(上接B6版)

中国平安股权结构较为分散,不存在依其持有的股份所享有的表决权足以对中国平安股东大会的决议产生重大影响的股东。中国平安不存在《公司法》第二百一十六条所规定的控股股东及实际控制人。

(二)主要财务数据

中国平安最近三年及一期的财务数据如下:

单位:人民币百万元

项目	2014年3月31日	2013年12月31日	2012年12月31日	2011年12月31日
总资产	3,661,234	3,360,312	2,844,266	2,285,424
股东权益	3,408,719	239,705	209,649	171,342
归属于母公司股东权益	252,515	182,709	159,617	130,867
项目	2014年1季度	2013年度	2012年度	2011年度
营业收入	131,154	362,631	299,372	248,915
利润总额	16,662	46,224	32,338	30,026
净利润	12,993	36,014	26,750	22,582
归属于母公司股东的净利润	10,809	28,154	20,050	19,475
归属于上市公司股东的扣除非经常性损益的净利润	10,807	28,348	20,098	19,435
经营活动产生的现金流量净额	106,400	217,138	280,897	75,348
基本每股收益 (元/股)	1.37	3.56	2.53	2.50
每股经营活动产生的现金流量净额 (元/股)	13.44	27.43	35.48	9.52
加权平均净资产收益率	5.7%	16.4%	13.8%	16.0%

(三)关联关系构成说明

截至2014年3月31日,中国平安及其控股子公司平安寿险合计持有公司约59%的股份,中国平安为公司的控股股东,因此中国平安认购本次非公开发行普通股构成关联交易。

三、关联交易的定价政策及定价依据

(一)定价方式

本次发行的定价基准日为公司第九届董事会第五次会议决议公告日。本次发行的发行价格不低于定价基准日前20个交易日公司股票交易均价的95%,即不低于9.34元/股。若公司股票在定价基准日至发行日期间发生派息、送股、资本公积金转增股本等除权除息事项,将对发行底价作相应调整。

最终发行价格将在公司取得中国证监会发行核准批文后,按照《上市公司非公开发行股票实施细则》的规定以竞价方式确定。中国平安不参与本次发行定价的市场询价过程,但接受市场询价结果并与其他投资者以相同价格认购。

(二)定价的公允性

本次非公开发行的定价原则符合《中华人民共和国公司法》、《中华人民共和国证券法》以及中国证监会发布的《上市公司证券发行管理办法》、《上市公司非公开发行股票实施细则》的相关规定。本次关联交易以不优于对非关联方同类交易的条件进行定价,交易条件公平、合理。

四、普通股认购协议摘要

(一)协议主体和签订时间

本协议由平安银行和中国平安于2014年7月15日签署。

(二)认购数量、认购价格、限售期

1、认购数量

平安银行本次发行人民币普通股(A股)数量为不超过1,070,663,811股。根据本协议的约定,中国平安认购本次发行人民币普通股数量的45%-50%,每股面值为人民币壹圆。该等股份不附带任何权利限制。若平安银行股票在本次非公开发行的定价基准日至发行日期间发生派息、送股、资本公积转增股本等除权、除息事项的,本次非公开发行的发行数量将相应调整。中国平安同意在可行的情况下尽早确定认购新发行股份的数量,其实际认购的股份数量应以通知的形式,最迟不晚于确定其他认购对象之前予以明确,并应以中国证监会最终核准的结果为准。

2、认购价格

本次发行的发行价格不低于定价基准日前20个交易日平安银行股票交易均价的95%,即不低于9.34元/股。若平安银行股票在定价基准日至发行日期间发生派息、送股、资本公积金转增股本等除权除息事项,将对发行底价作相应调整。最终发行价格将在平安银行取得中国证监会发行核准批文后,按照《上市公司非公开发行股票实施细则》的规定以竞价方式确定。中国平安同意不参与本次发行定价的市场询价过程,但接受市场询价结果并与其他投资者以相同价格认购。

3、限售期

在成交后的三十六(36)个月内,中国平安不得转让任何新发行股份。但是,在适用法律许可的前提下,在中国平安关联机构之间进行转让不受此限。

(三)协议的生效条件和生效时间

本协议经平安银行和中国平安签署后成立,在下述条件全部满足后立即生效:

1、经平安银行董事会、股东大会批准;

