（上接D14版）

49	财达证券有限责任公司	注册地址：河北省石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦23至26层 办公地址：河北省石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦23至26层 法定代表人：翟建强 联系人：陈丽君 联系电话：0311-66006219 客服电话：4006128888 公司网站：www.S10000.com
50	德邦证券有限责任公司	注册地址：上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼 办公地址：上海市浦东新区福山路500号城建国际中心26楼 法定代表人：姚文平 联系人：叶蕾 电话：021-68761616 传真：021-68767032 客服电话：4008888128 网址：www.tebon.com.cn
51	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 法定代表人：杜航 联系人：戴蓷 电话：0791-6768681 传真：0791-6770178 客服电话：400-8866-567 网址：http://www.avicsec.com/
52	国元证券股份有限公司	注册地址：安徽省合肥市寿春路179号 办公地址：合肥市花园街花园宾馆14楼 法定代表人：凤良志 联系电话：0551-2634400 客服电话：全国统一热线95578，4008888777，安徽省内热线96888 公司网站：www.gyzq.com.cn
53	国盛证券有限责任公司	注册地址：江西省南昌市永叔路15号 办公地址：江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦4楼 法定代表人：曾小普 联系人：徐美云 联系电话：0791-86285337 公司网站：www.gsstock.com
54	中国国际金融有限公司	注册地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层 办公地址：北京市建国门外甲6号SK大厦 法定代表人：李剑阁 联系人：王雪筠 联系电话：010-85679265 客服电话：(010)85679238(010)85679169 公司网站：www.cicc.com.cn
55	大同证券经纪有限责任公司	注册地址：山西省大同市大北街13号 办公地址：山西省太原市长治路111号山西世贸中心A座F12、F13 法定代表人：董祥 联系人：薛津 电话：0351-4130322 传真：0351-4192803 客服电话：4007121212 网址：http://www.dstbc.com.cn
56	方正证券股份有限公司	注册地址：湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22—24层 办公地址：湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22—24层 法定代表人：雷杰 联系人：薛猛 联系电话：0731-85832343 客服电话：95571 公司网站：www.foundersc.com
57	财通证券有限责任公司	注册地址：杭大路15号嘉华国际商务中心 办公地址：杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心1602室 法定代表人：沈继宁 联系人：乔颖 联系电话：0571-87925129 客服电话：0571-96336（上海地区：962336） 公司网站：www.ctsec.com
58	东海证券有限责任公司	注册地址：江苏省常州市延陵西路59号常信大厦18楼 办公地址：江苏省常州市延陵西路59号常信大厦18楼 法定代表人：朱科敏 联系人：霍晓飞 客服电话：400-888-8588（全国），0519-88166222（常州），021-52574550（上海），0379-64922266（洛阳） 公司网站：www.longone.com.cn
59	西部证券股份有限公司	注册地址：陕西省西安市东新街232号陕西信托大厦16—17层 办公地址：陕西省西安市东新街232号陕西信托大厦1层 法定代表人：刘建武 联系人：冯萍 电话：029-87406488 传真：029-87424426 客服电话：95582 网址：http://www.westsecu.com/
60	新时代证券有限责任公司	注册地址：北京市西城区月坛北街2号月坛大厦15层 办公地址：北京市西城区金融街1号A座8层 法定代表人：马金声 联系人：孙恺 联系电话：010-83561149 公司网站：www.xsdzq.cn
61	瑞银证券有限责任公司	注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层 办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层 法定代表人：刘弘 联系人：牟冲 联系电话：010-5832 8112 客服电话：400-887-8827 公司网站：www.ubsecurities.com
62	金元证券股份有限公司	注册地址：海口市南宝路36号证券大厦4楼 办公地址：深圳市深南大道4001号时代金融中心17层 法定代表人：陆涛 联系人：金春 联系电话：0755-83025695 客服电话：4008-888-228 公司网站：www.jyzq.com.cn
63	万联证券有限责任公司	注册地址：广州市中山二路18号电信广场36、37层 办公地址：广州市中山二路18号电信广场36、37层 法定代表人：张建军 联系人：罗剑斌 联系电话：020-37865070 客服电话：400-8888-133 公司网站：www.wlzq.com.cn
64	国金证券股份有限公司	注册地址：成都市东城根上街95号 办公地址：成都市东城根上街95号 法定代表人：冉云 联系人：金晶 电话：028-86690126 传真：028-86690126 客服电话：4006600109 网址：www.gjzq.com.cn
65	财富证券有限责任公司	注册地址：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼 办公地址：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼 法定代表人：周晖 联系人：郭磊 客服电话：0731-4403360 公司网站：www.cfzq.com
66	恒泰证券股份有限公司	注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号 办公地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号 法定代表人：庞介民 联系人：荣阿东 联系电话：0471-4979037 网址：www.cnht.com.cn
67	华龙证券有限责任公司	注册地址：兰州市城关区静宁路308号 办公地址：兰州市城关区东岗西路638号财富大厦4楼 法定代表人：李晓安 联系人：李楠 电话：0931-8784502 传真：0931-4890628 客服电话：4006-89-8888 网址：www.hlzqgs.com
68	华鑫证券有限责任公司	注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元 办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元 法定代表人：王文学 联系人：黄旭成 电话：0755-82083788 传真：0755-82083408 客服电话：021-32109999，029-68918888 网址：www.cfsc.com.cn
69	日信证券有限责任公司	注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区锡林南路18号 办公地址：北京市西城区阜市口大街1号长安兴融中心西座11层 法定代表人：孔伯杰 联系人：苏江 联系电话：010-88086830 公司网站：www.rxzq.com.cn
70	英大证券有限责任公司	注册地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层 办公地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层 法定代表人：赵文安 联系人：刘晓雲 联系电话：0755-83007190 客服电话：4008-698-698 公司网站：www.ydsc.com.cn
71	天相投资顾问有限公司	注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701 办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座4层 法定代表人：林义相 联系人：梁言灵 客服电话：010-66045678 传真：010-66045500 公司网址：http://www.txsec.com 公司基金网网址：https://jjjn.txsec.com
72	其他基金代销机构情况详见基金管理人发布的相关公告。	

