民生加银中证内地资源主题指数型证券投资基金更新招募说明书摘要

2012年第1号

基金管理人:民生加银基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司

二零一二年十月

重要提示

民生加银中证内地资源主题指数型证券投资基金经2011年9月22日中国证监会证监许可【2011】1540号文核准募集。

投资有风险,投资人申购基金时应认真阅读招募说明书;基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

本基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会审核同意,但中国证监会对本基金做出的任何决定,均不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

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。除非另有说明,本招募说明书所载内容截止日为2012年9月8日,有关财务数据和净值表现截止日为2012年6月30日。(财务数据未经审计)

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:民生加银基金管理有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路新世界商务中心42楼
办公地址:深圳市福田区益田路新世界商务中心42楼
法定代表人:万青元
成立时间:2008年11月3日
批准设立机关及批准设立文号:中国证券监督管理委员会证监许可[2008]1187号
组织形式:有限责任公司(中外合资)
注册资本:人民币贰亿元
存续期间:永续经营
经营范围:基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。
股权结构:公司股东为中国民生银行股份有限公司(特股60%)、加拿大皇家银行(特股30%)、三峡财务有限责任公司(特股10%)。
电话:010-88566528
传真:010-88566528
联系人:胡继聪

民生加银基金管理有限公司设有股东会、董事会、监事会;董事会下设专门委员会:审计委员会、合规与风险管理委员会、薪酬与提名委员会;经营管理层下设专门委员会:投资决策委员会、风险控制委员会,以及设立常设部门:深圳管理总部、工会办公室、监察稽核部、投资部、研究部、专户理财部、金融工程与产品部、渠道管理部、市场策划中心、机构一部、机构二部、客服与电子商务中心、运营管理部、交易部、信息技术部、综合管理部、财务部。

截至2012年9月8日,民生加银基金管理有限公司管理9只开放式基金:民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、民生加银增强收益债券型证券投资基金、民生加银精选股票型证券投资基金、民生加银稳健成长股票型证券投资基金、民生加银内需增长股票型证券投资基金、民生加银景气行业股票型证券投资基金、民生加银中证内地资源主题指数投资基金、民生加银信用双利债券型证券投资基金、民生加银红利回报灵活配置混合型证券投资基金。

(二)主要人员情况

万青元先生:董事长,硕士,高级编辑。历任中国人民银行金融时报社记者部副主任,中国民生银行总行办公室公关策划处处长,主任助理、副主任,企业文化部副总经理(主持工作)。现任中国民生银行董事会秘书、董事会办公室主任,民生加银基金管理有限公司党委书记、董事长。

沈建军先生:董事,硕士,高级经济师。历任国家物资部办公厅、国家内贸部办公厅处长、全国工商联办公厅处长、中国民生银行国际业务部、中国民生银行资产管理部副总经理、中国民生银行投资银行部总裁。现任中国民生银行董事会战略发展与投资管理委员会投资管理办公室主任。

Frank Lippa先生:董事,学士。曾在普华永道会计事务所从事审计、税务监督方面的工作,历任加拿大皇家银行高级顾问,加拿大皇家银行投资管理公司副总裁、首席会计师和首席财务官。现任加拿大皇家银行资产管理公司首席运营官和首席财务官。

王维烽先生:董事,学士。历任外汇管理局储备管理司副司长及首席投资官、汇丰集团伦敦总部及香港分行全球市场部董事总经理、加拿大皇家银行香港分行资本市场部董事总经理。现任加拿大皇家银行中国区董事总经理、北京分行行长。

李镇光先生:董事,博士,高级经济师。历任海口丰信公司总经理、香港景邦经济咨询公司总经理、三峡财务有限责任公司综合管理部副经理、投资银行部副经理、经理。现任三峡财务有限责任公司党委书记、副总经理。

朱晓光先生:董事,硕士,高级经济师。历任中国银行北京分行财会部副科长,中国民生银行总行财会部会计处处长,中国民生银行福州分行副行长,中国民生银行中小企业金融部财务总监,民生加银基金管理有限公司督察长。现任民生加银基金管理有限公司纪委书记、副总经理。

