鹏华行业成长证券投资基金

更新的招募说明书摘要

基金管理人：鹏华基金管理有限公司　基金托管人：中国工商银行股份有限公司

本基金经中国证监会 2002 年 4 月 15 日证监基金字[2002]13 号文件“关于同意鹏华行业成长证券投资基金设立的批复”批准发起设立。根据当时有效的法规，本基金基金合同已于 2002 年 5 月 24 日生效，基金管理人于该日起正式开始对基金财产进行运作。

重要提示

投资有风险，投资者申购基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据本基金的基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本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。

本基金的招募说明书已经本基金托管人复核。招募说明书所载内容截止日为 2006 年 11 月 23 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2006 年 9 月 30 日。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：鹏华基金管理有限公司

住所：深圳市深南东路 5047 号发展银行大厦 27 层

设立日期：1998 年 12 月 22 日

法定代表人：孙枫

办公地址：深圳市中心区益田路与福华三路交汇处深圳国际商会中心 43 层

联系电话：（0755）82021233

联系人：徐丽萍

股权结构：

出资人名称	出资额（万元）	出资比例
国信证券有限责任公司	7,500	50%
深圳市北融信投资发展有限公司	2,502	16.68%
方正证券有限责任公司	2,499	16.66%
安徽国元信托投资有限责任公司	2,499	16.66%
总 计	15,000	100%

（二）主要人员情况

1、基金管理人董事会成员

孙枫先生，董事长，国际金融专业硕士，高级会计师，中国注册会计师。历任武汉市经济研究所室负责人、副所长，武汉市一轻局副局长，武汉友谊复印机制造公司副经理，深圳市财政局企财处处长、办公室主任、党组成员、副局长，深圳市商业银行党委书记、董事长，深圳发展银行党委书记、董事长，现任鹏华基金管理有限公司党总支书记、董事长。

胡继之先生，董事，博士研究生，高级经济师。历任中国人民银行武汉市分行办公室副科长、金融研究所副所长、所长，中国人民银行深圳分行办公室负责人，深圳证券交易所总经理助理兼办公室主任、理事会秘书长、策划总监、纪委书记、党委委员、副总经理，现任国信证券有限责任公司总裁、党委副书记。

钱海章先生，董事，国际金融博士，高级经济师。历任中国银行绍兴分行会计部、调研部负责人，深圳国投证券有限责任公司投资管理部调研科副高级研究员，国信证券有限责任公司发展研究中心高级研究员、投资管理部特级研究员、资产管理委员会督察员兼秘书、交易监管部投资业务督察员兼副总经理、风险监管总部交易总监、投资管理委员会秘书兼止损执行委员，现任国信证券有限责任公司总裁助理兼投资管理总部总经理。

陈锐女士，董事，硕士。曾任方正证券有限责任公司经纪管理总部副总经理，现任方正证券有限责任公司投资管理总部副总经理。

过仕刚先生，董事。历任安徽省委政策研究室巡视员、安徽省委办公厅秘书，安徽省国际信托投资公司总经理助理、副总经理兼证券总部总经理，现任安徽国元信托投资有限责任公司董事长。

黄俞先生，董事，大学学历。曾在中农信公司、正大财务公司工作，现任深圳市北融信投资发展有限公司董事长。

郝珠江先生，独立董事，中国国际贸易仲裁委员会仲裁员，深圳市仲裁委员会委员、仲裁员。历任河南省高级人民法院经济审判庭庭长、审判委员会委员，深圳市中级人民法院行政审判庭庭长、审判委员会委员，深圳市中级人民法院副院长、党组成员，深圳市法制局局长、党组书记，深圳市人民政府行政复议办公室主任，深圳市人民政府法律顾问室主任，现任北京地平线律师事务所深圳分所律师。

方兆本先生，独立董事，美国匹兹堡大学统计学博士，中国科技大学教授，博士生导师。中国现场统计学会理事、中国概率统计学会理事，美国当代统计索引 CIS 通讯编辑，美国 ASA、IMS 会员。曾任中国科技大学数学系主任，现任中国科技大学商学院院长，全国政协常委，安徽省政协副主席。

柳青先生，独立董事，美国马凯大学法学院法学博士，美国律师协会会员，美国联邦法院认证律师。曾任美国卢德威尔律师事务所执业律师；美国克莱斯勒汽车公司法律部亚太地区法律顾问，兼大中国地区首席法律顾问；德国戴姆勒克莱斯勒公司全球投资兼并重组部高级法律顾问兼大中国地区首席法律顾问；现任福特汽车（中国）有限公司副总裁、法律总顾问。

