

南方积极配置证券投资基金

招募说明书（更新）

基金管理人：南方基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

截止日：2007 年 4 月 14 日

重要提示

南方积极配置证券投资基金(以下简称“南方积极配置基金”或“本基金”)经中国证券监督管理委员会 2004 年 6 月 11 日证监基金字[2004]84 号文批准发起设立,本基金的基金合同于 2004 年 10 月 14 日正式生效。

南方基金管理有限公司(“本基金管理人”或“基金管理人”或“管理人”)保证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核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

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财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

本基金的基金合同已经根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》及其它有关规定作了修订并已于中国证监会指定报刊或网站进行了公告。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2007 年 4 月 14 日,有关财务数据和净值表现截止日为 2007 年 3 月 31 日(未经审计)。

删除的内容: 6

删除的内容: 10

删除的内容: 4

删除的内容:

目录

一、绪言.....	3
二、释义.....	3
三、基金管理人.....	6
四、基金托管人.....	12
五、相关服务机构.....	15
六、基金份额的申购和赎回.....	28
七、基金份额的上市交易.....	32
八、基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转登记.....	33
九、基金份额的非交易过户和基金间转换.....	34
十、基金的投资.....	34
十一、基金的业绩.....	39
十二、基金的融资.....	40
十三、基金资产.....	40
十四、基金资产估值.....	41
十五、基金的收益与分配.....	42
十六、基金的费用与税收.....	43
十七、基金的会计与审计.....	44
十八、基金的信息披露.....	45
十九、风险揭示.....	47
二十、基金合同的变更、终止和基金财产的清算.....	49
二十一、基金合同的内容摘要.....	50
二十二、基金托管协议的内容摘要.....	61
二十三、基金份额持有人服务.....	67
二十四、其它应披露事项.....	68
二十五、招募说明书存放及其查阅方式.....	69
二十六、备查文件.....	69

一、绪言

本招募说明书依据 2003 年 10 月 28 日第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过并于 2004 年 6 月 1 日起施行的《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、2004 年 6 月 29 日中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)发布并于 2004 年 7 月 1 日起施行的《证券投资基金运作管理办法》(以下简称《运作办法》)和《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)、2004 年 6 月 11 日中国证监会发布并于 2004 年 7 月 1 日起施行的《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称《信息披露办法》)、2004 年 8 月 17 日深圳证券交易所发布并于 2004 年 8 月 17 日施行的《深圳证券交易所上市开放式基金业务规则》(以下简称《业务规则》)以及《南方积极配置基金基金合同》编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息,或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写,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》、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。

二、释义

在本招募说明书中除非文义另有所指,下列词语具有以下含义:

- | | |
|---------------|--|
| 基金或本基金: | 指南方积极配置证券投资基金或南方积极配置基金 |
| 基金合同或本基金合同: | 指《南方积极配置基金基金合同》及对本基金合同的任何修订和补充 |
| 招募说明书或本招募说明书: | 指《南方积极配置基金招募说明书》 |
| 发售公告或本发售公告: | 指《南方积极配置基金基金份额发售公告》 |
| 《基金法》 | 指 2003 年 10 月 28 日第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过并于 2004 年 6 月 1 日起施行的《中华人民共和国证券投资基金法》 |
| 《运作办法》 | 指 2004 年 6 月 29 日中国证监会发布并于 2004 年 7 月 1 日起施行的《证券投资基金运作管理办法》 |

《销售办法》	指 2004 年 6 月 29 日中国证监会发布并于 2004 年 7 月 1 日起施行的《证券投资基金销售管理办法》
《信息披露办法》	指 2004 年 6 月 11 日中国证监会发布并于 2004 年 7 月 1 日起施行的《证券投资基金信息披露管理办法》
《业务规则》	指 2004 年 8 月 17 日深圳证券交易所发布并于 2004 年 8 月 17 日起施行的《深圳证券交易所上市开放式基金业务规则》
中国证监会：	指中国证券监督管理委员会
银行业监管机构：	指中国银行业监督管理委员会、中国人民银行或其他经国务院授权的机构
基金合同当事人：	指受基金合同约束，根据基金合同享受权利并承担义务的基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
基金管理人：	指南方基金管理有限公司
基金托管人：	指中国工商银行股份有限公司（以下简称“中国工商银行”）
销售场所	指场外销售场所和场内交易场所，分别简称场外和场内
场外	指通过深圳证券交易所外的销售机构进行基金份额认购、申购和赎回的场所
场内	指通过深圳证券交易所内的会员单位进行基金份额认购、上市交易的场所
销售机构：	指基金管理人和基金销售代理人
基金销售代理人：	指依据有关销售代理协议办理基金销售的代理机构
会员单位：	指具有开放式基金代销资格的深圳证券交易所会员单位
注册登记人：	指中国证券登记结算有限公司
注册登记系统：	指中国证券登记结算有限公司开放式基金登记结算系统
证券登记结算系统：	指中国证券登记结算有限公司深圳分公司证券登记结算系统
个人投资者：	指依据中华人民共和国有关法律法规及其他有关规定可以投资于证券投资基金的自然人投资者
机构投资者：	指依据中华人民共和国有关法律法规及其他有关规定可以投资于证券投资基金的法人、社会团体或其他组织
基金募集期：	指自基金份额发售之日起不超过 3 个月
基金合同生效日：	指基金募集期结束并达到成立条件后向中国证监会办理基金合同备案手续并收到其书面确认之日
基金存续期：	指基金合同生效至基金合同终止，基金存续的不定期之期限
工作日：	指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日
T 日：	指认购、申购、赎回或其他交易的申请日
T+n 日：	指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）

日/天：	指公历日
月：	指公历月
发售：	指场外认购和场内认购
场外认购：	指基金募集期内投资者通过场外销售机构申请购买本基金份额的行为
场内认购：	指基金募集期内投资者通过场内会员单位申请购买本基金份额的行为
日常交易：	指申购、赎回和上市交易
申购：	指基金存续期间投资者通过场外销售机构向基金管理人提出申请购买本基金份额的行为
赎回：	指基金存续期间持有本基金份额的投资者通过场外销售机构向基金管理人提出申请卖出本基金份额的行为
上市交易：	指基金存续期间投资者通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为
系统内转托管：	指持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为
跨系统转登记：	指持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统间进行转登记的行为
开放式基金账户：	指注册登记人给投资者开立的用于记录投资者持有基金份额的账户，记录在该账户下的基金份额登记在注册登记人的注册登记系统
证券账户：	指注册登记人给投资者开立的用于记录投资者持有证券的账户，包括人民币普通股票账户和证券投资基金账户，记录在该账户下的基金份额登记在注册登记人的证券登记结算系统
基金信息披露义务人：	指基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律、行政法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织
指定报刊：	指中国证监会指定的全国性报刊，包括《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》等
网站：	指基金管理人、基金托管人的互联网网站(www.nffund.com ; www.icbc.com.cn)

三、基金管理人

(一) 基金管理人概况

名称：南方基金管理有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心区深南大道 4009 号投资大厦七楼

成立时间：1998 年 3 月 6 日

法定代表人：吴万善

注册资本：1.5 亿元人民币

电话：(0755) 82912000

传真：(0755) 82912948

联系人：鲍文革

基金管理人南方基金管理有限公司是经中国证监会证监基金字[1998]4 号文批准，由南方证券股份有限公司、厦门国际信托投资公司、广西信托投资公司共同发起设立。2000 年，经中国证监会证监基金字[2000]78 号文批准进行了增资扩股，注册资本达到 1 亿元人民币。2005 年，经中国证监会证监基金字[2005]201 号文批准进行增资扩股，注册资本达 1.5 亿元人民币。目前股权结构：华泰证券有限责任公司 45%、深圳市机场（集团）有限公司 30%、厦门国际信托投资有限公司 15%及兴业证券股份有限公司 10%。

(二) 主要人员情况

1、董事会成员

吴万善先生，董事长，中共党员，工商管理硕士，高级经济师。历任中国人民银行江苏省分行金融管理处科员、中国人民银行南京市分行江宁支行科员、华泰证券有限责任公司发行部副经理、总经理助理、副总经理、总裁，现任华泰证券有限责任公司董事长兼党委副书记、南方基金管理有限公司董事长。

杨进军先生，董事，中共党员，客座教授，历任中共中央党史研究室办公厅副主任、中共深圳市委宣传部助理巡视员、深圳市经济体制改革办公室主任、党组书记兼深圳社科联副主席、深圳市企业改革与发展办公室主任。现任深圳市机场（集团）有限公司党委书记、董事长，深圳市机场股份有限公司董事长。

周明先生，董事，中共党员，经济学学士，高级会计师。历任中国人民银行厦门市分行国外业务部副科长、厦门市财政局处长、厦门市国资局副局长、厦门国际信托投资公司总经理，现任厦门国际信托投资有限公司董事长。

兰荣先生，董事，中共党员，经济学硕士，经济师。历任福建兴业银行计划资金部副总经理、证券业务部副总经理、福建兴业证券公司总裁，现任兴业证券股份有限公司董事长兼总裁。

马昭明先生，董事，中共党员，硕士研究生，高级会计师。历任电子工业部第 898 厂会计科科长，华泰证券有限责任公司副总会计师，现任华泰证券有限责任公司副总裁。

汤大杰先生，董事，中共党员，经济师，博士研究生。历任深圳市计划局综合处主任科员、易方达基金管理有限公司投资管理部经理、深圳市机场股份有限公司投资发展部经理、深圳市机场（集团）有限公司投资经营部经理。现任深圳市机场（集团）有限公司副总经理。

张涛先生，董事，中共党员，博士，经济师。历任华泰证券有限责任公司投资银行业务总部业务经理、上海投资银行部副总经理，现任华泰证券有限责任公司副总裁、党委委员。

高良玉先生，董事，总经理，中共党员，经济学硕士，经济师。历任中国证监会发行部副处长、南方基金管理有限公司副总经理，现任南方基金管理有限公司董事总经理、党委书记。

高尚全先生，独立董事，教授，高级研究员，博士生导师。历任东北人民政府机械局干部、一机部农机局干部、国务院农机办副组长、国家机械委处长、国家体改委副主任，现任中国经济体制改革研究会会长。

孙树义先生，独立董事，中共党员，学士学位，高级工程师。历任第四机械工业部副处长、电子工业部生产司处长、国家经委体改局处长、国家体改委生产体制司司长、中央财经领导小组办公室副主任、国家人事部副部长、中央企业工委副书记，现任中国企业联合会、中国企业家协会执行副会长，第十届全国政协委员。

陈小悦先生，独立董事，中共党员，博士，教授，博士生导师。历任清华大学经济管理学院党委副书记、院长助理，现任北京国家会计学院院长兼清华大学会计研究所所长。

戴昌久先生，独立董事，中共党员，硕士研究生。历任财政部条法司科员、德恒律师事务所律师，现任北京昌久律师事务所主任。

2、监事会成员

骆新都女士，监事会主席，经济学硕士，经济师。历任民政部外事处处长、南方证券公司副总裁、南方基金管理有限公司董事长，现任南方基金管理有限公司监事会主席。

舒本娥女士，监事，学士学位，会计师。历任熊猫电子集团公司财务处处长、华泰证券公司计划资金部副总经理、稽查监察部总经理，现任华泰证券有限责任公司计划财务部总经理。

潘明华先生，监事，学士学位，高级会计师。历任铁道部大桥工程局桥梁机械厂会计、分公司财务经理、深圳机场（集团）公司财务部科长，现任深圳机场股份有限公司财务部经理。

苏荣坚先生，监事，学士学位，高级会计师。1982年9月参加工作，曾任职于三明市财政局、三明市财委、厦门信达股份有限公司财务部、厦门国际信托投资有限公司财务部副经理、自营业务部经理，现任厦门国际信托投资有限公司财务部经理。

庄园芳女士，监事，经济学硕士，经济师。历任福建兴业证券公司交易业务部总经理助理、证券投资部副总经理，现任兴业证券股份有限公司副总裁。

苏民先生，监事，工程师。南京东南大学计算机应用专业硕士，上海交通大学管理工程与科学专业在读博士研究生。1994年7月参加工作，历任安徽国投深圳证券营业部电脑工

程师、华夏证券深圳分公司电脑部经理助理，现任公司电子商务部总监。

3、总经理及其他高级管理人员

高良玉先生，董事，总经理，中共党员，经济学硕士，经济师。历任中国证监会发行部副处长、南方基金管理有限公司副总经理，现任南方基金管理有限公司董事总经理、党委书记。

许小松先生，副总经理，男，中共党员，经济学博士，历任南京农业大学讲师、深圳证券交易所综合研究所副所长。现任南方基金管理有限公司副总经理、党委委员。

邓召明先生，副总经理，男，中共党员，经济学博士，讲师，历任北京理工大学管理与经济学院讲师、机电部兵器工业总公司主任科员、中国证监会处长。现任南方基金管理有限公司副总经理、党委委员、纪委书记。

俞文宏先生，副总经理，男，中共党员，工商管理硕士，经济师，历任江苏省投资公司业务经理、江苏国际招商公司部门经理、江苏省国际信托投资公司投资银行部总经理、江苏国信高科技创业投资有限公司董事长兼总经理。现任南方基金管理有限公司副总经理、董事会秘书、党委副书记。

秦长奎先生，督察长，男，中共党员，MBA，历任华泰证券有限公司营业部总经理、部门总经理、总裁助理。现任南方基金管理有限公司督察长、党委委员、纪委委员。

4、基金经理

该基金历任基金经理及任职年限分别为：李明，2004年8月至2005年3月；陈健，2005年3月至2006年3月。

姜文涛，男，1973年生，中共党员，中国人民银行研究生部毕业，经济学硕士。1998年2月参加工作，曾任职国泰君安证券有限公司、博时基金管理有限公司、长盛基金管理有限公司。2004年5月起任职于南方基金管理有限公司，曾任天元证券投资基金经理助理，2005年3月至2006年3月任天元证券投资基金经理，2006年3月起至今担任本基金基金经理。

