



【重大事项】

本基金在稳健投资的理念下运用自上而下的策略对基金股票资产进行适度均衡行业配置。即在分析国内外宏观经济发展的基础上,通过分析行业的特点、发展现状、生命周期、景气程度,同时比较分析行业内价值和市场的差异情况,判断各个行业的相对投资价值和投资时机,确定和调整本基金股票资产在各行业的投资比例;其中本基金在考虑上述因素的前提下,重点关注处于成熟、成熟增长的行业,适当关注受益于国家扶持计划、经济转型或经济区域性转移等发展机遇的处于初期、衰退期的行业。

② 个选逻辑

本基金认为企业具有良好的成长性,是推动股价上升的重要因素,但是,本基金股票资产投资的企业不仅需要有良好的成长性,而且要求经营稳健。这是因为企业的成长是否又好又快长期可持续发展,而不是不稳定的短期盲目快速增长,稳健经营是企业保持良好成长性的必然要求;同时,稳健经营包含着积极进取的意味,不是固步自封,强调在安全与效率稳健的基础上求得长期可持续发展。此外,拟进入基金投资组合的企业,还要通过估值水平和流动性的审慎筛选。

1) 成长性良好企业的选择

本基金首先通过财务指标初步筛选出成长性良好的企业,然后通过外部环境和企业内部因素分析,寻找和研究支持企业成长的内因因素,并判断这些因因素在未来是否可能继续发挥作用支持企业长期可持续发展,保持成长长期可持续性,以验证财务指标筛选逻辑,并补充经过内外部因素深入细致分析挖掘出的成长性良好企业,以弥补单纯依赖财务指标选择的局限性。

② 财务指标分析

本基金从反映企业成长性的指标和对企业成长产生影响的因素两个维度开展企业成长性分析,其中,前一类指标侧重考察企业过去的成长状况,后一类指标侧重考察企业未来的持续成长能力。具体而言,反映企业成长性的指标有净利润增长率、销售收入增长率、总资产增长率、主营业务增长率等,它们分别反映企业成长速度、市场扩张能力、规模扩张能力、成本控制能力等,综合以上四项指标,可较合理地反映企业在过去一段期间的成长速度与成长质量。对于企业成长性产生影响的因素有净资产回报率、营业利润率、固定资产比率、资产负债率等,它们分别反映企业的盈利能力、主动负债运营能力、资产结构、资本结构等对企业成长的影响,综合以上四项指标,可较好地反映企业在未来实现持续成长的能力确定性。

本基金将上述指标通过加权计算得出成长性指标综合以下一项或者几项指标的企业:

- A 高于全市场平均水平;
- B 高于行业平均水平;
- C 高于企业自身往年平均水平。

② 外部环境影响分析

A 行业成长前景分析

行业成长前景分析,注重解决的是企业未来的行业成长空间问题。本基金认为行业发展前景分析,不能仅仅停留在行业的一般性描述中,应当深入到相关的细分行业中,做到精耕细作的深入研究。本基金主要从以下两个方面分析:其一,分析目前细分行业的市场竞争格局状况,包括企业数量、规模分布、新企业进入障碍、产品差异化程度、厂商竞争结构等方面因素,特别注重分析行业进入壁垒情况;其二,分析目前的行业竞争态势,及其对行业影响和推动行业市场空间变化的国家产业政策、技术创新、上下游产业供需状况等因素;三是,分析宏观经济和行业行业市场空间的影响,研究和判断行业的未来成长空间,是否足够以支持企业的长期成长发展需要。

B 宏观环境变化分析

对于国内外突然出现的社会、经济、政治环境的重大变化,例如,战争、恐怖事件、流行性疾病、重大经济政策转变、金融危机、经济危机、重大的技术突破等,本基金将及时跟踪研究,分析其对于相关行业的短期和中长期成长发展的影响,以寻找受益于环境变化而发展壮大的行业。

