(上接B9版)

人民币或其他外币掉期业务是指在委托日同时与银行约定两笔金额一致、买卖方向相反、交割日期不同的人民币或外币对另一外币的买卖交易，并在两笔交易的交割日按照该掉期合约约定的币种、金额、汇率办理的结汇或售汇业务。

三、远期外汇交易币种

公司拟开展的远期外汇交易业务，包括但不限于公司生产经营所使用的主要结算货币——美元、欧元、英镑等，开展交割期与预测回款期一致，且金额与预测回款金额相匹配的外汇交易业务。

四、拟投入资金

根据公司实际业务发展情况，公司预计自股东大会审议通过之日起，公司与全资子公司12个月内累计开展的远期外汇交易总额不超过50,000万美元。上述金额超出董事会权限，尚需提交股东大会审议。

开展远期外汇交易业务，公司及全资子公司除根据与银行签订的协议缴纳一定比例的保证金外，不需要投入其他资金，该保证金将使用公司的自有资金，不涉及募集资金。缴纳的保证金比例根据与不同银行签订的具体协议确定。

五、远期外汇交易业务的风险分析

公司及全资子公司开展远期外汇交易业务遵循锁定汇率风险、套期保值的原则，不做投机性、套利性的交易操作，在签订合约时严格按照公司预测回款期限和回款金额进行交易。

远期外汇交易可以在汇率发生大幅波动时，降低汇率波动对公司的影响，使公司专注于生产销售，但同时远期外汇交易也会存在一定风险：

1、汇率波动风险：在汇率行情变动较大的情况下，银行远期结汇汇率报价可能低于公司对客户报价汇率，使公司无法按照对客户报价汇率进行锁定，造成汇兑损失。

2、内部控制风险：远期外汇交易专业性较强，复杂程度较高，可能会由于内控制度不完善而造成风险。

3、客户违约风险：客户应收账款发生逾期，货款无法在预测的回款期内收回，会造成延期交割导致公司损失。

4、回款预测风险：公司及全资子公司根据客户订单和预计订单进行回款预测，实际执行过程中，客户可能会调整订单，造成公司回款预测不准，导致延期交割风险。

六、公司拟采取的风险控制措施

1、公司及全资子公司采用银行远期结汇汇率向客户报价，以便确定订单后，公司能够以对客户报价汇率进行锁定；当汇率发生巨幅波动，如果远期结汇汇率已经远低于对客户报价汇率，公司会提出要求，与客户协商调整价格。

2、公司及全资子公司已制定《远期外汇交易业务内部控制制度》，对远期外汇交易业务的操作原则、审批权限、责任部门及责任人、内部操作流程、信息隔离措施、内部风险报告制度及风险处理程序、信息披露等做出明确规定。

3、为防止远期结汇延期交割，公司高度重视应收账款的管理，积极催收应收账款，避免出现应收账款逾期的现象。

4、公司进行远期外汇交易须严格基于公司的外币收款预测。

5、公司内部审计部门、董事会审计委员会将会定期、不定期对实际交易合约签署及执行情况进行核查。

特此公告。

浙江大华技术股份有限公司董事会
2014年3月14日

证券代码:002236　　证券简称:大华股份　　公告编号:2014-015

浙江大华技术股份有限公司
关于为全资子公司提供担保的公告

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、误导性陈述或重大遗漏。

浙江大华技术股份有限公司(以下简称“公司”、“大华股份”)于2014年3月14日召开的第四届董事会第二十四次会议审议通过了《关于为全资子公司提供担保的议案》，拟调整对全资子公司浙江大华系统工程有限公司(以下简称“系统工程公司”)、浙江大华科技有限公司的担保，并新增对全资子公司大华技術(香港)有限公司(以下简称“大华香港”)的担保，该事项尚需提交股东大会审议。具体情况如下：

一、担保情况概述

公司于2013年4月23日召开的第四届董事会第十六次会议审议通过了《关于为全资子公司浙江大华系统工程有限公司申请银行授信提供担保的议案》，同意为系统工程公司向银行申请不超过人民币5,000万元额度的银行授信提供担保，担保期限不超过三年。

