(上接 B10 版)

[illegible]

(六)天盈 A 和天盈 B 的基金份额参考净值计算

本基金(基金合同)生效后 3 年期内,基金管理人在计算基金资产净值的基础上,采用"虚拟清算"原则分别计算并公告天盈 A 和天盈 B 的基金份额参考净值,其中,天盈 A 的基金份额参考净值计算日不包括天盈 A 的开放日。基金份额参考净值是对两级基金份额价值的一个估算,并不代表基金份额持有人可获得的实际价值。

1、天盈 A 的基金份额参考净值计算

[illegible]

天盈 A、天盈 B 的基金份额参考净值的计算,保留到小数点后 3 位,小数点后第 4 位四舍五入,由此产生的误差计入基金财产。

T 日的天盈 A 和天盈 B 的基金份额参考净值在当天收市后计算,并在 T+1 日内公告。如遇特殊情况,经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。

例 3:本基金(基金合同)生效之日起 3 年内,设自天盈 A 上一次开放日起的运作天数为 40 天,基金运作当年的实际天数为 365 天,基金资产净值为 55 亿元,天盈 A、天盈 B 的份额余额分别为 35 亿份和 15 亿份,天盈 A 上一次开放日设定的天盈 A 年收益率为 4.55%。则天盈 A、天盈 B 的基金份额参考净值计算如下:

[illegible]

二、(基金合同)生效后 3 年期届满时的基金份额转换

基金(基金合同)生效后 3 年期届满,本基金将按照(基金合同)定转换为上市开放式基金(LOF),天盈 A、天盈 B 的基金份额将以各自的基金份额净值为基准转换为上市开放式基金(LOF)份额,并办理基金的申购与赎回业务。

基金(基金合同)生效后 3 年期届满时的基金转换规则

1、份额转换基准日

本基金(基金合同)生效后 3 年期届满日,即本基金基金合同生效之日起 3 年后的对应日,如该日为非工作日,则顺延至下一个工作日。

2、份额转换方式

在份额转换基准日,本基金转换成上市开放式基金(LOF)后的基金份额净值调整为 1.000 元。

在份额转换基准日日终,以份额转换后 1.000 元的基金份额净值为基准,天盈 A、天盈 B 按照各自的基金份额净值转换成上市开放式基金(LOF)份额。

份额转换计算公式:

天盈 A 份额(或天盈 B 份额)的转换比率=份额转换基准日天盈 A(或天盈 B)的基金份额净值/1.000

天盈 A(或天盈 B)基金份额持有人持有的转换后上市开放式基金(LOF)份额=基金份额持有人持有的转换前天盈 A(或天盈 B)的份额数×天盈 A 份额(或天盈 B 份额)的转换比率

在进行份额转换时,天盈 A、天盈 B 的场外份额将转换成上市开放式基金(LOF)场外份额,且均登记在注册登记系统下;天盈 B 的场内份额将转换成上市开放式基金(LOF)场内份额,仍登记在证券登记结算系统下。

在实施基金份额转换时,天盈 A 份额(或天盈 B 份额)的转换比率、天盈 A(或天盈 B)基金份额持有人持有的转换后上市开放式基金(LOF)份额的具体计算见基金管理人届时发布的相关公告。

3、份额转换后的基金运作

天盈 A、天盈 B 的份额全部转换为上市开放式基金(LOF)份额之日起 30 日内,本基金将上市交易,并接受场外与场内申购和赎回。份额转换后本基金上市交易、开始办理申购与赎回的具体日期见基金管理人届时发布的相关公告。

4、份额转换的公告

(1)本基金(基金合同)生效后 3 年期届满时,本基金将转换为上市开放式基金(LOF),基金管理人将依照相关法律法规的规定就本基金进行基金转换的相关事宜进行公告,并报中国证监会备案;

(2)在本基金(基金合同)生效后 3 年期届满日前 30 个工作日,基金管理人将就本基金进行基金转换的相关事宜进行提示性公告。

(3)天盈 A、天盈 B 进行份额转换结束后,基金管理人应在 2 日内在指定媒体公告,并报中国证监会备案。

四、基金转型后基金的投资管理

本基金(基金合同)生效后 3 年期届满,本基金转换为上市开放式基金(LOF)后,本基金的投资目标、投资策略、投资理念、投资范围、投资限制、投资管理程序等将保持不变。

