

**(下转B34版)**

**(2) 组合调整方法**

**A. 定期调整**

本基金所构建的指数投资组合将主要根据跟踪的目标指数对其成份股的调整而进行相应的跟踪调整。本基金将按照事先约定的成份股及其权重的调整方案,在考虑跟踪误差风险的前提下,对股票投资组合进行相应调整。

本基金所构建的指数化投资组合为经过优化处理的抽样复制组合,将每季度末根据上述抽样复制方法调整投资组合及个股配置比例。

**B. 不定期调整**

根据跟踪复制原理,当标的指数的成份股因增发、送配等股权变动而需要进行成份股调整时,本基金将根据修正指数公司在股权变动公告次日发布的临时调整决定及其调整的股权比例,并根据抽样复制方法对投资组合进行相应调整。

**C. 手工调整及特殊调整**

如果因组合中个股停牌限制、交易量暂时不足等市场流动性因素或法律法规规定的投资限制,使得基金管理人无法购回买入成份股,本基金管理人将根据当时市场情况,综合考虑投资价值和跟踪误差最小化,决定部分持有现金或买入相关的替代性股票。替代股票的选取遵循“同行业基础上价格相关性最强,对于主要持仓替代股票,其替代跟踪误差的指标与本基金投资组合的跟踪误差相匹配,具有使股票流动性因素因循的前提下,在同行业范围内,选取相关性较大的股票进行替代。”

**D. 在其他不影响跟踪复制的情况下,本基金管理人可以根据市场情况,在跟踪误差最小的条件下,对投资组合进行适当的调整。**

**4. 债券投资策略**

本基金管理人将对国内外宏观经济形势的深入分析,国内财政政策与货币市场政策等因素对债券市场的影响,进行合理的利率预期,判断债券市场的基本走势,久期控制下的资产配置策略,在债券投资组合风险管理过程中,本基金管理人将根据采用期限结构配置、市场择时、信用利差和相对价值判断,信用风险评估,现金管理等多种手段进行券选择。

本基金债券投资的目的是在保障基金资产流动性的基础上,有效利用基金资产,提高基金资产的投资收益。

**5. 权证投资策略**

在法律法规允许的前提下,本基金可基于谨慎原则对权证进行投资,即根据权证合理价值与其市场价格间的差别,用“估值定价”以及权证合理价值对定价参数的敏感性,结合标的股票合理价格考量,决策买入、持有或卖出权证。

**(六) 投资决策依据与交易机制**

1. 投资决策依据

有关法律法规,基金合同以及标的指数的相关规定是基金管理人运用基金资产的投资决策依据。

2. 投资决策机制

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会负责做出有关标的指数权重调整的对标决策,基金组合重大调整的决定,以及其他单项投资的重要决策。基金经理负责做出日常的标的指数的跟踪过程中组合的构建、组合调整等决策。

3. 投资决策程序

研究、投资、交易、组合构建、交易执行、投资绩效评估、组合监控与调整各环节的相互协调与配合,构成了本基金的投资管理流程。本基金管理人定期或不定期对本基金的投资管理流程进行,并开展相关的绩效评估报告,确认本基金组合是否实现了投资预期,投资策略是否成功,并分析组合误差的来源进行相应分析等。基金经理根据绩效评估报告总结以往的投资策略,如果失败,亦对投资策略进行相应的调整。

4. 投资决策流程

本基金组合跟踪标的指数的每日变动情况,结合成份股的基本面情况、流动性状况、基金申购赎回的资金量情况,以及投资组合的跟踪误差情况,对基金投资组合进行动态监控和调整,密切跟踪标的指数。

基金管理人需在确保基金份额持有人利益的前提下,根据标的指数的变化和基金实际投资的需要,有权对上述投资组合进行调整,调整内容存在基金招募说明书及招募说明书更新中予以公告。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	174,540,100.94	94.06
A	其中:股票	174,540,100.94	94.06
2	固定收益投资	26,900.80	0.01
B	其中:债券	26,900.80	0.01
3	资产支持证券	-	-
C	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
D	其中:买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	10,779,676.62	5.54
6	其他资产	71,075,606.60	3.39
7	合计	183,564,857.96	100.00

