证券代码:000507 证券简称:珠海港 公告编号:2012-084

珠海港股份有限公司限售股份解除限售提示性公告

本公司及董事局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。

特别提示

1、本次限售股份实际可上市流通数量为53,775,074股,占公司总股本的8.66%。

2、本次限售股份可上市流通日期为2012年12月26日。

一、股权分置改革方案概述

1、股权分置改革对价方案概述

公司股权分置改革采用重大资产重组与送股相结合的方案:(1)资产重组对价:通过注入其他优质资产、解决大股东欠款,以降低未来公司的经营风险,提高公司持续发展的能力,并将资产重组所带来的盈利能力的提升作为对价安排的重要内容;(2)除上述重大资产置换外,公司非流通股股东还向股权分置改革方案实施登记日收市时在登记公司登记在册的公司流通股股东支付39,111,604股股份,相当于流通股股东每10股获付2股。

2、通过股权分置改革方案的股东大会日期、届次

2006年11月27日,股权分置改革方案经公司2006年第二次临时股东大会暨股权分置改革相关股东会议审议通过。

3、股权分置改革方案实施日期

2006年12月25日。

二、本次可上市流通限售股份持有人做出的各项承诺及履行情况

限售股份持有人名称	承诺及追加承诺内容	承诺及追加承诺的履行情况
珠海港控股集团有限公司	2006年12月25日,公司股权分置改革实施日,珠海港集团并不持有公司股份,无承诺情况。 2010年5月31日,公司原第一大股东珠海市国有资产监督管理委员会(以下简称"珠海国资委")将所持公司56,568,194股股份无偿划转给珠海港集团持有,珠海港集团承诺:严格履行珠海国资委在公司股权分置改革时作出的尚未履行完结的承诺: 在公司股权分置改革实施后的5年内,通过二级市场卖出所持有公司股票的价格不低于近5年的最高交易价格9.97元。 无追加承诺情况。	已履行完毕

三、本次限售股份可上市流通安排

1、本次限售股份可上市流通日期为2012年12月26日。

2、本次限售股份实际可上市流通数量为53,775,074股,占公司总股本的8.66%。

3、本次限售股份可上市流通情况如下:

序号	限售股份持有人名称	持有限售股份数(股)	本次可上市流通股数(股)	本次可上市流通股数占限售股份总数的比例(%)	本次可上市流通股数占无限售股份总数的比例(%)	本次可上市流通股数占公司总股本的比例(%)	冻结的股份数量(股)
1	珠海港控股集团有限公司	53,775,074	53,775,074	71.58	9.85	8.66	0
	合 计	53,775,074	53,775,074	71.58	9.85	8.66	0

四、股本结构变化和股东持股变化情况

1、本次解除限售前后的股本结构如下:

股份类型	本次限售股份上市流通前		本次变动数	本次限售股份上市流通后	
	股数	比例		股数	比例
一、有限售条件的流通股					
1.国家持股	0	0		0	0
2.国有法人持股	53,775,074	8.66%	-53,775,074	0	0
3.境内一般法人持股	21,340,440	3.438%		21,340,440	3.438%
4.境内自然人持股					
5.境外法人持股					
6.境外自然人持股					
7.内部职工股					
8.高管股份	12,848	0.002%		12,848	0.002%
9.机构投资者配售股份					
有限售条件的流通股合计	75,128,362	12.10%		21,353,288	3.44%
二、无限售条件的流通股					
1.人民币普通股	545,866,994	87.90%	+53,775,074	599,642,068	96.56%
2.境内上市的外资股					
3.境外上市的外资股					
4.其他					
无限售条件的流通股合计	545,866,994	87.90%		599,642,068	96.56%
三、股份总数	620,995,356	100%		620,995,356	100%

五、股东持股变化情况及历次限售情况

1、本次解除限售股东自公司股改实施后至今持股变化情况:

2006年12月25日,公司股权分置改革实施日,珠海港控股集团有限公司并不持有公司股份,其现持有公司股份及此次申请解除限售股份的形成过程如下:

(一)2010年5月,公司收到国务院国有资产监督管理委员会国资产权(2010)354号《关于珠海经济特区富华集团股份有限公司国有股东所持股份划转有关问题的批复》,同意将珠海市人民政府国有资产监督管理委员会(以下简称"珠海国资委")持有的公司56,568,194股(占公司总股本的16.4%)股份无偿划转给珠海港集团持有。2010年6月上述股权划转过户手续完成,届时,公司总股本344,997,420股,珠海国资委不再直接持有公司股份,珠海港集团持有公司股份56,568,194股,占公司总股本的16.4%。

(二)2012年6月,公司收到国务院国有资产监督管理委员会国资产权(2012)295号《关于珠海港股份有限公司国有股东所持股份无偿划转有关问题的批复》,同意珠海市纺织工业集团公司(以下简称"纺织集团")持有公司的23,407,041股股份、及纺织集团下属全资子公司珠海市冠华轻纺有限公司(以下简称"冠华轻纺")持有公司的6,468,000股股份,合计29,875,041股股份(仍处于股改限售状态,占公司总股本的8.66%)无偿划转给珠海港集团持有。