张志梅，女，1971年生，中共党员，中国人民银行研究生部毕业，硕士。1999年参加工作，曾任职南方证券有限公司研究所。2000年11月加入南方基金管理有限公司，先后任职于市场拓展部、研究部和投资部，曾任天元证券投资基金经理助理，现任南方积极配置基金经理助理。

5、投资决策委员会成员

总经理高良玉先生、副总经理许小松先生、投资部总监王宏远先生、固定收益部总监刘情剑先生。

（三）基金管理人的职责

1、依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

- 4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、编制中期和年度基金报告；
- 7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- 8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、召集基金份额持有人大会；
- 10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 12、有关法律、法规和中国证监会规定的其它职责。

(四) 基金管理人关于遵守法律法规的承诺

- 1、基金管理人承诺不从事违反《证券法》的行为，并承诺建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生；
- 2、基金管理人承诺不从事以下违反《基金法》的行为，并承诺建立健全的内部风险控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：
 - (1) 将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
 - (2) 不公平地对待管理的不同基金财产；
 - (3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
 - (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
 - (5) 依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。
- 3、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：
 - (1) 越权或违规经营；
 - (2) 违反基金合同或托管协议；
 - (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；
 - (4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
 - (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
 - (6) 玩忽职守、滥用职权；
 - (7) 泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
 - (8) 除按本公司制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其他股票投资；
 - (9) 协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；
 - (10) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
 - (11) 贬损同行，以提高自己；
 - (12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；

- (13) 以不正当手段谋求业务发展；
- (14) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (15) 其他法律、行政法规禁止的行为。

(五) 基金管理人关于禁止性行为的承诺

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- 1、承销证券；
- 2、向他人贷款或者提供担保；
- 3、从事承担无限责任的投资；
- 4、买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- 5、向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- 6、买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- 7、从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- 8、依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

(六) 基金经理承诺

- 1、依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；
- 2、不能利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；
- 3、不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- 4、不得以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

(七) 基金管理人的内部控制制度

1、内部控制制度概述

为了保证公司规范运作，有效地防范和化解管理风险、经营风险以及操作风险，确保基金财务和公司财务以及其他信息真实、准确、完整，从而最大程度地保护基金份额持有人的利益，本基金管理人建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制制度。

内部控制制度是指公司为实现内部控制目标而建立的一系列组织机制、管理方法、操作程序与控制措施的总称。内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等组成。

公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是对各项基本管理制度的总揽和指导，内部控制大纲明确了内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容。

基本管理制度包括内部会计控制制度、风险控制制度、投资管理制度、监察稽核制度、基金会计制度、信息披露制度、信息技术管理制度、资料档案管理制度、业绩评估考核制度和紧急应变制度等。

部门业务规章是在基本管理制度的基础上,对各部门的主要职责、岗位设置、岗位责任、操作守则等的具体说明。

2、内部控制原则

健全性原则。内部控制机制必须覆盖公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员,并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个运作环节。

有效性原则。通过科学的内控手段和方法,建立合理的内控程序,维护内控制度的有效执行。

独立性原则。公司各机构、部门、和岗位在职能上应当保持相对独立,公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。

相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互制衡,并通过切实可行的措施来实行。

成本效益原则。公司应充分发挥各机构、各部门及各级员工的工作积极性,运用科学化的方法尽量降低经营运作成本,提高经济效益,以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

3、主要内部控制制度

(1) 内部会计控制制度

公司依据《中华人民共和国会计法》、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《企业财务通则》等国家有关法律、法规制订了基金会计制度、公司财务会计制度、会计工作操作流程和会计岗位职责,并针对各个风险控制点建立严密的会计系统控制。

内部会计控制制度包括凭证制度、复核制度、账务处理程序、基金估值制度和程序、基金财务清算制度和程序、成本控制制度、财务收支审批制度和费用报销管理办法、财产登记保管和实物资产盘点制度、会计档案保管和财务交接制度等。

(2) 风险管理控制制度

风险控制制度由风险控制委员会组织各部门制定,风险控制制度由风险控制的目标和原则、风险控制的机构设置、风险控制的程序、风险类型的界定、风险控制的主要措施、风险控制的具体制度、风险控制制度的监督与评价等部分组成。

风险控制的具体制度主要包括投资风险管理制度、交易风险管理制度、财务风险控制制度以及岗位分离制度、防火墙制度、岗位职责、反馈制度、保密制度、员工行为准则等程序性风险管理制度。

(3) 监察稽核制度

公司设立督察长,负责监督检查基金和公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况。督察长由总经理提名,董事会聘任,并经全体独立董事同意。

督察长负责组织指导公司监察稽核工作。除应当回避的情况外,督察长享有充分的情权和独立的调查权。督察长根据履行职责的需要,有权参加或者列席公司董事会以及公司业务、投资决策、风险管理等相关会议,有权调阅公司相关文件、档案。督察长应当定期或者不定期向全体董事报送工作报告,并在董事会及董事会下设的相关专门委员会定期会议上

报告基金及公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况。

公司设立监察稽核部门,具体执行监察稽核工作。公司配备了充足合格的监察稽核人员,明确规定了监察稽核部门及内部各岗位的职责和 workflows。

检查公司各业务部门和人员遵守有关法律、法规和规章的情况;检查公司各业务部门和人员执行公司内部控制制度、各项管理制度和业务规章的情况。

四、基金托管人

(一) 基金托管人概况

名称:中国工商银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间:1984 年 1 月 1 日

法定代表人:姜建清

注册资本:人民币 334,018,850,026 元

联系电话:010-66106912

联系人:蒋松云

删除的内容:人民币
286,509,130,026 元

(二) 主要人员情况

截至 2007 年 3 月末,中国工商银行资产托管部共有员工 80 人,平均年龄 30 岁,90%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有硕士以上学位或高级职称。

删除的内容:中国工商银行资产托管部共有员工 77 人,平均年龄 30 岁,90%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有硕士以上学位或高级职称。

(三) 基金托管业务经营情况

作为中国首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国工商银行始终坚持“诚实信用、勤勉尽责”的原则,严格履行着资产托管人的责任和义务,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的业务管理模式、健全的托管业务系统、强大的市场营销能力,为广大基金份额持有人和众多资产管理机构提供安全、高效、专业的托管服务,取得了优异业绩。截至 2007 年 3 月,托管证券投资基金 77 只,其中封闭式 16 只,开放式 61 只。托管资产规模年均递增超过 70%。至今已形成包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社保基金、企业年金、产业基金、履约类产品、QFII 资产、QDII 资产等产品在内的托管业务体系。继先后获得《亚洲货币》和《全球托管人》评选的“2004 年度中国最佳托管银行”称号、《财资》和《全球托管人》评选的“2005 年度中国最佳托管银行”称号后,中国工商银行又分别摘取《环球金融》、《财资》杂志“2006 年度中国最佳托管银行”桂冠。

(四) 基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来,各项业务飞速发展,始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得,是与资产托管部“一手抓业务拓展,一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作,在积

极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。2005 年，中国工商银行资产托管部一次性通过了评估组织内部控制和安全措施是否充分的最权威的国际资格认证 SAS70（审计标准第 70 号），成为国内首个通过此认证的托管银行。

1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3、内部风险控制原则

（1）合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

（2）完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

（3）及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

（4）审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

（5）有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

（6）独立性原则。资产托管部托管的基金资产、托管人的自有资产、托管人托管的其他资产应当分离；直接操作人员和控制人员应相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

4、内部风险控制措施实施

（1）严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制

度和管理独立、网络独立。

(2) 高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者,要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况,以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展,并根据检查情况提出内部控制措施,督促职能管理部门改进。

(3) 人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制,建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线,健全绩效考核和激励机制,树立“以人为本”的内控文化,增强员工的责任心和荣誉感,培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书,使员工树立风险防范与控制理念。

(4) 经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务,从而有效地控制和配置组织资源,达到资源利用和效益最大化目的。

(5) 内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理,定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控,指导业务部门进行风险识别、评估,制定并实施风险控制措施,排查风险隐患。

(6) 数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

(7) 应急准备与响应。资产托管业务建立了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难应急方案,并组织员工定期演练。除了在数据服务端和应用服务端实时同步备份与数据更新外,资产托管部还建立了操作端的异地备份中心,能够确保交易的及时清算和交割,保证业务不中断。

5、资产托管部内部风险控制情况

(1) 资产托管部内部设置专职稽核监察部门,配备专职稽核监察人员,在总经理的直接领导下,依照有关法律规章,全面贯彻落实全程监控思想,确保资产托管业务健康、稳定地发展。

(2) 完善组织结构,实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与,只有这样,风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理,将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位,每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责,通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构,形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

(3) 建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设,一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力,资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度,包括:岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等,覆盖所有部门和岗位,渗透各项业务过程,形成各个业务环节之间的相互制约机制。

(4) 内部风险控制始终是托管部工作重点之一,保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务,资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作,一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展,新问题、新情况不断出现,资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置,视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

(五) 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

根据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规的规定,对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金申购资金的到账和赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规规定的行为,应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为,应立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正。

五、相关服务机构

(一) 基金份额发售机构

1、直销机构:南方基金管理有限公司

注册地址:广东省深圳市福田区中心区深南大道 4009 号投资大厦七楼

法定代表人:吴万善

电话:(0755) 82912936

传真:(0755) 82913232

联系人:汤艺娜

2、代销机构:

(1) 中国工商银行

注册地址:北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人:姜建清

电话:010-66107900

传真:010-66107914

联系人:田耕

(2) 交通银行

删除的内容:(1)南方基金管理有限公司

删除的内容:电话:(0755) 82912592

传真:(0755) 82913232

联系人:王世伟

删除的内容:(2)南方基金管理有限公司北京分公司

注册地址:北京西城区金融大街 19 号富凯大厦 17 层 B1702 室

法定代表人:吴万善

电话:(010) 66573399

传真:(010) 66573868

联系人:朱运东

(3)南方基金管理有限公司上海分公司

注册地址:上海市浦东南路 528 号上海证券大厦南塔 19 楼 1901 室

法定代表人:吴万善

电话:(021) 68817000 传真:

(021) 68817654

联系人:杨继东

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：蒋超良

电话：(021) 58781234

传真：(021) 58408842

联系人：王玮

网址：www.bankcomm.com

(3) 深圳发展银行

法定代表人：法兰克纽曼 (Frank N. Newman)

地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

邮政编码：518001

联系人：周勤

联系电话：0755-82088888

传真电话：0755-82080714

客户服务电话：95501

公司网址：www.sdb.com.cn

(4) 上海浦东发展银行

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：金运

电话：(021) 61618888

传真：(021) 63602431

联系人：徐伟、汤嘉惠

客户服务热线：95528

公司网站：www.spdb.com.cn

注：基金发售日的 9:30 至 16:00 (周六、周日不营业)

(5) 深圳市商业银行

注册地址：广东省深圳市深南中路 1099 号商业银行大厦

法定代表人：黄立哲

电话：25879127

传真：25878304

联系人：罗秀云

网站：www.18ebank.com

(6) 中国农业银行

住所：北京市复兴路甲 23 号

法定代表人：杨明生

客户服务电话：95599

删除的内容：注册地址：深圳市深南东路 5047 号
法定代表人：法兰克纽曼 (Frank N. Newman)
电话：(0755) 82088888
传真：(0755) 82080714
联系人：周勤、汪小苗、乔勇
客户服务电话：95501

删除的内容：注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号
法定代表人：金运
电话：021-33054678
传真：021-63602431
联系人：倪苏云、汤嘉惠

公司网址：www.abchina.com

(7) 招商银行

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：秦晓

电话：0755 - 83198888

传真：0755 - 83195109

联系人：兰奇

客服电话：95555

网址：www.cmbchina.com

(8) 广东发展银行

注册地址：广州农林下路 83 号

法定代表人：李若虹

电话：020-38323704、38322730、38323206

传真：020-87311780

联系人：江璐、罗环宇

(9) 中国邮政储蓄银行有限责任公司

注册地址：北京市西城区宣武门西大街 131 号

办公地址：北京市西城区宣武门西大街 131 号

法定代表人：陶礼明

客户服务电话：11185

联系人：陈春林

传真：010-66415194

网址：www.cpsrb.com

(10) 华泰证券有限责任公司

地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

电 话：(025)84457777-882、721

联系人：张小波

客户咨询电话：025-84579897

网址：www.htsc.com.cn

(11) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 99 号标力大厦

法定代表人：兰荣

电话：0591 - 7541476

客户服务热线：021-68419125

联系人：杨胜芳

删除的内容: 5

删除的内容: 注册地址：深圳
市福田区深南大道 7088 号招
商银行大厦
法定代表人：秦晓
电话：0755-83195487
传真：0755-83195049
联系人：朱小姐

删除的内容: 6

网址：www.xyq.com.cn

(12) 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

法定代表人：祝幼一

电话：021-62580818-177

传真：021-62583439

服务热线：4008888666 021-962588

联系人：芮敏祺

网址：www.gtja.com

(13) 广发证券股份有限公司

办公地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 36、38、41、42 楼

法定代表人：王志伟

电话：(020) 87555888

传真：(020) 87557985

联系人：肖中梅

网址：www.gf.com.cn

(14) 联合证券有限责任公司

办公地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 10、24、25 层

法定代表人：马国强

电话：0755-82493561

传真：0755-82492187

联系人：盛宗凌

网址：www.lhzq.com

(15) 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

法定代表人：肖时庆

联系电话：(010) 66568613、66568587

联系人：郭京华

公司网址：www.chinastock.com.cn

(16) 海通证券股份有限公司

地址：上海市淮海中路 98 号

法定代表人：王开国

电话：021 - 53594566 - 4125 传真：021-53858549

联系人：金芸

网址：www.htsec.com

(17) 国信证券有限责任公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层

法定代表人：胡继之

联系电话：0755-82130833-2181

传真：0755-82133302

联系人：林建闽

网址：www.guosen.com.cn

(18) 招商证券股份有限公司

地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 39-45 层

法定代表人：宫少林

电话：0755-82943511

传真：0755-82943237

联系人：童婕

客户服务热线：4008888111、0755-26951111

网址：www.newone.com.cn

(19) 东方证券股份有限公司

注册地址：上海浦东大道 720 号 20 楼

法定代表人：王益民

联系电话：021-68562200-3019

客服热线：021-962506

联系人：盛云

公司网址：www.dfzq.com.cn

(20) 光大证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东南路 528 号上海证券大厦南塔 15 楼