公司于2013年10月25日召开的第四届董事会第二十次会议审议通过了《关于为全资子公司浙江大华威讯科技有限公司提供担保的议案》，同意向浙江大华威讯科技有限公司提供不超过等值人民币20,000万元额度的担保，其中向供应商采购付款提供不超过等值人民币10,000万元的一般责任担保，向商业银行等金融机构申请综合授信额度或其它商定的融资方式提供不超过人民币10,000万元的连带责任担保，上述担保期限不超过两年。2013年12月，浙江浙江大华威讯科技有限公司更名为浙江大华科技有限公司(以下简称“大华科技”)。

为确保全资子公司系统工程公司、大华科技、大华香港生产经营持续健康发展，根据子公司的生产经营和资金需求情况，公司拟调整对系统工程公司、大华科技的担保额度及期限，并新增为大华香港向银行申请授信提供担保的额度，具体如下：

单位:万元

被担保方	担保内容	担保方式	调整前		调整后		备注
			担保额度	担保期限	担保额度	担保期限	
系统工程公司	向金融机构申请授信	连带责任保证	5,000.00	3年	10,000.00	5年	
大华科技	向金融机构申请授信	连带责任保证	10,000.00	2年	50,000.00	5年	
	向供应商采购付款	一般责任保证	10,000.00	2年	10,000.00	2年	不变
大华香港	向金融机构申请授信	连带责任保证	-	-	50,000.00	5年	
合计			-	-	120,000.00	-	

上述担保总额度超过公司2013年末经审计净资产的10%，根据《深圳证券交易所股票上市规则》和《公司章程》，上述担保还需提交公司股东大会审议。

二、被担保人基本情况

1、浙江大华系统工程有限公司

注册资本:人民币10,500万元，公司持有其100%的股权。

法定代表人:吴军

经营范围:计算机软件的技术开发、技术咨询、技术服务及技术成果转让，电子产品及通讯产品的开发、生产、安装及销售，煤矿安全电子设备及防爆电器产品的开发、生产、安装及销售，计算机系统集成，自动化控制工程的设计、施工、安装，办公设备及其耗材的销售及安装服务。(上述经营范围不含国家法律法规规定禁止、限制和许可经营的项目。)

截至2013年12月31日，系统工程公司总资产101,355.98万元，总负债61,104.69万元，营业收入7,1703.09万元，净利润10,956.58万元，资产负债率60.29%。(业经立信会计师事务所审计)

2、浙江大华科技有限公司

注册资本:1,000万元，公司持有其100%股权

电子产品及通讯产品的设计、开发、安装及销售，电子网络产品的开发、系统集成与销售，电子产品工程的设计、安装，经营进出口业务。

截至2013年12月31日，大华科技总资产76,062.66万元，总负债76,661.43万元，实现营业收入39,095.92万元，净利润-1,598.77万元，资产负债率100.79%。(业经立信会计师事务所审计)

3、大華技術(香港)有限公司

注册资本:1万港币，公司持有其100%股权

经营范围:计算机软件的服务、销售，电子产品及通讯产品的销售。网络产品的系统集成与销售，电子产品工程的安装，经营进出口业务。

截至2013年12月31日，大华香港总资产7,597.38万元，总负债7,981.63万元，实现营业收入13,047.08万元，净利润-386.23万元，资产负债率105.06%。(业经立信会计师事务所审计)

三、担保事项具体情况

1、调整对系统工程公司的担保

调整前:

1)担保方:大华股份

2)被担保方:系统工程公司

3)担保内容:向银行申请银行授信

4)担保方式:连带责任保证

5)担保金额:不超过5000万元人民币

6)担保期限:不超过三年

调整后:

1)担保方:大华股份

2)被担保方:系统工程公司

3)担保内容:向商业银行等金融机构申请综合授信额度或其它商定的融资方式

4)担保方式:连带责任保证

5)担保金额:不超过10,000万元人民币

6)担保期限:不超过五年

2、调整对大华科技的担保

调整前:

1)担保方:大华股份

2)被担保方:大华科技

3)担保内容:

a)向商业银行等金融机构申请综合授信额度或其它商定的融资方式:

担保方式:连带责任保证

担保金额:不超过10,000万元人民币

担保期限:不超过两年

b)向供应商采购付款:

担保方式:一般责任保证

担保金额:不超过等值10,000万元人民币

担保期限:不超过两年

调整后:

