关于增加和讯信息科技有限公司为浙商资管公募基金推广机构的公告

根据浙江浙商证券资产管理有限公司(简称“本公司”)与和讯信息科技有限公司签署的《浙江浙商证券资产管理有限公司开放式证券投资基金销售服务主协议》及《浙江浙商证券资产管理有限公司开放式证券投资基金销售服务补充协议》、《浙江浙商证券资产管理有限公司开放式证券投资基金销售服务主协议细则》,本公司决定于2016年6月27日增加和讯信息科技有限公司为浙商汇金转型成长混合型证券投资基金、浙商汇金转型驱动灵活配置混合型证券投资基金以及浙商汇金转型升级灵活配置混合型证券投资基金的推广机构。

即日起,投资者可通过和讯信息科技有限公司,办理浙商汇金转型成长混合型证券投资基金、浙商汇金转型驱动灵活配置混合型证券投资基金以及浙商汇金转型升级灵活配置混合型证券投资基金的开户、申购业务。

投资者也可以通过以下途径咨询有关情况:

和讯信息科技有限公司

名　　称:和讯信息科技有限公司

注册地址:北京市朝阳区朝外大街22号1002室

法定代表人:王莉

公司网址:http://www.hexun.com

浙江浙商证券资产管理有限公司

注册地址:浙江省杭州市下城区天水巷25号

法定代表人:李雪峰

公司网址:www.stocke.com.cn

风险提示:本公司承诺以诚实信用、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,也不保证最低收益。敬请投资者注意基金投资风险。投资者投资于上述基金前应认真阅读基金的基金合同、招募说明书。

本公告的解释权归浙江浙商证券资产管理有限公司。

咨询方法:

浙江浙商证券资产管理有限公司

客户服务热线:95345

公司网址:www.stocke.com.cn

特此公告。

浙江浙商证券资产管理有限公司

二○一六年六月二十七日

浙江浙商证券资产管理有限公司关于参加北京钱景财富投资管理有限公司费率优惠活动的公告

为答谢广大客户长期以来给予的信任与支持,经与北京钱景财富投资管理有限公司(以下简称“钱景财富”)协商一致,浙江浙商证券资产管理有限公司(以下简称“本公司”)决定旗下基金参加钱景财富的费率优惠活动。现将具体费率优惠情况公告如下:

一、费率优惠活动

1、费率优惠内容

自【2016】年【6】月【27】日起,投资者通过钱景财富申(认)购本公司旗下基金,申(认)购费率不设折扣限制,具体折扣费率以钱景财富活动为准。基金费率请详见基金合同、招募说明书(更新)等法律文件,以及本公司发布的最新业务公告。

费率优惠期限内,如本公司新增通过钱景财富销售的基金产品,则自该基金产品开放申(认)购当日起,将同时开通该基金上述优惠活动。

2、费率优惠期限

以钱景财富官方网站所示公告为准。

二、重要提示

1、本优惠活动仅适用于我司产品在钱景财富处于正常申购期的基金产品的前端收费模式的申购手续费及处于基金募集期的基金认购费。

2、本优惠活动仅适用于我司产品在钱景财富申(认)购业务的手续费,不包括基金赎回、转换业务等其他业务的手续费。

3、费率优惠活动解释权归钱景财富所有,有关优惠活动的具体规定如有变化,敬请投资者留意其相关公告。

4、费率优惠活动期间,业务办理的流程以钱景财富的规定为准。投资者欲了解基金产品的详细情况,请仔细阅读基金的基金合同、招募说明书等法律文件。

三、投资者可通过以下途径了解或咨询相关情况

机构名称	网址	客服热线
北京钱景财富投资管理有限公司	www.qianjing.com	400-893-6885
浙江浙商证券资产管理有限公司	www.stocke.com.cn	95345

风险提示:本公司承诺以诚实信用、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,也不保证最低收益。敬请投资人注意投资风险。投资者投资于上述基金前应认真阅读基金的基金合同、更新的招募说明书。

