申万菱信基金管理有限公司关于以通讯方式召开申万菱信添益宝债券基金基金份额持有人大会的第四次提示性公告

申万菱信基金管理有限公司已于 2012 年 9 月 18 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》及基金管理人网站发布了《申万菱信基金关于以通讯方式召开申万菱信添益宝债券基金基金份额持有人大会的公告》，并分别于 2012 年 9 月 19 日、9 月 20 日、10 月 24 日在上述报纸和网站上发布了《关于以通讯方式召开申万菱信添益宝债券基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告》、《关于以通讯方式召开申万菱信添益宝债券基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告》、《关于以通讯方式召开申万菱信添益宝债券基金基金份额持有人大会的第三次提示性公告》。为使本次基金份额持有人大会顺利召开，现将具体事宜再次提示如下：

一、召开会议基本情况

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》和《申万菱信添益宝债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，申万菱信添益宝债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金管理人申万菱信基金管理有限公司（以下简称“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，会议具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式。

2、表决票收取时间：自 2012 年 9 月 20 日起，至 2012 年 10 月 29 日 17:00 止（以收到表决票的时间为准）。

二、会议审议事项

《关于修改申万菱信添益宝债券型证券投资基金基金合同中投资范围、投资策略及收益分配条款等内容的议案》（附件一）

三、权益登记日

本次大会的权益登记日为 2012 年 9 月 19 日，该日下午交易时间结束后，在申万菱信基金管理有限公司登记在册的本基金全体基金份额持有人均有权参与本次会议的表决。

四、表决票的填写和寄交方式

1、本次会议表决票见附件二。基金份额持有人可剪报、复印或登陆本基金管理人网站（www.swsmu.com）下载表决票。

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）个人持有人自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人身份证件复印件；

（2）机构持有人自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章或经授权的业务公章（以下合称“公章”），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有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

（3）个人持有人委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供基金份额持有人身份证件复印件，以及填妥的授权委托书原件（见附件三）。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有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

（4）机构持有人委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供基金份额持有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原件（见附件三）。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有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

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前述表决票收取时间内（以收到时间为准），通过专人送交或邮寄的方式，提交给本次大会公证机构。

本次大会公证机构的联系方式如下：

公证机关：北京市方正公证处

地址：北京市西城区阜外大街 7 号国投大厦三层

联系人：王顺心　贺颖

联系电话：010-68096201；010-68096216；

邮政编码：100037

请在信封表面注明：“申万菱信添益宝基金基金份额持有人大会表决专用”。

五、计票

1、本次通讯会议的计票方式为：由本基金管理人派出的两名代表在基金托管人（中国工商银行股份有限公司）派出的一名代表的监督下在表决截止日期第二天统计全部有效表决票，并由公证机构对其计票过程予以公证并形成决议；

2、基金份额持有人所持的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公证机构的，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参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

（2）如表决票上的表决意见未选、多选或无法辨认则视为弃权表决，但计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。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公证机构的，均为无效表决票。无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

（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做出了不同表决意见，计入无效表决票；

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，邮寄的以公证员收到的时间为准。

六、决议条件

1、如提交有效表决票的基金份额持有人或其代理人所对应的基金份额占本基金在权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%），则本次通讯开会视为有效；

2、本次议案如经提交有效表决票的基金份额持有人或其代理人所对应的基金份额的 50%以上（含 50%）多数同意，则视为表决通过，形成的大会决议有效；

3、基金份额持有人大会表决通过的事项，将由本基金管理人在自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案，基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

七、本次大会相关机构

1、召集人：申万菱信基金管理有限公司

联系电话：400 880 8588（免长途话费）或 +86 21 962299

网址：www.swsmu.com

2、基金托管人：中国工商银行股份有限公司

3、见证律师：通力律师事务所

4、公证机构：北京市方正公证处

八、重要提示

1、关于本次议案的说明见附件四《关于申万菱信添益宝债券型证券投资基金修改基金合同事宜的说明》；

2、请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；

3、本次基金份额持有人大会有关公告可通过本基金管理人网站查阅，投资者如有任何疑问，可致电本基金管理人咨询；

4、本通知的有关内容由申万菱信基金管理有限公司负责解释。

附件：

1、关于修改申万菱信添益宝债券型证券投资基金基金合同中投资范围、投资策略及收益分配条款等内容的议案；

2、申万菱信添益宝债券型证券投资基金基金份额持有人大会通讯表决票；

3、申万菱信添益宝债券型证券投资基金基金份额持有人大会授权委托书；

4、关于申万菱信添益宝债券型证券投资基金修改基金合同事宜的说明。

附件一：

关于修改申万菱信添益宝债券型证券投资基金
基金合同中投资范围、投资策略及收益分配条款等内容的议案

申万菱信添益宝债券型证券投资基金基金份额持有人：

为维护基金份额持有人利益，提高产品的市场竞争力，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》和《申万菱信添益宝债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金管理人经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，提议对《申万菱信添益宝债券型证券投资基金基金合同》按照《关于申万菱信添益宝债券型证券投资基金修改基金合同事宜的说明》（附件四）提出的修订方案进行修改。

