



**(上接B58版)**  
**（四）审计机构**  
名称:普华永道中天会计师事务所有限公司  
住所:中国上海市浦东新区陆家嘴环路1318号展翼楼六层  
办公地址:上海市潍坊路202号普华永道中心14楼  
法定代表人:杨绍信  
电话:(021)23238880  
传真:(021)23238866  
联系人:魏佳亮  
经办注册会计师:汪稼、屈斯洁  
**四、基金名称**  
国泰事件驱动策略股票型证券投资基金  
**五、基金类型**  
1.基金类型:股票型证券投资基金  
2.基金运作方式:契约开放式  
3.基金的存续期间:不定期  
**六、投资目标**  
本基金将充分理解国内经济增长和结构转型所带来的事件性投资机会,在积极把握宏观经济和产业发展趋势的基础上精选具有价值优势的公司股票进行投资,力争获取超越业绩比较基准的收益。  
**七、投资范围**  
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行的上市公司股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的公司股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但应符合中国证监会的相关规定。  
如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入本基金的投资范围。  
基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的60%-95%;债券、货币市场工具、权证、资产支持证券及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他资产不高于基金资产的40%,其中,基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。  
**八、投资策略**  
本基金通过深入挖掘可能对行业或公司的当前或未来价值产生重大影响的事件,在积极把握宏观经济和产业发展趋势的基础上,将事件性因素作为投资的主线,并将事件驱动投资策略贯彻到本基金的投资管理中。  
具体而言,本基金的投资策略分三个层次,首先是大类资产配置,即采用基金管理人的资产配置评估模型(MeMo),依据对宏观经济、企业盈利、流动性、估值等相关因素的分析判断确定不同资产配置比例;其次是行业配置,即从估值水平和发展前景两个角度出发,注重事件性因素对行业影响的分析,采取定性和定量分析相结合的方法,对行业进行优化配置和动态调整;最后,在大类资产配置和行业配置的基础上,通过对影响上市公司当前和未来价值的的事件性因素进行深入的挖掘,深入挖掘受事件性因素或市场估值未能充分体现事件影响的上市公司股票,在综合考虑投资组合的风险和收益的前提下,完成本基金投资组合的构建,并依据事件影响的深入对其进行动态调整。  
1.大类资产配置策略  
本基金运用基金管理人开发的资产配置评估模型(MeMo),通过宏观经济、企业盈利、流动性、估值和行政干预等相关因素的分析判断,采用评分方法确定大类资产配置比例。  
2.行业配置策略  
在行业配置策略上,本基金将从估值水平和发展前景两个角度出发,注重事件性因素对行业影响的分析,采取定性和定量分析相结合的方法,对行业进行优化配置和动态调整。  
本基金管理人将定期根据行业生命周期、流动性等定量指标以及宏观经济环境、行业事件性因素等方面的定性分析,对各行业的当前价值和投资价值进行评估,排序,并根据评估结果确定本基金的行业配置。  
具体而言,本基金采用的行业评估体系主要包括以下定性、定量分析体系:  
(1)定量分析:  
①生命周期指标,包括行业销售增长率、行业产值占GDP的比重以及行业利润率等;  
②流动性指标,包括行业平均存货周转率、行业平均应收账款周转率等;  
③行业估值指标,包括行业PE、PB、PEG等。  
(2)定性分析:  
①宏观经济对行业的影响分析,分析和总结国内外主要宏观经济周期不同阶段的行业景气规律与股票市场不同阶段的行业表现规律,结合对当前中国经济和资本市场特征的研究,精选优秀行业;  
②事件性因素影响分析,对应国内经济处于转型期的现状,行业及板块受内生因素的影响比较明显,表现出很强的事件驱动性,行业的政策扶持、产业升级以及行业内重大事件往往会对整个行业或板块内的个股的估值水平产生普遍的影响,本基金认为可能对行业或板块带来趋势性影响的事件性因素主要包括:重大行业政策变化、行业管理的放松或收紧以及行业内重大事件等;  
③行业内外部环境分析,如新进入者的威胁、替代品的威胁、购买者的议价能力、供应商的议价能力、行业内竞争的竞争程度等分析。  
3.个股投资策略  
基于对国内外股票市场大量的实证研究,基金管理人开发了“国泰事件驱动因素选股系统”,将影响个股估值的事件性因素归纳为以下几个主要方面:  
(1)资产重组,包括重组、注入和收购并表  
资产重组是指企业与其它主体在资产、负债或所有者权益诸项目之间的调整,资产重组是在资产结构上的重大调整,而且往往对公司的运营产生深远的影响,这些影响包括生产效率的提升、生产成本的降低、渠道的整合、公司管理能力的提升等等多个方面,由于资产结构和运营模式的调整,发生资产重组的公司,其未来的估值水平会与之前的估值发生明显的改变。  
本基金广泛的收集市场公开的事件信息,借助“国泰事件驱动因素选股系统”,对在正在或者已完成资产重组的公司进行估值分析,估算公司预期盈利水平和成长潜力,挑选具有绝对或相对估值吸引力的上市公司股票。  
(2)公司股权变动  
与资产重组一样,公司股权的变动不仅直接改变公司的资产结构,同时也对企业未来在生产、经营、管理等多个方面产生影响,本基金通过定性和定量方法对股权变动可能带来的影响进行风险分析,并借助“国泰事件驱动因素选股系统”对发生股权变动的上市公司的估值预期进行调整,挑选具有绝对或相对估值吸引力的上市公司股票。  
(3)再融资

