(上接B6版)

(二)注册登记机构

名称:南方基金管理有限公司

住所及办公地址:深圳市福田中心区福华一路六号免税商务大厦塔楼31、32、33层整层

法定代表人:吴万善

电话:(0755)82763849

传真:(0755)82763868

联系人:古和鹏

(三)律师事务所

名称:广东华瀚律师事务所

注册地址:深圳市罗湖区笋岗东路1002号宝安广场A座16楼G.H室

负责人:李兆良

电话:(0755)82687860

传真:(0755)82687861

经办律师:杨忠、戴瑞冬

(四)会计师事务所

名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

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

执行事务合伙人:杨绍信

联系人:陈燕

联系电话:021-23238888

传真:021-23238800

经办会计师:薛竞、陈燕

四、基金名称

南方优选成长混合型证券投资基金

五、基金的类型

契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金通过精选高成长性的优质企业进行重点投资,并通过动态的资产配置,增加组合的超额收益,在有效控制市场风险的前提下,力争为投资者寻求长期稳定的资产增值。

七、基金的投资范围

本基金为混合型基金,投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市的各类股票、债券、短期金融工具、权证、股指期货及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的30%~80%,其中投资于高成长性企业的资产不低于股票资产的80%;债券、权证、货币市场工具、资产支持证券及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例范围为20%~70%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,基金持有权证的市值不得超过基金资产净值的3%。

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

八、基金的投资策略

(1)资产配置策略

本基金基于宏观经济环境、微观经济因素、经济周期情况、政策形势和证券市场趋势的综合分析,结合经济周期投资时钟理论,形成对不同市场周期的预测和判断,进行积极、灵活的资产配置,确定组合中股票、债券、现金等资产之间的投资比例。

本基金为混合型基金,通过积极分析判断市场趋势,运用战略资产配置策略和风险管理策略,系统化管理各大类资产的配置比例。本基金严谨衡量不同类别资产的预期风险/收益特征,评估股票市场价值,如股票市场价值的整体估值水平偏离企业实际的盈利状况和预期的

成长率或预计将出现较大的偏离,本基金将及时降低股票资产配置,或适度增加债券市场的配置权重,避免或减少可能给投资人带来潜在的资本损失。

(2)股票投资策略

本基金采用积极主动的投资管理策略,通过深入研究中小板、创业板以及主板的上市公司,重点考察企业成长性等指标,并以企业增长驱动因素作归因分析,精选出高成长性企业进行重点投资。同时本基金将及时跟踪并把握市场趋势和个股的投资机会,通过对股票价格与价值相对波动和偏离程度的分析来掌握买卖时机,在股价的波动中适时实现收益。

①企业过往的成长性和盈利状况能够在一定程度上反映企业未来的增长潜力。本基金首先通过企业成长性等定量指标初步筛选出成长潜力较大的上市公司作为本基金的初选备用库。采用的具体财务指标主要包括主营业务收入增长率和净利润增长率,将这两个指标由高到低分别进行排序,然后将排名结果相加,所得的排名作为上市公司的综合排名,选取主营业务收入增长率和净利润增长率高于行业和市场平均水平的上市公司作为初选股票。

本基金尤其注重上市公司主营业务收入增长率,在公司研究团队调研和分析的基础上主要选取未来两年预期主营业务收入增长率位于前1/2的上市公司。主营业务收入的增长所隐含的往往是企业市场份额的扩大,体现公司未来盈利潜力的提高,盈利稳定性的加大,公司持续成长能力的提升。

②针对初选备用库中的股票,进一步进行实地调研和深入研究,分析增长背后的驱动力量,判断这些驱动力量所带来的增长是否具备持续性。在此过程中,本基金管理人将应用"企业成长驱动归因模型",重点从五个维度评价,对企业在未来两到三年的成长性进行分析和预测,精选出具有未来增长潜力的上市公司。

"企业成长驱动归因模型"主要包括:

成长驱动要素	具体表现
行业成长前景	行业集中度和上市公司行业地位,所处行业的上下游运行态势与利益分配,行业发展前景,在行业竞争中上市公司受影响的程度
企业创新能力	企业是否具备战略规划,富有创新精神,关注技术、产品的革新和投资应用创新,获取企业增长动力和持续发展能力
核心竞争力	企业在规模经济、资源或政策垄断、品牌、经营效率等方面是否具有竞争对手在中长期时间内难以模仿的显著优势
市场战略	企业的"市场吸引力"和"市场竞争地位"两方面,如企业的市场规模增长、市场活动在产品生命周期中的位置、市场相对占有率、企业成本优势等
管理经营能力	企业的内部管理是否规范、科学,企业管理层的素质,管理水平是否能适应企业竞争优势的维持与开拓,以及管理层激励考核方式

"企业成长驱动归因模型"重点从五个维度对备选库股票进行综合评估,针对不同行业特征,按照一定的权重加权综合,得出该股票的综合评级。

③本基金将及时跟踪并把握市场趋势和个股的投资机会,结合股票规模、流动性和市值等多种因素,运用SAR转向指标、均线理论等技术分析手段,分析判断股票价格与价值相对波动和偏离程度,掌握买卖时机,在股价的波动中适时实现收益。此外,本基金积极把握经济转型结构当中出现的投资机会,关注如新兴战略产业、消费行业、高端制造业等、节能减排、低碳、区域投资等主题,积极捕捉由于总体或特定的经济、社会、政策以及科技等方面的发展变化所带来的投资机会,获取一定的超额收益。

(3)风险管理策略

本基金在进行主动投资管理的过程中,尤为关注风险控制,积极调整资产配置,控制下跌风险。

在资产配置方面,根据定量定性分析,在市场趋势发生变化时,灵活调整大类资产的配置比例,提高或降低风险资产持有比重;在股票投资方面,运用技术分析手段,从股票基本面变化、价格对比信号、收益率动态变化等方面进行有效跟踪,策略持有,而不片面强调中长期静态持有。

本基金管理人把保护投资者利益放在首位,设身处地从投资者角度来控制投资风险,力争为投资者追求较高的绝对回报。

(4)债券投资策略

本基金可投资的债券品种包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、短期融资券、次级债券、政府机构债、地方政府债、资产支持证券、可转换债券(包括分离交易的可转换债券)、债券回购、银行存款等。本基金将在研判利率走势的基础上做出最佳的资产配置及风险控制。

在选择债券品种时,首先根据宏观经济分析、资金面动向分析和投资人行为分析判断未来利率期限结构变化,并充分考虑组合的流动性管理的实际情况,配置债券组合的久期;其次,结合信用分析、流动性分析、税收分析等确定债券组合的类属配置;再次,在上述基础上利用债券定价技术,进行个券选择,选择被低估的债券进行投资。在具体投资操作中,采用骑乘操作、放大操作、换券操作等灵活多样的操作方式,获取超额的投资收益。

(5)权证投资策略

本基金在进行权证投资时,将通过对权证标的证券基本面的研究,并结合权证定价模型寻求其合理估值水平,主要考虑运用的策略包括:杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空保护性的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。

基金管理人将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征,通过资产配置、品种与类属选择,谨慎进行投资,追求较稳定的当期收益。

(6)股指期货投资策略

本基金在进行股指期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组,授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项,同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:

60%×沪深300指数+40%×上证国债指数

本基金为混合型基金,在考虑了基金股票组合的投资标的、构建流程以及市场上各个股票指数的编制方法和历史情况后,选定沪深300指数作为本基金股票组合的业绩基准。沪深300指数成份股选自沪深两个证券市场,覆盖了大部分流通市值,为中国A股市场中代表性强、流动性高的主流投资股票,能够反映A股市场总体发展趋势。债券组合的业绩基准则采用了上证国债指数,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。上证国债指数是上证指数系列的第一只债券指数,反映我国债券市场整体变动状况,具有较强的市场代表性。

如果今后法律法规发生变化,或者指数编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称、或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金业绩基准的指数时,经与基金托管人协商一致,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

十、基金的风险收益特征

本基金为混合型基金,其预期风险和收益水平高于债券基金及货币市场基金,低于股票基金。

十一、基金的投资组合报告(如无特别说明以下单位均为元)

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。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。本投资组合报告所载数据截至2014年6月30日(未经审计)。