上述议案，请予审议。

基金管理人：申万菱信基金管理有限公司

2012 年 9 月 18 日

附件二：

申万菱信添益宝债券型证券投资基金
基金份额持有人大会通讯表决票

基金份额持有人基本资料	
持有人姓名或名称：	
申万菱信基金账户号：（如有多个，请逐一填写）	
持有人身份证件类型及号码：（个人基金份额持有人填写）	
持有人营业执照类型及注册号：（机构基金份额持有人填写）	
如基金份额持有人委托他人代为投票，请填写	
代理人姓名或名称：	
代理人身份证件类型及号码：（代理人为个人）	
代理人营业执照类型及注册号：（代理人为机构）	
表决意见：《关于修改申万菱信添益宝债券型证券投资基金基金合同中投资范围、投资策略及收益分配条款等内容的议案》	
同意	
反对	
弃权	
签字或盖章	
个人持有人或代理人（代理人为个人）签字： 年　月　日	机构持有人或代理人（代理人为机构）盖章： 年　月　日

（本表决票可剪报、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）

关于表决票的填写说明：

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公证机构的，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参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

2、如表决票上的表决意见未选、多选或无法辨认则视为弃权表决，但计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。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公证机构的，均为无效表决票；无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

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做出了不同表决意见，计入无效表决票；

（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，邮寄的以公证员收到的时间为准。

附件三：

申万菱信添益宝债券型证券投资基金
基金份额持有人大会授权委托书

兹委托_____先生／女士／单位代表本人／本单位出席于__年_月_日召开的申万菱信添益宝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。本授权不得转授权。

委托人（签字/盖章）：

委托人身份证件号或营业执照注册号：

委托人申万菱信基金账户号：

受托人（签字/盖章）：

受托人身份证件号或营业执照注册号：

委托日期：　年　月　日

（本授权委托书可剪报、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：

关于申万菱信添益宝债券型证券投资基金
修改基金合同事宜的说明

一、修改基金合同的必要性

鉴于目前本基金管理人旗下的申万菱信添益宝债券型证券投资基金（以下简称“添益宝债券基金”或“本基金”）投资范围与市场上现有一级债基不完全一致，为维护基金份额持有人利益，使本基金的风险收益定位更加明确、清晰，本基金管理人希望能够对《申万菱信添益宝债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的部分内容进行修改，同时就《基金合同》中与现行法律法规不一致处进行修改。

二、可行性说明

1、法律可行性

添益宝债券基金原《基金合同》约定，变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）以及对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项应当召开基金份额持有人大会。另外，根据原《基金合同》，本次基金份额持有人大会决议不属于特别决议，经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）通过即为有效。基金份额持有人大会的决议自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

因此，本基金《基金合同》的修改目前不存在法律方面的障碍。

2、投资可行性

本基金修改投资范围后，增加了增发新股收益，不仅使本基金的一级债基类型定位更加明确，主要投资工具范围界定更加清晰，而且能够通过扩大基金收益来源来更有效的降低单个投资工具市场大幅波动给基金收益带来的影响。另外，修改后的投资范围更加符合投资实际操作过程中可能出现的各种情况，避免出现相关情形引起的相关资产短期被迫变现等风险以及带来的基金收益损失。

对相关投资策略部分的修改不涉及主体策略更改，仅就修改后的投资范围对相关策略进行了更清晰的阐述。本基金《基金合同》的修改不具有投资障碍。

3、技术运作可行性

本基金对投资工具范围及投资比例的修改不涉及对本基金基金类型及投资目标等的变动，且修改后的范围系对原《基金合同》投资范围更加完整、清晰的界定，涵括了原投资范围及比例，因此修改后操作上不会涉及对不符合规定资产的变现，不存在技术操作上的障碍。

另外，《基金合同》修改不涉及基金管理人和基金托管人的变更，技术上可以保障基金份额持有人大会顺利召开，和基金份额持有人大会决议顺利执行。

4、其他修订的可行性

鉴于本基金原《基金合同》中基金收益与分配部分有若干条款与 2009 年颁布的《证券投资基金收益分配条款的审核指引》不符，此次一并提请修改，以避免出现相关法律风险。