2012年6月21日,上述股权划转过户手续完成,届时,公司总股本仍为344,997,420股,珠海港集团持有公司86,443,235股股份(其中56,568,194股为无限售流通股,29,875,041股为有限售流通股)。

(三)公司以2012年6月21日为股权登记日,实施2011年度利润分配方案,其中包括:以总股本344,997,420股为基数,资本公积金向全体股东每10股转增8股。2012年6月25日,上述分配方案实施完成,届时,公司总股本增至620,995,356股,珠海港集团持有公司的股份数变更为155,597,823(其中101,822,749股为无限售流通股,53,775,074股为有限售流通股)。

2、股改实施后至今公司解除限售情况:

序号	刊登《限售股份上市流通提示性公告》的日期	该次解限涉及的股东数量	该次解限的股份总数量(股)	该次解限股份占当时总股本的比例(%)
1	2007年12月26日	8	12,028,761	3.49%
2	2010年3月9日	1	56,568,194	16.4%

六、保荐机构核查意见书的结论性意见

珠海港相关股东严格履行了在股改中做出的承诺。珠海港董事局提出的本次有限售条件的流通股上市申请符合相关规定。

七、控股股东对解除限售股份的持有意图及减持计划

公司控股股东、实际控制人是否计划在解除限售后六个月以内通过本所竞价交易系统出售股份达到5%及以上。

□是 √否;

若是,应当披露:拟出售的数量;拟出售的时间;拟出售的价格区间;减持原因。本所要求的其他内容。

珠海港控股集团有限公司承诺:我公司若计划未来通过深圳证券交易所竞价交易系统出售所持上市公司解除限售流通股,并于第一笔减持起六个月内减持数量达到5%及以上的,我公司将于第一次减持前两个交易日内通过上市公司对外披露出售提示性公告。

八、其他事项?

1、本次申请限售股份上市流通的限售股份持有人是否存在对公司的非经营性资金占用情况

□是 √否;

若存在违规情况,应当说明违规的具体情况、改正计划和措施;

2、本次申请限售股份上市流通的限售股份持有人是否存在公司对该股东的违规担保情况

□是 √否;

若存在违规情况,应当说明违规的具体情况、改正计划和措施;

3、本次申请限售股份上市流通的限售股份持有人是否存在违规买卖公司股票的行为;

□是 √否;

若存在违规行为,应当说明违规的具体情况、改正计划和措施;

4、解除股份限售的持股1%以上的股东已提交知悉并严格遵守《证券法》、《上市公司收购管理办法》、《上市公司解除限售存量股份转让指导意见》和本所有关业务规则的承诺文件

√是 □不适用;

九、备查文件

1、解除股份限售申请表

2、保荐机构核查意见书

珠海港股份有限公司董事局

2012年12月25日

股票代码:002672 股票简称:东江环保 公告编号:2012-54

东江环保股份有限公司第四届董事会第三十八次会议决议公告

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

一、董事会会议召开情况

东江环保股份有限公司(以下简称"本公司")第四届董事会第三十八次会议于2012年12月21日以现场会议方式在广东省深圳市南山区高新区北区朗山路9号东江环保大楼召开。会议通知于2012年12月18日以电子邮件方式送达。会议应到董事9名,实到董事9名。会议召开符合《公司法》及《公司章程》的规定。会议由董事长张维仰先生召集并主持,本公司高级管理人员列席会议。

二、董事会会议审议情况

《关于与华瑞东江微营养添加剂(深圳)有限公司签订销售合同的议案》

同意本公司与本公司参股公司华瑞东江微营养添加剂(深圳)有限公司(以下简称"深圳微营养")签订《销售合同》,由本公司及其控股子公司向深圳微营养销售碱式氯化铜,交易总金额不超过人民币4700万元(不含税)。

同意8票,弃权0票,反对0票。

关联董事张维仰先生回避表决,其余非关联董事一致同意。

上述内容详见本公司于巨潮资讯网(www.cninfo.com.cn)披露的公告《关于与华瑞东江微营养添加剂(深圳)有限公司的关联交易公告》(公告号:2012-55)。

本公司独立董事、保荐机构对本议案发表了核查意见,详见巨潮资讯网(www.cninfo.com.cn)。

三、备查文件

本公司第四届董事会第三十八次会议决议。

特此公告。

东江环保股份有限公司

董事会

2012年12月24日

证券代码:002672 证券简称:东江环保 公告编号:2012-55

东江环保股份有限公司关于与华瑞东江微营养添加剂(深圳)有限公司的关联交易公告

本公司及其全体董事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、关联交易概述

(一)东江环保股份有限公司(以下简称"本公司")于2012年12月21日与本公司参股公司华瑞东江微营养添加剂(深圳)有限公司(以下简称"深圳微营养")签订《销售合同》,根据合同约定,本公司及其控股子公司将向深圳微营养销售碱式氯化铜。

(二)深圳微营养系本公司持有其38%股权的参股子公司,本公司的董事张维仰先生、副总裁兰永辉先生在深圳微营养担任董事职务,按照深交所《股票上市规则》(2012年修订版)第10.1.3条(三)条的规定情形,深圳微营养系本公司的关联法人,本次交易构成了本公司的关联交易。