③ 企业内部因素分析

企业发展战略是企业对于市场环境、企业自身、竞争对手等情况进行综合分析判断后形成企业成长发展方式的选择。企业发展战略分析的主要内容包括企业发展的布局以及历史发展策略、业务范围的大小,是否坚持主营业务为主,还是多元化业务,特别是关注企业在企业资金运作上的体现即募集资金的投向,分析投资项目是否符合企业发展战略,是强化主营业务还是增加企业业务范围,以及分析和测算投资项目的收益和风险等。

A 企业管理能力分析

企业管理能力是在企业发展过程中的一种重要的企业能力,是影响其他能力发挥效用的关键因素,因此,企业在成长的同时,客观上要求对管理能力进行同步发展和提高,否则企业的发展将面临无休止的障碍。成长性良好的企业管理要求是:科学的经营管理理念、高素质、适应性的经营管理团队、健全、有效的组织结构、合理、有效、到位的激励约束机制等。因此,本基金将围绕以上四个方面分析企业的管理能力。其中,本基金将重点关注企业的经营管理团队和激励约束机制。因为,经营管理团队在企业的经营中具有核心和主导地位,通过指挥、协调、管理等作用,深刻影响着企业的生存和发展;激励约束机制直接影响着企业全体员工的积极性和创造性,从而影响着员工为企业创造价值的动力。对于经营管理团队分析,主要以职业经历、文化知识结构、团队人员的稳定性,是否具有开拓进取精神等方面开展。对于激励约束机制的分析,主要以绩效考核制度、员工晋升体系、员工培训体系等方面开展。

B 市场开发能力分析

市场开发能力是企业成长发展的内在要求,也是企业成长发展的外在核心表现。市场开发能力主要从产品创新能力、以顾客为导向的质量管理能力、品牌管理与营销推广能力、从原材料供应、生产、分销、物流、经销商到最终顾客的供应链管理能力、售后服务与客户管理能力等方面展开分析。其中,本基金将重点关注企业以顾客为导向的质量管理能力,服务与产品质量管理能力。这是因为对于一家企业而言,拥有顾客是生存和发展的前提,是在激烈的市场竞争中实现增长的关键;良好的品牌与营销管理能力,有助于企业在降低价格成本、提高对市场的需求弹性、增加销售量、提高产品及服务的品质、改善企业与顾客供应需求之间的关系,对于以顾客为导向的质量管理能力,在分析质量管理体系、产品质量的基础上,本基金将重点考察企业对顾客需求的识别和满足程度,现有顾客对企业忠诚度以及企业开发新顾客的能力。对于品牌运营的分析,主要从企业与外部供应商等企业之间的信息共享程度,是否建立长期互惠互利的战略合作关系,企业是否积极参与外部供应商的质量管理和质量改进;对于销售管理能力的分析,不仅要考察企业在不同销售渠道的拓展,还要研究企业对于销售渠道的员工、服务和流程的管理。

企业在成长壮大的过程中,经常遇到两个重要问题,其一是如何适应和对环境变化问题,其二是技术瓶颈问题。这两个问题的有效解决,需要企业具备良好的学习与技术创新能力,在市场竞争日益激烈的知识经济时代,企业具备良好的学习机制,可以促进员工和企业通过不断学习提升员工和企业整体的知识水平,培养员工和企业持续创新能力,有助于解决企业在成长中不断出现的问题,成为不断前进的学习型组织。本基金对于企业学习与技术创新能力的分析,主要从学习机制、激励机制、员工教育培训、技术研发投入、技术研发激励机制和激励机制,研发投入特别是核心技术研发投入、研发成果及转化的速度和创新保护等方面进行评价。其中,本基金特别关注科技成果转化成果、技术研发投入强度,因为只有将技术成果应用于生产,并且产品推向市场,才能最终体现技术价值,才能体现企业的创新能力,因为如果新技术不能转化为产品,企业没有有效的市场应用,新技术的价值就会随着成本的增加,而成为企业的技术创新投入不断耗散。