2、取得中国银监会和中国证监会的核准;

3、其他主管机关对本协议的批准(如需)。

(四)违约责任条款

在不抵触本协议责任限制条款的前提下,如因任何一方违反其在本协议下的任何声明保证或违反其在本协议项下的任何承诺或义务而(直接或间接地)导致对方蒙受任何损失、承担任何责任和/或发生任何费用(包括利息、合理的法律服务费和其它专家费用),则违约的一方应全额补偿守约的一方。

五、本次关联交易的目的以及对公司的影响

(一)本次关联交易的目的

近年来,与全球金融监管改革步调一致,中国银监会持续加强审慎监管力度,陆续出台新监管标准。中国银监会颁布的《商业银行资本管理办法(试行)》,自2013年1月1日起施行,对商业银行资本管理提出了更高的要求。

为了满足公司各项业务持续稳定发展的资金需求,适应中国银监会日趋严格的资本监管要求,公司有必要进一步提高资本充足率,以应对国内外经济的快速变化与挑战,实现稳健经营,提高风险抵御能力,在促进公司更好更快发展的同时为全体股东带来更丰厚的回报。

(二)对公司经营及资本状况的影响

本次非公开发行有助于本公司提高资本充足率,从而增加抵御风险能力,增强竞争力并获得更多业务发展机会。本次非公开发行对本公司的经营管理和财务状况产生的影响主要表现在:

1、对净资产、每股净资产和净资产收益率的影响

通过本次非公开发行,公司净资产规模将增加。本次非公开发行在短期内可能对公司的每股净资产和净资产收益率产生一定的摊薄,但长期来看,随着募集资金逐步产生效益,将对提升公司的每股净资产和净资产收益率产生积极的影响。

2、对资本充足率的影响

本次发行募集资金到位后将用于补充公司核心一级资本,公司的资本充足率和核心一级资本充足率将进一步提高,抗风险能力进一步增强。

(三)对盈利能力的影响

通过本次发行,将有助于推动公司各项业务的快速发展,进一步提高公司的盈利能力。

六、公司与中国平安及其子公司累计已发生的各类关联交易的总金额

截至2013年12月31日,中国平安及其子公司与本公司发生的各类关联交易期末情况如下:

单位:人民币百万元

项目	2013年12月31日
应收款项类投资	100
应收利息	3
其他资产	122
同业及其他金融机构存放款项	9,523
吸收存款	38,075
应付债券	–
应付利息	817
其他负债	57
授信额度	9,000
开出保函	6

2013年1至12月,中国平安及其子公司与本公司发生的各类关联交易情况如下:

单位:人民币百万元

项目	2013年1至12月
应收款类债券利息收入	4
代理手续费收入	153
托管手续费收入	202
同业及其他金融机构存放款项利息支出	151
吸收存款利息支出	1,667
应付债券利息支出	10
保费支出	85
经营租赁支出	76
服务费支出	1,098

2013年12月31日至本公告披露日,中国平安及其子公司与本公司未发生其它未经披露的重大关联交易。

七、独立董事意见

本公司独立董事马林、储一昀、王春汉、王松奇、韩小京对中国平安认购本次非公开发行普通股进行了事先认可,同意将本次非公开发行普通股暨关联交易相关事项提交董事会审议。

本公司独立董事发表了独立意见,认为:

一、本次发行符合《上市公司证券发行管理办法》、《上市公司非公开发行股票实施细则》等相关法律法规及公司章程的相关规定,对公司及全体股东是公平的,符合公司的利益。

二、本次发行的发行价格不低于定价基准日前20个交易日公司股票交易均价的95%,即不低于9.34元/股。在本次发行定价基准日至发行日期间,若公司发生权益分派、公积金转增股本或配股等除息、除权行为,本次发行的发行底价将作相应调整,发行数量也将随之进行相应调整(如需)。最终发行价格将在公司取得中国证监会发行核准批文后,按照《上市公司非公开发行股票实施细则》的规定以竞价方式确定。本次发行的定价原则符合《中华人民共和国公司法》、《中华人民共和国证券法》以及中国证监会发布的《上市公司证券发行管理办法》、《上市公司非公开发行股票实施细则》等有关法律法规的规定与要求。本次发行定价公允,不存在损害公司及其股东利益的情形。