九、基金的投资目标

本基金在追求基金资产长期安全的基础上,力争为基金份额持有人创造高于业绩比较基准的投资收益。

十、基金的投资方向

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国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、短期融资券、资产证券化产品、可转换债券、可分离债券和回购等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益证券品种(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金也可投资于非固定收益类金融工具。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产,但可以参与 A 股股票(包括中小板、创业板及其它经中国证监会核准上市的股票)的新股申购或增发新股,并可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证等,以及法律法规或中国证监会允许投资的其他非固定收益类品种(但须符合中国证监会的相关规定)。因上述原因持有的股票和权证等资产,本基金应在其可交易之日起的 30 个交易日内卖出。

如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。

十一、基金的投资策略

1、资产配置策略

本基金将采用自上而下的方法对基金资产进行动态的整体资产配置和类属资产配置。在认真研判宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上,根据整体资产配置策略动态调整大类金融资产的比例;在充分分析债券市场环境及市场流动性的基础上,根据类属资产配置策略对投资组合类属资产进行最优化配置和调整。

(1)整体资产配置策略

通过对国内外宏观经济状况、市场利率走势、市场资金供求情况,以及证券市场走势、信用风险情况、风险预算和有关法律法规等因素的综合分析,在整体资产之间进行动态配置,确定资产的最优配置比例和相应的风险水平。

(2)类属资产配置策略

在整体资产配置策略的指导下,根据资产的风险来源、收益率水平、利息税务处理以及市场流动性等因素,将市场细分为普通债券(含国债、金融债、央行票据、企业债、短期融资券等)、附权债券(含可转换公司债、各类附权债券等)、资产证券化产品等子市场,采取积极投资策略,定期对投资组合类属资产进行最优化配置和调整,确定类属资产的最优权数。

(3)明细资产配置策略

在明细资产配置上,首先根据明细资产的剩余期限、资产信用等级、流动性指标决定是否纳入组合;其次,根据个别债券的收益率(到期收益率、票面利率、利息支付方式、利息税务处理)与剩余期限的配比,对照基金的收益要求决定是否纳入组合;最后,根据个别债券的流动性指标(发行总量、流通量、上市时间),决定投资总量。

2、普通债券投资策略

本基金在普通债券的投资中主要基于对国家财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪,采用久期控制下的主动性投资策略,主要包括:久期控制、期限结构配置、信用风险控制、跨市场套利和相对价值判断等管理手段,对债券市场、债券收益率曲线以及各种债券价格的变化进行预测,相机而动、积极调整。

(1)久期控制是根据对宏观经济发展状况、金融市场运行特点等因素的分析确定组合的整体久期,有效的控制整体资产风险。

(2)期限结构配置是在确定组合久期后,针对收益率曲线形态特征确定合理的组合期限结构,包括采用集中策略、两端策略和梯形策略等,在长期、中期和短期债券间进行动态调整,从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

(3)信用风险控制是通过对宏观经济形势、基准利率走势、资金面状况、行业以及个券信用状况的研判,积极主动发掘收益充分覆盖风险,甚至在覆盖之余还存在超额收益的投资品种;同时通过行业及个券信用等级限定、久期控制等方式有效控制投资信用风险。

(4)跨市场套利根据不同债券市场间的运行规律和风险特性,构建和调整债券债组合,提高投资收益,实现跨市场套利。

(5)相对价值判断是根据对同类债券的相对价值判断,选择合适的交易时机,增持相对低估、价格将上升的债券,减持相对高估、价格将下降的债券。

3、附权债券投资策略

附权债券指对债券发行体授予某种期权,或者赋予债券投资者某种期权,从而使债券发行体或投资者有了某种灵活的选择余地,从而增强该种金融工具对不同发行体融资的灵活性,也增强对各类投资者的吸引力。当前附权债券的主要种类有可转换公司债券、分离交易可转换公司债券以及含赎回或回售选择权的债券等。

(1)可转换公司债券投资策略

可转换公司债券不同于一般的企业(公司)债券,其投资人具有在一定条件下转股和回售的权利,因此其理论价值应当等于作为普通债券的基础价值加上可转换公司债内含期权价值,是一种既具有债性、又具有股性的混合债券产品,具有抵御价格下行风险,分享股票价格上涨收益的特点。

