(上接 D22 版)

本基金管理人可根据情况变更或增减上述销售机构,并将另行公告。

具体可转换基金为各销售机构已销售基金。

(三)基金转换费及转换份额的计算:

1、进行基金转换的总费用包括转换手续费、转出基金的赎回费和转入基金与转出基金的申购补差费三部分。

(1)转换手续费率为零。如基金转换手续费率调整将另行公告。

(2)转出基金赎回费=转出金额×转出基金赎回费率

其中:转出金额=转出基金份额×转出基金当日基金份额净值

目前,本公司旗下开通转换业务的基金赎回费率如下:

基金名称	持有时间	费率
国联安稳健混合	全部	0.50%
国联安小盘精选混合 国联安中心成长混合 国联安精选股票 国联安优势股票 国联安红利股票 国联安主题驱动股票	持有 1 年以下	0.50%
	持有 1 年(含)至 2 年	0.25%
	持有 2 年(含)及以上	0.00%
国联安优选行业股票	持有 1 年以下	0.50%
	持有 1 年(含)至 2 年	0.20%
	持有 2 年(含)及以上	0.00%
国联安上证商品 ETF 联接	持有 1 年以下	0.50%
	持有 1 年(含)至 2 年	0.30%
	持有 2 年(含)及以上	0.00%
国联安增利债券 A	90天以下	0.30%
	90天以上	0.00%
国联安增利债券 B	持有 30 天以下	0.75%
	持有 30 天(含)及以上	0.00%
国联安信心增益债券	持有 30 天以下	0.90%
	持有 30 天(含)至 1 年	0.10%
	持有 1 年(含)至 2 年	0.05%
	持有 2 年(含)及以上	0.00%
国联安货币	全部	0.00%

注:其中 1 年按 365 天计算,2 年按 730 天计算。

上述赎回费率可能根据本公司公告而进行调整,届时以最新公布的费率为准。

(3) 转入基金与转出基金的申购补差费按转入基金与转出基金之间申购费率的差额计算收取,具体计算公式如下:

转入基金与转出基金的申购补差费率 = max [(转入基金的申购费率—转出基金的申购费率),0],即转入基金申购费率减去转出基金申购费率,如为负数则取零。

目前,本公司旗下开通转换业务的基金申购费率如下:

基金名称	申购金额(含申购费)	费率
国联安稳健混合 国联安小盘精选混合 国联安中心成长混合	100万以下	1.50%
	100万(含)至 500 万	1.00%
	500万元(含)以上	每笔交易 1000 元
国联安精选股票(前端) 国联安优势股票(前端) 国联安红利股票(前端) 国联安主题驱动股票	50万以下	1.50%
	50万(含)至 150 万	1.00%
	150万(含)至 500 万	0.60%
	500万(含)及以上	每笔交易 1000 元
国联安精选股票(后端) 国联安优势股票(后端) 国联安红利股票(后端)	持有 1 年以下	1.60%
	持有 1 年(含)至 3 年	1.30%
	持有 3 年(含)至 5 年	0.60%
	持有 5 年(含)及以上	0.00%
国联安上证商品 ETF 联接	100万以下	1.50%
	100万(含)至 500 万	0.70%
	500万元(含)以上	每笔交易 1000 元
国联安优选行业股票	50万元以下?	1.50%
	50万元(含)至 100 万元	1.20%
	100万元(含)至 500 万元	0.80%
	500万元(含)至 1000 万元	0.30%
国联安增利债券 A 国联安信心增益债券	100万以下	0.80%
	100万(含)至 300 万	0.50%
	300万(含)至 500 万	0.30%
	500万(含)及以上	每笔交易 1000 元
国联安增利债券 B	全部	0.00%
国联安货币	全部	0.00%

上述申购费率可能根据本公司公告而进行调整,届时以最新公布的费率为准。

前端分额之间转换的申购补差费率按转出金额对应转入基金的申购费率和转出基金的申购费率作为依据来计算。后端分额之间转换的申购补差费率为零,因此申购补差费为零。

投资者通过网上直销平台办理前端收费模式下本基金与本公司旗下其他开通基金转换业务的开放式基金间的基金转换业务,享受转换费率相应前端申购补差费率的优惠,其他费率标准不变。在确定基金转换补差费率时,对于转出基金、转入基金的标准申购费率高于 0.6%的,申购费率按各基金对应的 4 折优惠申购费率执行,但优惠申购费率不得低于 0.6%;转出基金、转入基金的标准申购费率等于或低于 0.6%的,则依据标准申购费率计算。

