招商基金管理有限公司关于以通讯方式二次召开招商 MSCI 中国 A 股国际通指数型证券投资基金基金份额持有人大会的公告

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”)曾于 2020 年 6 月 12 日起至 2020 年 7 月 17 日 17:00 止,以通讯方式召开招商 MSCI 中国 A 股国际通指数型证券投资基金(以下称“本基金”)基金份额持有人大会(以下简称“一次大会”)。因参加该次基金份额持有人大会表决的基金份额未达到权益登记日本基金总份额的 50%以上(含 50%),而未达到法定的会议召开条件,故该次基金份额持有人大会召集失败。基金管理人已于 2020 年 7 月 21 日发布了《关于招商 MSCI 中国 A 股国际通指数型证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告》就上述事项予以公告。

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 MSCI 中国 A 股国际通指数型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”或“基金合同”)的约定,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,决定以通讯方式二次召开本基金的基金份额持有人大会,审议《关于招商 MSCI 中国 A 股国际通指数型证券投资基金修改基金合同有关事项的议案》,权益登记日仍为 2020 年 6 月 12 日。

1、会议召开方式:通讯方式。

2、会议投票表决起止时间:自 2020 年 10 月 21 日 0:00 起,至 2020 年 11 月 20 日 17:00 止(以表决票收件人收到表决票时间为准)。

3、通讯表决票及授权委托书等文件寄送至如下地址:

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:深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 23 层

邮政编码:518040

联系电话:0755-83199596

请在信封表面注明:“招商 MSCI 中国 A 股国际通指数型证券投资基金基金份额持有人大会(二次召开)表决专用”

二、会议审议事项

本次持有人大会审议的事项为《关于招商 MSCI 中国 A 股国际通指数型证券投资基金修改基金合同有关事项的议案》(以下称“《议案》”),《议案》详见附件一。

三、权益登记日

本次二次召开基金份额持有人大会的权益登记日仍为 2020 年 6 月 12 日,即在 2020 年 6 月 12 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(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征集信函授权基金管理人、基金托管人或非直销销售机构投票的,接受有效委托的基金管理人、基金托管人或非直销销售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 2020 年 10 月 21 日 0:00 起至 2020 年 11 月 20 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(深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 23 层),并请在信封表面注明:“招商 MSCI 中国 A 股国际通指数型证券投资基金基金份额持有人大会(二次召开)表决专用”。

五、授权

1、纸面方式授权

(1)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)。

(2)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。

(3)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)。

2、网络授权(仅适用于个人投资者)

为方便基金份额持有人参与基金份额持有人大会投票,基金管理人提供官方微信(微信公众号:招商基金),官方 APP(APP 名称:招商基金),官方网站(www.cmfchina.com)和短信链接等通道供个人投资者进行授权,由基金管理人根据授权人的表决意见代为行使表决权。

网络授权的起止时间自 2020 年 10 月 21 日 0:00 起至 2020 年 11 月 19 日 15:00 止(授权时间以系统记录时间为准)。通过网络进行授权的基金份额持有人,应正确填写姓名、证件号码等信息,以核实基金份额持有人的身份,确保基金份额持有人权益。

基金份额持有人通过上述网络渠道进行授权的方式仅适用于个人投资者,对机构投资者暂不开通。

3、电话授权(仅适用于个人投资者)

为方便基金份额持有人参与本次基金份额持有人大会投票,基金管理人开设录音电话授权方式,基金管理人和部分销售机构可通过各自的客服代表与基金份额持有人取得联系,在通话过程中以回答身份验证问题的方式核实持有人身份并由客服代表根据客户意愿进行授权记录从而完成授权,由基金管理人根据授权人的表决意见代为行使表决权。为保护基金份额持有人的利益,整个通话过程将被录音。

电话授权的起止时间自 2020 年 10 月 21 日 0:00 起至 2020 年 11 月 19 日 15:00 止(授权时间以系统记录的电话授权时间为准),敬请投资者注意。

