

(上接B22版)

沪深300指数是沪深证券交易所第一次联合发布的反映A股市场整体走势的指数,它覆盖了沪深市场六成左右的市值,其走势与A股市场主要指数相关性高,具有良好的市场代表性。此外,该指数行业比重与沪深两市高度一致,体现出较强的行业代表性,能有效分散投资组合中的非系统性风险。

上证国债指数是国内目前跟踪范围最广的国债指数之一,具有良好的市场代表性。

6. 不可操纵性
由于本基金业绩比较基准和所采用指数具有较好的市场代表性,遵循客观的编制规则,具有较强的知名度和权威性,指数的编制规则合理、科学、透明,也保证了该指数的不可操纵性。

十一、基金的风险收益特征

本基金为股票型证券投资基金,预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金与货币市场基金,在证券投资基金中属于较高风险,较高预期收益的基金品种。

十二、基金投资组合报告

基金管理人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股份有限公司对本招募说明书中的基金投资组合报告和基金业绩中的数据进行复核。

本投资组合报告所载数据截至2013年6月30日(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	878,294,680.85	77.96
	其中:股票	878,294,680.85	77.96
2	固定收益投资	9,966,000.00	0.88
	其中:债券	9,966,000.00	0.88
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	100,320,470.48	8.90
	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	136,728,751.95	12.14
6	其他资产	1,324,133.26	0.12
7	合计	1,126,634,036.54	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	40,293,710.31	3.59
B	采矿业	11,406,398.25	1.02
C	制造业	439,164,778.60	39.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,064,329.86	0.90
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	48,047,284.85	4.28
G	交通运输、仓储和邮政业	19,800,869.76	1.77
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	176,795,923.30	15.77
J	金融业	115,270,711.28	10.28
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	10,961,878.20	0.98
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	6,488,795.25	0.58
S	综合	-	-
	合计	878,294,680.85	78.32

代码	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	600060	中信证券	7,355,273	76,421,286.47	6.81
2	600406	国电南瑞	4,064,559	60,683,865.87	5.41
3	600030	中信证券	5,326,275	53,958,204.75	4.81
4	002255	瀚蓝理工	2,518,506	43,118,303.20	3.86
5	002477	鼎泰新材	2,551,450	40,293,711.50	3.59
6	000063	中兴通讯	2,499,869	31,873,329.75	2.84
7	000100	TCL集团	13,000,000	29,510,000.00	2.63
8	002065	东方软件	1,488,761	29,477,840.80	2.63
9	002437	新宙斯药业	1,040,434	26,603,897.38	2.37
10	002104	新奥股份	2,035,515	26,278,498.65	2.34

证券简称:天威保变 证券代码:600550 编号:临2013-036
债券简称:11天威债 债券代码:122083

保定天威保变电气股份有限公司第五届董事会第二十三次会议决议公告

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。

一、董事会会议召开情况

保定天威保变电气股份有限公司(以下简称“天威保变”或“公司”)于2013年8月12日以传真或送达方式发出召开公司第五届董事会第二十三次会议的通知,于2013年8月13日以通讯表决方式召开了第五届董事会第二十三次会议,公司共有12名董事,11名董事参加了本次会议(公司董事长董克庆先生因出差未能参与本次会议表决),本次会议召开符合有关法律、行政法规、部门规章、规范性文件及公司章程的规定。

二、董事会会议审议情况

(一)审议通过了《关于对下属子公司实施债权转股的议案》

受国际经济形势及新能源产业形势影响,公司全资子公司保定天威风电科技有限公司(以下简称“天威风电”)、保定天威风电叶片有限公司(以下简称“天威叶片”)、天威新能源(长春)有限公司(以下简称“天威长春”)、保定天威薄膜光伏有限公司(以下简称“天威薄膜”)债务负担较重,财务费用较高,为解决上述四家新能源子公司的资金压力,降低企业资产负债率,提升企业的融资能力,公司将将之前向四家新能源子公司提供的委托贷款以股权转让的方式行转资金注入。
1.关于对天威风电实施债权转股的议案(该议案同意票11票,反对票0票,弃权票0票)
2.关于对天威叶片实施债权转股的议案(该议案同意票11票,反对票0票,弃权票0票)
3.关于对天威长春实施债权转股的议案(该议案同意票11票,反对票0票,弃权票0票)
4.关于对天威薄膜实施债权转股的议案(该议案同意票11票,反对票0票,弃权票0票)
投赞成票上述四家子公司仍为公司全资子公司。