再融资是指上市公司通过配股、增发或者发行可转换债券等方式在证券市场上进行的直接融资,再融资的上市公司,一方面其资产、负债或所有者权益的结构将发生变动;而另一方面,由于再融资投资的行为,公司的盈利能力、现金水平等也会相应的产生改变,本基金通过对公司再融资方式、融资资金用途和投入挖掘,结合对上市公司的实地考察和历史业绩分析,对公司的估值预期进行调整,并依此来挑选具有价值优势的上市公司股票。  
(4)大小非解禁  
本基金将关注存在大小非解禁的上市公司的基本面因素,对大小非解禁带来的影响进行全面的分析,并根据对估值水平和市场价格的判断选择具有价值优势的上市公司股票。  
(5)管理层股份解禁  
本基金将持续关注存在管理层股份解禁的上市公司基本面因素,研究管理层股份解禁给上市公司价值和市场价格表现带来的影响,并根据对估值水平和市场价格的判断选择具有价值优势的上市公司股票。  
(6)上市公司或控股股东管理层变动  
作为上市公司或控股股东的实际经营者,管理层的变动虽然不会改变公司的资产结构,但是对公司的运营状况有直接的影响,管理层的变动往往伴随着企业的经营方向、市场政策、开发投入等多个方面的变化,本基金通过实地调查和历史分析相结合的办法,力求形成对发生管理层变动的公司的合理估值预期,并根据事件影响的深入对其进行独特的跟踪和修正。  
(7)股权激励计划  
股权激励包括股票期权、员工持股计划和管理层收购等多种不同的表现形式,股权激励计划以股权形式给予企业经营者一定的经济权利,使他们能够以股东的身份参与企业决策、分享利润、承担风险,从而激励尽责地为公司的长期发展服务,从公司管理实践来看,股权激励对于改善公司治理结构,降低代理成本、提升管理效率,增强公司凝聚力和市场竞争力起到非常积极的作用,本基金通过实地调查,从本面的变动角度入手对公司进行重新估值,并挑选具有价值优势的上市公司股票。  
(8)重大合同或重大新产品推出  
重大合同公告或重大新产品的推出有可能对盈利能力、利润规模、增长水平甚至资产负债比例等诸多估值因素产生影响,本基金通过实地调查以及行业和历史分析,对公告重大合同或重大新产品的公司进行估值调整,并依此进行股票选择。  
(9)其他  
其他事件类型还包括上市公司重大事项、投资者与管理者的关系改善、同一公司其他类型证券的发行或到期等诸多方面,本基金将对影响公司的资产结构或者运营管理能力等方面的事件性因素进行综合分析,力求形成对上市公司的合理估值预期,并依此来挑选具有价值优势的上市公司股票。

**九、业绩比较基准**  
本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×80%+中证综合债券指数收益率×20%。  
本基金为股票型基金,在综合考虑了基金投资组合的构建、投资标的以及市场上可得股票指数的编制方法后,本基金选择市场认同度较高且并作为股指期货标的的沪深300指数作为本基金股票组合的业绩比较基准,沪深300指数成份股来自沪深两个证券市场,覆盖了大部分流通市值,为中国A股市场中代表性强、流动性高的主流投资股票,能够反映A股市场总体发展趋势,债券组合的业绩基准则采用了中证综合债券指数,中证综合债券指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央行票据及短期融资券整体走势的跨市场债券指数,该指数旨在更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势,具有较强的市场代表性。  
如果今后法律法规发生变化,或者指数编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称,或者有更权威、更能作为市场广泛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业绩基准的指数时,经与基金托管人协商一致,本基金可以在中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

