（上接D18版）

50 江海证券有限公司
注册地址：哈尔滨市香坊区赣水路56号
办公地址：哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人：孙名扬
联系人：张宇宏
联系电话：0451-82336863
客服热线：4006662288
网址：www.jhzq.com.cn
51 华西证券有限责任公司
注册地址：四川省成都市陕西街239号
办公地址：深圳市深南大道4001号时代金融中心18楼
法定代表人：杨炯洋
联系人：金达勇
联系电话：028-86137782
传真：028-86150615
客户服务咨询电话：400-8888-818
网址：www.hx168.com.cn
52 红塔证券股份有限公司
注册地址：昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼
办公地址：昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼
法定代表人：况雨林
联系人：刘晓明
电话：0871-3577942
客户服务电话：0871-3577930
网址：www.hongtazq.com
53 厦门证券有限公司
注册地址：厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼
办公地址：厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼
法定代表人：傅毅辉
电话：0592-5161642
传真：0592-5161140
联系人：卢金文
客户服务热线：0592-5163588
网址：www.xmzq.cn
54 银泰证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区竹子林四路紫竹七道18号光大银行大厦18楼
办公地址：深圳市福田区竹子林四路紫竹七道18号光大银行大厦18楼
法定代表人：高颂
联系人：林文宇
联系电话：0755-83703759
咨询电话：0755-83710885
公司网址：www.ytzq.net
55 华安证券有限责任公司
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路166号未来资产大厦27层
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路166号未来资产大厦27层
法定代表人：陈林
联系人：宋歌
客户服务电话：400-820-9898
网址：www.cnhbstock.com
56 爱建证券有限责任公司
注册地址：上海市南京西路758号23楼
办公地址：上海市南京西路758号20-25楼
法定代表人：郭林
联系人：陈薇
电话：021-62171984
传真：021-62878783
服务热线：021-63340678
公司网站：www.ajzq.com
57 国金证券股份有限公司
注册地址：成都市东城根上街95号
办公地址：成都市东城根上街95号
法定代表人：冉云
联系人：金喆
电话：028-86690126
传真：028-86690126
服务热线：4006-600109
公司网站：www.gjzq.com.cn
58 招迅证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼信达金融中心
法定代表人：高冠江
联系人：唐静
联系电话：010-63080985
客服热线：400-800-8899
网址：www.cindasc.com
59 华龙证券有限责任公司
注册地址：甘肃省兰州市静宁路308号
办公地址：甘肃省兰州市东岗路638号财富大厦
法定代表人：李晓安
电话：0931-8888088
传真：0931-4890515
联系人：李昕田
客户服务电话：0931-4890619，4890618，4890100
网址：http://www.hlzqgs.com
60 民生证券有限责任公司
注册地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-20层
办公地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-20层
法定代表人：岳献春
联系人：赵阳
电话：010-85252656
服务热线：400-619-8888
公司网站：www.mszq.com
61 华福证券有限责任公司
注册地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址：福州市五四路157号新天地大厦7至10层
法定代表人：黄金琳
邮政编码：350003
联系人：张腾
联系电话：0591-87383623
业务传真：0591-87383610
统一客户服务电话：96326（福建省外请先拨0591）。
公司网址：www.hfzq.com.cn
62 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
法定代表人：徐勇力
联系人：汤凌川
电话：010-66555835
服务热线：010-66555262，66555382
公司网站：www.dxzq.net
63 东方证券股份有限公司
注册地址：上海市中山南路318号2号楼22层-29层
办公地址：上海市中山南路318号2号楼22层-29层
法定代表人：王益民
电话：021-63325888
传真：021-63326173
联系人：吴宇
客户服务电话：95503
网址：www.dfzq.com.cn
64 国海证券股份有限公司
住所：广西南宁市滨湖路46号国海大厦
办公地址：深圳市福田区竹子林四路光大银行大厦3F
法定代表人：张雅锋
联系电话：0755-83709350
传真：0755-83704850
联系人：牛孟宇
网址：www.ghzq.com.cn
65 五矿证券有限公司
住所：深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公室47层01单元
办公地址：深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公室47层01单元
法定代表人：高竹
联系电话：0755-82545555
传真：0755-82545500
联系人：赖君伟
网址：www.wkzq.com.cn
66 天相投资顾问有限公司
注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
办公地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
法定代表人：林义相
联系人：姜吉灵
联系电话：010-66045491
基金热线：010-66045678
网址：www.txsec.com
基金管理人可根据有关法律法规要求，根据实情，选择其他符合要求的机构代理销售本基金或变更上述代销机构，并及时公告。

