股票代码:600674　股票简称:川投能源　公告编号:2014-072号

四川川投能源股份有限公司八届三十四次董事会决议公告

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。

重要内容提示:

●董事赵德胜涉嫌严重违纪违法,目前正接受组织调查,故未能出席本次董事会;

●独立董事邱国凡先生因个人原因未能参会。

一、董事会会议召开情况

四川川投能源股份有限公司八届三十四次董事会会议通知于2014年12月11日以送达、传真和电话通知方式发出,会议于2014年12月12日以通讯方式召开。会议应参加投票的董事10名,实际参加投票的董事8名,董事赵德胜涉嫌严重违纪违法,目前正接受组织调查,故未能参加投票。独立董事邱国凡先生因个人原因未能参会。会议的召集召开符合有关法律、法规、规章和公司章程的规定。

二、董事会会议审议情况

会议以记名投票方式审议通过了以下提案报告:

(一)《关于选举第九届董事会候选人的提案报告》,分项表决如下:

1.以8票赞成,0票反对,0票弃权,通过了选举黄顺福先生为第九届董事会董事候选人。

黄顺福:男,出生于1955年4月,中共党员,研究生学历,教授级高级工程师,国务院政府特殊津贴专家。中共十六大党代表,全国第十一届、第十二届人大代表,中共四川省委第八届委员,第九届省委候补委员,省委第七、八、九、十次党代表,省十届人大代表。

曾任四川省计经委工业综合处处长;四川省秀山县县委常委、副县长;四川省轻工业厅副厅长、党组成员;四川省雅安地委副书记;四川省轻工总会副会长、会长(正厅级)、党组副书记、书记;四川省交通厅常务副厅长、党组副书记(正厅级);四川省南充市市委书记、市人大常委会主任;川投能源公司第六、七届董事会董事长。现任四川省投资集团有限责任公司董事长、党委书记;川投能源公司第八届董事会董事长。

2.以8票赞成,0票反对,0票弃权,通过了选举金群先生为第九届董事会董事候选人。

金群:男,出生于1956年10月,中共党员,硕士研究生,高级经济师。曾任航空部305厂厂长;中国航空工业供销四川公司总经理;四川新牧投资公司总经理;四川省投资集团公司总经济师;四川省投资集团有限责任公司副总经理、党委委员。现任四川省投资集团有限责任公司董事、党委委员。

3.以8票赞成,0票反对,0票弃权,通过了选举李文志先生为第九届董事会董事候选人。

李文志:男,出生于1966年3月,中共党员,研究生。曾任四川省政府办公厅秘书一处副主任科员、主任科员、副处级调研员、正处级秘书;四川省投资集团有限责任公司总经理助理、办公室主任、信息中心主任、总经济师;川投能源公司第六届、第七届董事会董事。现任四川省投资集团有限责任公司副总经理;川投能源公司第八届董事会董事。

4.以8票赞成,0票反对,0票弃权,通过了选举宁祖先生为第九届董事会董事候选人。

宁祖:男,出生于1956年8月,中共党员,硕士学位,国际职业经理人、教授级高级工程师。曾任四川嘉阳电力有限责任公司副总经理;四川川投电力开发有限责任公司副总经理;四川巴蜀江油燃煤发电有限公司扩建指挥部副指挥长。现任四川省投资集团有限责任公司能源部经理。

5.以8票赞成,0票反对,0票弃权,通过了选举陈长江先生为第九届董事会董事候选人。@　陈长江:男,出生于1959年12月,中共党员,硕士学位,经济师。曾任工商银行四川省分行副科级干部;先后在四川省委财经领导小组办公室、四川省政府办公厅、四川省政府财贸办公室担任副处长、正处级秘书;香港嘉陵集团公司成都办事处副主任;海南贝迪房地产有限公司副总经理、董事、代总经理、总经理;川投能源公司副总经理、常务副总经理;四川新光硅业科技有限责任公司总经理、党委书记、董事。现任川投能源公司党委副书记、纪委书记、工会主席。

