(上接 D30 版)

①成长速度分析:本基金将在企业历史成长性分析的基础上,选取未来具有良好成长预期的上市公司股票进行投资,所采用的指标包括过去二年主营业务收入平均增长率、过去二年净利润平均增长率、未来二年主营业务复合预期增长率和未来二年净利润复合预期增长率等。

②成长效率分析:本基金将透过企业的业务、规模及其盈利增长的表象,选用净资产收益率(ROE)和投资回报率(ROIC)等指标,考察企业的成长效率。

③品质筛选:本基金将重点投资具有以下品质的优质成长性公司:

A、拥有成熟、实用的商业模式,所提供的产品或服务具有广阔的市场前景;

B、拥有独特的资源,如特许权、专有技术、品牌、网络等;

C、主营业务竞争力突出,具备通过内生增长或低成本外延扩张实现跨越式发展的素质与综合潜力;

D、注重创新,并通过创新引导、创造新的市场需求;

E、企业经营稳定、理性,具有完善的公司治理结构,注重股东利益保护;

F、财务稳健、现金流充沛。

在筛选优质成长企业过程中,全面的公司基本面分析将贯穿其中。公司基本面分析的主要内容包括价值评估、成长性评估、现金流预测和行业环境评估等。分析师从定性和定量两个方面考量行业竞争趋势、公司的竞争地位、短期和长期内公司现金流增长的主要驱动因素、业务发展的关键点以及公司治理结构状况。分析师要说明做出财务预测(包括 GEVS 模型输入变量)的重要假设条件,并评估这些假设的可靠性,对公司基本面状况做出明确的定性判断和定量研究,给出明确的公司评价和投资建议。

(2)本基金借鉴 GEVS,以合适方法估计股票投资价值

GEVS 是 UBS Global AM(瑞士银行环球资产管理公司)在全球使用了 20 多年的权益估值模型。模型分阶段考量现金流量增长率,得到各阶段现金流的现值总和,即股票的内在价值。市场价格与内在价值的差幅是基金买入或沽出股票的主要参考依据。本基金在借鉴 GEVS 方法的同时,还将考虑中国股票市场特点和某些行业或公司的具体情况。在实践中,现金流量贴现模型可能有应用效果不理想的情形,为此,我们不排斥选用其它合适的估值方法,如 P/E、P/B、EV/EBITA 等方法。

(3)构建(及调整)模拟组合

股票策略组借鉴 UBS Global AM(瑞士银行环球资产管理公司)全球股票研究经验,评估股票投资价值,考量分析师最有价值的研究成果,在充分评估风险的基础上,构建(及调整)股票模拟组合。

(4)风险管理与归因分析

在形成可执行组合之前,模拟组合需经风险考量和风险调整。本基金管理人借鉴 UBS Global AM(瑞士银行环球资产管理公司)的 GRS 等风险管理系统技术,对模拟组合(事前)和实际投资组合(事后)进行风险评估、绩效与归因分析,从而确定可执行组合以及组合调整策略。

3、债券投资管理

本基金借鉴 UBS Global AM(瑞士银行环球资产管理公司)固定收益组合的管理方法,采取“自上而下”的债券分析方法,确定债券模拟组合,并管理组合风险。

(1)评估债券价值

债券基本价值评估的主要依据是均衡收益率曲线(Equilibrium Yield Curves)。

均衡收益率曲线是所有相关的风险都得到补偿时,收益率曲线的合理位置。风险补偿包括四个方面:资金的时间价值(补偿)、通货膨胀补偿、期限补偿、流动性及信用风险补偿。

本基金基于均衡收益率曲线,计算不同债券资产类别、不同剩余期限配置的预期超额回报,并对预期超额回报进行排序,得到投资评级。

(2)选择投资策略

债券投资策略主要包括:久期策略、收益率曲线策略、类别选择策略和个券选择策略。在不同时期,以上策略对组合收益和风险的贡献不尽相同,具体采用何种策略,取决于债券组合允许的风险程度。

(3)构建(及调整)债券组合

债券策略组将借鉴 UBS Global AM(瑞士银行环球资产管理公司)债券研究方法,凭借各成员债券投资管理经验,评估债券价格与内在价值偏离幅度是否可靠,据此构建债券模拟组合。

债券策略组每周开会讨论及调整债券模拟组合,买入低估债券,卖出高估债券。同时从风险管理的角度,评估调整对组合久期、类别权重等的影响。

(4)风险管理与归因分析

本基金管理人借鉴 UBS Global AM(瑞士银行环球资产管理公司)的风险管理系统中的全球风险管理系统(GRS)方法管理债券组合风险。GRS 方法关注组合风险来源,包括久期、剩余期限、汇率和信用特征。把组合总体风险分解为市场风险、发行人特定风险和汇率风险等。

4、权证投资策略

(1)考量标的股票合理价值、标的股票价格、行权价格、行权时间、行权方式、股价历史与预期波动率和无风险收益率等要素,估计权证合理价值。

(2)根据权证合理价值与其市场价格间的差幅即“估值差价(Value Price)”以及权证合理价值对定价参数的敏感性,结合标的股票合理价值考量,决策买入、持有或沽出权证。

九、基金的业绩比较基准

衡量本基金投资业绩的比较基准(R)是:

R=中信标普 300 指数×80%+中信标普全债指数×20%

本基金属于股票型基金。在实际投资运作中,本基金将维持较高的股票投资比例,即股票资产在基金资产中的占比将以基金股票配置比例范围 60–95%的中间值,即约 80%为基准,根据股票、债券等类别资产的预期风险与预期收益的综合比较与判断进行调整,为此,综合基金资产配置与市场指数代表性等因素,本基金选用市场代表性较好的中信标普 300 指数和中信标普全债指数加权作为本基金的投资业绩评价基准。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时,基金管理人和基金托管人协商一致并履行相关程序后,可以变更业绩比较基准并及时公告。

十、基金的风险收益特征

本基金为股票型基金,属于高风险、高收益的基金品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

十一、基金的投资组合报告

本投资组合报告所载数据截至 2010 年 12 月 31 日,本报告中所列财务数据未经审计。

1、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	2,421,933,723.55	76.27
	其中:股票	2,421,933,723.55	76.27
2	固定收益投资	151,898,769.70	4.78
	其中:债券	151,898,769.70	4.78
	资产支持证券	–	–
3	金融衍生品投资	–	–
4	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
5	银行存款和结算备付金合计	594,706,509.93	18.73
6	其他资产	6,885,973.92	0.22
7	合计	3,175,424,977.10	100.00

2、按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采掘业	85,960,000.00	2.73
C	制造业	1,672,981,000.04	53.13
C0	食品、饮料	238,367,032.92	7.57
C1	纺织、服装、皮毛	84,267,000.29	2.68
C2	木材、家具	45,708,479.13	1.45
C3	造纸、印刷	–	–
C4	石油、化学、塑胶、塑料	230,559,694.39	7.32
C5	电子	88,037,655.48	2.80
C6	金属、非金属	183,128,919.47	5.82
C7	机械、设备、仪表	407,854,193.59	12.95
C8	医药、生物制品	309,108,107.31	9.82
C99	其他制造业	85,949,917.46	2.73
D	电力、煤气及水的生产和供应业	–	–
E	建筑业	13,681,149.93	0.43
F	交通运输、仓储业	–	–
G	信息技术业	76,061,164.00	2.42
H	批发和零售贸易	288,303,963.26	9.16
I	金融、保险业	112,974,000.00	3.59
J	房地产业	157,987,445.32	5.02
K	社会服务业	13,985,001.00	0.44
L	传播与文化产业	–	–
M	综合类	–	–
	合计	2,421,933,723.55	76.92

3、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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000513	丽珠集团	2,661,808	116,640,426.56	3.70
2	002028	思源电气	4,266,307	112,075,884.89	3.56
3	000039	中集集团	4,500,000	103,455,000.00	3.29
4	000028	一致药业	2,900,000	95,700,000.00	3.04
5	600327	大厦股份	7,445,931	89,276,712.69	2.84
6	601318	中国平安	1,400,000	78,624,000.00	2.50
7	600887	伊利股份	1,999,945	76,517,895.70	2.43
8	002206	海 利 得	3,515,232	76,456,296.00	2.43
9	600724	宁波富达	12,954,304	76,430,393.60	2.43
10	000568	泸州老窖	1,849,898	75,660,828.20	2.40

4、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	–	–
2	央行票据	149,380,000.00	4.74
3	金融债券	–	–
	其中:政策性金融债	–	–
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	可转债	2,518,769.70	0.08
7	其他	–	–
8	合计	151,898,769.70	4.82

5、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	0801056	08央行票据 56	500,000	50,225,000.00	1.60
2	0801053	08央行票据 53	500,000	50,215,000.00	1.59
3	1001015	10央行票据 15	500,000	48,940,000.00	1.55
4	126729	燕京转债	18,670	2,518,769.70	0.08

6、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。

7、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资产。

8、投资组合报告附注

(1)报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

(2)基金投资的前十名股票中,均属于基金合同规定备选股票库之内的股票。

(3)其他资产的构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,837,367.89
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	3,817,145.40
5	应收申购款	231,460.63
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	6,885,973.92

(4)持有的处于转股期的可转换债券明细。

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5)前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

(6)其他需说明的重要事项

本基金本期未投资托管行股票、未投资控股股东主承销的证券,未从二级市场主动投资分离交易可转债附送的权证,投资流通受限证券未违反相关法规或本基金管理公司的规定。

十二、基金的业绩

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,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

基金净值表现详见下表:

国投瑞银成长优选股票型证券投资基金历史各时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表(截止 2010 年 12 月 31 日)

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①–③	②–④
2008.01.10(基金合同生效日)至 2008.12.31	–46.46%	1.97%	–56.69%	2.41%	10.23%	–0.44%
2009.01.01 至 2009.12.31	83.45%	1.66%	72.12%	1.63%	11.33%	0.03%
2010.01.01 至 2010.12.31	3.43%	1.24%	–8.18%	1.26%	11.61%	–0.02%
自基金合同生效至今	1.59%	1.66%	–31.56%	1.84%	33.15%	–0.18%

注:上述基金业绩指标不包括持有人认(申)购或交易基金的各项费用(例如基金申购费、基金赎回费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。为增加比较基准与基金业绩的可比性,更合理反应基金的业绩表现,本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

十三、费用概览

(一)与基金运作有关的费用

1、与基金运作有关的费用列示

基金运作过程中,从基金财产中支付的费用包括:

(1)基金管理人的管理费;

(2)基金托管人的托管费;

(3)《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

(4)《基金合同》生效后与基金相关的会计师费和律师费;

(5)基金份额持有人大会费用;

(6)基金的证券交易费用;

(7)基金的银行汇划费用;

