# 中信稳定双利债券型证券投资基金更新招募说明书摘要

基金管理人：中信基金管理有限责任公司　基金托管人：中国建设银行股份有限公司

中信稳定双利债券型证券投资基金于2006年6月16日由中国证券监督管理委员会证监基金字[2006]121号《关于同意中信稳定双利债券型证券投资基金募集的批复》批准募集。本基金的基金合同于2006年7月20日正式生效。

**重要提示**

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

本摘要根据《中信稳定双利债券型证券投资基金基金合同》和《中信稳定双利债券型证券投资基金招募说明书》编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、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。

中信基金管理有限责任公司（下称"基金管理人"）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做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、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。

本更新招募说明书所载内容截止日2008年7月20日，有关财务数据和净值表现截止日为2008年6月30日。

## 一、基金管理人

（一）基金管理人概况

机构名称：中信基金管理有限责任公司
设立日期：二OO三年十月十五日
注册地址：广东省深圳市笋岗路12号中民时代广场B座33层
办公地址：北京市朝阳区裕民路12号中国国际科技会展中心A座8层
法定代表人：王东明
股权结构：有限责任公司
注册资本：壹亿元人民币
电话：（010）82028888
传真：（010）82253396
联系人：杨军智

中信基金管理有限责任公司由中信证券股份有限公司、国家开发投资公司、上海久事公司、中海信托投资有限责任公司共同发起设立，经中国证监会证监基金字[2003] 107号文批准，于2003年10月15日正式成立，注册资本金为1亿元人民币。经中国证监会证监基金字（2007）120号文批准，国家开发投资公司、上海久事公司、中海信托投资有限责任公司分别将其持有的本公司31%、10%和10%的股权转让给中信证券股份有限公司，上述股权转让已经完成，公司由中信证券股份有限公司全资持有。

中信基金管理有限责任公司目前下设十一个部门，分别是：股权投资部、固定收益投资部、研究开发部、基金运营部、市场业务部、客户服务部、信息技术部、综合管理部、监察稽核部、产品创新部、集中交易室。公司设立了投资管理委员会。投资管理委员会负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。

（二）主要人员情况

1、董事、监事以及高级管理人员概况

王东明先生，董事长，硕士研究生学历、高级经济师。北京外国语学院法语系学士，美国南加州大学政治经济学硕士，美国乔治城大学国际经济硕士。历任北京华远经济建设开发总公司副总经理，加拿大枫叶银行证券公司副总裁，华夏证券公司发行部副总经理，南方证券公司副总经理，中信证券有限责任公司副总经理、总经理、董事长、中国中信集团公司总经理协理等职务。

黄卫东先生，董事，硕士研究生。先后毕业于长沙铁道学院，清华大学经济管理学院。历任中信证券股份有限公司债券部总经理、资产管理部总经理、资金运营部总经理、金融产品开发小组组长、中信证券股份有限公司襄理。现任中信证券股份有限公司副总经理。

张建伟先生，董事，硕士研究生学历、高级经济师。历任上海玻璃厂副厂长、上海光通信器材公司副总经理、上海久事公司实业管理总部总经理、资产管理一、二部总经理、发展策划部经理、资产经营部经理、上海久事公司总经理助理兼发展策划部、资产经营部经理等职务。现任上海久事公司副总经理。

傅强先生，董事，北京大学光华管理学院工商管理硕士，中级经济师。历任北京市人民银行行员、北京证券有限公司投资部交易员、研究发展部研究员、中兴信托投资有限公司资产运营部经理、综合开发部经理、国融资产管理公司证券投资部副经理等职务。现任国家开发投资公司金融投资部高级项目经理。

储晓明先生，董事，香港大学国际工商管理硕士，高级经济师。历任工商银行商业信贷部科员、主任科员、技改信贷部项目评估处负责人、技改信贷部调查评估处副处长、固定资产信贷部调查评估处处长、资产风险管理部副总经理、中国海洋石油财务公司副总经理、中海信托投资有限责任公司常务副总经理。现任中海信托投资有限责任公司总经理兼党委书记。

夏斌先生，独立董事，经济学硕士。历任中国人民银行总行处长、副所长、中国证监会主任、深圳证券交易所总经理、中国人民银行总行司长等职务。现任国务院发展研究中心研究所所长。

王国樑先生，独立董事，硕士研究生。历任中国石油天然气总公司财务局副处长、处长、中油财务有限责任公司副总裁、中国石油天然气勘探开发公司副总经理兼总会计师等职务。现任中国石油天然气股份有限公司财务总监。

朱武祥先生，独立董事，经济学博士。历任清华大学经济管理学院经济系助教、讲师、副教授、系副主任等职务。现任清华大学经济管理学院金融与国际贸易系教授，承担教学工作。

郝如玉先生，独立董事，注册会计师、注册税务师，教授、博士生导师。历任中央财经大学税务系助教、讲师、副教授、系副主任、中央财经大学税务系系主任、教授等职务。现任中央财经大学税收经济研究所所长。兼任中国注册税务师协会副会长、全国政协委员、北京市人民代表大会常务委员、全国工商联执委、北京市工商联副会长等职务。

陈颖先生，监事，大学学历。曾在上海市人民政府国资办秘书处就职。现任上海久事公司法律事务部企业法律顾问。

李涛先生，监事，硕士研究生学历。曾在国家投资煤炭公司从事财务工作，先后担任国家开发投资公司金融资产管理部、国融资产管理公司项目经理。现任国家开发投资公司金融投资部业务经理。