三、《基金合同》具体修改要点

1、投资范围

《基金合同》第十一部分“基金的投资”中第“二、投资范围”部分内容原文如下：

“本基金投资于具有良好流动性的固定收益类品种，包括国债、金融债、公司债、企业债、次级债、可转换债券、资产支持证券、短期融资券、债券回购、央行票据、同业存款等，以及参与新股申购等权益类品种和法律法规或监管机构允许基金投资的其他金融工具。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资比例为：本基金对债券类资产投资比例为基金资产 80%-100%；股票等权益类资产的投资比例为基金资产的 0-15%。现金及到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，股票限于新股申购、可转债转股获得；不在二级市场主动买入股票及权证。”

现修改为：

“本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类品种，包括国债、金融债、公司债、企业债、次级债、可转换债券、资产支持证券、短期融资券、债券回购、央行票据、同业存款等以及法律法规或监管机构允许基金投资的其它金融工具。本基金不直接从二级市场买入股票或权证等权益类资产，但可以投资通过首次发行股票、增发新股、可转换债券转股以及权证行权等方式获得的股票资产，并可投资因股票派发或因投资分离交易可转债所产生的权证等资产。

法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金对债券类资产的投资比例不低于基金资产的 80%；对股票等权益类资产的投资比例不高于基金资产的 20%。现金及到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。”

2、投资策略

（1）、《基金合同》第十一部分“基金的投资”中第“四、投资策略 1、一级资产配置”部分内容原文如下：

“1、一级资产配置

资产配置策略确定基金在各大类资产的投资比例，在本基金中是指基金总资产在转债、债券、IPO/转债申购和现金证券的投资比例分配，资产配置是投资获利的决定性因素。从国内外情况来看，资产配置对总收益的贡献度超过 80%，对收益的波动解释超过 90%。

在大类资产的配置上，本基金主要根据宏观经济与市场运行趋势的综合分析，决定在转债、债券、IPO/转债申购和现金资产上的资金分配。宏观经济分析将基于宏观经济运行状况、国家财政和货币政策等方面进行研究，着重于对中国经济的运行环境、中国经济的增长前景、行业发展的分化、企业盈利的增长趋势等问题进行考察与评估；市场运行趋势分析将主要集中在对市场估值水平、资金供给、市场信心、市场运行周期、市场政策等方面进行研究，以期对市场未来的运行情况进行判断与预测。

在对宏观经济与市场运行趋势进行综合判断后，结合基金的流动性要求，确定债券、转债、现金及 IPO/转债申购的资金配置比例。此外，回顾与调整是资产配置策略的的一个重要组成部分。本基金按季度定期对基金的配置策略进行检视与调整，当遇到重大市场变化或政策变化时，本基金将及时对该事件进行评估并对资产配置策略进行调整，以确保资产配置策略能够及时对宏观经济与市场运行趋势的变化进行反应。”

现修改为：

“1、一级资产配置

资产配置策略确定基金在各大类资产的投资比例，在本基金中是指基金总资产在转债、债券、新股/转债申购和现金证券的投资比例分配，资产配置是投资获利的决定性因素。从国内外情况来看，资产配置对总收益的贡献度超过 80%，对收益的波动解释超过 90%。

在大类资产的配置上，本基金主要根据宏观经济与市场运行趋势的综合分析，决定在转债、债券、新股/转债申购和现金资产上的资金分配。宏观经济分析将基于宏观经济运行状况、国家财政和货币政策等方面进行研究，着重于对中国经济的运行环境、中国经济的增长前景、行业发展的分化、企业盈利的增长趋势等问题进行考察与评估；市场运行趋势分析将主要集中在对市场估值水平、资金供给、市场信心、市场运行周期、市场政策等方面进行研究，以期对市场未来的运行情况进行判断与预测。

在对宏观经济与市场运行趋势进行综合判断后，结合基金的流动性要求，确定转债、债券、新股/转债申购和现金的资金配置比例。此外，回顾与调整是资产配置策略的的一个重要组成部分。本基金按季度定期对基金的配置策略进行检视与调整，当遇到重大市场变化或政策变化时，本基金将及时对该事件进行评估并对资产配置策略进行调整，以确保资产配置策略能够及时对宏观经济与市场运行趋势的变化进行反应。”

（2）、《基金合同》第十一部分“基金的投资”中第“四、投资策略 3、一级市场申购策略”部分内容原文如下：

“3、一级市场申购策略

在股票和转债（包括传统转债和可分离转债）发行市场上，由于供求关系不平衡经常导致股票发行价格与二级市场价格之间存在一定的价差，从而使得新股和转债申购成为一种风险较低的投资方式。本基金将研究首次发行股票及发行转债公司的基本面，估计上市后的合理价格，判断是否参与新股及转债的一级市场申购。同时，由于新股和转债申购收益率有差异，为提高基金申购收益率，本基金以 2006 年以来沪深市场发行上市的新股、可转债、可分离转债为样本，分析同时有新股、可转债、可分离转债发行时的影响申购收益率因素及规律，确定最优申购策略，并根据当时的一级市场情况进行灵活调整。”