特此公告。

浙江浙商证券资产管理有限公司

【2016】年【6】月【27】日

浙江浙商证券资产管理有限公司关于旗下基金新增和讯信息为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告

经浙江浙商证券资产管理有限公司(以下简称“本公司”)与和讯信息科技有限公司(以下简称:和讯信息)协商一致,旗下公募基金浙商汇金转型成长混合型证券投资基金、浙商汇金转型驱动灵活配置混合型证券投资基金以及浙商汇金转型升级灵活配置混合型证券投资基金新增和讯信息为销售机构并将参加其申购费率优惠活动。

现将相关事项公告如下:

一、适用基金

浙商汇金转型成长混合型证券投资基金(000935)、浙商汇金转型驱动灵活配置混合型证券投资基金(001540)、浙商汇金转型升级灵活配置混合型证券投资基金 (基金代码:001604)

二、活动内容

自2016年6月27日起,凡通过和讯信息申购上述适用基金的投资者,申购费率享有如下优惠:原申购费率(前端模式)高于0.6%的,基金申购费率按4折优惠,即实收申购费率=原申购费率×0.4,优惠后费率如果低于0.6%,则按0.6%执行;原申购费率低于或等于0.6%或为固定费用的,则按原申购费率执行。

上述适用基金的原申购费率参见基金的相关法律文件及本公司发布的最新相关公告。

三、重要提示

1、本公司所管理的尚未参加本优惠活动的开放式基金及今后发行的开放式基金是否参与此项优惠活动将根据具体情况确定并另行公告。

2、本优惠活动的规则以和讯信息的规定为准。投资者欲了解基金产品的详细情况,请仔细阅读基金的基金合同、更新的招募说明书等法律文件。

3、本公告的解释权归浙江浙商证券资产管理有限公司所有。

四、投资者也可以通过以下途径咨询有关情况:

1、和讯信息科技有限公司

客服电话:4009200022/021-20835588

公司网站:www.hexun.com

2、浙江浙商证券资产管理有限公司

客服电话:95345

公司网站:www.stocke.com.cn

风险提示:本公司承诺以诚实信用、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,也不保证最低收益。敬请投资人注意投资风险。投资者投资于上述基金前应认真阅读基金的基金合同、招募说明书。

特此公告。

浙江浙商证券资产管理有限公司

2016年6月27日

浙江浙商证券资产管理有限公司关于增加钱景财富为旗下基金销售机构的公告

根据浙江浙商证券资产管理有限公司(简称“本公司”)与北京钱景财富投资管理有限公司(简称:“钱景财富”)签署的《浙江浙商证券资产管理有限公司开放式证券投资基金销售服务主协议》及《浙江浙商证券资产管理有限公司开放式证券投资基金销售服务补充协议》,本公司决定于2016年6月27日增加钱景财富为浙商汇金转型成长混合型证券投资基金、浙商汇金转型驱动灵活配置混合型证券投资基金以及浙商汇金转型升级灵活配置混合型证券投资基金的销售机构。

即日起,投资者可通过钱景财富办理前述基金的开户、申购、赎回等业务。

投资者可以通过以下途径咨询有关情况:

北京钱景财富投资管理有限公司

注册地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012

法定代表人:赵荣春

客服热线:400-893-6885

公司网址:www.qianjing.com

浙江浙商证券资产管理有限公司

注册地址:浙江省杭州市下城区天水巷25号

法定代表人:李雪峰

客服热线:95345

公司网址:www.stocke.com.cn

风险提示:本公司承诺以诚实信用、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,也不保证最低收益。敬请投资者注意基金投资风险。投资者投资于前述基金前应认真阅读基金的基金合同、招募说明书。

本公告的解释权归浙江浙商证券资产管理有限公司。

特此公告。

浙江浙商证券资产管理有限公司

二○一六年六月二十七日

东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的提示公告

根据《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)关于不定期份额折算的相关规定,当可转债B份额的基金份额净值达到0.450元,本基金将对可转债A份额(150164)、可转债B份额(150165)以及东吴转债(165809)进行不定期份额折算。