(三)本公司第四届董事会第三十八次会议对本次关联交易进行了审议,全体董事出席会议,关联董事张维仰先生依法回避表决,其表决结果8票同意、0票反对、0票弃权,该项议案获得通过。本次交易事前得到公司独立董事认可,并就事前认可和本次关联交易发表了意见。

(四)本次关联交易金额未达到本公司最近一期经审计净资产5%,根据《深圳证券交易所股票上市规则》和《公司章程》的规定,本次关联交易不需提交公司股东大会审议批准。

(五)本次关联交易不构成《上市公司重大资产重组管理办法》规定的重大资产重组,不需要股东大会审议批准。

二、关联方基本情况

公司名称:华瑞东江微营养添加剂(深圳)有限公司

注册地:深圳市南山区朗山路9号东江环保大楼东802室

注册资本:人民币200.00万元

企业性质:有限责任公司(台港澳与境内合资)

经营范围:饲料添加剂新技术的研发;提供饲料领域的技术服务和技术咨询;从事饲料、饲料添加剂、化工原料、化工产品(不含危险品)的批发、进出口。

股东:HERITAGE TECHNOLOGIES ASIA LIMITED(持有其62%股权);东江环保股份有限公司(持有其38%股权)

深圳微营养2011年经审计营业收入为99,572,056.03元,净利润为162,123.66元,净资产2,358,563.68元。

与公司的关系:为本公司持有其38%股权的参股公司

三、关联交易标的基本情况:

(一)按照本次交易的协议,本公司及其控股子公司向深圳微营养销售资源化产品碱式氯化铜,交易总金额不超过人民币47,000,000.00(不含税)元。

(二)按照有关法律、行政法规、部门规章、规范性文件以及深交所《股票上市规则》的规定,本次交易不需审计与评估。

(三)本次交易不涉及债权债务转移。

四、关联交易的定价政策及定价依据

交易双方按照公平、公正、合理的原则,参照同行业市场价格定价。本次交易标的的价格与市场均价基本相当,价格公允。

五、交易协议的主要内容

(一)合同甲方(供方)为东江环保股份有限公司(包括其控股子公司),乙方(需方)为华瑞东江微营养添加剂(深圳)有限公司;

(二)交易总金额不超过人民币47,000,000.00(不含税)元,具体金额以双方确认的实际销售结算金额为准。

(三)交易定价政策及定价依据:当月价格参照上月上海金属铜现货均价和上月网上饲料级硫酸铜均价,由双方协商拟定。

(四)支付方式:国内收货,乙方收到货后35天内将货款付给甲方;国外收货,乙方收到货后60天内将货款付给甲方。

六、关联交易对公司的影响

本次签订的销售合同属于本公司日常经营业务,以公开、公平、公正、公允为原则,不存在损害本公司及广大股东利益的情况。对本公司本期以及未来财务状况、经营成果无负面影响,本次关联交易亦不影响本公司的独立性。

七、今年年初至披露日与该关联人累计已发生的各类关联交易的总金额

本公司及其控股子公司自2012年1月1日至2012年11月31日止与深圳微营养累计已发生的此类关联交易的总金额为约109,407,420.00元(不含税)。该交易事项已经本公司于2009年12月7日召开的股东大会批准(详情可参阅本公司于2009年10月20日在香港联合交易所网站刊发的通函及2009年12月7日刊发的股东大会投票结果公告)。

八、备查文件

1、本公司第四届董事会第三十八次会议决议

2、关于与华瑞东江微营养添加剂(深圳)有限公司的关联交易出具的独立董事意见。

特此公告。

东江环保股份有限公司

董事会

2012年12月24日

证券代码:002371 证券简称:七星电子 公告编号:2012-032

北京七星华创电子股份有限公司关于收到国家科技重大专项部分资金的公告

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

公司目前承担着国家科技重大专项《极大规模集成电路制造装备及成套工艺》(即"02专项")--"300mm 90/65nm立式氧化炉/质量流量控制器研发及产业化"项目、"65nm超精细清洗设备研制与产业化"项目及"45-32nm LPCVD设备产业化"项目。其中,"300mm 90/65nm立式氧化炉/质量流量控制器研发及产业化"项目的立项审批情况已在公司首次公开发行股票招股说明书"第五节 业务和技术,九、发行人的研发情况,(二)产品技术开发情况"及"第十一节 业务发展目标,一、发行人当年及未来两年的发展计划,(二)技术与产品开发计划"中进行了披露;"65nm超精细清洗设备研制与产业化"项目立项审批情况已于2010年3月26日披露于公司指定信息披露媒体《中国证券报》、《证券时报》及巨潮资讯网(www.cninfo.com.cn)上的《关于本公司承担国家科技重大专项的公告》;"45-32nm LPCVD设备产业化"项目立项审批情况已于2011年5月12日披露于公司指定信息披露媒体《中国证券报》、《证券时报》及巨潮资讯网(www.cninfo.com.cn)上的《关于本公司承担国家科技重大专项的公告》。

