

(上接 D14 版)

**十二、基金的投资组合报告(未经审计)**

本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2008年4月15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。

本报告中列财务数据截至2008年3月31日,未经审计。

**1.截至2008年3月31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	9,881,538,928.88	83.10
2	债券	824,601,288.10	6.93
3	权证	3,163,932.31	0.03
4	银行存款及清算备付金	1,154,777,550.21	9.71
5	其他资产	27,327,047.10	0.23
合计		11,891,408,746.60	100

**2.截至2008年3月31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_农业	15,463,539.90	0.13
2	B 采矿业	1,058,548,574.08	9.07
3	C 制造业	4,850,677,508.88	41.56
其中:	C0 食品饮料	871,569,448.14	7.47
C1 纺织服装_皮毛	8,005,000.00	0.07	
C2 木材_家具	0.00	0.00	
C3 造纸_印刷	305,200,673.57	2.61	
C4 石油_化学_塑胶_塑料	730,531,831.01	6.26	
C5 电子	107,099,276.60	0.92	
C6 金属_非金属	808,627,291.42	6.93	
C7 机械_设备_仪器	1,328,696,357.86	11.38	
C8 医药_生物制品	626,980,813.48	5.37	
C9 其他制造业	63,966,876.00	0.55	
4	D 电力_煤气及水的生产和供应业	144,055,892.68	1.23
5	E 建筑业	205,679,413.72	1.76
6	F 交通运输_仓储业	492,949,688.31	4.22
8	H 批发和零售贸易	412,053,183.84	3.53
9	I 金融、保险业	1,290,276,509.58	11.05
10	J 房地产业	858,918,716.17	7.59
11	K 社会服务业	343,744,476.82	2.94
12	L 信息与文化产业	151,625,400.62	1.30
13	M 综合类	0.00	0.00
合计		9,881,538,928.88	84.65

**3.截至2008年3月31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	600519	贵州茅台	2,783,300	516,821,943.00	4.43
2	600036	招商银行	14,499,964	486,463,841.88	4.00
3	000933	神华股份	9,523,827	381,714,986.16	3.27
4	600016	民生银行	34,989,921	374,849,153.91	3.21
5	000669	招商局A	7,547,103	307,846,331.37	2.64
6	600383	金地集团	7,550,721	267,826,505.45	2.29
7	000063	中兴通讯	4,501,112	265,025,474.56	2.27
8	000012	南 玻 A	12,200,000	220,088,000.00	1.89
9	002024	苏宁电器	3,900,000	215,241,000.00	1.84
10	600482	凤凰股份	13,470,000	213,768,900.00	1.83

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	32,958,640.90	0.28
2	金融债	725,550,000.00	6.22
3	企业债	0.00	0.00
4	可转换债券	66,092,647.20	0.56
合计		824,601,288.10	7.06

**5.截至2008年3月31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	07高债 84	725,550,000.00	6.22
2	08中石化债	62,346,547.20	0.53
3	02国债 10	21,958,220.00	0.19
4	99国债 8	8,735,125.00	0.07
5	05央行票据	3,746,100.00	0.03

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		8,504,145.35
应收利息		16,023,210.90
应收申购款		2,799,690.85
合计		27,327,047.10

(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。  
7.本基金权证投资情况及本报告期末本基金持仓权证情况

权证名称	本报告期末权证金额(元)	本报告期末权证数量(股)	本报告期末权证公允价值(元)	本报告期末权证市值(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(%)
中化认购权证	0.00	8,170,496	19,030,875.19	18,282,966.67	3,163,932.31	0.03
华神认购权证	130,378,090.21	0	0.00	0.00	0.00	0.00
上汽汽车认购权证	0.00	110,844	884,666.77	887,550.08	0.00	0.00
合计	130,378,090.21	8,281,340	19,915,541.96	19,170,516.75	3,163,932.31	0.03

