上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书(摘要)

基金管理人:鹏华基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

二零一一年九月

重要提示

本基金经 2010 年 6 月 1 日中国证券监督管理委员会下发的《关于核准上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》(证监许可[2010]747 号文)核准,进行募集。并经中国证监会基金部 2010 年 8 月 5 日基金部函[2010]号文件《关于上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金备案确认的函》确认合法备案。根据相关法律法规,本基金基金合同已于 2010 年 8 月 5 日正式生效,基金管理人于该日起正式开始对基金财产进行运作管理。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,应全面了解本基金的产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,并承担基金投资中出现的各类风险,包括但不限于:市场风险、管理风险、技术风险、本基金特有风险及其他风险,等等。

基金的过往业绩并不预示其未来表现,基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,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。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金表现的保证。投资有风险,投资者在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。

本招募说明书与基金托管人相关信息更新部分已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2011 年 8 月 7 日,有关财务数据和净值表现截止日为 2011 年 6 月 30 日(未经审计)。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

1、名称:鹏华基金管理有限公司
2、住所:深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心 43 层
3、设立日期:1998 年 12 月 22 日
4、法定代表人:何如
5、办公地址:深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心 43 层
6、电话:(0755)82021102　　传真:(0755)82021155
7、联系人:罗娜
8、注册资本:人民币 1.5 亿元
9、股权结构:

出资人名称	出资额(万元)	出资比例
国信证券股份有限公司	7,500	50%
意大利欧利盛资本资产管理股份公司(Eurizon Capital SGR S.p.A.)	7,350	49%
深圳市北融信投资发展有限公司	150	1%
总　计	15,000	100%

(二)主要人员情况

1、基金管理人董事会成员

何如先生,董事长,硕士,高级会计师,国籍:中国。历任中国电子器件公司深圳公司副总会计师兼财务处处长、总会计师、常务副总经理、总经理、党委书记,深圳发展银行行长助理、副行长、党委委员、副董事长、行长、党委副书记,现任国信证券股份有限公司董事长、党委书记,鹏华基金管理有限公司董事长。

胡继之先生,董事,金融学博士,高级经济师,国籍:中国。历任中国人民银行武汉市分行办公室科长、金融研究所副所长、所长,中国人民银行深圳分行办公室负责人,深圳证券交易所总经理助理兼办公室主任、理事会秘书长、策划总监、纪委书记、党委委员、副总经理,现任国信证券股份有限公司总裁、党委副书记。

孙煜扬先生,董事,经济学博士,国籍:中国。历任贵州省政府经济体制改革委员会主任科员、中共深圳市委政策研究室副处长、深圳证券结算公司常务副总经理、深圳证券交易所首任行政总监、香港深业(集团)有限公司助理总经理、香港深业控股有限公司副总经理、中国高新技术产业投资管理有限公司董事长兼行政总裁、鹏华基金管理有限公司董事总裁,现任国信证券股份有限公司副总裁。

Massimo Mazzini 先生,董事,经济和商学学士。国籍:意大利。曾在安达信(Arthur Andersen MBA)从事风险管理和资产管理工作,历任 CA AIPG SGR 投资总监、CAAM AI SGR 及 CA AIPG SGR 首席执行官和投资总监、东方汇理资产管理股份有限公司(CAAM SGR)投资副总监、农业信贷另类投资集团(Credit Agricole Alternative Investments Group)国际执行委员会委员、欧利盛资本资产管理股份公司(Eurizon Capital SGR S.p.A.)投资方案部投资总监、Epsilon 资产管理股份公司(Epsilon SGR)首席执行官,现任欧利盛资本股份公司(Eurizon Capital S.A.)(卢森堡)首席执行官和总经理,同时兼任欧利盛 AI 资产管理股份公司(Eurizon AI SGR)首席执行官。

Alessandro Varaldo 先生,董事,经济学和商业管理博士,国籍:意大利。曾任米兰德意志银行集团 Finanza e Futuro Fondi Sprind 股份公司投资管理部债务基金和现金头寸管理高级经理,IMI Fideuram 资产管理股份公司投资管理部固定收益组合和现金管理业务负责人,圣保罗银行投资公司(Banca Sanpaolo Invest S.p.A.)财务及营销策划部负责人,Capitalia 股份公司(Capitalia S.p.A.)产品和销售部负责人,Capitalia 投资管理股份公司(Capitalia Investment Management S.A.)董事总经理,Unicredit Holding 财务风险管理部意大利企业法人风险管理业务负责人,欧利盛资本资产管理股份公司(Eurizon Capital SGR S.p.A)首席市场官、欧利盛资本股份公司(Eurizon Capital S.A.)(卢森堡)董事,现任意大利联合圣保罗银行股份有限公司(Intesa Sanpaolo S.p.A.)储蓄、投资和养老金产品部负责人。