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 528 号上海证券大厦北塔 2004 楼

法定代表人：王明权

电话：(021)68768800

传真：(021)68817271

联系人：刘晨

(21) 东吴证券有限责任公司

注册地址：苏州市十梓街 298 号

法定代表人：吴永敏

联系电话：0512-65158588

客服热线：0512-96288

传真：0512-65158028

联系人：方晓丹

公司网址：www.dfzq.com.cn

(22) 长江证券有限责任公司

注册地址：武汉市新华下路特8号

法定代表人：明云成

联系电话：021-63291352

服务热线:02765799883

传真：021-33130730

联系人：毕艇

公司网址：www.cz318.com.cn

(23) 湘财证券有限责任公司

地址：长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼

法定代表人：陈学荣

电话：021-68634518

传真：021-68865938

联系人：陈伟

网址：www.xcsc.com

(24) 山西证券有限责任公司

注册地址：山西省太原市迎泽大街282号

法定代表人：吴晋安

联系电话：0351-8686766、0351-8686708

联系人：张治国

网址：www.i618.com.cn

(25) 中信证券股份有限公司

住所：深圳市湖贝路1030号海龙王大厦

办公地址：北京朝阳区新源南路6号京城大厦

法定代表人：王东明

联系电话：010-84864818-63266

联系人：陈忠

(26) 申银万国证券股份有限公司

注册地址：上海市常熟路171号

法定代表人：王明权

联系电话：(021) 54033888

联系人：曹晔

(27) 中信万通证券有限责任公司

注册地址：青岛市东海路 28 号

法定代表人：史洁民

联系电话：0532-5023457

联系人：丁韶燕

(28) 渤海证券有限责任公司

注册地址:天津市经济技术开发区第一大街 29 号

办公地址:天津市河西区宾水道 3 号

法定代表人: 张志军

电话: (022)28451883

传真: (022)28451616

联系人:徐焕强

(29)广州证券有限责任公司

办公地址：广州市先烈中路 69 号东山广场主楼五楼

法定代表人：吴张

电话：020-87320991

传真：020-87325036

联系人：曾洋

客户服务热线：020-87320991、020-87320595

(30)长城证券有限责任公司

注册地址：深圳福田区深南大道 6008 特区报业大厦 14 层

法定代表人：魏云鹏

电话：0755-83516094

联系人：高峰

客户服务热线：0755-82288968

(31)南京证券有限责任公司

注册地址：江苏省南京市大钟亭 8 号

法定代表人：张华东

电话：025-83364032

联系人：胥春阳

公司网址:www.njzq.com.cn

(32)华西证券有限责任公司

注册地址:四川省成都市陕西街 239 号

办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 18 楼(深圳总部)

法定代表人:张慎修

联系人:华永奎

电话:0755-83025430

客服电话:4008888818

公司网址:www.hx168.com.cn

(33)平安证券有限责任公司

办公地址:深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦三楼

法定代表人:叶黎成

联系人:余江

电话:0755-82450826,22622287

传真:0755-82433794

全国统一客户服务热线:95511

公司网址:www.pa18.com

(34)华安证券有限责任公司

办公地址:安徽省合肥市阜南路166号

法定代表人:汪永平

联系人:唐泳

电话:0551-5161666

公司网址:www.huaans.com.cn

(35)中原证券有限责任公司

注册地址:郑州市经三路15号广汇国贸大厦10楼

办公地址:郑州市经三路15号广汇国贸大厦10楼

法定代表人:张建刚

联系人:陈利民

电话:0371-5585610

网址:www.ccnew.com.cn

(36)国都证券有限责任公司

注册地址:深圳市福田区华强北路赛格广场45层

办公地址:北京市东城区安外大街2号安贞大厦3层

法定代表人:王少华

业务联系人:马泽承

联系电话:010-64482828-390

客户服务热线:800-810-8809

公司网站:http://www.guodu.com

(37)宏源证券股份有限公司

注册地址:新疆维吾尔自治区乌鲁木齐市建设路2号

办公地址:北京市海淀区西直门北大街甲43号金运大厦B座6层

联系人:魏海

电话:010-62267799

公司网站:www.ehongyuan.com.cn

(38)东莞证券有限责任公司

注册地址:广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼

办公地址:广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼

联系人:张建平

电话:0769-22119426

公司网址:www.dgzq.com.cn

(39)国元证券有限责任公司

注册地址:安徽省合肥市寿春路179号

联系人:李蔡

电话:0551-2634400-1112

客服电话:4008-888-777

公司网址:www.gyzq.com.cn

(40)第一创业证券有限责任公司

注册地址:深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25层

办公地址:

法定代表人:刘学民

联系人:王立洲

电话:0755-25832686

公司网址:www.firstcapital.com.cn

(41)民生证券有限责任公司

注册地址:北京市朝阳区门外大街16号中国人寿大厦1901室

法定代表人:岳献春

电话:010-85252626

联系人:杨甦华

客服电话:0371-7639999

公司网址:www.msyzq.com.cn

(42)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:江西省南昌市永叔路15号信达大厦10-13楼

法定代表人:管荣升

联系电话:0791-6289771

联系人:徐美云

公司网址:www.gsstock.com

(43) 金通证券有限责任公司

注册地址:浙江省杭州市凤起路 108 号

法定代表人:应士歌

联系人:龚晓军

公司网址:www.bigsun.com.cn

(44) 国联证券有限责任公司

注册地址:江苏省无锡市县前东街 8 号

法定代表人:范炎

联系人:袁丽萍

电话:0510-2831662

客服电话:0510-2588168

公司网址:www.glsc.com.cn

(45) 西南证券有限责任公司

注册地址:重庆市渝中区临江支路 2 号合景国际大厦 A 幢 22 楼

法定代表人:张引

联系人: 杨卓颖

联系电话: 023-63786777

公司网址: www.swsc.com.cn

(46) 东北证券有限责任公司

注册地址:长春市人民大街 138-1 号

法定代表人:李书

联系人: 高新宇

联系电话: 0431-5069710

公司网址: www.nesc.cn

(47)世纪证券有限责任公司

办公地址: 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 41 层

法人代表: 段强

联系人: 章磊

电话: 0755 - 83199511

公司网址:www.cscs.com.cn

(48)中信建投证券有限责任公司

法定代表人: 黎晓宏

注册地址: 北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

开放式基金咨询电话: 4008888108

公司网站：www.csc108.com

联系人：权唐

(49)金元证券有限责任公司

注册地址：海南省海口市南宝路 36 号证券大厦 4 层

电话：0755-83025695

传真：0755-83025625

联系人：金春

公司网址：www.jyzq.cn

(50)上海证券有限责任公司

注册地址：上海市九江路 111 号

法定代表人：蒋元真

联系电话：021-65076608*557

传真：021-65081069

联系人：刘永

网址：<http://www.962518.com>

(51)西部证券股份有限公司

地址：西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16 - 17 层

法定代表人：刘建武

电话：029-87406172

传真：029-87406387

客服热线：029—87406132

联系人：黄晓军

网址：www.westsecu.com.cn

(52)东海证券有限责任公司

地址：上海市浦东新区东方路 989 号中达广场 13 楼

法定代表人：顾森贤

电话：021-50586660

传真：021-50586660-8880

联系人：邵一明

网址：<http://www.longone.com.cn>

(53)德邦证券有限责任公司

办公地址：上海市浦东南路 588 号浦发大厦 26 楼

法定代表人：王军

电话：021-68590808-8125

联系人：罗芳

客服电话：021-68590808-8119

网址：www.tebon.com.cn

(54)信泰证券有限责任公司

办公地址：南京市长江路 88 号

法定代表人：钱凯法

电话：025-84784765

传真：025-84784830

联系人：舒萌菲

公司网址：www.thope.com

(55)国海证券有限责任公司

法定代表人：张雅锋

办公地址：中国广西南宁市滨湖路 46 号

联系人：覃清芳

咨询电话：(0771) 96100、0771-5539262

业务传真：(0771) 5539033

公司网站：http://www.ghzq.com.cn

(56)齐鲁证券有限责任公司

联系人：傅咏梅

电话：0531-82024184

公司网址：www.qlzq.com.cn

(57)新时代证券有限责任公司

注册地址：北京市海淀区成府路 298 号方正大厦二层

办公地址：北京市西城区麟阁路 95 号尚信大厦 6、7 层

法定代表人：李文义

联系人：戴荻

电话：010-66423531

公司网站：http://www.xsdzq.cn

(58) 江南证券有限责任公司

法定代表人：姚江涛

地址：江西省南昌市抚河北路 291 号

邮政编码：330008

联系人：余雅娜

联系电话：0791-6768763

传真电话：0791-6789414

客服电话：0791-6768763

公司网址: : <http://www.scstock.com/>

(59)大同证券经纪有限责任公司

法定代表人:董祥

联系人:苏妮

邮政编码:030001

联系电话:0351-4167056

传真"0351-4192803

网址:www.dtsbc.com.cn

(60) 其他具有开放式基金代销资格的证券公司请向当地营业网点查询

(二) 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:北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

法定代表人:陈耀先

电话:(0755) 58598832

传真:(0755) 58598907

联系人:刘玉生

(三) 律师事务所

名称:广东华瀚律师事务所

注册地址:深圳市振华路 402 栋中联大厦 511 室

负责人:李兆良

电话:(0755) 83205718 13602620622

传真:(0755) 83203576

经办律师:杨忠、戴瑞冬

(四) 会计师事务所

名称:德勤华永会计师事务所有限公司

注册地址:中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼

法人代表:郑树成

电话:(0755)8246 3255

传真:(0755)8246 3186

联系人:李渭华

经办注册会计师:李渭华、周冰

六、基金份额的申购和赎回

本基金的日常交易包括申购赎回和上市交易两种方式。本章是有关基金的申购和赎回，上市交易适用下一章《基金份额的上市交易》的相关规定。

（一）场外基金份额的申购与赎回

一）申购、赎回的场所

- 1、本公司直销网点；
- 2、经本公司委托，具有销售本基金资格的商业银行或其他机构的营业网点。

二）申购、赎回的开放日及开放时间

本基金合同生效后三个月内开始办理申购、赎回。

申购、赎回的开放日为证券交易所交易日，在开放日的具体业务办理时间由基金管理人及销售代理人约定。

在确定了基金开放日申购、赎回的时间后，由基金管理人最迟在开放前 3 个工作日在至少一种指定报刊和网站上刊登公告。

三）申购、赎回的原则

- 1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日的基金份额净值为基准进行计算。
- 2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请。
- 3、当日的申购、赎回申请可以在基金管理人规定的时间以前撤销。

四）申购、赎回的程序

- 1、申请方式：书面申请或管理人公布的其他方式。
- 2、确认与通知：当日（T 日）在规定时间之前提交的申请，投资者通常可在 T+2 日到网点查询申购、赎回的确认情况。
- 3、款项支付：基金份额持有人赎回本基金申请确认后，赎回款项将在 T+7 日内划往基金份额持有人账户。在发生延期赎回的情形时，款项的支付办法参照基金合同的有关条款处理。

五）申购和赎回的数额约定

- 1、本基金代销机构首次申购和追加申购的最低金额均为 1000 元。本基金代销机构首次申购和追加申购的最低金额按照基金管理人和代销机构约定的为准。本基金直销网点最低申购金额由基金管理人制定和调整；
- 2、赎回的最低份额为 1000 份基金份额，基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回；
- 3、基金管理人可根据市场情况，调整申购、赎回份额的数量限制，调整前的三个工作日基金管理人必须在至少一种指定报刊和网站上刊登公告；
- 4、申购份额及余额的处理方式：本基金的申购有效份额为按实际确认的申购金额在扣

除相应的费用后,以当日基金份额净值为基准计算并四舍五入保留小数点后两位,小数点两位以后的部分舍去,舍去部分所代表的资产归基金所有。

5、赎回金额的处理方式:本基金的赎回金额按实际确认的有效赎回份额以当日基金份额净值为基准按四舍五入的方法计算并扣除相应的费用。

六) 申购费率和赎回费率

1、本基金的申购费率不高于 1.5%,随申购金额的增加而递减,如下表所示:

申购金额 (M)	申购费率
M < 100 万	1.5%
100 万 ≤ M < 1000 万	1.2%
M ≥ 1000 万	0.6%

2、本基金的赎回费率为 0.5%,如本基金推出后端收费模式,则赎回费率将另行公告。;

3、本基金的申购费率、赎回费率最高不得超过法律法规规定的限额。在法律法规规定的限制内,基金管理人可决定实际执行的申购、赎回费率,并在《招募说明书》中进行公告。基金管理人认为需要调整费率时,应最迟于新的费率开始实施前 3 个工作日在至少一种指定报刊和网站公告。

七) 赎回费的归属

本基金赎回费的 25%归基金资产所有。

八) 申购份额、赎回金额的计算方式

本基金根据基金份额净值计算申购份额和赎回金额。

1、申购份额的计算方法如下:

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日基金份额净值}$$

例:某投资者投资 10 万元申购本基金,对应费率为 1.5%,假设申购当日基金份额净值为 1.0168 元,则其可得到的申购份额为:

$$\text{净申购金额} = 100,000 / (1 + 1.5\%) = 98,522.17 \text{ 元}$$

$$\text{前端申购费用} = 100,000 - 98,522.17 = 1,477.83 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 98,522.17 / 1.0168 = 96,894.35 \text{ 份}$$

2、赎回金额的计算方法如下:

$$\text{赎回费用} = \text{赎回当日基金份额净值} \times \text{赎回份额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{赎回金额} = \text{赎回当日基金份额净值} \times \text{赎回份额} - \text{赎回费用}$$