三、本次发行方案已经公司第九届董事会第五次会议审议通过,董事会会议的召集和召开程序、表决程序符合《深圳证券交易所股票上市规则》和公司章程的规定,形成的决议合法、有效。本次发行尚需股东大会审议通过。届时,公司将向普通股股东提供网络投票,充分尊重和保护公司中小股东的合法权益。

四、中国平安认购本次非公开发行普通股构成公司关联交易。根据平等互利原则,中国平安已于2014年7月15日与公司签署了附条件生效的普通股认购协议,承诺不参与本次发行定价的市场询价过程,但接受市场询价结果并与其他投资者以相同价格认购,认购比例为本次发行数量的45%-50%。本次关联交易条件公平、合理,认购协议的条款及签署程序合法合规,不会损害公司及股东、特别是中小股东的利益。

五、公司董事会审议本次关联交易所涉相关事项时,关联董事已回避表决,决策程序符合有关监管要求和公司章程的有关规定。公司股东大会审议本次关联交易所涉相关事项时,关联股东将回避表决。

备查文件

1、第九届董事会第五次会议决议

2、平安银行股份有限公司关于非公开发行普通股的独立董事意见函

3、《平安银行股份有限公司和中国平安保险(集团)股份有限公司关于普通股之认购协议》

平安银行股份有限公司董事会

2014年7月16日

证券代码:000001　　证券简称:平安银行　　公告编号:2014-029

平安银行股份有限公司关于召开2014年第二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、召开会议基本情况

(一)股东大会届次:平安银行股份有限公司2014年第二次临时股东大会。

(二)召集人:平安银行股份有限公司第九届董事会。

(三)会议召开的合法合规性说明:本公司第九届董事会第五次会议审议通过了《关于召开平安银行股份有限公司2014年第二次临时股东大会的议案》。本公司董事会认为本次临时股东大会的召开符合有关法律、法规、规章和公司章程的规定。

(四)召开时间

1、现场会议召开时间:2014年8月4日下午14:30。

2、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时间为2014年8月4日9:30-11:30,13:00-15:00;通过深圳证券交易所互联网投票系统投票的时间为2014年8月3日15:00至2014年8月4日15:00期间的任意时间。

公司将在2014年7月26日发布《平安银行股份有限公司关于召开2014年第二次临时股东大会的提示性公告》。

(五)现场会议召开地点:深圳市深南东路5047号本公司六楼多功能会议厅。

(六)召开方式:采取现场投票与网络投票相结合的方式。公司将通过深圳证券交易所系统和互联网投票系统(http://wltp.cninfo.com.cn)向公司股东提供网络形式的投票平台,股东可以在网络投票时间内通过上述系统行使表决权。

(七)投票规则:公司股东只能选择现场投票、深圳证券交易所交易系统投票、深圳证券交易所互联网投票系统投票中的一种方式表决,同一表决权出现重复表决的,以第一次有效表决结果为准。

(八)出席对象

1、截至2014年7月24日下午收市后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、公司董事、监事和高级管理人员。

3、公司聘请的律师。

二、会议审议事项

(一)审议《平安银行股份有限公司关于符合非公开发行优先股条件的议案》;

(二)逐项审议《平安银行股份有限公司关于非公开发行优先股方案的议案》:

1、本次发行的种类和发行数量

2、票面金额和发行价格

3、募集资金用途

4、发行方式和发行对象

5、优先股股东参与分配利润的方式

6、转股条款

7、回购条款

8、表决权限制与恢复条款

9、本次发行股东大会决议的有效期

10、评级安排

11、担保安排

12、转让和交易安排

13、本次优先股授权事宜

(三)审议《平安银行股份有限公司关于与特定对象签署附条件生效的优先股认购协议的议案》;

(四)审议《平安银行股份有限公司关于符合非公开发行普通股的议案》;

(五)逐项审议《平安银行股份有限公司关于非公开发行普通股方案的议案》:

1、本次发行股票的种类和面值

2、发行方式

3、发行数量

4、发行对象

5、发行价格及定价方式

6、本次发行普通股的限售期

7、募集资金数额及用途

8、上市地

9、本次非公开发行完成前滚存未分配利润的安排

10、本次发行股东大会决议的有效期

11、本次普通股授权事宜

(六)审议《平安银行股份有限公司关于非公开发行普通股募集资金使用可行性报告的议案》;