6. 以8票赞成,0票反对,0票弃权,通过了选举毛学工先生为第九届董事会董事候选人。

毛学工:男,出生于1962年12月,中共党员,硕士研究生,高级经济师,注册安全工程师。曾任四川省电力管理局调度局调度员、经营科副科长、副局长;四川省经贸委电力处处长、综合处处长;雅砻江流域水电开发有限公司总经理助理。现任雅砻江流域水电开发有限公司副总经理。

7.以8票赞成,0票反对,0票弃权,通过了选举缪希强先生为第八届董事会董事候选人。

缪希强:男,出生于1963年3月,中共党员,本科学位。曾任中国农业银行承德分行办公室副主任、信贷处处长;中国农业银行隆化县支行行长;;北京大地远通(集团)有限公司副总经理。现任北京大地远通(集团)有限公司董事;川投能源公司第八届董事会董事。

8.以8票赞成,0票反对,0票弃权,通过了选举王民林先生为第九届董事会独立董事候选人。

王民林:男,出生于1952年1月,中共党员,学士学位,教授。曾任四川省计经委政治部宣传处副处长;中共四川省委工交财贸政治部综合处处长、政治部主任助理;四川省贸易厅副厅长;四川省酒类专卖管理局局长;四川经济管理学院党委书记;西华大学教授。现任川投能源公司第八届董事会独立董事。

9.以8票赞成,0票反对,0票弃权,通过了选举盛毅先生为第九届董事会独立董事候选人。

盛毅:男,出生于1956年10月,中共党员,硕士研究生,经济学研究员。曾任内江齿轮厂车间副主任、生产科长;四川省社会科学院经济研究所副所长;四川省社会科学院四川经济社会发展重大问题对策研究中心秘书长;四川省社会科学院宏观发展研究所所长;四川省社会科学院宏观经济与工业经济研究所所长。现任四川省社会科学院副院长。

10. 以8票赞成,0票反对,0票弃权,通过了选举姚国寿先生为第九届董事会独立董事候选人。

姚国寿:男,出生于1943年7月,中共党员,学士学位,主任编辑。曾任中国水利水电科学研究院秘书;水利电力部第六工程局政治部干事;成都水力发电学校党总支秘书;四川省电力工业局党组秘书;西南电业管理局党组秘书、秘书科(处)长;《西南电力报》社长兼总编辑。现任《四川水力发电》杂志常务副主编;《四川电力年鉴》副主编。

11.以8票赞成,0票反对,0票弃权,通过了选举吕先锫先生为第九届董事会独立董事候选人。

吕先锫: 男,出生于1964年1月,中共党员,博士,注册会计师,注册评估师。曾任西南财经大学审计教研室副主任、主任、会计学院副院长。现任西南财经大学审计处处长、教授。

本提案尚需提交公司股东大会审议。

公司独立董事发表独立意见如下:

第八届董事会已于2014年5月18日任期届满,根据《公司法》、《股票上市规则》和《公司章程》等规定,公司将组建第九届董事会。第九届董事会成员候选人的提名和选举符合《公司法》、《股票上市规则》和《公司章程》等规定。

公司召集、召开本次董事会会议程序以及会议的审议、表决均符合有关法律、法规规则及公司章程的规定。

(二)以8票赞成,0票反对,0票弃权通过了《关于公司增加注册资本(实收资本)的提案报告》:

2013年9月10日至2014年9月2日,川投转债共计1,983,138,000元转换为公司219,203,134股股票,增加股本人民币219,203,134元,需相应增加公司注册资本(实收资本)并办理完成相应工商变更手续,增加后的注册资本(实收资本)为人民币2,201,070,240元。

本提案尚需提交公司股东大会审议。

(三)以8票赞成,0票反对,0票弃权通过了《关于修订公司章程的提案报告》:

因可转债转股导致公司总股数发生变化等原因对《公司章程》进行了修订,详见与本决议公告同时在上交所网站(www.se.com.cn)披露的《公司章程》。

该提案尚需提交公司股东大会审议。

(四)以8票赞成,0票反对,0票弃权通过了《关于召开2014年第二次临时股东大会的提案报告》:

详见与本决议公告同时在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《金融投资报》和上交所网站(www.sse.com.cn)披露的《四川川投能源股份有限公司关于召开2014年第二次临时股东大会的通知》。

特此公告。

四川川投能源股份有限公司董事会
2014年12月13日

股票代码:600674　股票简称:川投能源　公告编号:2014-074号

四川川投能源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。

重要内容提示:

● 股东大会召开日期:2014年12月30日(星期二)上午9:30

● 股权登记日:2014年12月22日

● 本次股东大会采取现场投票与网络投票相结合的方式

● 本公司股票为融资融券标的,开展相关业务的证券公司可以按照相关规定参加本次股东大会。

一、会议召开的基本情况

(一)会议届次:2014年第二次临时股东大会

(二)会议召集人:公司董事会

(三)会议召开日期及时间

现场会议时间:2014年12月30日(星期二)上午9:30;

网络投票时间:2014年12月30日(星期二)9:30—11:30,13:00—15:00。

(四)会议表决方式:本次股东大会采取现场投票与网络投票相结合的方式。公司将通过上海证券交易所交易系统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。

(五)会议地点:成都市小南街23号川投大厦1601会议室

(六)股权登记日:2014年12月22日

(七)参会方式:

公司股东可以选择现场参加或通过网络投票方式参加本次股东大会。

开展融券融资业务的证券公司可以委托上证所信息网络有限公司通过上海证券交易所指定的融资融券业务证券公司投票系统,按照所征集的融资融券投资者投票意见进行投票,并应当根据融资融券投资者对同一议案的不同意见进行分拆投票。

合格境外机构投资者(QFII)参加网络投票的,应当根据其委托人对同一议案的不同意见进行分拆投票。

公司股东、开展融资融券业务的证券公司只能选择现场投票和网络投票中的一种表决方式。如同一股份通过现场、网络投票系统重复进行表决的,以第一次投票结果为准。

二、会议审议事项

1.关于选举第九届董事会董事的提案报告;

第九届董事会各位董事候选人情况如下:

(1)黄顺福:男,出生于1955年4月,中共党员,研究生学历,教授级高级工程师,国务院政府特殊津贴专家。中共十六大党代表,全国第十一届、第十二届人大代表,中共四川省委第八届委员,第九届省委候补委员,省委第七、八、九、十次党代表,省十届人大代表。

曾任四川省计经委工业综合处处长;四川省秀山县县委常委、副县长;四川省轻工业厅副厅长、党组成员;四川省雅安地委副书记;四川省轻工总会副会长、会长(正厅级)、党组副书记、书记;四川省交通厅常务副厅长、党组副书记(正厅级);四川省南充市市委书记、市人大常委会主任;川投能源公司第六、七届董事会董事长。现任四川省投资集团有限责任公司董事长、党委书记;川投能源公司第八届董事会董事长。

(2)金群:男,出生于1956年10月,中共党员,硕士研究生,高级经济师。曾任航空部305厂厂长;中国航空工业供销四川公司总经理;四川新牧投资公司总经理;四川省投资集团公司总经济师;四川省投资集团有限责任公司副总经理、党委委员。现任四川省投资集团有限责任公司董事、党委委员。

(3)李文志:男,出生于1966年3月,中共党员,研究生。曾任四川省政府办公厅秘书一处副主任科员、主任科员、副处级调研员、正处级秘书;四川省投资集团有限责任公司总经理助理、办公室主任、信息中心主任、总经济师;川投能源公司第六届、第七届董事会董事。现任四川省投资集团有限责任公司副总经理;川投能源公司第八届董事会董事。

