(上接D228版)

8、生效与公告

基金份额持有人大会的决议,召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会核准或者备案。

基金份额持有人大会的决议自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起2个工作日内在至少一家指定媒体及基金管理人网站上公告。如果采用通讯方式进行表决,在公告基金份额持有人大会决议时,必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。

生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

(三)基金收益分配原则、执行方式

1、基金收益分配原则

①)在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为6次,最少一次,每次收益分配比例不得低于截至收益分配基准日可供分配利润的20%,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;

②)本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资。登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额的投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;投资者对同一基金在同一基金销售机构处(或同一销售网点处,或同一交易账号处)的基金份额只能设定一种分红方式,投资者可以在同一日多次申报分红方式变更,本公司按照申请单号先后顺序,以最后一次申报的分红方式为准;投资者对同一基金在不同基金销售机构处(或不同销售网点处,或不同交易账号处)的基金份额可以设定不同的分红方式。登记在证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额,只能选择现金分红的方式,具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定;

③)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

④)每一基金份额享有同等分配权;

⑤)基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不得超过15个工作日;

⑥)法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

2、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

3、收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定,并由基金托管人复核,在2日内在指定媒体公告并报中国证监会备案。

基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不得超过15个工作日。

4、基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额,不足以支付银行转账或其他手续费用时,基金注册登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法,依照相关业务规则执行。

(四)与基金财产管理、运作有关费用的提取、支付方式与比例

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0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.6%÷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0.13%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.13%÷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。

3、基金的指数使用费

本基金作为指数基金,需根据与指数所有人中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付指数使用费。通常情况下,指数使用费按前一日基金资产净值的0.02%的年费率计提,且收取下限为每季度(包括基金成立当季)人民币5万元。计算方法如下:

H=E×0.02%÷当年天数

H为每日计提的指数使用费

E为前一日的基金资产净值

指数使用费从基金合同生效日开始每日计算,逐日累计。

指数使用费的支付由基金管理人向基金托管人发送划付指令,经基金托管人复核后于次季初10个工作日内从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司。

(五)基金资产的投资方向和投资限制

1、投资目标

本基金通过被动的指数化投资管理,力争将本基金的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控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内,实现对中证上游资源产业指数进行有效跟踪。

2、投资范围

本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具,包括标的指数成份股及其备选成份股(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、新股(一级市场初次发行或增发)、债券、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具。

其中,投资于标的指数成份股票及其备选成份股票的市值不低于基金资产净值的80%;投资于标的指数成份股票及其备选成份股票的市值加上买入、卖出股指期货合约的轧差合计值不低于基金资产净值的90%;任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,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%;权证以及其他金融工具的投资比例符合法律法规和中国证监会的规定。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他金融工具,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

3、投资限制

①)禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,本基金禁止从事下列行为:

①承销证券;

②向他人贷款或提供担保;

③从事承担无限责任的投资;

④买卖其他基金份额,但法律法规或中国证监会另有规定的除外;

⑤向基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或债券;

⑥买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券;

⑦从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动;

⑧当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定,本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

②)投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制:

a.本基金财产参与股票发行申购,所申报的金额不得超过本基金的总资产,所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

国投瑞银中证上游资源产业指数证券投资基金(LOF)基金份额上市交易公告书

b.本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的10%;本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的5%e;

c.本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;

d.本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;

e.本基金投资于标的指数成份股票及其备选成份股票的市值不低于基金资产净值的80%;

f.本基金投资于标的指数成份股票及其备选成份股票的市值加上买入、卖出股指期货合约的轧差合计值不低于基金资产净值的90%;

g.本基金在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值,不得超过基金资产净值的10%;

h.本基金在任何交易日日终,持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的100%,其中,有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;

i.本基金在任何交易日日终,持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%;

j.本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约价值不得超过上一交易日基金资产净值的20%;

k.本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券;

l.相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

如法律法规或监管部门取消上述限制性规定,履行适当程序后,本基金不受上述规定的限制。

基金托管人对本基金投资组合的监督自《基金合同》生效日起开始。基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合《基金合同》的约定。

由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内,但基金管理人应在10个交易日内进行调整,以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

