

全国社会保障基金境外投资管理暂行规定

第一章 总则

第一条 为规范全国社会保障基金(以下简称全国社保基金)投资于中华人民共和国境外的行为(以下简称境外投资),防范和化解全国社保基金投资风险,根据国家有关法律、法规,制定本规定。

第二条 全国社保基金境外投资应遵循安全、稳健原则。

第三条 全国社保基金境外投资,由全国社会保障基金理事会(以下简称社保基金会)负责组织实施。

第四条 财政部会同劳动和社会保障部(以下简称劳动保障部)、国家外汇管理局(以下简称外汇局)制定全国社保基金境外投资管理运作的有关政策,对全国社保基金境外投资运作情况进行监督。

中国证券监督管理委员会(以下简称证监会)、中国银行业监督管理委员会(以下简称银监会)按照各自职能对全国社保基金境外投资相关事宜进行监督。

第二章 全国社保基金境外投资管理人

第五条 社保基金会需委托符合本规定第六条规定的境外投资管理实施全国社保基金境外投资。

第六条 全国社保基金境外投资管理应具备以下条件:

- (一) 财务状况稳健,资信良好,风险控制指标符合所在国家或地区法律规定和监管机构的要求;
- (二) 经营资产管理业务达6年以上,最近一个会计年度管理的资产不少于50亿美元(或等值货币);
- (三) 从业人员符合所在国家或者地区的有关从业资格要求;
- (四) 有健全的治理结构和完善的内控制度,经营行为规范;
- (五) 近3年未受到所在国家或者地区监管机构的重大处罚;
- (六) 在中国境外设立并登记注册,所在国家或者地区法律和金融监管制度完善,监管机构与证监会签订监管合作谅解备忘录,并保持有效的监管合作关系。

第七条 社保基金会应参照国际通行原则,组织评选和确定全国社保基金境外投资管理人。评选结果应在评选结束后10日内向财政部、劳动保障部、证监会和外汇局报告。

第八条 社保基金会应与全国社保基金境外投资管理人签订委托资产管理合同,资产管理合同除应符合一般委托经营的惯例外,还应符合以下规定:

- (一) 合同文字以中文为准,但根据合同需要、市场实务或惯例需以外文为准的,应附中文译本;
- (二) 明确受托人应遵循利益回避的原则;
- (三) 明确受托人应负的责任和忠实义务;
- (四) 明确对投资品种或者工具的限制;
- (五) 明确投资于任一上市公司股票、债券或其他有价证券总金额的 limit;
- (六) 明确投资于任一上市公司股票占该公司已发行股份总数比例的限制;
- (七) 明确受托全国社保基金净资产价值及收益率的计算方式;
- (八) 明确社保基金会可聘请会计师事务所对全国社保基金境外投资管理人管理的全国社保基金资产进行审计;
- (九) 明确合同解除和终止的有关事项;
- (十) 需要明确的其他事项。

社保基金会签订全国社保基金委托资产管理合同前,需由执业5年以上的专业律师出具无保留法律意见。

社保基金会应在签订合同之日起15日内,将全国社保基金委托资产管理合同连同法律意见书报告财政部、劳动保障部、证监会和外汇局。

第三章 全国社保基金境外资产托管人

第九条 社保基金会需委托符合本规定第十条规定的境外资产托管人负责全国社保基金境外资产托管业务。

第十条 全国社保基金境外资产托管人应具备以下条件:

- (一) 最近一个会计年度实收资本不少于50亿美元(或等值货币)或托管资产规模不少于5000亿美元(或等值货币);
- (二) 国际公认评级机构最近3年对其长期信用评级在A级或者相当于A级以上;
- (三) 有足够的熟悉托管业务的专职人员;
- (四) 具备安全、高效的结算和交割能力;
- (五) 有符合要求的经营场所、安全防范设施以及在全国社保基金托管业务有关的其他设施;
- (六) 有完善的内部稽核控制制度和风险控制制度;
- (七) 近3年未受到所在国家或地区监管机构的重大处罚;
- (八) 在中国境外设立并登记注册,所在国家或者地区法律和金融监管制度完善,监管机构与银监会已签订监管合作谅解备忘录,并保持有效的监管合作关系。

