

(上接D6版)

93 融通证券有限责任公司
 注册地址:江西省南昌市北京西路 88 号江信国际融通大厦
 办公地址:江西省南昌市北京西路 88 号江信国际融通大厦 4 楼
 法定代表人:曹小军
 联系人:陈云云
 电话:0791-6285337
 传真:0791-6282293
 网址:www.rtfund.com
C. 注册验资机构
名称:大成基金管理有限公司
 住所:深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层
 办公地址:深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 33 层
 法定代表人:张树忠
 电话:0755-83183888
 传真:0755-83183229
 联系人:范妮
C. 律师事务所和经办律师
名称:北京中银律师事务所
 注册地址:北京市朝阳区东三环中路 7 号财富中心写字楼 A 座 40 层
 办公地址:北京市朝阳区东三环中路 7 号财富中心写字楼 A 座 40 层
 负责人:王宇
 电话:0755-22163333
 传真:0755-22163390
 经办律师:靳庆军、刘又
 联系人:冯文
(四) 会计师事务所和经办注册会计师
名称:普华永道中天会计师事务所有限公司
 会计师事务所名称:普华永道中天会计师事务所有限公司
 注册地址:上海市浦东新区陆家嘴 1318 号星展银行大厦 6 楼
 办公地址:上海市浦东新区 200 号华普永道中心 11 楼
 法人代表:傅继恒
 经办注册会计师:汪耘、金毅
 电话:021-23238888
 传真:021-23238800
四. 基金名称
基金名称:大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金
五. 基金类型
基金类型:混合型基金
六. 基金的运作方式
基金运作方式:契约、开放式
七. 基金的投资目标
 本基金投资于具有良好流动性的证券、固定收益类证券及货币市场工具等,通过调整资产配置策略,以适度风险控制,寻求在既定风险承受能力下的当期收益和资本增值的最佳体现。在 2020 年 12 月 31 日前,本基金力争实现当期收益不低于本基金净资产当期收益,资本增值为正。
八. 基金的投资方向
 本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于股票资产的比例不高于基金资产的 5%。
 本基金根据约定的资产配置策略进行股票和固定收益类(仅货币市场工具)资产的资产配置。
 本基金各个期间的资产配置比例如下表所示:

| 时间阶段 | 权益类资产比例范围 | 固定收益类证券及货币市场工具比例范围 |
|----------------------------------|-----------|--------------------|
| 基金合同生效日至 2010 年 12 月 31 日 | 0%-95% | 5%-100% |
| 2011 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 | 0%-75% | 25%-100% |
| 2016 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 | 0%-50% | 50%-100% |
| 2021 年 1 月 1 日及以后 | 0%-20% | 80%-100% |

在特殊情况下,若有充分合理的理由时,基于投资者利益最大化的原则,在不损害投资者利益且并不违背法律法规的前提下,本基金在履行相应程序后,可适当偏离上述比例范围,并予以公告。
九. 基金的投资策略
 本基金在资产配置中强调风险控制,通过合理、科学的方法,将定性分析和定量分析相结合,建立较全面的资产、个股投资价值评价体系,不断优化投资组合配置。
十. 资产配置策略
 本基金根据约定的资产配置策略进行股票和固定收益类(仅货币市场工具)资产的资产配置。本基金各个期间的资产配置比例如下表所示:

| 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 | -- | 0.00 |
| B | 采矿业 | 456,588,796.35 | 4.51 |
| C | 制造业 | 5,485,817,502.00 | 54.14 |
| CD | 食品饮料 | 1,439,813,810.57 | 14.21 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 15,756,952.80 | 0.16 |
| C2 | 木材、家具 | -- | 0.00 |
| C3 | 造纸、印刷 | 4,497,411.80 | 0.04 |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 345,847,471.00 | 3.41 |
| CS | 有色金属 | 546,295,486.66 | 5.39 |
| C6 | 金属、非金属 | 626,773,168.06 | 6.19 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 849,486,429.23 | 8.38 |
| C8 | 医药、生物制品 | 1,637,345,972.30 | 16.36 |
| C9 | 其他制造业 | -- | 0.00 |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 26,400,000.00 | 0.26 |
| E | 建筑业 | 34,472,615.60 | 0.34 |
| F | 交通运输、仓储业 | -- | 0.00 |
| G | 信息技术业 | 395,585,449.06 | 3.90 |
| H | 通信和设备制造业 | 288,693,852.73 | 2.85 |
| I | 金融、保险业 | 441,577,839.86 | 4.36 |
| J | 房地产业 | 118,776,428.58 | 1.17 |
| K | 社会服务业 | 131,680,000.00 | 1.30 |
| L | 文化传媒与文化产业 | 171,000,000.00 | 1.69 |
| M | 综合类 | -- | 0.00 |
| 合计 | | 7,550,992,479.98 | 74.52 |