**(1) 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	992,779.16	0.54
B	采矿业	17,708,983.81	9.59
C	制造业	56,687,797.18	30.69
D	建筑业	1,071,360.98	0.59
C1	纺织、服装、皮毛	447,557.77	0.24
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	3,368,542.83	1.82
C5	电子	2,810,827.19	1.52
C6	金属、非金属	13,991,271.70	7.69
C7	机械、设备、仪器	17,856,360.04	9.68
C8	医药、生物制品	7,962,481.22	4.31
C9	其他制造业	49,389.45	0.03
D	电力、煤气及水生产和供应业	3,936,323.05	2.13
E	建筑业	6,186,209.29	3.35
F	交通运输、仓储业	465,418.72	0.26
G	信息技术业	4,051,818.24	2.19
H	批发和零售业	4,011,183.93	2.17
I	金融、保险业	57,607,898.96	31.19
J	房地产业	10,700,395.60	5.79
K	社会服务业	1,799,667.70	0.97
L	传播与文化产业	2,328,753.43	1.26
M	综合类	170,539,162.74	92.33

**(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	-	-
B	采矿业	183,300.00	0.10
C	制造业	1,596,698.20	0.86
C0	食品、饮料	274,240.00	0.15
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	870,258.20	0.47
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪器	453,200.00	0.24
C8	医药、生物制品	-	-
C9	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水生产和供应业	646,500.00	0.35
E	建筑业	529,840.72	0.29
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售业	-	-
I	金融、保险业	563,450.00	0.31
J	房地产业	254,070.00	0.14
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	222,180.00	0.12
M	综合类	4,000,938.20	2.17

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。

公司于2013年3月11日召开2013年第1次临时股东大会,有关事项的公告已于2013年2月22日在《中国证券报》、《证券时报》和上海证券交易网站进行了公告。

日前,公司董事会收到大股东郭光华先生(持有本公司7,637万股,占总股本的30.14%)来函,提议公司2013年第1次临时股东大会增加审议《关于公司聘请2012年度审计机构的议案》。根据《上市公司股东大会规则》和公司《章程》等的规定,公司董事会认为郭光华先生的提议程序和内容符合法律、法规要求,同意将其提交于2013年第1次临时股东大会审议。

增加上述提案后,公司2013年第1次临时股东大会将审议6项议案,现将2013年第1次临时股东大会补充通知公告如下:

- 一、召开会议的基本情况
- 1.召集人:公司董事会
- 2.会议召开的法律、合规性:经本公司第二届董事会第六次会议审议通过,决定召开2013年第1次临时股东大会,召集程序符合有关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和公司《章程》的规定。
- 3.召开会议时间:2013年3月11日(星期一)13:30
- 4.会议召开方式:现场投票表决
- 5.会议出席对象
- (1)截至2013年3月1日(星期五)下午收市时,在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司登记在册的本公司全体股东。上述本公司全体股东均有权出席股东大会,并可以书面委托他人出席和参加表决,该股东代理人不必是公司的股东。
- (2)本公司董事、监事和高级管理人员。
- (3)本公司聘请的律师及邀请的其他嘉宾。
- 6.会议地点:公司会议室
- 二、会议审议事项
- 1.审议《关于公司向中国民生银行股份有限公司大连分行申请银行综合授信业务的议案》,该议案已经公司2013年2月21日召开的第二届董事会第六次会议审议通过。
- 2.审议《关于公司股东郭光华、秦丽娟为公司向中国民生银行股份有限公司大连分行申请银行综合授信提供担保的议案》,该议案公司独立董事已发表同意的专项意见,并已经公司2013年2月21日召开的第二届董事会第六次会议审议通过。
- 3.审议《关于公司向中国交通银行股份有限公司锦州分行申请短期流

**3. 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	600016	民生银行	842,461	6,621,743.46	3.59
2	601166	兴业银行	326,945	5,456,712.05	2.93
3	601318	中国平安	115,461	5,229,228.69	2.85
4	600000	浦发银行	469,565	4,658,084.80	2.52
5	601328	交通银行	843,468	4,166,731.92	2.26
6	600030	中信证券	274,486	3,667,132.96	1.99
7	000002	万科A	330,625	3,245,025.00	1.81
8	601169	北京银行	352,969	3,282,611.78	1.73
9	600837	海南发展	310,534	3,182,973.50	1.73
10	600519	贵州茅台	14,523	3,035,997.46	1.64