黄世忠先生，独立董事，加拿大达尔豪西（Dalhousie）大学工商管理学院工商管理硕士、厦门大学管理学（会计学）博士。兼任全国会计硕士专业学位教育指导委员会委员、财政部会计准则委员会咨询专家、中国注册会计师协会审计准则委员会委员、中国会计学会常务理事和学术委员。历任厦门大学会计系副主任、厦门天健会计师事务所首席合伙人、厦门大学管理学院副院长，现任厦门国家会计学院副院长、厦门大学管理学院会计系教授、博士生导师。

孙煜扬先生，董事、总裁，经济学博士，法学硕士。历任贵州省政府经济体制改革委员会主任科员、中共深圳市委政策研究室副处长、深圳证券结算公司常务副总经理、深圳证券交易所首任行政总监、香港深业（集团）有限公司助理总经理、香港深业控股有限公司（上市公司）副总经理、中国高新技术产业投资管理有限公司董事长兼行政总裁，现任鹏华基金管理有限公司党总支副书记、总裁。

殷克胜先生，董事、常务副总裁，经济学博士。历任中国综合开发研究院副研究员，深圳证券管理办公室政策法规处副处长、公司处副处长、公司处处长，现任鹏华基金管理有限公司常务副总裁兼投资管理总部总经理。

2、基金管理人监事会成员

李国阳先生，监事，监事会召集人，硕士研究生，高级会计师，9 年证券从业经历。1994 年毕业于中南财经大学会计系，同年进入国信证券有限责任公司工作，历任审计部副总经理、证券二部副总经理、副总会计师、上海管理总部总经理，现任国信证券有限责任公司首席会计师兼资金财务部总经理。

朱天相先生，监事，经济学学士。历任江西省机械设备进出口公司财务部外贸单证管理员、会计员、主管会计，上海捷兴实业发展有限公司财务经理，上海海泰克贸易发展有限公司财务经理，中国高科集团股份有限公司财务主管、财务部总经理助理、副总经理、总经理，方正证券有限责任公司稽核监管部总经理、稽核总监，现任方正证券有限责任公司合规总监。

徐剑先生，监事，本科学历，会计师。曾在黄河证券有限公司、民生证券有限公司工作，历任财务部经理、营业部总经理、计划资金总部总经理，现任深圳市北融信投资发展有限公司财务总监。

孙泽女士，监事。历任四川省什邡市税务局税收专管员，曾在中国证券业协会从事财务出纳和信息管理工作，现任鹏华基金管理有限公司监察稽核部总监助理。

3、经营管理层人员情况

孙枫先生，简历同上。

孙煜扬先生，简历同上。

殷克胜先生，简历同上。

于波先生，副总裁，工学硕士，经济学博士研究生，加拿大多伦多大学访问学者。历任中国机械设备进出口总公司国外大型项目商务代表兼商务运输部总经理、深圳证券交易所北京代表处首席代表、创业板上市推广总监，现任鹏华基金管理有限公司副总裁兼营运总部总经理。

刘昊先生，党总支副书记兼营销管理总部总经理，管理学博士。历任广东发展银行深圳分行人事部总经理、国家开发银行深圳分行人事处处长。

吴伟先生，督察长，法学博士。曾就职于中国建设银行深圳市分行。2001 年 3 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任公司法律顾问、社保基金独立稽察员、监察稽核部副总监，现任公司督察长兼监察稽核部总监。

陈红女士，总裁助理兼总裁办公室总监，西南师范大学体育心理学专业。曾任国信证券有限责任公司人力资源部高级经理、投资银行综合管理部副总经理。2003 年加盟鹏华基金管理有限公司，历任上海分公司总经理、市场营销部总监。

4、本基金基金经理

2002 年 5 月至 2003 年 4 月 李文忠先生

2003 年 4 月至 2005 年 2 月 杨毅平先生

2005 年 2 月至 2006 年 11 月 杨建勋先生

2006 年 11 月至今 易贵海先生

易贵海先生，经济学硕士，12 年证券从业经验。曾在大鹏证券、兆富投资、长盛基金从事研究和投资工作，2004 年 2 月加盟鹏华基金管理有限公司从事基金管理工作，从 2004 年 8 月至今，担任普丰基金基金经理。2006 年 11 月担任鹏华行业成长基金经理。易贵海先生具备基金从业人员资格。

5、投资决策委员会成员的姓名和职务

投资决策委员会成员组成：公司常务副总裁殷克胜先生、投资总部副总经理郑毅先生、机构理财部总监兼研究总监黄钦来先生、基金管理部副总监管文浩先生以及鹏华行业成长基金兼普丰基金经理易贵海先生。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：姜建清

注册资本：人民币 286,509,130,026 元

联系电话：010－66106912

联系人：蒋松云

（二）主要人员情况

中国工商银行资产托管部共有员工 77 人，平均年龄 30 岁，90%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有硕士以上学位或高级职称。