本基金投资、持仓权证金额、比例等符合相关法律法规及中国证监会的相关规定。

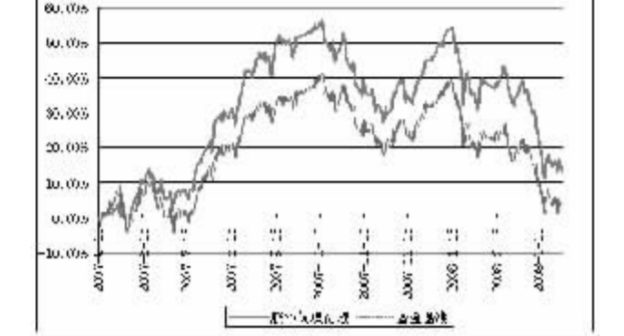
**十三、基金的业绩**

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。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。

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(本报告中列财务数据未经审计):

	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	业绩比较基准标准差4	1-3	2-4
2007年4月25日至2007年12月31日	44.90%	1.78%	31.54%	1.70%	13.36%	0.08%
2008年1月1日至2008年3月31日	-21.81%	2.41%	-21.97%	2.17%	0.16%	0.24%

自基金合同生效以来基金资产净值变动情况,并与同期业绩比较基准的变动进行比较:



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%。  
注2:本基金基金合同于2007年4月25日生效。  
注3:基金业绩截止日为2008年3月31日。

证券代码:600369 证券简称:ST长运 公告编号:2008-24

**重庆长江水运股份有限公司关于召开二〇〇七年年股东大会的通知**

公司定于2008年6月30日召开2007年年度股东大会,现将有关事项通知如下:

- 一、会议时间:2008年6月30日上午10:00
- 二、会议地点:三峡宾馆
- 三、会议内容:

- 1、审议《公司2007年年度报告及摘要》;
- 2、审议《公司2007年度董事会工作报告》;
- 3、审议《公司2007年度监事会工作报告》;
- 4、审议《公司2007年度财务决算报告》;
- 5、审议《公司2007年利润分配预案》。

**四、出席股东大会人员**

- 1、截止2008年6月20日下午交易结束后,在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司登记在册的本公司股东,因故不能出席会议的股东,可授权委托代理人出席会议和参加表决(授权委托书附后);
- 2、公司董事、监事、高级管理人员及法律顾问。
- 五、会议登记事项
- 1、会议登记办法:法人股股东持公司营业执照复印件(加盖公章)、股东帐户卡、法定代表人授权委托书和出席人身份证办理登记手续;个人股东持本人身份证、股东帐户、委托代理人持本人身份证、授权委托书、委托

股票帐户办理登记手续。异地股东可用信函或传真方式登记。

2、登记时间:2008年6月29日9:00—11:30,14:00—17:30。信函登记以收到邮戳为准。

- 3、登记地点:重庆长江水运股份有限公司董事会办公室
- 4、本次股东大会会期半天,与会股东住宿、交通费自理。
- 5、公司办公地址:重庆市渝中区陕西路1号三峡宾馆18楼

联系电话:(023)63800217-110  
传真:(023)63819708  
特此通知

重庆长江水运股份有限公司董事会

二〇〇八年六月五日

**授权委托书**

兹全权委托 先生/女士代表本人/本单位出席重庆长江水运股份有限公司2007年年度股东大会,并代为行使表决权。

委托人签名: 身份证号码:  
受托人持股票: 委托人股票帐户:  
受托人签名: 身份证号码:  
委托日期:

证券代码:600418 证券简称:江淮汽车 编号:临 2008-11

**安徽江淮汽车股份有限公司三届二十四次董事会决议公告**

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。

安徽江淮汽车股份有限公司(下称“公司”或“江淮汽车”)三届二十四次董事会会议于2008年6月5日采用通讯方式召开。本次董事会应参与表决董事为9人,实际参与表决的董事为9人,会议符合《公司法》与《公司章程》的规定。会议由董事以传真方式会签。