史际春先生,独立董事,法学博士,国籍:中国。历任安徽大学讲师、中国人民大学副教授,现任中国人民大学法学院教授、博士生导师,国务院特殊津贴专家,兼任中国法学会经济法学研究会副会长、北京市人大常委会和法制委员会委员、北京市人民政府顾问。

李相启先生,独立董事,高级经济师、研究员,国籍:中国。历任陕西省委办公厅秘书、省委政策研究室财贸处处长、副主任,陕西省经济体制改革委员会副书记、副主任、党组书记、主任,陕西省证券监管委员会主席,中国证监会济南证管办党委书记、主任、济南稽查局局长,山东证监局局长,上海证券交易所理事会理事、产品委员会主任。

宋泓先生,独立董事,经济学博士,国籍:中国。曾在美国哥伦比亚大学作访问学者,并在陕西省社科院工作,现任中国社会科学院世界经济与政治研究所国际贸易研究室主任、研究员、教授、博士生导师。

张新民先生,独立董事,管理学博士,会计学教授,博士生导师,国籍:中国。现任对外经济贸易大学副校长兼国际商学院院长,国务院特殊津贴专家,全国 MBA 教育指导委员会委员,英国特许公认会计师(FCCA),澳洲注册会计师(FCPA)。

2、基金管理人监事会成员

孙枫先生,监事会主席,国际金融专业硕士,高级会计师,中国注册会计师,国籍:中国。历任武汉市经济研究所副所长,武汉市轻工业局副局长,武汉友谊复印机制造公司副经理,深圳市财政局企财处处长、办公室主任、副局长,深圳市商业银行董事长、党委书记,深圳发展银行董事长、党委书记,鹏华基金管理有限公司董事长、党总支书记,现任鹏华基金管理有限公司监事会主席。

Andrea Vismara 先生,监事,法学学士,律师,国籍:意大利。曾在意大利多家律师事务所担任律师,先后在法国农业信贷集团(Credit Agricole Group)东方汇理资产管理股份有限公司(CAAM SGR)法务部、产品开发部,欧利盛资本资产管理股份公司(Eurizon Capital SGR S.p.A.)治理与股权部工作,现在欧利盛资本资产管理股份公司运营部工作。

黄俞先生,监事,研究生学历,国籍:中国。曾在中农信公司、正大财务公司工作,曾任鹏华基金管理有限公司董事,现任深圳市北融信投资发展有限公司董事长。

高鹏先生,职工监事,经济学硕士,国籍:中国。曾任博时基金管理有限公司监察法律部监察稽核经理,现任鹏华基金管理有限公司监察稽核部总经理。

刘慧红女士,职工监事,本科学历,国籍:中国。曾在中国工商银行深圳分行、平安证券公司工作,1998 年 12 月加盟鹏华基金管理有限公司,现任鹏华基金管理有限公司登记结算部副总经理。

3、高级管理人员情况

何如先生,同上。

邓召明先生,总裁,经济学博士,讲师,国籍:中国。历任北京理工大学管理与经济学院讲师、中国兵器工业总公司主任科员、中国证监会处长、南方基金管理有限公司副总经理,现任鹏华基金管理有限公司总裁、党总支书记。

高阳先生,副总裁,经济学硕士,十年证券从业经验,CFA,国籍:中国。历任中国国际金融有限公司债券投资经理,博时基金管理有限公司博时价值增长基金基金经理、固定收益部总经理、基金裕泽基金经理、基金裕隆基金经理、股票投资部总经理,现任鹏华基金管理有限公司副总裁。

曹毅先生,副总裁,经济学博士,国籍:中国。历任中国人民银行广州分行科员,中国人民银行深圳中心支行副主任科员,南方基金管理有限公司市场拓展部副总监、渠道部总监,现任鹏华基金管理有限公司副总裁。

胡湘先生,副总裁,经济学硕士,国籍:中国。历任全国社会保障基金理事会投资部、境外投资部副主任科员、主任科员、副处长,鹏华基金管理有限公司总裁助理,现任鹏华基金管理有限公司副总裁。

吴伟先生,督察长,法学博士,国籍:中国。曾任中国建设银行深圳市分行法律部副科长。2001 年 3 月加盟鹏华基金管理有限公司,历任公司法律顾问、社保基金独立稽察员、监察稽核部总监,现任公司督察长。

