

Disclosure

泰达荷银价值优化型成长类行业证券投资基金、周期类行业证券投资基金、稳定类行业证券投资基金更新招募说明书(摘要)

Table with columns: 债券名称, 市值, 市值占净值比例. Lists top 10 bonds held by the fund.

Table with columns: 项目, 金额. Lists various assets and liabilities of the fund.

Table with columns: 项目, 金额, 占基金总资产比例. Shows the composition of the fund's total assets.

Table with columns: 行业, 市值, 市值占净值比例. Lists industry allocations and their respective values.

Table with columns: 股票代码, 股票名称, 数量, 市值, 市值占净值比例. Lists the top 10 stocks held by the fund.

Table with columns: 债券类别, 债券市值, 市值占净值比例. Lists top 10 bond categories.

Table with columns: 债券名称, 市值, 市值占净值比例. Lists top 10 bonds held by the fund.

Table with columns: 项目, 金额. Lists various assets and liabilities of the fund.

Table with columns: 权证代码, 权证名称, 数量, 成本, 期末市值. Lists call options held by the fund.

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。

(一)截止2007年10月25日基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

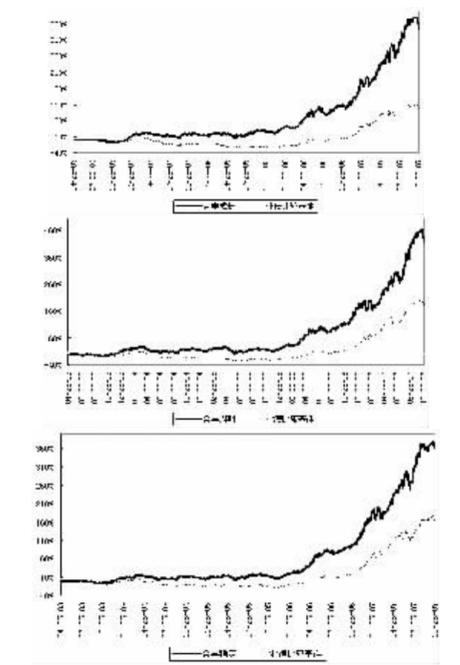
Table showing performance metrics for the fund's equity investment portfolio.

Table showing performance metrics for the fund's equity investment portfolio.

Table showing performance metrics for the fund's equity investment portfolio.

Table showing performance metrics for the fund's equity investment portfolio.

(二)自基金合同生效以来基金净值增长的变动情况,并与同期业绩比较基准的变动比较图



图一:泰达荷银价值优化型成长类行业证券投资基金自基金合同生效以来基金净值增长的变动情况

(一)本系列基金发生的费用按照公平原则经托管人认定后由各行业类别基金单独承担或由各行业类别基金分摊。

1.基金管理人的管理费; 2.基金托管人的托管费; 3.基金证券交易费用; 4.基金的信息披露费用; 5.基金的会计师事务所费; 6.按照国家有关规定可以列支的其他费用。

2. 赎回费率 赎回费率如下: 申购金额(M) <=500元 费率 1.50%

Table showing redemption fees for different investment amounts.

鹏华优质治理股票型证券投资基金(LOF)更新的招募说明书摘要

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量, 期末市值(元), 市值占基金资产净值比例(%). Lists top 10 stocks.

Table with columns: 序号, 债券名称, 期末市值(元), 市值占基金资产净值比例(%). Lists top 10 bonds.

Table with columns: 序号, 股票名称, 期末市值(元), 市值占基金资产净值比例(%). Lists top 10 stocks.

Table with columns: 序号, 股票名称, 期末市值(元), 市值占基金资产净值比例(%). Lists top 10 stocks.

(4) 本报告期末本基金没有持有处于转股期的可转换债券,也没有投资资产支持证券。

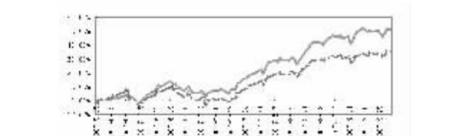
Table with columns: 权证名称, 本报告期末权证市值(元), 本报告期持有权证市值(元), 报告期末持有权证市值(元), 报告期末权证市值占基金资产净值比例(%).