基金管理人有权根据业务情况调整上述交易费用,并依据相关法规要求进行公告。

(4)其他销售机构办理基金转换业务适用的转换费率将在开通时另行公告。

2、转换份额的计算公式:

转出金额=转出基金份额×转出基金当日基金份额净值

转换费用=转换手续费+转出基金的赎回费+申购补差费

其中:

转换手续费=0

赎回费=转出金额×转出基金赎回费率

申购补差费=(转出金额-赎回费)×申购补差费率/(1+申购补差费率)

(1)如果转入基金的申购费率 > 转出基金的申购费率

转换费用=转出基金的赎回费+申购补差费

(2)如果转出基金的申购费率 ≥ 转入基金的申购费率

转换费用=转出基金的赎回费

(3)转入金额 = 转出金额 - 转换费用

(4)转入份额 = 转入金额 / 转入基金当日基金份额净值

其中,转入基金的申购费率和转出基金的申购费率均以转出金额作为确定依据。

注:转入份额的计算结果四舍五入保留到小数点后两位。

3、基金转换业务举例:

例:某投资者投资 101,500 元申购国联安优选行业股票基金,申购费率为 1.5%,申购申请当日国联安优选行业股票基金的基金份额净值是 1.0000 元, 则可申购国联安优选行业股票基金 100,000 份。持有一年半后, 该投资者将这 100,000 份国联安优选行业股票基金基金份额转换为国联安货币市场基金,转换申请当日国联安货币市场的基金份额净值为 1.0000 元,国联安优选行业股票基金基金份额净值为 1.0500 元。则:

转出金额 = 转出基金份额×转出基金当日基金份额净值 = 100,000×1.0500= 105,000 元;

赎回费 = 转出金额×转出基金赎回费率 = 105,000×0.2% = 210 元;

申购补差费率 = max [(转入基金申购费 - 转出基金申购费),0](即转入基金申购费减去转出基金申购费,如为负数则取零),即申购补差费率 = max[(0-1.5%),0] = 0;

申购补差费 =(转出金额-赎回费)×申购补差费率/(1+申购补差费率)=(105,000-210)× 0/(1+0)= 0 元;

转入金额 = 转出金额-赎回费-申购补差费=105,000-210-0=104,790 元;

转入份额 = 转入金额/转入基金当日基金份额净值=104,790/1.0000=104,790 份。

九、基金的投资目标

把握中国经济结构转型带来的投资机会,谋求基金资产长期稳定增值。

十、基金的投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或中国证监会允许基金投资其他品种的,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入本基金的投资范围。在有关金融衍生产品推出后,本基金还可依据法律法规的规定履行适当程序后,运用金融衍生产品进行投资风险管理。

本基金股票投资占基金资产的比例范围为 60%-95%,债券、现金、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%-40%,其中权证投资占基金资产净值的比例范围为 0-3%, 现金或者到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。当法律法规的相关规定变更时,基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。

十一、基金的投资策略及投资程序

一、投资策略

(一) 资产配置策略

根据宏观经济发展趋势、金融市场的利率变动和市场情绪,综合运用定性和定量的方法,对股票、债券和现金类资产的预期收益风险及相对投资价值进行评估,确定基金资产在股票、债券及现金类资产等资产类别的分配比例。在有效控制投资风险的前提下,形成大类资产的配置方案。

若出现重大突发事件、投资者情绪急剧变化、海外市场异常变动等因素导致投资决议形成的市场环境发生改变,基金经理可以提出大类资产配置的调整建议,投资决策委员会召开会议,讨论基金经理的建议并确定大类资产的调整比例,由基金经理执行。

(二) 股票投资策略

本基金股票投资运用主题驱动投资策略。通过"自上而下" 的分析方法,前瞻性地挖掘中国经济结构转型过程中涌现的投资主题,结合价值投资理念,精选投资主题下的个股,获取超额收益率。