2、场内发售机构：具有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位（具体名单见基金份额发售公告及其他相关业务公告）。

（二）注册登记机构
名称：中国证券登记结算有限责任公司
住所：北京西城区金融大街27号投资广场23层
办公地址：北京西城区太平桥大街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：北京市德恒律师事务所
住所：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座十二层
负责人：王丽
办公地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座十二层
联系电话：010-65232180 65269781
传真：010-65232181
联系人：徐芳
经办律师：陈静茹、苏文静

（四）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：金毅
经办会计师：薛竞、金毅

## 四、基金的名称

本基金名称：鹏华沪深300指数证券投资基金（LOF）

## 五、基金的运作方式及类型

（一）本基金运作方式
上市契约型开放式

（二）本基金类型
股票型证券投资基金

## 六、基金的投资目标

本基金采用指数化投资方式，追求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的跟踪误差最小化，力争将日平均跟踪误差控制在0.35%以内，以实现对沪深300指数的有效跟踪。

## 七、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，主要投资于沪深300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90%），现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。此外，为更好的实现投资目标，本基金将少量投资于非沪深300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，或将股指期货等金融衍生品纳入本基金的投资范围。

## 八、基金的投资策略

（一）股资策略
本基金采用被动式指数投资方法，按照成份股在沪深300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，使跟踪误差控制在限定的范围之内。

1、资产配置策略
为实现紧密跟踪业绩比较基准的投资目标，本基金将以不低于基金资产净值90%的资产投资于沪深300指数成份股和备选成份股。在正常市场情况下本基金将采用完全复制法，严格按目标指数的成份股权重构建组合，少数特殊情况下本基金将配合使用优化方法作为补充，以保证对标的指数的有效跟踪。

2、股票投资策略
本基金原则上通过指数复制法进行被动式指数化投资，根据沪深300指数成份股的基准权重构建股票投资组合，并根据成份股及其权重的变动而进行相应调整。

①股票投资组合的构建
本基金在建仓期内，将按照沪深300指数各成份股的基准权重对其逐步买入，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可采取适当方法，以降低买入成本。当遇到成份股停牌、流动性不足等其他市场因素而无法依指数权重购买某成份股及预期标的指数的成份股即将调整或其他影响指数复制的因素时，本基金可以根据市场情况，结合研究分析，对基金资产进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。

②股票投资组合的调整
本基金所构建的股票投资组合将根据沪深300指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发因素等变化，对其进行适时调整，以保证基金净值增长率与基准指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。由于受到各项指数比例限制，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，基金将会采用合理方法寻求替代。

① 定期调整
根据标的指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。

② 不定期调整
当成份股发生增发、配股、分红等情况而影响成份股在指数中权重的行为时，本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合；
根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数；
根据法律、法规和基金合同的规定，成份股在标的指数中的权重因其它特殊原因发生相应变化的，本基金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，最终使跟踪误差控制在限定的范围之内；
根据法律法规中针对基金投资比例的相关规定，当基金投资组合中按标的指数权重投资的股票资产比例或个股比例超过规定限制时，本基金将对其进行实时调整，并相应对其他资产或个股进行微调，以保证基金合法规范运作。

3、债券投资策略
本基金根据流动性管理的需要，选取到期日在一年以内的政府债券进行配置。本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略，根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化，并利用债券定价技术，进行个券选择。