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,也不保证最低收益。

1. 本基金基金合同生效以来的投资业绩与同期基准的比较如下表所示(本报告中所列财务数据未经审计):

Table showing performance metrics for the fund's equity investment portfolio.

本基金已于2007年7月18日开通转换业务,基金转换费率及转换业务规则等相关规定详见基金管理人于2007年7月13日刊登的《鹏华优质治理股票型证券投资基金(LOF)关于开放日常申购、转换及定期定额投资业务的公告》。



注1:业绩比较基准:沪深300指数×75%+新华富时中国综合债券指数×25%。

(一)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.基金证券交易费用; 4.基金的信息披露费用; 5.基金的会计师事务所费; 6.按照国家有关规定可以列支的其他费用。

鹏华优质治理股票型证券投资基金(LOF)更新的招募说明书摘要

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.基金合同生效后的会计师事务所费; 5.基金的销售费用; 6.基金的信息披露费用; 7.基金证券交易费用; 8.按照国家有关规定和基金合同约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

2. 赎回费率 赎回费率如下: 申购金额(M) <=500元 费率 1.50%

Table showing redemption fees for different investment amounts.

3. 根据本基金管理人于2007年6月18日刊登的《鹏华优质治理股票型证券投资基金(LOF)关于开放场外、场内日常申购业务的公告》和2007年7月13日刊登的《鹏华优质治理股票型证券投资基金(LOF)开放日常申购、转换及定期定额投资业务的公告》,在“十、基金份额的申购和赎回”的“(二)申购和赎回的开放日及办理时间”中“十一、基金份额的转换”部分增加了“场外申购、赎回、转换及定期定额投资业务的时间”等相关内容。

3. 根据本基金管理人于2007年7月13日刊登的《鹏华优质治理股票型证券投资基金(LOF)上市交易公告书》,在本招募说明书“九、基金份额的上市交易”部分中明确了本基金的上市交易时间。

4. 因本基金管理人股权变更,根据2007年6月14日刊登的《鹏华基金管理有限公司关于董事变更的公告》,经本公司2007年第三次临时股东大会会议决议,股东大会一致同意:Francis Candyll先生和Ciro Boffi先生担任鹏华基金管理有限公司独立董事,同意聘任刘先生、陈毅女士辞去本公司董事职务,不再担任本公司董事,据此相应调整了“三、基金管理人”部分“(二)主要人员情况”中“1.基金管理人董事会成员”的相关内容。

5. 因工作调整,本基金管理人对外投资决策委员会成员于己变更,程世杰先生接替曹勇先生担任投资决策委员会成员,据此相应调整了“三、基金管理人”部分“(二)主要人员情况”中“5.投资决策委员会成员”的相关内容。

6. 因工作调整,根据2007年8月29日刊登的《鹏华基金管理有限公司关于基金经理变更的公告》,经本公司第三届董事会第二十二次会议审议通过,增补魏少华先生、张卓先生为本基金基金经理,程世杰先生不再担任本基金基金经理,据此相应调整了“三、基金管理人”部分“(二)主要人员情况”中“4.本基金基金经理”的相关内容。

7. 根据本基金管理人于2007年8月29日刊登的《关于调整鹏华基金管理有限公司旗下开放式基金相关业务费率的公告》,基金账户最低持有份额由原“100份”调整为“30份”;增加“本基金定期定额投资业务每次最低扣款金额为200元”的约定内容。据此,调整了“十、基金份额的日常申购和赎回”部分“(五)申购与赎回的数额限制”的相关内容。

8. 因本基金管理人股权变更,根据2007年9月29日刊登的《鹏华关于股权转让暨工商变更登记的公告》,本基金管理人针对原股东深圳市北融信投资发展有限公司、方正证券有限责任公司、安徽国元信托有限责任公司将其持有的本公司总股本49%的股权、一次性整体转让给大成国际信托有限公司的事项完成了股权转让手续。本次股权转让后,国信证券有限责任公司、Buzon Financial Group、深圳市北融信投资发展有限公司三家股东的出资比例分别为50.49%、49%、1%。据此相应调整了“三、基金管理人”部分“(一)基金管理人概况”中“9.股权结构”的相关内容。