1)担保方:大华股份

2)被担保方:大华科技

3)担保内容:

a)向商业银行等金融机构申请综合授信额度或其它商定的融资方式:

担保方式:连带责任保证

担保金额:不超过50,000万元人民币

担保期限:不超过五年

b)向供应商采购付款:

担保方式:一般责任保证

担保金额:不超过等值10,000万元人民币(不变)

担保期限:不超过两年(不变)

3、新增对大华香港的担保

1)担保方:大华股份

2)被担保方:大华香港

3)担保内容:向商业银行等金融机构申请综合授信额度或其它商定的融资方式

4)担保方式:连带责任保证

5)担保金额:不超过50,000万元人民币

6)担保期限:不超过五年

四、董事会意见

公司董事会认为系统工程公司、大华科技、香港大华均为公司全资子公司，本公司持有其100%股权，公司提供以上担保能够解决其正常运营的资金需求，进一步提升其经济效益，符合公司的整体发展战略。公司为其提供担保的财务风险处于公司可控的范围之内，对公司的正常经营不构成重大影响，不存在与中国证监会相关规定及《公司章程》相违背的情况，此次担保符合公司和广大股东的利益，不会对公司产生不利的影响，同意为其提供以上担保。

上述担保总额度超过公司2013年末经审计净资产的10%，根据《深圳证券交易所股票上市规则》和《公司章程》，上述担保还需提交公司股东大会审议。

五、累计对外担保数量及逾期担保的数量

本次调整及新增的对外担保总额度为120,000万元人民币，占公司2013年末经审计净资产的28.79%。

截至本公告日，公司实际发生的担保余额为1,0000万元，占公司2013年末经审计净资产的2.40%，全部为对全资子公司的担保。

公司及控股子公司无逾期对外担保、无涉及诉讼的对外担保及因担保被判决败诉而应承担损失的情形。

特此公告。

浙江大华技术股份有限公司董事会
2014年3月14日

证券代码:002236　　证券简称:大华股份　　公告编号:2014-016

浙江大华技术股份有限公司
关于向激励对象授予限制性股票的公告

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、误导性陈述或重大遗漏。

浙江大华技术股份有限公司(以下简称“公司”)于2014年3月14日召开的第四届董事会第二十四次会议审议通过了《关于向激励对象授予限制性股票的议案》，确定2014年3月14日为授予日，对激励对象授予相应额度的限制性股票。具体情况如下：

一、股权激励计划简述及已履行的相关审批程序

(一)公司股权激励计划简述

《浙江大华技术股份有限公司2013年限制性股票激励计划(草案)修订稿》(以下简称“激励计划”)已经公司2013年第三次临时股东大会审议通过，主要内容如下：

1、标的股票种类:激励计划拟授予激励对象的标的股票为大华股份限制性股票。

2、标的股票来源:激励计划拟授予激励对象的标的股票的来源为向激励对象定向发行人民币普通股股票。

3、激励对象、授予数量及授予价格：

本激励计划确定首次授予人数共计653人，其中包括2名实际控制人的亲属。鉴于其中原激励对象赵峰、韩春晓、杨江华、陶军、田青、潘晖等6人因离职不再符合激励条件，公司董事会将首次授予的激励对象由653人调整为647人，激励计划总授予数量由2,766.35万股调整为2,746.43万股，其中首次授予数量由2,493.20万股调整为2473.28万股，预留部分数量不变，仍为273.15万股。

本计划限制性股票的首次授予价格为本计划(草案)首次公告前20个交易日公司股票均价(40.83元/股)的50%即20.42元/股。预留限制性股票的授予价格在该部分限制性股票授予时由董事会遵循首次授予时的定价原则确定，即按照授予该部分限制性股票的董事会会议决议公告日前20个交易日公司股票均价的50%确定。

