(上接B30版)

5)本基金在任何交易日日终,持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%;

本基金管理人应当按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等;

6)本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%;

7) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例, 不得超过基金资产净值的10%;

8)本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;

9)本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;

10)本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;

11)本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出;

12) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期;

13)法律法规规定的其他比例限制。

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的,以变更后的规定为准。

因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制。

(六)基金资产净值的计算方法和公告方式

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

《基金合同》生效后,在开始办理基金份额申购或者赎回前,基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后,基金管理人应当在每个开放日的次日,通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介,披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

(七)基金合同的变更、终止与基金财产的清算

1、基金合同的变更

(1) 变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的,应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项,由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告,并报中国证监会备案。

(2) 关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准或出具无异议意见后方可执行,自决议生效之日起按照《信息披露办法》的规定在指定媒体公告。

2、基金财产的清算

(1)基金财产清算小组:自出现基金合同终止事由之日起30个工作日内成立清算小组,基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2)基金财产清算小组组成:基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

(3)基金财产清算小组职责:基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

(4)基金财产清算程序:

1)基金合同终止情形出现时,由基金财产清算小组统一接管基金;

2)对基金财产和债权债务进行清理和确认;

3)对基金财产进行估值和变现;

4)制作清算报告;

5)聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计,聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书;

6)将清算报告报中国证监会备案并公告;

7)对基金财产进行分配。

(5)基金财产清算的期限为6个月,但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的,清算期限相应顺延。

3、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用,清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

4、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案,将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后,按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

5、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告;基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

6、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

(八)争议的处理和适用的法律

本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可通过友好协商解决,但若自一方书面提出协商解决争议之日起60日内争议未能以协商方式解决的,则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会,按照其时有效的仲裁规则进行仲裁,仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的,对仲裁各方当事人均具有约束力。

基金合同受中国法律管辖。除争议所涉内容之外,本基金合同的其他部分应当由本基金合同当事人继续履行。

(九)基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

《基金合同》正本一式六份,除上报有关监管机构一式二份外,基金管理人、基金托管人各持有二份,每份具有同等的法律效力。

《基金合同》可印制成册,供投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构的办公场所和营业场所查阅;投资者也可按工本费购买《基金合同》复制件或复印件,但内容应以《基金合同》正本为准。

七、基金财务状况

本基金募集期间发生的信息披露费、会计师费、律师费及其他费用由基金管理人承担,不从基金财产列支,其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率或佣金比例收取认购费。

本基金认购后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金2013年12月4日资产负债表(未经审计)如下:

银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金	
2013年12月4日资产负债表	
(除特别注明外,金额单位为人民币元)	
资产	
银行存款	22,619,516.81
结算备付金	5,620,487.35
存出保证金	336,334.41
交易性金融资产	441,557,699.04
其中:股票投资	441,557,699.04
债券投资	-
资产支持证券投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	3,192,439.91
应收股利	-
应收利息	157,649.41
应收申购款	-
其他资产	182,421.19
资产总计	473,666,548.12
负债及所有者权益	
负债	
应付证券清算款	2,996,893.63
应付管理人报酬	50,799.13
应付托管费	10,159.82
应付交易费用	837,807.22
应付税费	-
应付赎回款	-
其他负债	15,950.00
负债合计	3,911,609.80
所有者权益	
实收基金	458,328,703.92
未分配利润	11,426,234.40
所有者权益合计	469,754,938.32
负债及所有者权益总计	473,666,548.12
截至2013年12月4日,银华800的基金份额净值为 1.023元,银华800A的基金份额净值为1.001元,银华800B的基金份额净值为1.045元。	

八、基金投资组合

截至公告前两个工作日即2013年12月4日, 银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金的投资组合如下:

(一)基金资产组合情况

资产类别	金额(元)	占基金总资产的比例
股票	441,557,699.04	93.22%
债券	-	-
权证	-	-
资产支持证券	-	-
买入返售金融资产	-	-
银行存款和清算备付金合计	28,240,004.16	5.96%
应收申购款	-	-
其他资产	3,868,844.92	0.82%
合计	473,666,548.12	100.00%