2012年12月24日,公司收到北京市经济和信息化委员会通过北京电子控股有限责任公司拨付的国家科技重大专项地方财政配套资金共5,341.00万元,其中,"300mm 90/65nm立式氧化炉/质量流量控制器研发及产业化"项目地方财政配套资金2,077.00万元,"65nm超精细清洗设备研制与产业化"项目地方财政配套资金2,101.00万元,"45-32nm LPCVD设备产业化"项目地方财政配套资金1,163.00万元。在项目研发周期内,该部分与资产相关的政府补助确认为递延收益,自长期资产可供使用时起,按照长期资产的预计使用期限,将递延收益平均分摊转入当期损益,对2012年的净利润无影响。

上述公司承担的国家科技重大专项研发项目按计划进展顺利,将进一步强化核心技术,提高公司核心竞争能力。

特此公告。

北京七星华创电子股份有限公司

董事会

2012年12月24日

证券代码:002013 证券简称:中航精机 公告编号:2012-044

湖北中航精机科技股份有限公司对外投资进展公告

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。

一、对外投资的基本情况

湖北中航精机科技股份有限公司(以下简称"公司")2012年第四次临时股东大会审议通过了《关于对全资子公司增资的议案》。同意公司以自有资金5000万元对全资子公司武汉中航精冲技术有限公司进行增资。增资完成后武汉中航精冲技术有限公司的注册资本由78,408,843元变更为128,408,843元,公司持有武汉精冲100%股权不变。

详细内容见2012年11月16日及2012年10月30日公司指定信息披露媒体《证券时报》和信息披露网站巨潮资讯网(www.cninfo.com.cn)。

二、对外投资进展情况

武汉中航精冲技术有限公司已于近日获得武汉市工商行政管理局颁发的《企业法人营业执照》,内容如下:

注册号:420100400000703

名 称:武汉中航精冲技术有限公司

住 所:武汉经济技术开发区枫树五路8号

法定代表人姓名:雷自力

注册资本:128,408,843元

公司类型:有限责任公司(法人独资)

经营范围:汽车零部件及配件研发、制造与批零兼营;相关精冲件产品及零件的研发、制造与批零兼营;经营本企业的自产产品及技术出口业务;经营本企业生产所需的原材料、仪器仪表、机械设备、零配件及技术的进口业务。(涉及许可证的凭许可证方可经营)

成立日期:2007年08月08日

营业期限:2007年08月08日日至2037年08月07日

三、备查文件

武汉中航精冲技术有限公司《企业法人营业执照》。

特此公告。

湖北中航精机科技股份有限公司董事会

2012年12月24日

浙商沪深300指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的提示性公告

根据《浙商沪深300指数分级证券投资基金基金合同》(简称"基金合同")及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定,浙商沪深300指数分级证券投资基金(简称"本基金")将在2013年1月4日办理定期份额折算业务。相关事项提示如下:

一、基金份额折算基准日

根据基金合同的规定,定期份额折算基准日为每个会计年度第一个工作日。本次定期份额折算的基准日为2013年1月4日。

二、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的浙商稳健份额、浙商沪深300份额。浙商进取份额不参与定期折算,除非定期折算时同时满足不定期折算的条件。

三、基金份额折算方式

浙商稳健份额和浙商进取份额按照基金合同中规定的净值计算规则进行净值计算,对浙商稳健份额的约定应得收益进行定期份额折算,每2份浙商沪深300份额将按1份浙商稳健份额获得约定应得收益的新增折算份额。

在基金份额折算前与折算后,浙商稳健份额和浙商进取份额的份额配比保持1:1的比例。

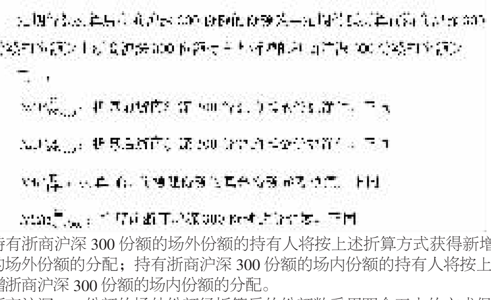
对于浙商稳健份额期末的约定收益,即浙商稳健份额每个会计年度12月31日份额参考净值超出1.000元部分,将折算为场内浙商沪深300份额分配给浙商稳健份额持有人。浙商沪深300份额持有人持有的每2份浙商沪深300份额将按1份浙商稳健份额获得新增浙商沪深300份额的分配。持有场外浙商沪深300份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外浙商沪深300份额的分配;持有场内浙商沪深300份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内浙商沪深300份额的分配。

经过上述份额折算,浙商稳健份额的基金份额参考净值和浙商沪深300份额的基金份额净值将相应调整。

每个会计年度第一个工作日为基金份额折算日,本基金将对浙商稳健份额和浙商沪深300份额进行已实现的约定收益的定期份额折算。

每个会计年度第一个工作日进行浙商稳健份额上一年度应得收益的定期份额折算时,有关计算公式如下:

1、浙商沪深300份额折算



持有浙商沪深300份额的场外份额的持有人将按上述折算方式获得新增浙商沪深300份额的场外份额的分配;持有浙商沪深300份额的场内份额的持有人将按上述折算方式获得新增浙商沪深300份额的场内份额的分配。