投资主题是影响经济发展或企业盈利前景的趋势性因素。投资主题是动态的,一般分为四个阶段:主题雏形阶段、主题形成阶段、主题繁荣阶段、主题衰退阶段。

在主题的雏形阶段,对主题的关注度较低,市场反映往往不足;主题繁荣阶段,主题引起广泛关注,市场反映往往过度。这种反应不足和反应过度就带来股票定价的偏差,即主题雏形阶段,股票往往被低估,而到主题繁荣阶段,股票往往被高估。通过对主题进程的把握,利用这种定价偏差,精选主题下的相关个股,在主题雏形阶段买入,在主题繁荣阶段卖出,形成完整的主题驱动投资策略。

主题驱动策略的实施步骤如下:

1、主题挖掘

遵循自上而下的分析模式,从宏观经济、政策制度、技术进步和社会文化等多个角度,对影响经济发展或企业盈利的趋势性因素进行抽象,形成投资主题,寻求处在雏形阶段的投资主题。

改革开放以来,中国经济经历了 30 多年的高速发展,前期推动经济增长的因素在逐渐消退,中国经济结构面临深刻转型,而经济结构转型是一个多层次、长周期的过程,目前还处在这一过程的起步阶段。通过深入挖掘,经济结构转型过程中将会不断有投资主题涌现。

主题的挖掘一般经历信息搜集、信息的处理和主题的确定三个步骤。信息的搜集是主题挖掘的基础,分别从宏观经济、政策制度、技术进步以及社会文化等方面搜集基础数据信息,信息搜集的渠道是多维的,可以是公开信息、专业的数据库、研究员实地调研、问卷调查等;信息搜集后,对信息作相应处理加工,挖掘数据的规律性,重点发现趋势的拐点,数据的处理方法包括:趋势分析法、移动平均法和回归分析法等;从趋势出现拐点的因素中选择能够对经济发展和企业盈利有较大影响因素,确定为投资主题。

2、个股筛选

本基金运用合理价格成长策略(GARP,Growth at a Reasonable Price)对个股进行筛选,筛选个股通常经过三个步骤:备选库确定,指标打分,核心库确定。

(1)备选库确定

每个主题或细分子主题都有相对应的该主题的备选库。根据主题因素对企业的主营业务收入、主营业务利润等财务指标的影响程度,作为企业和投资主题的相关度标准。依据研究员的行业个股研究,选择与主题相关度高的企业作为主题备选库。

(2)指标打分

指标打分包括指标选择和打分方法。

GARP 策略运用两大类指标:成长类指标和价值类指标。本基金选择 3 个成长类细分指标和 3 个价值类细分指标,构成成长价值矩阵。其中,成长类细分指标包括动态 EPS 增长率, 静态 ROE,静态销售毛利率;价值类细分指标包括静态 PB,静态 PS 和静态 PE。

确定完细分指标后,对每个主题下的备选库股票按照细分指标分别排序,按秩打分,取细分指标得分的均值作为成长类和价值类指标综合得分,分别用于衡量该股票的成长特性和价值特性。

(3)核心库确定

为满足"成长性好,估值相对合理"的选股要求,本基金设定主题备选库中成长类指标综合得分超过 60%并且价值类指标综合得分超过 30%的个股作为主题核心库。对主题核心库进行汇总,得到基金核心库。

3、主题配置

综合考虑主题的发展阶段、主题催化剂、主题市场容量等因素,确定每个主题的配置权重范围。

4、组合构建

考察主题下股的重叠、研究员行业个股研究、个股 PEG 指标等因素,对主题核心库内个股进行评估,在满足主题配置权重范围的条件下,确定投资组合的个股和权重,初步完成投资组合的构建,由于主题具有跨行业的特征,为了避免投资组合在行业上的大幅偏离,参考基金业绩比较基准指数的行业权重和市场的板块轮动特征,对投资组合的个股和权重做进一步的优化。

(三)债券投资策略

在债券投资方面,本基金可投资于国债、央行票据、金融债、企业债和可转换债券等债券品种。本基金采用久期控制下的债券积极投资策略,满足基金流动性要求的前提下实现获得与风险相匹配的投资收益。主要的债券投资策略有:

1、久期控制策略

在对利率变化方向和趋势判断的基础上,确定恰当的久期目标,合理控制利率风险。根据对市场利率水平的预期,在预期利率下降时,增加组合久期,以较多地获得债券价格上升带来的收益;在预期利率上升时,减小组合久期,以规避债券价格下降的风险。

