天治基金管理有限公司关于以通讯方式召开天治品质优选混合型证券投资基金基金份额持有人大会第一次提示性公告

天治基金管理有限公司决定以通讯方式召开天治品质优选混合型证券投资基金基金份额持有人大会,并于2016年3月15日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及天治基金管理有限公司网站(www.chinanature.com.cn)发布了《天治基金管理有限公司关于以通讯方式召开天治品质优选混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》。为使本次基金份额持有人大会顺利召开,现发布关于以通讯方式召开天治品质优选混合型证券投资基金基金份额持有人大会第一次提示性公告。

一、会议基本情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《天治品质优选混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)的有关规定,天治品质优选混合型证券投资基金的基金管理人天治基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”或“本公司”)决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会,会议召开的具体安排如下:

1、会议召开方式:通讯方式。

2、会议投票表决起止时间:自2016年3月31日起,至2016年4月15日17:00止(送达时间以本基金管理人收到表决票时间为准)。

3、会议计票日:2016年4月18日

4、会议通讯表决票的寄达地点:

基金管理人:天治基金管理有限公司

办公地址:上海市复兴西路159号

联系人:张雪

联系电话:021-60374923

请在信封表面注明:“天治品质优选混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

二、会议审议事项

《关于天治品质优选混合型证券投资基金转型有关事项的议案》(见附件一)。

三、基金份额持有人的权益登记日

本次大会的权益登记日为2016年3月30日,即在2016年3月30日下午交易时间结束后,在本基金注册登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人均有权参与本次基金份额持有人大会的表决。

四、表决票的填写和寄交方式

1、本次会议表决票见附件二。基金份额持有人可从相关报纸上剪裁、复印附件二或登录本基金管理人网站(www.chinanature.com.cn)下载并打印表决票。

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)个人投资者自行投票的,需在表决票上签字,并提供本人身份证件(包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明)正反面复印件;

(2)机构投资者自行投票的,需在表决票上加盖本单位公章(或基金管理人认可的其他印章,下同),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);合格境外机构投资者自行投票的,需在表决票上加盖本机构公章(如有)或由授权代表在表决票上签字(如无公章),并提供该授权代表的有效身份证件正反面复印件,该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件,以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件和取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件;

(3)个人投资者委托他人投票的,应由代理人在表决票上签字或盖章,并提供个人投资者身份证件(包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明)正反面复印件,以及填妥的授权委托书原件(可参照附件三)。如代理人为个人,还需提供代理人的身份证件(包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明)正反面复印件;如代理人为机构,还需提供代理人的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)机构投资者委托他人投票的,应由代理人在表决票上签字或盖章,并提供机构投资者的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(参照附件三)。如代理人为个人,还需提供代理人的身份证件(包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明)正反面复印件;如代理人为机构,还需提供代理人的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)。合格境外机构投资者委托他人投票的,应由代理人在表决票上签字或盖章,并提供该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件,以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件,以及填妥的授权委托书原件。如代理人为个人,还需提供代理人的身份证件(包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明)正反面复印件;如代理人为机构,还需提供代理人的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)。

(5)以上各项中的公章、批文、开户证明及登记证书,以基金管理人的认可为准。

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自2016年3月31日起,至2016年4月15日17:00以前(送达时间以基金管理人收到表决票时间为准)通过专人送交或邮寄的方式送达至本基金管理人办公地址,并请在信封表面注明:“天治品质优选混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

本基金管理人办公地址及联系方式如下:

基金管理人:天治基金管理有限公司

办公地址:上海市复兴西路159号

联系人:张雪

联系电话:021-60374923

五、计票

1、本次通讯会议的计票方式为:由本基金管理人授权的两名监督员在基金托管人(中国民生银行股份有限公司)授权代表的监督下在表决截止日期第2日(即2016年4月18日)进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证。

2、基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。

3、表决票效力的认定如下:

(1)表决票填写完整清晰,所提供文件符合本公告规定,且在规定时间之前送达基金管理人的,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、表决意见模糊不清或相互矛盾,但其他各项符合会议通知规定的,视为弃权表决,计入有效表决票,并按“弃权”计入对应的表决结果,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。