张亦春先生:独立董事,厦门大学教授、博士生导师。历任厦门大学经济系讲师、经济学院财金系副教授、教授、系副主任、系主任、厦门大学经济学院院长。现任厦门大学金融研究所所长。

王波明先生:独立董事,硕士。历任美国BK国际商务公司副总裁,美国纽约股票交易所经济师,北京证券交易所研究设计联合办公室副总干事。现任中国证券市场研究设计中心总干事、财讯传媒集团董事局主席。

于学会先生:独立董事,学士。从事过10年企业经营管理工作。历任北京市汉华律师事务所律师、北京市必浩得律师事务所合伙人、律师。现任北京市众天律师事务所合伙人、律师。

2.基金管理人监事会成员

袁美珍女士:监事会主席,学士。历任湖北大冶市劳动人事局副股长、中央组织部老干部局副主任、中国民生银行北京管理部党委委员、纪委书记;中国民生银行纪检监察室主任、纪委副书记。现任民生加银基金管理有限公司党委副书记、监事会主席。

徐敏文先生:监事,硕士,美国伊利诺州注册会计师,美国注册管理会计师,特许金融分析师。曾在加拿大皇家银行从事战略发展与财务分析工作,其中包括加拿大皇家银行资产管理公司的业务发展。现任加皇投资管理(亚洲)有限公司亚洲股票市场研究分析员。

李君波先生:监事,硕士。历任三峡财务有限责任公司投资银行部研究员、三峡财务有限责任公司研究发展部研究员、副经理,国务院国有资产监督管理委员会企业分配局改制分流处副处长(挂职)。现任三峡财务有限责任公司股权投资管理部副经理。

于善辉先生:监事,硕士。曾任职于天相投资顾问有限公司,任分析师、金融创新部经理、总裁助理、副总经理等职。现任民生加银基金管理有限公司总经理助理兼金融工程与产品部总监、研究部负责人。

董文艳女士:监事,学士。曾就职于中国人民银行郑州市中心支行稽核处,中国人民银行深圳市中心支行外汇检查处等。现任民生加银基金管理有限公司深圳管理总部负责人兼工会办公室主任。

3.基金管理人高级管理人员

万青元先生:董事长,简历见上。

俞岱曦先生:总经理,硕士。历任鹏华基金管理有限公司行业分析师,嘉实基金管理有限公司基金经理,中银基金管理有限公司副总经理,2011年9月加入民生加银基金管理有限公司,现任民生加银基金管理有限公司党委副书记、总经理。

张力女士:督察长,硕士。历任招商银行北京分行支行行长助理;中国民生银行北京管理部紫竹支行副行长、北京管理部投资银行处处长、北京管理部公司部总经理;2008年10月加入民生加银基金管理有限公司,曾任民生加银基金管理公司总经理助理兼渠道一部总监,2012年1月起任民生加银基金管理有限公司督察长。

朱晓光先生:副总经理,简历见上。

吴剑飞先生:副总经理,硕士,12年证券从业经历。历任长盛基金管理公司研究员;泰达宏利基金管理有限公司基金经理助理和基金经理;建信基金管理有限公司基金经理、投资决策委员会委员及投资部副总监;2009年至2011年,任职于平安资产管理公司,担任股票投资部总经理;2011年9月至今任职于民生加银基金管理有限公司任副总经理、投资决策委员会主席。

4.本基金基金经理

江国华先生:南开大学金融学硕士,6年证券从业经历。曾在招商基金从事投资风险管理和量化投资策略研究,2008年7月加入民生加银基金管理有限公司,担任金融工程研究员,兼任煤炭、电力、汽车、电力设备行业研究员;自2011年12月起至今担任民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金经理;自2011年12月20日至今担任民生加银精选股票型证券投资基金基金经理;自2012年3月起担任本基金基金经理。

5.投资决策委员会

投资决策委员会由5名成员组成,设主席1名,其他委员4名。名单如下:

吴剑飞先生,投资决策委员会主席,现任公司副总经理;于善辉先生,投资决策委员会委员,现任总经理助理兼金融工程与产品部总监及研究部负责人;乐瑞祺先生,投资决策委员会委员,现任公司投资部副总监;陈廷国先生,投资决策委员会委员,现任公司专户理财部首席理财师;牛洪振先生,投资决策委员会委员,现任公司交易部总监。

6.上述人员之间不存在亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人情况

1.基本情况

名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)
住所:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:王洪章
成立时间:2004年9月17日
组织形式:股份有限公司
注册资本:贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12号
联系人:尹东
联系电话:010-67595003

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的经营历史,其前身"中国人民建设银行"于1954年成立,1996年易名为"中国建设银行"。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立,承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码:939)于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市,是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日,中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为:250,010,977,486股(包括240,417,319,880股H股及9,593,657,606股A股)。

截至2011年9月30日,中国建设银行资产总额117,723.30亿元,较上年末增长8.90%。截至2011年9月30日止九个月,中国建设银行实现净利润1,392.07亿元,较上年同期增长25.82%。年化平均资产回报率为1.64%,年化加权平均净资产收益率为24.82%。利息净收入2,230.10亿元,较上年同期增长22.41%。净利差为2.56%,净利息收益率为2.68%,分别较上年同期提高0.21和0.23个百分点。手续费及佣金净收入687.92亿元,较上年同期增长41.31%。

中国建设银行在中国内地设有1.3万余个分支机构,并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约、胡志明市及悉尼设有分行,在莫斯科、台北设有代表处,海外机构已覆盖到全球13个国家和地区,基本完成在全球主要金融中心的网络布局,24小时不间断服务能力和基本服务架构已初步形成。中国建设银行筹建、设立村镇银行33家,拥有建行亚洲、建银国际,建行伦敦、建信基金、建信金融租赁、建信信托、建信人寿、中德住房储蓄银行等多家子公司,为客户提供一体化全面金融服务能力进一步增强。

中国建设银行得到市场和业界的支持和广泛认可。2011年上半年,中国建设银行主要国际排名位次持续上升,先后荣获国内外知名机构授予的50多个重要奖项。中国建设银行在英国《银行家》2011年"世界银行品牌500强"中位列第10,较去年上升3位;在美国《财富》世界500强中排名第108位,较去年上升8位。中国建设银行连续第三年获得香港《亚洲公司治理》杂志颁发的"亚洲企业管治年度大奖",先后摘得《亚洲金融》、《财资》、《欧洲货币》等颁发的"中国最佳银行"、"中国国内最佳银行"与"中国最佳私人银行"等奖项。

中国建设银行总行设投资托管服务部、下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队、涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海备份中心等12个职能处室、团队,现有员工130余人。自2008年以来中国建设银行托管业务持续通过SAS70审计,并已经成为常规化的内控工作手段。

2.主要人员情况

杨新丰,投资托管服务部副总经理(主持工作),曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部,长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟,投资托管服务部副总经理,曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部,长期从事大客户的客户管理及服务工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红,投资托管服务部副总经理,曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室,长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

3.基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国建设银行一直秉持"以客户为中心"的经营理念,不断加强风险管理和内部控制,严格履行托管人的各项职责,切实维护资产持有人的合法权益,为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展,中国建设银行托管资产规模不断扩大,托管业务品种不断增加,已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系,是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2011年12月31日,中国建设银行已托管224只证券投资基金。建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平,赢得了业内的高度认同。2011年,中国建设银行以总分第一的成绩被国际权威杂志《全球托管人》评为2011年度"中国最佳托管银行";并获和讯网2011年中国"最佳资产托管银行"奖。

(二)基金托管人的内部控制制度

1.内部控制目标

作为基金托管人,中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

2.内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会,负责全行风险管理与内部控制工作,对托管业务风险控制工作进行检查指导。投资托管服务部专门设置了监督稽核处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

3.内部控制制度及措施

投资托管服务部具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理严格实行复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

(三)基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

1.监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定,监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的"托管业务综合系统——基金监督子系统",严格按照现行法律法规以及基金合同规定,对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督,并定期编写基金投资运作监督报告,报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中,对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