(六)基金资产净值的计算方法和公告方式

1、基金资产净值的计算方法

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

2、基金资产净值的公告方式

《基金合同》生效后,在开始办理基金份额申购或者赎回前,基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后,基金管理人应当在每个开放日的次日,通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介,披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日,将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒体和基金管理人网站上。

(七)基金合同的变更、终止与基金财产的清算

1、《基金合同》的变更

①)以下变更《基金合同》的事项应经基金份额持有人大会决议通过:

①更换基金管理人;

②更换基金托管人;

③转换基金运作方式;

④提高基金管理人、基金托管人的报酬标准;

⑤变更基金类别;

⑥变更基金投资目标、范围或策略(法律法规和中国证监会另有规定的除外);

⑦本基金与其他基金的合并;

⑧变更基金份额持有人大会召开程序;

⑨终止《基金合同》;

⑩其他可能对基金当事人权利和义务产生重大影响的事项。

但出现下列情况时,可不经基金份额持有人大会决议,由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告,并报中国证监会备案:

①调低基金管理费、基金托管费;

②法律法规要求增加的基金费用的收取;

③在法律法规和《基金合同》规定的范围内变更基金的收费方式、调低申购费率或赎回费率;

④因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改;

⑤对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化;

⑥除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

②)关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行,自《基金合同》生效之日起在指定媒体公告。

2、《基金合同》的终止

有下列情形之一的,《基金合同》应当终止:

①)基金份额持有人大会决定终止的;

②)基金管理人、基金托管人职责终止,在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的;

③)《基金合同》约定的其他情形;

④)相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

3、基金财产的清算

①)基金财产清算小组:自出现《基金合同》终止情形之日起30个工作日内成立基金财产清算小组,基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

②)基金财产清算小组组成:基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

③)基金财产清算小组职责:基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

④)基金财产清算程序:

①出现《基金合同》终止情形后,由基金财产清算小组统一接管基金;

②对基金财产和债权债务进行清理和确认;

③对基金财产进行估值和变现;

④制作清算报告;

⑤聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计,聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书;

⑥将清算报告报中国证监会备案并公告;

⑦对基金财产进行分配。

⑤)基金财产清算的期限按照法律法规的规定执行。

4、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用,清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

5、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案,将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后,按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

6、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告;基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

7、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存,保管年限按照法律法规的规定执行。

(八)争议解决方式

各方当事人同意,因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议,如经友好协商未能解决的,应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁,仲裁地点为北京,仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力,仲裁费由败诉方承担。

《基金合同》受中国法律管辖。

(九)基金合同存放地和投资者取得合同的方式

《基金合同》可印制成册,供投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构的办公场所和营业场所查阅;投资者也可按工本费购买《基金合同》复制件或复印件,但内容应以《基金合同》正本为准。

七、基金财务状况

深圳证券交易所在国投瑞银中证上游资源产业指数证券投资基金(LOF)募集期间未收取任何费用,其他各基金销售机构根据本基金《招募说明书》设定的认购费用收取认购费。

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

国投瑞银中证上游资源产业指数证券投资基金(LOF)截止2011年8月22日资产负债表如下:

国投瑞银中证上游资源产业指数证券投资基金(LOF)	
2011年8月22日资产负债表	
	(除特别注明外,金额单位为人民币元)
资产	
银行存款	37,343,439.80
结算备付金	12,605,248.30
存出保证金	--
交易性金融资产	261,301,345.86
其中:股票投资	261,301,345.86
债券投资	--
资产支持证券投资	--
基金投资	--
衍生金融资产	--
买入返售金融资产	376,200,000.00
应收证券清算款	30,452,776.54
应收利息	132,535.22
应收股利	--
应收申购款	--
其他资产	139,203.77
资产总计	718,174,549.49
负债及所有者权益	
负债	
应付证券清算款	1,984,935.12
应付管理人报酬	261,921.90
应付托管费	56,749.73
应付交易费用	279,846.50
应付税费	--
应付赎回款	--
卖出回购金融资产款	--
应付利息	--
其他负债	44,908.38
负债合计	2,628,361.63
所有者权益	
实收基金	726,391,435.37
未分配利润	-10,845,247.51
所有者权益合计	715,546,187.86
负债及所有者权益总计	718,174,549.49

