南方新兴消费增长分级股票型证券投资基金之消费收益与消费进取基金份额上市交易公告书

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

公告日期:二〇一二年四月二十日

一、重要声明与提示

《南方新兴消费增长分级股票型证券投资基金之消费收益与消费进取基金份额上市交易公告书》(以下简称"本公告")依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号(上市交易公告书的内容与格式)》、《深圳证券交易所交易规则》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,南方新兴消费增长分级股票型证券投资基金(以下简称"本基金")管理人南方基金管理有限公司的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、深圳证券交易所对南方新兴消费增长分级股票型证券投资基金之消费收益与消费进取基金份额上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。凡本公告未涉及的有关内容,请投资者详细查阅刊登在《证券时报》及南方基金管理有限公司网站(www.nffund.com)上公告的《南方新兴消费增长分级股票型证券投资基金招募说明书》。

二、基金概览

1.基金名称:南方新兴消费增长分级股票型证券投资基金(基金简称"南方消费",基金代码"160127")

2.基金类型:股票型

3.基金运作方式:契约型开放式

4.基金份额结构:本基金的基金份额包括基础份额和分级份额。基础份额为"南方消费基础份额",分为场外基础份额和场内基础份额(基金简称"南方消费",基金代码"160127");分级份额包括南方消费收益份额(基金简称"消费收益",基金代码"150049")和南方消费进取份额(基金简称"消费进取",基金代码"150050")。南方消费收益份额和南方消费进取份额的基金份额配比保持1:1的比例不变。

5.本基金的存续期限为不定期。

6.本基金通过场外、场内两种方式公开发售南方消费基础份额。投资人场外认购所得的份额,不进行分拆。投资人场内认购所得的份额,按1:1的基金份额配比分拆为南方消费收益份额和南方消费进取份额。

7.基金合同生效后,南方消费基础份额只可以进行场外和场内申购、赎回,但不上市交易。南方消费收益份额和南方消费进取份额只可在深圳证券交易所上市交易,但不单独进行申购和赎回。

8.南方消费基础份额的申购与赎回;投资者可通过场外或场内两种方式申购与赎回南方消费基础份额。南方消费收益份额与南方消费进取份额不接受投资者的申购与赎回。

场外申购和赎回场所为基金管理人的直销网点及基金场外代销机构的代销网点,投资者需使用中国证券登记结算有限责任公司(深圳)开放式基金账户办理南方消费基础份额的场外申购与赎回业务。

场内申购和赎回场所为深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位,投资者需使用深圳证券账户,通过深圳证券交易所交易系统办理南方消费基础份额的场内申购与赎回业务。

9.份额配对转换

份额配对转换是指南方消费基础份额与南方消费收益份额和南方消费进取份额之间的配对转换,包括分拆与合并。分拆指基金份额持有人将其持有的每2份南方消费基础份额按照1:1的份额配比转换成1份南方消费收益份额与1份南方消费进取份额的行为。合并指基金份额持有人将其持有的每1份南方消费收益份额与1份南方消费进取份额按照1:1的基金份额配比转换成2份南方消费基础份额场内份额的行为。份额配对转换业务将于2012年4月25日开始办理。

10.基金份额折算

基金份额折算的频率为每个会计年度进行1次(到点折算除外),折算周期到期日为基金合同生效日的年度对日或上一折算周期到期日的年度对日,若该日为非工作日则顺延至下一工作日。有关基金份额的定期折算和到点折算约定,参见基金合同基金份额折算章节。定期折算日或到点折算日的具体日期和安排,详见基金管理人届时发布的公告。

11.基金份额总额

截至2012年4月18日,本基金的份额总额为1,929,828,737.62份;其中,南方消费基础份额为1,177,567,468.62份;南方消费收益份额为376,130,634份;南方消费进取份额为376,130,635份。

12.基金份额净值

截至2012年4月18日,南方消费基础份额的基金份额净值为1.002,南方消费收益份额的基金份额净值为1.007;南方消费进取份额的基金份额净值为0.997。

13.本次上市交易份额

基金份额简称:消费收益,基金代码:150049

基金份额简称:消费进取,基金代码:150050

14.上市交易的证券交易所:深圳证券交易所

15.上市交易日期:2012年4月25日

16.基金管理人:南方基金管理有限公司

17.基金托管人:中国工商银行股份有限公司

18.本次上市交易的基金份额注册登记机构:中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司

三、基金的募集与上市交易

(一)本次基金上市前基金募集情况

1.基金募集申请的核准机构和核准文号:中国证券监督管理委员会证监许可[2011]1279号

2.基金合同生效日:2012年3月13日

3.基金运作方式:契约型开放式

4.基金合同期限:不定期

5.发售日期:2012年2月7日至2012年3月7日

6.发售价格:1.00元人民币

7.发售方式:场外、场内认购

8.发售机构:

(1)场外销售机构:

1)直销机构:南方基金管理有限公司

2)场外代销机构:

中国工商银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、中国邮政储蓄银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、广发银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、中国光大银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、深圳发展银行股份有限公司、杭州银行股份有限公司、上海银行股份有限公司、北京银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、上海农村商业银行股份有限公司、东莞银行股份有限公司、华夏银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、南京银行股份有限公司、汉口银行股份有限公司、温州银行股份有限公司、乌鲁木齐市商业银行股份有限公司、广州银行股份有限公司、华泰证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、海通证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、长城证券有限责任公司、招商证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中银万国证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、宏源证券股份有限公司、湘财证券有限责任公司、中信证券(浙江)证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、中信万通证券有限责任公司、中银国际证券有限责任公司、信达证券股份有限公司、民生证券有限责任公司、东方证券股份有限公司、华融证券股份有限公司、华西证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、世纪证券有限责任公司、东北证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、江海证券有限公司、国联证券股份有限公司、东莞证券有限责任公司、渤海证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、国都证券有限责任公司、东吴证券股份有限公司、东兴证券有限责任公司、华林证券有限责任公司、南京证券有限责任公司、华安证券有限责任公司、华宝证券有限责任公司、山西证券股份有限公司、第一创业证券股份有限公司、华福证券有限责任公司、中山证券有限责任公司、国海证券有限责任公司、中原证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、德邦证券有限责任公司、中航证券有限公司、国元证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、大同证券经纪有限责任公司、方正证券股份有限公司、财通证券有限责任公司、东海证券有限责任公司、西部证券股份有限公司、新时代证券有限责任公司、瑞银证券有限责任公司、金元证券股份有限公司、万联证券有限责任公司、国金证券股份有限公司、财富证券有限责任公司、恒泰证券股份有限公司、华龙证券有限责任公司、华鑫证券有限责任公司、日信证券有限责任公司、天相投资顾问有限公司(排名不分先后)。

(2)场内代销机构:

场内代销机构为具有基金代销业务资格的深交所会员单位,具体名单见深圳证券交易所网站。

9.验资机构名称:普华永道中天会计师事务所有限公司

10.募集资金总额及入账情况

本次募集的净认购金额为1,929,268,676.92元人民币,认购资金在本基金验资确认日之前产生的银行利息共计566,365.50元人民币,按照本基金基金合同和招募说明书的约定,其中560,060.70元折算为基金份额分别计入各基金份额持有人基金账户,归基金份额持有人所有;其余的6,304.80元为利息折份额计算尾差归入基金财产。

本次募集有效认购总户数为29,998户,按照每份基金份额面值1.00元人民币计算,募集期募集资金及利息结转的基金份额共计1,929,828,737.62份,场外认购的基金份额为1,177,567,468.62份,场内认购的基金份额为752,261,269.00份。其中本基金管理人基金从业人员认购持有的基金份额总额为200,640.86份(含募集期利息结转的份额),占本基金总份额的比例为0.01%。

募集资金已于2012年3月13日划入本基金在基金托管人中国工商银行股份有限公司开立的基金托管专户。

11.本基金募集备案情况:本基金于2012年3月13日验资完毕,2012年3月13日向中国证监会提交了验资报告,办理基金备案手续,并于2012年3月13日获得书面确认,本基金合同自该日起正式生效。

12.基金合同生效日:2012年3月13日

13.基金合同生效日的基金份额总额:1,929,828,737.62份

(二)本基金上市交易的主要内容

1.基金上市交易的核准机构和核准文号:深证上[2012]90号

2.上市交易日期:2012年4月25日

3.上市交易的证券交易所:深圳证券交易所

4.上市交易份额简称:消费收益、消费进取

5.交易代码:消费收益为150049,消费进取为150050

6.本次上市交易份额:消费收益为376,130,634份,消费进取为376,130,635份。

7.未上市交易份额的流通规定:未上市交易的场外南方消费基础份额,持有人将其转托管至深圳证券交易所场内后,选择将南方消费基础份额分拆为消费收益和消费进取后,即可上市流通。