4、本基金基金经理

方南先生,国籍中国,工商管理硕士,9 年证券从业经验。曾任职于杭州恒生电子股份有限公司,上海新利多数字技术有限公司。2001 年 11 月加盟鹏华基金管理有限公司,历任金融工程部(原)研究员、金融工程部(原)总经理助理、鹏华沪深 300 指数证券投资基金(LOF)基金经理助理。2010 年 2 月至今担任鹏华中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金经理,2010 年 8 月至今兼任鹏华上证民企 50ETF 基金及其联接基金基金经理。方南先生具备基金从业资格。

本基金历任的基金经理:

2010 年 8 月基金合同生效至今由方南先生担任本基金基金经理。

本基金基金经理管理其它基金情况:

2010 年 2 月至今由方南先生担任鹏华中证 500 指数基金基金经理。

2010 年 8 月至今由方南先生担任鹏华上证民营企业 50ETF 联接基金基金经理。

本报告期内本基金基金经理未发生变更。

5、投资决策委员会成员情况

投资决策委员会成员组成:公司总裁邓召明先生、副总裁高阳先生、机构投资部总经理杨俊先生、研究部总经理冀洪涛先生、基金管理部总经理程世杰先生、固定收益部总经理初冬女士、鹏华动力基金经理黄鑫先生。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人基本情况

名称:中国工商银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街 55 号
成立时间:1984 年 1 月 1 日
法定代表人:姜建清
注册资本:人民币 349,018,545,827 元
联系电话:010-66105799
联系人:赵会军

(二)主要人员情况

截至 2011 年 6 月末,中国工商银行资产托管部共有员工 145 人,平均年龄 30 岁,95%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

(三)基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者,中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来,秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队,严格履行资产托管人职责,为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务,展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系,同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务,可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2011 年 6 月,中国工商银行共托管证券投资基金 219 只,其中封闭式 7 只,开放式 212 只。自 2003 年以来,本行连续八年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 26 项最佳托管银行大奖;是获得奖项最多的国内托管银行,优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1、申购赎回代理券商(简称“一级交易商”)

(1)国信证券股份有限公司
住所:深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦
办公地址:深圳市罗湖区红岭中路 1010 号国际信托大厦
法定代表人:何如
客户服务电话:95536
网址:www.guosen.com.cn

(2)兴业证券股份有限公司
注册地址:福州市湖东路 268 号
法定代表人:兰荣
办公地址:浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 21 层
客服电话:4008888123
业务联系电话:021-38565785
传真号码:021-38565955
业务联系人:谢高得
公司网站:(www.xyzq.com.cn)

(3)广发证券股份有限公司
注册地址:广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼(4301-4316 房)
办公地址:广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、41 和 42 楼
法定代表人:林治海
联系人:黄岚
统一客户服务热线:95575 或致电各地营业网点
公司网站:广发证券网 http://www.gf.com.cn

(4)渤海证券有限责任公司
住所:天津市经济技术开发区第一大街 29 号
法定代表人:杜庆平
地址:天津市河西区宾水道 3 号
联系人:王兆权
电话:(022)022-28451861
传真:(022)28451892
网址:wwww.bhzq.com

(5)齐鲁证券有限公司
注册地址:山东省济南市经十路 128 号
法定代表人:李玮
客户服务热线:95538
网址: www.qlzq.com.cn

(6)华泰证券股份有限公司
地址:江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦
法定代表人:吴万善
客户咨询电话:025-84579897
网址:www.htsc.com.cn

(7)长江证券股份有限公司
住所:武汉市新华路特 8 号长江证券大厦
法定代表人:胡运钊
客户服务电话:4008-888-999
公司网址:www.95579.com

(8)中国银河证券股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座
法定代表人:顾伟国
客户服务电话:4008-888-888
网址:www.chinastock.com.cn

(9)海通证券股份有限公司
住所:上海市广东路 689 号
法定代表人:王开国
客户服务电话:400-8888-001,(021)962503
网址:www.htsec.com

(10)招商证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层
法定代表人:宫少林
客户服务热线:95565、4008888111
网址:www.newone.com.cn

(11)光大证券股份有限公司
住所:上海市静安区新闸路 1508 号
法定代表人:徐浩明
客服电话:10108998
网址:www.ebscn.com

(12)国泰君安证券股份有限公司
住所:上海市浦东新区商城路 618 号
办公地址:上海市延平路 135 号
法定代表人:祝幼一
客服电话:400-8888-666
网址:www.gtja.com