(8)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。

本基金终止清算时所发生的费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。

2、与基金运作有关的费用计提方法、计提标准和支付方式

(1)基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×1.5%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前 2 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、公休假等,支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 2.5‰年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×2.5‰÷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

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前 2 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。

上述“1、与基金运作有关的费用列示”中第(3)–(7)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。

3、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

(1)基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;

(2)基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

(3)《基金合同》生效前的相关费用,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用;

(4)其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

4、费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率,须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率,无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 日在至少一种指定媒体和基金管理人网站上公告。

(二)与基金销售有关的费用

1、申购费与赎回费费率

(1)本基金的申购费率

本基金按申购费交纳时间分为前端申购和后端申购两种模式。目前,后端申购业务仅在本公司直销中心、中国工商银行、中国建设银行办理,如有新增机构,本公司将及时公告。

①前端申购费率

申购金额(M)	申购费率
M<100 万元	1.5%
100万元≤M<500 万元	1.0%
500万元≤M<1000 万元	0.3%
M≥1000 万元	每笔 2000 元

②后端申购费率

持有时间(Y)	申购费率
Y<1 年	1.8%
1年≤Y<2 年	1.6%
2年≤Y<3 年	1.2%
3年≤Y<4 年	0.8%
4年≤Y<5 年	0.4%
Y≥5 年	0

注:上表中,1 年按 365 天计算。

申购费用由基金申购人承担,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。投资者选择红利再投资所转成的基金份额不收取申购费用。

(2)本基金的赎回费率

本基金的赎回费率为:

持有时间(T)	赎回费率
T<1 年	0.5%
1≤T<2 年	0.25%
T≥2 年	0

注:上表中,1 年按 365 天计算。

赎回费用由基金赎回人承担,扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产,赎回费归入基金财产的比例不得低于法律法规或中国证监会规定的比例下限。

2、申购与赎回用的计算

(1)申购费用的计算

①前端收费模式

前端申购费用=申购金额–申购金额/(1+前端申购费率)

②后端收费模式

后端申购费用=赎回份额×申购当日基金份额净值×后端申购费率

(2)赎回费用的计算

赎回费=赎回份额×赎回当日基金份额净值×赎回费率

3、本基金的转换费用

投资者可以选择在本基金和本基金管理人管理的其他基金之间进行转换,转换业务的具体开办时间和转换规则请参见基金管理人届时发布的基金转换公告。

(三)基金的税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称《运作办法》)、《证券投资基金销售管理方法》(以下简称《销售办法》)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称《信息披露办法》)及其他有关法律法规的要求,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对 2010 年 8 月 24 日刊登的本基金招募说明书进行了更新,更新的主要内容如下:

1、更新了“重要提示”部分的内容。

2、在“三、基金管理人”部分,更新了主要人员情况和管理人的内部控制制度的介绍。

3、在“四、基金托管人”中,更新了基金托管人托管业务的经营情况的相关内容。

4、在“五、相关服务机构”部分,更新了代销机构变化情况和会计师事务所的信息。

5、在“八、基金份额的申购、赎回及其他注册登记业务”部分,更新了申购与赎回的办理时间、金额限制的内容。

6、在“九、基金的投资”部分,更新了本基金最近一期投资组合报告的内容。

7、在“十一、基金的业绩”部分,更新了基金合同生效以来的投资业绩。

8、在“二十三、其他应披露事项”部分,更新了本报告期内涉及本基金的相关公告以及其他应披露事项。

上述内容仅为本基金更新招募说明书的摘要,详细资料须以本更新招募说明书正文所载的内容为准。欲查询本更新招募说明书详细内容,可登录国投瑞银基金管理有限公司网站 www.ubssdic.com。

国投瑞银基金管理有限公司

2011 年 2 月 24 日

(上接 D35 版)

八、基金的投资策略

本基金将根据国内外宏观经济形势、市场利率走势以及债券市场资金供求情况来预测债券市场利率走势,并对各固定收益品种收益率、流动性、信用风险、久期和利率敏感性进行综合分析,评定各品种的投资价值,在严格控制风险的前提下,主动构建及调整固定收益投资组合,力争获取超额收益。此外,通过对首次发行和增发公司内在价值和一级市场申购收益率的细致分析,积极参与一级市场申购,获得较为安全的新股申购收益。

1、资产配置

本基金采取稳健的投资策略,通过固定收益类金融工具的主动管理,力求降低基金净值波动风险,并根据股票市场的趋势研判及新股申购收益率预测,积极参与风险较低的一级市场新股申购和增发新股,力求提高基金收益率。

2、债券类资产的投资管理

本基金借鉴 UBS Global AM 固定收益组合的管理方法,采取“自上而下”的债券分析方法,确定债券模拟组合,并管理组合风险。

(1)评估债券价值

债券基本价值评估的主要依据是均衡收益率曲线(Equilibrium Yield Curves)。

均衡收益率曲线是所有相关的风险都得到补偿时,收益率曲线的合理位置。风险补偿包括四个方面:资金的时间价值(补偿)、通货膨胀补偿、期限补偿、流动性及信用风险补偿。

本基金基于均衡收益率曲线,计算不同资产类别、不同剩余期限债券品种的预期超额回报,并对预期超额回报进行排序,得到投资评级。

(2)选择投资策略

债券投资策略主要包括:久期策略、收益率曲线策略、类别选择策略和个券选择策略。在不同时期,以上策略对组合收益和风险的贡献不尽相同,具体采用何种策略,取决于债券组合允许的风险程度。