鉴于本次债权转股过程中相关权益,公司将上述四家公司本次债权转股的相关信息,包括但不限于签署本次债权转股过程中相关权益。

详见同日披露于上海证券交易所网站http://www.sse.com.cn,《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上的《保定天威保变电气股份有限公司关于对全资子公司实施债权转股的对外投资公告》。

此议案尚需提交公司2013年第三次临时股东大会审议。
(二)审议通过了《关于召开公司2013年第三次临时股东大会的议案》(该议案同意票11票,反对票0票,弃权票0票)。
鉴于本次董事会审议通过的有关议案需提交股东大会审议,提议召开2013年第三次临时股东大会,具体事项详见同日披露于上海证券交易所网站http://www.sse.com.cn,《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上的《保定天威保变电气股份有限公司关于召开公司2013年第三次临时股东大会的通知》。

保定天威保变电气股份有限公司董事会	
2013年8月14日	

证券简称:天威保变 证券代码:600550 编号:临2013-037
债券简称:11天威债 债券代码:122083

保定天威保变电气股份有限公司关于对全资子公司实施债转股的外 对外投资公告

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。

重要内容提示:

●债券简称:保定天威风电科技有限公司(以下简称“天威风电”)、保定天威风电叶片有限公司(以下简称“天威叶片”)、天威新能源(长春)有限公司(以下简称“天威长春”)、保定天威薄膜光伏有限公司(以下简称“天威薄膜”)

●债券金额:保定天威保变电气股份有限公司(下称“天威保变”、“公司”或“本公司”)对上述四家全资子公司实施债转股,对天威风电实施债转股增资9,475万元人民币,其中5,141.25万元转为注册资本,42,063.75万元转为资本公积;对天威叶片实施债转股增资21,436万元人民币;对天威长春实施债转股增资15,420万元人民币;对天威薄膜实施债转股增资49,758万元人民币。

增资完成后上述四家子公司仍为公司全资子公司。

一、对外投资概述

4.报告期末按债券品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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,966,000.00	0.89
	其中:政策性金融债	9,966,000.00	0.89
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	9,966,000.00	0.89

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	120238	12国开38	100,000	9,966,000.00	0.89

注:本基金本报告期末仅持有上述债券。

注:本基金本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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

注:本基金本报告期末前十名资产支持证券明细

注:本基金本报告期末前十名资产支持证券明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

8.报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
注:本基金本报告期末未持有股指期货。

9.投资组合报告附注

9.1.本基金投资的前十名证券的发行主体本期不存在被监管部门立案调查,或在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
9.2.本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库之外的情形。
9.3.其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	667,943.98
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	412,095.98
5	应收申购款	244,093.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,324,133.26

9.4.报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

9.5.报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

9.6.投资组合报告附注的其他文本描述说明

由于四大重仓个股,各占比较大的持仓和与合计可能有尾差。

10.基金的业绩
本基金管理人恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的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。投资者有风险,投资者做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

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标准差③	①-③	②-③
2009.07.01-2009.12.31	9.53%	1.32%	10.82%	-1.39%	-0.38%
2010.01.01-2010.12.31	5.96%	1.58%	9.12%	-3.16%	-0.32%
2011.01.01-2011.12.31	-41.78%	1.42%	-19.67%	-22.11%	0.38%
2012.01.01-2012.12.31	2.27%	1.24%	7.04%	-4.77%	0.22%
2013.01.01-2013.06.30	2.81%	1.30%	-9.86%	12.67%	0.10%
自基金合同生效日至2013.06.30	-28.95%	1.40%	-21.88%	7.07%	0.18%