(13)安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路 2222 号安联大厦 34 层、28 层 A02 单元
办公地址:深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 20 层
法定代表人:牛冠兴
客户服务电话:0755-82825555
网址:www.axzq.com.cn

(14)方正证券有限责任公司
注册地址:湖南长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层
公司地址:湖南长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层
法定代表人:雷杰
客服电话:95571
网址:www.sunsc.com.cn

(15)东兴证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层
办公地址:北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层
法定代表:崔海涛
服务热线:010-66555262,66555382
公司网站:www.dxzq.net

(16)申银万国证券股份有限公司
注册地址:上海市常熟路 171 号
办公地址:上海市常熟路 171 号
法定代表人:丁国荣
客户服务电话:(021)962505
网址:www.sw2000.com.cn

(17)湘财证券有限责任公司
地址:湖南省长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼
邮编:410004
办公地点:湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号标志商务中心 11 楼
法定代表人:林俊波
电话:021-68634518
传真:021-68865680
联系人:钟康莺 021-68634518
客服电话:400-888-1551
公司网址:www.xcsc.com

(18)山西证券股份有限公司
住所:太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼
办公地址:太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼
法定代表人:吴晋安
联系电话:0351-8686659
联系人:郭熠
网址:www.i618.com.cn
客服电话:400-666-1618、95573

2、二级市场交易代理券商

包括具有经纪业务资格及上海证券交易所会员资格的所有证券公司。

3、基金管理人可以根据相关法律法规要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

(二)登记结算机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司
注册(办公)地址:北京市西城区太平桥大街 17 号
法定代表人:金颖
电话:010-59378839
传真:010-59378907
联系人:朱立元

(三)律师事务所

名称:北京市竞天公诚律师事务所
住所:北京市朝阳区朝阳门外大街 20 号联合大厦 15 层
负责人:张绪生
办公地址:北京市朝阳区朝阳门外大街 20 号联合大厦 15 层
联系电话:010- 65882200,0755-23982200
传真:010- 65882211,0755-23982211
联系人:黄亮
经办律师:孔雨泉、黄亮

(四)审计基金财产的会计师事务所

名称:普华永道中天会计师事务所有限公司
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
法定代表人:杨绍信
联系电话:(021)23238888
传真:(021)23238800
联系人:沈兆杰
经办会计师:薛竞、金毅

四、基金的名称

本基金名称:上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金。

五、基金的类型

本基金类型:股票型证券投资基金。

六、基金的投资目标

紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

七、基金的投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,主要投资于上证民营企业 50 指数的成份股及其备选成份股(投资比例不低于基金资产净值的 95%)。此外,为更好的实现投资目标,本基金将少量投资于非上证民营企业 50 指数成份股、新股(首次发行或增发等)以及法律法规及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。

若法律法规或监管机构允许,本基金在履行适当程序后,可以调整上述投资比例,或将法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他金融工具纳入本基金的投资范围。

八、基金的投资策略

本基金采用被动式指数投资方法,原则上按照成份股在上证民营企业 50 指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。

当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,并辅之以金融衍生产品投资管理等,力求降低跟踪误差。

本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.1%,年跟踪误差不超过 2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

1、投资决策依据

(1)有关法律、法规、基金合同等的相关规定;
(2)经济运行态势和证券市场走势;
(3)标的指数的编制方法及其变更。

2、投资决策程序

(1)本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理团队制。投资决策委员会负责制定基金投资方面的整体投资计划、投资原则及其它重大事项等;基金经理根据投资决策委员会的决策,负责投资组合的构建、调整和日常管理等工作;

(2)基金经理根据上证民营企业 50 指数成份股名单及权重,考虑本基金资产规模及需保留现金比例等因素,拟定本基金指数化投资的初始方案;

(3)基金经理根据标的指数变动情况、实际交易情况、申购赎回情况、对跟踪误差的监控结果和风险监控的评估结果,采用相应的投资策略、优化方法对投资组合进行动态调整,密切跟踪标的指数;

(4)交易执行相关部门根据基金经理下达的交易指令制定交易策略,完成具体证券品种的交易;

(5)风险绩效相关部门根据市场变化定期和不定期对基金进行投资绩效评估并提供相关绩效评估报告;

(6)监察稽核相关部门对投资合规性进行监控;

(7)本基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据市场环境变化和实际需要调整上述投资程序,并在基金招募说明书更新中予以公告。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为标的指数,即上证民营企业 50 指数。

本基金标的指数变更的,业绩比较基准随之变更并公告。

十、基金的风险收益特征

本基金属股票型基金,其预期的风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金,为证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