(3)如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基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的,或未能在规定时间之前送达基金管理人的,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。

(4)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,计入弃权表决票;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,邮寄的以基金管理人收到的时间为准。

六、决议生效条件

1、本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的50%以上(含50%);

2、《关于天治品质优选混合型证券投资基金转型有关事项的议案》应当由提交有效表决票的基金份额持有人和其代理人所持表决权的50%以上(含50%)通过;

3、直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和本公告的规定,并与注册登记机构记录相符;

4、本次基金份额持有人大会决议通过的事项,本基金管理人自生效之日起五日内报中国证监会备案,基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。

七、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及《基金合同》的规定,本次持有人大会需要本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额达到权益登记日基金总份额的50%以上(含50%)方可举行。如果本次基金份额持有人大会不符合前述要求而不能成功召开,根据2013年6月1日生效的《中华人民共和国证券投资基金法》,基金管理人可另行确定并公告重新开会的时间(至少应在25个工作日后)和地点,但权益登记日仍为2016年3月30日。

重新召开基金份额持有人大会时,除非授权文件另有载明,本次基金份额持有人大会授权期间基金份额持有人做出的各类授权依然有效,但如果授权方式发生变化或者基金份额持有人重新做出授权,则以最新方式或最新授权为准,详细说明见届时发布的重新召集基金份额持有人大会的通知。

八、本次大会相关机构

1、召集人:天治基金管理有限公司

联系人:张雪

联系电话:021-60374923

传真:021-60374924

网址:www.chinanature.com.cn

2、监督人:中国民生银行股份有限公司

3、公证机关:上海市东方公证处

联系人:林奇

联系电话:021-62178903

4、见证律师事务所:上海市通力律师事务所

联系人:安冬

联系电话:021-31358666

九、重要提示

1、请基金份额持有人在提交表决票时,充分考虑邮寄在途时间,确保表决票于表决截止时间前送达。

2、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客户服务电话400-098-4800、021-60374800咨询。

3、基金管理人将在发布本公告后2个工作日内连续公布相关提示性公告,就持有人大会相关情况做必要说明,请予以留意。

4、本公告的有关内容由天治基金管理有限公司负责解释。

天治基金管理有限公司
2016年3月16日

附件一:《关于天治品质优选混合型证券投资基金转型有关事项的议案》
附件二:《天治品质优选混合型证券投资基金基金份额持有人大会通讯表决票》
附件三:《授权委托书》
附件四:《天治品质优选混合型证券投资基金转型方案说明书》
附件一:

关于天治品质优选混合型证券投资基金转型有关事项的议案

天治品质优选混合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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《天治品质优选混合型证券投资基金基金合同》有关规定,基金管理人经与基金托管人中国民生银行股份有限公司协商一致,提议对天治品质优选混合型证券投资基金(以下简称“天治品质优选”)实施转型。《天治品质优选混合型证券投资基金转型方案说明书》见附件四。

为实施天治品质优选混合型证券投资基金转型方案,提议授权基金管理人办理本次天治品质优选混合型证券投资基金转型的有关具体事宜,并根据现时有效的法律法规的规定和《天治品质优选混合型证券投资基金转型方案说明书》的有关内容对《天治品质优选混合型证券投资基金基金合同》进行必要的修改和补充。

以上议案,请予审议。

基金管理人:天治基金管理有限公司
2016年3月15日

附件二:

天治品质优选混合型证券投资基金基金份额持有人大会通讯表决票

天治品质优选混合型证券投资基金份额持有人大会表决票			
基金份额持有人姓名名称:			
证件号码(身份证件号/营业执照号):	基金账号:		
审议事项	同意	反对	弃权
《关于天治品质优选混合型证券投资基金转型有关事项的议案》			
基金份额持有人/受托人签名或盖章 2016年 月 日			