4、对股份限售期安排的说明：

本激励计划有效期为48个月，自标的股票的首次授予日起计算。

公司首次授予激励对象的限制性股票自首次授予之日起12个月为禁售期；预留限制性股票在该部分股票授予日起12个月为禁售期。禁售期内，激励对象通过本计划持有的限制性股票将被锁定不得转让。首次授予的限制性股票禁售期满后36个月为解锁期，在解锁期内，在满足本激励计划规定的解锁条件时，激励对象可分三次申请标的股票解锁，即:自首次授予日起12个月后至24个月内、24个月后至36个月内、36个月后至48个月内可分别申请解锁所获授限制性股票总量的40%、30%和30%。预留限制性股票禁售期满后，激励对象根据授予时间分期申请标的股票的解锁，即:本计划生效后12个月内授予的预留限制性股票自该部分预留限制性股票授予日起12个月后至24个月内、24个月后至36个月内可分别申请解锁所获授限制性股票总量的50%、50%;本计划生效后第12个月后至第24个月内授予的限制性股票自该部分预留限制性股票授予日12个月后至本计划有效期满可一次性申请解锁所获授限制性股票。

(二)已履行的相关审批程序

1、2013年8月22日，公司召开的第四届董事会第十九次会议审议通过了《浙江大华技术股份有限公司2013年限制性股票激励计划(草案)》，公司独立董事对此发表了独立意见，此后公司向中国证监会上报了申请备案材料。

2、根据中国证监会的反馈意见，公司修订了限制性股票激励计划，并于2013年11月8日召开了第四届董事会第二十一次会议，审议通过了《浙江大华技术股份有限公司2013年限制性股票激励计划(草案)修订稿》，公司独立董事对此发表了独立意见，该修订稿已经中国证监会备案无异议。

3、2013年11月28日，公司召开的2013年第三次临时股东大会审议通过了《浙江大华技术股份有限公司2013年限制性股票激励计划(草案)修订稿》。

4、2014年3月14日，公司召开的第四届董事会第二十四次会议，审议通过了《关于调整限制性股票激励计划激励对象名单、授予数量的议案》、《关于向激励对象授予限制性股票的议案》，公司独立董事对本次限制性股票激励计划授予相关事项发表了独立意见，公司第四届监事会第十六次会议亦就激励对象资格发表了核查意见。

二、限制性股票授予条件成就情况的说明

(一)公司激励计划中限制性股票授予条件的规定如下：

1、公司向激励对象授予标的股票时须未发生如下任一情形：

(1)最近一个会计年度的财务会计报告被注册会计师出具否定意见或者无法表示意见的审计报告；

(2)最近一年内因重大违法违规行为被中国证监会予以行政处罚；

(3)中国证监会认定不能实行股权激励计划的其他情形。

公司发生上述情形时，不得向激励对象授予标的股票，且本股权激励计划同时终止。

2、公司向激励对象授予标的股票时，激励对象未发生如下任一情形：

(1)最近3年内被证券交易所公开谴责或宣布为不适当人选的；

(2)最近3年内因重大违法违规行为被中国证监会予以行政处罚的；

(3)具有《公司法》规定的不得担任公司董事、监事、高级管理人员情形的；

(4)激励对象在本计划实施前一年度的绩效考核中不合格。

3、公司向激励对象授予标的股票时，公司业绩应当符合以下条件:2013年度归属于母公司所有者的净利润比上年同期增长不低于60%。

(二)董事会对授予条件已经成就的说明

1、经董事会审核，公司最近一个会计年度财务会计报告未被注册会计师出具否定意见或者无法表示意见的审计报告;公司最近一年内未因重大违法违规行为被中国证监会予以行政处罚;公司不存在被中国证监会认定的不能实行股权激励计划的其他情形。

2、公司2013年度财务报告已经立信会计师事务所审计并出具了标准无保留的审计意见。经审计确认，公司2013年度实现归属于上市公司股东的净利润11.31亿元，同比增长61.52%，归属于上市公司股东的扣除非经常性损益的净利润为11.15亿元，同比增长62.52%，上述指标达到激励计划设定的公司业绩考核条件。

3、经董事会审核，除原激励对象赵峰、韩春晓、杨江华、陶军、田青、潘晖等6人因离职不再符合激励条件外，公司其余激励对象最近3年内均未被证券交易所公开谴责或宣布为不适当人选;最近3年内均未因重大违法违规行为被中国证监会予以行政处罚;作为公司高级管理人员的激励对象的任职资格均符合《公司法》及相关法律法规的规定;激励对象均不存在公司董事会认定的其他严重违反公司有关规定或严重损害公司利益的情形;个人绩效考核均达到合格标准,符合限制性股票的授予条件。