十一、基金的投资组合报告(未经审计)

本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。

本基金的托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,已于 2011 年 7 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告中所列财务数据截至 2011 年 6 月 30 日(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	441,411,395.35	99.36
	其中:股票	441,411,395.35	99.36
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	1,157,249.41	0.26
6	其他资产	1,699,334.24	0.38
7	合计	444,267,979.00	100.00

注:上表中的股票投资项含可退替代款估值增值,而 2、报告期末按行业分类的股票投资组合的合计项不含可退替代款估值增值。

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

(1)报告期末指数投资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	采掘业	-	-
C	制造业	295,463,210.87	66.60
C0	食品、饮料	18,613,031.61	4.20
C1	纺织、服装、皮毛	27,658,961.25	6.23
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	30,193,368.48	6.81
C5	电子	13,551,135.40	3.05
C6	金属、非金属	36,649,786.86	8.26
C7	机械、设备、仪表	95,403,568.42	21.50
C8	医药、生物制品	67,684,874.61	15.26
C99	其他制造业	5,708,484.24	1.29
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	21,011,652.43	4.74
H	批发和零售贸易	15,860,073.61	3.57
I	金融、保险业	66,689,016.63	15.03
J	房地产业	29,055,696.01	6.55
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	13,331,745.80	3.00
	合计	441,411,395.35	99.49

(2)报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

3、报告期末指数投资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	600016	民生银行	11,046,656	63,297,338.88	14.27
2	600031	三一重工	2,361,060	42,593,522.40	9.60
3	600089	特变电工	2,048,843	26,512,028.42	5.98
4	600256	广汇股份	908,101	21,594,641.78	4.87
5	600518	康美药业	1,196,861	15,750,690.76	3.55
6	600276	恒瑞医药	437,369	13,107,948.93	2.95
7	600252	中恒集团	679,048	12,637,083.28	2.85
8	600660	福耀玻璃	1,089,253	11,284,661.08	2.54
9	600143	金发科技	652,064	10,732,973.44	2.42
10	600177	雅戈尔	1,039,074	10,255,660.38	2.31

4、报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票

5、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7、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。

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、投资组合报告附注

(1)报告期内本基金投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的股票。

(2)报告期内本基金投资的前十名股票没有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(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	1,671,915.57
3	应收股利	27,196.25
4	应收利息	222.42
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,699,334.24

(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)报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

(6)报告期末积极投资前五名中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

(7)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,投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

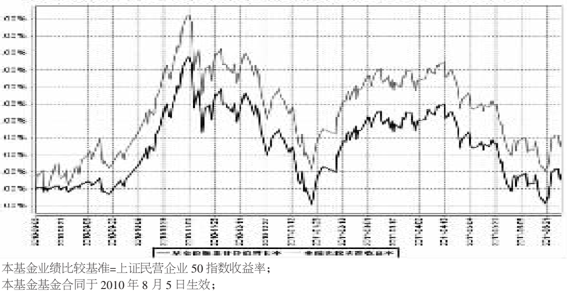
十二、基金的业绩

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财产,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,投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1、本基金基金合同生效以来的投资业绩与同期基准的比较如下表所示(本报告中所列财务数据未经审计):

成立时间	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
2010年 8 月 5 日至 2010 年 12 月 31 日	9.11%	1.45%	15.94%	1.69%	-6.83%	-0.24%
2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	-5.81%	1.31%	-6.20%	1.31%	0.39%	0.00%
自基金合同生效至 2011 年 6 月 30 日	2.77%	1.37%	8.76%	1.50%	-5.99%	-0.13%

2、基金合同生效以来基金份额净值的变动情况,并与同期业绩比较基准的变动进行比较:



注 1:本基金业绩比较基准=上证民营企业 50 指数收益率;
注 2:本基金基金合同于 2010 年 8 月 5 日生效;
注 3:本基金业绩截止日为 2011 年 6 月 30 日。

十三、基金的费用与税收

(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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;
5、基金份额持有人大会费用;
6、基金的证券交易费用;
7、基金的银行汇划费用;
8、基金上市费及年费;
9、《基金合同》生效后与基金相关的指数使用费;
10、基金收益分配中发生的费用;
11、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。

本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。

(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

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 2 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。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.1%÷当年天数
H 为每日应计提的基金托管费
E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,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托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

3、标的指数许可使用费

本基金的标的指数许可使用费按前一日基金资产净值的 0.03%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.03%÷当年天数
H 为每日应计提的基金标的指数许可使用费
E 为前一日的基金资产净值