（二）场内代销机构

场内代销机构是指具有基金代销业务资格、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位，具体名单详见发售公告。

（三）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人：金颖

电话：010-59378982

传真：010-59378907

联系人：程爽

（四）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

（五）会计师事务所

名称：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：陈燕

经办会计师：薛竞、陈燕

四、基金名称

南方中证50债券指数证券投资基金（LOF）

五、基金的类型

债券型证券投资基金

六、基金的投资目标

本基金采用被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，以实现对标的指数的有效跟踪。

七、基金的投资范围

本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证50债券指数的成份券及其备选成份券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。其中，中证50债券指数成份券及其备选成份券的投资比例不低于基金资产净值的90%，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%，其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

如法律法规或监管机构以后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、投资策略

本基金为被动式指数基金，采用最优复制法，主要以标的指数的成份券构成为基础，综合考虑跟踪效果、操作风险等因素构建组合，并根据本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性以及银行间和交易所债券交易特性及交易惯例等情况，进行取整和替代优化，以保证对标的指数的有效跟踪。

当预期成份券发生调整时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因市场流动性不足时，或因债券交易特性及交易惯例等因素影响跟踪标的指数效果时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将对投资组合管理进行适当变通和调整，构建替代组合。由于本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性、债券交易特性及交易惯例等因素的影响，本基金组合中个券权重和券种与标的指数成份券和券种间将存在差异。

在正常市场情况下，力争本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年跟踪误差不超过2%。如因指数编制规则或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

（一）资产配置策略

为实现紧密跟踪标的指数的投资目标，本基金将以不低于基金资产净值90%的资产投资于中证50债券指数成份券和备选成份券。本基金将采用最优复制法，主要以标的指数的成份券构成为基础，综合考虑跟踪效果、操作风险等因素构建组合，并根据本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性以及银行间和交易所债券交易特性及交易惯例等情况，进行取整和替代优化，以保证对标的指数的有效跟踪。

（二）债券投资策略

本基金通过最优复制法进行被动式指数化投资，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可采取适当方法，如“久期盯住”、“比例盯住”等优化策略对基金资产进行调整，降低交易成本，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。

1、债券投资组合的构建

本基金在建仓期内，将按照中证50债券指数各成份券构成，并综合考虑本基金资产规模、市场流动性和交易成本等因素对其逐步买入。当遇到成份券流动性不足、价格严重偏离合理估值、单只成份券交易量不符合市场交易惯例等其他市场因素及预期标的指数的成份券即将调整或其他影响指数复制的因素时，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，对个券权重和券种进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。