(4)宁祖:男,出生于1956年8月,中共党员,硕士学位,国际职业经理人、教授级高级工程师。曾任四川嘉阳电力有限责任公司副总经理;四川川投电力开发有限责任公司副总经理;四川巴蜀江油燃煤发电有限公司扩建指挥部副指挥长。现任四川省投资集团有限责任公司能源部经理。

(5)陈长江:男,出生于1959年12月,中共党员,硕士学位,经济师。曾任工商银行四川省分行副科级干部;先后在四川省委财经领导小组办公室、四川省政府办公厅、四川省政府财贸办公室担任副处长、正处级秘书;香港嘉陵集团公司成都办事处副主任;海南贝迪房地产有限公司副总经理、董事、代总经理、总经理;川投能源公司副总经理、常务副总经理;四川新光硅业科技有限责任公司总经理、党委书记、董事。现任川投能源公司党委副书记、纪委书记、工会主席。

(6)毛学工:男,出生于1962年12月,中共党员,硕士研究生,高级经济师,注册安全工程师。曾任四川省电力管理局调度局调度员、经营科副科长、副局长;四川省经贸委电力处处长、综合处处长;雅砻江流域水电开发有限公司总经理助理。现任雅砻江流域水电开发有限公司副总经理。

(7)缪希强:男,出生于1963年3月,中共党员,本科学位。曾任中国农业银行承德分行办公室副主任、信贷处处长;中国农业银行隆化县支行行长;;北京大地远通(集团)有限公司副总经理。现任北京大地远通(集团)有限公司董事;川投能源公司第八届董事会董事。

(8)王民林:男,出生于1952年1月,中共党员,学士学位,教授。曾任四川省计经委政治部宣传处副处长;中共四川省委工交财贸政治部综合处处长、政治部主任助理;四川省贸易厅副厅长;四川省酒类专卖管理局局长;四川经济管理学院党委书记;西华大学教授。现任川投能源公司第八届董事会独立董事。

(9)盛毅:男,出生于1956年10月,中共党员,硕士研究生,经济学研究员。曾任内江齿轮厂车间副主任、生产科长;四川省社会科学院经济研究所副所长;四川省社会科学院四川经济社会发展重大问题对策研究中心秘书长;四川省社会科学院宏观发展研究所所长;四川省社会科学院宏观经济与工业经济研究所所长。现任四川省社会科学院副院长。

(10)姚国寿:男,出生于1943年7月,中共党员,学士学位,主任编辑。曾任中国水利水电科学研究院秘书;水利电力部第六工程局政治部干事;成都水力发电学校党总支秘书;四川省电力工业局党组秘书;西南电业管理局党组秘书、秘书科(处)长;《西南电力报》社长兼总编辑。现任《四川水力发电》杂志常务副主编;《四川电力年鉴》副主编。

(11)吕先锫: 男,出生于1964年1月,中共党员,博士,注册会计师,注册评估师。曾任西南财经大学审计教研室副主任、主任、会计学院副院长。现任西南财经大学审计处处长、教授。

2.关于选举第九届董事会监事的提案报告;

第九届监事会各位监事候选人情况如下:

(1)董建良:男,出生于1955年9月,中共党员,研究生学历。曾任四川省商业厅劳动人事处主任科员、副处长;四川省商业集团有限公司人力资源部、发展策划部部长、总经理助理;四川省五交化股份有限公司总经理、党委书记、董事长;四川省糖酒公司党委书记、总经理、法定代表人;四川省商业集团有限公司副总经理、董事、总经理、党委书记、法定代表人;四川省投资集团有限责任公司党委副书记。现任四川省投资集团有限责任公司党委副书记、纪委书记;川投能源公司第八届监事会主席。