（二）股资决策依据及程序
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与投资原则；决定有关指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策；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）基金经理根据沪深300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）基金经理根据实际交易情况、申购赎回情况、对跟踪误差的监控结果、风险绩效小组风险绩效评估报告和监察稽核部风险监控和评估结果，采用相应的投资策略、优化方法对投资组合进行动态调整；
④）基金经理在目标指数成份股定期调整信息公布前一个月内，根据对调整方案的分析预测以及成份股调整对股价影响的分析，决定采取提前调整还是事后调整的策略，增持可能进入目标指数的股票，剔除可能被调整出目标指数的股票，并向投资决策委员会提交报告，经投资决策委员会批准后方可进行；
⑤）如出于更好跟踪标的指数的目的需要投资于股票期权、股指期货等金融衍生工具的，基金经理应向投资决策委员会提交报告，说明进行上述投资的目的、投资价值金额、可能产生的风险以及相应控制措施等内容，经投资决策委员会批准后方可进行；
⑥）交易室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；
⑦）风险绩效小组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；
⑧）监察稽核部对投资计划在合规性方面的执行情况的执行进行日常监督和实时风险控制；
⑨）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，并予以公告。

## 九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准：
沪深300指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%
本基金为沪深300指数基金，以沪深300指数作为业绩比较基准。沪深300指数选择我国A股市场规模较大、流动性较强、基本面良好的300家上市公司的股票作为样本股，充分反映了A股市场的行业代表性，描述了沪深A股市场的总体趋势，同时该指数还具有指数编制方法透明、样本股调整规则清晰等特征，是目前市场上较有影响力的股票投资业绩比较基准。

本基金充分考虑本基金各资产投资比例要求从而构建上述业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

## 十、基金的风险收益特征

本基金属于采用指数化操作的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金，为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

## 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2012年4月20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2012年3月31日（未经审计）。

1、截至2012年3月31日基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 617,192,972.95 | 94.68 |
| | 其中：股票 | 617,192,972.95 | 94.68 |
| 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 | 34,072,255.09 | 5.23 |
| 6 | 其他各项资产 | 580,195.56 | 0.09 |
| 7 | 合计 | 651,845,423.60 | 100.00 |

2、截至2012年3月31日按行业分类的股票投资组合
①）积极投资按行业分类的股票投资组合
本基金截至2012年3月31日未持有积极投资的股票。
②）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 | 3,950,021.87 | 0.61 |
| B | 采掘业 | 68,669,031.86 | 10.56 |
| C | 制造业 | 216,435,958.50 | 33.29 |
| C0 | 食品、饮料 | 44,668,185.49 | 6.87 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 2,117,549.22 | 0.33 |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 造纸、印刷 | - | - |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 12,319,298.33 | 1.89 |
| C5 | 电子 | 6,155,164.87 | 0.95 |
| C6 | 金属、非金属 | 52,580,415.64 | 8.09 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 71,835,050.13 | 11.05 |
| C8 | 医药、生物制品 | 26,469,597.22 | 4.07 |
| C99 | 其他制造业 | 290,697.60 | 0.04 |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 14,756,709.92 | 2.27 |
| E | 建筑业 | 16,342,935.88 | 2.51 |
| F | 交通运输、仓储业 | 18,199,002.77 | 2.80 |
| G | 信息技术业 | 20,241,871.99 | 3.11 |
| H | 批发和零售贸易 | 17,276,482.54 | 2.66 |
| I | 金融、保险业 | 192,883,116.62 | 29.66 |
| J | 房地产业 | 31,258,969.67 | 4.81 |
| K | 社会服务业 | 4,930,049.18 | 0.76 |
| L | 传播与文化产业 | 1,350,310.69 | 0.21 |
| M | 综合类 | 10,898,511.46 | 1.68 |
| | 合计 | 617,192,972.95 | 94.92 |