综上所述，公司本次限制性股票的授予条件已经成就。

三、对本次授予限制性股权激励对象情况的说明

(一)除原激励对象赵峰、韩春晓、杨江华、陶军、田青、潘晖等6人因离职不再符合激励条件，截至2014年3月14日，具备本激励计划对象资格的人员共计647人，公司监事会对激励计划中的激励对象名单进行了再次审核，确认其作为公司激励计划激励对象的主体资格合法、有效。

(二)经董事会核查，作为公司高级管理人员的激励对象在授予日前6个月未有买卖本公司股票的情况。

四、对激励对象名单、授予数量进行调整的情况说明

鉴于原激励对象赵峰、韩春晓、杨江华、陶军、田青、潘晖等6人因离职不再符合激励条件，董事会对首次授予限制性股票的对象及其授予数量进行了调整，将首次授予的激励对象由653人调整为647人，激励计划总授予数量由2,766.35万股调整为2,746.43万股，其中首次授予数量由2,493.20万股调整为2473.28万股，预留部分数量不变，仍为273.15万股。

除上述调整外，本次实施的激励计划与已披露的激励计划不存在差异。

本次授予不会导致公司股权分布不具备上市条件。

五、本次限制性股票的授予情况

(一)授予股份种类:本激励计划拟授予激励对象的标的股票为大华股份限制性股票。

(二)股票来源:本激励计划拟授予激励对象的标的股票的来源为向激励对象定向发行人民币普通股股票。

(三)授予日:授予日为2014年3月14日。

(四)授予价格:授予价格为20.42元。

(五)限制性股票具体分配情况如下：

序号	姓名	职务	获授股票数量(万股)	获授股票占标的股票总数的比例	获授股票占公司总股本的比例
1	吴坚	董事会秘书、副总裁	11.24	0.41%	0.01%
2	魏美钟	财务总监、副总裁	11.24	0.41%	0.01%
3	张兴明	副总裁	12.84	0.47%	0.01%
4	沈惠良	副总裁	12.68	0.46%	0.01%
5	陈雨庆	副总裁	12.68	0.46%	0.01%
6	应勇	副总裁	11.24	0.41%	0.01%
7	吴云龙	副总裁	10.6	0.39%	0.01%
8	燕刚	副总裁	11.24	0.41%	0.01%
9	鲁丹丹	副总裁	10.76	0.39%	0.01%
10	张伟	副总裁	12.5	0.46%	0.01%
11	核心技术(业务)人员共计637人		2356.26	85.79%	2.06%
12	预留部分		273.15	9.95%	0.24%
合 计			2746.43	100.00%	2.40%

六、实施本次激励计划对相关年度财务状况和经营成果影响的说明

根据《企业会计准则第11号——股份支付》的规定，公司本次激励计划股票的授予对公司相关年度的财务状况和经营成果将产生一定的影响。董事会已确定激励计划的授予日为2014年3月14日，计算成本将以授予日公司股票的收盘价(31.40元/股)为依据按年进行分摊。

经测算，预计激励计划实施对公司各期经营业绩的影响如下：

项？目	2014年	2015年	2016年	2017年
对净利润的影响(万元)	-4,421.58	-2,129.22	-232.15	-4.56
对每股收益的影响(元/股)	-0.04	-0.02	0.00	0.00

上述对公司财务状况和经营成果的影响最终结果将以会计师事务所出具的年度审计报告为准。

七、激励对象认购限制性股票及缴纳个人所得税的资金全部自筹，公司承诺不为激励对象依本计划获取标的股票提供贷款以及其他任何形式的财务资助，包括为其贷款提供担保。

八、监事会对激励对象名单核实的情况

公司监事会对激励对象名单进行了核查，监事会认为：

1、原激励对象赵峰、韩春晓、杨江华、陶军、田青、潘晖等6人因离职不再符合激励条件，公司董事会拟对首次授予限制性股票的对象及其授予数量进行调整，激励计划总授予数量由2,766.35万股调整为2,746.43万股，其中首次授予数量由2,493.20万股调整为2473.28万股，预留部分数量不变，仍为273.15万股；首次授予限制性股票的激励对象由653人调整为647人。本次调整符合《上市公司股权激励管理办法(试行)》、《股权激励有关备忘录1-3号》等相关规定。