(3)可转换债券的投资管理

可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性,具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金将选择公司基本面优良的可转换债券进行投资,并采用期权定价模型等数量化估值工具进行定价。本基金持有的可转换债券可以转换为股票。

(4)资产支持证券等的投资管理

资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上,辅以数量化模型确定其内在价值。

(5)组合构建及调整

由公司投资主管和债券组负责人组成债券策略组。该小组将借鉴 UBS Global AM 债券研究方法,结合各成员债券投资管理经验,评估债券价格与内在价值偏离幅度是否可靠,据此构建债券模拟组合。

债券策略组每周开会讨论债券策略组合,买入低估债券,卖出高估债券。同时从风险管理的角度,评估组合调整对组合久期、类别权重等的影响。

随着债券市场的发展与金融创新的深入,以及相关法律法规允许本基金可投资的金融工具出现时,本基金将基于审慎的原则,在满足本基金投资目标的前提下适时调整基金投资范围和投资比例。

(6)风险管理与归因分析

国投瑞银借鉴 UBS Global AM 全球风险管理系统(GRS)方法管理债券组合风险。GRS 方法关注组合风险来源,包括久期、剩余期限、汇率和信用特征。把组合总体风险分解为市场风险、发行人特定风险和汇率风险等。

3、新股申购策略

本基金将积极参与新股申购。在进行新股申购时,基金管理人将结合金融工程数量化模型,使用 GEVS 模型等方法评估股票的内在价值,充分借鉴合作券商等外部资源的研究成果,对于拟发行上市的新股(或增发新股)等权益类资产价值进行深入发掘,评估申购收益率,并通过对申购资金的积极管理,制定相应的申购和择时卖出策略以获取较好投资收益。

本基金结合发行市场资金状况和新股上市首日表现,预测股票上市后的市场价格,分析和比较申购收益率,从而决定是否参与新股申购。

一般情况下,本基金对获配新股将在上市首日起择机卖出,以控制基金净值的波动。若上市初价格低于合理估值,则等待至价格上升至合理价位时卖出,但持有时间最长不得超过可交易之日起的 90 个交易日。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为中信标普全债指数收益率

本基金为债券型基金,主要投资于固定收益类金融工具,强调基金资产的稳定增值,为此,本基金选取中信标普全债指数作为本基金的业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的债券指数时,基金管理人和基金托管人协商一致并履行相关程序后,可以变更本基金业绩比较基准并及时公告。

十、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期风险与收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

十一、基金的投资组合报告

本投资组合报告所载数据截至 2010 年 12 月 31 日,本报告中所列财务数据未经审计。

1、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	139,325,826.63	4.91
	其中:股票	139,325,826.63	4.91
2	固定收益投资	2,292,433,949.69	80.73
	其中:债券	2,292,433,949.69	80.73
	资产支持证券	–	–
3	金融衍生品投资	–	–
4	买入返售金融资产	294,000,681.00	10.35
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
5	银行存款和结算备付金合计	81,811,402.78	2.88
6	其他资产	31,908,235.08	1.12
7	合计	2,839,480,095.18	100.00

2、按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	11,098,783.98	0.39
B	采掘业	–	–
C	制造业	110,547,528.87	3.91
C0	食品、饮料	–	–
C1	纺织、服装、皮毛	8,619,181.30	0.30
C2	木材、家具	–	–
C3	造纸、印刷	20,050,000.00	0.71
C4	石油、化学、塑胶、塑料	–	–
C5	电子	18,553,579.50	0.66
C6	金属、非金属	8,129,686.60	0.29
C7	机械、设备、仪表	50,815,587.75	1.80
C8	医药、生物制品	4,379,493.72	0.15
C99	其他制造业	–	–
D	电力、煤气及水的生产和供应业	–	–
E	建筑业	7,248,251.40	0.26
F	交通运输、仓储业	–	–
G	信息技术业	–	–
H	批发和零售贸易	7,286,027.10	0.26
I	金融、保险业	–	–
J	房地产业	–	–
K	社会服务业	3,145,235.28	0.11
L	传播与文化产业	–	–
M	综合类	–	–
	合计	139,325,826.63	4.93

3、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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300156	天立环保	400,000	23,200,000.00	0.82
2	002511	中顺洁柔	500,000	20,050,000.00	0.71
3	002506	超日太阳	327,580	14,580,585.80	0.52
4	300124	汇川技术	89,502	12,519,539.76	0.44
5	601777	力帆股份	695,863	9,783,833.78	0.35
6	601118	海南橡胶	1,539,432	9,221,197.68	0.33
7	002487	大金重工	204,778	8,129,686.60	0.29
8	002482	广田股份	85,515	7,248,251.40	0.26
9	002485	希努尔	253,872	7,006,867.20	0.25
10	300138	晨光生物	127,163	4,379,493.72	0.15

4、按券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	–	–
2	央行票据	215,198,000.00	7.61
3	金融债券	575,642,000.00	20.36
	其中:政策性金融债	575,642,000.00	20.36
4	企业债券	1,109,245,231.27	39.24
5	企业短期融资券	–	–
6	可转债	392,348,718.42	13.88
7	其他	–	–
8	合计	2,292,433,949.69	81.10

5、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	113002	工行转债	2,423,000	286,253,220.00	10.13
2	126018	08江铜债	2,358,920	183,264,494.80	6.48
3	1001021	10央行票据 21	1,800,000	176,058,000.00	6.23
4	080406	08农发 06	1,500,000	150,435,000.00	5.32
5	090405	09农发 05	1,500,000	147,135,000.00	5.20