（三）基金托管业务经营情况

作为中国首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国工商银行始终坚持“诚实信用、勤勉尽责”的原则，严格履行着资产托管人的责任和义务，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的业务管理模式、健全的托管业务系统、强大的市场营销能力，为广大基金份额持有人和众多资产管理机构提供安全、高效、专业的托管服务，取得了优异业绩。截至 2006 年 9 月，托管证券投资基金 67 只，其中封闭式 16 只，开放式 51 只。托管资产规模年均递增 73%。至今已形成包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社保基金、企业年金、产业基金、QFII 资产、履约类产品等十大类 14 项产品的托管业务体系。继 2004 年先后获得《亚洲货币》和《全球托管人》评选的“中国最佳托管银行”称号后，2005 年，又分别获得《财资》和《全球托管人》评选的“中国最佳托管银行”称号。

三、相关服务机构

（一）基金销售机构

1、直销机构：

（1）鹏华基金管理有限公司

住所：深圳市福田区福华三路与益田路交汇处深圳国际商会中心 43 层

法定代表人：孙枫

办公地址：深圳市福田区福华三路与益田路交汇处深圳国际商会中心 43 层

电话：（0755）82021233

传真：（0755）82021155

联系人：徐丽萍

网址：www.phfund.com.cn

（2）鹏华基金管理有限公司北京分公司

办公地址：北京市海淀区三里河路 13 号中国建筑文化中心北塔楼 10 层

电话：（010）88082426

传真：（010）88082018

联系人：王乃力

（3）鹏华基金管理有限公司上海分公司

办公地址：上海市陆家嘴环路 958 号华能联和大厦 3010 室

电话：（021）58825962

传真：（021）68866470

联系人：李化怡

2、代销机构：

（1）中国工商银行

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

电话：（010）66107900

传真：（010）66107914

联系人：田耕

客户服务电话：95588（全国统一号码）

（2）深圳发展银行

住所：深圳市深南中路 5047 号

法定代表人：法兰克纽曼(Frank N. Newman)

办公地址：深圳市深南中路 5047 号

电话：0755－82088888－8811

传真：0755－82081020

联系人：周勤

网址：www.sdb.com.cn

热线电话：95501

（3）中信建投证券有限责任公司(原华夏证券股份有限公司)

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

法定代表人：黎晓宏

办公地址：北京市朝阳门内大街 188 号

联系电话：(010)65186080

传真：(010)65182261

联系人：魏明

客户服务电话：400－8888－108(免长途费)

网址：中信建投证券网 www.csc108.com

（4）国泰君安证券股份有限公司

住所：上海市浦东新区商城路 618 号

法定代表人：祝幼一

办公地址：上海市延平路 135 号

客户服务电话：（021）962588、800－820－6888

联系电话：021－62580818－213

传真：（021）62583439

联系人：芮敏祺

网址：www.gtja.com

（5）国信证券有限责任公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16－26 层

法定代表人：何如

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 21 层

客户服务电话：800－810－8868

联系电话：（0755）82133066

传真：（0755）82133302

联系人：林建闽

（6）联合证券有限责任公司

住所：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 10、24、25 层

法定代表人：马国强

办公地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 10、24、25 层

联系电话：（0755）82493561

传真：（0755）82492187

联系人：盛宗凌

（二）注册与过户登记人

注册与过户登记人：鹏华基金管理有限公司

住所：深圳市福田区福华三路与益田路交汇处深圳国际商会中心 43 层

法定代表人：孙枫

办公地址：深圳市福田区福华三路与益田路交汇处深圳国际商会中心 43 层

联系电话：（0755）82021106、82021109

联系人：吴群莉、潘艳梅

（三）律师事务所与经办律师

律师事务所：北京市德恒律师事务所

住所：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 12 层

负责人：王丽

办公地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 12 层

电话：（010）66575888

传真：（010）65232181

联系人：苏文静

经办律师：陈静茹、高国富

（四）会计师事务所和经办注册会计师

会计师事务所：普华永道中天会计师事务所有限公司

住所：上海市浦东新区沈家弄 325 号

法定代表人：Kent Watson

办公地址：上海市淮海中路 333 号瑞安广场 12 楼

电话：(021)63863388

传真：(021)63863300

联系人：陈兆欣

经办注册会计师：汪棣、单峰

四、基金的名称

本基金名称：鹏华行业成长证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型：混合型

六、基金的投资目标

在控制风险的前提下谋求基金财产的长期稳定增值。

七、基金的投资方向

本基金的投资方向为具有良好流动性的金融工具，主要包括国内依法发行、上市的股票、债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其它金融工具。其中，投资重点是预期营业收入或净利润增长率超过行业平均水平的成长性上市公司所发行的股票，这部分投资比例将不低于本基金股票资产的 80%。