注:由于四舍五入的原因,"占基金总资产的比例"分项之和与合计可能有尾差。

(二)按行业分类的股票投资组合

序号	行业分类	股票市值(元)	市值占基金资产净值比例
A	农、林、牧、渔业	9,676,987.23	2.06%
B	采矿业	19,052,952.26	4.06%
C	制造业	241,198,533.78	51.35%
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	24,746,871.61	5.27%
E	建筑业	4,512,693.34	0.96%
F	批发和零售业	18,931,960.37	4.03%
G	交通运输、仓储和邮政业	16,063,145.30	3.42%
H	住宿和餐饮业	1,833,202.00	0.39%
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,366,576.19	5.19%
J	金融业	20,829,864.96	4.43%
K	房地产业	37,266,035.96	7.93%
L	租赁和商务服务业	4,596,400.69	0.98%
M	科学研究和技术服务业	2,328.00	0.00%
N	水利、环境和公共设施管理业	7,527,494.24	1.60%
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	10,568,012.55	2.25%
S	综合	384,640.56	0.08%
	合计	441,557,699.04	94.00%

注:由于四舍五入的原因,市值占基金资产净值比例分项之和与合计可能有尾差。

(三)截至公告前两个工作日即2013年12月4日,按市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)	期末市值(元)	占净值比例
1	601318	中国平安	246,100	10,889,925.00	2.32%
2	000598	兴蓉投资	1,089,300	6,612,051.00	1.41%
3	000903	云内动力	1,262,812	5,834,191.44	1.24%
4	000793	华闻传媒	390,300	4,781,175.00	1.02%
5	000918	嘉凯城	1,675,375	4,674,296.25	1.00%
6	600673	东阳光铝	523,350	4,642,114.50	0.99%
7	000539	粤电力A	844,819	4,300,128.71	0.92%
8	000400	许继电气	136,622	4,292,663.24	0.91%
9	601088	中国神华	229,650	3,959,166.00	0.84%
10	600132	重庆啤酒	210,324	3,956,194.44	0.84%

(四)截至公告前两个工作日即2013年12月4日,按券种分类的债券投资组合

截至公告前两个工作日即2013年12月4日,本基金未持有债券。

(五)截至公告前两个工作日即2013年12月4日,按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

截至公告前两个工作日即2013年12月4日,本基金未持有债券。

(六)截至公告前两个工作日即2013年12月4日,按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券明细

截至公告前两个工作日即2013年12月4日,本基金未持有资产支持证券。

(七)投资组合报告附注

1、截至公告前两个工作日即2013年12月4日,本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

2、申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

本基金前10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、本基金2013年12月4日,其他资产构成如下:

序号	其他资产	金额(元)
1	存出保证金	336,334.41
2	应收利息	157,649.41
3	其他应收款	182,421.19
4	应收证券清算款	3,192,439.91
合计		3,868,844.92

4、截至公告前两个工作日即2013年12月4日,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5、截至公告前两个工作日即2013年12月4日,本基金未持有权证。

九、重大事件揭示

银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金基金合同已于2013年11月5日正式生效,基金管理人已于2013年11月6日在《上海证券报》刊登《银华基金管理有限公司关于银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金基金合同生效公告》。

银华800份额将于2013年12月11日开通日常申购、赎回、跨系统转托管等业务,具体业务办理规则请投资者参阅2013年12月9日刊登在《上海证券报》、《证券时报》以及《中国证券报》上的《银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金开放日常申购、赎回及定期定额投资业务的公告》、《关于银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金开通跨系统转托管业务的公告》。

本基金自合同生效至本公告书公告前未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出如下承诺:

(一)严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

(二)真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件,披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息,并接受中国证监会、深圳证券交易所的监督管理。

(三)在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后,将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺:

(一)严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,设立专门的基金托管部,配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员负责基金财产托管事宜。

(二)根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

(三)基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,督促基金管理人改正。

(四)基金托管人发现基金管理人有重大违规行为,将立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。

十二、基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

十三、备查文件目录

下列文件存放在本基金管理人和托管人的办公场所,投资者可在办公时间免费查阅;也可按工本费购买本基金合同复制件或复印件,但应以基金合同正本为准。

(一)中国证监会核准银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金募集的文件;

(二)《银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金基金合同》;

(三)《银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金招募说明书》;

(四)《银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金托管协议》;

(五)《关于银华基金管理有限公司募集设立银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金之法律意见书》;