当基金规模过小时，根据债券市场成交惯例，基金可能只能购买部分成份券；当基金规模过大时，受到市场流动性和法规限制等影响，基金将从备选成份券中挑选替代债券或替代组合满足跟踪需求。

2、债券投资组合的调整

①定期调整

本基金所构建的指数化投资组合将定期根据所跟踪的中证50债券指数对其成份券的调整而进行相应调整。

②不定期调整

1）当成份券发行量变动，本基金将根据指数的新构成进行相应调整；

2）本基金处理日常申购赎回时，资金量可能无法按照标的指数构成交易相应成份券。本基金将综合考虑交易规模、交易惯例和成份券（或备选成份券）的流动性等因素，对债券投资组合进行动态调整；

3）若成份券遇到退市、流动性不足、法规限制或组合优化需要等情况，基金管理人将综合考虑跟踪误差最小化和投资者利益，决定部分持有现金或买入相关的替代性组合。

4）本基金将以一定仓位参与一二级市场套利交易、回购套利交易、个券套利交易和放大交易，以期减小基金运作的有关费用对指数跟踪的影响。

③替代组合构建方法

由于定期和不定期的调整需求，基金管理人可构建替代组合。构建替代组合的方法如下：

1）按照与被替代债券久期、信用评级相似和交易市场相同的原则，选择标的指数成份券和备选成份券作为备选库；

2）采用备选库中各债券过去较长一段时间的历史数据，分析其与被替代债券的相关性，选择正相关度较高的债券进一步考察；

3）考察备选券的流动性，综合流动性和相关度两个指标挑选替代券，并使得替代组合与被替代债券的跟踪误差最小化。

④债券投资组合的优化

为更好地跟踪指数走势，我们将采取适当方法对债券投资组合进行整体优化调整，如“久期盯住”、比例盯住”等。

1）久期盯住

“久期盯住”策略是指投资组合久期与标的指数久期一致为目标，即满足：

从而使得在收益率曲线平行移动的情况下，债券投资组合和标的指数走势一致。

2）比例盯住

比例盯住”主要是考虑到不同类型债券和不同期限债券收益率波动情况的不一致，表现为隐含税率、信用利差和期限利差的变动。考虑各类型债券权重，力争基金组合各类型债券权重与标的指数分布相匹配，减少类型错配的跟踪误差；考虑各个期限的债券权重，力争基金组合各个期限段权重与标的指数分布相匹配，减少期限利差变动造成的跟踪误差。

九、风险收益特征

本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的债券市场相似的风险收益特征。

十、基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准：中证50债券指数×95%+银行活期存款利率（税后）×5%

中证50债券指数从包括上海证券交易所市场、深圳证券交易所市场以及银行间市场挑选50只流动性强、规模大、质地好的债券组成样本，是国内首只跨市场成份类债券指数。如果今后法律法规发生变化，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的业绩基准的指数时，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。

十一、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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年5月30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。

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，投资者在做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2012年3月31日（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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	843,941,980.00	95.05
	其中：债券	843,941,980.00	95.05
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	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	10,218,897.97	1.15
6	其他资产	33,742,034.64	3.80
7	合计	887,902,912.61	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

4、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	336,142,000.00	45.45
2	央行票据	20,294,000.00	2.74
3	金融债券	254,323,000.00	34.39
	其中：政策性金融债	254,323,000.00	34.39
4	企业债券	20,381,980.00	2.76
5	企业短期融资券	101,080,000.00	13.67
6	中期票据	111,721,000.00	15.11
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	843,941,980.00	114.11

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	110014	11附息国债14	500,000	50,655,000.00	6.85
2	110015	11附息国债15	300,000	31,152,000.00	4.21
3	110019	11附息国债19	300,000	31,026,000.00	4.20
4	110017	11附息国债17	300,000	30,531,000.00	4.13
5	110410	11农发10	300,000	30,387,000.00	4.11

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。

8.2 本基金本报告期末未持有股票。

8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	14,705.88
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	17,462,515.47
5	应收申购款	16,264,813.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	33,742,034.64

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

本基金本报告期末未持有股票。

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。

南方中证50债券指数（LOF）A

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)
2011.5.17-2011.12.31	5.86%	0.11%	3.87%	0.12%	1.99%	-0.01%
2012.1.1-2012.3.31	0.47%	0.07%	0.40%	0.07%	0.07%	0.00%
自基金成立起至今	6.36%	0.10%	4.29%	0.11%	2.07%	-0.01%