(七)审议《平安银行股份有限公司关于前次募集资金使用情况报告的议案》;

(八)审议《关于修订<平安银行股份有限公司章程>及其附件的议案》;

(九)审议《关于平安银行股份有限公司资本管理规划(2014年-2016年)的议案》;

(十)审议《平安银行股份有限公司关于变更注册资本的议案》。

上述议案第(二)项、第(三)项、第(五)项、第(八)项、第(十)项是特别决议案,其他议案是普通决议案。

上述各项议案的具体内容,请见本公司于2014年7月16日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》及巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn)上披露的《平安银行股份有限公司董事会决议公告》等有关公告。

三、现场股东大会会议登记方法

(一)登记方法

1、凡出席会议的个人股东应出示本人身份证和有效持股凭证,委托他人代理出席会议的,代理人应出示本人身份证、委托人身份证复印件、授权委托书和有效持股凭证。

2、法人股东由法定代表人出席会议的,应出示加盖单位公章的法人营业执照复印件、法人股东有效持股凭证、法定代表人本人身份证、能证明其具有法定代表人资格的有效证明;委托代理人出席会议的,代理人应出示加盖单位公章的法人营业执照复印件、法人股东有效持股凭证、代理人本人身份证、授权委托书。

本公司提请各股东注意,法人股东的法定代表人、个人股东、股东代理人现场参会时未能完整提供上述文件供本公司核验的,本公司将有权拒绝承认其参会或表决资格。

(二)登记时间:2014年8月4日下午12:30-14:15;

(三)登记地点:深圳市深南东路5047号本公司大会登记处;

(四)参加现场会议的股东及代理人的表决票将在现场发放。

四、采用交易系统进行网络投票的程序

(一)投票代码与投票简称

投票代码:360001　　投票简称:平安投票

(二)投票时间

通过深圳证券交易所系统进行网络投票的时间为2014年8月4日9:30-11:30,13:00-15:00。

(三)在投票当日,平安投票“昨日收盘价”显示的数字为本次股东大会审议的议案总数。

(四)具体投票程序

1、买卖方向为买入;

2、在“委托价格”项下填报股东大会议案序号,100.00代表总议案,1.00元代表议案(一),2.00元代表议案(二),依次类推。每一议案应以相应的委托价格分别申报。如股东对所有议案(包括议案的子议项)均表示相同意见,则可以只对“总议案”进行投票。本次股东大会需表决的议案事项及对应申报价格如下表所示:

议案序号	议案内容	对应申报价格
总议案	全部下述十个议案	100.00
(一)	审议《平安银行股份有限公司关于符合非公开发行优先股条件的议案》	1.00
(二)	逐项审议《平安银行股份有限公司关于非公开发行优先股方案的议案》:	2.00
	1、本次发行的种类和发行数量	2.01
	2、票面金额和发行价格	2.02
	3、募集资金用途	2.03
	4、发行方式和发行对象	2.04
	5、优先股股东参与分配利润的方式	2.05
	6、转股条款	2.06
	7、回购条款	2.07
	8、表决权限制与恢复条款	2.08
	9、本次发行股东大会决议的有效期	2.09
	10、评级安排	2.10
	11、担保安排	2.11
	12、转让和交易安排	2.12
	13、本次优先股授权事宜	2.13
(三)	审议《平安银行股份有限公司关于与特定对象签署附条件生效的优先股认购协议的议案》	3.00
(四)	审议《平安银行股份有限公司关于符合非公开发行普通股条件的议案》	4.00
(五)	逐项审议《平安银行股份有限公司关于非公开发行普通股方案的议案》:	5.00
	1、本次发行股票的种类和面值	5.01
	2、发行方式	5.02
	3、发行数量	5.03
	4、发行对象	5.04
	5、发行价格及定价方式	5.05
	6、本次发行普通股的限售期	5.06
	7、募集资金数额及用途	5.07
	8、上市地	5.08
	9、本次非公开发行完成前滚存未分配利润的安排	5.09
	10、本次发行股东大会决议的有效期	5.10
	11、本次普通股授权事宜	5.11
(六)	审议《平安银行股份有限公司关于非公开发行普通股募集资金使用可行性报告的议案》	6.00
(七)	审议《平安银行股份有限公司关于前次募集资金使用情况报告的议案》	7.00
(八)	审议《关于修订<平安银行股份有限公司章程>及其附件的议案》	8.00
(九)	审议《关于平安银行股份有限公司资本管理规划(2014年-2016年)的议案》	9.00
(十)	审议《平安银行股份有限公司关于变更注册资本的议案》	10.00