3. 报告期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 | 600267 | 海正药业 | 24,166,760 | 900,146,418.40 | 8.88 |
| 2 | 600132 | 康美药业 | 9,000,000 | 516,600,000.00 | 5.10 |
| 3 | 601699 | 厦门信达 | 9,000,000 | 299,290,000.00 | 2.92 |
| 4 | 600036 | 招商银行 | 21,735,294 | 282,997,438.85 | 2.79 |
| 5 | 600690 | 青岛海尔 | 9,499,957 | 265,523,778.18 | 2.62 |
| 6 | 002241 | 歌尔声学 | 9,999,739 | 253,793,883.42 | 2.50 |
| 7 | 000568 | 泸州老窖 | 5,200,000 | 234,624,000.00 | 2.32 |
| 8 | 000243 | 贵州茅台 | 5,500,000 | 226,390,000.00 | 2.24 |
| 9 | 600519 | 贵州茅台 | 952,831 | 202,600,455.53 | 2.00 |
| 10 | 600703 | 三安光电 | 12,000,000 | 196,800,000.00 | 1.94 |

4. 本次有限售条件的流通股上市情况与股改说明书所载情况完全一致。
5. 此前有限售条件的流通股上市情况:
 截止 2010 年 11 月 8 日本公司大股东广州粤泰集团有限公司所持有的本公司 146,521,570 限售流通股已经有 136,483,773 股上市流通,尚有 10,037,797 股限售流通股未能上市流通。2008 年 11 月 7 日,公司持股 5%以上的股东北京京城华威投资有限公司持有的 40,854,788 股限售流通股已经全部解除限售上市。其他已于 2006 年 11 月 7 日解除限售上市的股东分别为:广州市第三建筑工程有限公司、广州新利源消防工程企业有限公司、广州市人大常委会机关服务中心、广州白兰山企业集团总公司、广州市柒物物业管理有限公司、广州市白云区保安服务公司、南宁市台联装饰公司、广东广惠岭南贸易有限公司。2007 年 12 月 6 日,股改时并未明确表示同意的广州市番禺区华富金银珠宝工艺厂归还大股东代付的对价解除限售上市。2009 年 10 月,股改时并未明确表示同意的广州市东山国信企业管理有限公司归还大股东代付的对价解除限售上市。2010 年 10 月 22 日,股改时并未明确表示同意的广州市拜登贸易有限公司归还大股东代付的对价解除限售上市。公司目前仍有部分未明确表示同意股改的限售流通股大股东未办理相关手续。

七. 股本变动结构表

| 单位:股 | 单位:股 | 本次上市前 | 变动数 | 本次上市后 |
|-------------|-----------------|-------------|---------|-------------|
| 有限售条件的流通股 | 1. 国家持有股份 | | | |
| | 2. 境内法人持有股份 | | | |
| | 3. 其他境内法人持有股份 | 10,532,797 | -37,797 | 10,495,000 |
| | 4. 境内自然人持有股份 | | | |
| | 5. 境外法人、自然人持有股份 | | | |
| | 6. 流通股投资者配股股份 | | | |
| | 7. 一般法人配股股份 | | | |
| | 8. 其他 | | | |
| 有限售条件的流通股合计 | | 10,532,797 | -37,797 | 10,495,000 |
| | A 股 | 289,467,203 | +37,797 | 289,505,000 |
| 无限售条件的流通股 | H 股 | | | |
| | 其他 | | | |
| 无限售条件的流通股合计 | | 289,467,203 | +37,797 | 289,505,000 |
| 股份总额 | | 300,000,000 | | 300,000,000 |