由于近期可转债市场波动较大,截至2016年6月24日,可转债B份额的基金份额净值接近基金合同规定的不定期份额折算阈值,在此提请投资者密切关注可转债B份额近期份额净值的波动情况,并警惕可能出现的风险。

针对不定期折算可能带来的风险,本基金管理人特别提示如下:

一、由于可转债A份额、可转债B份额折算前可能存在折溢价交易情形,

不定期份额折算后,可转债A份额、可转债B份额的折溢价率可能发生较大变化。特提请参与二级市场交易的投资者注意高溢价所带来的风险。

二、本基金可转债B份额表现为高风险、高收益的特征,不定期份额折算后其杠杆倍数将大幅降低,恢复到初始的3.33倍杠杆水平,相应地,可转债B份额的净值随市场涨跌而增长或者下降的幅度也会大幅减小。

三、由于触发折算阈值当日,可转债B份额的净值可能已低于阈值,而折算基准日在触发阈值日后才能确定,因此折算基准日可转债B份额的净值可能与折算阈值0.450元有一定差异。

四、本基金可转债A份额表现为低风险、收益相对稳定的特征,但在不定

期份额折算后可转债A份额持有人的风险收益特征将发生变化,由持有单一的低风险收益特征可转债A份额变为同时持有低风险收益特征可转债A份额与较低风险收益特征东吴转债份额的情况,因此原可转债A份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加。此外,东吴转债份额为跟踪中证转债指数的基础份额,其份额净值将随市场涨跌而变化,因此原可转债A份额持有人还可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

本基金管理人的其他重要提示:

一、根据深圳证券交易所的相关业务规则,可转债A份额、可转债B份额、东吴转债份额的场内份额经折算后的份额数均取整计算(最小单位为1份),舍去部分计入基金财产,持有极小数量可转债A份额、可转债B份额、东吴转债份额的场内份额持有人,可能存在折算后份额因为不足1份而导致相应的资产被强制归入基金资产的情况。

二、为保证折算期间本基金的平稳运作,本基金管理人可根据深圳证券交易

所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停可转债A份额、可转债B份额的上市交易和东吴转债份额的申购及赎回等相关业务。届时本基金管理人将会对相关事项进行公告,敬请投资者予以关注。

投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情,请参阅基金合同及《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”)或者拨打本公司客服电话:400-821-0588(免长途话费)。

三、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,也不保证最低收益。本基金管理人提醒投资者知晓基金投资的“买者自负”原则,在做出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行承担。敬请投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书等相关法律文件。

特此公告。

东吴基金管理有限公司

二○一六年六月二十七日

东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金参加兴业证券股份有限公司费率优惠的公告

为答谢广大客户长期以来给予的信任与支持,经与兴业证券股份有限公司(以下简称“兴业证券”)协商一致,东吴基金管理有限公司(以下简称“本公司”)决定旗下部分基金参加兴业证券的费率优惠。现将具体费率优惠情况公告如下:

一、费率优惠

1、费率优惠内容

自【2016】年【6】月【28】日起,投资者通过兴业证券申购本公司旗下部分基金,申购及定投费率不设折扣限制,具体折扣费率以兴业证券公告为准。基金原费率请详见基金合同、招募说明书(更新)等法律文件,以及本公司发布的最新业务公告。

具体参与活动基金如下:

序号	基金名称	基金代码
1.	东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金	580001
2.	东吴价值成长双动力混合型证券投资基金前端收费	580002
3.	东吴行业轮动混合型证券投资基金	580003
4.	东吴进取策略灵活配置混合型证券投资基金	580005
5.	东吴新经济混合型证券投资基金	580006
6.	东吴优信稳健债券型证券投资基金A类	582001
7.	东吴中证新兴产业指数证券投资基金	585001
8.	东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金	002270
9.	东吴鼎元双债债券型证券投资基金A类	000958