现修改为：

“3、一级市场申购策略

本基金通过研究首次发行股票、增发新股及发行转债公司的基本面，估计上市后的合理价格，判断是否参与新股及转债的一级市场申购。同时，由于新股和转债申购收益率有差异，为提高基金申购收益率，本基金以 2006 年以来沪深市场发行上市的新股、可转债、可分离转债为样本，分析同时有新股、可转债、可分离转债发行时的影响申购收益率因素及规律，确定最优申购策略，并根据当时的一级市场情况进行灵活调整。”

3、基金的收益与分配

（1）、《基金合同》第十五部分“基金的收益与分配”部分内容原文如下：

“一、基金收益的构成

基金收益包括：基金投资所得红利、股息、债券利息、证券投资收益、证券持有期间的公允价值变动、银行存款利息以及其他收入。因运用基金财产带来的成本或费用的节约计入收益。

二、基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按照有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

三、基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，全年分配比例不得低于年度可供分配收益的 60%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，B 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同；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；

3、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；投资者可对 A 类基金份额和 B 类基金份额分别选择不同的分红方式。如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，基金注册登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准；

4、基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

5、基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；

6、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；

7、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

四、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金净收益、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

五、收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 2 日内在至少一家指定媒体公告并报中国证监会备案。

六、基金收益分配中发生的费用

收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足于支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。”

现修改为：

“一、基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

二、基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

三、基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 60%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、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；投资者可对 A 类基金份额和 B 类基金份额分别选择不同的分红方式；

3、基金收益分配后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；

4、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，B 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同；本基金同一基金份额类别内的每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

四、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

五、收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 2 个工作日内在指定媒体公告并报中国证监会备案。

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日。

六、基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足于支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。”

4、其他修改

《基金合同》第六部分“基金合同当事人及权利义务”中第“（一）、基金管理人概况”部分内容原文如下：

“注册资本：壹亿元人民币”

“存续期限：三十年”

“联系电话：+86-21-63353535”

现修改为：

“注册资本：壹亿伍仟万元人民币”

“存续期限：持续经营”

“联系电话：+86-21-23261188”

四、本次《基金合同》修改的主要风险及预备措施

1、预防《基金合同》修改方案被基金份额持有人大会否决的风险

为防范《基金合同》修改方案被基金份额持有人大会否决的风险，基金管理人将提前向基金份额持有人征询意见。如有必要，基金管理人将根据基金份额持有人意见，在履行相关程序后对《基金合同》修改方案进行适当修订，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。

如《基金合同》修改方案未获得基金份额持有人大会批准，则基金管理人将按照有关规定重新向持有人大会提交新的基金合同修改方案议案。

2、预防《基金合同》修改后基金运作过程中的相关运作风险

基金管理人将提前做好充分的内部沟通及外部沟通，避免《基金合同》修改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、合规说明

1、基金托管人中国工商银行股份有限公司对本次《基金合同》修改方案及相关文件出具了无异议的函。

2、基金管理人聘请的法律顾问通力律师事务所为本次《基金合同》修改出具了法律意见书。

六、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，欢迎及时反馈给本基金管理人。本基金管理人将根据投资者的反馈意见，进一步完善本方案。本方案若有任何修改，将在基金份额持有人大会正式召开前及时公告。

基金管理人：申万菱信基金管理有限公司

客户服务电话：400 880 8588（免长途话费）或 +86 21 962299

网址：www.swsmu.com

申万菱信基金管理有限公司

2012 年 10 月 26 日

股票简称：香溢融通　证券代码：600830　编号：临时 2012-043

香溢融通控股集团股份有限公司关于为控股子公司下属公司提供担保的公告

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，对公告的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏负连带责任。

重要内容提示

被担保人：浙江元泰典当有限责任公司

本次担保数量：3000 万元（为新增担保）

本次担保后公司累计对外担保数量：11000 万元（含本次担保），最高额保证担保 85000 万元

逾期对外担保数量：无

一、担保情况概况

2012 年 10 月 24 日，公司为控股子公司浙江香溢金联有限公司的控股子公司浙江元泰典当有限责任公司向广发银行杭州宝善支行借款 3000 万元提供担保，担保期限自 2012 年 10 月 24 日起至 2013 年 10 月 22 日。

二、被担保人基本情况

浙江元泰典当有限责任公司系浙江香溢金联有限公司的控股子公司，注册资金 10000 万元，法定代表人王鹤群，主要经营：质押典当业务、房地产抵押典当业务、限额内绝当物品的变卖、鉴定评估及咨询服务、国家经济贸易委员会依法批准的其他业务。