基金份额持有人通过电话授权的方式仅适用于个人投资者,对机构投资者暂不开通。

4、授权效力的确定原则

(1)直接表决优先规则

如果基金份额持有人进行了授权委托,又存在有效的直接投票表决,则以直接表决为有效表决,授权委托无效。

(2)最后授权优先规则

如果同一基金份额持有人在不同时间多次进行有效授权,无论表决意见是否相同,均以最后一次授权为准。如最后时间收到的授权委托有多次,不能确定最后一次授权的,按以下原则处理:若多次授权的表决意见一致的,按照该表决意见计票;若多次授权但授权意见不一致的,视为委托人授权受托人弃权票。

5、在本次二次召开的基金份额持有人大会中,除非授权文件另有载明,在一次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。

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,在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下进行计票,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地址,表决时间以收件人收到时间为准。2020 年 11 月 20 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。

5)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席其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三分之一(含三分之一);

2、《议案》应当出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 50%以上(含 50%)通过;

3、本基金份额持有人大会决议自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、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:赖思斯

联系电话:(0755)83199596

邮政编码:518040

网址: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

九、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(www.cmfchina.com)查阅,投资者如有任何疑问,可致电 400-887-9555 咨询。

附件一:《关于招商 MSCI 中国 A 股国际通指数型证券投资基金修改基金合同有关事项的议案》

附件二:招商 MSCI 中国 A 股国际通指数型证券投资基金修改基金合同方案说明书

附件三:授权委托书(样本)

附件四:招商 MSCI 中国 A 股国际通指数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
2020 年 10 月 21 日

附件一:

关于招商 MSCI 中国 A 股国际通指数型证券投资基金修改基金合同有关事项的议案

招商 MSCI 中国 A 股国际通指数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 MSCI 中国 A 股国际通指数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,审议招商 MSCI 中国 A 股国际通指数型证券投资基金修改基金合同有关事项。

为实施招商 MSCI 中国 A 股国际通指数型证券投资基金上述修改基金合同方案,提议授权基金管理人办理本次基金合同修改的有关具体事宜,包括但不限于根据市场情况确定变更的具体时间和方式、根据现时有效的法律法规的要求和《招商 MSCI 中国 A 股国际通指数型证券投资基金修改基金合同方案说明书》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
2020 年 10 月 21 日

附件二:

招商 MSCI 中国 A 股国际通指数型证券投资基金
修改基金合同方案说明书

一、声明

1、招商 MSCI 中国 A 股国际通指数型证券投资基金成立于 2018 年 4 月 13 日,基金托管人为中国银行股份有限公司。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 MSCI 中国 A 股国际通指数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,决定召开基金份额持有人大会,审议招商 MSCI 中国 A 股国际通指数型证券投资基金基金合同有关事项。

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 50%以上(含 50%)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,本基金管理人将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、修改基金合同方案要点

(一)变更基金名称

基金名称由“招商 MSCI 中国 A 股国际通指数型证券投资基金”变更为“招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金”。

(二)调整基金投资范围

调整后的基金投资范围为:

“本基金主要投资于目标 ETF、标的指数成份股、备选成份股。

为更好地实现基金的投资目标,本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非成份股(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许投资的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他中国证监会允许投资的债券)、货币市场工具、同业存单、债券回购、资产支持证券、银行存款、股指期货、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(但须符合中国证监的相关规定)。

本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。

基金的投资组合比例为:投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%,每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或者到期日在一年以内的政府债券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。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或变更投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以相应调整本基金的投资范围和投资比例规定。”

(三)调整投资策略

调整后的基金投资策略为:

“本基金为目标 ETF 的联接基金,以目标 ETF 作为主要投资标的,方便投资人通过本基金投资目标 ETF,本基金并不参与目标 ETF 的管理。

1、资产配置策略

本基金主要投资于目标 ETF、标的指数成份股、备选成份股,其中,投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%。为更好地实现基金的投资目标,本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非成份股(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许投资的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他中国证监会允许投资的债券)、货币市场工具、同业存单、债券回购、资产支持证券、银行存款、股指期货、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(但须符合中国证监的相关规定)。