8.基金资产净值的披露:开放式基金每个工作日交易结束后对基金资产净值进行的估值。

基金管理人每日对基金资产估值,用于基金信息披露的基金资产净值和南方消费、消费收益和消费进取的基金份额净值由基金管理人负责计算,基金托管人复核。基金管理人于每个工作日交易结束后将经过基金托管人复核的基金份额净值传给深交所,深交所于次日通过行情系统揭示。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

(一)持有人户数

截至2012年4月18日,场内基金份额持有人户数为12,173户,平均每户持有的基金份额为61,797.52份。其中,消费收益份额持有人户数为12,173户,平均每户持有的场内基金份额为30,898.76份;消费进取份额持有人户数为12,173户,平均每户持有的场内基金份额为30,898.76份。

(二)持有人结构

截至2012年4月18日,本基金场内份额持有人结构如下:

场内机构投资者持有的消费收益和消费进取基金份额分别为57,450,005份和57,450,006份,分别占本次消费收益场内基金总份额15.2740%和15.2740%;场内个人投资者持有的基金份额为318,680,629份和318,680,629份,占场内基金总份额的84.7260%和84.7260%。

(三)截至2012年4月18日,前十名场内基金份额持有人情况

基金简称:消费收益　　基金代码:150049

序号	持有人名称(全称)	证券帐户号	持有基金份额	占场内基金份额的比例(%)
1	山西明坤科工贸集团有限公司	0800031769	12,170,852	3.24
2	北方国际信托股份有限公司	0899025138	10,000,694	2.66
3	中国银河证券股份有限公司	0899054806	10,000,694	2.66
4	芦金营	0061927392	5,000,486	1.33
5	天津国际投资有限公司	0800018860	5,000,486	1.33
6	周元章	0125378520	3,100,145	0.82
7	王大林	0121281151	3,000,250	0.80
8	浙江万亿投资有限公司	0800170763	2,994,208	0.80
9	屠然	0149714457	2,744,766	0.73
10	华宝信托有限责任公司-单一类资金信托R2007ZX068	0899047003	2,500,174	0.66
合计			56,512,755	

基金简称:消费进取　　基金代码:150050

序号	持有人名称(全称)	证券帐户号	持有基金份额	占场内基金份额的比例(%)
1	山西明坤科工贸集团有限公司	0800031769	12,170,852	3.24
2	北方国际信托股份有限公司	0899025138	10,000,694	2.66
3	中国银河证券股份有限公司	0899054806	10,000,694	2.66
4	芦金营	0061927392	5,000,486	1.33
5	天津国际投资有限公司	0800018860	5,000,486	1.33
6	周元章	0125378520	3,100,146	0.82
7	王大林	0121281151	3,000,250	0.80
8	浙江万亿投资有限公司	0800170763	2,994,207	0.80
9	屠然	0149714457	2,744,767	0.73
10	华宝信托有限责任公司-单一类资金信托R2007ZX068	0899047003	2,500,173	0.66
合计			56,512,755	