一、会议以9票同意、0票弃权、0票反对,审议通过了《关于修改公司章程的议案》,同意提请股东大会审议,股东大会召开时间另行公告。

拟对公司章程第一百三十七条进行修改,具体修改内容如下:

修改前:  
第一百三十七条:公司设总经理1名,由董事会聘任或解聘。  
公司设副总经理2名,由董事会聘任或解聘。

修改后:  
第一百三十七条 公司设总经理1名,由董事会聘任或解聘。  
公司设副总经理若干名,由董事会聘任或解聘。

公司设副总经理、财务总监、董事会秘书为公司高级管理人员。  
公司设总经理、副总经理、财务负责人、董事会秘书为公司高级管理人员。

二、会议以9票同意、0票弃权、0票反对,审议通过了《关于聘任副总经理的议案》。

同意聘任严刚先生、余才荣先生为公司副总经理(简历附后)。

以上聘任需待公司股东大会审议通过《关于修改公司章程的议案》后生效。

特此公告!

安徽江淮汽车股份有限公司

董事会

2008年6月5日

**附:人员简历**

严刚,男,汉族,硕士学历,1963年12月出生。2006年荣获省五一劳动奖章,2008年任合肥市人大代表。2001年11月至今,任安徽江淮汽车股份有限公司总经理助理,期间先后兼任江淮汽车商务分公司总经理、乘用车制造公司总经理、发动机分公司总经理、轿车营销公司总经理。

余才荣,男,汉族,硕士学历,1966年6月出生。2001年10月至今,任安徽江淮汽车股份有限公司总经理助理,2006年1月至今兼任江淮汽车国际公司总经理。

**关于宝盈基金管理有限公司增加中国民生银行股份有限公司为代销机构的公告**

根据宝盈基金管理有限公司(以下简称“本公司”)与中国民生银行股份有限公司(以下简称“中国民生银行”)签署的基金销售代理协议,自公告之日起,本公司旗下宝盈鸿利收益证券投资基金(基金代码:213001)、宝盈泛海区域增长股票证券投资基金(基金代码:213002)和宝盈策略增长股票证券投资基金(基金代码:213003)增加中国民生银行为代销机构。投资者可在中国民生银行全国各省、自治区、直辖市的下属指定网点办理上述三只基金的代理销售业务。

投资者可以通过以下途径咨询有关详情:

- 1、宝盈基金管理有限公司
- 注册地:深圳深南大道6008号特区报业大厦15层
- 法定代表人:李建生
- 客户服务电话:400-8888-300

宝盈基金管理有限公司

2008年6月6日

股票名称:S\*ST 天海 S\*ST 天海B 股票代码:600751 900938 编号:临 2008-044

**天津市海运股份有限公司股票交易异常波动公告**

本公司及董事会全体成员保证本公告内容的真实、准确和完整,并对本公告中的任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏承担连带责任。

重要提示:  
●公司股票连续三个交易日的交易价格触及涨幅限制

●经向贵公司控股股东及实际控制人,截止本公告披露日并在预见未来两周内,公司、公司控股股东及实际控制人不存在应披露而未披露的信息。一、股票交易异常波动的具体情况  
2008年6月3日、6月4日、6月5日,本公司A股股票价格连续三个交易日触及涨幅限制,属于股票交易异常波动。

二、公司关注并核实的情况  
本公司未发现在公司股票交易价格可能产生重大影响的媒体报道或市场传闻,同时到目前为止并可预见的两周内,公司及控股股东均确认不存在应披露而未披露的重大信息,包括但不限于涉及公司股权转让、非公开发行、债务重组、业务重组、资产剥离或资产注入等重大事项。

天津市海运股份有限公司

2008年6月6日

**十四、基金的费用与税收**

- (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、基金合同生效后的信息披露费用;  
4、基金合同生效后的会计师费和律师费;  
5、基金份额持有人大会费用;  
6、基金的证券交易费用;  
7、基金的银行汇划费用;  
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。