八、基金的投资策略

（一）投资理念

本基金的投资理念是“投资在于把握未来价值”。

本基金认为股票价格变动主要是体现投资者对未来的预期，因此投资应该从基本面分析入手，坚持对股票未来价值的挖掘，包括对行业未来变动趋势的准确判断和对上市公司未来成长性的合理预测。

（二）投资策略

1、一级资产配置

基金管理人的投资决策委员会在综合考虑宏观经济形势、政策变动以及市场走势等因素的前提下及时调整基金财产中股票、债券和现金的配置比例。

2、股票投资

在基金一级资产配置中股票的投资比例确定之后，本基金通过两次优化配置最终完成投资组合的构建。

（1）以行业为导向进行资产配置

把握各行业发展趋势和市场波动特征，并对行业资产进行科学配置，是本基金投资的核心。本基金在对影响行业投资收益的众多因素进行深入分析的基础上，运用数量化和系统化的资产配置模型—最优行业表现资产配置模型（BPS），及时调整各行业的投资权重。

（2）成长性上市公司的选择

在行业的投资权重确定之后，本基金将在各行业中重点投资于预期收入或净利润增长率超过行业平均水平的成长性上市公司所发行的股票。具有以下特点的上市公司是本基金重点关注的对象：

1）上市公司所处行业发展状况良好，在本行业内处于领先地位；

2）上市公司财务状况良好，盈利能力较强且资产质量较好，业绩真实并且具有持续增长潜力；

3）上市公司治理结构规范，管理水平较高，有较强的技术开发和市场拓展能力。

本基金建立了一套行业导向的成长性公司选择体系。首先是根据对各行业内上市公司未来成长潜力的分析预测进行股票的初选；其次是利用本公司自主开发的财务分析系统对初选上市公司的盈利能力和资产质量进行对比分析，剔除其中存在财务隐患或业绩有虚假嫌疑的上市公司，构成股票备选库；最后是对股票备选库中上市公司的管理水平、技术水平和市场开发能力等进行深入分析，并结合其盈利能力、成长潜力和股价水平，选出具体的投资组合。

3、债券投资

本基金可投资于国债、金融债和企业债（包括可转债）。本基金将在对利率走势和债券发行人基本面进行分析的基础上，综合考虑利率变化对不同债券品种的影响、收益率水平、信用风险的大小、流动性强弱等因素，建立由不同类型、不同期限债券品种构成的组合。

（三）基金投资决策

1、决策依据

（1）国家有关法律、法规和基金合同的有关规定；

（2）国内国际宏观经济环境、国家货币政策、利率走势及通货膨胀预期、国家产业政策；

（3）各行业发展状况、市场波动和风险特征；

（4）上市公司研究，包括上市公司成长性的研究和市场走势；

（5）证券市场走势。

2、投资流程

（1）金融工程研究部及行业研究小组：对宏观经济、行业、上市公司、投资策略和金融工程等与投资决策有关的内容都会进行全面深入的研究，作为投资决策的依据。

（2）投资决策委员会：确定本基金总体资产分配和投资策略。投资决策委员会定期召开会议，由公司总裁或指定人员召集。如需做出及时重大决策或基金经理小组提议，可临时召开投资决策委员会会议。

（3）基金经理小组：设计和调整投资组合。设计和调整投资组合需要考虑的基本因素包括：每日基金申购和赎回净现金流量；基金合同的投资限制和比例限制；研究员的投资建议；基金经理的独立判断；绩效与风险评估小组的建议等。

（4）集中交易室：基金经理向集中交易室下达投资指令，集中交易室主管对基金投资指令进行审核后，分配给交易员执行投资指令。

（5）绩效与风险评估小组：对开放式基金投资组合进行评估，向基金经理小组提出调整建议。

（6）监察稽核部：对投资流程的合法合规性进行监控。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准＝中信综合指数涨跌幅×80%+ 中信标普国债指数涨跌幅×20%。

使用该业绩比较基准主要基于如下原因：

1、中信综合指数

中信综合指数是实时调整的全样本指数，作为按流通股本加权的综合指数，其样本股覆盖了上交所和深交所上市的所有 A 股，并且新股上市次日才计入指数调整，因此在客观上反映了二级市场的真实走势。

2、中信标普国债指数

中信标普国债指数样本涵盖了上海证券交易所所有的国债品种。交易所的国债交易市场具有参与主体丰富、竞价交易连续的特性，能反映出市场利率的瞬息变化，也使得中信标普国债指数能真实地标示出利率市场整体的收益风险度。