9. 根据本基金管理人于2007年9月29日刊登的《关于修改鹏华基金管理有限公司旗下基金基金合同中有关基金估值方法等相关内容》,相应调整了“十一、基金估值”及“十九、基金费用”中的相关内容。

10. 根据相关法律法规及本基金管理人内部控制制度的变更和执行情况,更新了“三、基金管理人”部分“(五)基金管理人内部控制制度”的相关内容。

11. 根据本基金管理人部分“(三)基金托管业务经营情况”中相关内容及数据更新至2007年9月30日。

12. 根据本基金管理人增加的代销机构的相关内容,在“五、相关服务机构”一章,增加了农业银行、西部证券、金元证券、东北证券、申银万国证券、江南证券六家机构为本基金代销机构。

13. 在“十一、基金的投资”部分,增加了本基金投资组合报告的相关内容,数据截止日期为2007年9月30日。

(上接 D20 版) (g) 行业研究小组研究人员通过自身研究以及借助外部研究机构的研究成果,形成宏观、策略方面的研究报告,为基金资产配置提供决策支持。

(h) 投资决策委员会依照基金提供的投资组合建议书审定投资原则与方向,即确定股票、债券和货币等大类资产之间的配置比例。

(i) 金融工程辅助公司的《上市公司治理结构综合评价系统》定期或不定期地提交上市公司治理结构综合评价的数量化分析报告,同时辅助公司的《股票成长性评估系统》定期提交有关股票成长性的数量化分析报告,作为决策支持。

(j) 行业研究员通过个股的财务指标、所处行业的定位分析、市场和经济环境分析等途径,对上市公司成长性和盈利性以及投资价值的各个方面进行综合评价,自下而上地筛选出具有相对完善的公司治理结构和良好成长性的优质上市公司,并以此作为本基金股票投资的主要标的。

(k) 本基金的投资配置以行业景气预测为基础,结合对产业政策、行业相关财务指标和财务指标的分析,对行业进行综合评价,行业研究小组将定期提交行业景气预测报告和行业配置建议。

(l) 基金经理及助理依据行业研究小组的投资建议报告,再结合自身对市场的判断,确定行业配置比例及个股权重,构建股票投资组合,再通过 Barra Aegis 风险管理系统的优化分析及基金经理小组的判断对组合作进一步的调整优化。

(m) 固定收益小组与基金经理在充分考虑基金投资的安全性和基金资产的高流动性前提下,构建债券组合。

(n) 交易室按有关交易规则执行交易指令,并将有关信息反馈给基金经理。

(o) 金融工程研究部负责对基金持仓的品种进行风险监控,风险预警以及投资业绩评估。

(p) 金融工程研究部绩效评估研究员定期为投资决策委员会、投资总监、基金经理提供基金业绩评估报告,基金经理对于投资决策委员会和风险管理小组认为具有较大风险的投资品种可以提交方案,并必须在规定的时间内调整投资组合。

(q) 监察稽核部对投资流程的合法合规性进行监控。

九、基金的投资比较基准 本基金业绩比较基准: 沪深300指数×75%+新华富时中国综合债券指数×25%

沪深300指数是由上海和深圳证券市场中共选取300只A股作为样本编制而成的成份股指数,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。该指数市场代表性强,指数编制方法透明,样本股票调整频率清晰,并作为今后基金工具创新和发展的主要参照指数,因此本基金选择沪深300指数作为股票投资部分的业绩比较基准。

新华富时中国综合债券指数是目前最常用的一种用于衡量债券投资的基准指数之一,它涵盖了我国三个市场(银行间市场、沪、深交易所)上市的可转债的固定利率债券,它编制的方法选择标准准确,再加上其具有权威、透明、及时的特点,因此本基金选择新华富时中国综合债券指数作为债券投资部分的业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威、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,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

十、基金的风险收益特征 本基金属于股票型基金,其预期的风险和收益高于货币型基金、债券基金、混合型基金,为证券投资基金中具有较高风险、较高收益的投资品种。

本基金管理人的董事会及基金经理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工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,已于2007年10月23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2007年9月30日基金资产净值情况