2、类属策略

通过研究宏观经济状况,货币市场及资本市场资金供求关系,以及市场投资热点,分析国债、金融债、企业债券等不同债券种类的利差水平,评定不同债券类属的相对投资价值,确定组合资产在不同债券类属之间配置比例。

3、收益率曲线配置策略

通过对央行货币政策、经济增长率、通货膨胀率和货币供应量等多种因素的分析来预测收益率曲线形状的可能变化,在久期确定的基础上,充分把握收益率曲线的非平行移动带来的机会,根据利率曲线移动情况,选择哑铃型组合、子弹型组合或阶梯型组合。

(四)权证投资策略

本基金将在严格控制风险的前提下,进行权证的投资。

1、综合分析权证的包括执行价格、标的股票波动率、剩余期限等因素在内的定价因素,根据 BS 模型和溢价率对权证的合理价值做出判断,对价值被低估的权证进行投资。

2、基于对权证标的股票未来走势的预期,充分利用权证的杠杆比率高的特点,对权证进行单边投资;

3、基于权证价值对标的价格、波动率的敏感性以及价格未来走势等因素的判断,将权证、标的股票等金融工具合理配置进行结构性组合投资,或利用权证进行风险对冲。

二、投资程序

1、由基金经理对宏观经济和市场状况进行考察,进行经济与政策研究;

2、数量策略部运用风险监测模型以及各种风险监控指标,对市场预期风险和投资组合风险进行风险测算,并提供分析报告;

3、投资决策委员会进行资产配置政策的制定。投资决策委员会定期召开会议,依据上述报告对资产配置提出指导性意见;如遇重大事项,投资决策委员会及时召开临时会议做出决策;

4、结合投资委员会和风险管理部的建议,基金经理根据市场状况进行投资组合方案设计;基金经理根据投资决策委员会的决议,参考上述报告,制定资产配置、类属配置和个债配置和调整计划,进行投资组合的构建和日常管理;

5、基金经理进行投资组合的敏感性分析;

6、对投资方案进行合规性检查,重点检查是否满足基金合同规定和各项法律法规的规定;

7、基金经理进行投资组合的实施,设定或者调整资产配置比例、单个券种投资比例,交易指令传达到交易部;交易部依据基金经理的指令,制定交易策略,通过交易系统执行投资组合的买卖。交易情况及时反馈到基金经理;

8、投资组合评价。风险管理部根据市场变化对投资组合的资产配置和调整提出风险防范建议;对投资组合进行评估,并对风险隐患提出预警;对投资组合的执行过程进行实时风险监控等。基金经理依据基金申购和赎回的情况控制投资组合的流动性风险。

十二、基金的业绩比较基准

本基金的整体业绩基准为:沪深 300 指数×80%+上证国债指数×20%。

我们选定沪深 300 指数作为本基金股票部分的业绩基准, 上证国债指数作为债券部分的业绩基准,按照预期的大类资产平均配置比例设置了业绩基准的权重。沪深 300 指数是由中证指数有限公司负责编制和维护的股票指数,该指数具有良好的市场代表性和权威性。上证国债指数是以上海证券交易所上市的所有固定利率国债为样本,按照国债发行量加权而成。上证国债指数能反映债券市场整体变动状况,是债券市场价格变动的"指示器"。

如果今后市场有其他更科学合理的业绩基准,本基金基金管理人须经基金托管人同意,并报中国证监会履行相应程序后方可变更业绩比较基准。

十三、基金的风险收益特征

本基金是股票型基金,在证券投资基金中属于较高风险品种,其预期收益水平和风险高于混合型基金和债券型基金。

十四、基金的投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证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——中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2012 年 7 月 13 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 2012 年 6 月 30 日,本报告财务资料未经审计师审计。

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	111,952,965.84	73.66
	其中:股票	111,952,965.84	73.66
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	18,800,000.00	12.37
	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	19,135,130.95	12.59
6	其他资产	2,094,989.23	1.38
7	合计	151,983,086.02	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	-	-
B	采掘业	2,557,327.52	1.69
C	制造业	70,737,814.38	46.87
C0	食品、饮料	20,083,560.12	13.31
C1	纺织、服装、皮毛	2,182,180.00	1.45
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	24,438,386.08	16.19
C6	金属、非金属	1,895,000.00	1.26
C7	机械、设备、仪表	8,616,080.98	5.71
C8	医药、生物制品	13,522,607.20	8.96
C99	其他制造业	-	-
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	10,662,090.62	7.07
H	批发和零售贸易	2,784,541.20	1.85
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	12,615,468.12	8.36
K	社会服务业	12,595,724.00	8.35
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	111,952,965.84	74.19