2011 年 12 月 31 日，该公司总资产 38003.95 万元、净资产 28485.40 万元，实现净利润 3121.06 万元，资产负债率 25.05%。

2012 年 9 月 30 日，该公司总资产 40365.86 万元、净资产 31111.82 万元，实现净利润 2626.42 万元，资产负债率 22.93%（未经审计）。

三、公司意见

2012 年 3 月 27 日，公司七届六次董事会审议通过了《关于授权公司总经理在一定范围内行使职权的决议》，授权公司总经理在单笔不超过公司净资产 10%额度内，决定对资产负债率不超过 70%的公司控股子公司（含孙公司）的担保事项，担保余额（按投资比例计算）不超过公司净资产的 40%，且不超过总资产的 25%；对公司单个控股子公司（含孙公司）的担保余额（按投资比例计算）不超过公司净资产的 25%。以上授权，不包括对控股子公司香溢担保有限责任公司经股东大会审议通过的为工程保函担保业务提供的最高额保证担保额度。

上述授权内容已列入《公司章程》相关条款，《公司章程》（2012 年修订稿）已经公司 2011 年度股东大会审议通过。

公司本次担保系公司对控股子公司下属公司提供的贷款担保，未与证监发[2005]120 号《关于规范上市公司对外担保行为的通知》的精神相违背。且本次担保相关标的未超过董事会授权，符合相关规定。

四、累计对外担保的数量和逾期担保情况

截止本公告披露日，本公司对控股子公司及控股子公司下属公司累计担保 96000 万元（其中贷款担保 11000 万元、最高额保证担保 85000 万元，含本次担保）。合计担保数占公司 2011 年度经会计师事务所审计的净资产 157243.78 万元的 61.05%，无其他担保，无逾期担保。

五、备查文件

1、公司七届六次董事会决议；

2、《公司章程》（2012 年修订稿）。

特此公告。

香溢融通控股集团股份有限公司

2012 年 10 月 25 日

证券代码：002086　证券简称：东方海洋　公告编号：临 2012-017

山东东方海洋科技股份有限公司 2012 年第一次临时股东大会决议公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容真实、准确和完整，并对公告中的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏承担责任。

一、重要提示

本次股东大会召开期间无增加、否决或变更提案。

二、会议召开情况

（一）召开时间：2012 年 10 月 25 日上午 9:00

（二）召开地点：烟台市莱山澳柯玛大街 9 号公司会议室

（三）召开方式：现场投票方式

（四）召集人：公司董事会

（五）主持人：董事长车轼先生

（六）会议的召开符合《公司法》、《上市公司股东大会规则》及《公司章程》的规定。

三、会议出席情况

出席会议的股东及股东代理人 3 人，代表 69,055,200 股，占公司发行在外股份总数的 28.32%。公司董事、监事和高级管理人员及公司聘请的见证律师出席了会议。

四、会议表决情况

审议通过《公司章程修正案》

同意董事会关于公司章程中利润分配相关条款的修订。修正案内容详见 2012 年 8 月 25 日刊登在《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》及巨潮资讯网 www.cninfo.com.cn 的《公司第四届董事会九次会议决议公告》（临 2012-015）。

表决结果：69,055,200 股同意，占出席会议有表决权股份总数的 100%；0 股反对；0 股弃权。

五、律师出具的法律意见

上海市锦天城律师事务所律师对公司 2012 年第一次临时股东大会出具了法律意见书并发表如下结论意见：本所律师认为，公司 2012 年第一次临时股东大会的召集和召开程序、召集人资格、出席会议人员资格、会议表决程序及表决结果等事宜，均符合《公司法》、《上市公司股东大会规则》等法律、法规、规章和其他规范性文件及《公司章程》的有关规定，本次股东大会通过的决议合法有效。

六、备查文件

1、山东东方海洋科技股份有限公司 2012 年第一次临时股东大会决议

2、上海市锦天城律师事务所关于山东东方海洋科技股份有限公司 2012 年第一次临时股东大会的法律意见书

特此公告。

山东东方海洋科技股份有限公司

董事会

2012 年 10 月 26 日

(上接D18版)

第一，境外投资顾问每周根据多策略趋势追踪模型的计算，为基金经理提供如下数据：各类资产的隐含预期收益率（表示资产的相对强弱）；各类资产的预期波动率；基本面因子对各类资产配置比例的影响幅度；各类资产的配置比例等。同时，本基金管理人也会在境外投资顾问的帮助下，自建模型对以上数据进行计算，初期主要用于与境外投资顾问提供的数据进行比对，根据运行结果对自身模型进行不断修正和相互验证，待自建模型运行成熟后，本基金管理人将主要以自身模型的计算结果为依据，来协助进行资产的配置。