可转换公司债券最大的优点在于,可以用较小的本金损失,博取股票上涨时的巨大收益。可以充分运用可转换公司债券在风险和收益上的非对称性分布,买入低转换溢价率的债券,并持有的投资策略,只要在可转换公司债券的存续期内,发行转债的公司股票价格上升,则投资就可以获得超额收益。

可转换公司债券可以按照约定价格转换为上市公司的股票,因此在日常交易过程中可能会出现可转换公司债券市场与股票市场之间的套利机会。本基金持有的可转换公司债券可以转换成股票。基金管理人在日常交易过程中,会密切关注可转换公司债券市场与股票市场之间的互动关系,恰当的选择时机进行套利。

(2)其它附权债券投资策略

本基金利用债券市场收益率数据,运用利率模型,计算含赎回或回售选择权的债券的期权调整利差(OAS),作为此类债券投资估值的主要依据。

分离交易可转换公司债券,是认股权证和公司债券的组合产品,该种产品中的公司债券和认股权证可在上市后分别交易,即发行时是组合在一起的,而上市后则自动拆分成公司债券和认股权证。本基金因认购分离交易可转换公司债券所获得的认股权证自可交易之日起 30 个交易日内全部卖出,分离交易可转换公司债券上市后分离出的公司债券的投资按照普通债券投资策略进行管理。

4、资产证券化产品投资策略

证券化是将缺乏流动性但能够产生稳定现金流的资产,通过一定的结构化安排,对资产中的风险与收益进行分离组合,进而转换成可以出售、流通,并带有固定收入的证券的过程。

资产证券化产品的定价受市场利率、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,对资产证券化产品的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析,采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略,投资于资产证券化产品。

5、新股申购策略

为保证新股发行成功,新股发行一级市场价格通常相对二级市场价格存在一定的折价。在中国证券市场发展历程中,参与新股申购是一种风险低、收益稳定的投资行为,为投资人带来较高的投资回报。本基金根据新股发行人的基本情况,以及对认购中签率和新股上市后表现的预期,谨慎参与新股申购,获取股票一级市场与二级市场的价差收益。申购所得的股票在可上市交易后 30 个交易日内全部卖出。

6、投资决策与交易机制

本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。

投资决策委员会负责确定本基金的大类资产配置比例、组合基准久期、回购的最高比例等重大投资决策。

基金经理在投资决策委员会确定的投资范围内制定并实施具体的投资策略,向集中交易室下达投资指令。

集中交易室设立债券交易员,负责执行投资指令,就指令执行过程中的问题及市场面的变化对指令执行的影响等问题及时向基金经理反馈,并可提出基于市场面的具体建议。集中交易室同时负责各项投资限制的监控以及本基金资产与公司旗下其他基金之间的公平交易控制。

7、投资程序

投资决策委员会负责决定基金投资的重大决策。基金经理在授权范围内,制定具体的投资组合方案并执行。集中交易室负责执行投资指令。

(1)基金经理根据市场的趋势、运行的格局和特点,并结合本基金合同、投资风格拟定投资策略报告。

(2)投资策略报告提交给投资决策委员会。投资决策委员会审批决定基金的投资比例、大类资产分布比例、组合基准久期、回购比例等重要事项。

(3)基金经理根据批准后的投资策略确定最终的资产分布比例、组合基准久期和个券投资分布方式等。

(4)对已投资品种进行跟踪,对投资组合进行动态调整。

十二、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为中央国债登记结算有限责任公司编制并发布的中债综合指数。

十三、基金的风险收益特征

从基金资产整体运作来看,本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险与预期收益高于货币市场基金、低于混合型基金和股票型基金。

从本基金所分离的两类基金份额来看,由于本基金资产及收益的分配安排,天盈 A 份额将表现出低风险、收益相对稳定的特征;天盈 B 份额则表现出较高风险、收益相对较高的特征。

十四、基金的投资组合报告

1、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	4,055,286,999.35	94.59
	其中:债券	4,055,286,999.35	94.59
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	100,000,350.00	2.33
	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	31,405,416.88	0.73
6	其他资产	100,676,271.63	2.35
7	合计	4,287,369,037.86	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

3、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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