C 经营稳健性选择

本基金认为一个经营稳健的企业应包括以下三个方面因素:健全有效的内部控制,这是经营稳健的基础;稳健合理的财务选择,这是经营稳健的保障;协调和成长,这是经营稳健的表现。

A 内部控制健全有效性分析

企业建立并实施行之有效的内部控制,是企业长期成长发展的重要基础。本基金将从企业的内控文化和氛围、内部控制制度机制、内控的组织机构、外部审计报告,是否发生违法违规、舆论报道等方面分析企业内控的健全有效性。

④ 财务稳健性选择分析

财务稳健性是企业长期良好成长性的必然要求。本基金重点分析企业资本结构的合理性,关注资本成本在企业发展中是否合理,以及是否合理承担债务资本比例增加股东权益,分析企业负债结构,研究是否按照合理比例调整资本安排中,中长期负债,特别关注企业对于短期负债比重的控制,是否会发生还债期集中于集中和还债高峰出现等。

C 成长协调和理性性分析

本基金主要从以下几个方面开展企业成长协调和谐性分析:其一,分析企业成长和外部环境以及公司

资源、发展阶段协调性,即分析企业的业务范围、扩张步伐是否和外部环境、公司资源、发展阶段相适应,是否存在不协调的地方而片面追求企业成长速度的盲目扩张现象;其二,分析企业在资产增加、销售额提高、人员增加、盈利扩大等方面“量”的扩张和“质”的扩张和“量”的扩张和“质”的扩张和“量”的扩张和“质”的扩张的协调性,是否根据行业和企业特点,有计划稳妥的处理好“量”的扩张与“质”的协调和和谐成长问题;其三,分析企业的投资额和净利润的协调性,两者是否同步增长或者“量”的扩张与“质”的协调和和谐成长问题;其四,分析企业的投资额和净利润的协调性,两者是否同步增长或者“量”的扩张与“质”的协调和和谐成长问题;其五,分析企业的投资额和净利润的协调性,两者是否同步增长或者“量”的扩张与“质”的协调和和谐成长问题。

2) 估值水平合理性的选择

本基金对于经过上述逻辑筛选出来的企业,进一步考量企业的估值水平和流动性,以构建投资组合。本基金将根据企业的行业特性和自身特征,从绝对价值和相对价值方法的角度开展分析,选择适用于该企业的估值方法,并通过对行业内、全市场内、国际间等发展阶段行业等范围内进行估值水平比较,筛选出具有足够安全边际的企业;此外,本基金还将从组合投资流动性策略的角度出发,结合企业价值的判断,对于企业的市场规模和市场交易情况进行分析,筛选出具有流动性活跃的企业。

3. 债券投资策略

本基金的债券投资策略主要包括债券投资组合策略和个券选择策略。

1) 久期策略

本基金的久期策略主要根据宏观经济形势、利率变动趋势进行判断,在充分保证流动性的前提下,确定债券组合久期以及可以调整的范围。

2) 收益曲线策略

收益曲线形状的变化将直接影响本基金投资组合的收益情况。本基金将根据宏观、货币政策等因素综合判断,对收益曲线变化进行预测,在确保债券流动性的前提下,适时采用子弹、杠铃或梯形策略构造组合。

② 个券选择策略

在个券选择上,本基金重点考虑个券的流动性,包括是否可以进行质押融资等因素,还将根据对未来利率走势的判断,综合运用收益率曲线估值、信用风险溢价等方法来评价个券的投资价值。此外,对于可转换债券等内嵌期权的债券,还将通过运用金融工程的方法对期权价值进行判断,最终确定其投资策略。

本基金将重点关注具有以下一项或者多项特征的债券:

1) 信用评级高、流动性好;

2) 资信优良良好,未来信用评级趋于稳定或有较大改善的企业发行的债券;

3) 信用评级和信用评级等因素基本一致的前提下,运用收益率曲线模型或其他相关估值模型进行估值后,市场交易价格相对低估;