南方中证50债券指数（LOF）C

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)
2011.5.17-2011.12.31	5.59%	0.11%	3.87%	0.12%	1.72%	-0.01%
2012.1.1-2012.3.31	0.37%	0.07%	0.40%	0.07%	-0.03%	0.00%
自基金成立起至今	5.98%	0.10%	4.29%	0.11%	1.69%	-0.01%

十三、基金费用概览

（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）从C类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；

④）（基金合同）生效后与基金相关的信息披露费用；

⑤）（基金合同）生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；

⑥）基金上市费及年费；

⑦）基金份额持有人大会费用；

⑧）基金的证券交易费用；

⑨）基金的指数使用费；

⑩）基金的银行汇划费用；

⑪）按照国家有关规定和（基金合同）约定，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，按实际支出额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0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H=E×0.5%÷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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，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，基金托管人复核后于次月前2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、公休假等，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0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H=E×0.1%÷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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，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，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

③）销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.35%。

本基金销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.35%年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

H=E×0.35%÷当年天数

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产一次性支付给基金管理人，经基金管理人代付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

销售服务费主要用于支付销售机构佣金、以及基金管理人的基金行销广告费、促销活动费、持有人服务费等。

销售服务费不包括基金募集期间的上述费用。

④）指数使用许可费

在通常情况下，指数许可使用基点费按前一日的基金资产净值的万分之一点五（1.5个基点）的年费率计提。

计算方法如下：

H=E×万分之一点五/当年天数

H为每日应付的指数许可使用基点费，E为前一日的基金资产净值

指数许可使用基点费每日计算，逐日累计，按季支付。许可使用基点费的收取下限为每季度人民币伍万元（5万元），基金设立当年，不足3个月的，按照3个月收费。

上述一、基金费用的种类中第3-10项费用，根据有关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。

3、不列入基金费用的项目

①）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；

②）基金管理人和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、信息披露费用等费用；

④）其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

4、费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售费率或基金销售服务费等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率（但根据法律法规的要求提高该等报酬费率标准的除外），须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在至少一种指定媒体上公告。

5、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、法规执行。

（二）与基金销售有关的费用

1、申购费用

本基金A类基金份额在申购时收取前端申购费用，C类基金份额不收取申购费用。本基金前端申购费率最高不高于0.8%，且随申购金额的增加而递减，如下表所示：

购买金额（M）	申购费率
M<100万	0.8%
100万≤M<500万	0.6%
500万≤M<1000万	0.4%
M≥1000万	每笔1,000元

申购费用由基金申购人承担，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、赎回费用

本基金A类基金份额场外赎回费率不高于0.1%，随申请份额持有时间增加而递减（其中1年为365天）。C类基金份额不收取赎回费（但基金管理人根据基金合同约定开始对持有期限少于30日的本类别基金份额收取赎回费除外）。具体如下表所示：

申请份额持有时间（N）	赎回费率
N<1年	0.1%
1年≤N<2年	0.05%
N≥2年	0

A类基金份额场内赎回费率为0.1%。

本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取，扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产，赎回费归入基金财产的比例不得低于法律法规或中国证监会规定的比例下限。

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、对于持续持有期少于30日的C类基金份额投资人，基金管理人可收取赎回金额0.5%的赎回费。赎回费总额的25%应归入基金财产，基金管理人最迟于实施日前30日在至少一家指定媒体公告。

5、基金管理人可以在不违背法律法规规定及（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者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相关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。

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“基本情况”、“主要人员情况”、“基金托管业务经营情况”、“基金托管人的内部控制制度”进行了更新。

3、在“相关服务机构”部分，对代销机构和注册登记机构进行了更新。

4、在“基金的投资”部分，补充了本基金最近一期投资组合报告的内容。

5、在“基金的业绩”部分，补充了本基金最近一期的业绩报告。

6、对“基金份额持有人服务”进行了更新。

7、对“其他应披露事项”进行了更新。

8、对部分表述进行了更新。

南方基金管理有限公司

二〇一二年六月二十六日

证券代码：600227　　证券简称：赤天化　　编号：临2012-21

贵州赤天化股份有限公司二〇一二年第一次临时股东大会决议公告

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。

重要内容提示：

1、本次会议未通过《关于公司转让所持贵州天福化工有限责任公司51%股份的议案》；

2、本次会议无新提案提交表决。

一、会议召开和出席情况

贵州赤天化股份有限公司（以下简称"公司"）于2012年6月25日上午8:30在赤水市公司一楼会议室召开了2012年第一次临时股东大会。本次股东大会采取现场记名投票与网络投票相结合的方式进行，现场会议于2012年6月25日上午8:30在公司一楼会议室召开，网络投票表决时间为2012年6月25日上午9:30-11:30，下午13:00-15:00。