例:某投资者赎回本基金 10 万份基金份额,赎回费率为 0.5%,假设赎回当日基金份额净值为 1.0168 元,则其可得到的赎回金额为:

$$\text{赎回费用} = 100,000 \times 1.0168 \times 0.5\% = 508.40 \text{ 元}$$

删除的内容: 申购费用 = 申购金额 / (1 + 申购费率) × 申购费率
净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)
申购份额 = 净申购金额 / 申购当日基金份额净值
例:某投资者投资 10 万元申购南方积极配置基金,假设申购当日的基金份额净值为 1.0168 元,则其可得到的申购份额为:

[1]

赎回金额=100,000 × 1.0168 - 508.40 = 101,171.60元

删除的内容: 例：某投资者赎回 1 万份南方积极配置基金，假设赎回当日的基金份额净值为 1.0568 元，则其可得到的赎回金额为：

3、本基金每个工作日公告基金份额净值，当日基金份额净值在当天收市后计算，并在下一工作日公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

九) 申购、赎回的注册登记

投资者申购基金成功后，注册登记人在T+1 日自动为投资者登记权益并办理注册登记手续，投资者自T+2 日（含该日）后有权赎回该部分基金；投资者赎回基金成功后，注册登记人在T+1 日自动为投资者办理扣除权益的注册登记手续。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于实施日前 3 个工作日在至少一种指定报刊和网站上刊登公告。

十) 暂停申购与赎回的情形和处理方式

1、暂停或拒绝申购的处理

发生下列情况时，基金管理人可暂停或拒绝接受基金投资者的申购申请：

(1) 基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益；

(2) 基金场内交易停牌时；

(3) 不可抗力的原因导致基金无法正常运转；

(4) 证券交易所非正常停市；

(5) 有关法律、法规规定或中国证监会认定的其他暂停申购情形；

(6) 当基金管理人认为某笔申购申请会影响到其他基金份额持有人利益时，可拒绝该笔申购申请。

发生上述(1)到(5)项暂停申购情形时，基金管理人应当立即在指定报刊和网站上刊登暂停申购公告；

发生上述(6)项拒绝申购情形时，申购款项将全额退还投资者。

发生基金合同或招募说明书中未予载明的重大事项，但基金管理人认为有正当理由需要暂停基金申购，应当报中国证监会批准；经批准后，基金管理人应当立即在指定报刊和网站上刊登暂停申购公告。

2、暂停赎回的处理

本基金必须保持足够的现金或者政府债券，以备支付基金份额持有人的赎回款项。但是发生下列情况时，基金管理人可暂停接受基金投资者的赎回申请：

(1) 不可抗力的原因导致基金无法正常运转；

(2) 证券交易所非正常停市；

(3) 因市场剧烈波动或其他原因而出现连续巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；

(4) 基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人合法权益的基金转换行为；

(5) 基金场内交易停牌时;

(6) 有关法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时,基金管理人在当日向中国证监会报告,已接受的申请,基金管理人足额兑付;如暂时不能足额兑付,可兑付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人,未兑付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以兑付,并以基金份额净值为依据计算赎回金额。投资者在申请赎回时可选择将当日未获受理部分予以撤销。

发生基金合同或招募说明书中未予载明的重大事项,但基金管理人认为需要暂停基金赎回,应当报中国证监会批准;经批准后,基金管理人应当立即在指定报刊和网站上刊登暂停公告。

十一) 巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

指在单个开放日内,本基金净赎回申请份额(该基金赎回申请总份额扣除申购申请总份额之余额)与净转出申请份额(该基金转出申请总份额扣除转入申请总份额之余额)之和超过上一开放日基金总份额 10% 的情形。

2、巨额赎回的处理方式

(1) 全额赎回:当基金管理人认为有能力兑付投资者的赎回申请时,按正常赎回程序执行。

(2) 部分延期赎回:当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难或认为兑付投资者的赎回申请而进行的资产变现可能对基金的资产净值造成较大波动时,基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10% 的前提下,对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请,按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例,确定当日受理的赎回份额;未受理部分可延迟至下一个开放日办理。转入下一个开放日的赎回申请不享有优先权并以该开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额,以此类推,直到全部赎回为止。但投资者在申请赎回时可选择将当日未获受理部分予以撤销。

3、巨额赎回的公告:当发生巨额赎回并延期支付时,基金管理人应通过指定报刊和网站在 3 个证券交易所交易日内刊登公告,并说明有关处理方法。

本基金连续两个开放日以上发生巨额赎回,如基金管理人认为有必要,可暂停接受赎回申请;已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项,但不得超过正常支付时间 20 个工作日,并应当在指定报刊和网站上进行公告。

十二) 重新开放申购或赎回的公告

如果发生暂停的时间为一天,暂停结束后基金管理人应在至少一种指定报刊和网站上刊登基金重新开放申购或赎回公告并公布最近一个工作日本基金的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过一天但少于两周,暂停结束基金重新开放申购或赎回时,基金管理人应提前 1 个工作日在至少一种指定报刊和网站上刊登基金重新开放申购或赎回公告,

并在重新开放申购或赎回日公告最近一个工作日本基金的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过两周,暂停期间,基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次;当连续暂停时间超过两个月时,可将重复刊登暂停公告的频率调整为每月一次。暂停结束基金重新开放申购或赎回时,基金管理人应提前 3 个工作日在至少一种指定报刊和网站上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告并在重新开放申购或赎回日公告最近一个工作日本基金的基金份额净值。

(二) 场内基金份额的申购与赎回

场内基金份额的申购与赎回遵守《深圳证券交易所开放式基金申购赎回业务实施细则》、《开放式基金通过深圳证券交易所场内申购赎回登记结算业务实施细则》的规定及 2005 年 8 月 22 日披露在报刊及网站的《南方积极配置证券投资基金(LOF)开放场内申购、赎回的公告》。

七、基金份额的上市交易

本基金的日常交易包括上市交易和申购赎回两种方式。本章是有关基金的上市交易,申购赎回适用上一章《基金份额的申购赎回》的相关规定。

(一) 上市交易的地点

深圳证券交易所。

(二) 上市交易的时间

本基金合同生效后三个月内开始在深圳证券交易所上市交易。

在确定上市交易的时间后,基金管理人最迟在上市前 3 个工作日在至少一种指定报刊和网站上刊登公告。

(三) 上市交易的规则

- 1、本基金上市首日的开盘参考价为前一交易日基金份额净值;
- 2、本基金实行价格涨跌幅限制,涨跌幅比例为 10%,自上市首日起实行;
- 3、本基金买入申报数量为 100 份或其整数倍;
- 3、本基金申报价格最小变动单位为 0.001 元人民币;
- 4、本基金上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》及《业务规则》的相关规定。

(四) 上市交易的费用

本基金上市交易的费用比照封闭式基金的有关规定办理。

(五) 上市交易的行情揭示

本基金在深圳交易所挂牌交易,交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示基金前一交易日的基金份额净值。

(六) 上市交易的注册登记

投资者T日买入成功后,注册登记人在T日自动为投资者登记权益并办理注册登记手续,投资者自T+1 日(含该日)后有权卖出该部分基金;

投资者 T 日卖出成功后,注册登记人在 T 日自动为投资者办理扣除权益的注册登记手续。

(七) 上市交易的停复牌

本基金的停复牌按照《业务规则》的相关规定执行。

(八) 暂停上市的情形和处理方式

本基金上市后,发生下列情况之一时,应暂停上市交易:

- (1) 基金份额持有人数连续 20 个工作日低于 1000 人;
- (2) 基金总份额连续 20 个工作日低于 2 亿份;
- (3) 违反国家有关法律、法规,被中国证监会决定暂停上市;
- (4) 深圳证券交易所认为须暂停上市的其他情况。

发生上述暂停上市情形时,基金管理人在接到深圳证券交易所通知后,应立即在至少一种指定报刊和网站上刊登暂停上市公告。

(九) 恢复上市的公告

暂停上市情形消除后,基金管理人可向深圳证券交易所提出恢复上市申请,经深圳证券交易所核准后,可恢复本基金上市,并在至少一种指定报刊和网站上刊登恢复上市公告。

(十) 终止上市的情形和处理方式

发生下列情况之一时,本基金应终止上市交易:

- (1) 自暂停上市之日起半年内未能消除暂停上市原因的;
- (2) 基金合同终止;
- (3) 基金份额持有人大会决定终止上市;
- (4) 深圳证券交易所认为须终止上市的其他情况。

发生上述终止上市情形时,基金管理人在报经中国证监会批准后终止本基金的上市,并在至少一种指定报刊和网站上刊登终止上市公告。

八、基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转登记

(一) 基金份额的登记

1、本基金的份额采用分系统登记的原则。场外认购或申购买入的基金份额登记在注册登记系统持有人开放式基金账户下;场内认购、申购或上市交易买入的基金份额登记在证券登记结算系统持有人证券账户下。

2、登记在注册登记系统中的基金份额只能申请赎回,不能直接在深圳证券交易所卖出;登记在证券登记结算系统中的基金份额可以在深圳证券交易所卖出,也可以直接申请赎回。

(二) 系统内转托管

1、系统内转托管是指持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构(网点)之间或证券登记结算系统内不同会员单位(席位)之间进行转托管的行为。

2、份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理基金赎回业务的销售机构(网点)时,销售机构(网点)之间不能通存通兑的,可办理已持有基金份额的系统内转托管。

3、份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理上市交易的会员单位(席位)时,可办理已持有基金份额的系统内转托管。

(三) 跨系统转登记

1、跨系统转登记是指持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转登记的行为。

2、本基金跨系统转登记的具体业务按照中国证券登记结算有限公司的相关规定办理。

3、跨系统转登记限于在已注册的开放式基金账户和其证券账户之间进行。

4、基金份额的跨系统转登记需要两个交易日的交易时间,即持有人 T 日提交跨系统转登记申请,如处理成功,经过两个工作日(T+2 日)可申请赎回或卖出。

5、暂停跨系统转登记的情形

(1) 本基金合同生效日至开放申购赎回日期间。

(2) 本基金收益分配期间(R-2日至R日,R日为权益登记日)。

(3) 处于冻结状态的基金份额。

九、基金份额的非交易过户和基金间转换

基金注册登记机构只受理继承、捐赠、司法执行和经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。其中,“继承”指基金份额持有人死亡,其持有的基金份额由其合法的继承人继承;“捐赠”只受理基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体;“司法执行”是指司法机关依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。办理非交易过户必须提供相关资料。

本基金已开通基金转换业务,具体费率详见 2006 年 3 月 29 日本公司发布的《关于开通南方积极配置基金与南方高增长基金转换的公告》。

删除的内容:

十、基金的投资

(一) 投资目标

本基金为股票配置型基金,通过积极操作进行资产配置和行业配置,在时机选择的同时精选个股,力争在适度控制风险并保持良好流动性的前提下,为投资者寻求较高的投资收益。

(二) 业绩比较基准

本基金股票投资部分的业绩比较基准采用上证综指,债券投资部分的业绩比较基准采用上证国债指数。本基金定位在股票配置型基金,以股票投资为主,国债投资只是为了回避市场的系统风险,因此,本基金的整体业绩比较基准可以表述为如下公式:

$$\text{基金整体业绩基准} = \text{上证综指} \times 85\% + \text{上证国债指数} \times 15\%$$

(三) 投资范围和投资对象

本基金的投资范围为国内依法公开发行的各类股票、债券及中国证监会批准的其他投资品种。

其中,股票投资范围为所有在国内依法公开发行的、具有良好流动性的 A 股;债券投资范围包括国债、金融债、企业债、可转债、短期票据和回购等;剩余部分的现金资产将主要投资于各类银行存款。

在以上投资范围内,根据本基金的投资目标、投资理念和投资策略,本基金将从中选择出适合的投资对象,完成资产配置、行业配置和个股选择的过程。

其中,资产配置将在上述各大类投资品种之间进行,以决定股票和债券的投资比例,本基金大类资产投资的目标比例为:股票 85%,债券 10%,现金 5%,可能比例为:股票 40% - 95%,债券 0% - 50%,现金 5% - 10%;行业配置将以与国民经济增长具有高度关联性、贡献度大、成长性快、投资价值高的六个行业为主,这六个行业的投资比例不低于整个股票投资的 65%;在资产配置和行业配置的基础上,本基金进行个股的选择。

(四) 投资理念

本基金将股票型、配置型和积极操作型基金相结合,采用定量分析和定性分析相结合的方法,在秉承南方基金管理公司一贯的投资理念的基础上,按照以下理念进行投资:

积极投资原则:本基金认为中国证券市场是一个非完全有效市场。因此,通过积极投资,动态资产配置和行业配置,挖掘出投资价值被市场低估的股票或债券,可以获得超过市场平均水平的收益。

价值投资原则:通过对中国经济发展的结构变化和各行业发展周期的研究,通过对上市公司投资价值的定性和定量研究,进行价值投资。

研究为本原则:本基金坚信在中国证券市场,研究创造价值。通过对上市公司具有前瞻性的研究,挖掘上市公司内在投资价值,有助于规避上市公司的道德及信用风险。

(五) 投资策略

本基金秉承的是“积极配置”的投资策略。通过积极操作进行资产配置和行业配置,在此基础上选择个股,力争达到“在适度控制风险并保持良好流动性的前提下,为投资者寻求较高的投资收益”的投资目标。

在本基金中,配置分为一级配置、二级配置和三级配置,其中一级配置就是通常所说的资产配置,二级配置是指股票投资中的行业配置,三级配置也就是个股选择。

1、一级配置(资产配置)

一级配置是在大类资产的层面上进行配置,大类资产是指股票、债券、现金,配置的结

果是确定这三类资产在总资产中的比例。

我国证券市场取得了令人瞩目的成就,但仍处于初期的发展阶段,表现出在市场非完全有效的情况下较高的投资收益和较大的投资风险并存,系统风险高于非系统风险的特征。这表明通过积极操作获取超额收益的可能,也表明资产配置的重要性。

本基金的资产配置根据宏观经济情况、及未来较长一段时间内股票走势的判断决定。在调整资产配置比例时,本基金重点考虑以下三个方面:一是政策面的变化,二是宏观经济的发展情况,三是市场本身的规律。通过这三个方面对市场的上升或下降方向及程度做出预测,动态调整股票二级市场的投资仓位,最终达到资产配置的目标。