十、基金的风险收益特征

本基金属混合型证券投资基金，为证券投资基金中的中高风险品种。本基金长期平均的风险和预期收益低于成长型基金，高于指数型基金、货币市场基金、纯债券基金和国债。

十一、基金的投资组合报告（未经审计）

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。

基金托管人中国工商银行根据基金合同规定，于 2006 年 12 月 25 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。

本报告中所列财务数据截至 2006 年 9 月 30 日，未经审计。

1、截至 2006 年 9 月 30 日基金资产组合情况

序号	资产品种	金额(元)	金额占基金总资产比例(%)
1	股票	423,458,680.38	71.23
2	债券	127,068,768.64	21.38
3	权证	2,463,360.47	0.41
4	银行存款及清算备付金	33,962,198.62	5.71
5	其他资产	7,524,290.97	1.27
	合计	594,477,299.08	100.00

2、截至 2006 年 9 月 30 日按行业分类的股票投资组合

序号	行业	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例（%）
1	A 农、林、牧、渔业	1,566,435.32	0.27
2	B 采掘业	14,551,393.00	2.47
3	C 制造业	146,108,991.52	24.77
其中：	C0 食品、饮料	20,603,097.74	3.49
	C1 纺织、服装、皮毛	0.00	0.00
	C2 木材、家具	0.00	0.00
	C3 造纸、印刷	0.00	0.00
	C4 石油、化学、塑胶、塑料	48,966,432.76	8.30
	C5 电子	0.00	0.00
	C6 金属、非金属	44,628,708.18	7.57
	C7 机械、设备、仪表	21,023,853.24	3.56
	C8 医药、生物制品	0.00	0.00
	C99 其他制造业	10,886,899.60	1.85
4	D 电力、煤气及水的生产和供应业	0.00	0.00
5	E 建筑业	0.00	0.00
6	F 交通运输、仓储业	29,073,029.68	4.93
7	G 信息技术业	53,461,795.23	9.07
8	H 批发和零售贸易	40,034,769.42	6.79
9	I 金融、保险业	33,795,006.00	5.73
10	J 房地产业	71,770,814.56	12.17
11	K 社会服务业	13,178,000.00	2.23
12	L 传播与文化产业	14,066,119.80	2.39
13	M 综合类	5,852,325.85	0.99
	合计	423,458,680.38	71.80

3、截至 2006 年 9 月 30 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)	市值占基金资产净值比例(%)
1	600036	G 招 行	3,399,900	33,795,006.00	5.73
2	600143	G 金 发	1,229,771	31,223,885.69	5.29
3	000002	G 万科 A	2,880,000	21,801,600.00	3.70
4	000063	G 中 兴	649,990	20,780,180.30	3.52
5	000024	G 招商局	1,280,881	19,520,626.44	3.31
6	000825	G 太 钢	2,858,341	17,721,714.20	3.00
7	601111	中国国航	4,911,396	17,582,797.68	2.98
8	600309	G 万 华	1,122,669	16,873,715.07	2.86
9	600694	大商股份	390,000	16,302,000.00	2.76
10	600406	国电南瑞	612,321	15,944,838.84	2.70

4、截至 2006 年 9 月 30 日按券种分类的债券投资组合

序号	债券品种	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	国债	95,723,231.60	16.23
2	金融债	25,072,000.00	4.25
3	企业债	0.00	0.00
4	可转换债券	6,273,537.04	1.07
	合计	127,068,768.64	21.55

5、截至 2006 年 9 月 30 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

序号	债券名称	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	21国债(3)	33,954,354.00	5.76
2	20国债(10)	19,470,294.00	3.30
3	21国债(10)	17,571,750.00	2.98
4	01国开 19	15,093,000.00	2.56
5	02国债(14)	12,673,233.60	2.15

6、投资组合报告附注

（1）报告期内本基金投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的股票。

（2）报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

（3）其他资产构成

其他资产明细	金额（元）
应收交易保证金	382,741.14
应收证券清算款	5,277,144.88
应收利息	1,814,220.95
应收申购款	50,184.00
合计	7,524,290.97

（4）截至 2006 年 9 月 30 日本基金没有持有处于转股期的可转换债券。

7、因股权分置获配权证情况及截至 2006 年 9 月 30 日本基金持有权证情况

本基金本报告期没有主动投资权证，因股权分置获配权证情况统计如下表：

权证名称	本报告期获配权证市值（元）	报告期初持有权证市值(元)	报告期末持有权证市值（元）	报告期末权证市值占基金资产净值比（%）
宝钢认购权证	0.00	277.55	0.00	0.00
烟台万华认购权证	0.00	2,087,932.55	2,025,054.47	0.34
贵州茅台认沽权证	0.00	644,406.00	438,306.00	0.08
合计	0.00	2,732,616.10	2,463,360.47	0.42