本基金将根据市场的实际情况,适当调整基金资产在各类资产上的配置比例,以保证对标的指数的有效跟踪。

在正常市场情况下,本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%,年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

2、目标 ETF 投资策略

(1)基金组合构建原则

本基金主要投资于其指定的目标 ETF。

(2)基金组合的构建方法

在基金合同生效后,本基金将通过以下两种方式构建基金组合,使得投资于目标 ETF 的资产占基金资产净值的比例不低于 90%。

1)按照目标 ETF 法律文件约定的方式申赎目标 ETF;

2)在二级市场上买卖本基金的目标 ETF,本基金的基金管理人在二级市场上买卖目标 ETF 基金份额是出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的。

(3)日常组合调整

在基金的日常投资过程中,本基金将按照目标 ETF 法律文件约定的方式申购、赎回目标 ETF 的基金份额,实现指数化投资。根据市场情况,本基金亦可通过二级市场在在证券交易所买入、卖出目标 ETF 基金份额。两种投资方式主要根据交易成本、市场流动性以及价格的优势决定。

3、股票投资策略

本基金对于标的指数成份股和备选成份股部分的投资,主要采用被动式指数化投资的方法进行日常管理。

4、债券(不含可转换债券、可交换债券)投资策略

本基金的债券资产投资主要以长期利率趋势分析为基础,结合中短期的经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析,并根据对个券相对价值的比较,进行个券选择和配置。债券投资的主要目的是保证基金资产的流动性,有效利用基金资产。

5、可转换债券和可交换债券投资策略

可转换债券和可交换债券投资是基于对宏观经济形势、国家财政政策、货币政策深入分析的基础上,对各类市场大势做出判断的前提下,一方面对可转换债券和可交换债券所对应的基础股票进行分析和研究,对盈利能力较强或成长性较好的行业和上市公司的可转债进行重点关注,另一方面,应用招商基金可转换债券和可交换债券评价体系,定量分析和定性分析相结合,选择具有较高投资价值的可转换债券和可交换债券进行投资,主要包括:基于二叉树模型的可转换债券和可交换债券价值分析、可转换债券和可交换债券的债 / 股性和隐含波动率分析、对可转换债券和可交换债券条款的定性分析等。

(1)基础股票分析.在当前的市场中,可转换债券和可交换债券投资获利的根本在于股价上涨带动债券价格上涨,正股是决定可转换债券和可交换债券投资价值的最主要因素。本基金管理人将充分利用招商基金的投资平台和股票估值体系,从宏观环境大势确定未来经济运行态势,进而分析和预测股票市场的整体走势,并确定当前经济发展阶段所对应股票市场各行业的表现,从而确定行业层面上的选择顺序,进而通过个股基本面研究,选择盈利能力及成长性较强的行业和上市公司发行的可转债。

(2)基于二叉树模型的可转换债券和可交换债券价值分析。基金管理人运用二叉树定价模型对可转换债券和可交换债券进行价值分析,即运用股价运动的二叉树数值来解方法对可转换债券和可交换债券的定价影响因素进行分析,以确认不同因素对可转换债券和可交换债券价值的影响程度,从而确定可转换债券和可交换债券不同阶段的理论价格,结合定价模型、市场定性分析和定量比较分析,充分考虑市场各时期的特征,合理地给出可转换债券和可交换债券的估值。

(3)可转换债券和可交换债券债性 / 股性的相对价值分析及隐含波动率分析。可转换债券和可交换债券兼具股性和债性,在不同市场环境下呈现出债性偏强、股性偏强、股债性平衡的特点。本基金优先投资于股性偏强的可转换债券和可交换债券。