说明:1、请就审议事项表示“同意”、“反对”或“弃权”,并在相应栏内画“√”,同一议案只能表示一项意见;表决意见代表基金份额持有人本基金账户下全部基金份额的表决意见;2、“基金账号”,仅指持有本基金份额的基金账户号,同一基金份额持有人拥有多个此类账户且需要按照不同账户持有基金份额分别行使表决权的,应当填写基金账号;其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的,将被默认为代表此基金份额持有人所持有的本基金所有份额;3、表决意见未选、多选或无法辨认、模糊不清或相互矛盾的表决票均视为投票人放弃表决权利,其所持全部基金份额的表决结果均计为“弃权”;4、本表决票可从本基金管理人网站(www.chinanature.com.cn)下载、从报纸上剪裁、复印或按此格式打印。

附件三:

授权委托书

兹全权委托 先生/女士或 单位代表本人(或本机构)参加投票截止日为2016年4月15日的以通讯方式召开的天治品质优选混合型证券投资基金基金份额持有人大会,并代为全权行使所有议案的表决权。表决意见以受托人的表决意见为准。

若在法定时间内就同一议案重新召开天治品质优选混合型证券投资基金基金份额持有人大会,除本人(或本机构)重新作出授权外,本次基金份额持有人大会授权期间本人(或本机构)做出的各类授权依然有效。

委托人姓名或名称(签字/盖章):

委托人证件号码(身份证件号/营业执照注册号):

委托人基金账户号:

受托人(代理人)姓名或名称(签字/盖章):

受托人证件号码(身份证件号/营业执照注册号):

委托日期:2016年 月 日

附注:1、此授权委托书可剪报、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。2、“基金账户号”,仅指持有本基金份额的基金账户号,同一基金份额持有人拥有多个此类账户且需要按照不同账户持有基金份额分别行使表决权的,应当填写基金账户号;其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的,将被默认为代表此基金份额持有人所持有的本基金所有份额。3、受托人的表决意见代表委托人本基金账户下全部基金份额的表决意见。

附件四:

天治品质优选混合型证券投资基金转型方案说明书

一、重要提示

1、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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《天治品质优选混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)有关规定,基金管理人经与基金托管人中国民生银行股份有限公司协商一致,提议以通讯方式召开基金份额持有人大会,审议关于天治品质优选混合型证券投资基金(以下简称“天治品质优选”)转型有关事项的议案。

2、本次天治品质优选混合型证券投资基金转型方案需经本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所持表决权的50%以上(含50%)通过,因此转型方案存在无法获得相关基金份额持有人大会表决通过的可能。

3、基金份额持有人大会表决通过的事项须报中国证监会备案,且基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。中国证监会对本次天治品质优选混合型证券投资基金持有人大会决议的备案,均不表明其对本次转型方案或本基金的投资价值、市场前景或投资者的收益做出实质性判断或保证。

二、转型方案要点

天治品质优选混合型证券投资基金转型方案的主要内容如下:

(一)更名

基金名称由“天治品质优选混合型证券投资基金”更名为“天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金”。同时,《天治品质优选混合型证券投资基金基金合同》将变更为《天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

(二)转型后基金产品方案要点

1、基金名称:天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金

2、基金类型:混合型证券投资基金

3、基金运作方式:契约型开放式

4、基金存续期限:不定期

5、投资目标:在灵活配置股票和债券资产的基础上,精选受益于低碳经济的主题相关企业,追求持续稳健的超额回报。

6、投资范围:本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券或票据)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。

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

7、投资组合比例

基金的投资组合比例为:本基金股票资产投资比例为基金资产的0%-95%,其中,投资于受益于低碳经济主题相关企业的证券不低于非现金基金资产的80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当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。

8、投资策略:

(1)资产配置策略

资产配置策略方面,本基金将采取战略性资产配置和战术性资产配置相结合的资产配置策略,根据宏观经济运行态势、政策变化、市场环境的变化,在长期资产配置保持稳定的前提下,积极进行短期资产灵活配置,力图通过时机选择构建在承受一定风险前提下获取较高收益的资产组合。

本基金实施大类资产配置策略过程中还将根据各类证券的风险收益特征的相对变化,动态优化投资组合,以规避或控制市场风险,提高基金收益率。

(2)股票投资策略

在全球气候变暖的背景下,以低能耗、低污染为基础的“低碳经济”成为全球热点。低碳经济是一种以低能耗、低污染、低排放为特点的发展模式,是以应对气候变化、保障能源安全、促进经济社会可持续发展有机结合为目的的新规则。本基金将沿着低碳经济的路线,把握其中蕴含的投资机会。