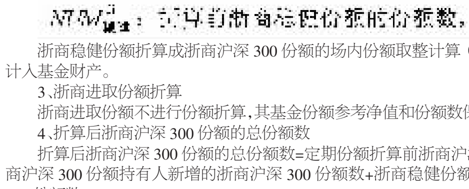
浙商沪深300份额的场外份额经折算后的份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后两位,由此产生的误差计入基金财产;浙商沪深300份额的场内份额经折算后的份额数取整计算(最小单位为1份),余额计入基金财产。

2、浙商稳健份额折算

定期份额折算后浙商稳健份额的基金份额参考净值=1.000元

定期份额折算后浙商稳健份额的份额数=定期份额折算前浙商稳健份额的份额数

浙商稳健份额持有人新增的浙商沪深300份额数=



浙商稳健份额折算成浙商沪深300份额的场内份额取整计算(最小单位为1份),余额计入基金财产。

3、浙商进取份额折算

浙商进取份额不进行份额折算,其基金份额参考净值和份额数保持不变。

4、折算后浙商沪深300份额的总份额数

折算后浙商沪深300份额的总份额数=定期份额折算前浙商沪深300份额的份额数+浙商沪深300份额持有人新增的浙商沪深300份额数+浙商稳健份额持有人新增的浙商沪深300份额数。

四、基金份额折算期间的业务办理

(一)定期份额折算基准日(即2013年1月4日),本基金暂停办理申购、赎回、系统内转托管和跨系统转登记、份额配对转换业务,浙商稳健份额、浙商进取份额正常交易。当日晚间,基金管理人计算当日基金份额净值及份额折算比例。

(二)定期份额折算基准日后的第一个工作日(即2013年1月7日),本基金暂停办理申购、赎回、系统内转托管和跨系统转登记、份额配对转换业务,浙商稳健份额暂停交易,浙商进取份额正常交易。当日,基金注册登记机构及基金管理人为份额持有人办理份额登记确认。

(三)定期份额折算基准日后的第二个工作日(即2013年1月8日),基金管理人将公告份额折算确认结果,份额持有人可以查询其账户内的基金份额。当日,本基金恢复办理申购、赎回、系统内转托管和跨系统转登记、份额配对转换业务,浙商稳健份额恢复交易,浙商进取份额正常交易。

(四)根据深圳证券交易所《关于分级基金份额折算后次日前收盘价调整的通知》,2013年1月8日浙商稳健复牌首日即时行情显示的前收盘价为2013年1月7日的浙商稳健份额的份额净值(四舍五入至0.001元)。由于浙商稳健份额折算前可能存在折溢价交易情形,折算前的收盘价扣除2012年约定收益后与2012年1月8日的前收盘价可能有较大差异,2012年1月8日当日可能出现交易价格大幅波动的情形。

五、重要提示

由于浙商稳健份额新增份额折算成浙商沪深300份额的场内份额数和浙商沪深300份额的场内份额经折算后的份额数取整计算(最小单位为1份),舍去部分计入基金财产,持有较少浙商稳健份额数或场内浙商沪深300份额数的份额持有人存在无法获得新增场内浙商沪深300份额的可能性。

投资人若希望了解基金定期份额折算业务详情,请登陆本公司网站:http://www.zsfund.com或拨打本公司客服电话:400-067-9908(免长途话费),021-60359000。

本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。投资者投资于基金前应认真阅读基金的基金合同、招募说明书等文件。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

浙商基金管理有限公司

2012年12月25日

(上接D35版)

七、基金的投资目标

以价值增长类股票为主构造投资组合,在有效分散投资风险的基础上,通过资产配置和投资组合的动态调整,达到超过市场的风险收益比之目标,实现基金资产的长期稳定增值。

八、基金的投资方向

本基金的投资范围限于国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具,主要投资对象为深、沪两市A股票中P/B值低、具有良好增长潜力的上市公司。

九、基金的投资策略

本基金投资策略分三个层次:资产配置和行业配置遵循自上而下的积极策略,个股选择遵循自下而上的积极策略。本基金的国债投资比例将不低于20%,股票投资部分重点关注:低P/B值、具有可持续增长潜力、盈利水平超过行业平均水平、具有核心竞争力的优势企业。

1.决策依据

本基金管理人将主要依据下述因素决定基金资产配置和具体证券的买卖:

(1)国家有关法律、法规和基金合同的有关规定;

(2)国家宏观经济环境及其对证券市场的影响;

(3)国家货币政策、产业政策以及证券市场政策;

(4)各行业、地区发展状况;

(5)上市公司财务状况、行业处境、经济和市场需求状况及其当前市场价格;

(6)证券市场资金供求状况及未来走势。

2.投资流程

(1)金融工程部和股票投资部分别提出市场策略研究报告和宏观经济、行业、上市公司分析报告

基金分析师和研究员在广泛参考和利用公司外部的研究成果,尤其是研究实力雄厚的证券经营机构提供的研究报告,并经常走访上市公司,拜访国家有关部委,了解国家宏观经济政策及行业发展状况的基础上,经过筛选、归纳和整理,定期或不定期地撰写市场策略研究报告和宏观经济分析报告、行业分析报告、上市公司分析报告。