作为配置的结果,当预期股票市场出现时间较长、幅度较大的上升行情时,本基金股票投资比例可以达到或接近 95%。也就是说,在既定情况下,本基金可以作为一只全股票基金看待。一般情况下,在一级配置中,本基金所持有的少量国债仅是为了应对市场的系统性风险。

2、二级配置(行业配置)

二级配置是在大类资产内部进行二次配置,主要是指股票投资中的行业配置。

具体而言,在股票投资部分,本基金将选择出与国民经济增长具有高度关联性、贡献度大、成长性快、投资价值高的六个行业,对这些行业的股票进行重点投资;在债券投资部分,本基金将根据剩余期限结构,结合久期策略选择重点投资品种,在国债、金融债、企业债、可转债、短期票据及回购间进行选择投资;在现金方面,本基金将以基金流动性管理为原则,在保证满足赎回要求的情况,根据上述的一、二级配置进行比例调整。

我国经济高速增长的同时不同行业分享经济增长成果能力显现出一定的差异。这表明在考虑宏观面的整体经济周期的同时也需要关注行业的经济周期,通过对其中表现最好的行业进行重点投资,能更好地分享整体经济增长的成果。

本基金采用自上而下和自下而上相结合的研究方法,结合行业 PEG 定量研究,最终达到行业配置的目标。自上而下的研究方法是指通过对主要宏观经济数据的分析和预测,确定主要宏观经济变量的变动对不同行业的影响。自下而上的研究方法是指通过对外部环境、产业政策和竞争格局的分析预测,确定行业结构变化对各个行业的潜在影响。行业 PEG 研究方法是指通过定量分析行业市盈率和行业增长率之间的比率关系,确定行业的投资价值。

作为配置的结果,本基金所选择的六个行业的投资比例不低于整个股票投资的 65%。

3、三级配置(个股选择)

三级配置是在一、二级配置之后对个股的选择。

本基金按照价值投资理念,通过综合考虑上市公司的产品定位与市场空间、市场潜力与增长速度、竞争环境与行业结构、成本控制与利润水平、绝对估值与相对估值,确定行业中投资价值被市场低估的公司,最终完成个股选择的过程。

(六) 投资决策

1、决策依据

(1) 有关法律、法规和本基金合同的有关规定。依法决策是本基金进行投资的前提；

(2) 宏观经济发展态势、微观经济运行环境和证券市场走势。是本基金投资的基础。

(3) 投资对象收益和风险的配比关系。在充分权衡投资对象的收益和风险的前提下做出投资决策，是本基金维护投资者利益的重要保障。

2、决策程序

本基金管理人的投资决策程序如下：

(1) 决定主要投资原则：投资决策委员会决定基金的主要投资原则，并对基金投资组合的一二级配置比例等提出指导性意见。

(2) 提出投资建议：研究人员通过对中国经济发展的结构变化和各行业发展周期的研究，从众多行业中精选出与国民经济增长具有高度关联性、贡献度大、成长性快、投资价值高的六个行业的股票进行投资，根据对六个行业的上市公司进行研究，确定公司的投资价值，向基金经理做出投资建议；根据基金经理提出的要求进行研究并提出投资建议。

(3) 制定投资决策：基金经理在遵守投资决策委员会的投资原则前提下，根据证券分析师提供的投资建议以及自己的分析判断，做出具体的投资决策。

(4) 进行风险评估：风险控制委员会定期召开会议，对基金投资组合进行风险评估，并提出风险控制意见。

(5) 评估和调整决策程序：管理人有权根据环境的变化和实际的需要调整决策的程序。

3、投资限制

(1) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；

(2) 本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和，不得超过该证券的 10%；

(3) 本基金参与股票发行申购所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次的股票发售总量；

(4) 遵守中国证监会规定的其他比例限制；

(5) 法律法规和监管机关对上述比例限制另有规定的，从其规定。

由于基金规模或市场变化等原因导致投资组合不符合上述约定比例不在限制之内。

(七) 建仓期

本基金的建仓期一般情况下为两个月，将根据实际情况进行调整。

(八) 基金管理人代表基金行使股东权利的原则

- 1、独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；
- 2、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 3、有利于基金资产的安全和增值；
- 4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

(九) 基金的投资组合报告(未经审计)

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

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2007年4月16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,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告财务资料未经审计。

(一) 期末基金资产组合情况

项 目	金 额	占基金总资产的比例
股 票	5,212,403,183.40	88.69%
债 券	—	—
权证	—	—
银行存款及清算备付金合计	550,241,523.52	9.36%
其他资产	114,550,562.10	1.95%
合 计	5,877,195,269.02	100.00%

(二) 期末按行业分类的股票投资组合

行 业 分 类	市 值	占基金资产净值比例
A 农、林、牧、渔业	—	—
B 采掘业	96,775,909.75	1.67%
C 制造业	2,150,735,194.99	37.17%
C0 食品、饮料	410,909,912.48	7.10%
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	24,840,000.00	0.43%
C5 电子	—	—
C6 金属、非金属	739,092,687.67	12.77%
C7 机械、设备、仪表	746,011,574.02	12.89%
C8 医药、生物制品	229,881,020.82	3.97%
C99 其他制造业	—	—
D 电力、煤气及水的生产和供应业	195,419,504.01	3.38%
E 建筑业	—	—
F 交通运输、仓储业	207,389,184.03	3.58%
G 信息技术业	172,046,602.30	2.97%
H 批发和零售贸易	547,911,914.05	9.47%
I 金融、保险业	1,154,009,650.47	19.94%
J 房地产业	562,952,400.20	9.73%
K 社会服务业	29,710,400.00	0.51%
L 传播与文化产业	29,990,000.00	0.52%
M 综合类	65,462,423.60	1.13%
—	—	—

合计	5,212,403,183.40	90.08%
----	------------------	--------

(三) 期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

序 号	股票代码	股票名称	数 量	市 值	市值占净值比例
1	600036	招商银行	26,300,000	457,094,000.00	7.90%
2	000002	万 科A	27,000,000	447,930,000.00	7.74%
3	600030	中信证券	9,867,245	424,587,552.35	7.34%
4	000039	中集集团	10,897,846	267,106,205.46	4.62%
5	600519	贵州茅台	2,066,341	195,269,224.50	3.37%
6	600016	民生银行	15,000,000	186,600,000.00	3.22%
7	000063	中兴通讯	3,919,057	172,046,602.30	2.97%
8	000651	格力电器	6,764,493	114,387,576.63	1.98%
9	600631	百联股份	7,729,509	105,662,388.03	1.83%
10	601006	大秦铁路	7,999,983	102,799,781.55	1.78%

(四) 投资组合报告附注

- 1、本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。
- 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。
- 3、期末其他资产构成

项 目	金 额
交易保证金	3,030,640.07
应收利息	190,141.07
应收申购款	56,879,780.96
其他应收款	54,450,000.00
合 计	114,550,562.10

4、权证投资情况

本报告期内本基金无新增投资权证情况。

十一、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。

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)
2004.10.14-2004.12.31	-1.62%	0.22%	-4.23%	0.90%	2.61%	-0.68%
2005.1.1-2005.12.31	-3.29%	0.93%	-4.98%	1.17%	1.69%	-0.24%
2006.1.1-2006.12.31	122.84%	1.37%	104.55%	1.15%	18.29%	0.22%
2007.1.1-2007.3.31	8.44%	2.36%	16.24%	2.04%	-7.80%	0.32%
自基金成立起至今	129.90%	1.29%	116.37%	1.25%	13.53%	0.04%

十二、基金的融资

本基金可以按照国家的有关规定进行融资。

十三、基金资产

（一）基金资产总值

是指购买的各类证券价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

其构成主要有：

- 1、银行存款及其应计利息；
- 2、清算备付金及其应计利息；
- 3、根据有关规定缴纳的保证金；
- 4、应收证券交易清算款；
- 5、应收申购款；
- 6、股票投资及其估值调整；
- 7、债券投资及其估值调整和应计利息；
- 8、其他投资及其估值调整；
- 9、其他资产等。

（二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

其构成主要有：

- 1、基金份额持有人申购基金份额所支付的款项；
- 2、运用基金资产所获得收益（亏损）；
- 3、以前年度实现的尚未分配的收益或尚未弥补的亏损。

（三）基金资产的账户

本基金资产以基金托管人名义开立基金托管专户和证券交易资金账户，以基金托管人和基金联名的方式开立基金证券账户、以基金的名义开立银行间债券托管账户，并报中国证监会及人民银行备案。开立的基金专用账户，与基金管理人、基金托管人、基金销售代理人、注册登记人自有的资产账户以及其他基金资产账户相独立。

（四）基金资产的处分

基金资产应独立于基金管理人、基金托管人的固有资产。基金管理人、基金托管人不得将基金资产归入其固有资产。基金管理人、基金托管人因基金资产的管理、运用或者其他情

形而取得的资产和收益，归入基金资产。基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金资产不属于其清算资产。非因基金资产本身承担的债务，不得对基金资产强制执行。

十四、基金资产估值

（一）估值目的

基金资产的估值目的是客观、准确地反映基金资产的价值。

（二）估值日

基金资产估值日为相关的证券交易所的正常营业日，估值时点为上述证券交易所的收市时间。

（三）估值对象

运用基金资产所购买的一切有价值证券。

（四）估值方法

1、上市流通的有价值证券以估值日证券交易所挂牌的该证券收盘价估值，该日无交易的，以最近一个工作日收盘价计算；

2、未上市的属于配股或增发的股票以估值日证券交易所提供的同一股票的收盘价估值，该日无交易的，以最近一个工作日收盘价计算；

3、未上市的属于首次公开发行的股票、债券以其成本价计算；

4、配股权证，从配股除权日起到配股确认日止，按收盘价高于配股价的差额估值；如果收盘价等于或低于配股价，则估值增值额为零；

5、证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值；

6、证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值，估值日没有交易的，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；

7、在银行间同业市场交易的债券按购入成本加计持有期利息估值，利息单列，不计入成本；

8、有确凿证据表明按上述规定不能客观反映基金资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况，在与基金托管人商议后，按最能反映基金资产公允价值的方法估值。即使存在上述情况，基金管理人若采用上述 1—7 规定的方法为基金资产进行了估值，仍应被认为采用了适当的估值方法。

9、如有新增事项或变更事项，按国家最新规定估值。

（五）估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金管理人完成估值后，将估值结果和基金份额净值

以书面形式并加盖业务公章报给基金托管人,基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核,基金托管人复核无误后加盖业务公章返回给基金管理人。

(六) 暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;
- 2、因其他任何不可抗力致使基金管理人无法准确评估基金资产价值时。

(七) 估值错误的处理方式

本基金基金份额净值的计算采用四舍五入的方法保留小数点后四位,国家另有规定的从其规定。当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后四位以内发生差错时,视为基金份额净值估值错误。

基金管理人和基金托管人应采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性和及时性。当基金管理人确认已经发生估值错误情形时,基金管理人立即公告、予以纠正,并采取合理的措施防止损失进一步扩大。错误偏差达到基金资产净值的 0.5%时,基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案。

因发生差错造成基金份额持有人损失的,由基金管理人负责赔偿,赔偿原则如下:

- 1、赔偿仅限于因差错而导致的基金份额持有人的直接损失;
- 2、基金管理人代表基金保留要求返还不当得利的权利;
- 3、基金管理人仅负责赔偿在单次交易时给每一单一当事人造成 10 元人民币以上的损失。
- 4、基金管理人在赔偿基金份额持有人后,有权向有关责任方追偿。

(八) 特殊情形的处理

1、基金管理人按本基金估值方法的第八条,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理;

2、由于证券交易所或登记结算公司发送的数据错误,或战争、火灾、地震、洪水等不可抗力原因,基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但未能发现错误的,由此造成的基金资产估值错误,基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

十五、基金的收益与分配

(一) 基金收益的构成

- 1、买卖证券差价;
- 2、基金投资所得红利、股息、债券利息;
- 3、银行存款利息;
- 4、已实现的其他合法收入。

因运用基金资产带来的成本或费用的节约计入收益。

（二）基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按照国家有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

（三）收益分配原则

- 1、基金收益分配比例按有关规定制定；
- 2、本基金每年收益分配次数最多为 4 次，年度收益分配比例不低于基金年度已实现收益的 50%；
- 3、场外投资者可以选择现金分红或红利再投资；场内投资者只能选择现金分红；本基金分红的默认方式为现金分红；
- 4、基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；
- 5、基金当期收益应先弥补上期亏损后，才可进行当期收益分配；
- 6、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年至少分配一次，但若成立不满 3 个月则不进行收益分配，年度收益分配在基金会计年度结束后的 4 个月内完成；
- 7、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；
- 8、每一基金份额享有同等分配权。

（四）南方积极配置基金收益分配方案和公告

基金收益方案中应载明基金收益的范围、基金净收益、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，基金托管人核实后确定并公告。

（五）基金收益分配中发生的费用

收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由基金份额持有人自行承担。

十六、基金的费用与税收

（一）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）证券交易费用；
- （4）基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- （5）基金份额持有人大会费用；
- （6）基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费；
- （7）按照国家有关规定可以列入的其他费用。

（二）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

在通常情况下，本基金的管理费按前一日基金资产净值 1.5%的年费率计算，计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费；

E 为前一日基金资产净值。

2、基金托管人的托管费

在通常情况下，本基金的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计算，计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费；

E 为前一日基金资产净值。

3、上述（一）中（3）到（7）项费用由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。

（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资产的损失，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。

其他具体不列入基金费用的项目依据中国证监会有关规定执行。

（四）基金管理人和基金托管人可磋商酌情降低基金管理费、基金托管费，下调前述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3个工作日在至少一种指定报刊和网站上刊登公告。

（五）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、基金的会计与审计

（一）基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- 2、基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果基金合同生效少于 3 个月，可以并入下一个会计年度；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关的会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

（二）基金审计

- 1、本基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券从业资格的会计

师事务所和注册会计师对基金年度财务报表进行审计；

2、会计师事务所更换经办注册会计师，须事先征得基金管理人和基金托管人同意；

3、基金管理人（或基金托管人）认为有充足理由更换会计师事务所，经基金托管人（或基金管理人）同意，并报中国证监会备案后可以更换。更换会计师事务所应在五个工作日内公告。