2.监督流程

①每工作日按时通过基金监督子系统,对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控,发现投资比例超标等异常情况,向基金管理人发出书面通知,与基金管理人进行情况核实,督促其纠正,并及时报告中国证监会。

②收到基金管理人的划款指令后,对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

③根据基金投资运作监督情况,定期编写基金投资运作监督报告,对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价,报送中国证监会。

④通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易,电话或书面要求基金管理人进行解释或举证,并及时报告中国证监会。

三、相关服务机构

(一)销售机构及联系人

1.直销机构

民生加银基金管理有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路新世界商务中心42楼
办公地址:深圳市福田区益田路新世界商务中心42楼
法定代表人:万青元
客服电话:400-8888-388
联系人:汤敏
电话:0755-23999809
传真:0755-23999810
网址:www.msjyfund.com.cn

2.代销机构

①中国建设银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:王洪章
电话:010-66275654
传真:010-66275654
联系人:张静
客服电话:95533
网址:www.ccb.com

②中国民生银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人:董文标
客服电话:95568
联系人:董云巍
电话:010-57092615
传真:010-57092611
网址:www.cmbc.com.cn

③中国银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人:肖钢
客户服务电话:95566
联系人:侯燕鹏
电话:010-66594838
传真:010-66594431
网址:www.boc.cn

④招商银行股份有限公司
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人:傅育宁
客户电话:95555
联系人:邓炯鹏
电话:0755-83198888
传真:0755-83195050
网址:www.cmbchina.com

⑤北京银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街甲17号首层
办公地址:北京市西城区金融大街丙17号
法定代表人:闫冰竹
客户服务电话:95526
联系人:谢小华
电话:010-66223587
传真:010-66226045
网址:www.bankofbeijing.com.cn

⑥渤海银行股份有限公司
注册地址:天津市河西区马场道201-205号
办公地址:天津市河西区马场道201-205号
法定代表人:刘宝凤
客服电话:400-888-8811
联系人:王宏
网址:www.cbhb.com.cn

⑦中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人:陈有安
客服电话:400-888-8888
联系人:田薇
电话:010-66568430
传真:010-665688990
网址:www.chinastock.com.cn

⑧中信建投证券有限责任公司
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址:北京市东城区朝阳门内大街188号
法定代表人:张佑君
开放式基金咨询电话:400-8888-108
联系人:魏明
电话:010-85130579
传真:010-65182261
网址:www.csc108.com

⑨国泰君安证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区商城路618号
办公地址:上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29层
法定代表人:万建华
客户服务热线:400-8888-666
联系人:芮敏祺
电话:021-38676666
传真:021-38670666
网址:www.gtja.com

⑩平安证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
办公地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
法定代表人:杨宇翔
联系人:郑舒丽
业务咨询电话:95511转8
开放式基金业务传真:0755-82400862
网站:http://www.pingan.com

⑪申银万国证券股份有限公司
注册地址:上海市常熟路171号
办公地址:上海市常熟路171号
法定代表人:丁国荣
客服电话:021-962505
联系人:曹晔
电话:021-54033888-2653
传真:021-54038844
网址:www.sywg.com

⑫招商证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45楼
办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45楼
法定代表人:宫少林
客户服务热线:95565,400-8888-111
联系人:林生迎
电话:0755-82943666
传真:0755-82943636
网址:www.newone.com.cn

⑬兴业证券股份有限公司
注册地址:福州市湖东路268号
办公地址:上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼21层
法定代表人:兰荣
客服热线:95562
联系人:谢高得
电话:021-38565785
传真:021-38565955
网址:www.xyzq.com.cn

⑭海通证券股份有限公司
注册地址:上海市淮海中路98号
办公地址:上海市广东路689号
法定代表人:王开国
电话:021-23219000
传真:021-23219100
联系人:李笑鸣
客服电话:95553或按打各城市营业网点咨询电话
公司网址:www.htsec.com

⑮华福证券有限责任公司
注册地址:福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址:福州市五四路157号新天地大厦7至10层
法定代表人:黄金琳
客服电话:0591-96326
联系人:张腾
电话:0591-87383623
传真:0591-87383610
网址:www.hfzq.com.cn