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	000002	万 科 A	919,972	8,196,950.52	5.43
2	002475	立讯精密	256,700	7,585,485.00	5.03
3	600519	贵州茅台	26,040	6,227,466.00	4.13
4	002304	洋河股份	46,000	6,189,300.00	4.10
5	002415	海康威视	200,000	5,440,000.00	3.60
6	600267	海正药业	304,640	5,325,107.20	3.53
7	601888	中国国旅	170,000	4,797,400.00	3.18
8	600587	新华医疗	184,701	4,613,830.98	3.06
9	000069	华侨城 A	719,800	4,592,324.00	3.04
10	600048	保利地产	389,640	4,418,517.60	2.93

4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

6 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7 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

本基金本报告期末未持有权证。

8 投资组合报告附注

8.1 本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查,或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.2 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。

8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	500,000.00
2	应收证券清算款	1,549,829.04
3	应收股利	16,623.09
4	应收利息	19,839.38
5	应收申购款	8,697.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,094,989.23

8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

十五、基金的业绩

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。基金的过往业绩不代表未来表现。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。

阶段	基金份额净值增长率①	同期业绩比较基准收益率③	①-③	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率标准差④	②-④
2009-8-26 至 2009-12-31	4.60%	12.34%	-7.74%	1.23%	1.60%	-0.37%
2010-1-1 至 2010-12-31	-5.64%	-9.12%	3.48%	1.44%	1.26%	0.18%
2011-1-1 至 2011-12-31	-15.50%	-19.67%	4.17%	1.18%	1.04%	0.14%
2012-1-1 至 2012-6-30	6.24%	4.47%	1.77%	1.06%	1.06%	0.00%
2009-8-26 至 2012-6-30	-11.40%	-14.32%	2.92%	1.26%	1.21%	0.05%

十六、费用概览

(一)基金的费用的种类

1.基金管理人的管理费;

2.基金托管人的托管费;

3.基金财产拨划支付的银行费用;

4.基金合同生效后的信息披露费用;

5.基金份额持有人大会费用;

6.基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费;

7.基金的证券交易费用;

8.依法可以在基金财产中列支的其他费用。

上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、与基金运作有关的费用

(1)基金管理人的管理费

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。计算方法如下:

H=E×年管理费率÷当年天数,

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起 3 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、休息日,支付日期顺延。

(2)基金托管人的托管费

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%年费率计提。计算方法如下:

H=E×年托管费率÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人, 若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

(3)除管理费和托管费之外的基金费用,由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定,按费用支出金额支付,列入或摊入当期基金费用。

2、与基金销售有关的费用

与基金销售有关的费用,即销售服务费是指基金管理人根据基金合同的约定及届时有效的相关法律法规的规定,从基金财产中计提的一定比例的费用,用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等。

(1) 申购费

本基金申购费的费率水平、计算公式和收取方式等内容详见"七、基金份额的申购与赎回"的内容。

(2) 赎回费

本基金赎回费的费率水平、计算公式和收取方式等内容详见"七、基金份额的申购与赎回"的内容。

(3) 转换费

本基金转换费的费率水平、计算公式和收取方式等内容详见"八、基金份额的申购与赎回"的内容。

(三)不列入基金费用的项目

基金管理人和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,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

(四)费用调整

在履行相关手续后,基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒体上刊登公告。

(五)基金税收

根据财政部财税[2004]78 号《国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》的要求,自 2004 年 1 月 1 日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征营业税和企业所得税。

根据财税字[2005]11 号文《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》,自 2005 年 1 月 24 日起,基金买卖股票按照 0.1%的税率缴纳印花税。

根据财税字[2005]102 号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》,自 2005 年 6 月 13 日起,基金取得的股票的股息、红利收入暂减按 50%计入个人应纳税所得额。

根据财税[2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》,(一)证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。(二)对投资者从证券投资基金分配中取得的收入,暂不征收企业所得税。(三)对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,暂不征收企业所得税。