第十一条 社保基金会应参照国际通行原则,组织评选和确定全国社保基金境外资产托管人。评选结果应在评选结束后10日内向财政部、劳动保障部、银监会、证监会和外汇局报告。

第十二条 社保基金会应与全国社保基金境外资产托管人签订全国社保基金境外资产托管合同,托管合同除应符合一般托管合同的惯例外,还应符合以下规定:

- (一) 合同文字以中文为准,但根据合同需要、市场实务或惯例需要以外文为准的,应附中文译本;
- (二) 明确托管人应负的责任和忠实义务;
- (三) 明确社保基金会可聘请会计师事务所对全国社保基金境外资产托管人托管的全国社保基金资产进行审计;
- (四) 明确合同解除和终止的有关事项;
- (五) 需要明确的其他事项。

社保基金会签订全国社保基金委托资产托管合同前,需由执业5年以上的专业律师出具无保留法律意见。

社保基金会应在签订合同之日起15日内,将全国社保基金委托资产托管合同连同法律意见书报告财政部、劳动保障部、银监会、证监会和外汇局。

第十三条 全国社保基金境外资产托管人应就下列事项向社保基金会作出书面承诺:

- (一) 遵守本规定第五章第二十二、二十三条关于全国社保基金境外外汇资金账户收支范围的规定;
- (二) 履行本规定第五章第二十五条规定的信息报告义务;
- (三) 监督全国社保基金境外投资管理人投资运作,发现全国社保基金境外投资管理人违反本规定第五章第二十二、二十三条有关全国社保基金外汇资金账户收支范围规定的,应及时向社保基金会和外汇局报告。

全国社保基金境外资产托管人无正当理由违反前述义务,财政部、劳动保障部和外汇局可建议社保基金会解除全国社保基金境外资产托管合同。

第四章 全国社保基金的境外投资

第十四条 全国社保基金投资境外的资金来源为以外汇形式上缴的境外国有股减持所得。全国社保基金境外投资的比例,按成本计算,不得超过全国社保基金总资产的20%。

第十五条 全国社保基金境外投资限于下列投资品种或者工具:

- (一) 银行存款;
- (二) 外国政府债券、国际金融组织债券、外国机构债券和外国公司债券;
- (三) 中国政府或者企业在境外发行的债券;
- (四) 银行票据、大额可转让存单等货币市场产品;
- (五) 股票;
- (六) 基金;
- (七) 掉期、远期等衍生金融工具;
- (八) 财政部会同劳动保障部批准的其他投资品种或工具。

第(一)项所称银行是指境外中资银行和国际公认评级机构最近3年对其长期信用评级在A级或者相当于A级以上的外国银行。

第(二)项所称债券是指国际公认评级机构对其评级在BBB级或者相当于BBB级以上的债券。

第(四)项所称货币市场产品是指国际公认评级机构对其评级在AAA级或者相当于AAA级的货币市场产品。

第(五)项所称股票是指在境外证券交易所上市的股票。

第(六)项所称基金是指证券市场公开发行的基金,基金

投资范围需符合本条关于其他投资品种或者工具的规定。

第(七)项所称掉期、远期等衍生金融工具是指金融市场上流通的衍生金融工具。全国社保基金投资衍生金融工具仅限于风险管理需要,严禁用于投机或放大交易。

第十六条 单个全国社保基金境外投资管理人管理的全国社保基金委托资产投资于一家机构发行的单只证券和基金不得超过该证券和基金份额的10%,按成本计算,不得超过其管理的全国社保基金境外委托资产总值的20%。