(4)可转换债券和可交换债券条款分析。可转换债券和可交换债券通常附有赎回、回售、转股价修正等条款,其中赎回条款是发行人促进转债转股的重要手段,而回售、转股价修正条款是对转债投资者的保护性条款。这些条款在特定环境下对可转换债券和可交换债券价值有着较大的影响。招商基金利用可转换债券和可交换债券条款分析模板对债券条款进行跟踪,根据标的公司当前经营状况和未来发展战略,以及公司的财务状况和融资需求,对发行人的促进转股能力和促进转股意愿进行分析,把握可能的投资机会。

6、资产支持证券投资策略

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、股指期货投资策略

本基金将遵循有效管理原则经充分论证后适度运用股指期货,通过对股票现货和股指期货市场运行趋势的研究,采用估值合理、流动性好、交易活跃的期货合约,对本基金投资组合进行及时、有效地调整和优化,提高投资组合的运作效率。

8、国债期货投资策略

为有效控制债券投资的系统性风险,本基金根据风险管理的原则,以套期保值为目的,适度运用国债期货,提高投资组合的运作效率。在国债期货投资时,本基金将首先分析国债期货各合约价格与最便宜可交割券的关系,选择定价合理的国债期货合约,其次,考虑国债期货各合约的流动性情况,最终确定与现货组合的合适匹配,以达到风险管理的目标。

9、融资及转融通投资策略

为更好地实现投资目标,在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下,本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场情况、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上,合理确定出借证券的范围、期限和比例。”

(四)调整基金投资限制

调整后的基金投资限制为:

“基金的投资组合应遵循以下限制:

(1)本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%;

(2)每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等;

(3)本基金投资于资产支持证券的投资限制如下:

1)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%;

2)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%;

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

4)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%;

5)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;

(4)基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过本基金的总资产,本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

(5)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%,本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年,债券回购到期后不得展期;

(6)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;

(7)本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%;

(8)本基金投资于股指期货,遵守以下投资限制:

1)本基金在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值,不得超过基金资产净值的 10%;在任何交易日日终,持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的 100%,其中,有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;

2)本基金在任何交易日日终,持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%;

3)本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定;

4)本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%;

(9)本基金投资于国债期货,遵守以下投资限制:

1)本基金在任何交易日日终,持有的买入国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的 15%;在任何交易日日终,持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的 100%,其中,有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;

2)本基金在任何交易日日终,持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%;

3)本基金所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买入、卖出国债期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定;

4)本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%;

(10)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、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该比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

(11)本基金参与融资的,每个交易日日终,本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的 95%;

(12)本基金参与转融通证券出借业务,出借证券资产不得超过基金资产净值的 30%,出借期限在 10 个交易日以上的出借证券应纳入《流动性风险管理规定》所述流动性受限证券的范围;参与出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的 50%; 最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元;证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天,平均剩余期限按照市值加权平均计算;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不符合本条上述规定的,基金管理人不得新增出借业务;

(13)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比例限制。

除上述第(2)、(6)、(10)、(12)项和第(3)项第 5)目另有约定外,因证券 / 期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、目标 ETF 暂停申购、赎回或二级市场交易停牌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,基金管理人应当在相关证券可交易的 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本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。”

(五)调整基金费用

调整后基金费用如下:

“一、基金费用的种类

1、基金管理人的管理费;

2、基金托管人的托管费;

3、C 类基金份额的基金销售服务费;

4、除法律法规、中国证监会另有规定外、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费;

6、基金份额持有人大会费用;

7、基金的证券、期货交易费用;

8、基金的银行汇划费用;

9、基金相关账户的开户及维护费用;

10、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

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

本基金基金财产中扣除了目标 ETF 部分的基金资产净值不收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额所对应基金资产净值后的余额(若为负数,则取 0)的 0.50%的年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.50%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额所对应基金资产净值后的余额(若为负数,则取 0)

基金管理费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金基金财产中扣除了目标 ETF 部分的基金资产净值不收取托管费。本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额所对应基金资产净值后的余额(若为负数,则取 0)的 0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.10%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额所对应基金资产净值后的余额(若为负数,则取 0)