八、基金投资组合

截止到2011年8月22日,国投瑞银中证上游资源产业指数证券投资基金(LOF)的投资组合如下:

(一)期末基金资产组合情况

项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
权益投资	261,301,345.86	36.38
其中:股票	261,301,345.86	36.38
固定收益投资	--	--
其中:债券	--	--
资产支持证券	--	--
金融衍生品投资	--	--
买入返售金融资产	376,200,000.00	52.38
其中:买断式回购的买入返售金融资产	--	--
银行存款和结算备付金合计	49,948,688.10	6.95
其他资产	30,724,515.53	4.28
合计	718,174,549.49	100.00

(二)期末按行业分类的股票系投资组合

行业	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
A、农、林、牧、渔业	--	--
B、采掘业	188,702,384.30	26.37
C、制造业	72,598,961.56	10.15
C0、食品、饮料	--	--
C1、纺织、服装、皮毛	2,507,340.00	0.35
C2、木材、家具	--	--
C3、造纸、印刷	--	--
C4、石油、化学、塑胶、塑料	--	--
C5、电子	--	--
C6、金属、非金属	67,062,011.41	9.37
C7、机械、设备、仪表	--	--
C8、医药、生物制品	--	--
C99、其他制造业	3,029,610.15	0.42
D、电力、煤气及水的生产和供应业	--	--
E、建筑业	--	--
F、交通运输、仓储业	--	--
G、信息技术业	--	--
H、批发和零售贸易	--	--
I、金融、保险业	--	--
J、房地产业	--	--
K、社会服务业	--	--
L、传播与文化产业	--	--
M、综合类	--	--
合计	261,301,345.86	36.52

(三)期末股票投资前十名明细

序号	股票代码	股票名称	股票数量(股)	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	601699	潞安环能	527,410	16,186,212.90	2.26
2	601857	中国石油	1,443,803	14,105,955.31	1.97
3	000758	中色股份	482,498	13,944,192.20	1.95
4	601088	中国神华	542,291	13,687,424.84	1.91
5	000933	神火股份	788,030	12,655,761.80	1.77
6	600123	兰花科创	285,200	12,506,020.00	1.75
7	600489	中金黄金	424,600	12,394,074.00	1.73
8	601899	紫金矿业	1,807,281	10,319,574.51	1.44
9	000960	锡业股份	382,800	10,285,836.00	1.44
10	600348	阳泉煤业	391,100	9,992,605.00	1.40

(四)期末按券种分类的债券投资组合

截至公告前两个工作日即2011年8月22日,本基金未持有债券。

(五)期末债券投资前五名明细

截至公告前两个工作日即2011年8月22日,本基金未持有债券。

(六)投资组合报告附注

1.申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

截至公告前两个工作日即2011年8月22日,本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查的,在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

2.申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

3、截至2011年8月22日其他资产构成

单位:人民币元

序号	项目	金额
1	存出保证金	--
2	应收证券清算款	30,452,776.54
3	应收股利	--
4	应收利息	132,535.22
5	应收申购款	--
6	其他应收款	139,203.77
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	30,724,515.53

九、重大事件揭示

国投瑞银中证上游资源产业指数证券投资基金(LOF)基金合同已于2011年7月21日正式生效,基金管理人已于2011年7月22日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》刊登国投瑞银中证上游资源产业指数证券投资基金(LOF)基金合同生效公告。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出如下承诺:

(一)严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

(二)真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件,披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息,并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。

(三)在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后,将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺:

(一)严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,设立专门的基金托管部,配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员负责基金财产托管事宜。

(二)根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

(三)基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,并在限期内,随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。

(四)基金托管人发现基金管理人有重大违规行为,将立即报告中国证监会,同时书面通知基金管理人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。

十二、备查文件目录

本基金备查文件包括下列文件:

(一)中国证监会核准基金募集的文件;

(二)国投瑞银中证上游资源产业指数证券投资基金(LOF)基金合同;

(三)国投瑞银中证上游资源产业指数证券投资基金(LOF)托管协议;