(2)郑世红:女,出生于1963年9月,中共党员,研究生,高级会计师。曾任水电部第七工程局财务处会计;二滩水电开发有限责任公司财务处会计、三产财会室主任、多经财务中心副主任;四川省投资集团有限责任公司审计监察部副主任、主任、资金财务部经理;川投能源公司第六届、第七届监事会监事。现任四川省投资集团有限责任公司副总会计师、资金财务部经理;川投能源公司第八届监事会监事。

(3)王静轶:女,出生于1975年10月,中共党员,本科。曾任四川川投资产管理有限责任公司财务部经理;四川川投水务集团有限公司副总会计师。现任四川省投资集团有限责任公司资金财务部副经理。

(二)以5票赞成,0票反对,0票弃权通过了《关于公司增加注册资本审核意见的提案报告》:

监事会认为:公司发行可转债通过了必要的审核程序,由于可转债转股原因引起公司注册资本(实收资本)的增加,符合相关法律法规的规定,同意本次增加注册资本(实收资本)。

(三)以5票赞成,0票反对,0票弃权通过了《关于对修改<公司章程>审核意见的提案报告》:

监事会认为:本次对《公司章程》的修订符合《公司法》、《上市公司章程指引》等相关法律法规的规定,同意本次对公司章程的修订。

公司第二届第二次职工代表大会已于2014年12月8日选举张昊先生、孙世明先生为公司第九届监事会职工代表监事,两位职工代表监事情况如下:

张昊:男,出生于1970年7月,中共党员,硕士学位。曾任四川省冶金工业厅办公室副主任科员;四川省投资集团公司办公室副主任;四川省投资集团公司董事会秘书;川投能源公司董事会秘书、党委副书记、纪委书记、工会主席。现任四川川投田湾河开发有限责任公司党委书记、总经理;川投能源公司第八届监事会监事。

孙世明:男,出生于1963年7月,中共党员,研究生学历。曾任嘉阳煤矿电厂厂长、工程师;四川嘉阳电力有限责任公司总经理助理、副总经理;四川天彭电力开发有限公司常务副总经理;党总支书记、总经理。现任四川嘉阳电力有限责任公司党委书记、总经理;川投能源公司第八届监事会监事。

特此公告。

四川川投能源股份有限公司监事会
2014年12月13日

(上接B38版)

3、股票投资策略

本基金采用“兴全社会责任四维选股模型”精选股票。

本基金的股票选择程序如下:

首先,根据公司的经济责任表现指标,定期对股票进行初步筛选,经济责任较好的股票进入基础股票池;同时,还剔除社会责任表现指标特别差的某些公司。

在此基础上,按照经济责任、持续发展责任、法律责任、道德责任等不同社会责任对公司价值的相对贡献,对基础股票池中的股票进行二次筛选,进入备选股票池。

对于备选股票池,本基金将定期(一般一个季度)或不定期(突发事件)进行四维风险因子度量,以判断经济责任、持续发展责任、法律责任、道德责任对公司价值的相对贡献因子大小。

同时,本基金将结合研究员对公司社会责任情况的实地调研,定期、动态调整股票组合,并根据实际估值、市场环境等多种因素作出投资决策,从而构建实际股票组合。

本基金的股票选择标准为:

(1)经济责任表现

公司经济责任指公司生产、盈利、满足消费需求的责任表现,其核心是公司创造利润、实现价值的能力。公司的经济责任表现可以通过三个方面进行考察:

A. 财务指标——衡量公司创造利润的表现。

本基金主要通过估值指标(如动态市盈率PEG、市净率B/M等)和增长指标(如主营业务增长率SG、EBIT增长率等)进行多重考察。

B. 产品与服务——衡量公司利润创造的源泉。

公司提供的产品和服务是公司实现价值的源泉,也是考察公司对社会贡献的关键点之一。本基金要求公司所生产或营销的产品和服务具有较强的竞争力、能为公司实现利润、并提高消费者健康水平和生活质量水平,具体而言:

●产品和服务安全、健康、环保,符合国家消费者商品安全条例;