注:对总议案100.00进行投票视为对本次会议所有审议事项表达相同意见的一次性表决。议案(二)含13个议项,对2.00进行投票视为对议案(二)全部议项表达相同意见;议案(五)含11个议项,对5.00进行投票视为对议案(五)全部议项表达相同意见。股东通过网络投票系统对总议案与单项议案重复投票的,以第一次有效投票为准。如股东先对某议案投票表决,再对总议案投票表决,则该议案以先表决的意见为准,其他未表决的议案以总议案的表决意见为准。若股东先对总议案投票表决,再对某议案投票表决,则以总议案的表决意见为准。

3、在“委托股数”项目下填报表决意见,1股代表同意,2股代表反对,3股代表弃权。如下表:

表决意见种类	对应的申报股数
同意	1股
反对	2股
弃权	3股

4、对每一议案的表决,一经投票,不能撤单;

5、不符合上述要求的表决申报无效,视为未参与投票。

五、采用互联网投票系统的身份认证与投票程序

(一)股东获取身份认证的流程

按照《深圳证券交易所投资者网络服务身份认证业务实施细则》的规定,股东可以采用服务密码或数字证书的方式进行身份认证。申请服务密码的,请登录网址http://wltp.cninfo.com.cn的“密码服务专区”注册,填写相关信息并设置服务密码。如服务密码激活指令在上午11:30前发出,当日下午13:00即可使用;如果服务密码激活指令在上午11:30之后发出,次日方可使用。申请数字证书的,可向深圳证券信息公司或其委托的代理发证机构申请。

(二)股东根据服务密码或数字证书登陆网站http://wltp.cninfo.com.cn进行网络投票系统投票。

(三)投票时间

通过深圳证券交易所互联网投票系统投票的时间为2014年8月3日15:00至2014年8月4日15:00期间的任意时间。

六、网络投票其他注意事项

通过深交所交易系统或互联网投票系统进行网络投票的,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。

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。

七、其他事项

(一)会议联系方式:

联系人:平安银行股份有限公司董事会办公室

联系电话:0755-82080387

传真:0755-82080386

(二)会议费用:

费用自理。

(三)网络投票系统异常情况的处理方式:网络投票期间,如网络投票系统遇突发重大事件的影响,则本次股东大会的进程按当日通知进行。

八、备案文件

《平安银行股份有限公司第九届董事会第五次会议决议公告》

特此通知。

平安银行股份有限公司
董事会
2014年7月16日

附件:授权委托书格式

授权委托书

平安银行股份有限公司:

兹委托　　先生(女士)代表本人(本单位)出席平安银行股份有限公司2014年第二次临时股东大会,并代表本人(本单位)对会议审议的各项议案按照本授权委托书的指示行使议案表决权,如没有作出指示,代理人有权按照自己的意愿表决,并代为签署本次会议需要签署的相关文件。

委托人对下述议案表决如下:

序号	议案名称	同意	反对	弃权
(一)	审议《平安银行股份有限公司关于符合非公开发行优先股条件的议案》			
(二)	逐项审议《平安银行股份有限公司关于非公开发行优先股方案的议案》:			
	1、本次发行的种类和发行数量			
	2、票面金额和发行价格			
	3、募集资金用途			
	4、发行方式和发行对象			
	5、优先股股东参与分配利润的方式			
	6、转股条款			
	7、回购条款			
	8、表决权限制与恢复条款			
	9、本次发行股东大会决议的有效期			
	10、评级安排			
	11、担保安排			
	12、转让和交易安排			
	13、本次优先股授权事宜			
(三)	审议《平安银行股份有限公司关于与特定对象签署附条件生效的优先股认购协议的议案》			
(四)	审议《平安银行股份有限公司关于符合非公开发行普通股条件的议案》			
(五)	逐项审议《平安银行股份有限公司关于非公开发行普通股方案的议案》:			
	1、本次发行股票的种类和面值			
	2、发行方式			
	3、发行数量			
	4、发行对象			
	5、发行价格及定价方式			
	6、本次发行普通股的限售期			
	7、募集资金数额及用途			
	8、上市地			
	9、本次非公开发行完成前滚存未分配利润的安排			
	10、本次发行股东大会决议的有效期			
	11、本次普通股授权事宜			
(六)	审议《平安银行股份有限公司关于非公开发行普通股募集资金使用可行性报告的议案》			
(七)	审议《平安银行股份有限公司关于前次募集资金使用情况报告的议案》			
(八)	审议《关于修订<平安银行股份有限公司章程>及其附件的议案》			
(九)	审议《关于平安银行股份有限公司资本管理规划(2014年-2016年)的议案》			
(十)	审议《平安银行股份有限公司关于变更注册资本的议案》			