**报告期末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**

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	000970	中科三环	14,000	456,260.00	0.25
2	002236	天邦股份	3,932	413,998.20	0.22
3	601800	中国交建	60,000	313,000.00	0.17
4	000750	信达证券	25,000	299,750.00	0.16
5	000596	鲁商置业	8,000	274,240.00	0.15

**4. 报告期末按券种及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	国债逆回购	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	26,900.80	0.01
8	其他	-	-
9	合计	26,900.80	0.01

**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**

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	110022	银行间债	230	26,900.80	0.01

注:本基金本报告期仅持有一支债券

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。

(1) 报告期末前十名股票的前十大证券的发行主体无被监管部门立案调查,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

(3) 其他债券投资

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	367,187.46
3	应收利息	-
4	其他应收款	2,452.47
5	其他流动资产	98,436.67
6	应收股利	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	718,076.60

(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。

(5) 期末按投资组合前十大股票中存在流通受限情况的说明

期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票不存在流通受限情况。

**十三、基金的业绩**

本基金成立以来业绩如下:

项目	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年8月4日至2010年12月31日	5.70%	1.36%	8.79%	1.51%	-3.09%	-0.15%
2011年度	-23.09%	1.21%	-23.73%	1.23%	0.64%	-0.02%
2012年度	-8.09%	1.20%	7.44%	1.22%	-0.57%	-0.02%
2010年8月4日至2012年12月31日	-12.20%	1.23%	-10.85%	1.28%	-1.35%	-0.05%

本基金管理人恪尽职守,诚实信用,谨慎勤勉的跟踪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。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。

**十四、基金费用与税收**

(一)基金费用的种类

- 1.基金管理人管理费;
- 2.基金托管人托管费;
- 3.基金财产运作及银行的费用;
- 4.基金合同生效前的基金信息披露费用;
- 5.基金合同持有人大会费用;
- 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.依法应由基金财产中列支的其他费用。

(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

(一)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0.75%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H为每日应计提的管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,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。

(二)基金托管人的托管费

基金托管费每日计算,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。

上述(一)基金费用的种类中第3-8项费用,根据有关法律法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

本基金申购费、赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和支付方式详见本招募说明书“第九部分基金费用的列支”中“申购费与赎回”和“第十部分基金费用的列支”中的相关规定。不同基金申购和赎回转换,相关费用由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的约定制定并公告,基金管理人有权根据市场情况调整基金申购费率、赎回费率。

(四)不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

- 1.基金管理人和基金托管人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;
- 2.基金管理人及基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
- 3.《基金合同》生效前的相关费用,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用以及其他费用。

(五)费用调整

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调低基金管理费和基金托管费率。基金管理人必须最迟于调整费率实施日2日前在指定媒体上刊登公告。

(六)基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律法规的规定,履行纳税义务。

**十五、对招募说明书更新部分的说明**

本招募说明书依据《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》及其他相关法律法规的要求,对本基金的招募说明书进行了更新,主要更新内容如下:

(一)更新了“二、释义”中的相关信息。

(二)更新了“三、基金管理人”中的相关信息。

(三)更新了“四、基金托管人”中的相关信息。

(四)更新了“五、相关服务机构”中的相关内容。

(五)更新了“十二、基金的投资”中,更新了“(十一)基金投资组合报告”的相关内容。

(六)更新了“十三、基金的风险”的相关内容。

(七)更新了“十四、基金信息披露”的相关内容。

本招募说明书更新部分,更新了本次招募说明书更新期间所涉及的相关信息披露。

**十六、 签署日期**

本招募说明书(更新)于2013年2月22日签署。

长盛基金管理有限责任公司  
二〇一三年三月一日

证券代码:603399 证券简称:新华龙 公告编号:2013-005  
**锦州新华龙铝业股份有限公司  
第二届董事会第七次会议决议公告**

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、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。

锦州新华龙铝业股份有限公司(以下简称“公司”)第二届董事会第七次会议于2013年2月28日在公司会议室以现场表决和通讯表决相结合的方式召开,本次董事会会议通知已于2013年2月25日分别以专人送达、电子邮件或传真等方式发出,本次会议表决截止时间2013年2月28日15时。会议应出席董事6人,实际出席6人,会议由董事长郭光华先生主持。会议召集及召开程序符合《公司法》和公司《章程》、《董事会议事规则》的有关规定。