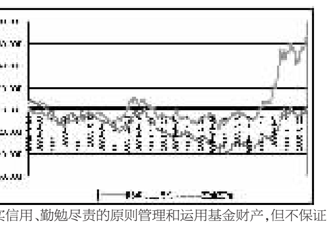
本基金持有权证的金额、比例符合相关法律法规及中国证监会的相关规定。

十二、基金的业绩

1、基金合同生效以来的投资业绩及其与同期基准的比较如下表所示：

	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年 5 月 24 日至 2002 年 12 月 31 日	－14.69%	0.55%	－12.30%	1.01%	－2.39%	－0.46%
2003年 1 月 1 日至 2003 年 12 月 31 日	16.85%	0.80%	－2.30%	0.88%	19.15%	－0.08%
2004年 1 月 1 日至 2004 年 12 月 31 日	－10.10%	0.99%	－13.84%	1.08%	3.74%	－0.09%
2005年 1 月 1 日至 2005 年 12 月 31 日	8.22%	0.97%	－6.70%	1.14%	14.92%	－0.17%
2006年 1 月 1 日至 2006 年 6 月 30 日	60.48%	1.25%	44.36%	1.13%	16.12%	0.12%
2006年 1 月 1 日至 2006 年 9 月 30 日	72.39%	1.19%	47.52%	1.14%	24.87%	0.05%
自基金合同生效起至今	67.20%	0.95%	1.61%	1.06%	65.59%	－0.11%

2、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进行比较：



基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

注 1：业绩比较基准＝中信综合指数涨跌幅×80%+ 中信标普国债指数涨跌幅×20%。

注 2：基金业绩截止日为 2006 年 9 月 30 日。

十三、基金的费用

（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）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、审计费、验资费和律师费；

（7）按照国家有关规定可以列入的其它费用。

上述基金费用由基金托管人根据有关法规和相应协议的规定，按费用的实际支出金额支付，列入当期基金费用。国家另有规定的从其规定。

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

基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计算。计算方法如下：

H＝E ×1.5% ÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，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，基金托管人复核后于次月前 2 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、休息日等，支付日期顺延。

（2）基金托管人的托管费

基金托管费按前一日的基金资产净值的 2.5‰的年费率计提。计算方法如下：

H＝E ×2.5‰ ÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，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，基金托管人复核后于次月前 2 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、休息日等，支付日期顺延。

（3）上述 1 中（3）至（7）项费用由基金托管人根据其它有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。

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财产的损失，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、基金管理人和基金托管人可磋商酌情调低基金管理费和基金托管费，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。

(二) 与基金销售有关的费用

1、本基金采用前端收费的形式收取销售费用，申购费率按申购金额的大小分为三档，最高不超过 1.6%，具体如下表所示：

申购金额（元）	申购费率	赎回费率
5,000 ≤ M ＜ 100 万	1.6%	0.5%
100万≤ M ＜1,000 万	1.3%	
M ≥1,000万	1.0%	

2、赎回费率为赎回总金额的 0.5%，[illegible]40%列入基金财产。

3、基金管理人可以在基金合同规定的范围内调整上述费率，[illegible]迟于新的费率实施[illegible]将在最新的招募说明书中列示。

4、基金管理人可以[illegible]划，针对特定[illegible]期或不定期[illegible]。

十四、对招募说明书本次更新部分的说明

本基金管理人依据《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，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对[illegible]招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

1、根据[illegible]调整本基金[illegible]。

2、根据《基金管理公司投资管理人员管理指导意见》的要求及本基金管理人于 2006 年 11 月 23 日公布的《鹏华基金管理有限公司关于基金经理变更的公告》，调整“三、基金管理人”一章中“主要人员情况”部分“4、本基金基金经理”的相关内容。

3、在“四、基金托管人”一章，更新“基金托管业务经营情况”至 2006 年 9 月。

4、在“八、基金的投资”一章，更新了投资组合报告，数据截至日期为 2006 年 9 月 30 日。

5、在“九、基金的业绩”一章，更新了基金的投资业绩，数据截至日期为 2006 年 9 月 30 日。

6、在“二十一、其他应披露事项”一章，更新了 2006 年 6 月 24 日至 2006 年 12 月 23 日期间的信息披露情况，包括公告事项、信息披露的媒体与披露时间。

鹏华基金管理有限公司
2007 年 1 月 5 日

股票代码：600107　股票简称：美尔雅　编号：2007001

湖北美尔雅股份有限公司关于以前年度对外担保重大事项进展的公告

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，对公告的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏负连带责任。