注:1、本表决票只能用“√”填写,其他符号、数字无效;

2、每项议案只能有一个表决意见,即只能在“同意”、“反对”、“弃权”三栏中任一栏打“√”;

3、未填、错填、字迹无法辨认的表决票或未投的表决票均视为投票人放弃表决权利,其表决结果计为“弃权”。

委托人姓名:　　委托人身份证号码:

委托人持股数量(股):　　委托人股东账号:

受托人姓名:　　受托人身份证号码:

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

证券代码:000001　　证券简称:平安银行　　公告编号:2014-030

平安银行股份有限公司复牌公告

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。

平安银行股份有限公司(以下简称“公司”)因筹划重大事项,按照有关规定,经公司申请,公司股票自2014年7月15日开市起停牌。2014年7月15日,公司召开董事会审议了相关议案,具体事项请见本公司于2014年7月16日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》及巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn)上披露的相关公告。

经公司申请,公司股票自2014年7月16日开市起复牌。

特此公告。

平安银行股份有限公司
董事会
2014年7月16日

(上接B8版)

公司网站:www.noah-fund.com

(109) 上海长量

注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

办公地址:上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层

法定代表人:张跃伟

联系人:单丙烨

电话:021-20691835

传真:021-20691861

客服电话:400-089-1289

公司网站:www.erichfund.com

(110) 深圳新兰德

注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#

办公地址:北京市西城区金融大街35号国企大厦C座9层

法定代表人:陈操

联系人:刘定文

电话:010-58325395

传真:010-58325282

客户服务电话:4008507771

公司网站:https://tjrj.com

(111) 晟视天下

注册地址:北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室

办公地址:北京市朝阳区朝外大街甲6号万通中心D座28层

法定代表人:蔡俊

联系人:徐长征、崔乐乐

电话:01058170943,01058170949

传真:01058170800

客户服务电话:4008188866

公司网站:www.shengshiview.com

(112) 数米基金

注册地址:杭州市余杭区仓前街文一西路1218号1幢202室

办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼

法定代表人:陈柏青

联系人:张裕

联系电话:021-60897840

客户服务电话:4000-766-123

传真:021-26609703

网址:http://www.fund123.cn/

(113) 天天基金

注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层

办公地址:上海市徐汇区龙田路195号3C座10楼

法定代表人:其实

联系人:潘世友

联系电话:021-54509998

客户服务电话:400-1818-188

传真:021-64385308

网址:www.1234567.com.cn

(114) 同花顺

注册地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室

办公地址:浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼2楼

法定代表人:凌顺平

联系人:胡璇

联系电话:0571-88911818

客户服务电话:0571-88920897,4008-773-772

传真:0571-86800423

网址:www.5ifund.com

(115) 万银财富

注册地址:北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内3201单元

办公地址:北京市朝阳区北四环中路27号院盘古大观3201

法定代表人:李招弟

联系人:陶翰辰

电话:010-59393923

传真:010-59393074

客服电话:400-808-0069

公司网站:http://www.wy-fund.com/

(116) 一路财富

注册地址:北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702

办公地址:北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702

法定代表人:吴雪秀

联系人:段京璐

电话:010-88312877

传真:010-88312885

客户服务电话:400-001-1566

公司网站:www.yilucaifu.com

(117) 展恒基金

注册地址:北京市顺义区后沙峪镇安富街6号

办公地址:北京市朝阳区德胜门外华严北里2号民建大厦6层

法定代表人:闫振杰

联系人:崔飞飞

联系电话:010-62020088

客户服务电话:400-888-6661

传真:010-62020355

网址:www.myfund.com

(118) 增财基金

注册地址:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室

办公地址:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208-1209室

法定代表人:罗细安

联系人:焦媛媛

电话:010-67000988

传真:010-67000988-6000

客户服务电话:400-001-8811

公司网站:www.zcvc.com.cn

(119) 中国国际期货

注册地址:北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1层、2层、9层、11层、12层