会议审议并通过了如下议案:

- 一、《关于公司聘请2012年度审计机构的议案》
- 公司独立董事已发表同意的专项意见。
- 同意聘请大信会计师事务所有限公司为公司2012年度审计机构。
- 应参加表决董事6人,实际参加表决董事6人,6票赞成,0票反对,0票弃权,本议案尚需股东大会审议通过。
- 二、《关于公司2013年第1次临时股东大会增加议案的议案》
- 根据《上市公司股东大会规则》和公司《章程》等的规定,公司大股东郭光华先生(持有本公司7,637万股,占总股本的30.14%)向董事会来函,提议2013年第1次临时股东大会增加审议《关于公司聘请2012年度审计机构的议案》。
- 应参加表决董事6人,实际参加表决董事6人,6票赞成,0票反对,0票弃权,本议案审议通过。

锦州新华龙铝业股份有限公司董事会  
2013年2月28日

证券代码:603399 证券简称:新华龙 公告编号:2013-006  
**锦州新华龙铝业股份有限公司  
关于增加2013年第1次临时股东大会  
临时提案的公告暨2013年第1次  
临时股东大会补充通知**

公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、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。

证券代码:002373 证券简称:联信永益 公告编号:2013-006  
**北京联信永益科技股份有限公司关于2012年度业绩快报的更正及补充公告**

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。

北京联信永益科技股份有限公司(以下简称“公司”)编制了2012年度业绩快报,并于2012年2月28日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》以及巨潮资讯网(www.cninfo.com.cn)上披露。现对2012年度业绩快报中披露的相关内容予以更正及补充

一、2012年度主要财务数据和指标更正

	单位:元
归属于上市公司股东的所有者权益	998,382,058.82
归属于上市公司股东的净资产	658,117,837.20
归属于上市公司股东的每股净资产(元)	8.73
	9.61
	-9.14%

二、公司经营业绩和财务状况补充说明

报告期内公司实现营业收入67,933.94万元,净利润-6,140.35万元;公司营业利润、利润总额和净利润分别较上年同期下降712.73%、450.05%和599.05%。主要原因是:报告期内,一方面,日常经营中的传统业务受市场因素的影响利润率较上年下降;另一方面,日常经营中的固定费用较上年有较大幅度增加,增幅较大的主要是募集资金投资项目资本摊销,办公新址正式投入使用,本期固定资产折旧增加;第三,公司流动资金贷款使用增加,导致本期财务费用利息支出较上年有所增加。

由此给广大投资者造成的不便,我们深表歉意,敬请广大投资者谅解。特此公告。

北京联信永益科技股份有限公司董事会  
2013年3月1日

**南方基金关于旗下部分基金增加东兴证券为代销机构及开通转换业务的公告**

根据南方基金管理有限公司(以下简称“南方”)与东兴证券股份有限公司(以下简称“东兴证券”)签署的销售合作协议,东兴证券将于2013年3月1日起代理销售本公司以下基金:

序号	基金名称	基金代码
1	南方稳健成长证券投资基金	202001
2	南方避险增值证券投资基金	202002
3	南方宝利债券基金	A类:202030, B类:202032
4	南方多利增强债券证券投资基金	A类:202033, C类:202032
5	南方现金增利基金	A类:202034, B类:202032
6	南方理财增值基金	202022
7	南方中证500指数证券投资基金	160105
8	南方高增长证券投资基金	前码:160106, 后码:160107
9	南方中证成长股票证券投资基金	前码:202001, 后码:202004
10	南方中证红利股票证券投资基金	前码:202005, 后码:202006
11	南方中证500指数证券投资基金	202001
12	南方中证500指数证券投资基金	前码:202007, 后码:202008
13	南方中证红利股票证券投资基金	前码:202009, 后码:202010
14	南方中证价值回报股票证券投资基金	前码:202011, 后码:202012
15	南方中证500指数证券投资基金	202011
16	南方中证500指数证券投资基金	前码:202015, 后码:202016
17	南方中证500指数证券投资基金	前码:160119, 后码:160120
18	南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	前码:202017, 后码:202018
19	南方中证红利股票证券投资基金	前码:202019, 后码:202020
20	中证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金	前码:202021, 后码:20