根据《中华人民共和国证券法》、《上海证券交易所股票上市规则》等有关规定，本公司对以前年度对外担保涉及的法律诉讼的相关各方调节情况，提示公告如下：

一、事由：

1994年本公司（作为丙方）为湖北省国际信托投资公司（借款方，乙方）向交通银行海南分行（出借方，甲方，下简称海南交行）拆借资金 2000 万元资金（已归还 400 万元）提供了连带责任担保。因借款方湖北省国际信托投资公司未能及时偿还海南交行的拆借资金，2001 年海南省高级人民法院判决本公司承担担保责任。

本公司自查发现后以及该项担保事项所涉重大诉讼的相关进展情况，公司分别于 2003 年 10 月 11 日披露了 2003014 号、2004 年 8 月 12 日披露了 2004011 号、2004 年 10 月 22 日披露了 2004012 号、2005 年 1 月 7 日披露了 2005001 号公告、2005 年 4 月 13 日披露了 2005002 号公告。上述公告分别刊登在公告日的《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上。

根据该项担保应承担的担保责任，本公司在 2004 年半年度财务报告中，预提了或有负债 6000 万元。

二、三方执行和解协议书相关内容：

近日湖北美尔雅股份有限公司（以下简称“美尔雅公司”或“本公司”）、湖北省国际信托投资公司（以下简称“省信托公司”）及交通银行股份有限公司海南分行（以下简称“海南交行”）三方就 1994 年本公司（作为丙方）为湖北省国际信托投资公司（借款方，乙方）向海南交行（出借方，甲方，下简称海南交行）拆借资金 2000 万元资金（已归还 400 万元）提供连带责任担保事项签订执行和解协议书。

三方达成如下协议：

1、省信托公司或本公司于 2006 年 12 月 20 日之前偿还海南交行拆借本金人民币 1600 万元和 400 万元利息。

2、对于省信托公司尚欠海南交行的利息 8,006,292.44 元，美尔雅公司按照如下计划偿还：

（1）2007 年 6 月 20 日前偿还尚欠海南交行利息 300 万元；

（2）2007 年 9 月 20 日前偿还尚欠海南交行利息 250 万元；

（3）2007 年 12 月 20 日前偿还尚欠海南交行利息 2,506,292.44 元。

（4）如美尔雅公司不能完全按上述履行还款义务，美尔雅公司应继续承担偿还海南交行为案件垫付的费用 867,634 元的义务。

3、省国际信托公司和美尔雅公司按照协议约定履行完毕之后，海南交行解除省国际信托公司的债务责任并向执行法院申请解除对武汉美尔雅大厦的查封，下达对省信托公司的执行终结裁定书。在美尔雅公司偿还完所有 8006292.44 元利息后，解除美尔雅公司的担保责任并向执行法院申请下达执行终结裁定书。

4、若省信托公司和美尔雅公司未能按照协议履行义务，省信托公司和美尔雅公司应向海南交行加倍支付迟延履行期间的债务利息，同时海南交行有权立即终止协议。

三、海南省海口市中级人民法院近期下达有关民事裁定书：

2006年 12 月 26 日我公司签收到海南省海口市中级法院下达的（2002）海中法执字第 133—10 号、（2003）海中法执字第 2—1 号民事裁定书确认上述三方签订的和解协议书生效，裁决书裁定事项是：

申请执行人：交通银行海南分行

被执行人：湖北美尔雅股份有限公司

被执行人：湖北省国际信托投资有限公司

裁定书认为，在案件执行过程中，对武汉美尔雅大厦进行了公开拍卖，买受人湖北美尔雅进出口贸易有限公司以人民币 1525 万元竞得，并已支付完全部的成交款，海南亚奥国际拍卖公司向本院司法鉴定中心出具了成交报告，由于交通银行海南分行与湖北美尔雅股份有限公司、湖北省国际信托投资有限公司三方达成执行和解，因此，对拍卖事项应追认其拍卖有效，并裁定如下：

（一）将被执行人湖北美尔雅股份有限公司名下位于武汉市洪山区珞瑜路 409 号 923.75 平方米土地及地上建筑物（即武汉美尔雅大厦）过户给买受人湖北美尔雅进出口贸易有限公司；

（二）解除本院以（2002）海中执字第 133－1 号民事裁定书，对被执行人湖北美尔雅股份有限公司名下位于湖北省武汉市洪山区珞瑜路 409 号 923.75 平方米土地及地上建筑物的查封；

（三）将执行案款 2000 万元，退付给本案申请执行人交通银行海南分行，冲抵湖北省国际信托投资有限公司所欠申请执行人交通银行海南分行的债务；而湖北美尔雅股份有限公司实际支付了 20,008,550 元在本院帐户上，因此，尚有余款 8550 元在本院帐户上，在湖北美尔雅股份有限公司履行 2007 年 6 月 20 日前偿还尚欠交通银行海南分行利息 300 万元时一并结算。