4) 公司基本面良好,具备良好的成长空间与潜力,转股溢价率合理,有一定下行保护的可转债。

4) 其他金融工具的投资策略

本基金的权益类投资以保本基金为主要投资策略,以充分捕捉权益类资产的投资机会,实现保值和增值收益的目的。本基金在权益投资中以对应的标的证券的基本面分析,结合权证定价模型、市场供求关系、交易难易程度等多种因素对权证进行定价,利用权证衍生工具的特性,通过权证与证券的组合投资,来达到改善组合风险收益特征的目的,包括但不限于杠杆交易策略、看跌保护组合策略、保护组合成本策略、获利保护策略、买入跨式投资策略等。

对于金融衍生品工具投资的其他金融工具,本基金将在谨慎分析权益性、风险水平、流动性和金融工具自身特征的基础上进行稳健投资,以降低组合风险,实现基金资产的保值增值。

4. 投资管理程序

本基金采用投资决策委员会领导下的基金基金经理负责制。本基金的投资管理程序如下:

1. 研究员提供研究报告,以研究驱动投资

本基金严格执行研究支持投资决策机制,加强对投资决策的支持工作,防止投资决策的随意性。研究员在熟悉基金投资目标和投资策略的基础上,对其分工的行业和上市公司进行综合研究、深度分析,广泛参与和利用外部研究成果,参与政府机构、行业协会等,了解国家宏观经济政策及行业发展状况,调查上市公司和相关的供应商、终端销售商,考察上市公司真实经营状况,并向投资决策委员会和基金经理定期或不定期提供宏观经济分析报告、证券市场中期报告、行业分析报告和上市公司及发债主体研究报告等。

2. 投资决策委员会会议并决定基金投资重大事宜

投资决策委员会将定期或不定期提供研究报告,在充分讨论宏观经济、股票和债券市场的基础上,根据基金合同规定的投资目标、投资范围和策略,依据基金管理人投资管理制度,确定基金的总体投资策略计划,包括基金在股票、债券及现金等资产上的投资比例等重大事项。

3. 基金经理构建具体的投资组合

基金经理根据投资决策委员会的资产配置比例要求,参考研究部门的研究报告,根据基金合同,依据专业经验进行分析和判断,在投资范围内构建具体的投资组合,并进行组合的日常管理。

4. 交易部独立执行投资交易指令

基金经理人设置独立的交易岗,由基金经理根据投资方案的要求和授权以及市场的运行特点,作出投资操作的相关决策,再向交易员发出投资指令。交易员根据基金经理的投资指令后,根据有关规定对投资指令的合规性、合理性及有效性进行检查,确保投资指令在合法、合规的前提下得到高效的执行,对交易情况及及时反馈,对交易情况进行监督;如果市场和个股出现异常情况,及时提示基金经理。

5. 基金绩效评估

基金经理对投资管理策略进行评估,出具自评估报告。金融工程小组就投资管理进行持续评估,定期提供评估报告,如发现现有的投资分析和投资策略与市场情况有较大的偏差,立即向基金经理和投资决策委员会报告。投资决策委员会将根据基金经理和金融工程小组的评估报告,对于基金业绩进行评估。基金经理根据投资决策委员会的意见对投资策略和基金投资组合进行调整。

6. 基金风险控制

监察稽核部对投资计划的执行过程进行日常监督和实时风险控制,包括投资组合中、投资组合比例、投资限制、投资授权等事项。风险控制委员会会根据市场变化对基金投资组合进行风险评估,并提出风险防范措施。

7. 投资管理中的关联交易

基金经理人在保证基金份额持有人利益的前提下,将根据投资需要和外部环境,对投资管理职责分工和程序进行调整,并在年报招募说明书中予以公告。

十一、业绩比较基准

业绩比较基准=沪深300指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%

基于沪深300指数和上证国债指数具有覆盖面广、编制合理、透明度高、运用广泛、市场代表性强的特点,本基金采用沪深300指数和上证国债指数加权组成的复合指数作为本基金业绩比较基准,能够真实反映本基金投资组合的投资特征,同时该复合指数与本基金的投资策略相一致。