4、报告期末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	205,533,000.00	5.45
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	3,480,123,599.35	92.28
5	企业短期融资券	10,111,000.00	0.27
6	中期票据	312,401,000.00	8.28
7	可转债	47,118,400.00	1.25
8	其他	-	-
9	合计	4,055,286,999.35	107.54

5、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	1101088	11央行票据 88	1,300,000	125,671,000.00	3.33
2	1180110	11大同建投债	913,920	91,373,721.60	2.42
3	122805	11大同债	720,310	72,031,000.00	1.91
4	122846	11渝富债	662,550	68,242,650.00	1.81
5	122929	09九江债	644,340	66,818,058.00	1.77

6、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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、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

注:本基金本报告期末未持有权证。

8、投资组合报告附注

(1)申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

报告期内本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或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

(2)申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

(3)其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	655,803.91
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	100,020,467.72
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	100,676,271.63

(4)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	113001	中行转债	47,118,400.00	1.25

(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

(6)投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

十五、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。

1、富国天盈分级债券型证券投资基金历史各时间段份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

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
2011.5.23-2011.12.31	2.52%	0.13%	3.89%	0.10%	-1.37%	0.03%
2012.1.1-2012.6.30	7.64%	0.20%	3.00%	0.07%	4.64%	0.13%
2012.7.1-2012.9.30	0.37%	0.06%	-0.15%	0.05%	0.52%	0.01%
2011.5.23-2012.9.30	10.76%	0.15%	6.84%	0.08%	3.92%	0.07%

2、自基金合同生效以来富国天盈分级债券型证券投资基金累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:截止日期为 2012 年 9 月 30 日。

本基金建仓期 6 个月,即从 2011 年 5 月 23 日起至 2011 年 11 月 22 日。建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

十六、费用概览

一、与基金运作有关的费用

(一)与基金运作有关费用列示

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、(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、律师费和诉讼费;

6、基金份额持有人大会费用;

7、基金的证券交易费用;

8、基金的银行汇划费用;

9、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费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。

(二)基金管理费计提方法、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 0.7%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.7%÷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、公休假或不可抗力等,顺延至法定节假日、公休日结束之日起 2 个工作日内支付。

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 0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

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付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等,顺延至法定节假日、公休日结束之日起 2 个工作日内支付。

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。

本基金的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.35%年费率计提。基金销售服务费费的计算方法如下:

H=E×0.35%÷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销售服务费划款指令,基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中划出,由基金管理人按相关合同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等,顺延至法定节假日、公休日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

上述"一、基金费用的种类"中第 4-9 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。

二、与基金销售有关的费用

(一)(基金合同)生效之日起 3 年内基金的申购与赎回费用

1、天盈 A 的申购与赎回费用

(1)天盈 A 不收取申购费用。赎回费用由基金赎回人承担。

(2),投资者可将其持有的全部或部分天盈 A 份额赎回。天盈 A 的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取,赎回费归入基金财产的比例为赎回费总额的 100%。

(3)天盈 A 的赎回费率

以(基金合同)生效后每满 6 个月为天盈 A 的一个开放周期,持有期限为一个开放周期的,天盈 A 的赎回费率为 0.1%;持有期限为一个以上开放周期(不含)的,天盈 A 的赎回费为 0。

(4)基金管理人可以根据(基金合同)的相关约定调整费率或收费方式,基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前 2 个工作日在指定媒体公告。

2、天盈 B 的申购与赎回费用

本基金(基金合同)生效之日起 3 年内,天盈 B 封闭运作并上市交易,封闭期内不接受申购与赎回。

天盈 B 的封闭期为自(基金合同)生效之日起至 3 年后对应日止。如该对应日为非工作日,则顺延至下一个工作日。

(二)(基金合同)生效后 3 年期届满并进行基金转换后的申购与赎回费用

1、本基金不收取申购费用。赎回费用由基金赎回人承担。

2、投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取,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赎回费总额的 25%。

3、本基金的场外赎回费率如下表所示,本基金的场内赎回费率为固定 0.1%:

持有时间	赎回费率
30天以内(含)	0.1%
30天以上	0

4、本基金由原有天盈 A、天盈 B 份额转入的场外份额不收取赎回费;由原有天盈 A、天盈 B 份额转入的场内份额赎回费率为 0.1%。

5、基金管理人可以根据(基金合同)的相关约定调整费率或收费方式,基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前 2 个工作日在指定媒体公告。