(六)基金管理人业务资格批件、营业执照;

(七)基金托管人业务资格批件、营业执照;

(八)中国证监会要求的其他文件。

银华基金管理有限公司
2013年12月6日

(上接B29版)

在债券投资方面,本基金将债券资产配置分为战略性资产和战术性资产两部分。

战略性资产配置体现指数化投资原则,将以中信全债指数样本券为基础,通过保持投资组合久期与目标指数久期有限度的偏离(偏离度5%),实现对目标指数的优化复制。战略性债券资产配置的最低比例为基金净资产的64%。随着债券市场有效性的提高,战略性债券资产配置的比重可适度增加。

战术性资产配置体现指数化的增强性投资,其投资品种不受指数样本库的限制,组合久期管理不受目标指数的限制,但受整个组合久期的限制。战术性资产投资于因投资主体偏好、流动性需求差别及市场分割而凸显投资价值的流动性较好的债券,是一个"自下而上"进行个券选择的过程。战术性债券资产最多可通过回购放大1倍操作。

	久期偏离下限	久期偏离上限
战略性债券资产	目标指数久期95%	目标指数久期105%
战术性债券资产	/	/
债券组合	目标指数久期80%	目标指数久期130%

……

2、以基金的名义使用不属于基金名下的资金买卖证券;

3、动用银行信贷资金从事基金投资;

4、将基金资产用于担保、资金拆借或者贷款;

5、从事证券信用交易;

6、以基金资产进行房地产投资;

7、从事可能使基金资产承担无限责任的投资;

8、将基金资产投资于与基金托管人或者基金管理人有利害关系的公司发行的证券;

9、《基金法》及相关法律法规禁止从事的其它行为。

十、基金的业绩比较标准

本基金为增强性指数化债券型投资基金，对目标指数的投资在资产配置中最低比例为64%，股票资产配置最高比例为16%,现金持有最低比例为3%。由于本基金主要投资于债券,股票投资是作为增强型投资提高收益的一种手段,预计股票投资比例的平均值为8%,因此将基金业绩比较设定为:

基金业绩比较基准=中信标普全债指数收益率×92%+中信标普A股综合指数收益率×8%。

目前投资人可以通过登录中信标普指数服务网获取中信标普全债指数和中信标普A股综合指数的相关信息。如果中信标普指数体系信息发布渠道增加,本基金管理人将另行公告。

十一、基金的风险收益特征

本基金属于证券投资基金中的低风险品种,其长期平均风险和预期收益均低于股票型基金。

十二、基金的投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证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——中国农业银行根据本基金合同规定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2013年9月30日,本报告财务资料未经会计师事务所审计。

……

5、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债券投资明细

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	110261	11国开61	200,000	19,702,000.00	7.82
2	110233	11国开33	200,000	19,440,000.00	7.72
3	122995	08合建投	149,700	15,474,489.00	6.14
4	110015	石化转债	144,580	14,152,936.20	5.62
5	122757	11丹东债	120,000	12,453,600.00	4.94

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

……

(一)与基金运营有关的费用

1、费用种类

(1)基金管理人的管理费;

(2)基金托管人的托管费;

(3)证券交易费用;

(4)基金信息披露费用;

(5)基金份额持有人大会费用;

(6)与基金相关的会计师费和律师费;

(7)按照国家有关规定可以列入的其它费用。

2、费用计提方法、计提标准和支付方式

……

长盛基金管理有限公司
二〇一三年十二月六日

证券代码:000851　证券简称:高鸿股份　公告编号:2013—104

大唐高鸿数据网络技术股份有限公司 非公开发行有限售条件的流通股 解除限售提示性公告

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,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

重要提示:

1、本次解除限售股东8家:深圳市平安创新资本投资有限公司、中国华电集团资本控股有限公司、中关村兴业(北京)创业投资有限公司、景顺长城基金管理有限公司、中钢投资有限公司、华安基金管理有限公司、华能资本服务有限公司、泰达宏利基金管理有限公司,有限售条件流通股实际可上市流通数量为15,364万股A股,占公司总股本的29.78%