十、基金的费用与税收

(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)基金合同生效后的信息披露费用;

(4)基金份额持有人大会费;

(5)基金合同生效后至基金有关的会计师事务所和律师费;

(6)基金的证券交易费用;

(7)基金管理人委托支付的银行费用;

(8)基金上市初费和上市费;

(9)按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

2.上述基金费用由基金管理人按法律法规规定的范围和比例按公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

3.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年费率计算。计算方法如下:

H= E×年管理费率÷当年天数,本基金年管理费率为1.5%

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

(2)基金托管人的托管费

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计算。计算方法如下:

H= E×年托管费率÷当年天数,本基金年托管费率为0.25%

H为每日应计提的基金托管费

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

(3)上述(一)至(三)项费用由基金托管人根据其他有关法律法规及相应协议的约定,按费用支出金额支付,列入或摊入当期基金费用。

4.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财产的损失,以及处理与基金运作无关的事项而发生的费用均不列入基金费用。

5.基金管理人及基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费和基金托管费率,降低基金管理费和基金托管费率,无需召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施前在指定媒体和基金管理人网站上刊登公告。

(二)与基金销售有关的费用

与基金销售有关的费用主要包括基金的认购费、申购费、赎回费、转换费等,上述费用具体的费率、计算方法、收取使用方式等内容参见本基金招募说明书“八、基金的集中申购”、“九、基金份额的上市交易、申购、赎回与转换”。

(三)基金税收

本基金基金管理人根据中国法律法规的规定,履行纳税义务。

十五、对招募说明书更新部分的说明

报告期内需披露证券投资基金招募说明书依据《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》及其它有关法律法规的要求,对本基金原招股说明书进行了更新,主要更新内容如下:

- 在“重要提示”部分,更新了招股说明书内容的截止日期及相关财务数据的截止日期。
- 在“三、基金管理人”部分,对基金管理人的概况及主要人员情况进行了更新。
- 在“四、基金托管人”部分,对基金托管人的基本情况进行了更新。
- 在“五、相关服务机构”部分,增加开普证券有限责任公司、华鑫证券有限责任公司及五矿证券有限公司为代销机构,并更新了部分代销机构的资料;对本基金提供代销服务的会计师事务所的信息进行了更新。
- 在“九、基金份额的上市交易、申购、赎回与转换”部分,更新了本基金在深圳证券交易所对养老金客户实施特定申购、赎回费率的情况。
- 在“十、基金的投资”部分,更新了最近一期的投资组合报告。
- 在“十一、基金的业绩”部分,说明了基金合同生效至2013年6月30日的基金业绩情况。
- 在“二十二、对基金份额持有人的服务”部分,更新了为投资者提供电子交易与服务的内容。
- 在“二十三、其他应披露事项”,列出了自上次招股说明书更新截止日以来涉及本基金的其他应披露的重大事项。
- 对部分表述进行了更新。

银华基金管理有限公司关于对银华全球核心优选证券投资基金于2013年8月14日的申购、赎回及定期定额投资业务申请作无效处理的公告

公告送出日期:2013年8月15日

银华基金管理有限公司	
2013年8月15日	

5.公司类型:有限责任公司(法人独资)
6.经营范围:风力发电机组叶片及其机械部件、玻璃制品的设计、研发、制造、销售、试验、检测、维修、货物技术进出口。

截至2012年12月31日,天威叶片资产总额45,192.72万元,净资产4,441.83万元,负债总额40,750.88万元,资产负债率90.17%,净利润-11,332.27万元。截止2013年3月31日,天威叶片资产总额42,078.40万元,净资产2,916.10万元,负债总额39,162.24万元,资产负债率率93.07%,净利润-1,539.00万元。

本次对上述四家全资子公司实施债转股增资事项前提交公司2013年第三次临时股东大会审议通过。

此次对外投资不属于关联交易和重大资产重组事项。

(二)增资方案基本情况

根据天信会计师事务所(特殊普通合伙)出具的截止2013年6月30日的拟实施债权转股权益情况的《审计报告》(大信审字[2013]第1-00728号),截止2013年6月30日,公司向天威风电提供委托贷款余额93475.00万元。