3、截至2012年3月31日按公允价值占基金资产净值比例大小排序的积极投资前五名与指数投资的前十名股票明细
①）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
本基金截至2012年3月31日未持有积极投资的股票。
②）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 | 3,498,187 | 21,933,632.49 | 3.37 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 1,609,573 | 19,153,918.70 | 2.95 |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 436,093 | 15,952,281.94 | 2.45 |
| 4 | 601328 | 交通银行 | 2,980,144 | 14,036,478.24 | 2.16 |
| 5 | 601166 | 兴业银行 | 982,757 | 13,090,323.24 | 2.01 |
| 6 | 600000 | 浦发银行 | 1,456,740 | 13,008,688.20 | 2.00 |
| 7 | 601939 | 建设银行 | 2,327,540 | 11,242,018.20 | 1.73 |
| 8 | 601088 | 中国神华 | 429,288 | 10,994,065.68 | 1.69 |
| 9 | 600519 | 贵州茅台 | 54,051 | 10,645,884.96 | 1.64 |
| 10 | 000002 | 万科A | 1,259,964 | 10,432,501.92 | 1.60 |

4、截至2012年3月31日按债券品种分类的债券投资组合
本基金截至2012年3月31日未持有债券。
5、截至2012年3月31日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
本基金截至2012年3月31日未持有债券。
6、截至2012年3月31日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
本基金截至2012年3月31日未持有资产支持证券。
7、截至2012年3月31日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
本基金截至2012年3月31日未持有权证。
8、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 | 52,949.36 |
| 2 | 应收证券清算款 | 419,931.45 |
| 3 | 应收股利 | 20,743.78 |
| 4 | 应收利息 | 7,279.20 |
| 5 | 应收申购款 | 79,291.77 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 580,195.56 |

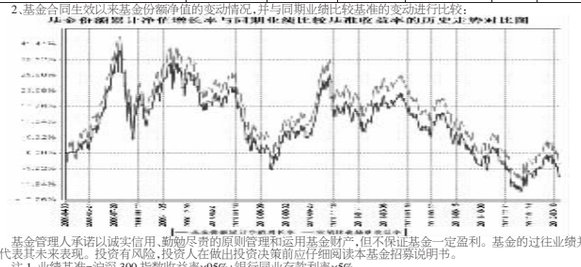
④）截至2012年3月31日持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金截至2012年3月31日未持有处于转股期的可转换债券。
⑤）期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金截至2012年3月31日未持有积极投资的股票。
⑥）投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 十二、基金的业绩

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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2009年4月3日-2009年12月31日 | 31.11% | 1.75% | 36.80% | 1.87% | -5.69% | -0.12% |
| 2010年1月1日-2010年12月31日 | -12.63% | 1.51% | -11.77% | 1.50% | -0.86% | 0.01% |
| 2011年1月1日-2011年12月31日 | -23.60% | 1.24% | -23.83% | 1.23% | 0.23% | 0.01% |
| 2012年1月1日-2012年3月31日 | 4.31% | 1.44% | 4.46% | 1.44% | -0.15% | 0.00% |
| 自基金合同生效至2012年3月31日 | -8.72% | 1.49% | -3.95% | 1.52% | -4.77% | -0.03% |

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：




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招募说明书。

注1：业绩基准=沪深300指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%。
注2：本基金基金合同于2009年4月3日生效。
注3：基金业绩截止日为2012年3月31日（未经审计）。

## 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、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0.75%年费率计提。管理费的计算方法如下：
H=E×0.75%÷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0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下：
H=E×0.15%÷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付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。
上述一、基金费用的种类中第3-7项费用，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）与基金销售有关的费用
1、申购费
本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取。本基金的申购费用不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。
本基金采取金额申购的方式，场外、场内的申购费率相同，具体费率如下：

| 申购金额M（元） | 申购费率 |
|---|---|
| M<100万 | 1.2% |
| 100万≤M<250万 | 0.8% |
| 250万≤M<500万 | 0.4% |
| M≥500万 | 每笔1000元 |