●实施质量控制措施和顾客满意原则;

●对质量安全问题能迅速反应,并采取合理措施;

●产品广告、包装与产品内容一致。

在具体的量化指标选择上,本基金可通过品牌指标(如市场占有率、行业集中度、品牌渗透率等)和质量指标(如产品合格率、产品返修率等)等进行考察。

C. 治理结构——衡量利润创造的保证。

本基金从多个角度考察公司的治理状况:信息披露程度和强度、董事会的独立性及多样性、执行赔偿、是否关心股东利益等。对那些管理结构较差、委托-代理制度混乱、以及在大股东操纵、内部人控制、担保欺骗、行受贿等方面存在可疑或违法行为的公司,本基金将不予投资。相反,本公司寻求具有以下特征的公司:

●具有多样化且独立的董事会;

●具有健全、可操作性强的、责权明确的公司管理治理规则,能保证内控的贯彻实施;

●具有完善的风险管理和内部人监督体系;

●能强化信息披露,保证公司的透明度;

●注重培养健康、有道德的公司文化

同时,本基金通过股东制衡表现(如大股东持股比例、股东持股量的集中度等)、管理层激励表现(如是否实施股权激励制度、高管人员的持股比例等)等具体量化指标方面进行考察。

(2)其他责任表现

A. 持续发展责任——保证企业与社会可持续发展的责任。

本基金通过两方面对公司进行考察:

一方面是环保责任,即公司保护和利用现有资源的责任履行情况。在评估公司环境保护方面的表现时,本基金要求公司:

●始终遵守国家及所在地方政府的环境政策和条例;

●有专门为保护环境及提高资源利用效率的方案及措施;

●每年有稳定的预算经费用于环境保护及治理;

除上述三个基本标准外,本基金更偏好于满足以下一个或多个要求的公司:

●公司本身拥有新能源开发、环保相关产品研发、经营等环保产业的一项或多项业务。

●实施独创性的有效防止污染、节约自然资源的环境保护方案,以表明公司正走在可持续发展的道路上;

●高层管理者具有环境保护意识和责任,并对那些在环境保护上做出成绩者给与奖赏;

●对可能造成环境污染的项目进行披露,并采取措施把污染降低到最低程度。

在量化指标选择上,本基金可通过计算公司的单位收入能耗、单位工业产值主要污染物排放量、环保投资率、横向比较公司在同行业的环保表现等方法,评估公司的环保责任表现。

另一方面是创新责任,即公司研发、创造新产品、新资源的责任。

从公司来看,其研发能力、业务创新实力与公司的长期绩效紧密相关;从社会来看,一国的科研与创新能力是实现社会可持续发展的关键点,因此,公司的创新能力表现也是本基金重点关注的因素之一。本基金寻求满足以下一个或多个要求的公司:

●拥有一项或多项在本行业具有先进水平的自主研发技术;

●每年新产品推出的速度和数量居行业前列;

●制订有切实可行的政策,奖励在创新方面做出突出贡献的员工;

●每年有稳定的经费专用于公司产品或服务的研发、创新。

在量化指标的选择上,本基金可通过两大类指标考察公司的创新能力:一是创新产出指标,如新产品产值率、专利水平等项;二是创新潜力指标,包括技术创新投入率、技术开发人员比率等项。

B. 法律责任——履行法律法规各项义务的责任。

本基金通过两方面对公司进行考察:

一方面是税收责任,即公司按照有关法律法规的规定,照章纳税和承担政府规定的其他责任义务。具体看来,本基金要求公司:

●积极配合政府的干预和监督,不逃税、偷税、漏税或非法避税;

●依照各项法律制度及时地缴税、纳税;

●不存在挤占挪用国家税款的违法行为。

在具体的量化指标上,本基金可通过资产纳税率、税款上缴率等指标对该项进行考察。

另一方面是雇主责任,即公司承担对职工的福利、安全、教育等方面义务的责任。具体看来,本基金要求公司:

●严格遵守政府建立的各项劳动政策法规和制度条例,提供完备的员工利益保障;

●具有完备的员工健康安全保障体系以及良好的安全性表现记录;

●强调使用法律来保障劳资双方的合法权益。

在具体的量化指标上,本基金可通过工资支付率、法定福利支付率、社保提取率、社保支付率等指标对该项进行考察。

C. 道德责任——满足社会准则、规范和价值观、回报社会的责任。

本基金通过两方面对公司进行考察:

一方面是内部道德责任。即公司对内部员工的福利、未来发展等方面所承担的责任。本基金寻求满足以下要求的公司:

●实施良好的员工培训计划,树立健康的劳工关系以及劳资共赢的观念;

●建立效益挂钩的绩效制度与利益分享的激励机制。

在具体的量化指标选择上,可以通过员工培训支出比率、员工人均年培训经费、员工工资增长率、就业贡献率等指标对该项进行考察。

另一方面是外部道德责任。即公司对社会慈善事业和其他公益事业的社会责任。本基金所投资的公司须有良好的反馈社会意识,积极投身于有益于国家和社会和谐发展的项目和产业,积极参与公益事业,主动把企业发展与社会发展融为一体,实现企业与社会的共同发展。具体而言,本基金偏好于满足以下一个或多个要求的公司:

●坚定支持所在地的建设和活动,与公司所在地居民和社区的各类发展组织具有良好的合作关系;

●参与国家政策积极引导、大力提倡的投资项目或产业;

●参与国家政策积极引导、大力提倡的投资项目或产业(如西部开发等);

●在公司慈善、员工自愿者计划、弱势群体扶助等公益方面有较完善的实施计划及良好表现。

在具体的量化指标选择上,本基金可通过捐赠收入比率等指标对该项进行考察。

本基金在精选股票的同时强调以下两个原则:一是行业内社会责任的相对表现;二是辅以优化行业配置策略调整最终的股票投资组合,以避免过高的行业配置风险。

本基金以四维社会责任综合指标作为投资评价依据,将定期(一般一个季度)或不定期(突发事件)进行社会责任指标度量,并对不符合下述标准的股票予以剔除:一是相关指标发生变化导致其综合社会责任指标排名下降,不再符合相应股票组合入选标准的股票;二是发生重大、突发事件,导致某项指标严重违反本基金设定的社会责任标准的股票。剔除的股票品种池将及时告知托管行。

4、债券投资策略

本基金将采取久期偏离、收益率曲线配置和类属配置、无风险套利、杠杆策略和个券选择策略等积极投资策略,发现、确认并利用市场失衡实现组合增值。这些积极投资策略是在遵守投资纪律并有效管理风险的基础上作出的。

本基金还将凭借多年的可转债投资研究力量积累进行可转债品种投资,着重对可转债的发行条款、对应基础股票进行分析与研究,重点关注那些有着较好盈利能力或成长前景的上市公司的可转债,并依据科学、完善的“兴业可转债评价体系”选择具有较高投资价值的个券进行投资。

另外,对于公司发行的各类债券,本基金将参考“兴全社会责任四维选股模型”对相关公司进行筛选。

5、权证投资策略

本基金将综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素对权证进行投资,主要运用的投资策略为:正股价值发现驱动的杠杆投资策略、组合套利策略以及复制性组合投资策略等。

本基金将在进行充分风险控制和遵守中国证监会相关法律规定的基础上,投资于未来出现的新投资品种。

二、投资限制

1、组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点,通过分散投资降低基金财产的非系统性风险,保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制:

(1)本基金持有一家上市公司的股票,其市值不超过基金资产净值的10%;

(2)本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;

(3)本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券,不超过该证券的10%;

(4)本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的10%;

(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%;