金融工程部和股票投资部向投资决策委员会和基金经理提供研究报告,作为其投资决策依据。

(2)投资决策委员会决议确定本基金资产分配比例

投资决策委员会根据金融工程部和股票投资部提供的策略分析报告和研究报告,决议确定本基金资产的股票、债券、现金分配比例和总体投资计划。

(3)基金经理制定具体的投资策略和投资组合方案

基金经理根据投资决策委员会确定的基金总体投资计划,参考投资部的宏观、行业、企业及市场分析报告,制定投资仓位以及具体的资产分配比例,选择行业和个股,构造投资组合方案。

(4)基金投资组合经投资决策委员会审核后,由基金经理向集中交易室下达具体交易指令。

(5)风险控制委员会提出风险控制建议

风险控制委员会根据市场变化对本基金投资组合进行风险评估,并提出风险防范措施。监察稽核部对计划的执行过程进行日常监督,投资计划执行完毕,本基金经理负责向投资决策委员会提出总结报告。

(6)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流程。

3.投资方法

(1)股票投资

本基金的股票投资部分既注重股票现期价格又关注未来的收益增长,以价值型股票中增长较快的股票构建投资组合,关注市场及个股的风险控制和流动性管理。具体的选股策略如下:

①首先将深沪所有A股上市公司按行业分类,并按P/B值大小排序,剔除各行业中P/B值最大的1/3,构成价值类股票备选库;

②将价值类股票备选库按年报公布的净利润增长率大小排序(在行业中排序),剔除最小的1/3,构成价值增长类股票备选库;

③运用相对价值评估法和现金流量折现等价值评估方法,对以上价值增长类股票备选库进行价值评估,选出未来盈利增长最好的一批股票构造投资组合;

④对于范围以外的股票,本基金将根据上市公司基本面结合二级市场表现,有选择地纳入研究范围,但该部分的投资不会作为基金投资的重点;

⑤对于每年05月至下一年度04月上市的新股,本基金将其作为一个特殊资产分类单独管理。

(2)债券投资

本基金可投资于国债、金融债和企业债(包括可转换债),并可进行债券回购,国债投资部分将不低于本基金资产净值的20%。本基金管理人将按照基金总体资产配置计划,以满足流动性需求为目标,灵活运用久期、免疫等各种利率风险管理技术,并结合对市场的判断,合理构造和调整债券品种和期限的组合,提高基金收益水平。

我国债券市场属于新兴市场,存在市场和制度性缺陷双重因素造成的市场机会,采用波段操作具有现实基础和积极意义。通过判断整个市场利率走势以及波段价格变动的趋势,运用利率预期、单个债券选择、信用利差分析、收益率曲线预测和回购放大操作等积极的债券组合管理策略,并通过银行间与交易所间进行跨市套利,提高本基金债券投资的收益率水平。在债券资产配置上,基于国内债券市场大部分品种流动性不足的现状,本基金采取"两极策略"和"梯形策略"相结合的方式,充分保证资产的流动性。

十、基金的业绩比较基准

本基金原业绩比较基准为:中信价值指数×80%+中信国债指数×20%。自2008年3月1日起,该基金业绩比较基准更改为:沪深300指数×80%+中信标普国债指数×20%。

中信国债指数的编制人中信标普指数信息服务有限公司已将"中信国债指数"更名为"中信标普国债指数",指数的编制方法未发生变动,保持了较好的延续性和连接性。鉴于此,本基金业绩比较基准中对应的指数名称也做相应调整。

十一、基金的风险收益特征

本基金的收益与风险介于价值型基金与成长型基金之间,具有风险中等、收益较高的特点。

十二、基金的投资组合报告

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。

基金托管人中国农业银行根据本基金合同规定,于2012年11月15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。

本投资组合报告所载数据截至2012年9月30日,本报告中所列财务数据未经审计。

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	5,851,517,909.09	76.38
	其中:股票	5,851,517,909.09	76.38
2	固定收益投资	1,560,519,782.80	20.37
	其中:债券	1,560,519,782.80	20.37
	资产支持证券	-	0.00
3	金融衍生品投资	-	0.00
4	买入返售金融资产	-	0.00
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
5	银行存款和结算备付金合计	209,275,414.09	2.73
6	其他资产	39,460,678.65	0.52
7	合计	7,660,773,784.63	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	16,977,860.52	0.22
B	采掘业	118,151,225.44	1.55
C	制造业	3,012,401,201.76	39.49
C0	食品、饮料	1,396,185,942.71	18.30
C1	纺织、服装、皮毛	10,964,477.16	0.14
C2	木材、家具	-	0.00
C3	造纸、印刷	-	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	130,884,222.40	1.72
C5	电子	117,532,295.17	1.54
C6	金属、非金属	138,388,334.86	1.81
C7	机械、设备、仪表	449,703,075.43	5.90
C8	医药、生物制品	768,742,854.03	10.08
C99	其他制造业	-	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	5,713,502.80	0.07
E	建筑业	316,547,729.07	4.15
F	交通运输、仓储业	80,399,669.93	1.05
G	信息技术业	132,544,181.08	1.74
H	批发和零售贸易	15,984,118.40	0.21
I	金融、保险业	1,211,000,303.76	15.88
J	房地产业	546,904,124.45	7.17
K	社会服务业	214,322,293.06	2.81
L	传播与文化产业	180,571,698.82	2.37
M	综合类	-	0.00
	合计	5,851,517,909.09	76.72