(四)国投瑞银中证上游资源产业指数证券投资基金(LOF)招募说明书;

(五)法律意见书;

(六)基金管理人业务资格批件、营业执照;

(七)基金托管人业务资格批件和营业执照;

(八)中国证监会要求的其他文件。

存放地点:基金管理人和基金托管人的住所

查阅方式:基金投资者可在营业时间免费查阅,或通过指定的信息披露媒体、本基金管理人网站(www.ubssdic.com)查阅。

国投瑞银基金管理有限公司

2011年8月24日

(上接D226版)

客服电话:400-8866-567

网址:http://www.avicsec.com/

(56)国元证券股份有限公司

注册地址:安徽省合肥市寿春路179号

办公地址:合肥市花园街花园宾馆14楼

法定代表人:凤良志

联系电话:0551-2634400

客服电话:全国统一热线95578,4008888777,安徽省内热线96888

公司网站:www.gyzq.com.cn

(57)国盛证券有限责任公司

注册地址:江西省南昌市永叔路15号

办公地址:江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦4楼

法定代表人:管荣升

联系人:徐美云

联系电话:0791-6289771

公司网站:www.gsstock.com

(58)中国国际金融有限公司

注册地址:北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

办公地址:北京市建国门外甲6号SK大厦

法定代表人:李剑阁

联系人:王雪筠

联系电话:010-85679265

客服电话:(010)85679238 (010)85679169

公司网站:www.cicc.com.cn

(59)大同证券经纪有限责任公司

注册地址:山西省大同市大北街13号

办公地址:山西省太原市长治路111号山西世贸中心A座F12、F13

法定代表人:董祥

联系人:薛津

电话:0351-4130322

传真:0351-4192803

客服电话:4007121212

网址:http://www.dtsbc.com.cn

(60)方正证券股份有限公司

注册地址:湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22—24层

办公地址:湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22—24层

法定代表人:雷杰

联系人:彭博

联系电话:0731-85832343

客服电话:95571

公司网站:www.foundersc.com

(61)财通证券有限责任公司

注册地址:杭州市解放路111号金钱大厦

办公地址:杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心1602室

法定代表人:沈继宁

联系人:乔骏

联系电话:0571-87925129

客服电话:0571-96336(上海地区:962336)

公司网站:www.ctsec.com

(62)东海证券有限责任公司

注册地址:江苏省常州市延陵西路59号常信大厦18楼

办公地址:江苏省常州市延陵西路59号常信大厦18楼

法定代表人:朱科敏

联系人:霍晓飞

客服电话:400-888-8588(全国),0519-88166222(常州),021-52574550(上海),0379-64902266(洛阳)

