中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）摘要

（2011年第2号）

基金管理人：南方基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司

本招募说明书（更新）摘要内容截止日：2011年8月27日

重要提示

[illegible]

一、基金管理人

[illegible]

二、基金托管人

[illegible]

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来，秉承"诚实信用、勤勉尽责"的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2011年6月，中国工商银行共托管证券投资基金219只，其中封闭式7只，开放式212只。自2003年以来，本行连续八年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的26项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

（四）基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部"一手抓业务拓展，一手抓内控建设"的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。继2005、2007、2009年三次顺利通过评估组织内部控制和安全措施是否充分的最权威的SAS70（审计标准第70号）审阅后，2010年中国工商银行资产托管部第四次通过SAS70审阅获得无保留意见的控制及有效性报告，表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可。也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托

[illegible]

三、相关服务机构

[illegible]

联系人：刘晨
联系电话：021-22169999
客服电话：10108998
公司网站：www.ebscn.com

（9）中国建银投资证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层至21层
办公地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层至21层
法定代表人：杨明辉
联系人：刘毅
联系电话：0755-82023442
传真 0755-82026539
客服电话：400-600-8008
公司网站：www.cjis.cn

（10）中信万通证券有限责任公司
注册地址：青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层（1507-1510室）
办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场20层
法定代表人：张智河
联系人：吴忠超
联系电话：0532-85022326

[illegible]

（3）组合构建：根据标的指数，结合研究报告，基金经理以完全复制标的指数成份股权重的方法构建组合。在追求跟踪误差和偏离度最小化的前提下，基金经理将采取适当的方法，降低买入成本、控制投资风险。

（4）交易执行：中央交易室负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责。

（5）投资绩效评估：金融工程小组定期和不定期对基金进行投资绩效评估，并提供相关报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来源及投资策略成功与否，基金经理可以据此检视投资策略，进而调整投资组合。

（6）组合维护：基金经理将跟踪标的指数变动，结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资管理体制和程序做出调整，并在《招募说明书》中列示。

九、业绩比较基准

本基金业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为中证南方小康产业指数，简称小康指数。

如果指数编制单位变更或停止中证南方小康产业指数的编制、发布或授权，或中证南方小康产业指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致本基金管理人认为中证南方小康产业指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，在履行适当程序后变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称。其中，若变更标的指数涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案且在指定媒体公告。若变更标的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响（包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案并及时公告。

十、风险收益特征

本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2011年9月8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。

本投资组合报告所载数据截至2011年6月30日（未经审计）。

（一）期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	394,654,899.33	93.83
	其中：股票	394,654,899.33	93.83
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	-	-
	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	25,486,609.80	6.06
6	其他各项资产	473,316.95	0.11
7	合计	420,614,826.08	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而（二）的合计项中不含可退替代款估值增值。

（二）期末按行业分类的股票投资组合

1、指数投资部分

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	2,234,736.00	0.56
B	采掘业	49,066,941.17	12.28
C	制造业	135,222,375.82	33.84
C0	食品、饮料	6,947,472.00	1.74
C1	纺织、服装、皮毛	6,935,697.00	1.74
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	4,895,588.30	1.23
C5	电子	7,038,215.00	1.76
C6	金属、非金属	69,182,087.46	17.31
C7	机械、设备、仪表	36,179,932.06	9.06
C8	医药、生物制品	4,043,384.00	1.01
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	15,787,702.37	3.95
E	建筑业	38,330,168.00	9.59
F	交通运输、仓储业	21,907,184.00	5.48
G	信息技术业	44,620,767.50	11.17
H	批发和零售贸易	14,334,951.80	3.59
I	金融、保险业	51,838,788.23	12.97
J	房地产业	16,211,211.80	4.06
K	社会服务业	716,650.64	0.18
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	4,383,422.00	1.10
	合计	394,654,899.33	98.77

2、积极投资部分

注：本基金本报告期未积极投资。

（三）指数投资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	占基金资产净值比例(%)
1	600050	中国联通	7,104,910	37,300,777.50	9.34
2	600019	宝钢股份	3,593,828	21,670,782.84	5.42
3	600030	中信证券	1,272,900	16,649,532.00	4.17
4	601668	中国建筑	3,570,700	14,389,921.00	3.60
5	600005	武钢股份	2,946,173	12,226,617.95	3.06
6	601939	建设银行	1,941,092	9,588,994.48	2.40
7	600010	包钢股份	994,100	8,300,735.00	2.08
8	601169	北京银行	743,100	7,408,707.00	1.85
9	600585	海螺水泥	265,100	7,359,176.00	1.84
10	601186	中国铁建	1,172,300	7,092,415.00	1.78