6、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

7、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资产。

8、投资组合报告附注

(1)报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

(2)基金投资的前十名股票均属于基金合同规定备选股票库之内的股票。

(3)其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	7,021,645.50
3	应收股利	–
4	应收利息	23,570,876.88
5	应收申购款	1,065,712.70
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	31,908,235.08

(4)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	110003	新钢转债	68,216,160.00	2.41
2	125731	美丰转债	37,879,338.42	1.34

(5)前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300156	天立环保	23,200,000.00	0.82	网下申购锁定期
2	002511	中顺洁柔	20,050,000.00	0.71	网下申购锁定期
3	002506	超日太阳	14,580,585.80	0.52	网下申购锁定期
4	601777	力帆股份	9,783,833.78	0.35	网下申购锁定期
5	601118	海南橡胶	9,221,197.68	0.33	网下申购锁定期
6	002487	大金重工	8,129,686.60	0.29	网下申购锁定期
7	002485	希努尔	7,006,867.20	0.25	网下申购锁定期
8	300138	晨光生物	4,379,493.72	0.15	网下申购锁定期

(6)本基金本期未投资托管行股票、未投资控股股东主承销的证券,未从二级市场主动投资分离交易可转债附送的权证,投资流通受限证券未违反相关法规或本基金管理公司的规定。

十二、基金的业绩

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,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

基金净值表现详见下表:

国投瑞银稳定增利债券型证券投资基金历史各时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表(截止 2010 年 12 月 31 日)

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①–③	②–④
2008.01.11(基金合同生效日)至 2008.12.31	9.67%	0.11%	9.34%	0.10%	0.33%	0.01%
2009.01.01 至 2009.12.31	4.12%	0.19%	0.27%	0.06%	3.85%	0.13%
2010.01.01 至 2010.12.31	9.23%	0.20%	2.00%	0.07%	7.23%	0.13%
自基金合同生效至今	24.73%	0.17%	11.89%	0.08%	12.84%	0.09%

注:上述基金业绩指标不包括持有人认(申)购或交易基金的各项费用(例如基金申购费、基金赎回费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。为增加比较基准与基金业绩的可比性,更合理反应基金的业绩表现,本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

十三、费用概览

(一)与基金运作有关的费用

1、与基金运作有关的费用列示

(1)基金管理人的管理费;

(2)基金托管人的托管费;

(3)基金销售服务费;

(4)因基金的证券交易或结算而产生的费用(包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等);

(5)基金合同生效以后的信息披露费用;

(6)基金份额持有人大会费用;

(7)基金合同生效以后的会计师费和律师费;

(8)基金的资金汇划费用;

(9)按照国家有关法律法规规定可以列支的其他费用。

2、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

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 0.6%年费率计提。

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的 0.6%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.6%÷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

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人于次月首日起 2 个工作日内向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人复核后于 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

(2)基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.2%年费率计提。

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的 0.2%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.2%÷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

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人于次月首日起 2 个工作日内向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。

(3)基金销售服务费

基金销售服务费用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等。

在通常情况下,本基金的销售服务年费率为 0.3%,基金销售服务费计提的计算公式如下:

H=E×0.3%÷当年天数

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提,按月支付。由基金管理人于次月首日起 2 个工作日内向基金托管人发送基金销售服务费划付指令,基金托管人复核后于 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给注册登记机构,由注册登记机构代付给销售机构。

3、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

本条第(一)款约定以外的其他费用,以及基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失等不列入基金费用。

4、基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费,无须召开基金份额持有人大会。

(二)与基金销售有关的费用

1、本基金的申购费用

本基金基金份额的申购不收取申购费用。

2、本基金的赎回费用

(1)本基金的赎回费率

本基金的赎回费用在投资者赎回本基金基金份额时收取,赎回费率为:

持有时间(T)	赎回费率
T<60 日	0.10%
T≥60 日	0

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担,其中不低于 25%的部分归入基金财产,其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

(2)赎回费用的计算方式

赎回费用=赎回份数×赎回当日基金份额净值×赎回费率

3、本基金的转换费用

投资者可以选择在本基金和本基金管理人管理的其他基金之间进行转换,转换业务的具体开办时间和转换规则请参见基金管理人发布的基金转换公告。

(三)基金的税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称《运作办法》)、《证券投资基金销售管理方法》(以下简称《销售办法》)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称《信息披露办法》)及其他有关法律法规的要求,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对 2010 年 8 月 25 日刊登的本基金招募说明书进行了更新,更新的主要内容如下:

1、更新了“重要提示”部分的内容。

2、在“三、基金管理人”部分,更新了主要人员情况和管理人的内部控制制度的介绍。

3、在“四、基金托管人”中,更新了基金托管人托管业务的经营情况的相关内容。

4、在“五、相关服务机构”部分,更新了代销机构变化情况和会计师事务所的信息。

5、在“八、基金份额的申购、赎回及其他注册登记业务”部分,更新了申购与赎回的金额限制的内容。

6、在“九、基金的投资”部分,更新了本基金最近一期投资组合报告的内容。

7、在“十一、基金的业绩”部分,更新了基金合同生效以来的投资业绩。

8、在“二十三、其他应披露事项”部分,更新了本报告期内涉及本基金的相关公告以及其他应披露事项。

上述内容仅为本基金更新招募说明书的摘要,详细资料须以本更新招募说明书正文所载的内容为准。欲查询本更新招募说明书详细内容,可登录国投瑞银基金管理有限公司网站 www.ubssdic.com。