**十、风险收益特征**  
本基金为股票型基金,股票型基金的风险高于混合型基金,债券型基金和货币市场基金,属于较高风险、相对较高预期收益的品种。  
**十一、基金投资组合报告**  
本基金管理人的董事会及董事承诺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。  
基金管理人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2013年1月16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12月31日,本报告所有财务数据未经审计。

**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	125,072,678.82	90.52
	其中:股票	125,072,678.82	90.52
2	固定收益投资	5,501,549.50	3.98
	其中:债券	5,501,549.50	3.98
	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	7,050,086.84	5.10
6	其他各项资产	551,356.22	0.40
7	合计	138,175,665.38	100.00

**(三) 募集基金结余情况**  
截至2012年12月31日,募集资金存储专户余额为13,311.22万元,具体情况如下:

序号	专户银行名称	银行账号	账户类别	期末余额
1	中国银行股份有限公司张家港支行	480658217538	募集资金专户	2,422.85
			定期存款	3,000.00
2	中国农业银行股份有限公司张家港港区支行	52820104006268	募集资金专户	1,354.62
			定期存款	2,000.00
3	江苏张家港农村商业银行股份有限公司港区支行	80200002888818	募集资金专户	533.75
			定期存款	4,000.00
	合计			13,311.22

注:因中国银行股份有限公司张家港支行系统升级原因,原在中国银行股份有限公司张家港支行开立的募集资金存储专户(号码为122968090000)变更为480658217538(详见公司2011-024号公告)。  
**二、募集资金管理情况**  
(一)募集资金管理制度的建立  
为规范募集资金的管理和使用,提高募集资金使用效率,切实保护广大投资者的利益,公司依据《中华人民共和国公司法》、《中华人民共和国证券法》、《首次公开发行股票并上市管理办法》、《上市公司证券发行管理办法》、《深圳证券交易所股票上市规则》、《深圳证券交易所中小企业上市公司特别规定》、《关于统一规范上市公司募集资金管理问题的通知》、《中小企业上市公司募集资金管理细则(2008年修订)》等法律、法规、规范性文件以及《长江润发机械股份有限公司章程》,结合公司实际情况,制定《长江润发机械股份有限公司募集资金管理制度》(以下简称“管理制度”),该《管理制度》于2008年8月15日召开的股东大会审议通过,并于2011年4月25日经2010年度股东大会审议通过第一次修订,根据《管理制度》的要求并结合公司生产经营需要,公司对募集资金采用专户存储制度,对募集资金实行严格的审批制度,以便对募集资金使用情况进行监督,保证募集资金专款专用。  
(二)募集资金管理制度的执行  
为规范募集资金的管理和使用,切实保护投资者的利益,根据深圳证券交易所《上市规则》(2006年修订)、《中小企业上市公司募集资金管理制度》和公司《募集资金管理制度》等相关法律法规和规范性文件的规定,并经公司第一届董事会第十次会议审议通过,公司与保荐机构国海证券股份有限公司及中国银行股份有限公司张家港支行、中国农业银行股份有限公司张家港港区支行、江苏张家港农村商业银行股份有限公司港区支行分别签署《募集资金三方监管协议》,共同对募集资金的使用和存储情况进行监督,签署的《募集资金三方监管协议》与监管协议范本不存在重大差异。  
2010年9月,为提高募集资金使用效率,合理降低财务费用,增加存储收益,规范募集资金管理,保护中小投资者的权益,公司以定期存单方式存放募集资金,根据募集资金管理方面的相关规定,公司分别与专户银行及保荐机构签订《长江润发机械股份有限公司募集资金三方监管补充协议》。  
公司三方监管协议与深圳证券交易所三方监管协议范本不存在重大差异,三方监管协议的履行不存在问题。

**三、2012年度募集资金的实际使用情况**

募集资金总额		51,150.00	本报告期投入募集资金总额	7,521.07
报告期内变更用途的募集资金总额		0.00		
累计变更用途的募集资金总额		0.00		
累计投入的募集资金总额比例		0.00%		

**四、募集资金使用情况**  
公司2010年IPO募集资金总额为29,127,840.47元,使用情况如下:根据公司第一届董事会第十次会议决议,为提高公司募集资金使用效率,有效降低公司财务费用,实现公司和投资者利益的最大化,根据《中小企业上市公司募集资金管理制度》(2008年2月修订)的规定,截止本报告期末,公司募集资金已将超额部分中的2,600.00万元用于“年产3万台电动自行车智能调速器”项目。  
募集资金总额127,840.47元,公司将本着审慎、负责的态度,根据公司发展战略和经营实际需要,对利息超募资金进行专项计划安排并及时披露。  
五、变更募集资金投资项目的使用情况  
截止2012年12月31日,公司无变更募集资金投资项目的资金使用问题。  
六、募集资金使用及披露中存在的问题  
公司已披露的募集资金使用的真实信息及时、真实、准确、完整,不存在募集资金管理违规情形。