基金托管费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

3、C 类基金份额的基金销售服务费

销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金份额分为不同的类别,其中,A 类基金份额不收取销售服务费,C 类基金份额销售服务费年费率为 0.5%。

销售服务费计算方法如下:

H=E×R÷当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

R 为 C 类基金份额适用的销售服务费率

销售服务费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起第 2-5 个工作日内从基金财产中划出,经基金管理人分别支付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、公休日等、支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类”中第 4—10 项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。”

(六)其他

根据现行有效的法律法规以及基金管理人、基金托管人的最新信息对《招商 MSCI 中国 A 股国际通指数型证券投资基金基金合同》中的其他相关条款进行了修改和补充。原招商 MSCI 中国 A 股国际通指数型证券投资基金 A 类基金份额转为招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金 A 类基金份额,原招商 MSCI 中国 A 股国际通指数型证券投资基金 C 类基金份额转为招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金 C 类基金份额。

本议案如获得基金份额持有人大会审议通过,基金管理人将根据基金份额持有人大会决议对《招商 MSCI 中国 A 股国际通指数型证券投资基金基金合同》进行修改,并可在不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下,对《招商 MSCI 中国 A 股国际通指数型证券投资基金基金合同》进行其他修改或必要补充。招商 MSCI 中国 A 股国际通指数型证券投资基金的托管协议、招募说明书也将进行必要的修改或补充。

《基金合同》的具体修改内容见本说明书之附件:《基金合同修订对照表》。

三、《招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金合同》的生效

本次基金份额持有人大会决议自通过之日起生效。《招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金合同》于本次会议决议生效日的同日生效,原《招商 MSCI 中国 A 股国际通指数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的规定及《招商 MSCI 中国 A 股国际通指数型证券投资基金修改基金合同方案说明书》以上要点修订基金合同并实施变更方案。

四、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

附:《基金合同修订对照表》

章节	原《招商 MSCI 中国 A 股国际通指数型证券投资基金基金合同》条款	拟修订后《招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》条款
	内容	内容
基金名称	招商 MSCI 中国 A 股国际通指数型证券投资基金	招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金
全文	指定报刊	规定报刊
	指定媒介	规定媒介
	指定网站	规定网站
第一部分 前言	一、订立本基金合同的目的、依据和原则 2、……《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》以上简称“《流动性风险规定》”)和其他有关法律法规。	一、订立本基金合同的目的、依据和原则 2、……《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)和其他有关法律法规。
	三、招商 MSCI 中国 A 股国际通指数型证券投资基金电基金管理人依照《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。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。投资者应当认真阅读基金招募说明书。基金合同等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,自行承担投资风险。	三、招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金由招商 MSCI 中国 A 股国际通指数型证券投资基金变更而来。招商 MSCI 中国 A 股国际通指数型证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、《招商 MSCI 中国 A 股国际通指数型证券投资基金基金合同》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,其变更为本基金已经中国证监会变更注册。中国证监会对招商 MSCI 中国 A 股国际通指数型证券投资基金变更为本基金的注册审查以要件齐备和内容合规为基础,以充分的信息披露和投资者利益保护和防范系统性风险为目标。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。投资者应当认真阅读基金招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,自行承担投资风险。
	无	六、本基金合同约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求,自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。
	1、基金或本基金:指招商 MSCI 中国 A 股国际通指数型证券投资基金	1、基金或本基金:指招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金,本基金由招商 MSCI 中国 A 股国际通指数型证券投资基金变更而来
	6、招募说明书:指《招商 MSCI 中国 A 股国际通指数型证券投资基金招募说明书》及其定期更新	6、招募说明书:指《招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》及其更新
	7、基金份额发售公告:指《招商 MSCI 中国 A 股国际通指数型证券投资基金基金份额发售公告》	删除
	无	7、基金产品资料概要:《招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金产品资料概要》及其更新
	9、《基金法》:指 2012 年 12 月 28 日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议通过,自 2013 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订 11、《信息披露办法》:指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订 13、《流动性风险规定》:指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年