下列情形,不受前款规定比例的限制:

- (一) 社保基金会委托全国社保基金境外投资管理人以机构投资者身份参与境外上市配售以及定向配售;
- (二) 社保基金会将其持有股票委托给全国社保基金境外投资管理人投资运作的。

第十七条 根据全国社保基金境外投资运作情况,财政部会同劳动保障部可对全国社保基金境外投资品种和比例进行调整。

第十八条 社保基金会应按照分散化原则委托全国社保基金境外投资管理人投资运作。

社保基金会委托单个全国社保基金境外投资管理人管理的资产,不得超过全国社保基金境外投资委托资产总值的50%。

第十九条 全国社保基金境外投资管理费和托管费应参照国际同类产品费用标准确定,并报财政部和劳动保障部。

第五章 全国社保基金境外投资的外汇管理

第二十条 全国社保基金境外投资应遵循国家外汇管理

的有关规定。

第二十一条 社保基金会应参照国际惯例以及境外投资需要,在全国社保基金境外资产托管人处开立全国社保基金境外外汇资金账户。外汇资金账户开立后5个工作日内,社保基金会应将开户情况向外汇局备案。

第二十二条 全国社保基金境外外汇资金账户的收入范围是:

- (一) 从境内外汇存款账户汇入的资金;
- (二) 出售投资产品所获资金;
- (三) 境外投资收益;
- (四) 境外投资相关收入以及经外汇局批准的其他收入。

第二十三条 全国社保基金境外外汇资金账户的支出范围是:

- (一) 汇回境内外汇存款账户的资金;
- (二) 买入投资产品支付的资金;
- (三) 境外投资相关支出(含相关税费)以及经外汇局批准的其他支出。

第二十四条 社保基金会汇出、汇入本金或收益超过5000万美元(或等值货币),应提前3个工作日向外汇局备案。

经国务院批准,外汇局可根据国际收支形势要求社保基金会调整汇出、汇入外汇本金或收益的时间。

第二十五条 社保基金会应在全国社保基金境外资产托管合同中要求全国社保基金境外资产托管人向外汇局报送下列相关信息:

- (一) 社保基金会汇出、汇入外汇资金后两个工作日内,报告资金汇出、汇入情况;
- (二) 每月初5个工作日内,报送上月全国社保基金境外投资有关情况;
- (三) 每个会计年度初始3个月内,报送上一年度全国社保基金境外投资有关会计报表。

本条所称工作日以全国社保基金境外资产托管人所在国家或地区的工作日为准。

第六章 报告制度

第二十六条 社保基金会应对全国社保基金境外投资管理和托管情况进行监督、检查和评估,按季度、半年、年度向财政部和劳动保障部报告有关情况。全国社保基金境外投资发生重大事件,社保基金会应立即向财政部、劳动保障部和外汇局报告。

第二十七条 社保基金会应将境外委托资产纳入全国社保基金总资产统一编制财务会计报告,并依照《全国社会保障基金投资管理暂行办法》的规定进行披露和报告。

第二十八条 财政部、劳动保障部和外汇局有权要求社保基金会提供全国社保基金境外投资有关情况的报告,对于社保基金会违反本规定的行为,按照各自职能,责令其改正,并按有关规定给予处罚。

第七章 附则

第二十九条 全国社保基金投资于香港特别行政区、澳门特别行政区,适用本规定。

第三十条 本规定自2006年5月1日起施行。

长盛货币市场基金收益支付公告

(2006年第4号)

长盛货币市场基金(以下简称“本基金”)基金合同已于2006年12月12日正式生效,根据《长盛货币市场基金基金合同》、《长盛货币市场基金招募说明书》的约定,本基金投资者的累计收益定于每月第一个工作日集中支付,本基金经理人长盛基金管理有限公司定于2006年5月8日对本基金自2006年4月3日至2006年5月7日的累计收益进行集中支付并结转为基金份额,现将有关具体事宜公告如下:

一、收益支付说明

本基金经理人定于2006年5月8日将投资者所拥有的自2006年4月3日至2006年5月7日的累计待结转收益进行集中支付,并按1元面值直接结转为基金份额,不进行现金支付。

投资者的待结转收益具体计算公式如下:

投资者累计待结转收益=Σ投资者日待结转收益(即基金份额持有人日待结转收益逐日累加)

投资者日待结转收益=(投资者当日所持有的基金份额+当日累计待结转收益)×当日基金收益/当日基金总份额+所有待结转收益

投资者当日待结转收益以截尾的形式保留到小数点后八位,截尾部分当日进行二次分配。

投资者累计待结转收益结转为基金份额时,以截尾的方式保留小数点后两位,截尾部分保留在投资者收益账户内。

二、收益支付时间

1. 收益支付日:2006年5月8日。
2. 收益结转基金份额日:2006年5月8日。
3. 本次收益结转的基金份额赎回起始日:2006年5月9日。

三、收益支付对象

2006年4月28日在长盛基金管理有限公司登记在册的本基金全体基金份额持有人。

四、收益支付方式

本基金收益支付方式为收益再投资方式,投资者收益结转的基金份额将于2006年5月8日直接计入其基金账户,2006年5月9日起可查询及赎回。

五、有关税收和费用的说明

1. 根据财政部、国家税务总局《关于开放式基金有关税收问题的通知》(财税字[2002]128号),对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入,暂不征收个人所得税和企业所得税。

2. 本基金本次收益分配免收手续费。

六、提示

1. 根据中国证监会《关于货币市场基金投资等相关问题的通知》(证监基金字[2006]41号)第十款的规定“当日申购的基金份额自下一工作日起享有基金的分配权益;当日赎回的基金份额自下一工作日起不享有基金的分配权益”。投资者于4月28日申购长盛货币市场基金的基金份额将于下一工作日起享受本基金的分配权益。投资者于4月28日赎回长盛货币市场基

金的基金份额将于下一工作日起不享受本基金的分配权益。

2. 本基金投资者的累计收益定于每月第一个工作日集中支付并按1.00元面值自动转为基金份额。如遇特殊情况,将另行公告。

七、咨询办法

1. 长盛基金管理有限公司网站:www.csfund.com.cn。
2. 长盛基金管理有限公司客户服务中心电话:010-62350088。
3. 本基金销售机构:长盛基金管理有限公司直销中心、中国农业银行、兴业银行股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、联合证券有限责任公司、申银万国证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、长江证券有限责任公司、国元证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、恒泰证券有限责任公司、德邦证券股份有限公司、广发华福证券有限责任公司。

特此公告。

长盛基金管理有限公司

2006年5月8日

长盛基金管理有限公司关于基金经理调整的公告

因工作需要,根据公司第三届董事会第十次会议决议,公司决定对基金

经理职务做如下调整:

- 一、聘任田荣华先生为长盛成长价值证券投资基金基金经理,因显不再担任长盛成长价值证券投资基金和长盛动态精选证券投资基金基金经理职务;
 - 二、聘任肖强为基金同益基金经理;
 - 三、聘任邓永明为基金同德基金经理。
- 上述事项已按有关规定报监管部门备案。特此公告。

长盛基金管理有限公司

二〇〇六年四月二十九日

附:基金经理简历

田荣华先生,硕士,历任北京证券深圳业务部总经理、国信证券深圳红荔路营业部总经理;2004年4月加入长盛基金管理有限公司,担任基金同益基金经理助理、基金同益基金经理、基金同德基金经理。

肖强先生,学士,曾历任中信证券有限责任公司北太平庄营业部交易部经理、营业部总经理助理,中信证券股份有限公司研究咨询部副总经理、高级分析师,中信证券股份有限公司交易部高级交易员。2002年6月加入长盛基金管理有限公司,历任基金同益基金经理助理、基金同益基金经理、长盛动态精选基金基金经理。