⑯国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人:何如
客服电话:95536
联系人:齐晓燕
电话:0755-82130833
传真:0755-82133952
网址:www.guosen.com.cn

⑰宏信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
办公地址:深圳市福田区深南大道凤凰大厦1栋9层
法定代表人:牛冠兵
开放式基金咨询电话:4008-001-001
联系人:陈剑虹
联系电话:0755-82558305
开放式基金业务传真:0755-82558355
网址:www.wind.com.cn

⑱中国中投证券有限责任公司
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—21层及第04层01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23单元
办公地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层
法定代表人:龙增来
客服电话:400-600-8008
联系人:刘毅
电话:0755-82023442
传真:0755-82026539
网址:www.china-invs.cn

⑲广发证券股份有限公司
注册地址:广州市天河北路183号大都会广场43楼
办公地址:广州市天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼
法定代表人:孙树明
客服电话:95575或致电各地营业网点
联系人:黄岚
开放式基金咨询电话:020-87555888
开放式基金业务传真:020-87555303
网址:http://www.gf.com.cn

⑳国联证券股份有限公司
注册地址:江苏省无锡市县前东街168号
办公地址:无锡市县前东街168号国联大厦6楼-8楼
法定代表人:雷建辉
客服电话:400-888-5288
联系人:沈刚
电话:0510-82831662
传真:0510-82830162
网址:www.glsc.com.cn

㉑民生证券有限责任公司
注册地址:北京东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-18层
办公地址:北京东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-18层
法定代表人:余政
客服电话:400-619-8888
联系人:赵明
开放式基金业务传真:010-85127917
公司网站:www.mszq.com

㉒中原证券股份有限公司
注册地址:河南省郑州市郑东新区商务外环路10号
办公地址:河南省郑州市郑东新区商务外环路10号
法定代表人:菅明军
客服电话:0371-967218或400-813-9666
联系人:程月艳
电话:0371-65585670
传真:0371-65585665
网址:www.ccnew.com

㉓东海证券有限责任公司
注册地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼
办公地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼
法定代表人:朱科敏
客服电话:400-888-8588
联系人:梁旭
电话:0519-88157761
传真:0519-88157761
网址:http://www.longone.com.cn

㉔光大证券股份有限公司
注册地址:上海市静安区新闸路1508号
办公地址:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:徐浩明
客服电话:4008888888,10108998
联系人:刘晨、李芳芳
电话:021-22169999
传真:021-22169134
网址:www.ebscn.com

㉕长江证券股份有限公司
注册地址:湖北省武汉市新华路特8号长江证券大厦
办公地址:湖北省武汉市新华路特8号长江证券大厦
法人代表人:胡运钊
客户服务电话:95579或4008-888-999
联系人:李良
电话:027-65799999
传真:027-85481900
网址:www.95579.com

㉖中航证券有限公司
注册地址:南昌市抚河北路291号
办公地址:南昌市抚河北路291号
法人代表人:杜航
客户服务电话:400-8866-567
联系人:余雅娜
电话:0791-6768763
传真:0791-6789414
网址:www.avicsec.com

㉗中信证券股份有限公司
注册地址:广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层
办公地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人:王东明
客服电话:95558
联系人:陈忠
电话:010-60838888
传真:010-60833739
网址:www.citics.com

㉘中信万通证券有限责任公司
法定代表人:杨宝林
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1号楼第20层
注册时间:2004年4月29日
注册资本:8亿元人民币
营业期限:永久
基金业务联系人:吴忠超
电话:0532-85022326
传真:0532-85022605
客户服务电话:0532-96577
网址:www.zxwt.com.cn

㉙中信证券(浙江)有限责任公司
注册地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
法定代表人:沈强
客服电话:0571-96598
联系人:周妍
电话:0571-87112510
传真:0571-86065161
网址:www.bigsun.com.cn