2、除前述因离职而失去激励资格的激励对象以外，本次授予的激励对象均为在公司(含控股子公司、分公司)任职人员，符合《公司法》、《证券法》、《公司章程》等法律、法规和规范性文件规定的任职资格，不存在最近三年内被证券交易所公开谴责或宣布为不适当人选，也不存在最近三年内因重大违法违规行为被中国证监会予以行政处罚的情形，符合《上市公司股权激励管理办法(试行)》、《股权激励有关备忘录1-3号》规定的激励对象条件，其作为公司本次股权激励计划的激励对象的主体资格合法、有效。

3、除前述因离职而失去激励资格的激励对象以外，公司本次授予限制性股票的激励对象名单与股东大会批准的激励对象名单相符。

九、独立董事关于公司激励计划授予相关事项发表的意见

独立董事认为：

1、鉴于原激励对象赵峰、韩春晓、杨江华、陶军、田青、潘晖等6人因离职不再符合激励条件，公司董事会对激励对象名单、授予数量进行了调整，符合《上市公司股权激励管理办法(试行)》、《股权激励有关事项备忘录1-3号》、《中小企业板信息披露业务备忘录第9号:股权激励限制性股票的取得与授予》以及公司激励计划中的规定，同意董事会对激励对象人数、授予数量进行调整。

2、本次授予限制性股票的授予日为2014年3月14日，该授予日符合《上市公司股权激励管理办法(试行)》、《股权激励有关事项备忘录1-3号》、《中小企业板信息披露业务备忘录第9号:股权激励限制性股票的取得与授予》以及公司限制性股票激励计划中关于授予日的相关规定，同时本次授予也符合公司限制性股票激励计划中关于激励对象获授限制性股票的条件，同意确定公司限制性股票激励计划的授予日为2014年3月14日。

3、公司本次限制性股票激励计划所确定的授予限制性股票激励对象不存在禁止获授限制性股票的情形，激励对象的主体资格合法、有效且激励对象范围的确定符合公司实际情况以及公司业务发展的实际需要，同意激励对象获授限制性股票。

十、法律意见书的结论意见

北京国枫凯文律师事务所对公司2013年限制性股票激励计划授予相关事项出具的法律意见书认为:大华股份董事会授予限制性股票的批准与授权、授予日确定、授予条件成就等事项，均符合《公司法》、《证券法》、《管理办法》、《备忘录》、本次激励计划及股东大会对董事会的授权，合法、有效。

十一、备查文件

1、第四届董事会第二十四次会议决议;

2、第四届监事会第十六次会议决议;

3、独立董事关于相关事项的独立意见;

4、北京国枫凯文律师事务所出具的法律意见书。

特此公告。

浙江大华技术股份有限公司董事会
2014年3月14日

证券代码:002236　　证券简称:大华股份　　公告编号:2014-017

浙江大华技术股份有限公司
关于举办投资者接待日活动的公告

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、误导性陈述或重大遗漏。

浙江大华技术股份有限公司(以下简称“公司”)已于2014年3月17日披露了《2013年年度报告》，为便于广大投资者深入全面地了解公司情况，公司将举办投资者接待日活动，现就有关事项公告如下：

一、接待时间

2014年4月30日(星期三)下午13:00-15:00。

二、接待地点

浙江省杭州市滨江区滨安路1199号公司会议室。

三、预约方式

参与投资者请于2014年4月24~25日，上午9:00-11:30，下午13:30-15:00，与公司证券投资部联系，以便接待登记和安排。

联系人:李晓明，电话:0571-28939522，传真:0571-28051737。

四、公司参与人员

董事长兼总裁傅利泉先生、董事会秘书兼副总裁吴坚先生、财务总监兼副总裁魏美钟先生(如有特殊情况，参与人员会有调整)。

五、注意事项

1、来访个人投资者请携带个人身份证原件及复印件、证券账户卡原件及复印件，机构投资者携带机构相关证明文件及其复印件，公司将对来访投资者的上述证明性文件进行查验并存档复印件，以备监管机构查阅。

2、保密承诺:公司将按照深圳证券交易所的规定，要求投资者签署《承诺书》。

3、为提高接待效率，在接待日前，投资者可通过电话、邮件等形式向证券投资部提出所关心的问题，公司针对相对集中的问题形成答复意见。

衷心感谢广大投资者对公司的关心和支持!欢迎广大投资者积极参与!