本基金运作过程中的各类纳税主体,依照国家法律、法规的规定,履行纳税义务。

十七、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《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》及其他有关法律法规的要求,对本基金管理人于 2012 年 4 月 10 日刊登的本基金原招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

1、更新了"第三部分 基金管理人"的内容。

2、更新了"第四部分 基金托管人"的内容。

3、更新了"第五部分 相关服务机构"的内容。

4、更新了"第八部分 基金份额的申购和赎回"的内容。

5、更新了"第十部分 基金的投资"的内容。

6、更新了"第十一部分 基金的业绩"的内容。

7、更新了"第二十二部分 对基金份额持有人的服务"的内容。

8、更新了"第二十三部分 其他应披露事项"的内容。

国联安基金管理有限公司
二○一二年十月九日

证券代码:000776 证券简称:广发证券 公告编号:2012-071

广发证券股份有限公司关于获批开展约定购回式证券交易业务的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

近日,公司收到上海证券交易所《关于确认广发证券股份有限公司约定购回式证券交易权限的通知》(上证会字[2012]196号)。根据该通知,上海证券交易所确认本公司的约定购回式证券交易权限,试点期间业务规模为10亿元。

公司将严格按照上海证券交易所等相关部门的规定,合规、有序地开展约定购回式证券交易业务。

特此公告。

广发证券股份有限公司董事会
二○一二年十月九日

证券代码:002292 证券简称:奥飞动漫 公告编号: 2012-037

广东奥飞动漫文化股份有限公司停牌公告

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

广东奥飞动漫文化股份有限公司(以下简称"公司")拟于近日进行对外投资事项。根据《深圳证券交易所股票上市规则》的有关规定,为维护广大投资者的利益,避免引起股票价格异常波动,经公司申请,公司股票(股票简称:奥飞动漫,股票代码:002292)于2012年10月09日开市起停牌,待公司披露相关事项后复牌。预计公司股票不迟于2012年10月12日开市起复牌。

敬请广大投资者注意投资风险。

特此公告!

广东奥飞动漫文化股份有限公司董事会
2012年10月8日

证券简称:燕京啤酒 证券代码:000729 公告编号:2012-056
证券简称:燕京转债 证券代码:126729

北京燕京啤酒股份有限公司股本结构变动公告

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

重要提示:

1、"燕京啤酒"(代码:000729)2012年7月1日至2012年9月30日期间因 "燕京转债"(代码:126729)转股累计增加股数为1,319股。

2、2012年9月30日的"燕京啤酒"总股本为2,522,587,229股。

一、股份变动的原因

公司发行的可转换公司债券"燕京转债"转股所致

截至2012年9月30日,本公司发行的可转换公司债券"燕京转债"尚有83,389,400元在市场流通。"燕京转债"发行总额为1,130,000,000元,因回售减少262,268,100元,因转股减少784,342,500元。"燕京啤酒"因转股累计增加数量为51,027,324股,其中2012年7月1日至2012年9月30日期间因转股累计增加数量为1,319股。

二、股份总额、股份结构变动情况

	2012年6月30日		本次变动增减(+、-)			2012年9月30日	
	股份数量(股)	占比(%)	转债转股(股)	高管锁定股份变动(股)	合计	股份数量(股)	占比(%)
一、限售流通股(或非流通股)	309,222,806	12.26	0	20,949	20,949	309,243,755	12.26
高管锁定股	308,132	0.01	0	20,949	20,949	329,081	0.01
首发前机构类限售股	308,914,674	12.25	0	0	0	308,914,674	12.25
二、无限售流通股	2,213,363,104	87.74	1,319	-20,949	-19,630	2,213,343,474	87.74
其中未托管股数	0	0.00	0	0		0	0.00
三、总股本	2,522,585,910	100.00	1,319	0	1,319	2,522,587,229	100.00

股本结构变动情况说明:

1、因公司监事会换届新增高管锁定股份数量为20,949股。

2、因燕京转债转股增加无限售股份数量为1,319股。

三、前十名股东持股情况(截至2012年9月30日)