第二，在多因子趋势追踪模型分析的基础上，基金经理将综合分析投资决策委员会确定的投资比例范围和模型分析的结果，综合考虑部分不易量化的基本面因素的影响，以及对未来趋势的判断来对模型分析结果进行调整。

但是，在市场出现突发事件或某些特定的市场环境下，本基金将主要依靠投研团队对于相关突发事件和市场环境的分析来确定基金的资产配置，此时，资产配置的结果可能会与多因子趋势分析模型的结论有较大差异。

（2）ETF组合构建

首先，基金管理人会与境外投资顾问一道，确定ETF备选池，并提交投资决策委员会讨论。经投资决策委员会讨论确定的股票池将作为本基金正式的备选股票池，基金经理和投资顾问每年会对ETF池进行调整，并提交投资决策委员会进行讨论。ETF备选池由相关市场的具有代表性的指数ETF构成，对于股票类资产，也会选择行业、风格和主题等类ETF。

在日常投资过程中，基金经理会根据资产配置过程的结果，从备选的ETF池中选择满足条件的ETF构成各个资产类别的ETF组合，对于股票类资产类别，基金经理会选择市场基准类ETF的同时，通过对海外市场行业、风格等子市场的研究来选择部分子市场ETF进行投资。

ETF组合构建主要由基金经理根据基金投资策略来确定，同时也会参考境外投资顾问的建议，境外投资顾问的建议可以是ETF的买卖建议，但最终的决策权在于本公司。

（3）投资执行

该阶段主要由基金管理人负责。投资交易指令通过公司的全球交易平台执行。

（4）投资风险控制

该阶段工作主要由基金管理人负责。根据中国证监会和境外相关市场的监管要求，制定风险管理制度，实施有效的风险管理。

1）基金经理会在基金日常投资过程中对投资组合的波动率，VaR，跟踪误差等风险指标进行前端控制，通过预先设定波动率、VaR和跟踪误差（　　　　，其中，Di表示i日基金资产组合收益与业绩比较基准收益之差，i=1，2，…，N）等风控指标的预算范围，并每周进行监控，来保证基金投资组合在预先设定的风险预算范围内运行，这项工作主要由基金经理完成，但是在早期基金管理人的资产配置模型尚未完善时，涉及需要模型参数设置来控制的部分将主要由境外投资顾问完成；

2）每月公司交易部门将出具月度交易报告，包括该月交易情况汇总、月末基金资产明细，以及交易指令合规性的说明，由基金经理签字后，上报公司内控审计和风险管理部、督察长；

3）基金经理每月向投资总监提交所管理境外证券投资基金的投资总结，投资总结应附有所管辖基金资产投资组合的财务报表及基金有关遵守《华宝兴业境外证券投资管理制度》、《基金合同》、《资产配置、区域配置方案》所规定的框架进行投资的声明。投资总监应定期复核投资经理的所有交易记录，确保各基金投资组合的操作符合《基金合同》和投资决策委员会的要求；

4）内控审计风险管理部通过交易数据的核对，对前日交易操作进行复核，如发现有违反证监会《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和公司相关管理制度的交易操作，须立刻向副总经理汇报，并同时通报督察长、境外投资团队；

5）督察长、副总经理和内控审计风险管理部人员对投资决策和投资执行的过程进行监督检查，并对有关数据和资料进行备案。

（5）投资业绩评估

1）公司境外投资业绩评估委员会每月召开会议，评估基金的整体运作绩效、基金经理的管理能力，确定公司在对外宣传材料中对基金业绩、策略的说明。同时也对境外投资顾问和境外券商的业绩做出评价；

2）公司内控审计和风险管理部负责对相关部门的业绩报告进行确认和评估，在此基础上，做进一步的绩效分析；

3）公司境外投资团队、境外研究小组每月编写境外投资顾问评估报告，提交公司绩效评估委员会进行讨论和评价。

十、基金的业绩比较基准

50%MSCI全球指数（此处指全收益指数）+50%花旗全球政府债券指数

MSCI全球指数（MSCI World Index）是MSCI Barra指数公司编制的自由流通市值加权指数，主要用来衡量全球发达市场的表现。截至2010年2月，MSCI全球指数包含23个发达国家市场，分别为：澳大利亚、奥地利、比利时、加拿大、丹麦、芬兰、法国、德国、希腊、香港特别行政区、爱尔兰、意大利、日本、荷兰、新西兰、挪威、葡萄牙、新加坡、西班牙、瑞典、瑞士、英国和美国。共1654家上市公司，总市值共计21万亿美元。