本基金终止清算前所发生费用,按实际支出额从基金财产中列支。  
(二)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  
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:  
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

基金管理费每日计算,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管理费划款指令,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、公休假等,支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费  
本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:  
H=E×0.25%×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

基金托管费每日计算,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款指令,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取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

上述一、基金费用的种类中第3—7项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

(三)与基金销售有关的费用  
1、集中申购费  
投资者在集中申购期内可以多次申购基金份额,但申购资金一旦支付,撤销申请不予接受。本基金份额的发售面值为人民币一元。投资者申购采用全额缴款的申购方式。

投资者申购费用按申购费用、申购费率按申购金额采用比例费率,投资者在一天之内如果有 multiple 申购,申购费用按单笔分别计算。

场外申购申购费率如下:

申购金额(M,含申购费)	费率
M<100元	1.2%
100元≤M<500元	1.0%
500元≤M<1000元	0.8%
M≥1000元	1000元/笔

计算公式:  
净申购金额=申购金额/(1+申购费率)  
申购费用=申购金额-净申购金额  
申购费率=净申购金额/申购金额

申购份额=(净申购金额+利息)/基金份额面值  
申购基金中申购费用利息,在基金集中申购期结束后折算成基金份额,归投资者所有,其中利息计算以注册登记日的记录为准。对于办理场外申购的投资者,申购份额的计算以四舍五入的方法保留小数点后两位,由此误差产生的损失或收益归入基金资产。

2、日常申购费  
本基金申购费用由基金申购人承担,不列入基金财产。本基金申购费用在申购时交纳,具体申购费率如下:

申购金额(M,含申购费)	申购费率
M<100元	1.5%
100元≤M<500元	1.2%
500元≤M<1000元	1.0%
M≥1000元	1000元/笔

投资者在一天之内如果有 multiple 申购,适用费率按单笔分别计算。  
计算公式:  
净申购金额=申购金额/(1+申购费率)  
申购费用=申购金额-净申购金额  
申购费率=净申购金额/申购金额

本基金的申购份额由申购金额扣除申购费用后除以申购申请当日的基金份额净值确定。对于办理场内申购的投资者,申购份额的计算采用截尾法保留至整数位,剩余部分对应的资金将返回至投资者资金帐户。对于办理场外申购的投资者,申购份额的计算以四舍五入的方法保留小数点后两位,由此误差产生的损失或收益归入基金资产。

3、转换费  
四、分配对象  
截止2008年6月12日下午上海证券交易所收市后,在中国证券登记结算公司上海分公司登记在册的本公司全体股东。

五、分配实施办法  
1.限售条件的流通股股东的现金红利由本公司直接发放。  
2.无限售条件的流通股股东的现金红利委托中国证券登记结算公司上海分公司通过资金清算系统向股权登记日登记在册并在上海证券交易所各会员单位指定交易的股东发放。已办理全面指定交易的投资者可于红利发放日在其指定的证券营业部领取现金红利,未办理指定交易的股东红利暂由中国证券登记结算公司上海分公司保管,待办理指定交易后再进行发放。

六、咨询联系办法  
咨询地点:湖南省湘潭市下摄司街302号  
湘潭电机股份有限公司证券部  
联系电话:0732-8595732 8595252(传真)  
邮政编码:411101

七、备查文件  
1. 本公司《关于2007年度利润分配方案》的股东大会决议及其公告;  
2. 登记公司确认有关分红派息具体时间安排的文件。  
特此公告。

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》。

4、日常赎回费率  
本基金的场外赎回费率按持有年限逐年递减,具体费率如下:

持有年限(Y)	场外赎回费率
Y<1年	0.5%
1≤Y<2年	0.25%
Y≥2年	0

本基金的场内赎回费率为固定值0.5%。  
计算公式:  
赎回总金额=赎回份数×赎回当日基金份额净值  
赎回费用=赎回总金额×赎回费率  
净赎回金额=赎回总金额-赎回费用