十八、基金的信息披露

本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。本基金信息披露事项应当在中国证监会规定时间内，通过指定报刊和网站等媒介披露，并保证投资人能够按照基金合同约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

公开披露的基金信息包括：

（一）基金招募说明书、基金合同、基金托管协议

基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人应当在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书、基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应当同时将基金合同、基金托管协议登载在网站上。

基金合同生效后，基金管理人应当在每六个月结束之日起四十五日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定报刊上。

（二）基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。

（三）基金募集情况公告

基金管理人应当就基金份额发售的结果编制基金募集情况公告，并在募集期结束的次日登载于指定报刊和网站上。

（四）基金合同生效公告

基金管理人应当在基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。

（五）基金份额上市交易公告书

基金份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易的三个工作日前，将基金份额上市交易公告书登载在指定报刊和网站上。

（六）基金资产净值、基金份额净值

基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在半年度和年度最后一个市场交易日的次日，将前日的基金资产净值、

基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

(七) 基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率,并保证投资人能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

(八) 基金定期报告,包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起九十日内,编制完成基金年度报告,并将年度报告正文登载于网站上,将年度报告摘要登载在指定报刊上。

基金管理人应当在上半年结束之日起六十日内,编制完成基金半年度报告,并将半年度报告正文登载在网站上,将半年度报告摘要登载在指定报刊上。

基金管理人应当在每个季度结束之日起十五个工作日内,编制完成基金季度报告,并将季度报告登载在指定报刊和网站上。

基金合同生效不足两个月的,基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

(九) 临时报告

基金发生重大事件,即可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的事件,有关信息披露义务人应当在两日内编制临时报告书,予以公告,并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。重大事件包括:

- 1、基金份额持有人大会的召开;
- 2、终止基金合同;
- 3、转换基金运作方式;
- 4、更换基金管理人、基金托管人;
- 5、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更;
- 6、基金管理人股东及其出资比例发生变更;
- 7、基金募集期延长;
- 8、基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动;
- 9、基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十;
- 10、基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过百分之三十;
- 11、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼;
- 12、基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查;
- 13、基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚,基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚;
- 14、重大关联交易事项;

- 15、基金收益分配事项；
- 16、管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 17、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；
- 18、基金改聘会计师事务所；
- 19、变更基金份额发售机构；
- 20、基金更换注册登记机构；
- 21、开放式基金开始办理申购、赎回；
- 22、开放式基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- 23、开放式基金发生巨额赎回并延期支付；
- 24、开放式基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- 25、开放式基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- 26、中国证监会规定的其他事项。

(十) 基金份额持有人大会决议

召开基金份额持有人大会的,召集人应当至少提前三十日公告基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。

基金份额持有人依法自行召集持有人大会,基金管理人、基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务的,召集人应当履行相关信息披露义务。

(十一) 澄清公告

在基金合同期限内,任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的,相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清,并将有关情况立即报告中国证监会、基金上市交易的证券交易所。

(十二) 中国证监会规定的其他信息。

(十三) 信息披露文件的存放与查阅

招募说明书公布后,应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金份额发售机构的住所,供公众查阅、复制。

上市交易公告书公布后,应当分别置备于基金管理人的住所和基金上市交易的证券交易所,供公众查阅、复制。

基金定期报告公布后,应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所,以及基金上市交易的证券交易所供公众查阅、复制。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

(十四) 本基金同时遵循《业务规则》中有关信息披露的规定。

十九、风险揭示

本基金定位为股票配置型基金,强调采用积极策略通过三级配置(资产配置、行业配置

和个股配置)进行投资,因此属于证券投资基金中较高预期风险和较高预期收益的品种。

(一) 市场风险

证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响,导致基金收益水平变化,产生风险,主要包括:

1、政策风险。因国家宏观政策(如货币政策、财政政策、行业政策、地区发展政策等)发生变化,导致市场价格波动而产生风险。

2、经济周期风险。随经济运行的周期性变化,证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金投资于债券与上市公司的股票,收益水平也会随之变化,从而产生风险。

3、利率风险。金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率,影响着企业的融资成本和利润。基金投资于债券和股票,其收益水平会受到利率变化的影响。

4、上市公司经营风险。上市公司的经营好坏受多种因素影响,如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等,这些都会导致企业的盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善,其股票价格可能下跌,或者能够用于分配的利润减少,使基金投资收益下降。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险,但不能完全规避。

5、信用风险。主要是指债务人的违约风险,若债务人经营不善,资不抵债,债权人可能会损失掉大部分的投资,这主要体现在企业债中。

6、购买力风险。基金的利润将主要通过现金形式来分配,而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降,从而使基金的实际收益下降。

7、债券收益率曲线变动风险。债券收益率曲线变动风险是指与收益率曲线非平行移动有关的风险,单一的久期指标并不能充分反映这一风险的存在。

8、再投资风险。再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资收益的影响,这与利率上升所带来的价格风险(即前面所提到的利率风险)互为消长。具体为当利率下降时,基金从投资的固定收益证券所得的利息收入进行再投资时,将获得较少的收益率

9、波动性风险。波动性风险主要存在于可转债投资中,表现为可转债的价格受到其对应股票价格波动的影响,同时可转债还有信用风险与转股风险。转股风险指相对应股票价格跌破转股价,不能获得转股收益,从而无法弥补当初付出的转股期权价值。

(二) 配置的风险

虽然配置将会对基金资产的增值带来超额回报,但由于信息来源的不足、滞后或错误,导致基金管理人在判断宏观市场、行业周期产生偏差及选择证券品种的失误,造成基金资产的配置未能达到预期的目标,投资者将蒙受一定的损失。

(三) 上市交易的风险

本基金将在发行结束后在深圳证券交易所挂牌上市,由于上市期间可能因信息披露导致基金停牌,投资者在停牌期间不能买卖基金,产生风险;同时,可能因上市后交易对手不足导致基金流动性风险;另外,当基金份额持有人将份额转向场外交易后导致场内的基金份额

或持有人数不满足上市条件时，本基金存在暂停上市或终止上市的可能。

（四）管理风险

在基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平，造成管理风险。

（五）流动性风险

本基金属开放式基金，在所有开放日管理人有义务接受投资者的赎回。中国股市波动性较大，在下跌时经常出现交易量急剧减少的情况，如果这时出现较大数额的赎回申请，则使基金资产变现困难，基金面临流动性风险。另外，固定收益证券相对于股票市场流动性较低，从而在买卖时较难获得合理的价格或者要付出更高的费用。这些都构成基金流动性风险。

（六）其他风险

- 1、因技术因素而产生的风险，如电脑系统不可靠产生的风险；
- 2、因业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等不完善而产生的风险；
- 3、因人为因素而产生的风险、如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；
- 4、对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；
- 5、因业务竞争压力可能产生的风险；
- 6、不可抗力可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险；
- 7、其他意外导致的风险。

二十、基金合同的变更、终止和基金财产的清算

（一）基金合同的变更

- 1、本基金合同的变更应经基金管理人和基金托管人同意；
- 2、变更基金合同应经基金份额持有人大会决议通过并报中国证监会批准，自批准之日起生效。但如因相应的法律法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行变更的情形，或者基金合同的变更不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化，或者基金合同的变更对基金份额持有人利益无实质性不利影响，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意变更后公布，并报中国证监会备案。

（二）基金合同的终止

- 1、出现下列情况之一的，本基金合同经中国证监会批准后将终止：
 - （1）基金份额持有人大会决定终止的；
 - （2）基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
 - （3）基金合同约定的其他情形；
 - （4）中国证监会允许的其他情况。
- 2、基金合同终止时，基金管理人应予公告并组织清算组对基金财产进行清算。

(三) 基金财产的清算

1、清算小组

(1) 自基金合同终止之日起三个工作日内成立基金财产清算小组,清算小组必须在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2) 清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。清算小组可以聘请必要的工作人员。

(3) 清算小组负责基金资产的保管、清理、估价、变现和分配。清算小组可以依法进行必要的民事活动。

2、清算程序

(1) 基金合同终止后,由清算小组统一接管基金资产;

(2) 清算小组对基金资产进行清理和确认;

(3) 对基金资产进行估价;

(4) 对基金资产进行变现;

(5) 将基金清算结果报告中国证监会;

(6) 公布基金清算公告;

(7) 进行基金剩余资产的分配。

3、清算费用

清算费用是指清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用,清算费用由清算小组从基金资产中支付。

4、基金剩余资产的分配

基金清算后的全部剩余资产扣除基金清算费用后,按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

5、基金清算的公告

清算小组作出的清算报告经会计师事务所审计,律师事务所出具法律意见书后,报中国证监会备案后5个工作日内由清算小组公告。

6、基金清算账册及文件的保存

基金清算账册及有关文件由基金托管人按照国家有关规定保存。

二十一、基金合同的内容摘要

一、基金合同的当事人及权利义务

(一) 基金合同的当事人

1、基金管理人

名称:南方基金管理有限公司

注册地址:广东省深圳市福田区中心区深南大道4009号投资大厦七楼

法定代表人：吴万善

成立时间：1998 年 3 月 6 日

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：证监基字[1998]4 号

组织形式：有限责任公司

实收资本：1.5 亿元人民币

存续期间：持续经营

2、基金托管人

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

成立时间：1984 年 1 月 1 日

批准设立机关及批准设立文号：1983 年 9 月 17 日国务院发布的《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 334,018,850,026 元

存续期间：持续经营

删除的内容：人民币
286,509,130,026 元

3、基金份额持有人

基金投资者购买本基金基金份额的行为即视为对本基金合同的承认和接受，基金投资者自取得依据本基金合同发售的基金份额，即成为本基金份额持有人和本基金合同的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为本基金合同当事人并不以在本基金合同上书面签章为必要条件。

(二) 基金管理人的权利与义务

1、基金管理人的权利

- (1) 自本基金合同生效之日起，依法律法规和本基金合同的规定运用并管理基金资产；
- (2) 依据基金合同的规定，获得基金管理人的管理费、其他法定收入 and 法律法规允许或监管部门批准的约定收入；
- (3) 提议召开基金份额持有人大会；
- (4) 监督本基金的托管行为，如认为基金托管人违反了本基金合同及国家法律法规，应呈报中国证监会和银行业监管机构，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (5) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (6) 发售基金份额；
- (7) 选择、更换基金销售代理人，对基金销售代理人的相关行为进行监督和处理；
- (8) 委托其他机构担任注册登记人，担任注册登记人，更换注册登记人；
- (9) 依照有关法律法规，代表基金行使因运营基金资产而产生的股权、债权及其他权

利；

(10) 以自身名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(11) 依据有关法律规定及本基金合同制定或决定基金收益的分配方案；

(12) 在基金存续期内，依据有关的法律法规和本基金合同的规定，暂停受理申购、赎回申请或暂停上市交易；

(13) 在符合有关法律法规和基金合同的前提下，制订和调整开放式基金业务规则，决定基金的除托管费率之外的相关费率结构和收费方式；

(14) 有关法律、法规和基金合同规定的其他权利。

2、基金管理人的义务

(1) 遵守基金合同；

(2) 办理基金备案手续；

(3) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产；

(4) 对所管理的不同基金资产分别设账、进行基金会计核算，编制财务会计报告及基金报告。

(5) 设置相应的部门并配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金资产；

(6) 设置相应的部门并配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购、赎回和其他业务或委托其他机构代理该项业务；

(7) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金资产和基金管理人的资产相互独立，保证不同基金在资产运作、财务管理等方面相互独立；

(8) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得利用基金资产为自己及基金份额持有人外的任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金资产；

(9) 办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

(10) 依法接受基金托管人的监督；

(11) 按规定计算并公告基金资产净值、基金份额净值；

(12) 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

(13) 按照有关的法律法规保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等。

除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

(14) 按基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

(15) 按规定受理并办理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(16) 不谋求对上市公司的控股和直接管理；

(17) 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会；

(18) 保存基金的会计账册、报表、记录 15 年以上；

(19) 确保向基金投资者提供的各项文件或资料在规定的时间内发出；保证基金投资者能够按照基金合同规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并得到有关资料的复印件；

(20) 参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；

(21) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

(22) 因过错导致基金资产的损失，应承担赔偿责任，其过错责任不因其退任而免除；

(23) 因基金估值错误给投资者造成损失的，应先由基金管理人承担，基金管理人对其不应由其承担的责任，有权向过错人追偿；

(24) 监督基金托管人按照基金合同规定履行义务，基金托管人因过错造成基金资产损失时，应为基金向基金托管人追偿，但不承担连带责任、赔偿责任及其他法律责任；

(25) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

(26) 有关法律、法规和基金合同规定的其他义务。

(三) 基金托管人的权利与义务

1、基金托管人的权利

(1) 自本基金合同生效之日起，依法律法规和本基金合同的规定持有并保管基金资产；

(2) 依据本基金合同约定获得基金托管费、其他法定收入和其他法律法规允许或监管部门批准的约定收入；

(3) 依据有关法规监督本基金的投资运作，如认为基金管理人违反了本基金合同及国家法律法规，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(4) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(5) 提议召开基金份额持有人大会；

(6) 有关法律、法规和基金合同规定的其他权利。

2、基金托管人的义务

(1) 遵守基金合同；

(2) 依法持有基金资产；

(3) 以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金资产；

(4) 设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备有足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金资产托管事宜；

(5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金资产的安全，保证其托管的基金资产与基金托管人自有资产以及不同的基金资产相互独立；对不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