在本基金的投资过程中,如果发生法律法规变化,或者指数编制单位停止计算编制有关指数,或者出现有代表性、权威、更为市场普遍接受的业绩比较基准,则本基金管理人履行适当程序后,可以对业绩比较基准进行变更。

十二、风险收益特征

本基金属于主动投资的股票型证券投资基金,通常预期风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金,属于证券投资基金中的较高风险收益基金。

十三、基金投资组合报告

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。

基金管理人中银国际证券股份有限公司根据本基金合同规定复核了本报告投资组合内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证基金份额持有人资产不受损失,如果出现法律允许范围内的基金资产价值下降,基金管理人不承担赔偿责任。

基金过往业绩并不代表其未来表现,投资者有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本投资组合报告截至时间为2012年3月31日,本投资组合所列数据未经审计。

证券代码:600885 证券简称:ST力阳 公告编号:临2012-021

武汉力诺太阳能集团股份有限公司诉讼公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

一、本次重大诉讼事项受理的基本情况

今日公司收到河南省濮阳市中级人民法院传票(012)传字第4号、(012)传字第5号、(012)传字第6号、三份传票案由:民间借贷,开庭时间:2012年9月20日,根据《证券法》以及相关的法律法规的规定,将有关情况公告如下:

二、有关诉讼的基本情况

(一)原告:濮阳市新鑫隆投资有限公司(以下简称:本公司)

被告:武汉力诺太阳能集团股份有限公司(以下简称:本公司)

被告:武汉力诺太阳能集团股份有限公司中原公司(本公司分公司,以下简称:中原公司)

被告:力诺集团股份有限公司(以下简称:力诺集团)

诉讼请求:

1、判令三被告支付原告借款本金、利息、违约金共计9,848,451元。

2、判令被告承担本案的诉讼费用。

事实与理由:被告中原公司自2011年5月开始多次从原告处借款,被告中原公司于2011年12月29日与原告签订了还款协议,被告力诺集团为该还款协议连带责任人,2012年2月15日借款到期,被告中原公司未能按照该还款协议履行还款义务,被告中原公司应严格按照约定支付剩余本金、利息及违约金,被告本公司应当对中原公司的债务承担责任。被告力诺集团作为被告中原公司借款的保证人,应对上述债务承担保证责任。

(二)原告:彭青格

被告:武汉力诺太阳能集团股份有限公司(以下简称:本公司)

被告:武汉力诺太阳能集团股份有限公司中原公司(本公司分公司,以下简称:中原公司)

被告:力诺集团股份有限公司(以下简称:力诺集团)

诉讼请求:

1、判令三被告支付原告借款本金、利息、违约金共计2,835,393元。

2、判令被告力诺集团对上述债务承担保证责任。

3、诉讼费用由被告承担。

事实与理由:被告中原公司自2011年9月开始多次从原告处借款,被告中原公司于2011年12月29日与原告签订了还款协议,被告力诺集团为该还款协议连带责任保证人,2012年2月15日

证券代码:000546 证券简称:光华控股 公告编号:2012-17号

吉林光华控股集团股份有限公司关于公司总经理辞职公告

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。

2012年8月8日,吉林光华控股集团股份有限公司(以下简称“公司”)董事会收到总经理蔡建新女士的《辞职报告》,因年龄原因,蔡建新女士向董事会请求辞去总经理职务,辞职后不在公司担任任何职务。《辞职报告》自2012年8月8日送达公司董事会时生效,公司及董事会衷心感谢蔡建新女士在任职期间为公司所做出的贡献。