办公地址:北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1层、2层、9层、11层、12层

法定代表人:王兵

联系人:孟夏

电话:010-59539861

传真:010-59539806

客户服务电话:95162

公司网站:http://www.cifco.net/

(120) 中期时代

注册地址:北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢11层1103号

办公地址:北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢2层

法定代表人:路瑶

联系人:侯英建

电话:010-65807865

传真:010-65807864

客户服务电话:010-65087609

公司网站:www.cifcofund.com

(121) 众禄基金

注册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25层H单元

办公地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25层H单元

法定代表人:薛峰

联系人:童彩平

电话:0755-33227950

传真:0755-82080798

客户服务电话:4006-788-887

公司网站:www.zlfund.cn　　www.jjmmw.com

(二)基金注册登记机构

名称:易方达基金管理有限公司

注册地址:广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-8室

办公地址:广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼

法定代表人:叶俊英

电话:4008818088

传真:020-38799249

联系人:余贤燕

(三)律师事务所和经办律师

律师事务所:上海市通力律师事务所

地址:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19楼

负责人:韩炯

电话:(021)31358666

传真:(021)31358600

经办律师:启红、安冬

联系人:安冬

(四)会计师事务所和经办注册会计师

名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

首席合伙人:杨绍信

联系电话:(021)23238888

传真电话:(021)23238800

经办注册会计师:薛竞、沈兆杰

联系人:沈兆杰

四、基金的名称

本基金名称:易方达双倍增强债券型证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型:契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金主要投资于信用债、可转债等固定收益品种,通过积极主动的投资管理,力争为投资者提供持续稳定的回报。

七、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,包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券、公司债、可转债(含分离交易可转债)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会批准上市的股票)、权证等权益类资产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,但须符合中国证监会相关规定。

本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产,但可以参与一级市场新股申购(含增发),并可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票派发的权证以及因投资分离交易可转债而产生的权证等。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人提前公告后,可以将其纳入投资范围,其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。

本基金各类资产的投资比例范围为:固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%,其中,信用债和可转债合计投资比例不低于债券资产的80%;权益类资产的比例不高于基金资产的20%;现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。

本基金所指的信用债为除国债、央行票据和政策性金融债之外的、非由国家信用担保的固定收益证券品种,包括企业债、公司债、短期融资券、资产支持证券和非政策性金融债等。

八、基金的投资策略

1.建仓期策略

建仓期内,本基金将采用相对保守的投资策略,主要投资于流动性风险较小、安全边际较高的品种。在该期间,本基金对固定收益类资产的建仓将优先考虑通过一级市场新债(包括新可转债)申购来完成。在对本基金主要的两类投资品种——可转债与信用债进行建仓时,本基金将严格遵循防范风险的原则,着重选择纯债溢价率较低的可转债品种,以及久期相对较短(如短期融资券)或息票率较高的信用债品种进行投资。此外,本基金根据组合收益情况与资产结构,综合考虑宏观基本面数据、各类资产市场走势、市场供求关系、流动性等因素,控制建仓进度。

2.资产配置策略

本基金的资产配置策略包括大类资产配置策略与固定收益类资产配置策略。

(1)大类资产配置策略

本基金根据对国内外宏观经济形势、宏观经济政策、市场利率走势、证券市场走势、投资新股收益率等因素进行分析和判断,对大类资产的风险收益特征及相关关系进行研究,确定权益类资产、固定收益类资产以及货币市场工具的配置比例。

(2)固定收益类资产配置策略

在大类资产配置的基础上,本基金采取以下策略,将固定收益类资产在信用债、可转债和其他资产间进行配置。

首先,本基金分别对影响信用债市场的信贷水平、信用利差水平、信用债市场供求关系等因素进行分析;然后,对影响可转债市场的转股溢价率、股息率、对应正股的市场走势、可转债市场供求关系等因素进行分析研究;最后,本基金根据上述分析结论,预测和比较两类资产未来的收益率与风险,并结合二者的相关关系,确定并调整两类资产的配置比例,在收益与风险间寻求最佳平衡。除信用债与可转债外,本基金还将在综合考虑组合收益、利率风险以及流动性的前提下,投资于国债、央行票据等利率品种。