(6) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金资产；

- (7) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- (8) 以基金托管人的名义开立基金托管专户和证券交易资金账户，以基金托管人及基金联名的方式开立基金证券账户，以基金的名义开立银行间债券托管账户，负责基金投资于证券的清算交割，执行基金管理人的划款指令，并负责办理基金名下的资金往来；
- (9) 保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
- (10) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值；
- (11) 采用适当、合理的措施，使本基金份额的认购、申购、赎回等事项符合基金合同等有关法律文件的规定；
- (12) 采用适当、合理的措施，使基金管理人用以计算本基金份额的认购、申购和赎回的方法符合本基金合同等有关法律文件的规定；
- (13) 采用适当、合理的措施，使基金投资和融资的条件符合本基金合同等有关法律文件的规定；
- (14) 按规定出具基金托管情况的报告，复核基金业绩报告，并报银行业监管机构和中国证监会；
- (15) 在定期报告内出具基金托管人意见；
- (16) 按有关规定，保存基金的会计账册、报表和记录 15 年以上；
- (17) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (18) 依基金管理人指令或有关规定将基金份额持有人收益和赎回款项自基金托管专户划出；
- (19) 参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (20) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会和银行业监管机构，并通知基金管理人；
- (21) 因过错导致基金资产的损失，应承担赔偿责任，其过错责任不因其退任而免除；
- (22) 监督基金管理人按照基金合同规定履行义务，基金管理人因过错造成基金资产损失时，应为基金向基金管理人追偿，但不承担连带责任、赔偿责任及其他法律责任；
- (23) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
- (24) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (25) 有关法律、法规和基金合同规定的其他义务。

(四) 基金份额持有人的权利和义务

- 1、每份基金份额代表同等的权利和义务。
- 2、基金份额持有人权利
 - (1) 分享基金财产收益；
 - (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
 - (3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；

- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 对基金管理人、基金托管人、销售机构、注册登记人损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- (8) 有关法律、法规和基金合同约定的其他权利。

3、基金份额持有人义务

- (1) 遵守基金合同；
- (2) 缴纳基金认购、申购款项及规定的费用；
- (3) 承担基金亏损或者终止的有限责任；
- (4) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
- (5) 有关法律、法规和基金合同规定的其他义务。

二、基金份额持有人大会

(一) 基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人合法的授权代表共同组成。

(二) 召开事由

下列事项应当通过召开基金份额持有人大会审议决定：

- 1、修改基金合同（基金合同中约定可由基金管理人和基金托管人协商后修改而无需召开基金份额持有人大会的情形除外）；
- 2、终止基金合同；
- 3、转换基金运作方式；
- 4、提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- 5、更换基金管理人、基金托管人；
- 6、法律法规规定或基金合同约定的其他事项。

基金合同中约定可由基金管理人和基金托管人协商后修改而无需召开基金份额持有人大会的情形：

- 1、调低基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- 2、在基金合同约定的范围内变更本基金的申购费率、赎回费率或收费方式；
- 3、因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；
- 4、对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- 5、对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- 6、按照法律法规或基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

(三) 召集人

1、基金份额持有人大会由基金管理人召集；基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

2、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。

基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

3、代表基金份额百分之十以上（不含 10%）的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。

基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额百分之十以上（不含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。

基金托管人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开。

基金管理人和基金托管人都不召集基金份额持有人大会的，代表基金份额百分之十以上（不含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并应当至少提前三十日向中国证监会备案。

（四）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前30 天，在至少一种指定报刊和网站上公告通知。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- (1) 会议召开的时间、地点、会议方式；
- (2) 会议拟审议的主要事项、议事程序；
- (3) 会议的表决方式；
- (4) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权利登记日；
- (5) 代理投票授权委托书送达时间和地点；
- (6) 会务常设联系人姓名、电话；
- (7) 与会者须准备或履行的文件和手续；
- (8) 召集人认为需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见的寄交的截止时间和收取方式。

（五）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会等方式召开。

会议的召开方式由会议召集人确定，但更换基金管理人和基金托管人必须以现场开会方式召开。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托书委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会。现场开会同时

符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

(1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、本基金合同和会议通知的规定；

(2) 经核对，汇总到会者出示的在权利登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权利登记日基金总份额的 50%（不含 50%）。

2、通讯开会。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

(1) 基金管理人按本基金合同规定公布会议通知后，在两个工作日内连续公布相关提示性公告；

(2) 基金管理人在基金托管人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；

(3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权利登记日基金总份额的 50%（不含 50%）；

(4) 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、本基金合同和会议通知的规定；

(5) 会议通知公布前报中国证监会备案。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为无效表决。

3、如果开会条件达不到上述现场开会或通讯开会的条件，则对同一议题可履行再次开会的程序，再次开会日期的提前通知期限为 10 天，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权利登记日不应发生变化。

4、属于以现场开会方式再次召集基金份额持有人大会的，必须同时符合以下条件：

(1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、本基金合同和会议通知的规定；

(2) 经核对，汇总到会者出示的在权利登记日持有的基金份额凭证显示，全部有效的凭证所对应的基金份额不小于本基金在权利登记日基金总份额的 50%（不含 50%）。

属于以通讯开会的方式再次召集基金份额持有人大会的，必须同时符合以下条件：

(1) 基金管理人按本基金合同规定公布会议通知后，在两个工作日内连续公布相关提示性公告；

(2) 基金管理人在基金托管人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；

(3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不少于在权利登记日基金总份额的 50%（不含 50%）；

(4) 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人,同时提交持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、本基金合同和会议通知的规定;

(5) 会议通知公布前已报中国证监会备案。

(六) 议事内容与程序

1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项,如修改基金合同、决定终止基金、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及基金合同规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权利登记日基金总份额10%(不含10%)以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案;也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案,临时提案应当在大会召开日前10天提交召集人。

基金份额持有人大会的召集人发出召集现场会议的通知后,对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开日5天前公告。否则,会议的召开日期应当顺延并保证至少有5天的间隔期。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

召集人对于基金管理人、基金托管人和基金份额持有人提交的临时提案进行审核,符合条件的应当在大会召开日5天前公告。大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核:

(1) 关联性。大会召集人对于提案涉及事项与基金有直接关系,并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的,应提交大会审议;对于不符合上述要求的,不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决,应当在该次基金份额持有人大会上进行解释和说明。

(2) 程序性。大会召集人可以对提案涉及的程序性问题做出决定。如将提案进行分拆或合并表决,需征得原提案人同意;原提案人不同意变更的,大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定,并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

单独或合并持有权利登记日基金总份额10%(不含10%)以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案,未获基金份额持有人大会审议通过,就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议,需由单独或合并持有权利登记日基金总份额20%(不含20%)以上的基金份额持有人提交;基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案,未获得基金份额持有人大会审议通过,就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议,其时间间隔不少于六个月。

2、议事程序

(1) 现场开会

在现场开会的方式下,首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人,

然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人所持表决权的50%以上（不含50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。

(2) 通讯开会

在通讯开会的情况下，公告会议通知时应当同时公布提案，在所通知的表决截止日期第二天统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

(七) 表决

- 1、基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。
- 2、基金份额持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。
- 3、基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

(1) 一般决议，一般决议须经出席会议的基金份额持有人所持表决权的50%以上（不含50%）通过方为有效；除下列（2）所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

(2) 特别决议，特别决议须经出席会议的基金份额持有人所持表决权的2/3以上（不含2/3）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者更换基金托管人、终止基金合同等重大事项必须以特别决议通过方为有效。

- 4、基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。
- 5、采取通讯方式进行表决时，符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决。
- 6、基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

(八) 计票

1、现场开会

(1) 如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

(2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

(3) 如果会议主持人或基金份额持有人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

(4) 计票过程应由公证机关予以公证。

2、通讯开会

在通讯开会的情况下,计票方式为:由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表(若由基金托管人召集,则为基金管理人授权代表)的监督下进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证。

(九)生效与公告

基金份额持有人大会表决通过的事项,召集人应当自通过之日起五日内报中国证监会核准或者备案。

基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 5 个工作日内在至少一种指定报刊和网站公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决定。

三、基金合同的变更和终止

(一)基金合同的变更修改

1、本基金合同的变更修改应经基金发起人、基金管理人和基金托管人同意;

2、变更修改基金合同应经基金份额持有人大会决议通过并报中国证监会批准,自批准之日起生效。但如因相应的法律法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行变更修改的情形,或者基金合同的变更修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化,或者基金合同的变更修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响,可不经基金份额持有人大会决议,而经基金管理人和基金托管人同意变更修改后公布,并报中国证监会备案。

(二)基金合同的终止

1、出现下列情况之一的,本基金合同经中国证监会批准后将终止:

(1) 基金份额持有人大会决定终止的;

(2) 基金管理人、基金托管人职责终止,在六个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的;

(3) 基金合同约定的其他情形;

(4) 中国证监会允许的其他情况。

2、基金合同终止时,基金管理人应予公告并组织清算组对基金财产进行清算。(1) 存续期间内,基金份额持有人数量连续 60 个工作日达不到 200 人,或连续 60 个工作日基金资产净值低于人民币 5000 万元,基金管理人将宣布本基金终止;

(2) 基金经持有人大会表决终止的;

(3) 因重大违法行为,基金被中国证监会责令终止的。

(4) 基金管理人因解散、破产、撤销等事由,不能继续担任本基金管理人的职务,而无其他适当的基金管理公司承受其原有权利及义务;

(5) 基金托管人因解散、破产、撤销等事由,不能继续担任本基金托管人的职务,而无其他适当的托管机构承受其原有权利及义务;

(6) 中国证监会允许的其他情况。

2、基金合同的终止。

本基金终止后,须依法和本基金合同对基金进行清算。本基金合同于中国证监会批准基金清算结果并予以公告之日终止。

四、争议的解决方式

各方当事人因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议,如经友好协商未能解决的,可向基金管理人注册地人民法院起诉。

五、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

《基金合同》、《招募说明书》和更新的招募说明书等文本存放在基金管理人、基金托管人和基金销售代理人处,投资者可免费查阅。在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件复印件。

对投资者按此种方式所获得的文件及其复印件,基金管理人和基金托管人应保证与所公告文本的内容完全一致。

二十二、基金托管协议的内容摘要

一、托管协议当事人

(一) 基金管理人

名称:南方基金管理有限公司

注册地址:广东省深圳市福田区深南大道 4009 号投资大厦七楼

法定代表人:吴万善

成立时间:1998 年 3 月 6 日

批准设立机关:中国证监会

批准设立文号:证监基字[1998]4 号

组织形式:有限责任公司

实收资本:1.5 亿元人民币

(二) 基金托管人

基金托管人名称:中国工商银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人:姜建清

成立时间:1984 年 1 月 1 日

批准设立机关及批准设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146号）

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 334,018,850,026 元

存续期间：持续经营

经营范围：办理人民币存款、贷款、国内外结算、办理票据承兑、贴现、转贴现、国内会计业务、代理资金清算、提供信用证服务、代理销售业务、代理发行、代理承销、代理承兑债券、代收代付业务、代理证券资金清算业务、保险业代理业务、代理外国银行和国际金融机构贷款业务、证券投资基金、企业年金托管业务、企业年金账户管理服务、认购申购业务、咨询调查业务、贷款承诺、企业个人财务顾问服务、组织或参加银行贷款外汇存款、外汇贷款、外币兑换、出口托收及进口代收、外汇票据承兑和贴现、外汇借款、外汇担保、发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外汇有价证券。自营代外汇买卖、外汇金融衍生业务、银行卡业务、电话银行、网上银行、手机银行业务、办理结汇售汇业务，经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。

删除的内容：人民币
286,509,130,026 元

二、基金托管人与基金管理人之间的业务监督、核查

（一）基金托管人根据《基金法》、《基金合同》和有关法规的规定，对基金投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产核算、基金价格的计算方法、基金管理人报酬的计提和支付、基金费用的支付、基金申购资金的到账和赎回资金的划付、基金收益分配、基金的融资条件等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的违规行为，应及时以书面形式通知基金管理人，并要求其限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对、确认并以书面形式给托管人发出回函。在限期内，托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

（二）根据《基金法》、《基金合同》及其它有关规定，基金管理人就基金托管人是否及时执行基金管理人的投资指令、是否妥善保管基金的全部资产、是否及时按照基金管理人的指令向注册登记人支付赎回和分红款项，对基金托管人进行监督和核查。

基金管理人可定期对基金托管人保管的基金资产进行核查。基金管理人发现基金托管人未对基金资产实行分账管理、擅自挪用基金资产、因托管人的过错导致基金资产灭失、减损、或处于危险状态的，基金管理人应以书面方式要求托管人予以纠正和采取必要的补救措施。基金管理人有权要求托管人赔偿基金因此所受的损失。

基金管理人发现基金托管人的行为违反《基金法》、《基金合同》和其他有关法规的规定，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。

删除的内容：办理人民币存款、贷款、国内外结算、办理票据承兑、贴现、转贴现、国内会计业务、代理资金清算、提供信用证服务、代理销售业务、代理发行、代理承销、代理承兑债券、代收代付业务、代理证券资金清算业务、保险业代理业务、代理外国银行和国际金融机构贷款业务、证券投资基金、企业年金托管业务、企业年金账户管理服务、认购申购业务、咨询调查业务、贷款承诺、企业个人财务顾问服务、组织或参加银行贷款外汇存款、外汇贷款、外币兑换、出口托收及进口代收、外汇票据承兑和贴现、外汇借款、外汇担保、发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外汇有价证券。自营代外汇买卖、外汇金融衍生业务、银行卡业务、电话银行、网上银行、手机银行业务、办理结汇售汇业务，经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。

基金管理人发现基金托管人有重大违规行为,应立即报告中国证监会,同时通知基金托管人限期纠正。

(三)基金管理人和基金托管人有义务配合和协助对方依照本协议对基金业务执行监督、核查。基金管理人或托管人无正当理由,拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权,或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督,情节严重或经监督方提出警告仍不改正的,监督方应报告中国证监会。

三、基金资产保管

(一)基金资产保管的原则

基金托管人依法持有基金资产,应安全保管所收到基金的全部资产。

基金资产应独立于基金管理人、基金托管人的自有资产。基金托管人应为基金设立独立的账户。本基金资产与托管人的其他资产及其他基金的资产应该实行严格的分账管理。托管人不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。

对于因为基金投资产生的应收资产,应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知托管人,到账日基金资产没有到达托管人处的,托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收,由此给基金造成损失的,基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失。

对于基金申(认)购过程中产生的应收资产,应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人,到账日基金资产没有到达托管人处的,基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收,由此给基金造成损失的,管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失。