特此公告。

吉林光华控股集团股份有限公司
董 事 会
2012年8月9日

证券代码:002535 证券简称:林州重机 公告编号:2012-0038

林州重机集团股份有限公司关于控股子公司完成工商设立登记的公告

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

2011年12月28日,林州重机集团股份有限公司与宁波长盛海动力科技有限公司、鄂尔多斯林州重机制造有限公司在河南省林州市签署了《合作协议》(详见公司于2011年12月29日登载于指定信息披露媒体《证券时报》、《证券日报》、《中国证券报》和巨潮资讯网 <http://www.cninfo.com.cn>)上的《林州重机集团股份有限公司关于签署设立公司的公告》(公告编号:2011-0083),协议约定三方在鄂尔多斯市设立新公司,从事液压支架用以及电液控制系统的研发、制造、销售、维修和服务为一体的生产经营业务。

2012年8月6日,合资公司完成了工商设立登记,取得了宁夏回族自治区工商行政管理局颁发的《企业法人营业执照》(注册号:150627000028504),营业执照上载明的具体内容:

名称:鄂尔多斯市琅赛科技有限公司
住所:伊旗阿镇现代装备制造基地
法定代表人:郭生书
注册资本:人民币叁仟柒佰万元

实收资本:人民币壹仟壹佰叁拾万元
公司类型:有限责任公司
经营范围:许可经营项目:无
一般经营项目:从事液压支架用及电液控制系统的研发、制造、销售、维修及服务。法律、行政法规、国务院决定规定应经许可的,未获许可不得生产经营)
成立日期:2012年8月6日
营业期限:2012年8月6日至2022年8月6日
发起机构:伊金霍洛旗工商行政管理局
核准日期:2012年8月6日
特此公告。

林州重机集团股份有限公司
董 事 会
2012年8月10日

证券代码:000546 证券简称:光华控股 公告编号:2012-18号

吉林光华控股集团股份有限公司重大诉讼进展公告

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。

近日,吉林光华控股集团股份有限公司(以下简称“公司”)收到广东省珠海市中级人民法院(以下简称“珠海中院”)0202珠中法执字第208-2号《限期履行通知书》,珠海中院判令公司在收到《限期履行通知书》之日起五日内将欠款人民币2100万元汇入珠海中院执行账户,逾期不履行的,珠海中院将依法处置公司持有的已冻结的航空动力(证券代码:600893)股票1,494,860股,所得款项用于案件执行。

2010年,珠海中院依据《001 判决书》(民事判决书)申请执行人在中国信达资产管理公司广州办事处(以下简称“信广办事处”)的申请,恢复执行信广办事处申请执行公司及珠海白云不锈钢制品有限公司、赵志杰借款合同纠纷案,详见公司于2010年3月20日刊登在《中国证券报》、《证券时报》和巨潮资讯网 <http://www.cninfo.com.cn>上的《吉林光华控股集团股份有限公司诉讼公告》。

公司将持续关注上述诉讼事项,并履行持续信息披露义务。

特此公告。

吉林光华控股集团股份有限公司
董 事 会
2012年8月9日

证券代码:600555 股票简称:九龙山 公告编号:2012-28

上海九龙山股份有限公司关于股东持有股票部分解除质押的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

上海九龙山股份有限公司(以下简称“公司”或“九龙山”)于2012年8月8日接公司股东大会新大新华实业有限公司(以下简称“新大新华实业”)通知:

新大新华实业于2012年8月2日将其所质押给浙商银行股份有限公司上海分行的无限售条件的部分流通A股5217万股(占本公司总股本的4% 股票解除了质押,并在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司办理了解除质押手续。

截止本公告出具日,新大新华实业所持本公司的所有股份皆已解除质押。

特此公告。

上海九龙山股份有限公司
董 事 会
2012年8月10日

证券代码:600555 股票简称:九龙山 公告编号:临2012-29

上海九龙山股份有限公司关于收到股东海航置业控股(集团)有限公司澄清说明的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

上海九龙山股份有限公司(以下简称“公司”、“本公司”或“九龙山”)于2012年8月4日在《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》和上海证券交易所网站同时披露了《上海九龙山股份有限公司第五届监事会第5次会议决议公告》【详见2012年8月4日公司临:2012-26号】公告】