特此公告。
广州东华实业股份有限公司
董事会
 2011 年 10 月 27 日

证券代码:600393 股票简称:东华实业 编号:临 2011-021 号
债券代码:123002 债券简称:09 东华债

广州东华实业股份有限公司
有限售条件的流通股上市公告
 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,对公告的真实性、准确性、完整性、及时性承担个别及连带责任。
重要提示:
 ● 本次有限售条件的流通股上市数量为 37,797 股
 ● 本次有限售条件的流通股上市流通日为 2011 年 11 月 7 日
 一、股权分置改革方案的相关情况
 1. 公司股权分置改革于 2005 年 10 月 28 日经相关股东会议通过,以 2005 年 11 月 3 日作为股权登记日实施,于 2005 年 11 月 7 日实施后首次复牌。
 2. 公司股权分置改革方案是否非追加对价:否
 二、股权分置改革方案中关于有限售条件的流通股上市流通有关承诺
 1. 本公司控股股东在公司实行股权分置时承诺:
 a) 以持有的原非流通股股票中划出 1000 万股用于东华实业管理层的长期激励计划,并授权东华实业董事会按照相关法律、法规的规定拟定该长期激励计划的具体方案。b) 持有的原非流通股股份(不包括用于东华实业管理层长期激励计划的 1000 万股)的限售期限和限售条件:①自股权分置改革方案实施之日起三十六个月内不通过证券交易所挂牌出售。②自股权分置改革方案实施之日起第二十七个月至第四十八个月内,通过证券交易所挂牌出售的股份数量占公司股份总数的比例不超过百分之二十,并且只有在满足以下条件下方可进行:东华实业经审计的前 3 年加权平均净资产收益率不低于 10%,且最近一年净资产收益率不低于 13%。③自股权分置改革方案实施之日起第四十九个月至第六十个月内,通过证券交易所挂牌出售股份同样需满足:东华实业经审计的前 3 年加权平均净资产收益率不低于 10%,且最近一年净资产收益率不低于 13%。因此公司控股股东广州粤泰集团有限公司 37,797 股限售流通股未能于 2010 年 11 月上市流通。
 截止目前,距离东华实业股权分置改革完成时间已经超过 60 个月,东华实业大股东承诺自股权分置改革方案实施之日起第四十九个月至第六十个月内,通过证券交易所挂牌出售股份同样需满足:东华实业经审计的前 3 年加权平均净资产收益率不低于 10%,且最近一年净资产收益率不低于 13%。"已经自动失效,因此公司控股股东广州粤泰集团有限公司 37,797 股限售流通股已经具备上市流通的条件,将在 2011 年 11 月 7 日上市流通。

粤泰集团承诺的用于东华实业管理层长期激励计划的 1000 万股于本公司未制定股权激励的具体方案,因此本次大股东承诺用于股权激励的 1000 万股限售流通股未能上市,公司将根据具体情况及公司的具体情况在适当的时候制定股权激励的具体方案。
 公司目前仍有部分未明确表示同意股改的限售流通股大股东未办理相关手续。
 三、股改实施后至今公司股本结构变化和限售持股变化情况
 1. 股改实施后至今,未发生过除分配、转增以外的股本结构变化。
 2. 股改实施后,2007 年 12 月 6 日广州市番禺区华富金银珠宝工艺厂归还本公司控股股东广州粤泰集团有限公司代付的对价 3,436 股,使粤泰集团所持有的股份的数量由归还对价前的 146,480,337 股,占公司总股本的 48.83%,变更为 146,483,773 股,占公司总股本的 48.83%。2010 年 10 月 22 日,广州拜登贸易有限公司归还广州粤泰集团有限公司代付的对价 37,797 股,使粤泰集团所持有的股份的数量由归还对价前的 146,483,773 股,占公司总股本的 48.83%,变更为 146,521,570 股,占公司总股本的 48.84%。
 四、公司不存在大股东占用资金。
 五、保荐机构核查意见
 本公司股改保荐机构为海通证券股份有限公司,海通证券认为,本公司本次相关股东申请拟上市流通的有限限售流通股事宜符合中国证监会和上海证券交易所有关的相关规定。

2008 年 10 月,公司收到海通证券《关于更换保荐代表人的通知》,本公司原保荐代表人项敏由于工作原因不再担任本公司股改保荐代表人,改由赵春奎先生担任。
 六、本次有限售条件的流通股情况
 1. 本次有限售条件的流通股上市数量为 37,797 股;
 2. 本次有限售条件的流通股上市流通日为 2011 年 11 月 7 日;
 3. 有限售条件的流通股上市明细清单

| 序号 | 股东名称 | 持有有限售条件的流通股股份数量 | 持有有限售条件的流通股股份占本公司总股本比例 | 本次上市数量(单位:股) | 剩余有限售条件的流通股数量 |
|----|-----------------|-----------------|------------------------|--------------|---------------|
| 1 | 广州粤泰集团有限公司 | 10,037,797 | 3.35% | 37,797 | 10,000,000 |
| 2 | 其他未对股改事项表示同意的股东 | 495,000 | 0.17% | 0 | 495,000 |
| 合计 | | 10,532,797 | 3.51% | 37,797 | 10,495,000 |