花旗全球政府债券指数（World Government Bond Index）是由花旗集团指数部门采用市值加权的方法编制，包括23个国家的政府债券，包括：澳大利亚、奥地利、比利时、加拿大、丹麦、芬兰、法国、德国、希腊、爱尔兰、意大利、日本、马来西亚、荷兰、挪威、波兰、葡萄牙、新加坡、西班牙、瑞典、瑞士、英国和美国。

当市场出现更合适，更权威的比较基准时，经基金托管人同意，本基金管理人履行适当的程序后，可以选用新的比较基准，并将及时公告。

十一、基金的风险收益特征

在正常市场情况下，本基金的风险收益特征类似于全球平衡型基金，属于中等预期风险和收益的证券投资品种，其预期风险和收益水平低于全球股票型基金，高于债券基金和货币市场基金。

在部分极端市场情况下，本基金存在策略失效的风险，此时的预期风险水平可能会显著增加。

十二、基金的投资组合报告

本基金的投资组合报告所载的数据截至2012年6月30日，本报告中所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	–	–
	其中：普通股	–	–
	存托凭证	–	–
	优先股	–	–
	房地产信托凭证	–	–
2	基金投资	48,998,954.45	64.49
3	固定收益投资	–	–
	其中：债券	–	–
	资产支持证券	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
	其中：远期	–	–
	期货	–	–
	期权	–	–
	权证	–	–
5	买入返售金融资产	–	–
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	货币市场工具	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	26,926,908.90	35.44
8	其他各项资产	53,337.49	0.07
9	合计	75,979,200.84	100.00

2、期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

3、期末按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

4、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5、期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

6、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

本基金本报告期末未持有债券投资。

7、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

8、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

9、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	POWERSHARES QQQ NASDAQ 100	ETF基金	开放式	Invesco PowerShares Capital Management	6,898,694.93	10.01
2	SPDR S&P 500 ETF TRUST	ETF基金	开放式	SSGA Funds Management Inc	6,033,258.86	8.76
3	VANGUARD LONG-TERM Corporate BOND ETF	ETF基金	开放式	Vanguard Group Inc	3,947,053.85	5.73
4	ISHARES MSCI Hong Kong	ETF基金	开放式	BlackRock Fund Advisors	3,474,900.06	5.04
5	SPDR BARCLAYS CAPITAL 1-3 MO	ETF基金	开放式	SSGA Funds Management Inc	3,418,975.29	4.96
6	ISHARES BARCLAYS 1-3 YEAR TR	ETF基金	开放式	BlackRock Fund Advisors	3,415,243.60	4.96
7	ISHARES BG EURO INF LNKD BND	ETF基金	开放式	BlackRock Fund Advisors	3,221,332.69	4.68
8	SPDR S&P OIL & GAS EXP & PR	ETF基金	开放式	SSGA Funds Management Inc	3,187,749.60	4.63
9	TECHNOLOGY SELECT SECT SPDR	ETF基金	开放式	SSGA Funds Management Inc	2,909,454.00	4.22
10	DB X-TRACKERS MSCI PAC X-JPN	ETF基金	开放式	DB X-TRACKERS	2,810,419.26	4.08

10、投资组合报告附注

（1）基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚，无证券投资决策程序需特别说明。

（2）本报告期内本基金的前十名股票投资没有超出基金合同规定的股票备选库。

（3）期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	–
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	51,199.50
4	应收利息	751.29
5	应收申购款	1,386.70
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	53,337.49

（4）期末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）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及存托凭证。

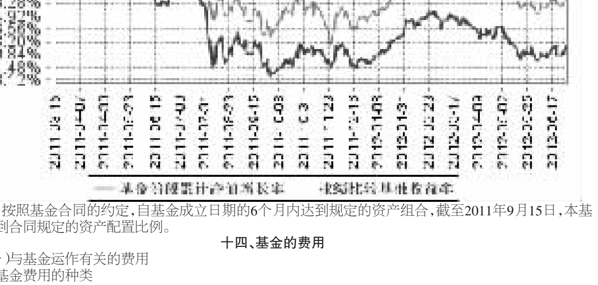
十三、基金的业绩

基金业绩截止日为2012年6月30日，所列数据未经审计。

1、净值增长率与同期比较基准收益率比较：

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
2011/03/15-2011/12/31	-10.90%	0.72%	-4.87%	0.82%	-6.03%	-0.10%
2012/01/01-2012/06/30	2.36%	0.50%	3.64%	0.47%	-1.28%	0.03%
2011/03/15-2012/6/30	-8.80%	0.65%	-1.41%	0.71%	-7.39%	-0.06%

2、自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较：



注：按照基金合同的约定，自基金成立日期的6个月内达到规定的资产组合，截至2011年9月15日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