参加本次会议的股东及股东代表共计139人，代表有表决权的股份总数为279,771,663股，占公司2012年6月15日股权登记日总股本(950,392,526股)的29.44%，其中，出席现场会议并投票的社会公众股股东及授权代表人数14人，代表股份272,348,346股，占公司股权登记日总股本的28.66%；参加网络投票的社会公众股股东人数125人，代表股份7,423,317股，占公司股权登记日总股本的0.78%，符合《公司法》和公司《章程》等有关规定，会议合法有效。公司部分董事、监事及高级管理人员和见证律师参加了会议，会议由公司董事会召集，董事长郑才友先生主持会议。

二、提案审议情况

本次股东大会以现场记名投票和网络投票相结合的方式，审议通过了以下决议：

1、审议未通过《关于公司转让所持贵州天福化工有限责任公司51%股份的议案》；

表决结果：1,898,372股赞成，占参加会议股东有效表决权股份总数（关联股东回避）的24.55%；4,250,681股反对，占参加会议股东有效表决权股份总数（关联股东回避）的54.97%；1,583,400股弃权，占参加会议股东有效表决权股份总数（关联股东回避）的20.48%。

2、审议通过了《关于公司符合配股条件的议案》。

表决结果：272,778,625股赞成，占参加会议股东有效表决权股份总数的97.50%；4,578,893股反对，占参加会议股东有效表决权股份总数的1.64%；2,414,145股弃权，占参加会议股东有效表决权股份总数的0.86%。

3、审议通过了《关于公司配股方案的议案》。

各子议案表决结果如下：

①）发行股票的种类和面值

表决结果：272,735,625股赞成，占参加会议股东有效表决权股份总数的97.49%；5,262,789股反对，占参加会议股东有效表决权股份总数的1.88%；1,773,249股弃权，占参加会议股东有效表决权股份总数的0.63%。

②）配股基数、比例和数量

表决结果：272,735,625股赞成，占参加会议股东有效表决权股份总数的97.49%；5,260,389股反对，占参加会议股东有效表决权股份总数的1.88%；1,775,649股弃权，占参加会议股东有效表决权股份总数的0.63%。

③）配股价格和定价原则

表决结果：272,735,625股赞成，占参加会议股东有效表决权股份总数的97.49%；5,232,789股反对，占参加会议股东有效表决权股份总数的1.87%；1,803,249股弃权，占参加会议股东有效表决权股份总数的0.64%。

④）配售对象

表决结果：272,735,625股赞成，占参加会议股东有效表决权股份总数的97.49%；5,232,789股反对，占参加会议股东有效表决权股份总数的1.87%；1,803,249股弃权，占参加会议股东有效表决权股份总数的0.64%。

⑤）本次配股募集资金的用途

表决结果：272,735,625股赞成，占参加会议股东有效表决权股份总数的97.49%；5,232,789股反对，占参加会议股东有效表决权股份总数的1.87%；1,803,249股弃权，占参加会议股东有效表决权股份总数的0.64%。

⑥）发行方式

表决结果：272,735,625股赞成，占参加会议股东有效表决权股份总数的97.49%；5,232,789股反对，占参加会议股东有效表决权股份总数的1.87%；1,803,249股弃权，占参加会议股东有效表决权股份总数的0.64%。

⑦）发行时间

表决结果：272,735,625股赞成，占参加会议股东有效表决权股份总数的97.49%；5,232,789股反对，占参加会议股东有效表决权股份总数的1.87%；1,803,249股弃权，占参加会议股东有效表决权股份总数的0.64%。

⑧）承销方式

表决结果：272,735,625股赞成，占参加会议股东有效表决权股份总数的97.49%；5,232,789股反对，占参加会议股东有效表决权股份总数的1.87%；1,803,249股弃权，占参加会议股东有效表决权股份总数的0.64%。