浙江大华技术股份有限公司
董事会
2014年3月14日

(上接B10版)

(69)上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

办公地址:上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层

法定代表人:张跃伟

联系人:敖玲

电话:021-58788678-8201

传真:021-58787698

客服电话:400-089-1289

公司网站:www.erichfund.com

(二)注册登记机构:东吴基金管理有限公司

注册地址:上海市浦东新区源深路279号(200135)

办公地址:上海市浦东新区源深路279号(200135)

法定代表人:任少华

联系人:吴靖

电话:021-50509888

传真:021-50509884

客户服务电话:4008210588

网站:www.scfund.com.cn

(三)律师事务所和经办律师

名称:北京市君泽君律师事务所

住所:北京市西城区金融大街9号金融街中心南楼六层

办公地址:北京市西城区金融大街9号金融街中心南楼六层

负责人:陶修明

电话:010-66523388

传真:010-66523399

经办律师:王勇、余红征

(四)会计师事务所和经办注册会计师

名称:江苏天衡会计师事务所有限公司

注册地址:南京市正洪街18号东宇大厦8楼

办公地址:南京市正洪街18号东宇大厦8楼

法定代表人:余瑞玉

经办注册会计师:读建忠　魏娜

电话:025-84711188

传真:025-84716883

四、基金的名称

本基金名称:东吴中证新兴产业指数证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型:股票型指数基金

六、基金的投资目标

本基金采用指数化投资，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年化跟踪误差不超过4%，以实现对标的指数的有效跟踪。

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，包括标的指数成份股、备选成份股、新股(一级市场初次发行或增发)、现金或者到期日在一年以内的政府债券等。其中，中证新兴产业指数成份股、备选成份股的投资比例不低于基金资产的90%，现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

因基金规模或市场变化等因素导致本基金投资组合不符合上述规定的，基金管理人将在10个工作日内调整至符合上述规定。法律、法规另有规定的，从其规定。

八、基金的投资策略

1、股票投资组合的构建

本基金对中证新兴产业指数进行完全复制，在初始建仓期或者为申购资金建仓时，本基金按照中证新兴产业指数各成份股所占权重逐步买入。在买入过程中，本基金采取相应的交易策略降低建仓成本，力求跟踪误差最小化。在投资运作过程中，本基金以标的指数权重为标准配置个股，并进行适时调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

2、股票投资组合的调整

(1)组合调整原则

本基金为完全复制的指数型基金，基金所构建的指数化投资组合将根据基准指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时，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、配股增发因素等变化，对基金投资组合进行适时调整，以保证基金净值增长率与业绩比较基准间的高度正相关和跟踪误差最小化。

(2)组合调整方法

1)定期调整

本基金所构建的指数化投资组合将定期根据中证新兴产业指数对其成份股的调整而进行相应的跟踪调整。本基金将按照标的指数对成份股及其权重的调整方案，在考虑跟踪误差风险的基础上，对股票投资组合进行相应调整。

2)不定期调整

在一些特殊情况下，我们将适当调整投资标的。

①根据指数编制规则，当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时，本基金将根据标的指数权重比例的变化，进行相应调整。

②当标的指数成份股因停牌、流动性不足等因素导致基金无法按照指数权重进行配置，基金管理人将综合考虑跟踪误差和投资者利益，选择相关股票进行适当的替代。

③根据本基金的申购赎回情况，对组合进行相应调整，力求达到跟踪误差最小化。

3)在其他不影响指数复制的情况下，本基金管理人可以根据市场情况，在跟踪误差最小化的条件下，对基金资产组合进行适当的调整。

3、替代成份股的构建

本基金选择其他中证新兴产业指数成份股或备选成份股构建替代成份股。具体按照以下流程进行替代成份股的筛选：

(1)在中证新兴产业指数成份股中，筛选出被替代股票所在细分行业内的股票，作为替代成份股的备选池。

(2)通过“东吴优化筛选模型”筛选相同行业成份股进行替代，以估计替代时间的长短，作为模型计算的时间区间;