邓永明先生,学士,1999年4月到2005年7月就职于大成基金管理有限公司,曾任研究员、交易员和基金经理助理。2005年7月底加入长盛基金管理有限公司投资管理部,任基金同益基金经理助理。

证券代码:600459 证券简称:贵研铂业 编号:临2006-23

贵研铂业股份有限公司关于召开2006年第一次临时股东大会暨相关股东会议的第二次提示公告

本公司及其董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确、完整,对公告的虚假记载、误导性陈述重大遗漏负连带责任。

贵研铂业股份有限公司(以下简称“公司”或“本公司”)董事会曾于2006年4月10日在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》及上海证券交易所网站(<http://www.sse.com.cn>)上刊登了关于召开公司股权分置改革相关股东会议的通知,于2006年4月24日在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》及上海证券交易所网站(<http://www.sse.com.cn>)上刊登了关于召开2006年第一次临时股东大会暨相关股东会议的第一次提示公告。根据中国证监会《关于加强社会公众股股东权益保护的若干规定》及《上市公司股权分置改革管理办法》的要求,现公告本次股东大会的第二次提示公告。

一、召开会议基本情况

- (一) 会议召开时间
现场会议召开时间为:2006年5月15日(星期一)上午9:30
网络投票时间为:2006年5月11日至2006年5月15日交易日9:30—11:30、13:00—15:00;
- (二) 股权登记日:2006年4月27日(星期四)
- (三) 现场会议召开地点:云南省昆明市二环北路核核贵研铂业股份有限公司第二会议室
- (四) 召集人:公司董事会
- (五) 会议方式:本次相关股东会议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流通股股东提供网络投票的平台,流通股股东可以在网络投票时间内通过上海证券交易所交易系统行使表决权。
- (六) 参加本次相关股东会议的方式:公司股东只能选择现场投票、委托董事会投票(征集投票权、下同)和网络投票中的一种表决方式。

七、提示公告

本次相关股东会议召开前,公司共发布两次本次相关股东会议提示公告,两次提示公告时间分别为4月24日和5月8日。

- (八) 会议出席对象
1. 凡2006年4月27日(星期四)下午交易结束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公司股东均有权以本通知公布的方式出席本次相关股东会议及参加表决;不能亲自出席本次相关股东会议现场会议的股东可授权他人代为出席(被授权人不必为本公司股东),或在网络投票时间内参加网络投票。
2. 公司董事会、监事、高级管理人员、公司律师和保荐机构相关人员。
- (九) 公司股票停牌、复牌事宜
1. 本公司董事会已申请相关证券自2006年4月3日起停牌,于2006年4月20日复牌,此段时期为股东沟通时期;
2. 本公司董事会已申请在2006年4月19日(含本日)之前公告非流通股股东与流通股股东沟通协商的情况,并己申请公司相关证券于公告后下一交易日复牌。
3. 本公司董事会己申请自本次相关股东会议的股权登记日(4月27日)次一交易日(4月28日)起至改革规定程序结束之日公司相关证券停牌。

二、会议审议事项

会议审议事项为《关于云南锡业公司向公司无偿注入云南锡业集团有限责任公司98%股权收购方案》
本次云南锡业公司(以下简称“云锡公司”)向本公司无偿注入权益性资产是公司股权分置改革方案不可分割的一部分,云锡公司向本公司注入权益性资产属于关联交易,根据《公司法》、《上海证券交易所股票上市规则》(2004年修订)及贵研铂业《公司章程》的有关规定,云锡公司向本公司注入权益性资产需要通过本公司股东大会批准。有权参