本基金的赎回金额以赎回申请当日基金份额净值扣除赎回费用后确定。赎回金额计算单位为人民币元,赎回金额保留小数点后两位,小数点后第三位四舍五入,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。  
赎回费用由赎回申请人承担,赎回费率的25%归入基金资产,其余用于支付登记结算费、销售手续费等各项费用。

(四)不列入基金费用的项目  
下列费用不列入基金费用:  
1.基金管理人及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;  
2.基金管理人及基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;  
3.基金合同生效前的相关费用,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用;  
4.其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(五)费用调整  
基金管理人根据法律法规及中国证监会的有关规定和在不列入基金费用的项目。  
基金管理人根据基金托管人协商一致,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率等费率,须经召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率、基金托管费率等费率,无须召开基金份额持有人大会。  
基金管理人必须就上述新的费率实施日前2日在至少一种指定媒体和基金管理人网站上公告。

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体,其纳税义务按照国家税收法律、法规执行。  
十五、对招募说明书更新部分的内容  
本基金经理人根据《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基金管理活动,对基金管理人于2007年12月7日公告的本基金招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

1.因本基金管理人股权变更,按照《中华人民共和国公司法》和《鹏华基金管理有限公司章程》的有关规定,2007年12月11日,经本公司2007年第四次临时股东大会会议审议通过,选举一致同意钱海勇、黄俞、殷克胜辞去董事职务,董事会成员由原来的十二名董事改为现在由孙帆、胡健之、孙煜松、Francis Cantylias、Ciro Beffi、鄧殊江、方兆本、柳丹、黄世忠九名董事组成。同时,股东会一致同意朱天来辞去监事职务,监事会成员由原来的四名监事改为现在由李国阳、徐兴和三名监事组成。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”及“2、基金管理人监事会成员”的相关内容。上述董事、监事变更事项已按规定履行完毕必要程序。

2.根据2008年2月1日《鹏华基金管理有限公司关于公司总经理变更的公告》,经本公司第三届董事会第十六次会议审议通过,同意杨杨先生辞去本公司总经理职务,同意由胡明先生担任本公司总经理。上述变更事项已经中国证监会基金监管部备案委员会证监函[2008]122号文核准。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”和“3、管理层人员情况”的相关内容。

3.根据2008年2月29日《鹏华基金关于明确办公地址门牌号码的公告》,将公司注册地和办公地址由以前的“深圳市福田区福华三路与益田路交汇处深国际商务中心43楼”正式明确为“深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心第43层”。据此相应调整了“三、基金管理人”部分“(一)基金管理人概况”中“住所”和“办公地址”以及“十九、基金托管协议的主要内容”部分“(一)托管协议当事人”中“1、基金管理人”的相关内容。

4、“四、基金托管人”部分“(三)、基金托管业务经营情况”中相关内容及数据更新至2008年3月31日。

5.根据本基金管理人登载增加代销机构的相关公告,在“五、相关服务机构”一章,增加了民生银行、中信银行、华安证券、安信证券、华泰证券、渤海证券六家机构为本基金代销机构。

6.在“十一、基金的投资”部分,更新了本基金投资组合报告的相关内容,数据截止日期为2008年3月31日。

7.更新了“十二、基金的业绩”的相关内容,数据截止日期为2008年3月31日。

8.更新了“二十一、其他重要事项”的相关内容,具体内容自2008年11月1日至2008年4月25日期间的信息披露情况,包括公告事项、信息披露的载体与披露时间。

鹏华基金管理有限公司

2008年6月6日

证券代码:600416 证券简称:湘电股份 公告编号:临 2008-016

**湘潭电机股份有限公司2007年度分红派息公告**

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。

重要内容提示:  
●每股派发现金红利0.08元(含税);每10股派发现金红利0.80元(含税)

- 扣税前每股现金红利0.08元,扣税后每股现金红利0.072元
- 股权登记日:20