投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

2、转换费
本基金目前仅可办理场外转换业务，场内暂未开通基金间转换业务。
具体转换费率、计算公式及转换业务规则详见基金管理人于2010年3月12日刊登的《鹏华基金管理有限公司关于调整旗下开放式证券投资基金转换业务规则的公告》。

3、赎回费：本基金的场外赎回费率按持有年限逐年递减，具体费率如下：

| 持有年限（Y） | 场外赎回费率 |
|---|---|
| Y<1年 | 0.5% |
| 1年≤Y<2年 | 0.25% |
| Y≥2年 | 0 |

本基金的场内赎回费率为固定值0.5%。
本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取。本基金的赎回费用由赎回申请人承担，赎回费总额的25%归基金财产，75%用于支付市场推广、注册登记费和其他手续费。

4、本基金的申购费率、转换费率、赎回费率和收费方式由基金管理人根据《基金合同》的规定确定并在《招募说明书》中列示。基金管理人和基金托管人协商后，可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前2个工作日在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。

5、基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行相关手续后基金管理人可以适当调低基金申购费率、基金赎回费率和基金转换费率。

（四）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。

（五）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。

（六）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，对本基金管理人原公告的本基金招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：
1、在“重要提示”部分明确了更新招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。
2、对“三、基金管理人”部分内容进行了更新。
3、对“四、基金托管人”部分内容进行了更新。
4、对“五、相关服务机构”内容进行了更新。
5、更新了“十一、基金的投资”一章中基金投资组合报告内容，数据截至日期为2012年3月31日。
6、更新了“十二、基金的业绩”一章的投资业绩内容，数据截至日期为2012年3月31日。
7、鉴于本基金管理人投资者服务方面措施的进一步提升，在“二十三、对基金份额持有人的服务”一章，更新了服务中的相关内容。
8、对“二十四、其他应披露事项”一章内容进行了更新。

鹏华基金管理有限公司
2012年5月17日

---

证券代码：002665　证券简称：首航节能　公告编号：2012-007

# 北京首航艾启威节能技术股份有限公司第一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。

一、董事会会议召开情况
北京首航艾启威节能技术股份有限公司（以下简称“公司”）第一届董事会第十次会议于2012年05月15日在北京市丰台区南四环188号总部基地3区20号楼以现场参会方式召开，会议通知于2012年05月02日以电话、传真、邮件等方式通知各位董事。本次董事会会议由董事长黄文佳先生召集和主持，会议应出席董事9人，实际出席董事9人，公司部分高级管理人员列席会议，符合《中华人民共和国公司法》、《公司章程》等相关法律法规的规定，所作决议合法有效。

二、董事会会议审议情况
1、审议通过了《公司2011年度总经理工作报告》
本议案获同意票9票，反对票0票，弃权票0票。
2、审议通过了《公司2011年度董事会工作报告》
本议案获同意票9票，反对票0票，弃权票0票，同意将该议案提请公司2011年度股东大会审议。
公司独立董事陶文铨、耿建新、刘敬东向董事会提交了《独立董事述职报告》，并将在公司2011年度股东大会上述职。
3、审议通过了《关于公司2011年度财务决算的议案》
经中瑞岳华会计师事务所（特殊普通合伙）对本公司2011年会计年度的财务审计，公司2011年度主要经营指标情况如下：营业收入为75206万元，比上年增加17586万元，增长30.52%；利润总额为13350万元，比上年增加2578万元，增长23.94%；净利润为11025万元，比上年增加1893万元，增长20.73%；资产总额为107364万元，比上年增加10557万元，增长10.91%；股东权益为49832万元，比上年增加12531万元，增长33.60%。
本议案获同意票9票，反对票0票，弃权票0票，同意将该议案提请公司2011年度股东大会审议。
4、审议通过了《关于公司董事会授权总经理办理银行授信事宜的议案》
董事会授权总经理为公司正常经营所需的贷款、保函、票据等事项，办理银行授信。董事会授权总经理可选择在以下授信额度范围内办理银行授信相关事宜：北京银行股份有限公司授信额度在3亿元人民币内，杭州银行股份有限公司授信额度在3亿元人民币内，招商银行股份有限公司授信额度在2亿元人民币内，民生银行股份有限公司授信额度在1亿元人民币内，其他银行授信额度在人民币1亿元以内。上述授信额度总额不得超过上年经审计的资产总额的50%，其中单笔授信中贷款额度不超过授信额度的50%。董事会授权总经理在上述授信额度内办理银行授信规模项下有关事宜。董事会授权总经理自2012年5月15日起至2014年5月30日止在上述授信额度内办理银行授信规模项下有关事宜。
如果单笔授信额度达到人民币1亿元或以上，公司应及时进行信息披露。
本议案获同意票9票，反对票0票，弃权票0票。
5、审议通过了《关于修改北京首航艾启威节能技术股份有限公司章程的议案》
本议案获同意票9票，反对票0票，弃权票0票，同意将该议案提请公司2011年度股东大会审议。
6、审议通过了《关于继续聘任中瑞岳华会计师事务所（特殊普通合伙）为公司审计机构的议案》
本议案获同意票9票，反对票0票，弃权票0票，同意将该议案提请公司2011年度股东大会审议。
7、审议通过了《关于提请召开北京首航艾启威节能技术股份有限公司2011年度股东大会的议案》
本议案获同意票9票，反对票0票，弃权票0票。