公司网站: www.longone.com.cn

(63)西部证券股份有限公司

注册地址:陕西省西安市东新街232号陕西信托大厦16-17层

办公地址:陕西省西安市东新街232号陕西信托大厦1层

法定代表人:刘建武

联系人:冯萍

电话:029-87406488

传真:029-87424426

客服电话:95582

网址:http://www.westsecu.com/

(64)新时代证券有限责任公司

注册地址:北京市西城区月坛北街2号月坛大厦15层

办公地址:北京市西城区金融街1号A座8层

法定代表人:马金声

联系人:朱雪雁

联系电话:010-83561165

公司网站:www.xsdzq.cn

(65)瑞银证券有限责任公司

注册地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层

办公地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层

法定代表人:刘弘

联系人:邱培玲

联系电话:010-5832 8366

客服电话:400-887-8827

公司网站:www.ubssecurities.com

(66)金元证券股份有限公司

注册地址:海口市南宝路36号证券大厦4楼

办公地址:深圳市深南大道4001号时代金融中心17层

法定代表人:陆涛

联系人:金春

联系电话:0755-83025695

客服电话:4008-888-228

公司网站: www.jyzq.com.cn

(67)万联证券有限责任公司

注册地址:广州市中山二路18号电信广场36、37层

办公地址:广州市中山二路18号电信广场36、37层

法定代表人:张建军

联系人:罗创斌

联系电话:020-37865070

客服电话:400-8888-133

公司网站:www.wlzq.com.cn

(68)国金证券股份有限公司

注册地址:成都市东城根上街95号

办公地址:成都市东城根上街95号

法定代表人:冉云

联系人:金喆

电话:028-86690126

传真:028-86690126

客服电话:4006600109

网址:www.gjzq.com.cn

(69)财富证券有限责任公司

注册地址:长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼

办公地址:长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼

法定代表人:周晖

联系人:郭磊

客服电话:0731-4403360

公司网站:www.cfzq.com

(70)恒泰证券股份有限公司

注册地址:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号

南方高增长证券投资基金招募说明书(更新)摘要

办公地址:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号

法定代表人:庞介民

联系人:常向东

联系电话:0471-4979037

网址:www.cnht.com.cn

(71)华龙证券有限责任公司

注册地址:兰州市城关区静宁路308号

办公地址:兰州市城关区东岗西路638号财富大厦4楼

法定代表人:李晓安

联系人:李杨

电话:0931-8784502

传真:0931-4890628

客服电话:4006-89-8888

网址:www.hlzqgs.com

(72)华鑫证券有限责任公司

注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元

办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元

法定代表人:王文学

联系人:黄旭成

电话:0755-82083788

传真:0755-82083408

客服电话:021-32109999,029-68918888

网址:www.cfsc.com.cn

(73)江信证券有限责任公司

注册地址:内蒙古呼和浩特市新城区锡林南路18号

办公地址:北京市西城区闹市口大街1号长安兴融中心西座11层

法定代表人:孔佑杰

联系人:张霄宇

联系电话:010-88086830-669

公司网站:www.rxzq.com.cn

(74)英大证券有限责任公司

注册地址:深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层

办公地址:深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层

法定代表人:赵文安

联系人:李欣

联系电话:0755-83007179

客服电话:4008-698-698

公司网站:www.ydsc.com.cn

(75)天相投资顾问有限公司

注册地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701

办公地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座4层

法定代表人:林义相

联系人:林爽

客服电话:010-66045678

传真:010-66045500

公司网址: http://www.txsec.com

(76)其他具有开放式基金代销资格的证券公司请向当地营业网点查询

(二)注册登记机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司

注册地址:北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人:金颖

电话:010- 59378982

传真:010-59378907

联系人:程爽

(三)律师事务所

名称:广东华瀚律师事务所

注册地址:深圳市振华路402栋中联大厦511室

负责人:李兆良

电话:0755-82687860

传真:0755-82687861

经办律师:杨忠、戴瑞冬

(四)会计师事务所

名称:普华永道中天会计师事务所有限公司

住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

法定代表人:杨绍信

联系电话:(021)23238888

传真:(021)23238800

联系人:陈熹

经办会计师:薛竞、陈熹

四、基金名称

南方高增长证券投资基金

五、基金的类型

上市契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金为股票基金,在适度控制风险并保持良好流动性的前提下,以具有高成长性的公司为主要投资对象,力争为投资者寻求最高的超额回报。

七、基金的投资方向

本基金的投资标的物包括国内依法公开发行的各类股票、债券及其他金融工具,其中股票(含可转债)的投资比例为60%-95%,并以具有如下高增长特征的品种为主:

1、未来2年预期主营业务收入增长率和息税前利润增长率均超过GDP增长率3倍,且根据“南方高成长评价体系”,在全部上市公司中成长性和投资价值排名前5%的公司。

2、面临重大的发展机遇,具备超常规增长潜力的公司。

八、投资策略

1、决策依据

①)国家有关法律、法规和本基金合同的有关规定。依法决策是本基金进行投资的前提;