注:以上信息依据中国证券登记结算有限公司深圳分公司提供的持有人信息编制。

五、基金主要当事人简介

(一)基金管理人

名称:南方基金管理有限公司

法定代表人:吴万善

总经理:高良玉

注册资本:1.5亿元人民币

注册地址:深圳市福田中心区福华一路6号免税商务大厦塔楼31、32、33层整层

设立批准文号:中国证监会证监基字[1998]4号

工商登记注册的法人营业执照文号:440301103129537

经营范围:基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务

2.股东及其出资比例:华泰证券股份有限公司45%、深圳市投资控股有限公司30%、厦门国际信托有限公司15%及兴业证券股份有限公司10%。

3.内部组织结构及职能

委员会名称	职责
投资决策委员会	指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则
风险控制委员会	研究制定风险管理政策和制度,提出重大风险的解决方案,指导和监督各职能部门开展风险管理工作
估值委员会	负责公司估值原则的确定及调整;对特殊品种及特殊情况的估值予以确定。
信息技术治理委员会	负责公司中长期信息技术的规划及信息技术治理工作。
市场营销委员会	审议公司营销、宣传、产品设计等方案;督促并指导市场体系各部门的工作;
年金投资决策委员会	对年金大类资产配置进行决策。
部门名称	职能定位
投资部	负责公募股票类基金产品的投资管理
研究部	负责宏观策略、行业与上市公司研究
专户投资管理部	负责年金、社保及专户产品的权益类资产的投资管理
固定收益部	负责固定收益类基金产品及资产的投资管理
国际业务部	负责国际基金的投资管理与业务合作
数量化投资部	负责数量化基金、指数基金的投资运作及数量化投资策略、金融工程的研究
养老金业务部	负责企业年金基金的市场开拓与服务
机构业务部	负责机构直销及一对一专户产品的业务拓展及服务工作
产品开发部	负责产品开发、设计、报批及产品管理工作
营销策划部	负责品牌及产品推广、营销策划、媒体宣传、公共关系维护
市场管理部	负责对各营销中心的监督管理、代销渠道总部的开发及维护、渠道经理的培训等
北京营销中心	负责所在区域公募基金、一对多专户等产品的销售工作及区域内代销渠道机构的维护和服务
上海营销中心	
深圳营销中心	
广州营销中心	
成都营销中心	
西安营销中心	
哈尔滨营销中心	
沈阳营销中心	
南京营销中心	
电子商务部	负责基金产品的网上销售及公司网站建设
客户服务部	为基金持有人提供专业服务及投资理财资讯服务
合肥分公司	CALL-CENTER客户营销及服务中心
监察稽核部	负责合规及运作风险的全面管理
风险管理部	负责投资风险识别、评估、控制、应急处理及业绩归因分析
交易管理部	负责执行基金、组合交易指令,实施一线风险监控
信息技术部	负责信息技术平台建设、保障业务开展
运作保障部	负责投资交易与产品销售的后台清算、核算及投资运作的定期信息披露
人力资源管理与服务	负责人力资源管理与服务,使公司获取并保持人力资源竞争优势
综合管理部	负责办公管理、财务管理、后勤保障
规划发展部	负责公司发展战略规划研究、基金行业动态分析及公司社会公益事业建设
党群工作部	负责党务及共青团、工会工作
基建办	负责公司办公大楼的基建工作
北京分公司	作为公司在北京地区的业务窗口
上海分公司	作为公司在上海地区的业务窗口

4.人员情况

截止到2012年3月,我公司共有员工359人,博士12人、硕士182人、本科150人、其他15人。

5.信息披露负责人:鲍文革

咨询电话:400-889-8899

6.基金管理业务情况

截至2011年末,南方基金管理有限公司旗下共管理30只开放式基金和2只封闭式基金及多只社保投资组合和企业年金投资组合,管理总资产规模超过1700亿元人民币,旗下管理的开放式基金有南方稳健、南方宝元、南方避险、南方现金、南方积配、南方高增、南方多利、南稳武号、南方绩优、南方隆元、南方成份、南方价值、南方盛元、南方恒元、南方300、南方500、深成ETF、南方深成、南方策略、小康ETF、南方小康、南方广利、南方成长、南方50倍、南方保本、380ETF、南方380、南方全球、南方金砖和南方中国;封闭式基金有基金开元和基金天元;以及多个全国社会保障基金委托投资组合和企业年金投资组合。

7.本基金基金经理简介

杜冬松先生,第三军医大学医学硕士,具有基金从业资格。曾担任天津272医院外科主治医师、深圳健安医药市场部部长、中新药业或药分公司学术推广部部长;2002年4月至2008年8月,历任平安证券研究所研究员、医药行业首席研究员、行业部副总经理。2008年9月加入南方基金,任研究部医药行业首席研究员和消费组组长;2012年3月至今,任南方消费基金经理。

张旭先生,毕业于中央财经大学,获金融学硕士学位,具有基金从业资格。2008年加入南方基金,曾任金融及地产行业研究员、高级策略研究员、南方盛元基金经理助理;2012年3月至今,任南方消费基金经理。

(二)基金托管人

1.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334,018,850,026元

联系电话:010-66105799

联系人:赵会军

2.主要人员情况

截至2011年12月末,中国工商银行资产托管部共有员工145人,平均年龄30岁,95%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

3.基金托管业务经营情况

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12月,中国工商银行共托管证券投资基金231只,其中封闭式7只,开放式224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28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。

(三)验资机构

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:薛尧、陈熹

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七、基金财务状况

本基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费及其他费用由基金管理人承担,不从基金财产中支付。其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率或佣金比例收取认购费。

本基金募集结束后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

南方新兴消费增长分级股票型证券投资基金2012年4月18日资产负债表如下:

资　产	期　末	负债和所有者权益	期　末
	余　额		余　额
资　产:		负债:	
银行存款	419,215,621.82	短期借款	
结算备付金	29,102,747.41	交易性金融负债	
存出保证金	222,137.75	衍生金融负债	
交易性金融资产	294,037,079.57	卖出回购金融资产款	
其中:股票投资	293,231,321.37	应付证券清算款	9,897,824.55
债券投资	805,758.20	应付赎回款	
资产支持证券投资		应付管理人报酬	1,421,032.61
基金投资		应付托管费	236,838.77
衍生金融资产		应付销售服务费	
买入返售金融资产	1,200,000,000	应付交易费用	239,036.78
应收证券清算款		应付税费	
应收利息	2,157,395.81	应付利息	
应收股利	115,658.10	应付利润	
应收申购款		其他负债	
其他资产		负债合计	11,794,732.71
		所有者权益:	
		实收基金	1,929,828,737.62
		未分配利润	3,227,170.13
		所有者权益合计	1,933,055,907.75
资产合计:	1,944,850,640.46	负债与持有人权益总计:	1,944,850,640.46

八、基金投资组合

截止到2012年4月18日,南方新兴消费增长分级股票型证券投资基金的投资组合如下:

(一)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	293,231,321.37	15.08
	其中:股票	293,231,321.37	15.08
2	固定收益投资	805,758.20	0.04
	其中:债券	805,758.20	0.04
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	1,200,000,000.00	61.70
	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	448,318,369.23	23.05
6	其他资产	2,495,191.66	0.13
7	合计	1,944,850,640.46	100.00

(二)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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	214,764,019.53	11.11
C0	食品、饮料	73,523,850.54	3.80
C1	纺织、服装、皮毛	8,401,004.90	0.43
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	4,379,819.25	0.23
C5	电子	7,396,476.00	0.38
C6	金属、非金属	8,796,966.00	0.46
C7	机械、设备、仪表	88,718,492.41	4.59
C8	医药、生物制品	21,720,675.39	1.12
C99	其他制造业	1,826,735.04	0.09
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	9,119,202.06	0.47
H	批发和零售贸易	33,356,490.38	1.73
I	金融、保险业	16,092,788.43	0.83
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	19,898,820.97	1.03
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	293,231,321.37	15.17

(三)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	000651	格力电器	973,782	21,043,429.02	1.09
2	000963	华东医药	671,729	16,853,680.61	0.87
3	000800	一汽轿车	1,178,066	13,170,777.88	0.68
4	000069	华侨城A	1,652,500	12,327,650.00	0.64
5	600741	华域汽车	1,165,550	12,179,997.50	0.63
6	600742	一汽富维	547,420	12,125,353.00	0.63
7	000527	美的电器	893,506	11,865,759.68	0.61
8	600887	伊利股份	514,036	11,791,985.84	0.61
9	000895	双汇发展	166,486	11,404,291.00	0.59
10	600809	山西汾酒	144,800	10,293,832.00	0.53

(四)报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	805,758.20	0.04
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	805,758.20	0.04

(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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	120288	02金茂债	8,060	805,758.20	0.04

(六)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(七)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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

(八)投资组合报告附注

1. 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	222,137.75
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	115,658.10
4	应收利息	2,157,395.81
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,495,191.66

2. 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

3. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

九、重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺:

(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、深圳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

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺:

(一)严格遵守《证券基金法》、《证券基金投资运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则托管基金资产。

(二)根据《证券基金法》、《证券基金投资运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》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、基金份额净值计算进行监督和核查;如发现基金管理人违反《证券基金法》、《证券基金投资运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定,将及时通知基金管理人纠正;基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人将及时向中国证监会报告。

十二、备查文件目录

以下备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所,投资者可在办公时间免费查阅。

(一)中国证监会核准基金募集的文件

(二)《南方新兴消费增长分级股票型证券投资基金基金合同》

(三)《南方新兴消费增长分级股票型证券投资基金托管协议》

(四)《南方新兴消费增长分级股票型证券投资基金招募说明书》

(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、营业执照

南方基金管理有限公司
二〇一二年四月二十日

附件:基金合同摘要

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

(一)基金份额持有人的权利与义务

基金投资者购买本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受,基金投资者自取得依据《基金合同》募集的基金份额,即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人,直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