四、公司所承担的相关付款义务

根据海口市中院裁定书的认定，执行案款 2000 万元来源于美尔雅大厦拍卖的买受人湖北美尔雅进出口贸易有限公司支付拍卖款 1525 万元，其中购买美尔雅大厦净支付款 1445.605 万元（扣除佣金、公告费用部分）和本公司委托湖北美红服装有限公司支付执行案件款 555.25 万元。

根据海口市中院司法鉴定中心出具的（2004）海中法拍字第 39 号鉴定报告，美尔雅大厦拍卖由美尔雅进出口贸易公司以人民币 1525 万元竞得（本公司于 2005 年 4 月 13 日就该拍卖事项披露了 2005002 号公告），拍卖款转执行案件回转额为 1445.605 万元，加上本公司已经支付的 555.25 万元，本公司已经支付 2000.855 万元以及拍卖佣金、公告费等款项 79.395 万元。

2006 年 12 月 21 日，申请人交行海南分行向海口中院书面提出解除对武汉美尔雅大厦的查封及退付 2000 万元案件款的申请。

该担保事项目前尚未影响公司正常生产经营，公司将视调解情况及具体执行实际情况履行披露义务，公司董事会特提请投资者注意投资风险。

湖北美尔雅股份有限公司董事会
二 00 六年十二月三十日

证券代码：600712　证券简称：S 南百　编号：临 2007—001

南宁百货大楼股份有限公司关于股权分置改革方案实施公告的更正公告

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，对公告的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏负连带责任。

本公司于 2006 年 12 月 28 日发布了《南宁百货大楼股份有限公司股权分置改革方案实施公告》，由于工作疏忽，其中“六、有限售条件股份可上市流通预计时间表”中股东名称出现部分文字错误，原为：

序号	股东名称	占总股本比例	可上市流通时间
1	南宁沛宁资产经营有限责任公司	5.00%	R+12个月
		5.00%	R+24个月
		8.86%	R+36个月
2	浙江利时投资集团股份有限公司	5.00%	R+12个月
		5.00%	R+24个月
		4.46%	R+36个月
3	广西国力投资担保有限公司	5.00%	R+12个月
		3.78%	R+24个月
4	广西国力投资担保有限公司	0.03%	G+12个月
5	瑞安东大眼镜有限公司	0.02%	G+12个月
6	广西南宁金焰燃气有限责任公司	0.01%	G+12个月
7	其他非流通股东	1.86%	G+12个月

现更正为：

序号	股东名称	占总股本比例	可上市流通时间
1	南宁沛宁资产经营有限责任公司	5.00%	R+12个月
		5.00%	R+24个月
		8.86%	R+36个月
2	浙江利时投资集团股份有限公司	5.00%	R+12个月
		5.00%	R+24个月
		4.46%	R+36个月
3	广西国力投资担保有限公司	5.00%	R+12个月
		3.78%	R+24个月
4	瑞安东大眼镜有限公司	0.03%	G+12个月
5	广西南宁金焰燃气有限责任公司	0.02%	G+12个月
6	南宁市桂达贸易总公司	0.01%	G+12个月
7	其他非流通股东	1.86%	G+12个月

本公司对此疏漏深表歉意！

南宁百货大楼股份有限公司
董　事　会
二〇〇七年一月四日

股票代码：600116　股票简称：三峡水利　编号：临 2007-01 号

重庆三峡水利电力(集团)股份有限公司 2006 年度预计业绩大幅下降公告

本公司董事会全体成员保证公告内容真实有效，准确和完整，并对公告中的任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏承担责任。

一、预计的本期业绩情况

1、业绩预告期间：2006 年 1 月 1 日至 2006 年 12 月 31 日

2、业绩预告情况：大幅度下降

本公司主要为水力发电，由于 2006 年本公司所在地重庆市及万州区遇特大干旱，水电上网电量大幅度下降，自发火电量及外购电量大幅上升，致使公司供电成本大幅增加，经本公司财务部初步测算，本公司 2006 年业绩较 2005 年有较大幅度下降，预计公司净利润同比下降 50%以上，具体数据将在 2006 年年度报告中详细披露。

3、本次所预计的业绩未经注册会计师预审计。

二、上年度同期业绩

1、净利润：20,435,639.59 元

2、每股收益：0.12 元

三、未在前一定期报告中进行业绩预告的原因

本公司所在地重庆市万州区在第四季度自然降雨量和上游来水较以前年度同期大幅度减少，水电出力不足，所以未能在前一定期报告中进行业绩预告。

四、其他相关说明

本公司敬请广大投资者注意投资风险。

特此公告

重庆三峡水利电力(集团)股份有限公司
二 00 七年一月四日