(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	632,534,001.63	57.90
	其中:股票	632,534,001.63	57.90
2	固定收益投资	257,221,155.50	23.55
	其中:债券	257,221,155.50	23.55
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	199,819,359.22	18.29
7	其他资产	2,818,920.74	0.26
8	合计	1,092,393,437.09	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	采矿业	22,110,000.00	2.03
C	制造业	355,522,730.35	32.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	20,302,623.84	1.87
F	批发和零售业	11,694,861.68	1.08
G	交通运输、仓储和邮政业	22,085,000.00	2.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	106,598,774.26	9.81
J	金融业	38,688,000.00	3.56
K	房地产业	20,185,200.00	1.86
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	35,346,811.50	3.25
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	632,534,001.63	58.21

(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	300124	汇川技术	1,177,030	36,723,336.00	3.38
2	300070	碧水源	1,208,438	35,346,811.50	3.25
3	600703	三安光电	1,340,800	30,114,368.00	2.77
4	600406	国电南瑞	2,184,500	29,119,385.00	2.68
5	002415	海康威视	1,600,000	27,104,000.00	2.49
6	000581	威孚高科	900,000	24,273,000.00	2.23
7	000001	深发展A	2,400,000	23,784,000.00	2.19
8	002466	天齐锂业	725,700	23,577,993.00	2.17
9	600583	海油工程	3,000,000	22,110,000.00	2.03
10	601006	大秦铁路	3,500,000	22,085,000.00	2.03

(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	101,037,960.50	9.30
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	156,183,195.00	14.37
8	其他	-	-
9	合计	257,221,155.50	23.67

(五)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	110023	民生转债	572,050	53,086,240.00	4.89
2	122214	12大秦债	480,930	48,020,860.50	4.42
3	122068	11海螺01	330,000	32,957,100.00	3.03
4	110015	石化转债	300,000	32,391,000.00	2.98
5	113001	中行转债	250,000	25,447,500.00	2.34

(六)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序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

(八)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

(九)报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1.报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有股指期货,股指期货投资本期收益为-1,726,680.00元,公允价值变动总额合计609,780.00元,股指期货投资本期公允价值变动609,780.00元。

2.本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时,根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

基金管理人充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

基金管理人建立了股指期货交易决策部门或小组,授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项,同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

本基金本报告期内的股指期货交易符合既定投资政策和投资目标。

(十)报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

(十一)投资组合报告附注

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

2.本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

3.其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	213,677.68
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,521,759.53
5	应收申购款	83,483.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,818,920.74

4.报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110023	民生转债	53,086,240.00	4.89
2	110015	石化转债	32,391,000.00	2.98
3	113001	中行转债	25,447,500.00	2.34
4	110024	隧道转债	23,894,455.00	2.20
5	113005	平安转债	21,364,000.00	1.97

5.报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600703	三安光电	30,114,368.00	2.77	非公开发行
2	002466	天齐锂业	23,577,993.00	2.17	重大事项停牌

注:

1.基金可作为特定投资者,认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票,所认购的股票自发行结束之日起12个月内不得转让。

2.本基金截至2014年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

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。

净值增长率与同期业绩基准收益率比较表:

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)
2011.01.30-2011.12.31	-16.90%	0.67%	-13.37%	0.76%	-3.53%	-0.09%
2012.01.01-2012.12.31	9.99%	0.93%	6.36%	0.77%	3.63%	0.16%
2013.01.01-2013.12.31	13.68%	0.94%	-3.08%	0.84%	16.76%	0.10%
2014.01.01-2014.06.30	2.31%	0.91%	-3.48%	0.62%	5.79%	0.29%
自基金成立起至今	6.30%	0.87%	-13.80%	0.77%	20.10%	0.10%

十三、基金的费用概览

(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)基金财产拨划支付的银行费用;

(4)基金合同生效后的基金信息披露费用;

(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)依照国家有关规定和基金合同可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用,按实际支出从基金财产总值中扣除。

2.基金费用计提方法、计提标准和支付方式

(1)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1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×1.5%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

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5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

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.25%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

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5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。

3.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。

4.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整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须依照《信息披露办法》的有关规定于新的费率实施前在至少一家指定媒体上刊登公告。

(二)与基金销售有关的费用

1.认购费用

本基金提供两种认购费用的支付模式。本基金在认购时收取的认购费用称为前端认购费用,在赎回时收取的认购费用称为后端认购费用。基金投资者可以选择支付前端认购费用或后端认购费用。

本基金前端认购费率最高不高于1.2%,且随认购金额的增加而递减,后端认购费率最高不高于1.5%,且随持有时间的增加而递减,如下表所示:

前端收费:

购买金额(M)	认购费率
M<100万	1.2%
100万≤M<500万	0.8%
500万≤M<1000万	0.2%
M≥1000万	每笔1,000元

后端收费(其中1年为365天):

持有期限(N)	认购费率
N<1年	1.5%
1年≤N<2年	1.2%
2年≤N<3年	0.9%
3年≤N<4年	0.6%
4年≤N<5年	0.3%
N≥5年	0

投资者重复认购,须按每次认购所对应的费率档次分别计费。

2.申购与赎回费

(1)申购费

本基金前端申购费率最高不高于1.5%,且随申购金额的增加而递减,后端申购费率最高不高于1.8%,且随持有时间的增加而递减,如下表所示:

前端收费:

购买金额(M)	申购费率
M<100万	1.5%
100万≤M<500万	0.9%
500万≤M<1000万	0.3%
M≥1000万	每笔1,000元

后端收费(其中1年为365天):

持有期限(N)	申购费率
N<1年	1.8%
1年≤N<2年	1.5%
2年≤N<3年	1.2%
3年≤N<4年	0.8%
4年≤N<5年	0.4%
N≥5年	0

申购费用由投入人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

(2)赎回费

本基金赎回费率不高于0.5%,随申请份额持有时间增加而递减(其中1年为365天)。具体如下表所示:

申请份额持有时间(N)	赎回费率
N<1年	0.5%
1年≤N<2年	0.3%
N≥2年	0

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。不低于赎回费总额的25%应归基金财产,其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

(3)本基金的申购费率、申购份额具体的计算方法、赎回费率、赎回金额具体的计算方法和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定,并在招募说明书中列示。基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式,并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在至少一家指定媒体上公告。

(4)基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,按相关监管部门要求履行必要手续后,基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

(5)转换费

基金管理人已开通本基金与基金管理人旗下部分基金在直销机构和部分代销机构的基金转换业务,业务规则和转换费用的相关规定详见2011年4月18日发布的《南方优选成长混合型证券投资基金开放申购、赎回、转换和定期定额业务的公告》和其他有关基金转换公告。

(三)其他费用

本基金其他费用根据相关法律法规执行。

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》及其他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,对基金管理人主要人员情况进行了更新。

2.在"基金托管人"部分,对基金托管人的情况进行了更新。

3.在"相关服务机构"部分,对代销机构及会计师事务所的办公地址进行了更新。

4.在"基金份额的申购和赎回"部分,增加了基金开放日常申购赎回时间及可在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下,对基金销售费用实行一定优惠的表述。

5.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。

6.在"基金的业绩"部分,更新了"净值增长率与同期业绩基准收益率比较表"。

7.在"风险揭示"部分,补充了本基金投资股指期货的风险。

8.对"基金份额持有人服务"进行了更新。

9.对部分表述进行了更新。

南方基金管理有限公司

2014年9月5日

证券代码:000401 证券简称:冀东水泥 公告编号:2014-052

唐山冀东水泥股份有限公司 第六届董事会第七十七次会议决议公告

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。

唐山冀东水泥股份有限公司(以下简称"公司"或"本公司")董事会于2014年8月30日以专人传达和电子邮件方式向全体董事、监事及高级管理人员发出了关于召开公司第六届董事会第七十七次会议的通知。会议于2014年9月3日在公司会议室召开。会议应到董事九名,实际出席董事九名,监事会成员、公司高级管理人员和其他相关人员列席会议。会议由董事长张增光先生召集并主持。会议的召集、召开符合《中华人民共和国公司法》和公司《章程》的有关规定。会议对所列议案进行了审议,经表决形成如下决议:

一、审议通过了《关于受让陕西秦岭水泥(集团)股份有限公司全部资产、负债的议案》

具体内容详见本公司于2014年9月5日发布在《中国证券报》、《证券时报》和巨潮资讯网(www.cninfo.com.cn/)的《受让陕西秦岭水泥(集团)股份有限公司全部资产公告》。