1)低碳经济主题类股票的界定:

本基金认可的低碳经济主题类股票包括两种类型的股票:

①直接从事低碳经济主题相关行业的股票

a.清洁能源:主要包括清洁能源的研发、生产与运营,如风能、太阳能、生物质能、水电及核电等;也包括清洁能源的传输、服务等配套产业,如特高压输电、智能电网等相关上市公司;

b.节能减排:主要包括与节能技术和装备、节能产品及节能服务产业的相关上市公司,如工业节能、建筑节能、汽车节能;也包括化石能源减排,如清洁燃煤、整体煤气化联合循环、碳捕获与封存等相关上市公司;

c.碳交易与陆地碳汇、海洋碳汇:主要包括与清洁发展机制项目和农林产业减排增汇等相关的上市公司;

d.环保行业:包括环保技术和设备、环保服务和资源利用等相关行业的上市公司;

②受益于低碳经济主题的股票,包括:

a.传统高耗能高污染行业中,通过有效节能减排措施或污染治理措施,实现能耗降低、污染改善,从而实现产业升级,相对同类公司受益的上市公司;

b.与低碳经济主题相关的服务行业

c.投资于低碳经济相关产业的上市公司;

d.因与低碳经济主题相关的产业结构升级、消费生活模式转变而受益的其他上市公司。

未来,由于经济增长方式转变、产业结构升级等因素,从事或受益于上述投资主题的外延将会逐渐扩大,本基金将视实际情况调整上述对低碳环保主题类股票的识别及认定。

(2)个股投资策略

通过行业领先度和市场领先度的双重定量评价以及长期驱动因素和事件驱动因素的双重定性分析,精选受益于低碳经济主题相关企业进行重点投资。

行业领先度主要考察盈利能力、行业贡献度和主营业务显著度,其中以盈利能力为主。盈利能力通过净资产收益率和毛利率并辅以经营性现金净流量和自由现金流量进行综合评估,行业贡献度依据营业收入和营业利润在行业中占比进行衡量,主营业务显著度通过主营行业或产品的营业收入占比和营业利润占比进行比较。

市场领先度主要考察估值水平、流动性和机构认同度,其中以估值水平为主。估值水平通过PE、PS、PB、净利润增长率、营业收入增长率、PEG、PSG 等静态估值水平、动态估值水平、历史成长性、预期成长性指标以及综合估值水平与成长性的指标进行横向和纵向比较,流动性指标包括自由流通比例和日均换手率、日均交易额等交易活跃度指标,机构认同度是指外部研究机构对个股的成长性与价值的一致性预期。

长期驱动因素主要考察主营业务前景、管理层能力、公司战略和治理结构。以上因素作为公司内生性成长的基础,是公司可持续性发展的保障。

事件驱动因素主要考察公司是否存在兼并收购、投资项目、资产增值等基本面的正向变动。以上因素是公司外延式增长的体现,作为长期驱动因素分析的有效补充。

(3)债券投资策略

在选择债券品种时,首先根据宏观经济、资金面动向、发行人情况和投资人行为等方面的分析判断未来利率期限结构变化,并充分考虑组合的流动性管理的实际情况,配置债券组合的久期;其次,结合信用分析、流动性分析、税收分析等确定债券组合的类属配置;再次,在上述基础上利用债券定价技术选择个券,选择被价格低估的债券进行投资。

本基金投资于中小企业私募债。由于中小企业私募债券整体流动性相对较差,且整体信用风险相对较高。中小企业私募债券的这两个特点要求在具体的投资过程中,应采取更为谨慎的投资策略。本基金投资该类债券的核心要点是分析和跟踪发债主体的信用基本面,并综合考虑信用基本面、债券收益率和流动性等要素,确定最终的投资决策。