⑨）本次配股前滚存未分配利润的分配方案

表决结果：272,735,625股赞成，占参加会议股东有效表决权股份总数的97.49%；5,232,789股反对，占参加会议股东有效表决权股份总数的1.87%；1,803,249股弃权，占参加会议股东有效表决权股份总数的0.64%。

⑩）决议的有效期

表决结果：272,735,625股赞成，占参加会议股东有效表决权股份总数的97.49%；5,232,789股反对，占参加会议股东有效表决权股份总数的1.87%；1,803,249股弃权，占参加会议股东有效表决权股份总数的0.64%。

4、审议通过了《关于公司配股募集资金运用可行性分析报告的议案》。

表决结果：272,782,746股赞成，占参加会议股东有效表决权股份总数的97.50%；3,476,507股反对，占参加会议股东有效表决权股份总数的1.24%；3,512,410股弃权，占参加会议股东有效表决权股份总数的1.26%。

5、审议通过了《关于提请股东大会授权董事会全权办理本次配股相关具体事宜的议案》。

表决结果：272,785,146股赞成，占参加会议股东有效表决权股份总数的97.50%；3,469,907股反对，占参加会议股东有效表决权股份总数的1.24%；3,516,610股弃权，占参加会议股东有效表决权股份总数的1.26%。

6、审议通过了《关于前次募集资金使用情况报告的议案》。

表决结果：272,841,185股赞成，占参加会议股东有效表决权股份总数的97.52%；3,373,307股反对，占参加会议股东有效表决权股份总数的1.21%；3,557,171股弃权，占参加会议股东有效表决权股份总数的1.27%。

7、审议通过了《关于修改公司<章程>的议案》。

表决结果：272,950,303股赞成，占参加会议股东有效表决权股份总数的97.56%；2,551,209股反对，占参加会议股东有效表决权股份总数的0.91%；4,270,151股弃权，占参加会议股东有效表决权股份总数的1.53%。

三、律师见证情况

公司聘请的北京市万商天勤律师事务所李大鹏律师和罗超律师对公司本次临时股东大会进行见证，律师见证意见如下：公司本次股东大会的召集、召开程序符合法律、法规和公司章程的有关规定；出席会议人员的资格合法、有效；表决程序和表决结果符合法律、法规和公司章程的规定；本次股东大会通过的有关决议合法有效。

四、备查文件目录

1、贵州赤天化股份有限公司2012年第一次临时股东大会会议决议；

2、北京市万商天勤律师事务所出具的《法律意见书》。

特此公告。

贵州赤天化股份有限公司董事会

二〇一二年六月二十六日

北京市万商天勤律师事务所关于贵州赤天化股份有限公司2012年第一次临时股东大会的法律意见书

致：贵州赤天化股份有限公司

根据《中华人民共和国证券法》（下称《证券法》）、《中华人民共和国公司法》（下称《公司法》）和中国证券监督管理委员会（下称"中国证监会"）《上市公司股东大会规则》（下称"《规则》"）等法律、法规和规范性文件的要求，北京市万商天勤律师事务所（下称"本所"）接受贵州赤天化股份有限公司（下称"公司"）委托，指派李大鹏律师、罗超律师出席公司2012年第一次临时股东大会（下称"本次股东大会"），并出具本法律意见书。

为出具本法律意见书，本所律师对公司本次股东大会所涉及的有关事项进行了核查，查阅了本所律师认为出具本法律意见书所必须查阅的文件，并对有关问题进行了必要的核查和验证。在本法律意见书中，本所律师根据《规则》的要求，仅对公司本次股东大会的召集、召开程序、出席人员的资格、新议案的提出、股东大会表决程序和表决结果的合法性发表意见，而不对本次股东大会所审议的议案内容和该等议案中所表述的事实或数据的真实性和准确性发表意见。本所律师依法对本法律意见书承担相应的责任。

本所律师根据《证券法》第二十条和《规则》第五条的要求，按照律师行业公认的业务标准、道德规范和勤勉尽责精神，对公司提供的有关文件和有关事项进行了核查和验证，出席了公司本次股东大会。现出具法律意见如下：

一、关于本次股东大会召集、召开的程序

1、经本所律师核查，2012年6月5日召开的公司第五届五次临时董事会会议决定召开本次股东大会；2012年6月7日，公司董事会在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和上海证券交易所网站（www.sse.com.cn）上刊登了关于召开