三、备查文件
1.北京首航艾启威节能技术股份有限公司第一届董事会第十二次会议决议。

北京首航艾启威节能技术股份有限公司
董事会
2012年5月15日

证券代码：002665　证券简称：首航节能　公告编号：2012-008

# 北京首航艾启威节能技术股份有限公司第一届监事会第七次会议决议公告

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。

一、监事会会议召开情况
北京首航艾启威节能技术股份有限公司（以下简称“公司”）第一届监事会第七次会议于2012年5月15日下午14:30点在北京市丰台区南四环188号总部基地3区20号楼召开，本次会议通知及相关资料已于2012年5月2日以邮件、电话及传真方式送达全体监事。会议应到监事3名，实到监事3名。出席会议人数符合《中华人民共和国公司法》和《公司章程》的规定。本次会议由监事会主席刘强主持。

二、监事会会议审议情况
1、审议通过了《北京首航艾启威节能技术股份有限公司2011年度监事会工作报告》
该议案获同意票3票，反对票0票，弃权票0票。同意将该议案提请2011年度股东大会审议批准。
2、审议通过了《关于北京首航艾启威节能技术股份有限公司2011年度财务决算的议案》
经中瑞岳华会计师事务所（特殊普通合伙）对本公司2011年会计年度的财务审计，公司2011年度主要经营指标情况如下：营业收入为75206万元，比上年增加17586万元，增长30.52%；利润总额为13350万元，比上年增加2578万元，增长23.94%；净利润为11025万元，比上年增加1893万元，增长20.73%；资产总额为107364万元，比上年增加10557万元，增长10.91%；股东权益为49832万元，比上年增加12531万元，增长33.60%。
该议案获同意票3票，反对票0票，弃权票0票。同意将该议案提请2011年度股东大会审议批准。
3、审议通过了《关于继续聘任中瑞岳华会计师事务所（特殊普通合伙）为公司审计机构的议案》
本议案获同意票3票，反对票0票，弃权票0票，同意将该议案提请公司2011年度股东大会审议。
三、备查文件
1、北京首航艾启威节能技术股份有限公司第一届监事会第十二次会议决议。