积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

注：本基金本报告期未积极投资。

（四）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。

（五）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

注：本基金本报告期末未持有债券。

（六）投资组合报告附注

1、本基金本期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、处罚的证券。

2、本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、其他资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	19,230.77
2	应收证券清算款	2,793.45
3	应收股利	449,291.56
4	应收利息	2,001.17
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	473,316.95

4、本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债券。

5、本基金本报告期末指数投资前五名股票中不存在流通受限情况。

本基金本报告期未积极投资。

十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、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，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，投资者在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(3)	业绩比较基准收益率标准差(4)	(1)-(3)	(2)-(4)
2010.10.1-2010.12.31	5.04%	1.71%	8.00%	1.83%	-2.96%	-0.12%
2011.1.1-2011.6.30	-0.45%	1.18%	-1.56%	1.20%	1.11%	-0.02%
自基金成立起至今	4.64%	1.31%	8.31%	1.41%	-3.67%	-0.10%

十三、基金费用概览

（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》生效后与基金相关的信息披露费用；

4）《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；

5）基金上市费及年费；

6）基金份额持有人大会费用；

7）基金的证券交易费用；

[illegible]

售在外的基金份额总数。申购、赎回清单由基金管理人编制。T日的申购、赎回清单在当日深圳证券交易所开市前公告。如遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

十四、对招募说明书更新部分的说明

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，，对本基金的原招募说明书进行了更新，，主要更新的内容如下：

1、在"基金管理人"部分，根据国际金融机构的惯例，基金管理人于2011年4月18日正式启用高级管理层职位职衔体系"总裁序列"。相较之前，原总经理职衔，现变更为总裁；原副总经理/总经理助理职衔，现变更为副总裁/总裁助理。据此变化，对"主要人员情况"相关信息进行了更新；公司增聘了副总裁，对"总经理及其他高级管理人员"进行了更新；对"基金经理"工作履历进行了更新。

2、在"基金托管人"部分，对托管人情况进行了更新。

3、在"相关服务机构"部分，更新了本基金申购、赎回代理证券公司以及二级市场交易代理证券公司的信息，更新了注册登记机构信息。

4、在"基金的投资"部分，更新了本基金最近一期投资组合报告的内容。

5、在"基金的投资"部分，更新了"净值增长率与同期业绩基准收益率比较表"。

6、对"基金份额持有人的服务"进行了更新。

7、对"其他应披露事项"进行了更新。

8、对部分表述进行了更新。

南方基金管理有限公司
二〇一一年九月三十日

证券代码：002212　　证券简称：南洋股份　　公告编号：2011-040

广东南洋电缆集团股份有限公司关于非公开发行股票限售股份上市流通的提示性公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容真实、准确和完整，并对公告中的虚假记载、误导性陈述或重大遗漏承担责任。

特别提示：

1、广东南洋电缆集团股份有限公司（以下简称"公司"）本次解除限售的非公开发行股票数量为51,534,000股，占公司总股本的10.10%；

2、本次限售股份可上市流通日为2011年10月12日。

一、公司非公开发行股票情况及前期解除限售情况

1、本次非公开发行股票相关情况

经中国证券监督管理委员会证监许可[2010]865号文核准，公司于2010年9月2日向特定9家投资者非公开发行A股2,863万股。其中，郑钟南先生认购股票数量为286.3万股，限售期为36个月，可上市流通时间为2013年10月12日；其余八家投资者认购的股票数量为2576.7万股，限售期为12个月，可上市流通时间为2011年10月12日。本次非公开发行股票于2010年10月12日在深圳证券交易所中小企业板上市。公司非公开发行股份前股本为22,650万股，发行上市后公司总股本为25,513万股。

2011年5月18日，根据公司2010年度股东大会决议，公司实施了2010年度资本公积转增股本方案：以公司总股本255,130,000股为基数，以资本公积金向全体股东每10股转增10股，共计转增255,130,000股。9家特定对象在转增实施后股本增至5,726万股，公司总股本增至51,026万股。