债、企业债、金融债等品种之间的类别分配。在本基金具体进行类别配置的过程中,将综合考虑模型辅助和主动预测相结合的方法。
 在确定自长期资产配置比例后,本基金将对长、中、短期债券品种进行期限配置,根据不同情况,决定采用子弹、哑铃或阶梯形策略实现不同期限债券品种的搭配。
4. 交易策略
 在主动构建和调整过程中,本基金将采用一系列凸度策略、收益率利差策略和回购套利等多种交易策略,以提高组合整体投资收益水平,控制组合的投资风险。

十. 基金的业绩比较基准

| 时间阶段 | 业绩比较基准 |
|----------------------------------|--------------------------------|
| 基金合同生效日至 2010 年 12 月 31 日 | 75%×新华富时中国 A600 指数+25%×中国债券总指数 |
| 2011 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 | 45%×沪深 300 指数+55%×中国债券总指数 |
| 2016 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 | 25%×沪深 300 指数+75%×中国债券总指数 |
| 2021 年 1 月 1 日以及该日以后 | 10%×沪深 300 指数+90%×中国债券总指数 |

注:大成基金管理有限公司根据《中国证监会 2020 年生命周期证券投资基金业务指导意见》,经与基金托管人协商一致,并自中国证监会备案,自 2011 年 1 月 1 日起,大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金使用业绩比较基准由原:

| 时间阶段 | 业绩比较基准 |
|----------------------------------|--------------------------------|
| 基金合同生效日至 2010 年 12 月 31 日 | 75%×新华富时中国 A600 指数+25%×中国债券总指数 |
| 2011 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 | 45%×沪深 300 指数+55%×中国债券总指数 |
| 2016 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 | 25%×沪深 300 指数+75%×中国债券总指数 |
| 2021 年 1 月 1 日以及该日以后 | 10%×沪深 300 指数+90%×中国债券总指数 |

“变更前”

| 时间阶段 | 业绩比较基准 |
|----------------------------------|--------------------------------|
| 基金合同生效日至 2010 年 12 月 31 日 | 75%×新华富时中国 A600 指数+25%×中国债券总指数 |
| 2011 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 | 45%×沪深 300 指数+55%×中国债券总指数 |
| 2016 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 | 25%×沪深 300 指数+75%×中国债券总指数 |
| 2021 年 1 月 1 日以及该日以后 | 10%×沪深 300 指数+90%×中国债券总指数 |

“变更后”

| 时间阶段 | 业绩比较基准 |
|----------------------------------|--------------------------------|
| 基金合同生效日至 2010 年 12 月 31 日 | 75%×新华富时中国 A600 指数+25%×中国债券总指数 |
| 2011 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 | 45%×沪深 300 指数+55%×中国债券总指数 |
| 2016 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 | 25%×沪深 300 指数+75%×中国债券总指数 |
| 2021 年 1 月 1 日以及该日以后 | 10%×沪深 300 指数+90%×中国债券总指数 |

在本基金的运作过程中,如果由于外部投资环境或法律法规的变化而使使得业绩比较基准更符合基金份额持有人的利益,基金管理人可以以业绩比较基准进行适当调整,并在报中国证监会核准后,提前公告予以实施。
十一. 基金的风险收益特征
 本基金属于证券投资基金,2020 年 12 月 31 日为基金的风险收益特征。从建仓期起至目标日期止,本基金的风险收益水平将随着期间的流逝逐步降低,即本基金初始投资阶段的风险收益水平将随着目标日期的临近,本基金逐步降低一只低风险债券基金。
十二. 基金的投资报告
 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。
 基金托管人中国银行股份有限公司根据基金合同规定,于 2011 年 9 月 29 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。
 本报告除投资组合报告取自大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金 2011 年 2 季度报告,截至 2011 年 6 月 30 日(财务数据未经审计)。
1. 报告期末基金资产净值及基金份额持有人数量