十四、基金的费用

（一）与基金运作有关的费用

1、基金费用的种类

（1）基金管理人的管理费，含境外投资顾问收取的费用；

（2）基金托管人的托管费，含境外托管人收取的费用；

（3）基金的证券交易和清算费用；

（4）基金合同生效以后的信息披露费用；

（5）基金份额持有人大会费用；

（6）基金合同生效以后的会计师费和律师费；

（7）基金的资金汇划费用；

（8）外汇兑换交易的相关费用；

（9）在证监会规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明；

按照国家有关规定可以列入的其他费用。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

基金的各项费用以人民币提取，以人民币支付。

（1）基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费（如基金管理人委托境外投资顾问，包括投资顾问费）按基金财产净值的1.5%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金财产净值的1.5%年费率计提。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 为前一日基金财产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人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次月首日起10个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

（2）基金托管人的托管费

基金托管人的基金托管费（如基金托管人委托境外托管人，包括向境外托管人支付的相应服务费）按基金财产净值的0.3%年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金财产净值的0.3%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.3%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金财产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人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次月首日起10个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

（3）本条第（一）款第3至第10项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

3、不列入基金费用的项目：

本条第1款约定以外的其他费用，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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

4、基金费用调整

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

5、税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，依照国家法律法规和基金投资所在地的法律法规的规定履行纳税义务。

（二）与基金有关的销售费用

1、申购费与赎回费

1）投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。本基金的申购费率表如下：

申购金额	申购费率
500万（含）以上	每笔1000元
大于等于200万，小于500万	0.4%
大于等于100万，小于200万	0.8%
大于等于50万，小于100万	1.0%
50万以下	1.2%

申购费用由投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记结算等各项费用。

2）赎回费随基金持有时间的增加而递减，费率如下：

持有基金份额期限	赎回费率（%）
两年以内（含两年）	0.4%
两年-三年（含三年）	0.2%
三年以上	0%

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用在扣除手续费后余额不得低于赎回费总额的25%应当归入基金财产，其余用于支付登记结算费和其他必要的手续费。

3）基金管理人可以在法律法规和本基金合同规定范围内调整申购费率或收费方式和调低赎回费率或收费方式。费率或收费方式如发生变更，基金管理人应在调整实施三个工作日之前在指定媒体上刊登公告。

4）基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情况下根据市场情况制定基金促销计划，经相关代销机构同意后，针对投资者定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后，对投资者适当调低基金申购费率、赎回费率和转换费率。

2、申购份额与赎回金额的计算方式

1）申购份额的计算

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/申购当日基金份额净值。

上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例：假定T日基金份额净值为1.086元，某投资人当日申购本基金10万元，对应的本次前端申购费率为1.20%，该投资人可得到的基金份额为：

净申购金额=100000/（1+1.20%）=98814.23元

申购费用=100000-98522.17=1185.77元

申购份额=98814.23/1.086=90989.16份

即：投资人投资10万元申购本基金，假定申购当日基金份额净值为1.086元，可得到90989.16份基金份额。

2）赎回金额的计算

本基金的净赎回金额为赎回金额扣减赎回费用。其中，

赎回金额=赎回份数×T 日基金单位净值

赎回费用=赎回金额×赎回费率

净赎回金额=赎回金额-赎回费用

上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资者赎回本基金1万份基金份额，持有时间为三年三个月，对应的赎回费率为0%，假设赎回当日基金份额净值是1.150 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总额=10000×1.150=11500 元

赎回费用=11500×0%=0 元

赎回金额=11500-0=11500 元

即：投资者赎回本基金1万份基金份额，持有期限为三年三个月，假设赎回当日基金份额净值是1.150元，则其可得到的赎回金额为11，500元。

十五、《招募说明书》更新部分的说明

根据《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办法》（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》）及其他有关规定，华宝兴业基金管理有限公司对《华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金招募说明书》作如下更新：

1、“四、基金管理人”部分更新了基金管理人的相关情况。

2、“十、基金的投资”部分增加了截至2012 年6月30日的基金的投资组合报告。

3、“十一、基金的业绩”中增加了截至2012 年6月30日的基金业绩数据。

4、“十九、基金托管人”更新了基金托管人的情况和信息。

5、“二十、境外托管人”更新了境外托管人的情况和信息。

6、“二十一、相关服务机构”部分更新了“一、基金份额发售机构”中代销机构的相关信息。

7、“二十二、基金合同的内容摘要”更新了基金管理人的部分信息。

8、“二十三、基金托管协议内容摘要”更新了基金托管当事人的部分信息。

9、“二十四、对基金份额持有人的服务”更新了部分服务内容和信息。

10、“二十五、其他应披露事项”部分，对本报告期内的相关公告作了信息披露。

上述内容仅为摘要，须与本《招募说明书》后面所载之详细资料一并阅读。

华宝兴业基金管理有限公司

2012年10月26日