三、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。

四、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 日在指定媒体上公告。

五、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十七、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》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求,对本基金招募说明书进行了更新,主要更新内容如下:

1、重要提示"部分增加了更新招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。

2、"三、基金管理人"部分对基金管理人概况、主要人员情况等内容进行了更新。

3、"四、基金托管人"部分对基金托管人主要人员情况、基金托管业务经营情况等内容进行了更新。

4、"五、相关服务机构"部分对直销机构、代销机构等信息进行了更新。

5、"十、基金份额的申购与赎回"部分新增了天盈 A 第三个开放申购赎回日。

6、"十三、基金的投资"部分对投资组合报告内容更新至 2012 年 9 月 30 日。

7、"十四、基金的业绩"部分对基金业绩更新至 2012 年 9 月 30 日,并更新了历史走势对比图。

8、"二十四、基金托管协议的内容摘要"部分对基金管理人联系人进行了更新。

9、"二十六、其它应披露事项"部分对本报告期内的应披露事项予以更新。

富国基金管理有限公司

二〇一二年十二月二十二日

证券代码:600077 证券简称:宋都股份 公告编号:临 2012-048

宋都基业投资股份有限公司 第七届董事会第三十三次会议决议公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、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。

宋都基业投资股份有限公司第七届董事会第三十三次会议于 2012 年 12 月 16 日以传真或电子邮件方式发出通知,于 2012 年 12 月 21 日以通讯表决的方式召开。应当参加表决的董事 7 名,实际参加表决董事 7 名。会议符合《公司法》和《公司章程》的有关规定。

会议审议并通过了以下决议:

一、审议通过了《关于公司新增对外担保额度的议案》

为了满足公司贷款、信托、股权等融资需要,董事会提请股东大会批准公司如下对外担保(以限于本公司与子公司相互间以及各子公司相互间提供的担保,不含对本公司及子公司以外的第三方提供的担保):

1、在公司已发生的对外担保的基础上,2013 年 1 月至 2013 年 12 月期间新增对外担保额度总额不超过 30 亿元;

2、单笔对外担保额度不超过 10 亿元。

3、在股东大会批准上述担保事项的前提下,授权公司董事长在上述额度范围内审批具体的担保事宜(包含《上海证券交易所股票上市规则》和《公司章程》规定的需要提交股东大会审批的全部担保情形),公司董事长在额度内批准担保后应在每季度末向董事会通报,特别重大的担保应在月末向董事会通报。

4、在不超过上述已审批总额度的情况下,公司可依据各子公司的实际融资额度适当调整担保对象和担保额度。

该议案尚需提交股东大会审议。具体内容详见公司同日在上海证券交易所网站披露的《宋都股份关于公司预计新增对子公司担保的公告》。

表决结果:同意 7 票、反对 0 票、弃权 0 票。

二、审议通过了《关于公司调整 A 股股票期权激励计划股票期权数量及行权价格的议案》

根据上市规则的有关规定,作为公司 A 股股票期权激励计划的激励对象,汪萍女士、龚睿先生构成关联董事,对本议案回避表决,其他 5 名非关联董事参加了表决。具体内容详见公司同日在上海证券交易所网站披露的《宋都股份关于调整 A 股股票期权激励计划股票期权数量及行权价格的公告》。

表决结果:同意 5 票、反对 0 票、弃权 0 票。

股东大会召开时间另行通知。

特此公告

宋都基业投资股份有限公司

董事会

2012年 12 月 21 日

证券代码:600077 证券简称:宋都股份 公告编号:临 2012-049

宋都基业投资股份有限公司 关于公司预计新增对子公司担保的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、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。

为了满足公司贷款、信托、股权等融资需要,公司第七届董事会第三十三次会议审议通过了《关于公司新增对外担保额度的议案》,董事会同意提请公司股东大会批准公司在已发生的对外担保的基础上,2013 年 1 月至 2013 年 12 月期间预计新增对外担保(以限于本公司与子公司相互间以及各子公司相互间提供的担保,不含对本公司及子公司以外的第三方提供的担保)额度总额不超过 30 亿元,且单笔担保不超过 10 亿元,并提请公司股东大会批准上述担保事项的前提下,授权公司董事长在上述额度范围内审批具体的担保事宜(包含《上海证券交易所股票上市规则》和《公司章程》规定的需要提交股东大会审批的全部担保情形),公司董事长在额度内批准担保后应在每季末向董事会通报,特别重大的担保应在月末向董事会通报;并提请股东大会授权在不超过上述已审批总额度的情况下,公司可依据各子公司的实际融资额度适当调整担保对象和担保额度。