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	000858	五 粮 液	12,534,358	424,914,736.20	5.57
2	600519	贵州茅台	1,700,000	417,860,000.00	5.48
3	601318	中国平安	5,692,682	238,751,083.08	3.13
4	000568	泸州老窖	6,022,475	231,865,287.50	3.04
5	000651	格力电器	10,000,000	213,800,000.00	2.80
6	601601	中国太保	10,075,772	203,832,867.56	2.67
7	601886	江河幕墙	10,524,442	183,756,757.32	2.41
8	600276	恒瑞医药	5,674,153	171,983,577.43	2.25
9	000002	万 科A	20,113,792	169,559,266.56	2.22
10	000826	桑德环境	6,790,576	166,029,583.20	2.18

4.报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	83,981,782.80	1.10
2	央行票据	1,044,006,000.00	13.69
3	金融债券	432,532,000.00	5.67
	其中:政策性金融债	432,532,000.00	5.67
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	-	0.00
6	中期票据	-	0.00
7	可转债	-	0.00
8	其他	-	0.00
9	合计	1,560,519,782.80	20.46

5.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1001042	10央行票据42	1,900,000	189,620,000.00	2.49
2	1101088	11央行票据88	1,800,000	174,006,000.00	2.28
3	1001060	10央行票据60	1,600,000	159,552,000.00	2.09
4	1001032	10央行票据32	1,200,000	119,808,000.00	1.57
5	1101078	11央行票据78	1,000,000	101,740,000.00	1.33

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。

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五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.投资组合报告附注

(1)本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(2)基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

(3)基金的其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,085,740.02
2	应收证券清算款	9,037,881.04
3	应收股利	768,512.07
4	应收利息	27,420,535.42
5	应收申购款	148,010.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	39,460,678.65

(4)报告期末基金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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

(6)由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

十三、基金业绩

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

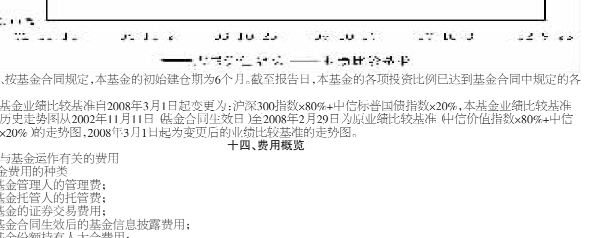
(一)自基金合同生效以来(2002年11月11日)至2012年9月30日基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较:

阶段	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
2002.11.11—2002.12.31	-0.35%	0.06%	-8.95%	1.12%	8.60%	-1.06%
2003.01.01—2003.12.31	18.29%	0.67%	4.37%	0.93%	13.92%	-0.26%
2004.01.01—2004.12.31	0.15%	0.89%	-10.80%	1.06%	10.95%	-0.17%
2005.01.01—2005.12.31	5.04%	0.90%	-5.66%	1.08%	10.70%	-0.18%
2006.01.01—2006.12.31	109.74%	1.24%	74.51%	1.13%	35.23%	0.11%
2007.01.01—2007.12.31	125.42%	1.70%	145.25%	2.00%	-19.83%	-0.30%
2008.01.01—2008.12.31	-49.65%	2.09%	-54.61%	2.44%	4.96%	-0.35%
2009.01.01—2009.12.31	67.96%	1.64%	73.63%	1.64%	-5.67%	0.00%
2010.01.01—2010.12.31	6.95%	1.28%	-9.20%	1.26%	16.15%	0.02%
2011.01.01—2011.12.31	-26.38%	1.07%	-19.61%	1.04%	-6.77%	0.03%
2012.01.01-2012.09.30	-1.91%	1.12%	-1.05%	1.03%	-0.86%	0.09%
2002.11.11-2012.09.30	282.99%	1.33%	106.13%	1.46%	176.86%	-0.13%

(二)自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的比较

大成价值增长证券投资基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2002年11月11日至2012年9月30日)



注:1、按基金合同规定,本基金的初始建仓期为6个月。截至报告日,本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

2、本基金业绩比较基准自2008年3月1日起变更为:沪深300指数×80%+中信标普国债指数×20%,本基金业绩比较基准收益率的历史走势图从2002年11月11日(基金合同生效日)至2008年2月29日为原业绩比较基准(中信价值指数×80%+中信国债指数×20%)的走势图,2008年3月1日起为变更后的业绩比较基准的走势图。

十四、费用概览

(一)与基金运作有关的费用

1.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)基金的证券交易费用;

(4)基金合同生效后的基金信息披露费用;

(5)基金份额持有人大会费用;

(6)基金合同生效后的会计师费和律师费;

(7)按照国家有关规定可以列入的其他费用。

2.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

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.50%÷当年天数

H为每日应支付的基金管理费

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,由基金托管人于次月的前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

(2)基金托管人的托管费

基金托管人的托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%÷当年天数

H为每日应支付的基金托管费

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,由基金托管人于次月的前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

(3)上述(一)基金费用中第3-7项费用由基金托管人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资产中支付。

3.不列入基金费用的项目

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资产的损失,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