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------------|-------------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 7,550,992,479.98 | 74.36 |
| 2 | 固定收益投资 | 7,550,992,479.98 | 16.56 |
| | 其中:债券 | 1,681,584,692.32 | 16.56 |
| 3 | 货币资金 | 1,681,584,692.32 | 0.00 |
| 4 | 买入返售金融资产 | 297,500,806.25 | 0.00 |
| 5 | 银行存款和结算备付金合计 | 584,284,462.01 | 5.75 |
| 6 | 其他资产 | 40,251,114.49 | 0.40 |
| 7 | 合计 | 10,154,613,556.05 | 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 | -- | 0.00 |
| B | 采矿业 | 456,588,796.35 | 4.51 |
| C | 制造业 | 5,485,817,502.00 | 54.14 |
| CD | 食品饮料 | 1,439,813,810.57 | 14.21 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 15,756,952.80 | 0.16 |
| C2 | 木材、家具 | -- | 0.00 |
| C3 | 造纸、印刷 | 4,497,411.80 | 0.04 |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 345,847,471.00 | 3.41 |
| CS | 有色金属 | 546,295,486.66 | 5.39 |
| C6 | 金属、非金属 | 626,773,168.06 | 6.19 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 849,486,429.23 | 8.38 |
| C8 | 医药、生物制品 | 1,637,345,972.30 | 16.36 |
| C9 | 其他制造业 | -- | 0.00 |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 26,400,000.00 | 0.26 |
| E | 建筑业 | 34,472,615.60 | 0.34 |
| F | 交通运输、仓储业 | -- | 0.00 |
| G | 信息技术业 | 395,585,449.06 | 3.90 |
| H | 通信和设备制造业 | 288,693,852.73 | 2.85 |
| I | 金融、保险业 | 441,577,839.86 | 4.36 |
| J | 房地产业 | 118,776,428.58 | 1.17 |
| K | 社会服务业 | 131,680,000.00 | 1.30 |
| L | 文化传媒与文化产业 | 171,000,000.00 | 1.69 |
| M | 综合类 | -- | 0.00 |
| 合计 | | 7,550,992,479.98 | 74.52 |

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 | 600267 | 海正药业 | 24,166,760 | 900,146,418.40 | 8.88 |
| 2 | 600132 | 康美药业 | 9,000,000 | 516,600,000.00 | 5.10 |
| 3 | 601699 | 厦门信达 | 9,000,000 | 299,290,000.00 | 2.92 |
| 4 | 600036 | 招商银行 | 21,735,294 | 282,997,438.85 | 2.79 |
| 5 | 600690 | 青岛海尔 | 9,499,957 | 265,523,778.18 | 2.62 |
| 6 | 002241 | 歌尔声学 | 9,999,739 | 253,793,883.42 | 2.50 |
| 7 | 000568 | 泸州老窖 | 5,200,000 | 234,624,000.00 | 2.32 |
| 8 | 000243 | 贵州茅台 | 5,500,000 | 226,390,000.00 | 2.24 |
| 9 | 600519 | 贵州茅台 | 952,831 | 202,600,455.53 | 2.00 |
| 10 | 600703 | 三安光电 | 12,000,000 | 196,800,000.00 | 1.94 |

4. 本次有限售条件的流通股上市情况与股改说明书所载情况完全一致。
5. 此前有限售条件的流通股上市情况:
 截止 2010 年 11 月 8 日本公司大股东广州粤泰集团有限公司所持有的本公司 146,521,570 限售流通股已经有 136,483,773 股上市流通,尚有 10,037,797 股限售流通股未能上市流通。2008 年 11 月 7 日,公司持股 5%以上的股东北京京城华威投资有限公司持有的 40,854,788 股限售流通股已经全部解除限售上市。其他已于 2006 年 11 月 7 日解除限售上市的股东分别为:广州市第三建筑工程有限公司、广州新利源消防工程企业有限公司、广州市人大常委会机关服务中心、广州白兰山企业集团总公司、广州市柒物物业管理有限公司、广州市白云区保安服务公司、南宁市台联装饰公司、广东广惠岭南贸易有限公司。2007 年 12 月 6 日,股改时并未明确表示同意的广州市番禺区华富金银珠宝工艺厂归还大股东代付的对价解除限售上市。2009 年 10 月,股改时并未明确表示同意的广州市东山国信企业管理有限公司归还大股东代付的对价解除限售上市。2010 年 10 月 22 日,股改时并未明确表示同意的广州市拜登贸易有限公司归还大股东代付的对价解除限售上市。公司目前仍有部分未明确表示同意股改的限售流通股大股东未办理相关手续。

七. 股本变动结构表

| 单位:股 | 单位:股 | 本次上市前 | 变动数 | 本次上市后 |
|-----------|---------------|------------|---------|------------|
| 有限售条件的流通股 | 1. 国家持有股份 | | | |
| | 2. 境内法人持有股份 | | | |
| | 3. 其他境内法人持有股份 | 10,532,797 | -37,797 | 10,495,000 |
| | 4. 境内自然人持有股份 | | | |