费率优惠期限内,如本公司新增通过兴业证券代销的基金产品,则自该基金产品开放申购及定投当日起,将同时开通该基金上述费率优惠。

2、费率优惠期限

以兴业证券官方网站所示公告为准。

二、重要提示

1、本费率优惠仅适用于我司产品在兴业证券处于正常申购期的基金产品的前端收费模式的申购手续费(含定期定额申购业务产生的申购手续费)。

2、本费率优惠仅适用于我司产品在兴业证券申购业务的手续费,不包括基金赎回等其他业务的手续费。

3、费率优惠解释权归兴业证券所有,有关费率优惠的具体规定如有变化,敬请投资者留意前述代销机构的有关规定。

4、费率优惠期间,业务办理的流程以兴业证券的规定为准。投资者欲了解基金产品的详细情况,请仔细阅读基金的基金合同、招募说明书等法律文件。

三、投资者可通过以下途径了解或咨询相关情况

机构名称	网址	客服热线
兴业证券股份有限公司	www.xyzq.com.cn	95562
东吴基金管理有限公司	www.scfund.com.cn	4008210588

风险提示:本公司承诺以诚实信用、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,也不保证最低收益。敬请投资人注意投资风险。投资者投资于上述基金前应认真阅读基金的基金合同、更新的招募说明书。

特此公告。

东吴基金管理有限公司

2016年6月27日

证券代码:600360　　证券简称:华微电子　　公告编号:临2016-016

债券代码:122134　　债券简称:11华微债

吉林华微电子股份有限公司利润分配实施公告

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:

● 每股现金红利(税前):人民币0.02元

● 每股现金红利(税后):持有无限售条件流通股的自然人股东和证券投资基金在公司派发现金红利时暂不扣缴个人所得税,待实际转让股票时根据持股期限计算应纳税额;合格境外机构投资者(以下简称"QFII")股东,按10%税率代扣代缴所得税,税后每股现金红利为0.018元;其他机构投资者和法人股东,公司将不代扣代缴企业所得税,每股派发现金红利为0.02元。

● 股权登记日:2016年7月1日

● 除权(除息)日:2016年7月4日

● 现金红利发放日(除息日):2016年7月4日

一、通过利润分配方案的股东大会届次和日期

吉林华微电子股份有限公司(以下简称"公司")2015年度利润分配预案已经2016年5月16日召开的公司2015年年度股东大会审议通过。公司2015年年度股东大会决议公告(公告编号:2016-013)已于2016年5月17日刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》及上海证券交易所网站(www.sse.com.cn)。

二、利润分配方案

(一)发放年度:2015年度

(二)发放范围:

截止2016年7月1日(股权登记日)下午上海证券交易所收市后,在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司登记在册的全体股东。

(三)公司2015年度的利润分配方案为:

以公司现有总股本738,080,000股为基数,每10股派发现金股利0.20元(含税),总计派发现金股利14,761,600.00元(含税)。

(四)代扣所得税的有关说明:

(1)对于持有无限售条件流通股的个人股东及证券投资基金,根据《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》(财税[2015]101号)和《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》(财税[2012]85号)的有关规定,个人从公开发行和转让市场取得的公司股票,持股期限超过1年的,股息红利所得暂免征收个人所得税,每股实际派发现金红利0.02元;对个人持股1年以内(含1年)的,公司暂不扣缴个人所得税,每股实际派发现金红利0.02元,待个人转让股票时,中国证券登记结算有限责任公司上海分公司根据其持股期限计算应纳税额,由证券公司等股份托管机构从个人资金账户中扣收并划付中国证券登记结算有限责任公司上海分公司,中国证券登记结算有限责任公司上海分公司于次月5个工作日内划付公司,公司在收到税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳。

具体实际税负为:股东的持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额,实际税负为20%;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额,实际税负为10%;持股期限超过1年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。