(二)基金合同生效时募集资金的验证

基金募集截止,由基金管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资,出具验资报告。基金管理人应督促注册登记人应将募得的全部资金存入基金托管人为基金开立的指定账户中。基金托管人在收到资金当日出具基金资产接收报告。

(三)投资人申购资金的归集和赎回资金的派发

基金申购、赎回的款项采用净额交收的结算方式。T+3 日的赎回款与 T+2 日申购款进行轧差净额交收。

基金托管人应及时查收申购资金是否到账,对于未准时到账的资金,应及时通知基金管理人,由基金管理人负责催收。

因投资者赎回而应划付的款项,基金托管人应根据基金管理人的指令进行划付。

(四)基金银行账户的开设和管理

基金托管人以基金托管人的名义在其营业机构开设基金托管专户,保管基金的银行存款。该基金托管专户是指基金托管人在集中托管模式下,代表所托管的基金与中国证券登记结算有限责任公司进行一级结算的专用账户。该账户的开设和管理由基金托管人承担。本基金的一切货币收支活动,均需通过基金托管人的基金托管专户进行。

基金托管专户的开立和使用,限于满足开展本基金业务的需要。托管人和管理人不得假借本基金的名义开立任何银行账户;亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

基金托管专户的管理应符合《银行账户管理办法》、《现金管理条例》、《中国人民银行利率管理的有关规定》、《关于大额现金支付管理的通知》、《支付结算办法》以及银行业监管机构、中国证券监督管理委员会和中国证券登记结算有限公司的其他规定。

(五) 基金证券账户和资金账户的开设和管理

基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司/深圳分公司开设证券账户。

基金证券账户的开立和使用,限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户;亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开立基金证券交易资金账户,用于证券清算。

(六) 债券托管乙类账户的开设和管理

1、基金合同生效后,基金管理人负责向中国证监会和中国人民银行申请基金进入全国银行间同业拆借市场进行交易。由基金管理人在中国外汇交易中心开设同业拆借市场交易账户,由基金托管人在中央国债登记结算有限责任公司开设债券托管乙类账户,并由基金托管人负责基金的债券的后台匹配、查询及资金的清算。

2、同业拆借市场交易账户和债券托管账户根据中国人民银行、中国外汇交易中心和中央国债登记结算有限责任公司的有关规定,由基金管理人和基金托管人签订补充协议,进行使用和管理。基金管理人和基金托管人应一起负责为基金对外签订全国银行间国债市场回购主协议,正本由基金托管人保管,基金管理人保存副本。

(七) 基金资产投资的有关实物证券的保管

实物证券由基金托管人存放于托管银行的保管库;也可存入中央国债登记结算公司或交易所登记结算公司或其他的代保管库中。保管凭证由基金托管人保存。实物证券的购买和转让,由基金托管人根据基金管理人的指令办理。托管人对托管人以外机构实际有效控制的证券不承担责任。

(八) 和基金资产有关的重大合同的保管

与基金投资有关的重大合同的签署,除本协议另有规定外,由基金管理人负责。合同原件由基金管理人保管。保管期限按照国家有关规定执行。

与基金资产有关的重大合同,根据基金的需要以基金的名义签署。合同原件由托管人保管。

四、资产净值计算和会计核算

（一）基金资产净值的计算和复核

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额资产净值是指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数后的价值。

基金管理人应每日对基金资产估值。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额资产净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值并以加密传真方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后，签名、盖章并以加密传真方式传送给基金管理人，由基金管理人对外公布。

根据《基金法》，开放式基金的基金会计责任方由基金管理人担任。因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，则先按基金会计责任方的建议执行。

（二）净值差错处理

当基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告的，由此造成的投资者或基金的损失，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，由基金管理人和基金托管人按照管理费率 and 托管费率的比例各自承担相应的责任。

由于一方当事人提供的信息错误，另一方当事人在采取了必要合理的措施后仍不能发现该错误，进而导致基金份额净值计算错误造成投资者或基金损失，以及由此造成以后交易日基金份额净值计算顺延错误而引起的投资者或基金损失，由提供错误信息的当事人一方负责赔偿。

由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

针对净值差错处理，如果法律法规或证监会有新的规定，则按新的规定执行；如果行业有通行做法，在不违背法律法规且不损害投资者利益的前提下，相关各方当事人应本着平等互利的原则重新协商确定处理原则。

当基金管理人计算的基金份额净值与基金托管人的计算结果不一致时，相关各方应本着勤勉尽责的态度重新计算核对，如果最后仍无法达成一致，应以基金管理人的计算结果为准对外公布，由此造成的损失以及因该交易日基金份额净值计算顺延错误而引起的损失由基金管理人承担赔偿责任，基金托管人不负赔偿责任。

（三）基金账册的建账和对账

基金管理人和基金托管人在基金合同生效后，应按照相关各方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登录和保管本基金的全套账册，对相关各方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金资产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，应以基金

管理人的处理方法为准。

经对账发现相关各方的账目存在不符的,基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正,保证相关各方平行登录的账册记录完全相符。若当日核对不符,暂时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净值的计算和公告的,以基金管理人的账册为准。

(四) 基金财务报表与报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制,应于每月终了后 5 日内完成;投资组合公告每季度公布一次,在截止日后 15 个工作日内公告;招募说明书在本基金合同生效后每六个月公告一次,于截止日后 1 个月内公告。年中报告在会计年度半年终了后 60 日内公告;年度报告在会计年度结束后 90 日内公告。

基金管理人在月度报表完成当日,对报表加盖公章后,以加密传真方式将有关报表提供基金托管人复核;基金托管人在收到后 5 个工作日内进行复核,并将复核结果及时书面通知基金管理人。基金管理人在年中报告完成当日,将有关报告提供基金托管人复核,基金托管人在收到后 30 日内进行复核,并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日,将有关报告提供基金托管人复核,基金托管人在收到后 30 日内复核,并将复核结果书面通知基金管理人。基金托管人在复核过程中,发现相关各方的报表存在不符时,基金管理人和基金托管人应共同查明原因,进行调整,调整以相关各方认可的账务处理方式为准。核对无误后,基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖公章,相关各方各自留存一份。

基金托管人在对中报或年报复核完毕后,需出具相应的复核确认书,以备有权机构对相关文件审核时提示。

五、基金份额持有人名册的登记与保管

基金份额持有人名册,包括基金设立募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册、每月最后一个交易日的基金份额持有人名册由基金过户与注册登记人负责制定。基金过户与注册登记人对基金份额持有人名册负保管义务。

六、争议的处理

因本协议产生的争议,双方当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的,可以在有管辖权的人民法院通过诉讼解决。

争议处理期间,双方当事人应恪守基金管理人和托管人职责,各自继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务,维护基金份额持有人的合法权益。

七、托管协议的修改和终止

(一) 本协议双方当事人经协商一致,可以对协议进行修改。修改后的新协议,其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。修改后的新协议,报中国证监会批准后生效。

(二) 发生以下情况，本托管协议终止：

- 1、基金合同终止；
- 2、基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；
- 3、基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管其基金管理权；
- 4、发生法律、法规规定的基金终止事项。

二十三、基金份额持有人服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务，以下是主要的服务内容，基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加和修改服务项目。

(一) 持有人交易资料的寄送服务

1、场外投资者。每次交易结束后，可在 T+2 个工作日后通过销售机构的网点查询和打印确认单；每季度结束后 10 个工作日内，注册登记机构或基金管理人向本季度有交易的场外部分的投资者寄送对账单；每年度结束后 10 个工作日内，注册登记机构或基金管理人向所有持有本基金份额的场外部分的投资者或在最后一个季度内有交易的投资者寄送对账单。

2、场内投资者。每次交易结束后，可在 T+1 个工作日后到交易网点进行确认单的查询和打印，注册登记机构和基金管理人不会寄送场内投资者的对账单，投资者可随时到交易网点打印或通过交易网点提供的自助、电话、网上服务手段查询。

(二) 网上交易服务

场外投资者可通过销售机构网站办理申购、赎回及信息查询。场内投资者可通过交易网点提供的网站进行网上交易。基金管理人也可利用自己的网站(www.nffund.com)为投资者提供基金网上交易服务，业务开通的时间由基金管理人另行公告。

(三) 定期定额投资计划

通过定期定额投资计划，投资者可以通过固定的渠道，定期定额申购基金份额。定期定额投资计划的有关规则另行公告。

(四) 信息定制服务

场外投资者可以通过基金管理公司网站、客户服务中心提交信息定制申请，基金管理公司通过E-MAIL、手机短信、传真等定期为客户发送所定制的信息。可定制的信息包括：每日基金份额净值、每笔交易确认、每月账户余额及损益、最近季度的基金投资组合、公司最新公告、新产品信息等。业务开通的时间由基金管理人另行公告。

(五) 网络在线服务

客户通过基金账户号和查询密码登录基金公司网站“网上客服”栏目，可享受有账户查询，信息定制，资料修改，理财刊物查阅，在线咨询等多项在线服务。业务开通的时间由基金管理人另行公告。

(六) 客户服务中心电话服务

拨打免长途话费的全国统一客服热线400-889-8899,将为您提供如下信息:基金净值信息、账户交易情况、基金产品与服务等信息查询。在正常交易时间的电话委托下单服务目前只对直销客户开放。业务开通的时间由基金管理人另行公告。

客户服务中心人工坐席提供每周五天,每日不少于8小时的座席服务,投资者可以通过该热线获得业务咨询,信息查询,服务投诉,信息定制,资料修改等专项服务。

(七) 客户投诉受理服务

投资者可以通过各销售机构网点柜台,基金公司网站投诉栏目,自动语音留言栏目,客户服务中心人工热线,书信,电子邮件等六种不同的渠道对基金公司和销售网点所提供的服务以及公司的政策规定进行投诉。

对于工作日期间受理的投诉,原则上是及时回复,对于不能及时回复的投诉,我们承诺在24小时之内对您的投诉做出回复。对于非工作日提出的投诉,本公司将在顺延的工作日当日进行回复。

(八) 南方投资者俱乐部

凡南方开放式基金投资人均为南方投资者俱乐部会员,南方投资者俱乐部开展的各项活动及服务,详细内容由基金管理人另行公告。

删除的内容:

二十四、其它应披露事项

(一) 选择使用基金专用交易席位的证券经营机构的选择标准和程序

基金管理人负责选择证券经营机构,选用其专用交易席位供本基金证券买卖专用,选择标准为:

- 1、实力雄厚,信誉良好,注册资本不少于3亿元人民币。
- 2、财务状况良好,各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- 3、经营行为规范,最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚。
- 4、内部管理规范、严格,具备健全的内控制度,并能满足基金运作高度保密的要求。
- 5、具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要,并能为本基金提供全面的信息服务。

6、研究实力较强,有固定的研究机构和专门的研究人员,能及时为本基金提供高质量的咨询服务,包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订委托协议,报中国证监会备案并公告。

(二) 席位租用期限及更换方式

席位的使用期限暂定为半年。使用期满后,基金管理人将根据各证券经营机构所提供的各类研究报告和信息资讯进行综合评价,包括:

- 1、提供的研究报告质量和数量;

- 2、研究报告被基金采纳的情况；
- 3、因采纳其报告而为基金运作带来的直接效益和间接效益；
- 4、因采纳其报告而为基金运作避免或减少的损失；
- 5、由基金管理人提出课题，证券经营机构提供的研究论文质量；
- 6、开放证券经营机构资料库的情况；
- 7、其他可评价的量化标准。

根据上述综合评价的结果进行排名。在这一过程中，管理人不但对已使用席位的证券经营机构进行排名，同时亦关注并接受其他证券经营机构的研究报告和信息资讯，为半年后的席位更换作准备。

若证券经营机构所提供的研究报告及其他信息服务不符合要求，基金管理人有权提前中止租用其交易席位。

（三）席位运作方式

根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》中关于“每只基金通过任何一家证券经营机构买卖证券的年成交量，不超过该基金买卖证券年总成交量的 30%”的规定，基金管理人将结合各证券经营机构提供研究报告及信息服务的质量，分配基金在各席位买卖证券的交易量。

（四）其他事宜

基金管理人将根据有关规定，在基金中期报告和年度报告中将所选择的证券经营机构的有关情况、基金通过该证券经营机构买卖证券的成交量、支付的佣金等予以披露，并向中国证监会报告。

二十五、招募说明书存放及其查阅方式

本招募说明书存放在本基金管理人、基金托管人、销售代理人和注册登记机构的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅；也可按工本费购买本基金合同复制件或复印件，但应以基金合同正本为准。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

二十六、备查文件

- （一）中国证监会批准南方积极配置基金设立的文件；
- （二）《南方积极配置基金基金合同》；
- （三）《南方积极配置基金注册登记协议》；

- (四) 《南方积极配置基金托管协议》;
- (五) 法律意见书;
- (六) 基金管理人业务资格批件、营业执照;
- (七) 基金托管人业务资格批件、营业执照;
- (八) 《南方基金管理有限公司开放式基金业务管理规则》;
- (九) 中国证监会要求的其他文件。

南方基金管理有限公司

2007 年 5 月 29 日

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率}) \times \text{申购费率}$$

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日基金份额净值}$$

例：某投资者投资 10 万元申购南方积极配置基金，假设申购当日的基金份额净值为 1.0168 元，则其可得到的申购份额为：

	南方积极配置基金
申购金额	100,000元
基金份额净值 (NAV)	1.0168元
申购费用	$100,000 / (1 + 1.5\%) \times 1.5\% = 1,477.83\text{元}$
净申购金额	$100,000 / (1 + 1.5\%) = 98,522.17\text{元}$
申购份额	$98,522.17 / 1.0168 = 96,894.34\text{份}$

例：某投资者赎回 1 万份南方积极配置基金，假设赎回当日的基金份额净值为 1.0568 元，则其可得到的赎回金额为：

	南方积极配置基金
赎回份额	10,000份
基金份额净值 (NAV)	1.0568元
赎回费用	$10,000 \times 1.0568 \times 0.5\% = 52.84\text{元}$
赎回金额	$10,000 \times 1.0568 - 52.84 = 10,515.16\text{元}$