国投瑞银基金管理有限公司

2011 年 2 月 24 日

股票代码:000937 股票简称:冀中能源 公告编号:2011 临–002

冀中能源股份有限公司第四届董事会第二十次会议决议公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

冀中能源股份有限公司(以下简称“公司”)于 2011 年 2 月 22 日上午 9:00 以现场会议的方式在公司金牛大酒店四层第二会议厅召开公司第四届董事会第二十次会议,会议通知已于两日前以专人送达或传真方式发出。参加本次会议的董事应到 15 名,现场出席会议的董事 13 名,独立董事宋淑艾、杨化彭因公不能现场出席,分别委托独立董事赵保卿代为出席并表决,会议由董事长王社平先生主持,公司监事、高级管理人员及其他有关人员列席了会议。会议的召集、召开和表决程序符合《中华人民共和国公司法》和《公司章程》的有关规定。与会董事经过认真审议,以记名投票的方式通过了以下议案:

一、关于发行公司债券的议案

为降低公司财务费用,优化融资结构,满足公司生产经营的资金需求,公司拟发行不超过 40 亿元人民币的公司债券。发行方案如下:

(一)发行规模:

本次公司债券的发行规模为不超过人民币 40 亿元,具体发行规模提请股东大会授权董事会在前述范围内确定。

(二)向公司股东配售的安排:

本次公开发行公司债券可以向股东配售,具体配售安排(包括是否配售、配售比例等)提请股东大会授权董事会根据发行时的市场情况以及发行具体事宜确定。

(三)债券期限:

本次公司债券的期限不超过 5 年(含 5 年),可以为单一期限品种,也可以是多种期限的混合品种。本次公司债券的具体期限构成和各期限品种的发行规模提请股东大会授权董事会在发行前根据市场情况和公司资金需求情况确定,并在本次公司债券的《募集说明书》中予以披露。

(四)募集资金用途:

本次公司债券的募集资金拟用于:偿还银行借款、补充公司营运资金。募集资金的具体用途提请股东大会授权董事会根据公司的具体情况确定。

(五)债券利率:

本次公司债券的利率水平及利率确定方式,提请股东大会授权董事会在发行前根据市场情况与主承销商协商确定,并在本次公司债券的《募集说明书》中予以披露。

(六)担保事项:

提请股东大会授权董事会,根据具体情况办理本次发行的相关担保事宜。

(七)发行债券的上市:

在满足上市条件的前提下,提请股东大会授权公司董事会根据证券交易所的相关规定办理本次公司债券上市交易事宜。

(八)决议的有效期:

关于本次发行事宜的决议有效期限为自公司股东大会审议通过之日起二十四个月内有效。

(九)对董事会的其他授权事项:

公司提请股东大会授权董事会办理一切与本次发行公司债券有关的事宜,包括但不限于:

1、决定发行方案以及修订调整本次债券发行的条款,包括但不限于具体发行数量、实际总金额、发行价格、债券利率或其确定方式、发行时机、债券期限、债券品种、是否设置回售条款和赎回条款、评级安排、担保事项、还本付息、偿债保障、上市安排等,以及在股东大会核准的用途范围内决定募集资金的具体使用等事宜;

2、执行就本次发行及申请上市而作出所有必要的步骤,包括但不限于:签署所有必要的法律文件,选择并委聘涉及的各类中介机构,确定承销安排,编制及向监管机构报送有关申请文件,选择债券受托管理人,签署债券受托管理协议及制定债券持有人会议规则等;在本次发行完成后,办理上市交易的相关事宜;

3、如监管部门的政策发生变化或市场条件发生变化,除涉及有关法律、法规及公司章程规定必须由股东大会重新表决的事项外,可依据监管部门的意见(如有)对本次公司债券发行的具体方案等相关事项作适当调整或根据实际情况决定是否继续开展本次公司债券发行的工作;

4、当公司出现预计不能或者到期未能按期偿付本次发行公司债券的本息时,可根据中国境内的法律、法规及有关监管部门等要求作出偿债保障措施决定,包括但不限于:(1)不向股东分配利润;(2)暂缓重大对外投资、收购兼并等资本性支出项目的实施;(3)调减或停发董事和高级管理人员的工资和奖金;(4)主要责任人不得调离等措施;

5、本次公司债券发行及上市相关事宜的授权有效期为自股东大会批准本次公司债券的议案之日起至上述授权事项办理完毕之日止。

本议案尚需提交公司股东大会审议。

同意 15 票 反对 0 票 弃权 0 票

二、关于发行中期票据的议案

为降低公司财务费用,优化融资结构,满足公司生产经营的资金需求,公司拟发行不超过 40 亿元人民币的中期票据。发行方案如下:

(一)公司拟在中国银行间市场交易商协会注册金额不超过 40 亿元人民币、期限不超过 5 年的中期票据,并在注册额度有效期内,根据市场情况、利率变化及公司自身需求在银行间债券市场分期择机发行。

(二)本次中期票据的发行利率,根据公司信用评级状况,参考市场同期中期票据发行情况等,由公司和主承销商协商确定。

(三)公司提请股东大会授权董事会在上述发行方案内,全权决定和办理与本次发行有关的事宜,包括但不限于:

1、根据市场情况变化决定发行时机、发行额度、发行期数、发行利率、募集资金用途等与中期票据申报和发行有关的事项;

2、签署必要的文件,包括但不限于发行申请文件、募集说明书、承销协议、各类公告等;

3、办理必要的手续,包括但不限于办理有关的注册登记手续;