(4)权证投资策略

本基金在进行权证投资时,将通过对权证标的证券基本面的研究,并结合权证定价模型寻求其合理估值水平,并充分考虑权证资产的收益性、流动性、风险性特征,主要考虑运用的策略包括:价值挖掘策略、获利保护策略、杠杆策略、双向权证策略、价差策略、买入保护性的认沽权证策略、卖空保护性的认购权证策略等。

(5)资产支持证券投资策略

资产支持证券投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析,本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下,采用基本面分析和数量化模型相结合,对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。

(6)股指期货投资策略

本基金在进行股指期货投资时,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值或期限套利等操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

今后,随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等,基金还将积极寻求其他投资机会,如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,本基金将在履行适当程序后,将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。

9、投资比例限制

(1)组合限制

本基金的投资组合应遵循以下限制:

1)本基金股票资产投资比例为基金资产的0%-95%,其中,投资于受益于低碳经济主题相关企业的证券不低于非现金基金资产的80%;

2)本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当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%;

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)本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;

6)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%;

7)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%;

8)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%;

9)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%;

10)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%;

11)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%;

12)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;

13)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;

14) 本基金进入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;

15)本基金投资股指期货后,需遵循下述比例限制:

在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值,不得超过基金资产净值的10%;在任何交易日日终,持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的95%,其中,有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;在任何交易日日终,持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%;在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指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20%;所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定;

16)本基金持有的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%;

17)本基金总资产不得超过基金净资产的140%;

18)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。

除上述第(12)项另有约定外,因证券或期货市场波动、上市公司合并、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。

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。在上述期间内,本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。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。

如果法律法规或监管部门对上述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。

(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)违反规定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,但中国证监会另有规定的除外;

5)向基金管理人、基金托管人出资;

6)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;

7)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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。

如法律、行政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。

10、业绩比较基准:

本基金的业绩比较基准为:中证内地低碳经济主题指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%。

中证内地低碳经济主题指数是为了反映在中国内地上市的低碳经济类公司股票的整体走势,从沪深A 股中挑选日均总市值较高的50只低碳经济主题公司股票组成样本股,基日为2010年6月30日,基点为1000点。在编制方法上,中证内地低碳经济主题指数采用了主流的市值加权方法,具有较好的市场代表性;另外还采用了分级靠档技术,分级靠档技术的采用可以使在样本公司股本发生微小变动时保持用于指数计算的样本公司股本数的稳定,可以降低股本变动频繁带来跟踪投资成本,便于投资者进行跟踪投资。中证全债指数由中证指数公司编制,样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成,是综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。

随着法律法规和市场环境发生变化,如果上述业绩比较基准不适用本基金,或者本基金业绩比较基准中所使用的指数暂停或终止发布,或者推出更权威的能够代表本基金风险收益特征的指数,基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则,与基金托管人协商一致后,对业绩比较基准进行相应调整,并报中国证监会备案并及时公告,无需召开基金份额持有人大会。

11、风险收益特征:本基金为混合型基金,其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金,高于债券型基金、货币市场基金。

12、基金交易模式:投资者可以在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。基金份额的申购、赎回以基金份额净值为基础计算交易价格。

13、基金的申购费率:投资人申购本基金需缴纳申购费,投资人在同一天多次申购的,根据单次申购金额确定每次申购所适用的费率。申购费用由投资者承担,用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用,不列入基金财产。具体费率如下:

申购金额(M,含申购费)	申购费率
M<25万元	1.50%
25万元≤M<100万元	1.00%
100万元≤M<500万元	0.50%
M≥500万元	每笔收取1200元

注:1 个月按30 日计算,2 个月按60 日计算,以此类推;1 年按365 日计算,2 年按730日计算,以此类推。投资人通过日常申购所得基金份额,持有期限自登记机构确认登记之日起计算(下同)。

14、基金的赎回费率:赎回费由赎回人承担,25%归基金财产所有,75%支付注册登记费和相关手续费。本基金的赎回费率随持有年限的增加逐步递减:

持有期限(N)	赎回费率
N<1年	0.50%
1年≤N<2年	0.30%
2年≤N<3年	0.10%
N≥3年	0

15、管理费用、托管费用:拟定基金管理费年费率为1.50%,拟定托管费年费率为0.25%。

16、估值方法

(1)证券交易所上市的有价证券的估值

1)交易所上市的非固定收益类有价证券(包括股票、权证等),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)交易所上市的固定收益类有价证券,区分如下情况处理:对在交易所市场上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种,使用估值技术或选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价。对在交易所市场上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种,使用估值技术或选取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。对在交易所市场上市交易的可转换债券,按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含债券应收利息后得到的净价进行估值。

3)交易所上市不存在活跃市场的非固定收益类有价证券,采用估值技术确定公允价值。

4)交易所挂牌转让的资产支持证券,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)处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:

1)送股、转增股、配股和公开增发的新股,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值;该日无交易的,以最近一日的市价(收盘价)估值;

2)首次公开发行未上市的股票、债券和权证,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)首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,按交易所上市的同一股票的估值方法估值;非公开发行有明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值;

4)对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的固定收益类品种,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;对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下,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,应采用估值技术确定其公允价值。

(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)股指期货合约,一般以估值当日结算价进行估值,估值当日无结算价的,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。国家有最新规定的,按其规定进行估值。

(6)基金所持有的中小企业私募债按照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。国家有最新规定的,按其规定进行估值。

(7)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。

(8)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。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时,应立即通知对方,共同查明原因,双方协商解决。

根据有关法律法规,基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任,因此,就与本基金有关的会计问题,如经相关各方在平等基础上充分讨论后,仍无法达成一致的意见,按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

17、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20%,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;(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)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。

18、基金管理人:天治基金管理有限公司

19、基金托管人:中国民生银行股份有限公司

20、注册登记机构:天治基金管理有限公司

21、基金销售机构:中国民生银行股份有限公司、天治基金管理有限公司等

22、会计师事务所:安永华明会计师事务所有限公司

23、律师事务所:上海市通力律师事务所

(三)授权基金管理人修订基金合同

除上述内容的调整需要修改基金合同以外,考虑到自《天治品质优选混合型证券投资基金基金合同》生效以来,《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其配套准则等法律法规陆续颁布和实施,基金管理人需要根据现行有效的法律法规要求及转型后的天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金的产品特征修订《天治品质优选混合型证券投资基金基金合同》的相关内容。

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按照现行有效的法律法规的规定及转型后的天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金的产品特性相应修订《基金合同》的内容。

(四)天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金基金合同的生效

自本次基金份额持有人大会决议生效并公告之日起,由《天治品质优选混合型证券投资基金基金合同》修订而成的《天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效,原《天治品质优选混合型证券投资基金基金合同》同日起失效。

综上所述,拟请基金份额持有人大会授权基金管理人针对上述事项修订基金合同内容,基金管理人完成基金合同内容修订并经基金托管人审核同意后,将报中国证监会备案。

三、基金管理人就方案相关事项的说明

(一)天治品质优选混合型证券投资基金基本情况

天治品质优选混合型证券投资基金经中国证监会《关于核准天治品质优选混合型证券投资基金募集的批复》(证监许可〔2004〕192号文)核准募集,基金管理人为天治基金管理有限公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

天治品质优选混合型证券投资基金自2004年11月29日至2005年1月7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,《天治品质优选混合型证券投资基金基金合同》于2005年1月12日生效。

(二)天治品质优选混合型证券投资基金召开持有人大会的必要性

从合规的角度来看,根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条,基金合同生效后,连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续六十个工作日出现前述情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。“天治品质优选混合型证券投资基金已经出现连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情况,基金管理人拟以修改基金合同并转型的方案以求解决上述情况。

从维护投资者利益的角度来看,为了优化基金的投资目标与投资策略,维护基金份额持有人利益,天治品质优选混合型证券投资基金转型为天治低碳经济灵活配置混合型基金,放宽了投资范围和投资比例的限制,提高了产品的市场竞争力,故天治品质优选混合型证券投资基金需要转型。

因此,天治品质优选混合型证券投资基金的转型,将有力于帮助投资者参与资本市场,分享中国资本市场成长果实,为投资者提供更多样化、更细分的理财产品。

四、本基金转型的主要风险及预备措施

(一)预防转型方案被基金份额持有人大会否决的风险

为防范转型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转型方案进行适当修订,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