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书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.基金运行方式: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1结束的年份进行的份额折算。年度份额折算是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按四舍五入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,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机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份额的约定收益,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;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均应调整。

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。

10.基金份额参考净值:截至2014年8月18日,本基金的基金份额参考净值为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(遇节假日顺延)

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、中银万国证券、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、方正证券、广发证券、天风证券、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,基金注册登记机构已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44.50%;个人投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44.50%;个人投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	刘荣芳	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	王广辉	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21亿元

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:100000400000761

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:营销

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、基金财务部、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:负责对公司日常管理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:

联系电话:(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.本基金基金经理办个

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,曾任职于投资银行部、证券研究所、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)66220150

传真:(010)66220151

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:王国容、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未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、完整和及时地按篇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.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中请查阅以下文件:

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,应星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;

(8)选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;

(16)在符合有关法律、法规的前提下,制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则;

(17)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2.根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的义务包括但不限于:

(1)依法募集基金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;

(2)办理基金备案手续;

(3)自《基金合同》生效之日起,以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产;

(4)配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;

(5)建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;

(6)除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;

(7)依法接受基金托管人的监督;

(8)采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回的价格;

(9)进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

(10)编制季度、半年度和年度基金报告;

(11)严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;

(12)保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基法法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不向他人泄露;

(13)按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配基金收益;

(14)按规定受理申购与赎回申请,及时、足额支付赎回款项;

(15)依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;

(16)按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上;

(17)确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出,并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件;

(18)组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

(19)面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;

(20)因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

(21)监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时,基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;

(22)当基金管理人将其义务委托第三方处理有关基金事务的行为承担责任;

(23)以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;

(24)基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件,《基金合同》不能生效,基金管理人承担全部募集费用,将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人;

(25)执行生效的基金份额持有人大会的决议;

(26)建立并保存基金份额持有人名册;

(27)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

3.根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基托管人的权利包括但不限于:

(1)自《基金合同》生效之日起,依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产;

(2)依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用;

(3)监督基金管理人对本基金的投资运作,如发现基金管理人有违反《基金合同》及国家法律法规行为,对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形,应呈报中国证监会,并采取必要措施保护基金投资者的利益;

(4)根据相关市场规则,为基金开设证券账户,为基金办理证券交易资金清算。

(5)提议召开或召集基金份额持有人大会;

(6)在基金管理人更换时,提名新的基金管理人;

(7)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

4.根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金托管人的义务包括但不限于:

(1)以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产;

(2)设立专门的基金托管部门,具有符合要求的营业场所,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;

(3)建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,确保基金财产的安全,保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立;对所托管的不同的基金分别设置账户,独立核算,分账管理,保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立;

(4)除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;

(5)保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证;

(6)按规定开设基金财产的资金账户和证券账户,按照《基金合同》的约定,根据基金管理人的投资指令,及时办理清算、交割事宜;

(7)保守基金商业秘密,除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前予以保密,不得向他人泄露;

(8)复核、审查基金管理人计算的基金资产净值,包括招商可转债份额的基金份额净值、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)办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;

(10)对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见,说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行;如果基金管理人有未执行《基金合同》规定的行为,还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施;

(11)保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料15年以上;

(12)建立并保存基金份额持有人名册;

(13)按规定制作相关账册并为基金管理人核对;

(14)依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项;

(15)依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定,召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;

(16)按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作;

(17)参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

(18)面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会和银行监管机构,并通知基金管理人;

(19)因违反《基金合同》导致基金财产损失时,应承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

(20)按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时,应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿;

(21)执行生效的基金份额持有人大会的决议;

(22)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

5.根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的权利包括但不限于:

(1)分享基金财产收益;

(2)参与分配清算后的剩余基金财产;

(3)依照法律法规及基金合同的规定,依法转让其持有的招商转债A份额与招商转债B份额,依法转让或者申请赎回其持有的招商可转债份额;

(4)按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会;

(5)出席或者委派代表出席基金份额持有人大会,对基金份额持有人大会审议事项行使表决权;

(6)查阅或者复制公开披露的基金信息资料;

(7)监督基金管理人的投资运作;

(8)对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁;

(9)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

6.根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的义务包括但不限于:

(1)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(二)基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

1.基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。基金份额持有人大会的审议事项应分别由招商可转债份额、招商转债A份额与招商转债B份额的基金份额持有人独立进行表决。基金份额持有人持有的每一基金份额在其对应的份额级别内拥有平等的投票权。

2.当出现或需要决定下列事由之一的,应当召开基金份额持有人大会:

(1)终止《基金合同》;