表决结果:九票同意 零票反对 零票弃权

二、审议通过了《关于陕西秦岭水泥(集团)股份有限公司发行股份购买资产的议案》

同意控股子公司秦岭水泥向中国再生资源开发有限公司、中再资源再生开发有限公司、黑龙江省中再生资源开发有限公司、山东中再生投资开发有限公司、广东华清再生资源有限公司、湖北省再生资源有限公司、四川省农业生产资料集团有限公司、唐山市再生资源有限公司、河北君诚投资有限责任公司、刘永彬、郇庆明等11名交易对方发行股份购买其合计持有的黑龙江省中再生废旧家电拆解有限公司100%股权、湖北蕲春鑫丰废旧家电拆解有限公司100%股权、江西中再生资源开发有限公司100%股权、中再生洛阳投资开发有限公司100%股权、四川中再生资源开发有限公司100%股权、唐山中再生资源开发有限公司100%股权、广东华清废旧电器处理有限公司100%股权,以及山东中绿资源再生有限公司56%股权。

根据中和资产评估有限公司出具的中和评报字(2014)第BJV5001-1号、第BJV5001-2号、第BJV5001-3号、第BJV5001-4号、第BJV5001-5号、第BJV5001-6号、第BJV5001-7号、第BJV5001-8号评估报告书,以2014年3月31日为评估基准日,上述标的资产于评估基准日2014年3月31日的合计评估值为人民币187,216.57万元,交易各方确定标的资产的交易价格为187,216.57万元。

秦岭水泥本次股票发行价格为2.75元/股,向发行对象合计发行680,787,523股股票,其中分别向中国再生资源开发有限公司、中再资源再生开发有限公司、黑龙江省中再生资源开发有限公司、广东华清再生资源有限公司、山东中再生投资开发有限公司、湖北省再生资源有限公司、唐山市再生资源有限公司、四川省农业生产资料集团有限公司、河北君诚投资有限责任公司、刘永彬、郇庆明等11名发行对象发行240,060,867股、108,273,600股、102,778,981股、64,704,981股、55,234,472股、32,918,727股、24,857,738股、22,340,516股、8,976,405股、10,320,618股、10,320,618股。上述股份的最终发行数量将由秦岭水泥股东大会审议批准,并经中国证监会核准确定,若秦岭水泥在基准日至发行日期间有派息、送股、资本公积金转增股本、增发新股或配股等除权、除息事项,发行数量进行相应调整。

表决结果:九票同意 零票反对 零票弃权

特此公告。

唐山冀东水泥股份有限公司董事会

二〇一四年九月四日

证券代码:000401 证券简称:冀东水泥 公告编号:2014-053

唐山冀东水泥股份有限公司受让陕西秦岭水泥(集团)股份有限公司全部资产公告

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。

特别提示:

1、本次交易与陕西秦岭水泥(集团)股份有限公司(以下简称"秦岭水泥")重大资产重组事项互为前提且不可分割,秦岭水泥重大资产重组事项尚需秦岭水泥股东大会批准和中国证券监督管理委员会核准。

2、秦岭水泥2013年度归属于母公司所有者的净利润为亏损11703万元(经审计),2014年1-6月归属于母公司所有者的净利润为亏损12750万元(未经审计),秦岭水泥资产盈利能力的改善具有不确定性。

3、本次交易的实施方式为秦岭水泥全资子公司冀东水泥铜川有限公司承接秦岭水泥资产(含负债)、业务和员工,待本次重大资产重组方案获准实施时,将该子公司的股权连同秦岭水泥体内其他的资产(含负债)出售给本公司。

上述事项存在不确定性,敬请广大投资者注意投资风险。

一、交易概述

为了落实秦岭水泥的重整计划,彻底解决秦岭水泥的生存和发展的问题,中国再生资源开发有限公司(以下简称"中再生")拟对秦岭水泥注入优质资产。根据本公司与秦岭水泥签署的《重大资产出售协议》,本公司拟以人民币2945万元购买秦岭水泥的全部资产(含负债)及业务。实施方式为秦岭水泥全资子公司冀东水泥铜川有限公司承接秦岭水泥资产(含负债)、业务和员工,待本次重大资产重组方案获准实施时,将该子公司的股权连同秦岭水泥体内其他的资产(含负债)出售给本公司。

本公司于2014年9月3日召开第六届董事会第七十七次会议,审议通过了《关于受让秦岭水泥全部资产、负债的议案》(表决结果:九票同意、零票反对、零票弃权)。

本公司本次交易不构成关联交易,不构成重大资产重组,无须提交本公司股东大会审议。本次交易与秦岭水泥重大资产重组事项互为前提且不可分割,秦岭水泥重大资产重组事项尚需秦岭水泥股东大会批准和中国证券监督管理委员会核准。