4、其他一切与本次发行有关的必要行动。

(四)本次中期票据发行的相关事宜授权有效期为自股东大会批准之日起二十四个月。

本次中期票据的发行尚需获得中国银行间市场交易商协会接受注册后实施。

本议案尚需提交公司股东大会审议。

同意 15 票 反对 0 票 弃权 0 票

三、关于授权择优选择融资方式的议案

提请股东大会授权董事会根据公司发展战略规划、资金使用计划和融资市场的变化情况,择优选择公司债券或中期票据的融资方式。即若本次中期票据发行的注册时间先于公司债券的核准时间或中期票据的融资成本低于公司债券的融资成本,则董事会将根据情况调整公司债券的发行方案;若本次中期票据发行的注册时间晚于公司债券的核准时间或公司债券的融资成本低于中期票据的融资成本,则董事会将根据情况调整中期票据的发行方案。公司发行的公司债券和中期票据的总额不超过 40 亿元人民币。

本议案尚需提交公司股东大会审议。

同意 15 票 反对 0 票 弃权 0 票

四、关于修改公司章程的议案

根据公司的业务发展需要,拟调整经营范围和副总经理职数,并对《公司章程》的第十三条、第一百二十四条进行修订(附《章程修正案(草案)》)。

本议案尚需提交公司股东大会审议。

同意 15 票 反对 0 票 弃权 0 票

五、关于设立供应分公司的议案

为进一步强化采购管理,提高采购的集中度,优化管控模式,降低采购成本,公司拟设立“冀中能源股份有限公司供应分公司”,全面负责公司采购业务管理。

同意 15 票 反对 0 票 弃权 0 票

六、关于召开 2011 年第一次临时股东大会的议案

公司定于 2011 年 3 月 16 日以现场表决与网络投票相结合的方式召开 2011 年第一次临时股东大会。审议以下议案:

(一)关于发行公司债券的议案

(二)关于发行中期票据的议案

(三)关于授权择优选择融资方式的议案

(四)关于修改公司章程的议案

根据《公司章程》的规定,议案(四)属于特别决议事项,应当由出席股东大会的股东(包括股东代理人)所持表决权的三分之二以上通过。

同意 15 票 反对 0 票 弃权 0 票

特此公告。

冀中能源股份有限公司董事会

二〇一一年二月二十三日

证券代码:000937 证券简称:冀中能源 编号:2011 临–003

冀中能源股份有限公司关于召开 2011 年第一次临时股东大会的通知

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

一、召开会议的基本情况

(一)根据公司第四届董事会第二十次会议决议,公司定于 2011 年 3 月 16 日召开 2011 年第一次临时股东大会。本次会议的召集和召开符合法律、行政法规、部门规章、规范性文件和公司章程的规定。

(二)会议召集人:公司第四届董事会

(三)会议召开方式

本次临时股东大会将采取现场表决与网络投票相结合的方式。

(四)会议召开时间

现场会议时间:2011 年 3 月 16 日下午 2:00。

网络投票时间:

通过深圳证券交易所交易系统进行网络投票的具体时间为 2011 年 3 月 16 日上午 9:30~11:30 和下午 1:00~3:00;

通过深圳证券交易所互联网投票系统投票的具体时间为 2011 年 3 月 15 日下午 3:00 至 2011 年 3 月 16 日下午 3:00 期间的任意时间。

公司将于 2011 年 3 月 14 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》以及巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn)上刊登本次临时股东大会召开的提示性公告。

(五)投票规则

公司将通过深圳证券交易所交易系统和互联网投票系统向公司股东提供网络形式的投票平台,公司股东可以在网络投票时间内通过上述系统行使表决权。参加本次临时股东大会的方式:公司股东只能选择现场表决和网络投票中的一种表决方式。同一表决权出现重复表决的以第一次投票结果为准。

(六)股权登记日:2011 年 3 月 11 日(星期五)

(七)出席对象

1、截至 2011 年 3 月 11 日下午收市时在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司登记在册的本公司全体股东;上述本公司全体股东均有权出席股东大会,并可以书面形式委托代理人出席会议和参加表决,该股东代理人不必是本公司股东;

2、本公司董事、监事和高级管理人员;

3、本公司聘请的律师。

(八)现场会议召开地点

河北省邢台市中兴西大街 191 号金牛能源大酒店四楼第二会议厅。

二、会议审议事项

(一)会议议案

本次临时股东大会审议的议案有 4 项,该等议案已经公司第四届董事会第二十次会议审议通过,并同意提交公司股东大会审议。

具体审议事项如下:

1、关于发行公司债券的议案

(1)发行规模;

(2)向公司股东配售的安排;

(3)债券期限;

(4)募集资金用途;

(5)债券利率;

(6)担保事项;

(7)发行债券的上市;

(8)决议的有效期;

(9)对董事会的其他授权事项;

2、关于发行中期票据的议案

3、关于授权择优选择融资方式的议案

4、关于修改公司章程的议案

根据《公司章程》的规定议案 4 属于特别决议事项,应当由出席股东大会的股东(包括股东代理人)所持表决权的三分之二以上通过。

(二)披露情况

上述议案的具体内容详见 2011 年 2 月 24 日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》以及巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn)上的《冀中能源股份有限公司第四届董事会第二十次会议决议公告》。

三、出席现场会议登记方法

1、登记手续

凡符合本通知所述资格的股东,请持本人身份证、股东帐户卡原件(委托出席者须持授权委托书,见附件)登记,或以书面通讯及传真方式登记。书面通讯(以寄出邮戳为准)及传真方式登记截止时间为 2011 年 3 月 15 日,书面通讯请在信封或传真件左上角注明股东登记字样。