标的指数许可使用费每日计算,逐日累计至每季季末(当季不足 50,000 元的,按 50,000 元计算),按季支付,由基金管理人向基金托管人发送标的指数许可使用费划款指令,基金托管人复核后于次季前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类”中除 1、2、9 项之外的费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

(三)不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
3、《基金合同》生效前的相关费用,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用;
4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(四)费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率等费率,须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率、基金托管费率等费率,无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 日在至少一种指定媒体和基金管理人网站上公告。

(五)基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的规定,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,本基金管理人对本基金于 2011 年 3 月 18 日公告的招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

1、根据公司业务发展所需,本基金管理人于 2011 年 4 月 30 刊登了《鹏华基金管理有限公司关于增聘副总经理的公告》,上述事项已按有关规定向中国证券监督管理委员会及深圳监管局报告,并经中国证券监督管理委员会核准(证监许可[2011]613 号)。据此对“三、基金管理人”的“(二)主要人员情况”中“3、高级管理人员情况”的相关内容进行了更新。

2、根据最新资料,对“三、基金管理人”的“(二)主要人员情况”中“4、本基金基金经理”的相关内容进行了更新。

3、对“四、基金托管人”部分相关内容进行了更新,数据截止日期 2011 年 6 月 30 日。

4、在“十、基金的投资”一章,更新了投资组合报告的相关内容,数据截至日期为 2011 年 6 月 30 日。

5、更新了“十一、基金的业绩”一章的投资业绩内容,数据截至日期为 2011 年 6 月 30 日。

6、鉴于本基金管理人投资者服务方面措施的进一步提升,在“二十二、对持有人的服务”一章,更新了服务中的相关内容。

7、在“二十三、其他应披露事项”一章,更新了自 2011 年 2 月 5 日至 2011 年 8 月 7 日期间的信息披露情况,包括公告事项、信息披露的媒体与披露时间。

鹏华基金管理有限公司
2011 年 9 月 20 日

证券代码:000705　　证券简称:浙江震元　　公告编号:2011-026

浙江震元股份有限公司关于召开 2011 年第一次临时股东大会的提示性公告

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。

本公司已于 2011 年 9 月 8 日在《证券时报》及巨潮资讯网上刊登了《浙江震元股份有限公司关于召开 2011 年第一次临时股东大会通知》。本次股东大会公司采取现场投票与网络投票相结合的方式,为进一步保护投资者的合法权益,方便本公司股东行使表决权,现将公司关于召开 2011 年第一次临时股东大会的通知提示如下:

一、召开会议的基本情况

1、现场会议召开时间:2011 年 9 月 23 日(星期五)下午 2:00 整

2、网络投票时间:2011 年 9 月 22 日至 2011 年 9 月 23 日

其中:通过深圳证券交易所交易系统进行网络投票的时间为一天,具体时间为:2011 年 9 月 23 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具体时间为 2011 年 9 月 22 日 15:00 至 9 月 23 日 15:00。

3、股权登记日:2011 年 9 月 16 日

4、现场会议召开地点:浙江震元股份有限公司七楼会议室(绍兴市解放北路 289 号)

5、召集人:浙江震元股份有限公司董事会

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

7、参加会议人员:(1)凡在 2011 年 9 月 16 日(星期五)下午交易结束后,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均有权出席会议;因故不能出席会议的股东可以书面委托授权代理人出席和参加表决(该代理人可不必是公司股东)或在网络投票时间内参加网络投票;(2)公司董事、监事、高级管理人员和公司聘请的律师;(3)其他有关人员。

二、会议审议事项

(一)提案名称

1.关于公司符合非公开发行 A 股股票条件的议案;
2.关于公司非公开发行 A 股股票方案的议案;
2.01 发行股票的种类和面值
2.02 发行方式
2.03 发行数量
2.04 发行对象及认购方式
2.05 发行价格及定价原则
2.06 限售期安排
2.07 上市地点
2.08 募集资金数额及用途
2.09 本次发行完成前滚存未分配利润的安排
2.10 本次发行决议的有效期
3.关于公司非公开发行 A 股股票预案的议案;
4.关于公司非公开发行股票募集资金使用可行性分析报告的议案;
5.关于与绍兴市旅游集团有限公司签署《附条件生效的股份认购合同》的议案;
6.关于与绍兴市旅游集团有限公司签署《附条件生效的资产转让合同》的议案;
7.关于本次非公开发行股票涉及重大关联交易的议案;
8.关于本次非公开发行部分募集资金投资项目涉及关联交易的议案;
9.关于提请股东大会授权董事会全权办理本次发行工作相关事宜的议案;
10.关于修改公司章程有关条款的议案;