㉚国信证券有限责任公司
注册地址:呼和浩特市新城区锡林南路18号
办公地址:北京西城区闹市口大街1号长安兴融中心西楼11层
法定代表人:孔伯杰
客服电话:400-660-9839
联系人:文思婷
电话:010-83991737?
传真:010-66412537
网址:www.rxzq.com.cn

(二)注册登记机构

名称:民生加银基金管理有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路新世界商务中心42楼
办公地址:深圳市福田区益田路新世界商务中心42楼
法定代表人:万青元
电话:0755-23999888
传真:0755-23999833
联系人:蔡海峰

(三)出具法律意见书的律师事务所和经办律师

名称:上海市通力律师事务所
注册地址:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:韩炯
经办律师:吕红、安冬
电话:021-31358666
传真:021-31358600
联系人:安冬

(四)审计基金财产的会计师事务所和经办注册会计师

名称:安永华明会计师事务所
注册地址:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层
办公地址:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层
法人代表:葛明
经办注册会计师:张小东、周刚
电话:010-58153000
传真:010-85188298
联系人:李妍明

四、基金的名称

民生加银中证内地资源主题指数型证券投资基金

五、基金的类型

指数型

六、基金的投资目标

本基金采取全样本复制法进行被动指数化投资,力求实现跟踪偏离度与跟踪误差的最小化,获得与标的指数收益相似回报。

七、基金的投资方向

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(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、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(且须符合中国证监会的相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:本基金投资于中证内地资源主题指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%;权证投资比例占基金资产净值的比例不高于3%;保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

八、投资决策依据

1、国家相关法律法规和基金合同的有关规定;
2、国内外宏观经济形势及其对中国证券市场的影响;
3、国家货币政策、产业政策以及证券市场政策;
4、行业发展现状及前景;
5、股票市值及流通性;
6、股票、债券等资产的预期收益率及风险水平。

九、基金的投资策略

1.股票投资策略

本基金采取全样本复制法进行被动指数化投资,即按照中证内地资源主题指数的成份股组成及权重构建股票投资组合。但是当以下情况发生时,基金管理人将对投资组合进行适当调整,以实现本基金对业绩比较基准的紧密跟踪:

①基金管理人预期指数成份股或权重发生变化;
②由于市场因素影响、法律法规限制等原因,本基金无法根据指数构建组合;
③基金发生申购赎回、成份股派发现金股息等可能影响跟踪效果的情形。

2.股票投资组合的动态调整

在基金运作过程中,当发生以下情况时,基金管理人将对投资组合进行调整,以降低跟踪误差,实现对业绩比较基准的紧密跟踪。

①指数编制方法发生变更。基金管理人将评估指数编制方法变更对指数成份股及权重的影响,适时调整投资组合。

②指数成份股定期或者临时调整。基金管理人将对标的指数成份股调整的可能情况做出预期和判断,在此基础上适时调整投资组合,从而减小跟踪误差。

③中证内地资源主题指数成份股出现股本变化、增发、配股、派发现金股息等情形。基金管理人将密切关注这些情形对基金投资组合的影响,并据此调整投资策略。

④基金发生申购赎回,参与新股申购等影响跟踪效果的情形。基金管理人将分析这些情形对跟踪效果的影响,据此对投资组合进行相应调整。

⑤法律法规限制、部分标的股票流动性不足、股票停牌等因素导致基金无法根据标的指数成分股构成建立组合。基金管理人将根据实际情况,以跟踪误差最小化为原则适时调整投资组合。

十、投资管理程序

本基金采用投资决策委员会领导下的基金经理负责制。本基金的投资管理程序如下:

1.研究员提供研究报告,以研究驱动投资

本基金严格实行研究支持投资决策机制,加强研究对投资决策的支持工作,防止投资决策的随意性。研究员在熟悉基金投资目标和投资策略的基础上,对指数编制方法、指数复制、风险管理、业绩归因进行量化研究,并向投资决策委员会和基金经理定期或不定期撰写提供宏观经济分析报告、证券市场行情报告、行业分析报告和上市公司及发债主体研究报告等。

