%

（注：赎回份额持有时间的计算，以该份额在注册登记机构的登记日开始计算。）

本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，其中对持续持有期少于7日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产，对于持续持有期不少于7日的投资者收取的赎回费，不低于25%的部分归入基金财产。赎回份额持有时间的计算，以该份额在登记机构的登记日开始计算。

（六）授权基金管理人修订基金合同

除上述转型方案要点外，考虑到自天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金获批以来，《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法律法规颁布实施或陆续修改和基金托管人的情况变化，基金管理人需要根据现行有效的法律法规、监管机构要求、基金托管人信息更新及转型后的天治鑫利纯债债券型证券投资基金基金的产品特征修订《天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金基金合同》的相关内容，修订的内容请见附件《天治鑫利纯债债券型证券投资基金基金合同》修改对照表。

基金管理人拟提请基金份额持有人大会授权基金管理人修订《天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金基金合同》，并相应修改更新托管协议及招募说明书。

（七）转型选择期的相关安排

本次持有人大会决议生效后，天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金将安排不少于20个交易日的选择期。选择期期间，天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金将暂停申购业务，但赎回业务照常办理。基金份额持有人在天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金正式实施转型前可选择赎回，对于在选择期内未作出选择的基金份额持有人，其持有的天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金的基金份额将默认变更为天治鑫利纯债债券型证券投资基金的基金份额。在选择期期间，由于天治鑫利半年定期开放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天治鑫利半年定期开放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，以及根据实际情况暂停申购、赎回等。具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

（八）《天治鑫利纯债债券型证券投资基金基金合同》的生效

本次基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。自基金管理人届时公告的选择期到期，天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金正式实施转型之日起，修订后的《天治鑫利纯债债券型证券投资基金基金合同》生效，原《天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金基金合同》自同日起失效。

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和监管机构要求及《天治鑫利半年定期开放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并实施转型方案。

三、基金管理人就相关事项的说明

（一）天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金的历史沿革

天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金经中国证监会证监许可【2016】1652号文准予募集，自2016年11月1日起向社会公开募集，于2016年11月30日结束募集工作，并于2016年12月7日获得中国证监会的书面确认，《天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金基金合同》自该日起生效。

（二）基金转型有利于保护基金份额持有人利益

随着市场环境的变化，天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金的运作方式、投资范围、投资策略、投资比例限制等已不能很好地适应市场环境。本次基金转型后可以更好地满足投资者需求，并使基金法律文件符合现行法律法规与监管政策的要求，有利于维护基金份额持有人利益。

（三）基金转型的可行性

1、基金转型不存在法律障碍

《基金法》第四十七条规定，“基金份额持有人大会由全体基金份额持有人组成，行使下列职权：……（二）决定修改基金合同的重要内容……”。

《基金法》第八十六条规定，“……基金份额持有人大会就审议事项作出决定，应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的二分之一以上通过；但是，转换基金的运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、提前终止基金合同、与其他基金合并，应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上通过。基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报国务院证券监督管理机构备案，并予以公告。”

《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十八条规定，“……基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。……”

因此，天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金转型事项不存在法律方面的障碍。

2、基金转型不存在技术障碍

天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金转型为天治鑫利纯债债券型证券投资基金后，在技术系统运作上与基金管理人管理的其他同类基金并无明显差异，因而不存在技术操作上的障碍。

四、基金转型的主要风险及预备措施

（一）基金转型方案被基金份额持有人大会否决的风险

在设计转型方案之前，基金管理人已对基金份额持有人进行了走访，认真听取了相关意见，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，对基金转型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）基金转型后的运作风险

基金管理人将提前做好充分的内部沟通及外部沟通，避免基金转型后基金运作过程中出现相关操作风险、管理风险等运作风险。

五、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：

持有人大会专线/客服电话：400-098-4800

会务常设联系人：张亮

会务常设联系人电话：021-60374935

传真：021-60374934

电子邮件：hanhan@chinanature.com.cn

网址：www.chinanature.com.cn

附件：《天治鑫利纯债债券型证券投资基金基金合同》修改对照表附件：

《天治鑫利纯债债券型证券投资基金基金合同》修改对照表

章节	原文	修订后内容
第一部分 前言	三、天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证监会监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)注册。 中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值、市场前景和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。	三、天治鑫利纯债债券型证券投资基金（以下简称“基金”或“本基金”）由天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金转型而来，天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)注册。 中国证监会对天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金募集的注册及对天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金转型为本基金的变更注册，并不表明其对本基金的投资价值、市场前景和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。
第二部分 释义	1、基金或本基金：指天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金 4、基金合同或本基金合同：指《天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充 6、招募说明书：指《天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新 7、基金份额发售公告：指《天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金基金份额发售公告》 15、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会 27、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户 28、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期 30、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月 31、定期开放：指本基金采取的在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作模式 32、封闭期：本基金的封闭期为自基金合同生效之日起（包括基金合同生效之日）或自每一开放期结束之日次日起（包括该日）6个月的期间。本基金的第一个封闭期为自基金合同生效之日起6个月。下一个封闭期为首个开放期结束之日次日起的6个月，以此类推。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易 33、开放期：本基金办理申购与赎回业务的开放期为本基金每个封闭期结束之后第一个工作日起不少于5个工作日并且最长不超过15个工作日的期间。开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准。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 34、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限 41、认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为 47、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一工作日基金总份额的20% 54、A类基金份额：指在投资人认购/申购时收取前端认购/申购费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，不收取销售服务费的基金份额 55、C类基金份额：指在投资人认购/申购时不收取前端认购/申购费，而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额 54、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等	1、基金或本基金：指天治鑫利纯债债券型证券投资基金，由天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金转型而来 4、基金合同或本基金合同：指《天治鑫利纯债债券型证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《天治鑫利纯债债券型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充 6、招募说明书：指《天治鑫利纯债债券型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新 14、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会 26、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户 27、基金合同生效日：指《天治鑫利纯债债券型证券投资基金基金合同》生效日，原《天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金基金合同》自同一日失效 29、存续期：指《天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金基金合同》生效至《天治鑫利纯债债券型证券投资基金基金合同》终止之间的不定期期限 30、基金转型：指对包括天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金调整运作方式、投资范围、投资策略、投资限制、业绩比较基准、收益分配原则、修订基金合同并更名为“天治鑫利纯债债券型证券投资基金”等一