(2)对于持有公司股份的居民企业股东(含机构投资者),其所得税自行缴纳,实际派发现金红利为每股0.02元。

(3)对于持有本公司股票的合格境外机构投资者(QFII)股东,由公司根据国家税务总局于2009年1月23日颁布的《关于中国居民企业向QFII支付股息、红利、利息代扣代缴企业所得税有关问题的通知》(国税函[2009]47号)的规定,按照10%的税率统一代扣代缴企业所得税,税后每股实际派发现金红利0.018元人民币。如相关股东认为其取得的股息、红利收入需要享受税收协定(安排)待遇的,可按照规定在取得股息、红利后自行向主管税务机关提出申请。

(4)对于香港市场投资者投资上海证券交易所公司A股股票("沪股通"),其股息红利将由公司通过中国证券登记结算有限责任公司上海分公司按股票名义持有人(香港中央结算有限公司)账户以人民币派发。根据《财政部、国家税务总局、证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》(财税[2014]81号)的有关规定,公司按照10%的税率代扣现金红利所得税,税后每股实际派发现金红利0.018元。

(5)对于其他非居民企业,公司不代扣代缴所得税,由纳税人在所得发生地缴纳。

三、实施日期

1、股权登记日:2016年7月1日

2、除权(除息)日:2016年7月4日

3、现金红利发放日(除息日):2016年7月4日

四、分派对象

截至2016年7月1日(股权登记日)下午15:00上海证券交易所收市后,在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司登记在册的本公司全体股东。

五、分配实施办法

1、公司股东上海鹏盛科技实业有限公司及吉林市中小企业信用担保集团有限公司现金红利由公司按照有关规定直接发放。

2、除上述股东外,公司其他股东红利委托中国证券登记结算有限责任公司上海分公司通过其资金清算系统向股权登记日登记在册并在上海证券交易所各会员单位办理了指定交易的股东派发。已办理指定交易的投资者可于红利发放日在其指定的证券营业部领取现金红利,未办理指定交易的股东红利暂由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司保管,待办理指定交易后再进行派发。

六、有关咨询办法

1、咨询部门:公司董事会秘书处

2、联 系 人:聂嘉宏、李铁岩

3、地　　址:吉林省吉林市高新区深圳街99号

4、邮　　编:132013

5、电　　话:0432-64684562

6、传　　真:0432-64665812

七、备查文件

● 吉林华微电子股份有限公司2015年年度股东大会决议

特此公告。

吉林华微电子股份有限公司董事会

2016年6月27日

(上接B18版)

原合同:

“(15)选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;”

修订为:

“(15)选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商、期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;”

2、“(二)基金托管人的权利与义务”中,

(1)原合同:

“(4)根据相关市场规则,为基金开设证券账户,为基金办理证券交易资金清算;”

修订为:

“(4)根据相关市场规则,为基金开设证券账户、资金账户、期货账户等投资所需账户,为基金办理证券、期货交易资金清算;”

(2)原合同:

“(6)按规定开设基金财产的资金账户和证券账户,按照《基金合同》的约定,根据基金管理人的投资指令,及时办理清算、交割事宜;”

修订为:

“(6)按规定开设基金财产的资金账户、证券账户、期货账户等投资所需账户,按照《基金合同》的约定,根据基金管理人的投资指令,及时办理清算、交割事宜;”

(三)基金份额持有人大会

1、“一、召开事由”中,

原合同:

“一、召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的,应当召开基金份额持有人大会:

……

(5)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准和提高销售服务费;

……

2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改,不需召开基金份额持有人大会:

(1)调低基金管理费、基金托管费;

(2)法律法规要求增加的基金费用的收取;

……”

修订为:

“一、召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的,应当召开基金份额持有人大会(法律法规、《基金合同》或中国证监会另有规定的除外):

……

(5)调整基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费,但法律法规要求调整该等报酬标准或销售服务费率的除外;

……

2、以下情况在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下,可由基金管理人和基金托管人协商后修改,不需召开基金份额持有人大会:

(1)法律法规要求增加的基金费用的收取;

……”

2、原合同:

“九、本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定,凡是直接引用法律法规的部分,如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的,基金管理人提前公告后,可直接对本部分内容进行修改和调整,无需召开基金份额持有人大会审议。”