4.基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人与基金托管人可根据市场和基金发展情况磋商酌情降低基金管理费及基金托管费,经中国证监会核准后公告,无须召开基金份额持有人大会通过。

(二)与基金销售相关费用

1.基金认购费用

本基金认购费率最高不超过1.0%,认购费率依认购金额的增加而递减。

认购金额	费率
1亿元以下(不含1亿元)	1.0%
1亿元以上	不高于1.0%

认购费用在基金募集时从认购金额中扣除,不列入基金资产。

基金认购费用用于基金设立募集期间发生的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

2.申购费用

申购费用是基金销售和服务过程中发生费用,由基金份额持有人承担,按交易金额的一定比例收取。

(1)投资者既可以选择申购时交纳申购费用,也可以选择赎回时交纳申购费用。投资者若选择申购时交纳称为前端申购费,投资者若选择在赎回时交纳则称为后端申购费。

(2)投资者选择交纳前端申购费时,按照申购金额采用比例费率,具体如下表所示:

申购金额M	费率
M<50万	1.5%
50万≤M<200万	1.0%
200万≤M<500万	0.6%
M≥500万	1000元/笔

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额,计算公式如下:

净申购金额=申购金额/(1+申购费率)

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/T日基金份额净值

对于前端收费模式下通过大成网上交易平台进行申购,其申购费率享受一定优惠,具体情况请见有关公告。

(3)投资者选择交纳后端申购费时,按照持有时间采用比例费率,并随持有时间递减,具体如下表所示:

持有基金时间	费率
1年以内	2.0%
1年以上、2年以内(含1年)	1.5%
2年以上、3年以内(含2年)	1.0%
3年以上、5年以内(含3年)	0.5%
5年以上(含5年)	0

3.赎回费率

赎回费用是基金销售和服务过程中发生费用,由基金份额持有人承担,按交易金额的一定比例收取。

本基金的净赎回金额前端收费模式为赎回金额扣减赎回费用;后端收费模式为赎回金额扣减后端申购费用和赎回费用,计算公式如下:

赎回价格=申请日基金份额净值

赎回金额=赎回份数×赎回价格

赎回费用=赎回金额×赎回费率

前端收费模式净赎回金额=赎回金额-赎回费用

后端收费模式净赎回金额=赎回金额-后端申购费用-赎回费用

在前端和后端收费形式下,本基金的赎回费率为赎回基金总额的0.25%,赎回费用于支付相关手续费后余额归入基金财产。赎回费用归入基金财产的比例不得低于赎回费用总额的25%。

4.基金管理人可根据市场情况调整本基金的申购和赎回费率,调整结果将前2日内在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

5.基金转换费用

(1)每笔基金转换视为转出基金的一笔基金赎回和转入基金的一笔基金申购。基金转换费用由转出基金赎回费用及基金申购补差费用两部分构成。

(2)转入基金时,从申购费用低的基金向申购费用高的基金转换时,每次收取申购补差费用;从申购费用高的基金向申购费用低的基金转换时,不收取申购补差费用。转入基金的申购补差费用按照转换金额对应的转出基金与转入基金的申购费率差额进行补差。

(3)转出基金时,如涉及的转出基金有赎回费用,收取该基金的赎回费用。收取的赎回费用25%归入基金资产,其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

(4)投资者可以发起多次基金转换业务,基金转换费用按每笔申请单独计算。

(5)基金管理人可以根据市场情况在不违背有关法律、法规和基金合同的规定之前提下,调整上述收费方式和费率水平,但最迟应于新收费办法开始实施日前2日内在至少一种中国证监会指定媒体上公告。

(6)基金转换的计算公式

A=[B×C×(1-D)/(1+G)+F]/E@其中,A为转入的基金份额;B为转出的基金份额;C为转换申请当日转出基金的基金份额净值;D为转出基金的对应赎回费率,G为对应的申购补差费率;E为转换申请当日转入基金的基金份额净值;F为基金账户内货币市场基金全部份额转出时,结转的账户当前累计未付正收益(仅限转出基金为货币市场基金)。@具体份额以注册登记机构的记录为准。转入份额的计算结果四舍五入保留到小数点后两位,由此误差产生的损失由基金财产承担,产生的收益归基金财产所有。

(三)基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,应按国家税收法律、法规履行其纳税义务。

按照国家现行税收法律、法规规定,个人投资者投资本基金所获增值部分免税,机构投资者投资本基金所获增值部分应按相关规定缴纳企业所得税。

十五、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《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》及其他有关法律法规的要求,对2012年6月20日公布的《大成价值增长证券投资基金更新的招募说明书(2012年第1期)》进行了更新,并根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新,主要更新的内容如下:

1.根据最新资料,更新了"三、基金管理人"部分。

2.根据最新资料,更新了"四、基金托管人"部分。

3.根据最新资料,更新了"五、相关服务机构"部分。

4.根据最新数据,更新了"九、基金的投资"部分。

5.根据最新数据,更新了"十、基金的业绩"部分。

6.根据最新公告,更新了"二十二、其他应披露的事项"。

7.根据最新情况,更新了"二十三、招募说明书更新部分的说明"。

大成基金管理有限公司

二〇一二年十二月二十五日