以上议案详细内容见 2011 年 8 月 6 日、8 月 20 日刊载在巨潮资讯网和《证券时报》的七届二次董事会决议公告和七届三次董事会决议公告。

(二)说明事项:本次股东大会第 2 项的第 4 小项、第 8 小项,第 3、5、6、7、8 项提案涉及公司关联交易,关联股东需回避表决。

三、现场股东大会会议登记方法

1、登记方式:法人股东由法定代表人出席会议的,须持有股东帐户卡、加盖公章的营业执照复印件、法人代表证明书和本人身份证办理会议登记手续,委托代理人出席的,还须持有法人授权委托书和出席人身份证;个人股东须持本人身份证、股东帐户卡和有效持股凭证办理会议登记手续,受委托出席的股东代理人还须持有股东本人的授权委托书和出席人身份证;异地股东可用信函或传真方式登记。

2、登记时间:2011 年 9 月 19 日——2011 年 9 月 21 日
(上午 8:00—11:00　下午 2:00—5:00)

3、登记地点:浙江省绍兴市解放北路 289 号公司董事会办公室。

4、出席会议的股东及股东代理人请携带相关证件原件到场。

四、参加网络投票的操作流程

(一)采用深交所交易系统投票的程序

1、本次股东大会通过深圳证券交易所交易系统进行网络投票的时间为一天,具体时间为:2011 年 9 月 23 日 9:30-11:30,13:00-15:00。

2、本次股东大会的投票代码是:360705;投票简称是:震元投票

3、股东投票的具体程序是

(1)买卖方向为买入投票

	议案名称	对应申报价格
总议案	表示对以下议案 1 至议案 10 统一表决	100.00
1	关于公司符合非公开发行 A 股股票条件的议案	1.00
2	关于公司非公开发行 A 股股票方案的议案	2.00
①	发行股票的种类和面值	2.01
②	发行方式	2.02
③	发行数量	2.03
④	发行对象及认购方式	2.04
⑤	发行价格及定价原则	2.05
⑥	限售期安排	2.06
⑦	上市地点	2.07
⑧	募集资金数额及用途	2.08
⑨	本次发行完成前滚存未分配利润的安排	2.09
⑩	本次发行决议的有效期	2.10
3	关于公司非公开发行 A 股股票预案的议案	3.00
4	关于公司非公开发行股票募集资金使用可行性分析报告的议案	4.00
5	关于与绍兴市旅游集团有限公司签署《附条件生效的股份认购合同》的议案	5.00
6	关于与绍兴市旅游集团有限公司签署《附条件生效的资产转让合同》的议案	6.00
7	关于本次非公开发行股票涉及重大关联交易的议案	7.00
8	关于本次非公开发行部分募集资金投资项目涉及关联交易的议案	8.00
9	关于提请股东大会授权董事会全权办理本次发行工作相关事宜的议案	9.00
10	关于修改公司章程有关条款的议案	10.00

(2)在“委托价格”项下填报本次年度股东大会的申报价格,100.00 元代表总议案,1.00 元代表议案一,以此类推。每一议案应以相应的价格分别申报;

(3)在“委托股数”项下填报表决意见,1 股代表同意,2 股代表反对,3 股代表弃权;

表决意见类型	委托数量
同意	1股
反对	2股
弃权	3股

(4)在股东对总议案进行投票表决时,如果股东先对议案 1 至议案 10 中的一项或多项投票表决,然后对总议案投票表决,以股东对议案 1 至议案 10 中已投票表决议案的表决意见为准,未投票表决的议案,以对总议案的投票表决意见为准;如果股东先对总议案投票表决,然后对议案 1 至议案 10 中的一项或多项议案投票表决,则以对总议案的投票表决意见为准。

(5)对同一议案的投票只能申报一次,不能撤单;

(6)不符合上述规定的投票申报无效,视为未参与投票。

(二)采用互联网投票系统的投票程序

1.互联网投票系统开始投票的时间为 2011 年 9 月 22 日下午 3:00,结束时间为 2011 年 9 月 23 日下午 3:00。

2. 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,请登陆网址 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上午 11:30 前发出后,当日 13:00 即可使用;如服务密码激活指令上午 11:30 后发出后,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。

3.股东根据获取的服务密码或数字证书,可登录 http://wltp.cninfo.com.cn 在规定时间内通过深交所互联网投票系统进行投票。

(三)投票注意事项

1、对同一表决事项的投票只能申报一次,多次申报的以第一次申报为准;