修订为:

“九、本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定,凡是直接引用法律法规的部分,如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的,基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后,可直接对本部分内容进行修改和调整,无需召开基金份额持有人大会审议。”

(四)基金的投资

1、“二、投资范围”中,

原合同:

“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、公司债、短期融资券、中期票据、资产支持证券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、中小企业私募债、债券回购、银行存款等固定收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的相关规定。

……

基金的投资组合比例为:本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%;基金投资于中小企业私募债的比例不高于基金资产净值的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%。”

修订为:

“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、公司债、超短期融资券、短期融资券、中期票据、资产支持证券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、中小企业私募债、债券回购、银行存款、同业存单、非金融企业债务融资工具等固定收益类资产、国债期货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。

……

基金的投资组合比例为:本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%;基金投资于中小企业私募债的比例不高于基金资产净值的20%;每个交易日日终,在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,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%。”

2、“三、投资策略”中,

新增如下内容:

“8、国债期货投资策略

本基金投资国债期货,将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征,在风险可控的前提下,适度参与国债期货投资。”

3、“四、投资限制”中,

(1)“1、组合限制”中,

原合同:

“1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

(1)本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%;

(2)保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券;

(3)本基金投资于中小企业私募债的比例不超过基金资产净值的20%;

(4)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%;

(5)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%;

(6)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%;

(7)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%;

(8)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%;

(9)本基金持有单只中小企业私募债券,其市值不得超过基金资产净值的10%;

(10)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;

(11)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%,本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期;

(12)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券市场波动、债券发行人合并、基金规模变动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。法律法规另有规定的,从其规定。

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。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制或按照调整后的规定执行。”

修订为:

“1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

(1)本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%;

(2)本基金在每个交易日日终,扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券;

(3)本基金投资于中小企业私募债的比例不超过基金资产净值的20%;

(4)本基金持有一家公司发行的证券,其市值不超过基金资产净值的10%;

(5)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%;

(6)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%;

(7)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%;

(8)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%;

(9)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%;

(10)本基金持有单只中小企业私募债券,其市值不得超过基金资产净值的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)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%;本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期;

(13)本基金资产总值不超过基金资产净值的140%;

(14)本基金在任何交易日日终,持有的买入国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%。本基金在任何交易日日终,持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%。在任何交易日内,本基金交易(不包括平仓)的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的30%;

(15)本基金所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买入、卖出国债期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合《基金合同》关于债券投资比例的有关约定;

(16)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动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,但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的,从其规定。”

(2)新增如下内容:

“3、关联交易

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有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,或者从事其他重大关联交易的,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循基金份额持有人利益优先原则,防范利益冲突,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意,并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议,并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。”

(五)基金资产估值

1、修改的内容:

(1)原合同:

“一、估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。”

修订为:

“一、估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券、期货交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。”

(2)原合同:

“二、估值对象

基金所拥有的债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。”

修订为:

“二、估值对象

基金所拥有的债券、国债期货合约和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。”

(3)原合同:

“三、估值方法

1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1)交易所上市的有价证券,以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,以最近交易日的市价(收盘价)估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格;

(2)交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值,估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格;

(3)交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值;估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格;

(4)交易所上市不存在活跃市场的有价证券,采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

2、首次公开发行未上市的债券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种,采用估值技术确定公允价值。

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的,按债券所处的市场分别估值。

5、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

6、基金所持有的中小企业私募债,按成本估值。国家有最新规定的,按其规定进行估值。

7、相关法律法规以及监管部门有强制规定的,从其规定。如有新增事项,按国家最新规定估值。”

修订为:

“1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1)交易所上市的有价证券,以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,以最近交易日的市价(收盘价)估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格。

(2)在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(另有规定的除外)选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。

(3)对在交易所市场上市交易的可转换债券,按照每日收盘价作为估值全价。

(4)对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募证券,估值日不存在活跃市场时采用估值技术确定其公允价值进行估值或按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:

(1)首次公开发行未上市的债券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

(2)对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券,对存在活跃市场的情况下,应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值进行估值;对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下,按成本应对市场报价进行调整,确认计量日的公允价值;对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下,则采用估值技术确定公允价值。

3、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种,按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种,按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种,回售登记截止日(含当日)后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市,且第三方估值机构未提供估值价格的债券,在发行利率与二级市场利率不存在明显差异,未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下,按成本估值。

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的,按债券所处的市场分别估值。

5、本基金所持有的国债期货合约,一般以估值当日结算价进行估值,估值日无结算价的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化的,采用最近交易日结算价估值。

6、存款的估值方法

持有的银行定期存款或通知存款以本金列示,按协议或合同利率逐日确认利息收入。

7、本基金可以采用第三方估值机构按照上述公允价值确定原则提供的估值价格数据。

8、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

9、相关法律法规以及监管部门有强制规定的,从其规定。如有新增事项,按国家最新规定估值。”

(4)原合同:

“四、估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后,基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算,精确到0.001元,小数点后第4位四舍五入。国家另有规定的,从其规定。”

修订为:

“四、估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后,基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算,精确到0.0001元,小数点后第5位四舍五入。国家另有规定的,从其规定。”

(5)原合同:

“五、估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后3位以内(含第3位)发生估值错误时,视为基金份额净值错误。”

修订为:

“五、估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后4位以内(含第4位)发生估值错误时,视为基金份额净值错误。”

(6)原合同:

“六、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;”

修订为:

“六、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;”

2、新增如下内容:

“八、特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按基金合同规定的估值方法的第8项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力原因,或由于证券、期货交易所及登记结算公司发送的数据错误等,基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但未能发现错误的,由此造成的基金资产估值错误,基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。”

(六)基金费用与税收

1、“一、基金费用的种类”中,

原合同:

“一、基金费用的种类

1、基金管理人的管理费;

2、基金托管人的托管费;

3、基金的销售服务费用;

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、基金的开户费用、账户维护费用;

10、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。”

修订为:

“一、基金费用的种类

1、基金管理人的管理费;

2、基金托管人的托管费;

3、基金的销售服务费用;

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、仲裁费和诉讼费;

6、基金份额持有人大会费用;

7、基金的证券、期货交易费用;

8、基金的银行汇划费用;

9、基金的开户费用、账户维护费用;

10、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。”

2、“1、基金管理人的管理费”中,

原合同:

“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0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.5 %÷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5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。”

修订为:

“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0.25%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.25%÷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5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。”

(七)基金的信息披露

1、“五、公开披露的基金信息”中,

(1)原合同:

“11、涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼;”

修订为:

“11、涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁;”

(2)原合同:

“(十)基金投资中小企业私募债

基金管理公司应当在基金投资中小企业私募债券后两个交易日内,在中国证监会指定媒体披露所投资中小企业私募债券的名称、数量、期限、收益率等信息。”

修订为:

“(十)基金投资中小企业私募债

基金管理公司应当在基金投资中小企业私募债券后两个交易日内,在中国证监会指定媒介披露所投资中小企业私募债券的名称、数量、期限、收益率等信息。

基金管理人应当在本基金季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露中小企业私募债券的投资情况。”

(3)新增如下内容:

“(十一)投资资产支持证券的相关公告

基金管理人应在本基金半年度报告及年度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。

基金管理人应在本基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前10名资产支持证券明细。

(十二)基金投资国债期货

基金管理人在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露国债期货交易情况,包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等,并充分揭示国债期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。”

2、新增如下内容:

“八、暂停或延迟信息披露的情形

当出现下述情况时,基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息:

1、不可抗力;

2、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;

3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变,而基金管理人为保障投资人的利益,决定延迟估值;

4、法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情况。”

(八)违约责任

原合同:

“三、由于基金管理人、基金托管人不可控制的因素导致业务出现差错,基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但是未能发现错误的,由此造成基金财产或投资人损失,基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但是基金管理人和基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。”

修订为:

“三、由于基金管理人、基金托管人不可控制的因素导致业务出现差错,基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但是未能发现错误的,由此造成基金财产或投资人损失,基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但是基金管理人和基金托管人应积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。”

(九)争议的处理和适用的法律

原合同:

“各方当事人同意,因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议,应经友好协商解决,但若自一方书面提出协商解决争议之日起60日内争议未能以协商方式解决的,则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会,按照其时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的,对仲裁各方当事人均具有约束力。”

修订为:

“各方当事人同意,因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议,应经友好协商解决,但若自一方书面提出协商解决争议之日起60日内争议未能以协商方式解决的,则任何一方有权将争议提交位于北京市的中国国际经济贸易仲裁委员会,按照其时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的,对仲裁各方当事人均具有约束力,仲裁费用由败诉方承担。”

(十)基金合同内容摘要

基金合同内容摘要部分涉及上文内容的一并修改。

(十一)授权基金管理人修订基金合同其他内容

除上述对基金合同的修订外,考虑到自本基金成立以来,《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规陆续颁布实施和基金管理人、基金托管人的情况变化,基金管理人需要根据现行有效的法律法规、行业规范要求和基金管理人、基金托管人最新的基本情况修订《国泰淘金互联网债券型证券投资基金基金合同》的相关内容。

(十二)修订后的基金合同的生效

本次基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效,修订后的基金合同自本次基金份额持有人大会决议生效公告之日起生效,原基金合同自同日起失效。

综上所述,基金管理人拟提请基金份额持有人大会授权基金管理人办理本次修订基金合同的具体事宜,包括但不限于根据市场情况确定实施的具体时间、根据现时有效的法律法规的要求和《国泰淘金互联网债券型证券投资基金基金合同修改说明书》相关内容对本基金基金合同进行修订和补充。

三、基金管理人就相关事项的说明

(一)国泰淘金互联网债券型证券投资基金的历史沿革

本基金经中国证监会《关于核准国泰淘金互联网债券型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2013]1050号)核准募集。基金管理人为国泰基金管理有限公司,基金托管人为宁波银行股份有限公司。

本基金于2013年11月1日至2013年11月15日公开募集,募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认,《国泰淘金互联网债券型证券投资基金基金合同》于2013年11月19日生效。

(二)修改基金合同有利于保护基金份额持有人利益

本基金自基金合同生效以来,因市场环境变化等因素的影响,未能形成持续有效需求,产品维护成本越来越高。本次基金合同修改后可以更好地满足投资者需求,维护基金份额持有人利益。

(三)基金合同修改的可行性

1、基金合同修改事项不存在法律障碍

《基金法》第四十七条规定,“基金份额持有人大会由全体基金份额持有人组成,行使下列职权:……(二)决定修改基金合同的重要内容……”。

《基金法》第八十六条规定,“……基金份额持有人大会就审议事项作出决定,应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的二分之一以上通过;但是,转换基金的运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、提前终止基金合同、与其他基金合并,应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上通过。基金份额持有人大会决定的事项,应当依法报国务院证券监督管理机构备案,并予以公告。”

《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十八条规定,“……基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。……”

因此,本基金基金合同修改事项不存在法律方面的障碍。

2、基金合同修改不存在技术障碍

基金合同修改后,投资范围中增加了国债期货,鉴于基金管理人在债券型基金、股票型基金和混合型基金方面拥有丰富的债券、期货的投资、运营、风控经验,因而不存在技术操作上的障碍。

四、修改基金合同的主要风险及预备措施

(一)修改基金合同方案被持有人大会否决的风险

在设计修改方案之前,基金管理人已对基金份额持有人进行了走访,认真听取了相关意见,拟定议案综合考虑了基金份额持有人的要求。如有必要,基金管理人将根据基金份额持有人意见,对基金合同修改方案进行适当的修订,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。

(二)基金合同修改前后的运作风险

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、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,请通过以下方式联系基金管理人:

国泰基金管理有限公司

联系电话:021-31089000

传真:021-31081700

电子邮件:service@gtfund.com

网址:www.gtfund.com