2、历次股份解除限售情况

（1）2009年2月1日，公司首次公开发行前已发行股份解除限售226,000股，实际可上市流通股份数量为98,875股，上市流通日为2009年2月2日。

（2）2011年2月1日，公司首次公开发行前已发行股份解除限售169,161,000股，实际可上市流通股份数量为52,353,501股。

二、相关股东履行股份限售承诺情况

根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》的规定及参与认购的非公开

发行股份投资者承诺：控股股东郑钟南承诺其认购的本次非公开发行股票自2010年10月12日起36个月内不转让。其他八家投资者陈炳基、国华人寿保险股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、上海淳阳顺投资发展中心（有限合伙）、杭州博泰信息技术服务有限公司、常州投资集团有限公司、湖北益龙创业投资有限公司和西安国际信托有限公司承诺其认购的本次非公开发行股票自2010年10月12日起12个月内不转让。

截止本公告日，本次解禁限售股份持有人不存在非经营性占用公司资金的情形，公司亦不存在为其提供担保的情况。上述承诺均得到了严格履行。

三、本次限售股份可上市流通安排

1、本次限售股份可上市流通日为2011年10月12日；

2、本次可上市流通股份的总数为51,534,000股，占公司总股本的10.10%；

3、本次申请解除股份限售的股东为8家。

4、本次股份解除限售及上市流通具体情况如下：

序号	限售股份持有人名称	持有限售股份数	本次解除限售数量	备注
1	陈炳基	6,000,000	6,000,000	其中冻结股份数为3,000,000股
2	国华人寿保险股份有限公司	9,600,000	9,600,000	
3	中信建投证券有限责任公司	3,934,000	3,934,000	
4	上海淳阳顺投资发展中心（有限合伙）	6,000,000	6,000,000	
5	杭州博泰信息技术服务有限公司	6,000,000	6,000,000	
6	常州投资集团有限公司	8,000,000	8,000,000	
7	湖北益龙创业投资有限公司	6,000,000	6,000,000	
8	西安国际信托有限公司	6,000,000	6,000,000	
	合计	51,534,000	51,534,000	

四、公司股份变动情况表

股份类型	本次限售股份变动前	本次变动		本次变动后
		增加	减少	
总股份	510,260,000	-	-	510,260,000
一、无限售条件的流通股	219,178,424	51,534,000	0	270,712,424
二、有限售条件股份	291,081,576	0	51,534,000	239,547,576
1、国家持股	0	0	0	0
2、国有法人持股	11,934,000	0	11,934,000	0
3、境内非国有法人持股	24,000,000	0	24,000,000	0
4、境内自然人持股	11,726,000	0	6,000,000	5,726,000
5、基金、产品及其他	9,600,000	0	9,600,000	0
6、高管股份	233,821,576	0	0	233,821,576

五、保荐机构核查的结论性意见

经核查，保荐机构认为：

（1）公司本次解除限售股份数量、上市流通时间符合《公司法》、《证券法》、《深圳证券交易所股票上市规则》、《深圳证券交易所中小板上市公司规范运作指引》等有关法律、法规、规章的要求；

（2）公司本次解禁限售股份持有人陈炳基、国华人寿保险股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、上海淳阳顺投资发展中心（有限合伙）、杭州博泰信息技术服务有限公司、常州投资集团有限公司、湖北益龙创业投资有限公司和西安国际信托有限公司严格履行了股份限售承诺；

（3）公司本次解禁限售股份持有人不存在非经营性占用公司资金的情形，公司未为上述股东提供担保；

（4）公司对上述内容的信息披露真实、准确、完整。

综上，本保荐机构同意公司本次解除限售股份上市流通。

六、备查文件

1、广东南洋电缆集团股份有限公司限售股份上市流通申请报告

2、广东南洋电缆集团股份有限公司限售股份上市流通申请表

3、股本结构表和限售股份明细数据表

4、保荐机构的核查意见

特此公告

广东南洋电缆集团股份有限公司董事会
二〇一一年九月三十日

证券代码：002212　　证券简称：南洋股份　　公告编号：2011-041

广东南洋电缆集团股份有限公司第三届董事会第三次会议决议公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容真实、准确和完整，并对公告中的虚假记载、误导性陈述或重大遗漏承担责任。

广东南洋电缆集团股份有限公司（下称公司）第三届董事会第三次会议于2011年9月29日上午9:00在本公司三楼会议室以现场表决的形式召开，会议通知于2011年9月24日以传真等通讯方式向全体董事发出。应到董事9名，实到董事9名。会议的召集和召开符合《中华人民共和国公司法》和《公司章程》的有关规定。会议审议通过了以下议案：

一、以9票赞成，0票反对，0票弃权审议并通过《关于公司内部控制规则落实情况自查报告》的议案；

根据深圳交易所《关于开展"加强中小企业板上市公司内控规则落实"专项活动的通知》要求，公司对内部控制规则落实情况进行了认真核查，自查报告于2011年9月30日刊登在巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn）。保荐人出具的核查意见详见同日巨潮资讯网。