2、同一表决权既通过交易系统又通过互联网投票,以第一次投票为准。

五、其他事项

1、出席会议股东的住宿、交通等费用自理。

2、联系人:周黔莉、蔡国权　电话:0575-85144161　传真:0575-85148805
地址:浙江省绍兴市解放北路 289 号公司董事会办公室　邮编:312000

特此公告。

浙江震元股份有限公司
董事会
二〇一一年九月十九日

附:

授 权 委 托 书

兹委托　　　先生(女士)代表本人(本单位)出席浙江震元股份有限公司 2011 年第一次临时股东大会,并授权其代表本人(本单位)行使表决权。

一、委托人姓名(单位名称):
委托人身份证号码(单位注册号):
委托人持股数:　　　　　　委托人股东帐号:
二、受托人姓名:　　　　　　受托人身份证号码:
三、经委托人授权,受托人有以下表决权:
1、对公告所列的第　　　　　条事项投同意票;
2、对公告所列的第　　　　　条事项投反对票;
3、对公告所列的第　　　　　条事项投弃权票;
4、对可能纳入的临时议案　　　权行使表决权。
备注:委托人对上述不作具体指示,受托人可按自己的意愿表决。
本委托书有效期限自 2011 年　　月　　日至 2011 年　　月　　日。
委托人签名(单位公章):　　　　　受托人签名:
签署日期:2011 年　　月　　日

证券代码:002601　　证券简称:佰利联　　公告编号:2011-014

河南佰利联化学股份有限公司关于完成工商变更登记的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

河南佰利联化学股份有限公司(以下简称"公司")经中国证券监督管理委员会"证监许可[2011]1016 号"文核准,首次向社会公开发行股票 2,400 万股,每股发行价格为 55.00 元。亚太(集团)会计师事务所有限公司已于 2011 年 7 月 11 日对公司首次公开发行股票的资金到位情况进行了审验,并出具了亚会验字(2011)027 号《验资报告》验证确认。经深圳证券交易所深证上[2011]215 号文同意,公司发行的人民币普通股股票于 2011 年 7 月 15 日在深圳证券交易所中小企业板上市。

根据公司 2009 年度股东大会的授权,公司董事会按照公司本次公开发行股票的实施结果对公司上市后适用的《河南佰利联化学股份有限公司章程》(草案)中涉及上市之后的部分条款做了修订,并经公司第四届董事会第二次会议及 2011 年第一次临时股东大会审议通过了《关于增加公司注册资本并办理相关工商变更登记事宜的议案》和《关于修订<公司章程>(草案)部分条款的议案》。具体内容详见刊登在《中国证券报》、《证券时报》及巨潮资讯网(www.cninfo.com.cn)上的《公司第四届董事会第二次会议决议公告》(2011 年 8 月 6 日刊登)及《公司 2011 年第一次临时股东大会决议公告》(2011 年 8 月 23 日刊登)。

2011 年 9 月 16 日,公司完成相关工商变更登记手续并取得了河南省焦作市工商行政管理局换发的《企业法人营业执照》,公司注册资本由 7000 万元人民币变更为 9400 万元人民币,公司类型由股份有限公司(非上市)变更为股份有限公司(上市),注册号为 410800100001308。

特此公告。

河南佰利联化学股份有限公司
董事会
2011 年 9 月 19 日

证券代码:002258　　股票简称:利尔化学　　公告编号:2011-026

利尔化学股份有限公司第二届董事会第十二次会议决议公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整,并对公告中的虚假记载,误导性陈述或重大遗漏承担责任。

2011年 9 月 19 日,利尔化学股份有限公司(以下简称"公司")第二届董事会第十二次会议以通讯方式召开。会议通知及会议资料于 2011 年 9 月 14 日以直接送达或传真、电子邮件方式送达。应出席会议的董事 9 人,实际出席会议的董事 9 人。会议程序符合《公司法》和公司章程的规定。会议由公司董事长黄晓忠主持,经过与会董事认真审议,形成如下决议:

1、会议以 9 票同意,0 票弃权,0 票反对的结果,审议通过了《公司内控规则落实情况自查表》。

《公司内控规则落实情况自查表》全文刊登于 2011 年 9 月 20 日的巨潮资讯网。

2、会议以 9 票同意,0 票弃权,0 票反对的结果,审议通过了《加强中小企业板上市公司内控规则落实"专项活动的整改计划》。

《加强中小企业板上市公司内控规则落实"专项活动的整改计划》全文刊登于 2011 年 9 月 20 日的巨潮资讯网。

特此公告。

利尔化学股份有限公司
董事会
二０一一年九月二十日