公司将拟将93,475万元委托贷款中的51,411.25万元转为注册资本,42,063.75万元转为资本公积。
在公司对天威风电实施债权转股完成后,天威风电注册资本为76,411.25万元,本公司仍持有其100%的股权,天威风电的资产负债率将下降95%左右。

2.天威叶片增资基本情况

根据天信会计师事务所(特殊普通合伙)出具的截止2013年6月30日的拟实施债权转股权益情况的《审计报告》(大信审字[2013]第1-00727号),截止2013年6月30日,公司向天威叶片提供委托贷款余额21,436万元。

公司将拟将21,436万元委托贷款全部转为注册资本。
在公司对天威叶片实施债权转股完成后,天威叶片注册资本为41,436万元,本公司仍持有其100%的股权,天威叶片的资产负债率将下降50%左右。

3.天威长春增资基本情况

根据天信会计师事务所(特殊普通合伙)出具的截止2013年6月30日的拟实施债权转股权益情况的《审计报告》(大信审字[2013]第1-00728号),截止2013年6月30日,公司向天威长春提供委托贷款余额15,420万元。公司将拟将15,420万元委托贷款全部转为注册资本。

在公司对天威长春实施债权转股完成后,天威长春注册资本为25,420万元,本公司仍持有其100%的股权,天威长春的资产负债率将下降30%左右。

4.天威薄膜增资基本情况

根据天信会计师事务所(特殊普通合伙)出具的截止2013年6月30日的拟实施债权转股权益情况的《审计报告》(大信审字[2013]第1-00724号),截止2013年6月30日,公司向天威薄膜提供委托贷款余额49,758万元。

公司将拟将49,758万元委托贷款全部转为注册资本。
在公司对天威薄膜实施债权转股完成后,天威薄膜注册资本为168,858万元,本公司仍持有其100%的股权,天威薄膜的资产负债率将下降30%左右。

本次债权转股实施后,四家子公司的注册资本变化情况如下:

公司名称	原注册资本(万元)	债转股注入注册资本的金额(万元)	债转股进入资本公积的金额(万元)	债转股后注册资本(万元)
天威风电	25,000	51,411.25	42,063.75	76,411.25
天威叶片	20,000	21,436	0	41,436
天威长春	10,000	15,420	0	25,420
天威薄膜	119,100	49,758	0	168,858

债转股完成后,天威风电、天威叶片、天威长春、天威薄膜仍为公司的全资子公司。

二、投资标的的基本情况

(一)天威风电

- 名称:保定天威风电科技有限公司
- 住所:保定市高新区创业路111号
- 法定代表人:孙福泉
- 注册资本:25000万元人民币
- 公司类型:有限责任公司(自然人投资或控股的法人独资)
- 经营范围:风力发电机组和组件、配件的设计、研发、制造、销售及试验、检测、维修;货物、技术进出口业务。

截至2012年12月31日,天威风电资产总额103,886.66万元,净资产17,922.26万元,负债总额121,808.94万元,资产负债率117.28%,净利润-23,077.02万元。截止2013年3月31日,天威风电资产总额102,858.77万元,净资产19,984.21万元,负债总额122,843.07万元,资产负债率119.43%,净利润-2,072.98万元左右。

(二)天威叶片

- 名称:保定天威风电叶片有限公司
- 住所:保定市朝阳北大街1089号
- 法定代表人:孙福泉
- 注册资本:20000万元人民币
- 公司类型:有限责任公司(自然人投资或控股的法人独资)
- 经营范围:风力发电机组叶片及其机械部件、玻璃制品的设计、研发、制造、销售及试验、检测、维修;货物、技术进出口业务。

截至2012年12月31日,天威风电资产总额103,886.66万元,净资产17,922.26万元,负债总额121,808.94万元,资产负债率117.28%,净利润-23,077.02万元。截止2013年3月31日,天威风电资产总额102,858.77万元,净资产19,984.21万元,负债总额122,843.07万元,资产负债率119.43%,净利润-2,072.98万元左右。

根据