**五、募集资金使用及披露中存在的问题**

四、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

再融资是指上市公司通过配股、增发或者发行可转换债券等方式在证券市场上进行的直接融资,再融资的上市公司,一方面其资产、负债或所有者权益的结构将发生变动;而另一方面,由于再融资投资的行为,公司的盈利能力、现金水平等也会相应的产生改变,本基金通过对公司再融资方式、融资资金用途和投入挖掘,结合对上市公司的实地考察和历史业绩分析,对公司的估值预期进行调整,并依此来挑选具有价值优势的上市公司股票。  
(4)大小非解禁  
本基金将关注存在大小非解禁的上市公司的基本面因素,对大小非解禁带来的影响进行全面的分析,并根据对估值水平和市场价格的判断选择具有价值优势的上市公司股票。  
(5)管理层股份解禁  
本基金将持续关注存在管理层股份解禁的上市公司基本面因素,研究管理层股份解禁给上市公司价值和市场价格表现带来的影响,并根据对估值水平和市场价格的判断选择具有价值优势的上市公司股票。  
(6)上市公司或控股股东管理层变动  
作为上市公司或控股股东的实际经营者,管理层的变动虽然不会改变公司的资产结构,但是对公司的运营状况有直接的影响,管理层的变动往往伴随着企业的经营方向、市场政策、开发投入等多个方面的变化,本基金通过实地调查和历史分析相结合的办法,力求形成对发生管理层变动的公司的合理估值预期,并根据事件影响的深入对其进行独特的跟踪和修正。  
(7)股权激励计划  
股权激励包括股票期权、员工持股计划和管理层收购等多种不同的表现形式,股权激励计划以股权形式给予企业经营者一定的经济权利,使他们能够以股东的身份参与企业决策、分享利润、承担风险,从而激励尽责地为公司的长期发展服务,从公司管理实践来看,股权激励对于改善公司治理结构,降低代理成本、提升管理效率,增强公司凝聚力和市场竞争力起到非常积极的作用,本基金通过实地调查,从本面的变动角度入手对公司进行重新估值,并挑选具有价值优势的上市公司股票。  
(8)重大合同或重大新产品推出  
重大合同公告或重大新产品的推出有可能对盈利能力、利润规模、增长水平甚至资产负债比例等诸多估值因素产生影响,本基金通过实地调查以及行业和历史分析,对公告重大合同或重大新产品的公司进行估值调整,并依此进行股票选择。  
(9)其他  
其他事件类型还包括上市公司重大事项、投资者与管理者的关系改善、同一公司其他类型证券的发行或到期等诸多方面,本基金将对影响公司的资产结构或者运营管理能力等方面的的事件性因素进行综合分析,力求形成对上市公司的合理估值预期,并依此来挑选具有价值优势的上市公司股票。

**九、业绩比较基准**  
本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×80%+中证综合债券指数收益率×20%。  
本基金为股票型基金,在综合考虑了基金投资组合的构建、投资标的以及市场上可得股票指数的编制方法后,本基金选择市场认同度较高且并作为股指期货标的的沪深300指数作为本基金股票组合的业绩比较基准,沪深300指数成份股来自沪深两个证券市场,覆盖了大部分流通市值,为中国A股市场中代表性强、流动性高的主流投资股票,能够反映A股市场总体发展趋势,债券组合的业绩基准则采用了中证综合债券指数,中证综合债券指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央行票据及短期融资券整体走势的跨市场债券指数,该指数旨在更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势,具有较强的市场代表性。  
如果今后法律法规发生变化,或者指数编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称,或者有更权威、更能作为市场广泛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业绩基准的指数时,经与基金托管人协商一致,本基金可以在中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

**十、风险收益特征**  
本基金为股票型基金,股票型基金的风险高于混合型基金,债券型基金和货币市场基金,属于较高风险、相对较高预期收益的品种。  
**十一、基金投资组合报告**  
本基金管理人的董事会及董事承诺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。  
基金管理人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2013年1月16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12月31日,本报告所有财务数据未经审计。

**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	125,072,678.82	90.52
	其中:股票	125,072,678.82	90.52
2	固定收益投资	5,501,549.50	3.98
	其中:债券	5,501,549.50	3.98
	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	7,050,086.84	5.10
6	其他各项资产	551,356.22	0.40
7	合计	138,175,665.38	100.00