2012年8月8日,本公司收到海航置业控股(集团)有限公司(以下简称“海航置业”)《关于海航置业持有股份的公告》(公告编号:2012-19)

重庆涪陵电力实业股份有限公司关于2012年第一次临时股东大会临时提案的公告

特别提示

本公司定于2012年8月22日召开公司2012年第一次临时股东大会,有关会议事项通知已于2012年7月27日在上海证券交易所网站、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》及《上海证券报》进行了公告。日前,公司收到控股股东重庆川东电力集团有限责任公司(持有本公司股份8,263万股股份,占本公司总股本的51.64%)《关于增加2012年第一次临时股东大会提案的函》,根据中国证监会清理证券“一参一控”相关要求以及公司压缩股权级次的需要,公司拟对所持东海证券的股权进行评估后挂牌转让处理。该事项已于2012年3月30日公司第四届二十次董事会审议通过(详见www.sse.com.cn 600452公告编号2012-10),公司在第四届二十次董事会审议通过后,聘请了中同华资产评估有限公司,以2011年12月31日为评估基准日,对灤州公司所持东海证券1,4371.0 0400万股 股权进行了评估,而现在评估已经完成,评估结果为每元注册资本单价6.10元,川东电力集团有限责任公司认为公司有必要将《关于转让所持东海证券有限责任公司的议案》提交公司2012年第一次临时股东大会审议,根据《公司法》、《公司章程》及相关规定,经董事会研究,同意将该临时提案提交公司2012年第一次临时股东大会审议。

根据以上增加临时提案的情况,公司对2012年7月27日发布的《重庆涪陵电力关于第四届二十次董事会决议的公告暨召开2012年第一次临时股东大会的通知》进行了补充,现将2012年第一次临时股东大会大会通知公告如下:

根据《公司法》、《公司章程》和《公司章程》的有关规定,拟定于2012年8月22日召开公司2012年第一次临时股东大会,会议内容如下:

1.时间安排

会议召开时间:2012年8月22日(星期三)上午10:00时;

股权登记日:2012年8月15日(星期二)

参会登记日:2012年8月20-21日

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	103,012,936.78	73.89
	其中:股票	103,012,936.78	73.89
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	买入返售金融资产	-	-
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	35,629,742.88	25.56
6	其他资产	766,064.37	0.55
7	合计	139,408,744.03	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	-	-
B	采矿业	7,204,100.00	5.21
C	制造业	64,570,711.52	46.70
CD	食品饮料	8,668,886.00	6.27
C1	纺织服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	1,445,310.00	1.05
C4	石油、化学、塑胶、塑料	1,419,304.00	1.03
C5	电子	14,566,263.00	10.54
C6	金属、非金属	5,141,055.00	3.72
C7	机械、设备、仪表	23,449,213.52	16.96
C8	医药、生物制品	9,880,600.00	7.15
C9	其他制造业	-	-
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	1,184,000.00	0.86
G	信息技术业	2,853,861.29	2.06
H	批发和零售业	2,981,269.00	2.16
I	金融、保险业	6,280,892.00	4.54
J	房地产业	8,731,200.64	6.32
K	社会服务业	4,908,896.88	3.55
L	文化传播与文化产业	4,298,005.45	3.11
M	综合类	-	-
N	合计	103,012,936.78	74.51

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	600072	沱牌舍得	212,800	5,732,832.00	4.15
2	002429	兆驰光电	503,400	5,215,224.00	3.77
3	002004	华邦制药	118,300	4,220,944.00	3.05
4	000651	格力电器	199,640	4,057,949.32	2.94
5	300062	能龙信息	424,495	3,973,273.20	2.87
6	002285	置业地产	298,176	3,694,400.64	2.67
7	601318	中国平安	97,400	3,464,760.00	2.58
8	600111	包钢稀土	51,000	3,404,760.00	2.46
9	600104	上汽集团	220,000	3,262,600.00	2.36
10	600741	华			