2.投资决策委员会审议并决定基金投资重大事项

投资决策委员会将定期分析投资研究团队所提供的研究报告,在充分讨论宏观经济、股票和债券市场的基础上,根据基金合同规定的投资目标、投资范围和投资策略,依据基金管理人的投资管理制度,确定基金的总体投资计划。

3.基金经理构建具体的投资组合

基金经理根据投资决策委员会的资产投资比例等决议,参考研究团队的研究成果,根据基金合同,依据专业经验进行分析判断,在授权范围内构建具体的投资组合,进行组合的日常管理。

4.交易部独立执行投资交易指令

基金管理人设有独立的交易部,由基金经理根据投资方案的要求和授权、以及市场的运行特点,作出投资操作的相关决定,向交易部发出投资指令。交易部接到基金经理的投资指令后,根据有关规定对投资指令的合规性、合理性和有效性进行检查,确保投资指令在合法、合规的前提下得到高效的执行;并对交易情况及时反馈,对投资指令进行监督;如果市场和个股交易出现异常情况,及时提示基金经理。

5.基金绩效评估

基金经理对投资管理策略进行评估,出具自我评估报告。金融工程部门就投资管理进行持续评估,定期提出评估报告,如发现原有的投资分析和投资决策同市场情况有较大的偏离,立即向主管领导和投资决策委员会报告。投资决策委员会根据基金经理和金融工程部门的评估报告,对于基金业绩进行评估。基金经理根据投资决策委员会的意见对投资组合进行调整。

6.基金风险监控

监察稽核部对投资组合计划的执行过程进行日常监督和实时风险控制,包括投资集中度、投资组合比例、投资限制、投资权限等交易情况,风险控制委员会根据市场变化对基金投资组合进行风险评估,并提出风险防范措施。

7.投资管理程序的调整

基金管理人在保证基金份额持有人利益的前提下,有权根据投资需要和环境变化,对投资管理的职责分工和程序进行调整,并在招募说明书或其更新中予以公告。

十一、业绩比较基准

基金的业绩比较基准 = 中证内地资源主题指数×95%+活期存款利率(税后)×5%。

中证内地资源主题指数是中证指数有限公司在中证800指数的基础上,选择属于资源性行业中具有代表性的股票作为成分股编制而成,能够综合反映沪深证券市场中内地资源上市公司的整体表现。资源性行业包括综合性油气企业、油气的勘探与生产、煤炭与消费用燃料、铝、黄金、多种金属与采矿、贵重金属与矿石等行业;成分股是在资源性行业中选择市值规模排名居前、流动性较好、符合指数跟踪的一般要求的具有相当代表性的股票。

如果中证内地资源主题指数的编制单位变更或停止中证内地资源主题指数的编制及发布、或中证内地资源主题指数由其他指数替代、或中证内地资源主题指数编制方法发生重大变更导致该指数不宜继续作为业绩比较基准的组成部分,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,履行必要手续后,调整业绩比较基准并及时公告。如变更业绩比较基准需事先征得基金托管人同意。

十二、风险收益特征

本基金是指数型股票基金,属于证券投资基金中的高风险、高收益品种,风险收益水平高于混合基金、债券基金和货币市场基金。

十三、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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定复核了本投资组合报告内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

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。

本投资组合报告截至时间为2012年6月30日,本报告中所列财务数据未经审计。

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	123,141,727.68	37.65
	其中:股票	123,141,727.68	37.65
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	110,000,405.00	33.63
	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	93,819,226.71	28.68
6	其他资产	144,900.23	0.04
7	合计	327,106,259.62	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	50,908,849.68	16.13
C	制造业	70,198,373.36	22.24
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	4,475,000.00-	1.42
C6	金属、非金属	65,723,373.36	20.82
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	2,034,504.64	0.64
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		123,141,727.68	39.01

②报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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

①)报告期末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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600111	包钢稀土	500,000	19,730,000.00	6.25
2	600549	厦门钨业	389,982	17,124,109.62	5.42
3	000878	云南铜业	599,967	10,739,409.30	3.40
4	601958	金钼股份	749,998	9,502,474.66	3.01
5	600547	山东黄金	275,400	9,044,136.00	2.