加相关股东会议并行使表决权的股东均有权参加本次股东大会并行使表决权,因此,应将审议云锡公司向本公司无偿注入权益性资产议案的临时股东大会和相关股东会议合并举行,并将关于云南锡业公司向公司无偿注入云南锡业集团有限责任公司98%股权和股权分置改革方案作为同一事项进行表决,临时股东大会和相关股东会议的股权登记日应同日一致。鉴于本次关联交易是股权分置改革方案对价安排不可分割的一部分,故本次会议审议时须满足以下条件方可实施,即经参加表决的流通股股东所持表决权的三分之二以上通过,经参加表决的流通股股东所持表决权的三分之二以上通过,且经参加表决的非流通股股东所持表决权的二分之一以上通过。

根据规定,本次会议采用现场投票、委托董事会投票与网络投票相结合的表决方式,流通股股东可通过上海证券交易所交易系统对以上议案进行投票表决,上述议案需参加表决的非流通股股东进行类别表决,流通股股东网络投票具体程序详见本通知第五项内容。流通股股东委托董事会投票具体程序见《贵研铂业股份有限公司董事会投票委托征集函》或本通知第六项内容。

三、流通股股东享有的权利

流通股股东依法享有出席2006年第一次临时股东大会暨相关股东会议的权利,并享有知情权、发言权、质询权和提议权等权利。根据相关规定,2006年第一次临时股东大会暨相关股东会议所审议的议案须经参加表决的流通股股东所持表决权的三分之二以上通过,并经参加表决的非流通股股东所持表决权的三分之二以上通过。

(二) 流通股股东主张权利的时间、条件和方式

根据中国证券监督管理委员会《上市公司股权分置改革管理办法》规定,本次会议采用现场投票、委托董事会投票与网络投票相结合的表决方式,流通股股东可在上述网络投票时间内通过上海证券交易所交易系统对2006年第一次临时股东大会暨相关股东会议议案进行投票表决。流通股股东网络投票具体程序详见本通知第五项内容。

根据中国证券监督管理委员会《上市公司股权分置改革管理办法》规定,相关股东会议征集投票委托事宜,由公司董事会负责办理。为此,本公司董事会作为征集人向流通股股东征集对本次相关股东会议审议事项的投票委托。有关征集投票委托具体程序详见公司于4月10日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上的《贵研铂业股份有限公司董事会投票委托征集函》或本通知第六项内容。

四、流通股股东参加投票表决的重要性

- (一) 有利于保护自身利益不受损害;
- (二) 充分表达意见,行使股东权利;
- (三) 如本次股权分置改革方案获得2006年第一次临时股东大会暨相关股东会议表决通过,则不论流通股股东是否参与了本次投票表决,也不论流通股股东是否投了反对票,只须其为2006年第一次临时股东大会暨相关股东会议股权登记日登记在册的股东,就均需按2006年第一次临时股东大会暨相关股东会议表决通过的决议执行。

五、参与网络投票的股东的身份认证与投票程序

在本次相关股东会议上,公司将通过上海证券交易所交易系统向流通股股东提供网络形式的投票平台,流通股股东可以通过交易系统参加网络投票。
本次相关股东会议通过交易系统进行网络投票的时间为2006年5月11日至5月15日交易日9:30—11:30、13:00—15:00,投票程序比照上海证券交易所新股申购业务操作。具体操作程序详见附件一。

公司股东只能选择现场投票、委托董事会投票和网络投票中的一种表决方式,如果重复投票,则以现场投票、委托董事会投票和网络投票的优先顺序择其一作为有效表决进行统计。

- (一) 如果同一股份通过网络、网络或委托董事会投票重复投票,以现场投票为准。
- (二) 如果同一股份通过网络或委托董事会投票重复投票,以委托董事会投票为准。

附件一:

投资者参加网络投票的操作流程

一、投票要素

股票代码	投票简称	表决议案数量	说明
沪市A股投资者	738459 贵研投票	1	A股
深圳市值配售投资者	363459 贵研投票	1	A股

2. 表决议案:申报价格