2、登记地点及信函地址

河北省邢台市中兴西大街 191 号冀中能源股份有限公司证券部

邮政编码:054000

3、登记时间

2010 年 3 月 11 日至 3 月 15 日,上午 8:30–12:00;下午 2:00–5:30。

四、参加网络投票的具体操作流程

在本次临时股东大会上,公司将通过深圳证券交易所交易系统和互联网投票系统向公司股东提供网络形式的投票平台,公司股东可以在网络投票时间内通过上述系统行使表决权。

(一)采用交易系统投票的投票程序

1、投票代码:360937;

2、投票简称:冀中投票

3、投票时间:2011 年 3 月 16 日的交易时间,即上午 9:30~11:30 和下午 1:00~3:00,

4.在投票当日,“冀中投票”“昨日收盘价”显示的数字为本次股东大会审议的议案总数。

5、通过交易系统进行网络投票的操作程序:

(1)进行投票时买卖方向应选择“买入”;

(2)在“委托价格”项下填报股东大会议案序号。100.00 元代表总议案,1.00 元代表议案 1,2.00 元代表议案 2,依此类推。每一议案应以相应的委托价格分别申报。股东对“总议案”进行投票,视为对除累积投票议案外的所有议案表达相同意见。

对于逐项表决的议案,如议案 1 中有多个需表决的子议案,1.00 元代表对议案 1 下全部子议案进行表决,1.01 元代表议案 2 中子议案(1),1.02 元代表议案 1 中子议案(2),依此类推。

表 1 股东大会议案对应“委托价格”一览表

议案序号		议案名称	委托价格
总议案		总议案	100.00
议案 1		关于发行公司债券的议案	1.00
	(1)	发行规模;	1.01
	(2)	向公司股东配售的安排;	1.02
	(3)	债券期限;	1.03
	(4)	募集资金用途;	1.04
	(5)	债券利率;	1.05
	(6)	担保事项;	1.06
	(7)	发行债券的上市;	1.07
	(8)	决议的有效期;	1.08
	(9)	对董事会的其他授权事项;	1.09
议案 2		关于发行中期票据的议案	2.00
议案 3		关于授权择优选择融资方式的议案	3.00
议案 4		关于修改公司章程的议案	4.00

(3)在“委托数量”项下填报表决意见或选举票数。对于不采用累积投票制的议案,在“委托数量”项下填报表决意见,1 股代表同意,2 股代表反对,3 股代表弃权;对于采用累积投票制的议案,在“委托数量”项下填报投给某候选人的选举票数。

表 2 表决意见对应“委托数量”一览表

表决意见类型	委托数量
同意	1股
反对	2股
弃权	3股

(4)股东对所有议案(包括议案的子议案)均表示相同意见,则可以只对“总议案”进行投票。

如股东通过网络投票系统对“总议案”和单项议案进行了重复投票的,以第一次有效投票为准。即如果股东先对相关议案投票表决,再对总议案投票表决,则以已投票表决的相关议案的表决意见为准,其它未表决的议案以总议案的表决意见为准;如果股东先对总议案投票表决,再对相关议案投票表决,则以总议案的表决意见为准。

(5)对同一议案的投票只能申报一次,不能撤单;

(6)不符合上述规定的投票申报无效,深交所交易系统作自动撤单处理,视为未参与投票。

(二)通过互联网投票系统的投票程序

1、互联网投票系统开始投票的时间为 2011 年 3 月 15 日(现场股东大会召开前一日)下午 3:00,结束时间为 2011 年 3 月 16 日(现场股东大会结束当日)下午 3:00。

2、股东通过互联网投票系统进行网络投票,需按照《深交所投资者网络服务身份认证业务实施细则》的规定办理身份认证,取得“深交所数字证书”或“深交所投资者服务密码”。公司可以写明具体的身份认证流程。

3、股东根据获取的服务密码或数字证书,可登录 http://wltp.cninfo.com.cn 在规定时间内通过深交所互联网投票系统进行投票。

(三)网络投票其他注意事项

1、网络投票系统按股东账户统计投票结果,如同一股东账户通过深交所交易系统和互联网投票系统两种方式重复投票,股东大会表决结果以第一次有效投票结果为准。

2、股东大会有多项议案,某一股东仅对其中一项或者几项议案进行投票的,在计票时,视为该股东出席股东大会,纳入出席股东大会股东总数的计算;对于该股东未发表意见的其他议案,视为弃权(如适用)。

五、其他事项

1、联系方式

联系人:陈立军 洪波

联系电话:0319–2098828 0319–2068242

传真:0319–2068666

电子邮箱:000937@vip.163.com

2、本次临时股东大会会期预计半天,参加现场会议的股东食宿、交通费自理。

3、网络投票期间,如投票系统遇突发重大事件的影响,则本次会议的进程另行通知。

4、授权委托书剪报、复印或按以下格式自制均有效。

六、备查文件

1、公司第四届董事会第二十次会议决议

冀中能源股份有限公司董事会

二〇一一年二月二十三日

附件 1:授权委托书格式

股东授权委托书

兹委托 __________ 先生(女士)代表我单位(个人)出席冀中能源股份有限公司 2011 年第一次临时股东大会,并代为行使表决权。

委托人姓名:

身份证号码:

委托人持股数量:

股东账号:

受托人姓名:

身份证号码:

委托人签名或盖章(法人股东加盖单位印章):

委托日期: 年 月 日