一、本公司或全资控股子公司杭州宋都房地产集团有限公司(以下简称:宋都集团)预计对控股子公司的新增银行融资担保情况概述:

1、对南京南郡房地产开发有限公司新增担保 130,000 万元,用于南郡国际项目的开发。

2、对绍兴县宋都房地产开发有限公司新增担保 30,000 万元,用于绍兴项目的开发及归还往来款。

3、对桐庐大奇山郡置业有限公司新增担保 30,000 万元,用于大奇山郡项目的开发。

4、对建德宋都置业有限公司新增担保 30,000 万元,用于建德项目的开发。

5、对浙江东霖房地产开发有限公司新增担保 80,000 万元,用于阳光国际项目的开发。

二、被担保人及担保基本情况及担保的主要内容

1、对南京南郡房地产开发有限公司提供融资担保 130,000 万元

南京南郡房地产开发有限公司注册资本 2,000 万元,公司持有其 100%的股份,主营业务为房地产开发经营。公司成立于 2012 年 12 月 10 日,目前公司尚在注册成立阶段;被担保资金主要用于南京南郡国际项目的开发。

2、对绍兴县宋都房地产开发有限公司提供融资担保 30,000 万元

绍兴县宋都房地产开发有限公司注册资本 5,000 万元,公司持有其 100%的股份,主营业务为房地产开发经营;商品房出售;房屋租赁。2011 年主营业务收入 2.00 万元,2011 年净利润-361.91 万元,截至 2011 年 12 月 31 日,净资产 11,235.73 万元;截至 2012 年 9 月,主营业务收入 81.26 万元,净利润-86.01 万元,截至 2012 年 9 月 30 日,净资产 11,149.72 万元;被担保资金主要用于绍兴项目的开发及归还往来款。

3、对桐庐大奇山郡置业有限公司提供融资担保 30,000 万元

桐庐大奇山郡置业有限公司注册资本 20,000 万元,公司持有其 50%的股份,主营业务为房地产开发经营;商品房出售;房屋租赁。2011 年主营业务收入 2.28 万元,2011 年净利润-1,533.08 万元,截至 2011 年 12 月 31 日,净资产 17,347.57 万元;截至 2012 年 9 月,主营业务收入 0 万元,净利润-787.74 万元,截至 2012 年 9 月 30 日,净资产 16,560.43 万元;被担保资金主要用于大奇山郡项目开发,其他股东将按持股比例提供相应额度的担保。

4、对建德宋都置业有限公司提供融资增担保 30,000 万元

建德宋都置业有限公司注册资本 600 万元,公司持有其 100%的股份,主营业务为房屋建设及城市土地开发经营;商品房出售;房屋租赁。2011 年主营业务收入 0 万元,2011 年净利润-140.11 万元,截至 2011 年 12 月 31 日,净资产 395.66 万元;截至 2012 年 9 月,主营业务收入 0 万元,净利润-108.83 万元,截至 2012 年 9 月 30 日,净资产 286.83 万元;被担保资金主要用于建德项目开发。

5、对浙江东霖房地产开发有限公司提供融资增担保 80,000 万元

浙江东霖房地产开发有限公司注册资本 30,000 万元,公司持有其 100%的股份,主营业务为九堡镇杨公村开发经营多种档次的住宅、公寓及配套设施。2011 年主营业务收入 71,823.66 万元,2011 年净利润 17,907.19 万元,截至 2011 年 12 月 31 日,净资产 43,107.39 万元;截至 2012 年 9 月,主营业务收入 133,283.12 万元,净利润 35,719.99 万元,截至 2012 年 9 月 30 日,净资产 77,929.59 万元;被担保资金主要用于阳光国际项目的开发。