**(三) 募集基金结余情况**  
截至2012年12月31日,募集资金存储专户余额为13,311.22万元,具体情况如下:

序号	专户银行名称	银行账号	账户类别	期末余额
1	中国银行股份有限公司张家港支行	480658217538	募集资金专户	2,422.85
			定期存款	3,000.00
2	中国农业银行股份有限公司张家港港区支行	52820104006268	募集资金专户	1,354.62
			定期存款	2,000.00
3	江苏张家港农村商业银行股份有限公司港区支行	80200002888818	募集资金专户	533.75
			定期存款	4,000.00
	合计			13,311.22

注:因中国银行股份有限公司张家港支行系统升级原因,原在中国银行股份有限公司张家港支行开立的募集资金存储专户(号码为122968090000)变更为480658217538(详见公司2011-024号公告)。  
**二、募集资金管理情况**  
(一)募集资金管理制度的建立  
为规范募集资金的管理和使用,提高募集资金使用效率,切实保护广大投资者的利益,公司依据《中华人民共和国公司法》、《中华人民共和国证券法》、《首次公开发行股票并上市管理办法》、《上市公司证券发行管理办法》、《深圳证券交易所股票上市规则》、《深圳证券交易所中小企业上市公司特别规定》、《关于统一规范上市公司募集资金管理问题的通知》、《中小企业上市公司募集资金管理细则(2008年修订)》等法律、法规、规范性文件以及《长江润发机械股份有限公司章程》,结合公司实际情况,制定《长江润发机械股份有限公司募集资金管理制度》(以下简称“管理制度”),该《管理制度》于2008年8月15日召开的股东大会审议通过,并于2011年4月25日经2010年度股东大会审议通过第一次修订,根据《管理制度》的要求并结合公司生产经营需要,公司对募集资金采用专户存储制度,对募集资金实行严格的审批制度,以便对募集资金使用情况进行监督,保证募集资金专款专用。  
(二)募集资金管理制度的执行  
为规范募集资金的管理和使用,切实保护投资者的利益,根据深圳证券交易所《上市规则》(2006年修订)、《中小企业上市公司募集资金管理制度》和公司《募集资金管理制度》等相关法律法规和规范性文件的规定,并经公司第一届董事会第十次会议审议通过,公司与保荐机构国海证券股份有限公司及中国银行股份有限公司张家港支行、中国农业银行股份有限公司张家港港区支行、江苏张家港农村商业银行股份有限公司港区支行分别签署《募集资金三方监管协议》,共同对募集资金的使用和存储情况进行监督,签署的《募集资金三方监管协议》与监管协议范本不存在重大差异。  
2010年9月,为提高募集资金使用效率,合理降低财务费用,增加存储收益,规范募集资金管理,保护中小投资者的权益,公司以定期存单方式存放募集资金,根据募集资金管理方面的相关规定,公司分别与专户银行及保荐机构签订《长江润发机械股份有限公司募集资金三方监管补充协议》。  
公司三方监管协议与深圳证券交易所三方监管协议范本不存在重大差异,三方监管协议的履行不存在问题。

**三、2012年度募集资金的实际使用情况**

募集资金总额		51,150.00	本报告期投入募集资金总额	7,521.07
报告期内变更用途的募集资金总额		0.00		
累计变更用途的募集资金总额		0.00		
累计投入的募集资金总额比例		0.00%		

**四、募集资金使用情况**  
公司2010年IPO募集资金总额为29,127,840.47元,使用情况如下:根据公司第一届董事会第十次会议决议,为提高公司募集资金使用效率,有效降低公司财务费用,实现公司和投资者利益的最大化,根据《中小企业上市公司募集资金管理制度》(2008年2月修订)的规定,截止本报告期末,公司募集资金已将超额部分中的2,600.00万元用于“年产3万台电动自行车智能调速器”项目。  
募集资金总额127,840.47元,公司将本着审慎、负责的态度,根据公司发展战略和经营实际需要,对利息超募资金进行专项计划安排并及时披露。  
五、变更募集资金投资项目的使用情况  
截止2012年12月31日,公司无变更募集资金投资项目的资金使用问题。  
六、募集资金使用及披露中存在的问题  
公司已披露的募集资金使用的真实信息及时、真实、准确、完整,不存在募集资金管理违规情形。

**五、募集资金使用及披露中存在的问题**

四、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

五、报告期内持有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。

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	-	-
B	采掘业	4,764,000.00	3.53
C	制造业	72,047,292.26	53.36
C0	食品、饮料	7,713,162.22	5.71
C1	纺织、服装、皮毛	2,454,400.00	1.82
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	10,809,880.00	8.01
C5	电子、电器	15,872,700.00	11.76
C6	金属、非金属</		