除份额净值计算、收益分配、基金份额折算、《基金合同》终止时的基金清算财产分配、南方消费收益份额和南方消费进取份额终止运作后的份额折算及本合同对的其他特别约定外,本基金每份基金份额具有同等的合法权益。如果南方消费收益份额和南方消费进取份额的运作出现终止,则在终止南方消费收益份额和南方消费进取份额的运作后,本基金每份基金份额具有同等的合法权益。

1.根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的权利包括但不限于:

(1)分享基金财产收益;

(2)参与分配清算后的剩余基金财产;

(3)依法申请赎回其持有的基金份额;

(4)按照规定要求召开基金份额持有人大会;

(5)出席或者委派代表出席基金份额持有人大会,对基金份额持有人大会审议事项行使表决权;

(6)查阅或者复制公开披露的基金信息资料;

(7)监督基金管理人的投资运作;

(8)对基金管理人、基金托管人、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼;

(9)法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

2.根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的义务包括但不限于:

(1)遵守《基金合同》;

(2)缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用;

(3)在其持有的基金份额范围内,承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任;

(4)不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动;

(5)返还在基金交易过程中因任何原因,自基金管理人、基金托管人及代销机构处获得的不当得利;

(6)执行生效的基金份额持有人大会的决定;

(7)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(二)基金管理人的权利与义务

1.根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的权利包括但不限于:

(1)依法募集基金;

(2)自《基金合同》生效之日起,根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产;

(3)依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用;

(4)销售基金份额;

(5)召集基金份额持有人大会;

(6)依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人,如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定,应呈报中国证监会和其他监管部门,并采取必要措施保护基金投资者的利益;

(7)在基金托管人更换时,提名新的基金托管人;

(8)选择、委托、更换基金代销机构,对基金代销机构的相关行为进行监督和处理;

(9)担任或委托其他符合条件的机构担任基金注册登记机构办理基金注册登记业务并获得《基金合同》规定的费用;

(10)依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案;

(11)在《基金合同》约定的范围内,拒绝或暂停受理申购与赎回申请;

(12)在符合有关法律法规和《基金合同》的前提下,制订和调整《业务规则》,决定和调整除调高管理费率和托管费率之外的基金相关费率结构和收费方式;

(13)依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利,为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利;

(14)在法律法规允许的前提下,为基金的利益依法为基金进行融资;

(15)以基金管理人的名义,代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;

(16)选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;

(17)法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

2.根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的义务包括但不限于:

(1)依法募集基金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;如认为基金代销机构违反《基金合同》、基金销售与服务代理协议及国家有关法律规定,应呈报中国证监会和其他监管部门,并采取必要措施保护基金投资者的利益;

(2)办理基金备案手续;

(下转D115版)

南方新兴消费增长分级股票型证券投资基金开放日常申购、赎回及定期定额投资业务的公告

公告送出日期:2012年4月20日

1.公告基本信息

基金名称	南方新兴消费增长分级股票型证券投资基金		
基金简称	南方新兴消费增长分级股票		
场内简称	南方消费		
基金主代码	160127		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012年3月13日		
基金管理人名称	南方基金管理有限公司		
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司		
基金注册登记机构名称	中国证券登记结算有限责任公司		
公告依据	《南方新兴消费增长分级股票型证券投资基金基金合同》、《南方新兴消费增长分级股票型证券投资基金招募说明书》		
申购起始日	2012年4月25日		
赎回起始日	2012年4月25日		
转换转入起始日	-		
转换转出起始日	-		
定期定额投资起始日	2012年4月25日		
下属分级基金的基金简称	南方消费	消费收益	消费进取
下属分级基金的交易代码	160127	150049	150050
下属分级基金的前端交易代码	-	-	
下属分级基金的后端交易代码	-	-	
该分级基金是否开放申购、赎回、定期定额投资	是	否	否

注:本基金的基金份额包括基础份额和分级份额。基础份额为"南方消费基础份额"(基金简称"南方消费",基金代码"160127"),分为场外和场内两部分;分级份额包括南方消费收益份额(基金简称"消费收益",基金代码"150049")和南方消费进取份额(基金简称"消费进取",基金代码"150050")。基金合同生效后,投资者可以通过场外或场内方式申购赎回南方消费基础份额。南方消费收益份额和南方消费进取份额不接受投资者的申购赎回。

2.日常申购、赎回、定期定额投资业务的办理时间

南方消费基础份额申购和赎回的开放日为证券交易所交易日(基金管理人公告暂停申购或赎回时除外),投资者应当在开放日办理申购和