二、交易标的基本情况

1、秦岭水泥基本情况

公司名称:陕西秦岭水泥(集团)股份有限公司

住所:陕西省铜川市耀州区东郊

注册资本:66080万元

法定代表人:于九洲

公司性质:股份有限公司(上市)

经营范围:水泥、水泥熟料及水泥深加工产品、水泥生产及研究开发所需原料、设备配件、其他建材的生产、销售;相关产品的销售、运输;与水泥产品相关的技术服务。

秦岭水泥成立于1996年11月6日,股票于1999年12月16日在上海证券交易所上市交易(股票代码600217),秦岭水泥现有两条2000t/d的新型干法生产线,一条4000t/d水泥熟料生产线,一条4500t/d水泥熟料生产线,水泥年生产能力600万吨。主导产品为P.C32.5R、P.O42.5R、P.O52.5R普通硅酸盐水泥。

2、交易涉及的资产审计情况

经具有证券从业资格的信永中和会计师事务所(特殊普通合伙)审计(XYZH/2013XAA3023号),秦岭水泥2013年度及2014年第一季度财务数据简要如下:

(1)资产负债表(合并报表)

单位:元

项目	2014年3月31日	2013年12月31日
货币资金	46,102,366.23	29,462,343.15
应收票据	31,315,536.20	130,286,664.04
流动资产	272,106,691.10	308,297,827.91
非流动资产	1,889,761,741.21	1,923,785,391.96
资产总计	2,161,868,432.31	2,232,083,219.87
流动负债	469,400,171.72	459,569,429.14
非流动负债	1,739,759,315.91	1,735,090,979.16
负债合计	2,209,159,487.63	2,194,660,408.30
归属于母公司股东权益合计	-44,198,595.72	40,495,357.13
少数股东权益	-3,092,459.60	-3,072,545.56
股东权益合计	-47,291,055.32	37,422,811.57

(2)利润表(合并报表)

单位:元

项目	2014年1-3月	2013年度
一、营业总收入	125,097,963.13	797,539,698.41
其中:营业收入	125,097,963.13	797,539,698.41
二、营业总成本	195,758,357.35	927,396,121.65
其中:营业成本	123,613,219.89	655,760,864.73
营业税金及附加	59,801.56	4,862,434.64
销售费用	5,320,482.23	32,826,001.27
管理费用	36,866,210.91	126,911,512.15
财务费用	26,370,969.10	98,602,783.50
资产减值损失	3,527,673.66	8,432,525.36
投资收益(损失以"-"号填列)	-	2,339,617.16
三、营业利润(亏损以"-"号填列)	-70,660,394.22	-127,516,806.08
加:营业外收入	526,522.60	10,460,961.84
减:营业外支出	14,579,995.27	185,911.67
其中:非流动资产处置损失	-	21,668.98
四、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-84,713,866.89	-117,241,755.91
五、净利润(净亏损以"-"号填列)	-84,713,866.89	-117,241,755.91
归属于母公司股东的净利润	-84,693,952.85	-117,030,465.71
少数股东损益	-19,914.04	-211,290.20

3、交易涉及的资产评估情况

经具有政权从业资格的中和资产评估有限公司采用成本法评估[中和评报字(2014)第BJV1023号],截至2014年3月31日秦岭水泥拟出售资产涉及的总资产账面价值为216,945.95万元,评估价值为222,601.93万元,增值额为5,655.98万元,增值率为2.61%;总负债账面价值为220,585.29万元,总负债评估价值为219,813.84万元,减值额为771.45万元,减值率为0.35%;净资产账面价值为-3,639.34万元,评估值为2,788.09万元,增值6,427.43万元。

资产评估结果汇总表

金额单位:人民币万元

	项目	账面价值	评估价值	增减值	增值率
		A	B	C=B-A	D=C/A*100%
1	流动资产	30,297.22	28,151.13	-2,146.09	-7.08%
2	非流动资产	186,648.73	194,450.80	7,802.07	4.18%
3	其中:可供出售金融资产				
4	持有至到期投资				
5	长期股权投资	189.00	92.53	-96.47	-51.04%