北京首航艾启威节能技术股份有限公司
监事会
2012年5月15日

证券代码：002665　证券简称：首航节能　公告编号：2012-009

# 北京首航艾启威节能技术股份有限公司关于召开2011年年度股东大会的通知

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。

一、本次股东大会召开的基本情况
北京首航艾启威节能技术股份有限公司（以下简称“公司”、“本公司”）第一届董事会第十二次会议审议通过了《关于召开公司2011年度股东大会的议案》，会议决定于2012年06月07日召开公司2011年度股东大会（以下简称“本次股东大会”），现将有关事项通知如下：
1、股东大会届次：2011年年度股东大会；
2、会议召集人：公司董事会；
3、会议方式：本次股东大会采取现场表决方式；
4、本次股东大会的召开时间：2012年6月7日（星期四）下午1:00时起；
5、股权登记日：2012年6月4日（星期一）
6、现场会议召开地点：北京首航艾启威节能技术股份有限公司二楼会议室
二、出席会议人员
1、本次股东大会的股权登记日为2012年6月4日（星期一）深交所收市后，在中国证券登记结算公司深圳分公司登记在册的本公司全体股东均有权出席本次股东大会，并可以以书面形式委托代理人出席会议和参加表决（授权委托书见附件2），该受托代理人不必是公司的股东；
2、公司董事、监事、董事会秘书及其他高级管理人员；
3、公司聘请的律师和保荐机构代表。
三、本次股东大会审议的事项
1、审议《公司2011年度董事会工作报告》
2、审议《公司2011年度监事会工作报告》
3、审议《关于公司2011年度财务决算的议案》
经中瑞岳华会计师事务所（特殊普通合伙）对本公司2011年会计年度的财务审计，公司2011年度主要经营指标情况如下：营业收入为75206万元，比上年增加17586万元，增长30.52%；利润总额为13350万元，比上年增加2578万元，增长23.94%；净利润为11025万元，比上年增加1893万元，增长20.73%；资产总额为107364万元，比上年增加10557万元，增长10.91%；股东权益为49832万元，比上年增加12531万元，增长33.60%。
4、审议《关于公司2011年度利润分配方案（预案）的议案》
根据中瑞岳华会计师事务所（特殊普通合伙）出具的无保留意见审计报告（中瑞岳华审字[2012]第1135号），公司2011年度实现净利润1.10亿元，扣除提取的法定盈余公积金后加上年初未分配利润，本年度可供投资者分配的利润为1.12亿元。
该议案2012年3月18日经公司第一届董事会第十次会议审议通过。决议2011年不进行利润分配，也不转增股本。2012年3月27公布于巨潮网http://www.cninfo.com.cn供投资者查阅，详见《上市公告书》第六节其他重要事项。
5、审议《关于修改北京首航艾启威节能技术股份有限公司章程的议案》
6、审议《关于继续聘任中瑞岳华会计师事务所（特殊普通合伙）为公司审计机构的议案》
公司独立董事将在本次股东大会上进行述职
四、本次股东大会现场会议登记方法
1、个人股东亲自出席股东大会，应持股东账户卡、身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明；委托他人出席会议的，代理人应持股东账户卡、股东有效身份证件、股东授权委托书和代理人有效身份证件。
2、法人股东应由法定代表人或者法定代表人委托的代理人出席会议。法定代表人出席会议的，应持本人身份证、能证明其具有法定代表人资格的有效证明；法人股东的法定代表人委托他人出席会议的，代理人应持本人身份证、法人股东单位的法定代表人依法出具的授权委托书、能证明法定代表人资格的有效证明。
3、异地股东登记可采用信函或传真的方式登记。传真或信函需在2012年6月6日16:30前送达或传真至公司董事会办公室，公司不接受电话登记。
来信请寄：北京市总部基地3区20号楼（南四环西路188号）北京首航艾启威节能技术股份有限公司董事会办公室收，邮政编码：100070（信封请注明“会议登记”字样）。
4、登记时间：2012年6月6日上午9:00-11:30，下午1:30-4:30
5、登记地点及联系方式：
北京市总部基地3区20号楼（南四环西路188号），北京首航艾启威节能技术股份有限公司董事会办公室。
联系电话：010-52255555，传真：010-52256633
联系人：黄卿义、张保源
五、其他事项
1、与会人员宿舍费用及交通费用自理。
附：1、股东会通知回执
2、授权委托书

北京首航艾启威节能技术股份有限公司董事会
2012年5月15日

附件1：