3.信用债投资策略与信用风险管理

对不同市场以及不同种类的信用债,本基金将结合自上而下的配置策略和自下而上的个券选择策略进行投资。

(1)配置策略

a.市场间配置

本基金根据交易所市场和银行间市场信用债到期收益率的变化、流动性的变化和市场规模等情况,分析不同市场信用债的信用利差水平及差异变动,动态调整两个市场信用债的投资比例。

b.类属资产配置

本基金运用数量化方法对不同种类信用债(包括金融债、企业债、公司债、短期融资券等)的信用风险溢价、流动性风险溢价、税收溢价等因素进行分析,综合考虑其流动性、收益率以及各类信用债市场供求状况,优化配置各类信用债的投资比例。

c.平均久期配置

本基金通过对货币信贷、固定资产投资、通胀率等宏观经济变量和货币政策、财政政策等宏观经济政策,进行定性和定量的分析,预测未来的利率变化趋势,判断信用债市场对上述变量和政策的反应,并据此积极调整信用债组合的平均久期,提高投资收益。

d.期限结构配置

本基金对信用债市场收益率期限结构进行分析,运用统计和数量分析技术,预测收益率期限结构的变化方式,选择合适的期限结构配置策略,配置各期限信用债的比例,以达到预期投资收益最大化的目的。

(2)个券选择策略

本基金运用行业研究方法和公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量,选择风险与收益相匹配的更优品种进行投资。具体而言:

a.根据宏观经济环境及各行业的发展状况,确定各行业的优先配置顺序;

b.研究债券发行人的产业发展趋势、行业政策、公司背景、盈利状况、竞争地位、治理结构、特殊事件风险等基本面信息,分析企业的长期运作风险;

c.运用财务评价体系对债券发行人的资产流动性、盈利能力、偿债能力、现金流水平等方面进行综合评价,度量发行人财务风险;

d.利用历史数据、市场价格以及资产质量等信息,估算债券发行人的违约率及违约损失率;

e.综合发行人各方面分析结果,确定信用利差的合理水平,利用市场的相对失衡,选择溢价偏高的品种进行投资。

(3)信用风险管理

本基金从以下四个方面来进行信用风险管理:

a. 运用信用产品的相关数据资料,分析发行人的公司背景、行业特性、流动性、盈利能力、偿债能力和表外事项等因素,对信用债进行信用风险评估,并确定信用债的风险等级;

b.严格遵守信用类债券的备选库制度,根据不同的信用风险等级,设置不同的投资管理流程和权限管理制度;

c. 对信用产品备选库内的债券进行跟踪信用评估;

d.采取分散化投资策略和集中度限制,严格控制组合整体的违约风险水平。

4.可转债投资策略

(1)普通可转债投资策略

普通可转债是一种被赋予了股票转换权的债券,投资者可以在约定期限内按照事先确定的价格和比例将该债券转为对应的普通股。可转债的价值取决于普通债券价值加上内含的转股权等期权价值。可转债同时具有股性和债性这两种性质,当正股下跌时,可转债中的普通债券价值可以作为其价格支撑,以此抵御下跌风险;当正股上涨时,可转债中的转股期权能够使其分享股票价格上涨带来的收益。

a.个券投资策略

本基金对可转债发行公司的基本面进行分析,包括所处行业的景气度、公司成长性、市场竞争力等,并参考同类公司的估值水平,判断可转债券的股权投资价值;基于对利率水平、票息率、派息频率及信用风险等因素的分析,判断其债券投资价值;采用期权定价模型,估算可转债券的转换期权价值,综合以上因素,对可转换债券进行定价分析,决定可转债个券的投资策略。

b.可转债条款博弈策略

可转债通常含有修正转股价、提前赎回、提前回售等条款,这些条款对可转债的价值有着重要的影响。其中,修正转股价条款允许公司向下修正转股价,从而提高转债的转股价值,对投资者是一种保护。赎回条款则允许发行人向投资人赎回可转债,若发行人放弃赎回权,则也能提高转债的价值。回售条款为投资人的权利,它允许投资人将可转债出售给发行人,