2、本次非公开发行股票,上述8家股东的限售期为12个月,本次限售条件流通股可上市流通日为2013年12月09日。

一、公司非公开发行有关情况概述

2011年7月14日至15日召开第六届董事会第二十二次会议,审议通过本次非公开发行股票的方案。

2011年8月8日召开2011年第三次临时股东大会,审议通过本次非公开发行股票的方案。公司本次非公开发行股票的发行数量为不超过16,000万股,发行价格为不低于8.87元/股,拟募集资金总额为不超过136,374万元。

2012年1月12日召开第六届董事会第二十六次会议,审议通过本次非公开发行股票的调整方案。

2012年2月10日召开2012年第二次临时股东大会,审议通过本次非公开发行股票的调整方案。公司2012年度非公开发行股票的发行数量调整为20,000万股,发行价格相应调整为不低于6.12元/股,拟募集资金总额调整为不超过116,374万元。

2012年4月11日,中国证监会发行审核委员会审核通过公司本次发行申请。2012年5月30日,公司收到中国证监会《关于核准大唐高鸿数据网络技术股份有限公司非公开发行股票的批复》(证监许可[2012]690号),核准本公司非公开发行不超过20,000万股新股。

2012年11月23日,公司以非公开发行的方式向9名特定投资者发行了18,304 万股股份,特定投资者均以现金认购,中瑞岳华会计师事务所(特殊普通合伙)出具了中瑞岳华验字[2012]第0335号《验资报告》。根据该验资报告,截至2012年11月23日,募集资金总额为1,120,204,800.00元,扣除发行费用40,770,000.00元,实际募集资金净额为1,079,434,800.00元。

2012年11月28日,公司在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司办理了本次非公开发行股票的股份预登记及股份限售手续的预登记。

2012年12月7日,本次非公开发行的18,304 万股股份在深证证券交易所上市。

二、关于有限售条件流通股上市流通的有关承诺及履行情况

本次发行对象共9名特定投资者,除控股股东电信科学技术研究院外其他8名投资者,深圳市平安创新资本投资有限公司、……

……

1、人民币普通股	330,501,818	64.06%	153,640,000	484,141,818	93.84%
2、境内上市的外资股	0	0.00%	0	0	0.00%
3、境外上市的外资股	0	0.00%	0	0	0.00%
三、股份总数	515,940,000	100.00%	0	515,940,000	100.00%

五、保荐机构核查意见

公司限售股份持有人均严格履行了其在公司首次公开发行股票中做出的各项承诺。公司本次限售股份上市流通符合《公司法》、《深圳证券交易所股票上市规则》等相关规定的要求,不存在实质性障碍。

保荐人对公司本次限售股份上市流通无异议。

六、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不存在对公司的非经营经营性资金占用情况;

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

3、本次申请限售股份上市流通的限售股份持有人不存在违规买卖公司股票的行为。

七、备查文件

1、非公开发行有限售条件的流通股解除限售的说明

2、保荐机构核查意见

特此公告。

大唐高鸿数据网络技术股份有限公司
2013年12月05日

国信证券股份有限公司关于 大唐高鸿数据网络技术股份有限公司 限售股份上市流通的核查意见

深圳证券交易所:

根据《证券发行上市保荐业务管理办法》、《深圳证券交易所股票上市规则》、《深圳证券交易所主板上市公司规范运作指引》等有关规定,作为大唐高鸿数据网络技术股份有限公司(以下简称"高鸿股份"或"公司")非公开发行的保荐人,国信证券股份有限公司(以下简称"国信证券"或"保荐人")对公司2012年度非公开发行股票的限售股份持有人所持限售股份将上市流通情况进行了认真、审慎的核查。核查的具体情况如下:

一、保荐人进行的核查工作

1、限售股上市流通情况

高鸿股份2012年度向9名特定投资者非公开发行股票,其中,控股股东电信技术科学院承诺认购的股票限售期为36个月,其余8名特定投资者承诺认购的股票限售期为12个月,本次非公开发行的限售股份将于2013年12月9日起上市流通,解禁股份具体情况如下:

序号	投资者全称	持股数量(万股)
1	深圳市平安创新资本投资有限公司	1,800
2	中国华电集团资本控股有限公司	1,960
3	中关村兴业(北京)创业投资有限公司	820
4	景顺长城基金管理有限公司	2,973

……

国信证券股份有限公司
2013年11月28日