上述担保事项已经公司第七届董事会第三十三次会议审议通过,董事会同意提请公司股东大会批准公司在已发生的对外担保的基础上,2013 年 1 月至 2013 年 12 月期间预计新增对外担保(以限于本公司与子公司相互间以及各子公司相互间提供的担保,不含对本公司及子公司以外的第三方提供的担保)额度总额不超过 30 亿元,且单笔担保不超过 10 亿元,并提请公司股东大会批准上述担保事项的前提下,授权公司董事会主席在上述额度范围内审批具体的担保事宜(包含《上海证券交易所股票上市规则》和《公司章程》规定的需要提交股东大会审批的全部担保情形),公司董事长在额度内批准担保后应在每季末向董事会通报,特别重大的担保应在月末向董事会通报;并提请股东大会授权在不超过上述已审批总额度的情况下,公司可依据各子公司的实际融资额度适当调整担保对象和担保额度。公司将按照相关规定,在上述担保事项实际发生后再根据实际情况及时履行信息披露义务。

三、董事会意见

本公司董事会经认真审议并审慎判断,认为上述担保事项均为本公司为控股子公司或控股子公司相互间提供的担保,且提供担保的资金主要用于项目开发等生产经营,不存在与中国证监会证监发[2003]56 号文《关于规范上市公司与关联方资金往来及上市公司对外担保若干问题的通知》及证监发[2005]120 号文《关于规范上市公司对外担保行为的通知》相违背的情况。公司将通过完善担保管理、加强内部控制、监控被担保人的合同履行情况,强化担保管理,降低担保风险。

四、累计对外担保数量及逾期担保的数量

截止 2012 年 11 月末,本公司及控股子公司对外担保总额为 335,797.125 万元,占本公司 2012 年 9 月末未经审计净资产的 160.86%,公司无逾期担保事项,也不存在涉及诉讼及因担保被判决而应承担的事项。

特此公告

宋都基业投资股份有限公司

2012年 12 月 21 日

证券代码:600077 证券简称:宋都股份 公告编号:临 2012-050

宋都基业投资股份有限公司 关于调整 A 股股票期权激励计划股票期权数量及行权价格的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、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。

宋都基业投资股份有限公司(以下简称"公司")第七届董事会第三十三次会议审议通过了《关于公司调整 A 股股票期权激励计划股票期权数量及行权价格的议案》,有关事项详细如下:

一、股票期权激励计划简述

宋都基业投资股份有限公司《公司 A 股股票期权激励计划(草案修订稿)》(以下简称"股票期权激励计划")经公司第七届第十九次董事会审议通过,并经中国证监会备案审核无异议后,由公司 2012 年第一次临时股东大会审议批准实施。2012 年 3 月 16 日,公司进行了 A 股股票期权激励计划首次授予。

二、调整事由及调整方法

鉴于公司于 2012 年 7 月 11 日实施了 2011 年度分红派息方案,根据公司股东大会的授权,董事会对公司授出的股票期权数量及行权价格作如下调整:

公司 2011 年度股东大会审议通过 2011 年度利润分配及资本公积金转增股本方案,向全体股东每 10 股派发现金股利 0.6 元(含税),资本公积金每 10 股转增 10 股。

根据公司《股票期权激励计划》,若在行权前有派息、资本公积金转增股份、派送股票红利、股票拆细或缩股、配股或增发等事项,对公司股票期权激励计划的股票期权数量及行权价格进行调整如下:

$Q=Q_0 \times (1+n)=2,603.61\times(1+1)=5,207.22$(万份)

$P=(P_0-V)\div(1+n)=(9.17-0.06)\div(1+1)=4.56$(元)

其中:Q_0 为调整前的股票期权数量;n 为每股的资本公积转增股本的比率(即每股股票经转增后增加的股票数量);Q 为调整后的股票期权数量;P_0 为调整前的行权价格;P 为调整后的行权价格;V 为每股的派息额。

公司本次股票期权激励计划的股票期权数量由 2,603.61 万份调整为 5,207.22 万份,行权价格由 9.17 元调整为 4.56 元。

三、律师意见

公司本次股票期权激励计划的调整已获得了必要的授权和批准;其调整方法和程序符合公司《股票期权激励计划》、《激励管理办法》、《公司法》及《公司章程》的相关规定。

四、备查文件

1、第七届董事会第三十三次会议决议;

2、浙江天册律师事务所关于宋都基业投资股份有限公司调整 A 股股票期权激励计划股票期权数量及行权价格的法律意见书。

特此公告