②)宏观经济发展态势、微观经济运行环境和证券市场走势。这是本基金投决策的基础。

③)投资对象收益和风险的配比关系。在充分权衡投资对象的收益和风险的前提下作出投资决策,是本基金维护投资者利益的重要保障。

④)团队投方式。本基金在投资决策委员会领导下,通过投资研究全体人员的共同努力与分工协作,由基金经理具体执行投资计划,争取良好投资业绩。

2、决策程序

①)决定主要投资原则:投资决策委员会是公司投资的最高决策机构,决定基金的主要投资原则,确立基金的投资方针及投资方向,审定基金的资产及行业配置方案。

②)团队投与投资决策制定:在遵守投资决策委员会制定的投资原则前提下,通过投资研究全体人员的团队投资、分工协作,由基金经理具体执行投资计划;1)、依据整体投资研究团队对宏观经济、股市政策、市场趋势的判断,结合基金合同、投资制度的要求提出本基金的资产及行业配置建议,在投资决策委员会授权及批准的范围内,最终决定基金的资产及行业配置方案;2)、依据整体投资研究团队对各行业的具体分析与股票备选名单,结合基金合同、投资制度的要求,在投资决策委员会授权及批准的范围内,制定基金的个股投资方案。

③)进行风险评估:风险控制委员会定期召开会议,对基金投资组合进行风险评估,并提出风险控制意见。

④)评估和调整决策程序:基金管理人有权根据环境的变化和实际的需要调整决策的程序。

3、投资策略

作为以高增长为目标的股票基金,本基金在股票和可转债的投资中,采用“自下而上”的策略进行投资决策,以寻求超额收益。本基金选股主要依据南方基金公司建立的“南方高成长评价体系”,通过定量与定性相结合的评价方法,选择未来2年预期主营业务收入增长率和息税前利润增长率均超过GDP增长率3倍,且根据该体系,在全部上市公司中成长性和投资价值排名前5%的公司,或者是面临重大的发展机遇,具备超常规增长潜力的公司为主要投资对象,这类股票占全部股票市值的比例不低于80%。

九、风险收益特征

本基金定位为股票基金,坚持积极投资、价值投资的理念,以具有高成长性的公司为主要投资对象,追求超额收益,因此属于证券投资基金中较高预期风险和较高预期收益的品种。

十、基金业绩比较基准

本基金股票投资部分的业绩比较基准采用上证综指,债券投资部分的业绩比较基准采用上证国债指数。作为股票基金,本基金的整体业绩比较基准可以表述为如下公式:

基金整体业绩基准=上证综指×90%+上证国债指数×10%

十一、基金投资组合报告

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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

本基金的托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同的规定,已于2011年7月22日复核了本投资组合报告的内容。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本投资组合报告所载数据截至2011年6月30日(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	2,914,244,235.52	79.73
	其中:股票	2,914,244,235.52	79.73
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	199,990,619.99	5.47
	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	506,587,124.61	13.86
6	其他资产	34,332,271.67	0.94
7	合计	3,655,154,251.79	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	18,021,105.00	0.49
B	采掘业	194,375,211.07	5.34
C	制造业	1,299,181,053.56	35.68
C0	食品、饮料	189,275,064.29	5.20
C1	纺织、服装、皮毛	47,652,179.28	1.31
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	145,013,194.84	3.98
C5	电子	209,803,706.74	5.76
C6	金属、非金属	242,207,162.10	6.65
C7	机械、设备、仪表	233,360,030.91	6.41
C8	医药、生物制品	231,869,715.40	6.37
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	308,953,856.53	8.48
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	149,561,004.07	4.11
H	批发和零售贸易	192,167,475.20	5.28
I	金融、保险业	332,429,398.97	9.13
J	房地产业	284,677,566.36	7.82
K	社会服务业	111,758,817.37	3.07
L	传播与文化产业	23,118,747.39	0.63
M	综合类	-	-
	合计	2,914,244,235.52	80.03

3、报告期末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	601117	中国化学	22,000,000	194,920,000.00	5.35
2	600256	广汇股份	8,005,055	190,360,207.90	5.23
3	600068	葛洲坝	9,510,747	114,033,856.53	3.13
4	002179	中航光电	4,912,352	110,527,920.00	3.04
5	601699	潞安环能	3,319,526	108,913,648.06	2.99
6	000877	天山股份	2,579,991	91,692,880.14	2.52
7	000069	华侨城A	10,488,407	82,963,299.37	2.28
8	000063	中兴通讯	2,703,540	76,456,111.20	2.10
9	000001	深发展A	4,380,071	74,767,811.97	2.05
10	600036	招商银行	5,592,429	72,813,425.58	2.00

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

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