(6)本基金不得违反本基金合同关于投资范围和投资比例的约定。本基金为股票型基金,各类资产的投资比例为:股票投资比例为65%-95%;债券投资比例为0%-30%;资产支持证券占0%-20%;权证投资比例为0%-3%;现金或者到期日在一年以内的政府债券不小于基金资产净值的5%。本基金投资组合中突出社会责任投资股票的合计投资比例不低于股票资产的80%。

(7)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%;

(8)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%;

(9)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%;

(10)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%;

(11)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;

(12)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;

(13)本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%;

(14)如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的,以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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10个交易日内进行调整。

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。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

(1)承销证券;

(2)向他人贷款或者提供担保;

(3)从事承担无限责任的投资;

(4)买卖其他基金份额,但是国务院另有规定的除外;

(5)向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;

(6)买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券;

(7)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;

(8)依照法律法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他活动。

(9)法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制。

第九部分　基金的业绩比较基准

业绩比较基准=80%×中信标普300指数+20%×中信标普国债指数

第十部分　基金的风险收益特征

本基金为股票型基金,因此其基本风险收益特征为较高风险,较高回报。

第十一部分　基金的投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,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。

基金托管人中国建设银行根据本基金合同规定,复核了本投资组合报告,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据取自兴全社会责任股票型证券投资基金2014年第3季度报告,所载数据截至2014年9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(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	4,291,396,241.68	87.97
	其中:股票	4,291,396,241.68	87.97
2	固定收益投资	180,280,000.00	3.70
	其中:债券	180,280,000.00	3.70
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	买入返售金融资产	-	-
5	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	185,260,076.51	3.80
7	其他资产	221,290,767.96	4.54
8	合计	4,878,227,086.15	100.00

2、报告期末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	采矿业	-	-
C	制造业	2,940,105,651.50	60.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	279,804,548.38	5.78
E	建筑业	32,864,000.00	0.68
F	批发和零售业	140,229,973.20	2.90
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	758,587,663.88	15.66
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	90,824,601.84	1.88
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	48,979,802.88	1.01
S	综合	-	-
	合计	4,291,396,241.68	88.61

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

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	600867	通化东宝	27,268,000	380,933,960.00	7.87
2	002450	康得新	11,380,000	354,145,600.00	7.31
3	300017	网宿科技	5,677,992	317,513,312.64	6.56
4	600674	川投能源	14,115,745	250,695,631.20	5.18
5	002502	骅威股份	13,235,657	217,726,557.65	4.50
6	002250	联化科技	13,280,000	209,824,000.00	4.33
7	000625	长安汽车	14,656,816	200,798,379.20	4.15
8	300049	福瑞股份	4,749,818	173,843,338.80	3.59
9	002008	大族激光	8,373,400	163,699,970.00	3.38
10	002085	万丰奥威	5,371,082	148,295,574.02	3.06

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	-	-
3	金融债券	180,280,000.00	3.72
	其中:政策性金融债	180,280,000.00	3.72
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	180,280,000.00	3.72

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	140204	14国开04	1,000,000	100,240,000.00	2.07
2	130243	13国开43	800,000	80,040,000.00	1.65
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

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

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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、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

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1)报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

(2)本基金投资股指期货的投资政策

股指期货暂不属于本基金的投资范围,故此项不适用。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1)本期国债期货投资政策

国债期货暂不属于本基金的投资范围,故此项不适用。

(2)报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

(3)本期国债期货投资评价

国债期货暂不属于本基金的投资范围,故此项不适用。

11、投资组合报告附注

(1)本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,并且未在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(2)本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

(3)其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	1,059,796.13
2	应收证券清算款	209,142,175.44
3	应收股利	-
4	应收利息	6,953,371.98
5	应收申购款	4,135,424.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	221,290,767.96

(4)报告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)报告期末前十名股票中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的情况。(6)投资组合报告附注的其他文字描述部分由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

第十二部分　基金的业绩

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金合同生效日2008年4月30日,基金业绩截止日2014年9月30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
2014年3