1、燕京啤酒前十名股东持股情况

总股数(股)		2,522,587,229
总户数		77,113
股东名称(全称)	持股比例(%)	持股总数(股)
北京燕京啤酒投资有限公司	57.48	1,450,067,390
中国太平洋人寿保险股份有限公司-分红-个人分红	4.13	104,165,423
中国人寿保险股份有限公司-分红-个人分红-005L-FH002深	2.18	54,912,350
北京燕京啤酒集团公司	1.88	47,380,124
泰康人寿保险股份有限公司-分红-个人分红-019L-FH002深	1.81	45,739,442
泰康人寿保险股份有限公司-万能-个险万能	0.80	20,107,967
泰康资产管理有限责任公司-开泰-稳健增值投资产品	0.79	20,000,000
中国银行-易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金	0.72	18,078,956
泰康人寿保险股份有限公司-投连-个险投连	0.57	14,447,404
中国工商银行-融通深证100指数证券投资基金	0.51	12,978,054

2、燕京转债持有人情况

转债数量(张)		833,894
持有人数		1,929
前十名转债持有人情况如下:		
可转换公司债券持有人名称	期末持债数量(张)	持有比例(%)
中信信托有限责任公司-双盈10号	238,382	28.59
中国银行-易方达平稳增长证券投资基金	80,000	9.59
海通-中行-富通银行	63,413	7.60
交通银行-华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)	55,133	6.61
泰康人寿保险股份有限公司-传统-普通保险产品-019L-CT001深	31,228	3.74
包头市虹烨投资顾问有限公司	28,692	3.44
中国农业银行-东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金	25,564	3.07
中国农业银行-富国可转换债券证券投资基金	25,116	3.01
中国农业银行-华夏复兴股票型证券投资基金	16,456	1.97
交通银行-汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金	16,370	1.96

四、备查文件

1、截至2012年9月30日"燕京啤酒"股本结构表。

2、截至2012年9月30日"燕京转债"股本结构表。

北京燕京啤酒股份有限公司董事会
二○一二年十月八日

证券简称:燕京啤酒 证券代码:000729 公告编号:2012-057
证券简称:燕京转债 证券代码:126729

北京燕京啤酒股份有限公司关于 燕京转债"2012年付息事宜的公告

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

重要内容提示

1、"燕京转债"第二年度债券年利率为0.7%;

2、付息债权登记日:2012年10月12日;

3、付息日:2012年10月15日。

北京燕京啤酒股份有限公司于2010年10月15日发行了可转换公司债券(以下简称"燕京转债"),截至2012年10月15日将满两年。 根据《北京燕京啤酒股份有限公司可转换公司债券募集说明书》(以下简称"《募集说明书》")有关条款规定,"燕京转债"每年付息一次,现将本期付息事项公告如下:

一、付息方案

根据《募集说明书》有关条款规定,"燕京转债"采用每年付息一次的付息方式,计息起始日为可转债发行首日,即2010年10月15日。在可转债存续期间,第一次付息日为发行首日(2010年10月15日)的次年当日(即2011年10月15日),以后每年的该日(10 月15 日)为当年的付息日。第一年到第五年的利率分别为:第一年0.5%、第二年0.7%、第三年0.9%、第四年1.1%、第五年1.4%。

本期"燕京转债"付息方案:每10张"燕京转债"(面值1,000元)税前利息为7.00元。 对于持有"燕京转债"的个人投资者和证券投资基金,公司按20%的税率代扣代缴个人所得税后,实际每10张派发利息5.6元;对于持有"燕京转债"的QFII 、RQFII,公司按10%的税率代扣代缴所得税后,实际每10张派发利息6.3元;对于持有"燕京转债"的其他机构投资者,公司不代扣代缴所得税,实际每10张派发利息7.00元。

二、付息债权登记日与付息日

根据《募集说明书》和《公司可转换公司债券上市公告书》有关条款规定,本次付息债权登记日为2012年10月12日(星期五),付息日为2012年10月15日(星期一)。

三、付息对象

本次付息对象:截至2012年10月12日(星期五)下午深圳证券交易所收市后,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全体"燕京转债"持有人。

四、付息方法

本次"燕京转债"所派利息于2012年10月15日(星期一)通过持债人托管券商直接划入其资金账户。

本公司将委托中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司代理支付燕京转债的利息。

五、所得税缴纳

根据《中华人民共和国企业所得税法》第二十七条第五款、第三条第三款和《中华人民共和国企业所得税法实施条例》第九十一条的规定,对于QFII、RQFII所得转债利息按10%的税率征收预提所得税,并由公司作为代扣代缴义务人进行代扣代缴。 如该类投资者在本