二、以9票赞成，0票反对，0票弃权审议并通过《关于向交通银行股份有限公司汕头分行申请不超过2.2亿元授信额度》的议案。

因公司经营需要，拟向交通银行股份有限公司汕头分行申请不超过人民币2.2亿元的授信额度。授信期限为申请获批准后二年内有效。

本议案须提请公司2011年第五次临时股东大会审议。

三、以9票赞成，0票反对，0票弃权审议并通过了《关于召开2011年第五次临时股东大会》的议案。

会议召开基本情况：

1、会议地点：广州经济技术开发区永和区永丰路19号四楼会议室

2、股权登记日：2011年10月12日

3、会议召开时间：2011年10月15日下午15:00

《召开2011年第五次临时股东大会的通知》于2011年9月30日刊登在巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn）、《证券时报》、《中国证券报》和《上海证券报》。

特此公告！

广东南洋电缆集团股份有限公司董事会
二〇一一年九月三十日

证券代码：002212　　证券简称：南洋股份　　公告编号：2011-042

广东南洋电缆集团股份有限公司关于召开2011年第五次临时股东大会的通知

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

广东南洋电缆集团股份有限公司（下称公司）第三届董事会第三次会议于2011年9月29日上午9:00在本公司三楼会议室以现场表决的形式召开，会议决定于2011年10月15日召开公司2011年第五次临时股东大会。本次股东大会采用现场投票的方式进行，现将有关事项通知如下：

一、会议召开的基本情况

（一）会议时间：2011年10月15日下午15:00

（二）会议地点：广州经济技术开发区永和区永丰路19号四楼会议室

（三）会议召集人：公司董事会

（四）会议召开方式：现场会议

二、会议审议事项

审议《关于向交通银行股份有限公司汕头分行申请不超过2.2亿元授信额度》的议案；

以上议案内容详见本公司在《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》及巨潮资讯网（http://www.cninfo.com.cn）上发布的第三届董事会第三次会议决议公告。

三、出席会议人员

（一）本次股东大会的股权登记日为2011年10月12日，截止2011年10月12日15:00在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司登记在册的本公司股东。全体股东均有权出席股东大会，并可以书面委托代理人出席会议或参加表决，该股东代理人不必是公司的股东。

（二）公司董事、监事及高级管理人员。

（三）公司聘请的见证律师及公司邀请的其他嘉宾。

四、参加会议登记办法

（一）登记时间：2011年10月13日至14日，上午9:30-12:30、下午13:30-17:30

（二）登记地点：公司董事会办公室

（三）登记办法：

1、自然人股东本人出席会议的，凭本人有效身份证原件、股票账户卡、持股凭证等办理登记手续；

自然人股东委托代理人出席会议的，凭代理人本人有效身份证原件、自然人股东出具的授权委托书、自然人股东的证券账户卡及持股凭证等办理登记手续；

2、法人股东由法定代表人出席会议的，凭本人有效身份证原件、证明具有法定代表人资格的书面证明（加盖公章）、法人股东的营业执照复印件（加盖公章）、单位持股凭证；

法人股东由法定代表人委托的代理人出席会议的，凭代理人本人有效身份证原件、法人股东单位的法定代表人出具的授权委托书（见附件）法人股东的营业执照复印件（加盖公章）、单位持股凭证等办理登记手续；

3、异地股东可凭以上有关证件采取信函或传真方式登记，公司不接受电话登记。

五、其他事项

（一）本次会议会期半天，出席会议者食宿费、交通费自理。

（二）联系人：曾理先生

（三）联系电话：0754-86332188　　传真：0754-86332188

（四）邮政编码：515041

广东南洋电缆集团股份有限公司董事会
二〇一一年九月三十日

附件：

授权委托书

兹委托　　女士/先生代表本人（单位）出席广东南洋电缆集团股份有限公司2011年第五次临时股东大会，并代为行使表决权。

授权期限：自本授权委托书签发之日起至2011年第五次临时股东大会结束时止。

审议《关于向交通银行股份有限公司汕头分行申请不超过2.2亿元授信额度》的议案；

同意□　反对□　弃权□

委托人签名（盖章）：　　身份证号码：

持股数量：　股　　股东账号：

受托人签名：　　身份证号码：

受托日期：　年　月　日

注：1、股东请在选项中打√；

2、每项均为单选，多选无效；

3、授权委托书用剪报或复印件均有效。