(3)使用东吴优化筛选系统计算出替代成份股的比例之后，由行业分析师对初选结果进行复议，从基本面角度考察用于替代的成分股是否合适用于替换目的，并酌情进行调整。

4、基金组合的优化策略

本基金对由于仓位限制、基金费用、成份股调整、申购赎回等因素会产生的跟踪误差，采取适当策略进行修正。

(1)成份股权重策略

针对建仓期间仓位未达到目标水平、应付赎回、配股增发的现金预留引起仓位不足、申购资金与分红资金等资金流入导致仓位不足、换股期间成分股操作引起仓位变动等导致基金仓位低于基准而产生的跟踪误差，该策略根据降低跟踪误差的原则，通过衡量相应成份股的基本面和流动性，在指数成份股标准权重的基础上进行微调。

(2)交易策略

针对由于基金管理费、托管费、交易费用、冲击成本等因素产生的跟踪误差，该策略主要通过在基金建仓和成份股调整时，低买高卖或提前建仓以减小冲击成本等进行修正。

5、跟踪误差控制

本基金主要通过“跟踪误差”和“跟踪偏离度”两个指标，对跟踪误差进行控制管理，确保基金对指数的紧密跟踪。

(1)跟踪误差

[illegible]

(2)跟踪偏离度

跟踪偏离度=前n日基金净值累计收益率-前n日基金业绩比较基准累计收益率

本基金定期计算基金组合的跟踪误差和跟踪偏离度，确保单日基金跟踪偏离度不高于0.35%，年度跟踪误差不超过4%。特殊情况下，本基金通过定性研究和定量分析方法，对基金资产组合进行适当调整，以期在约定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。

6、债券投资策略

本基金采取积极的债券投资管理策略。采用自上而下的方式制定具体投资策略，考虑的主要因素是:宏观经济走势、资金供求状况、基础利率、债券收益率曲线、市场波动等。基金管理人将根据利率变化的大周期、市场运行的小周期和中国债券市场的固定特性，结合基金申购赎回的情况，判断基金对流动性的需求，制定相应的债券投资策略。

本基金债券投资主要是流动性管理的需要、获取适当收益、因此债券投资以流动性好，风险较小的短期政府债券为主;中国的债券市场处于扩张阶段，品种不断丰富、衍生工具有所增加，本基金的债券投资将注重创新品种的选择和创新工具的运用，以流动性好、风险低的品种作为投资目标。

九、业绩比较基准

基金业绩比较基准=95%*中证新兴产业指数收益率　+5%*银行同业存款利率

中证新兴产业指数由中证指数有限公司编制并发布。该指数精选在上海证券交易所和深圳证券交易所中上市的规模大、流动性好的100家新兴产业公司作为样本，综合反映了沪深证券市场中新兴产业公司的整体表现。

本基金认为，该业绩比较基准目前能够有效地反映本基金的风险收益特征。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，本基金可以在履行适当程序后变更业绩比较基准。经与基金托管人协商一致，并在中国证监会指定的媒体以及公司网站上公告。

十、风险收益特征

本基金属于股票型基金，预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金以及混合型基金。本基金为指数型基金，紧密跟踪中证新兴产业指数，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中预期风险较高、预期收益也较高的品种。

十一、基金投资组合报告

东吴中证新兴产业指数证券投资基金(以下简称“本基金”)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农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年1月17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。

1、截至2013年12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	845,975,169.02	93.79
	其中:股票	845,975,169.02	93.79
2	固定收益投资	19,947,000.00	2.21
	其中:债券	19,947,000.00	2.21
	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	35,733,261.13	3.96
6	其他资产	356,610.48	0.04
7	合计	902,012,040.63	100.00

2、截至2013年12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

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	8,179,407.32	0.91
B	采矿业	15,999,524.32	1.78
C	制造业	642,498,823.40	71.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,348,243.68	1.82
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	96,147,034.96	10.68
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	4,813,861.44	0.53
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	783,986,895.12	87.11

(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	8,871,456.00	0.99
B	采掘业	-	-
C	制造业	26,533,121.40	2.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,260,768.70	0.92
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,604,101.00	1.07
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	8,718,826.80	0.97
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	61,988,273.90	6.89

3、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

(1)截至2013年12月31日期末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	000778	新兴铸管	2,160,449	13,762,060.13	1.53
2	600276	恒瑞医药	254,410	9,662,491.80	1.07