李志文先生，监事，大学学历，曾任中国新闻社人事部干部、中信证券股份有限公司人力资源部主管，现任中信基金管理有限责任公司综合管理部负责人。

吕涛先生，总经理，英国克拉费尔德大学管理学院工商管理硕士。14年证券、金融从业经历，具有基金从业人员资格证书和证券从业人员资格证书。历任中信兴业信托投资公司金融证券处外汇交易员、中信证券股份有限公司资产管理部副总经理、总经理。现任中信基金管理有限责任公司总经理。

章月平女士，督察长，经济学学士、高级会计师。25年财务从业经历、14年证券从业经历。历任煤炭部财务司主任科员、中寰会计师事务所注册会计师、中信证券有限责任公司计财部副总经理、稽核室副主任、主任、中信证券股份有限公司计财部总经理等职务。现任中信基金管理有限责任公司督察长。

2、基金经理介绍

张国强先生，经济学硕士。8年证券从业经历，历任中信证券股份有限公司研究咨询部助理分析师、分析师，中信证券股份有限公司债券销售交易部经理、产品设计主管、总监等职。2005年7月加盟中信基金管理有限责任公司，现任固定收益部总监。自2006年7月20日中信稳定双利债券型证券投资基金成立之日起担任本基金的基金经理，并作为本基金唯一的基金经理工作至今，在此之前曾于2006年1月10日至2006年8月10日担任过中信经典配置证券投资基金的基金经理。

3、投资管理委员会成员

公司目前投资管理委员会共由6人组成：

| | |
|---|---|
| 投资管理委员会主任委员 | 王江平 |
| 投资管理委员会委员 | 吕 涛 |
| 投资管理委员会委员 | 郑 煜 |
| 投资管理委员会委员 | 孙建波 |
| 投资管理委员会风控委员 | 赵 楠 |
| 投资管理委员会委员 | 张国强 |

上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

（一）基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)
住所：北京市西城区金融大街25号
办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人：郭树清
成立时间：2004年09月17日
组织形式：股份有限公司
注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元人民币
存续期间：持续经营
基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号
联系人：尹东
联系电话：(010) 6759 5003

中国建设银行股份有限公司在中国拥有悠久的经营历史，其前身"中国人民建设银行"于1954年成立，1996年易名为"中国建设银行"。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代号：HK0939)于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市，是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日，中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后建设银行的已发行股份总数为：233,689,084,000股（包括224,689,084,000股H股及9,000,000,000股A股）。2007年，中国建设银行的综合盈利能力达到同业领先水平，实现净利润691.42亿元，较上年上升49.27%。平均资产回报率为1.15%，平均股东权益回报率为19.50%，分别较上年提高0.23个百分点和4.50个百分点，每股盈利为0.30元，较上年提高0.09 元。总资产达到65,981.77 亿元，较上年增长21.10%。资产质量稳步上升，不良贷款额和不良贷款率实现双降，信贷资产质量持续改善，不良贷款率为2.60%，较上年下降0.69个百分点。拨备水平充分，拨备覆盖率为104.41%，较上年末提升22.17 个百分点。

中国建设银行在中国内地设有1.4万余个分支机构，并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京及首尔设有分行，在伦敦、纽约、悉尼设有代表处。2006年8月24日，中国建设银行在香港与美国银行签署协定，收购美国银行在香港的全资子公司美国银行(亚洲)股份有限公司100%的股权，并于2006年12月29日完成收购交割，美国银行(亚洲)有限公司更名为"中国建设银行(亚洲)股份有限公司"。

2007年，中国建设银行在英国《银行家》杂志公布的世界银行1000强中列第14位；被美国《福布斯》杂志评为全球上市公司2000强第69位；被英国《金融时报》评为"全球500强"第35位；荣获美国《环球金融》杂志"年度中国最佳银行奖"、香港《资本》杂志"中国杰出银行奖"、香港《财资》杂志"中国最佳银行"、《亚洲风险》杂志"中国最佳金融风险管理奖"、《亚洲银行家》杂志"零售风险管理卓越奖"等奖项。中国建设银行在2007年首届中国基金行业年度评选中荣获"最佳托管银行奖"；荣获《财资》杂志颁发的"2007中国最佳次托管银行奖"。在取得出色的经营业绩的同时，中国建设银行亦积极承担企业公民的社会责任，2007年获得中国扶贫基金会"扶贫中国公益家"荣誉称号，获得新华网颁发的"企业社会责任贡献奖"，获得香港上市公司公会和浸会大学工商管理学院颁发的"企业社会责任奖"，连续两次获得中国红十字基金会颁发的"最具责任感企业奖"。

中国建设银行总行设投资托管服务部，下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队、涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海备份中心等12个职能处室，现有员工110余人。

（二）主要人员情况

罗中涛，投资托管服务部总经理，曾就职于国家统计局、中国建设银行总行评估、信贷、委托代理等业务部门并担任领导工作，对统计、评估、信贷及委托代理业务具有丰富的领导经验。

李春信，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行人事教育部、计划部、筹资储蓄部、国际业务部，对商业银行综合经营计划、零售业务及国际业务具有较丰富相关工作经验。

（三）基金托管业务经营情况

截止到2008年3月31日，中国建设银行已托管兴华、兴和、泰和、金鑫、金盛、通乾、鸿飞、银丰等8只封闭式证券投资基金，以及华夏成长、融通新蓝筹、博时价值增长、华宝兴业宝康系列(包括宝康消费品、宝康债券、宝康灵活配置3只子基金)、博时裕富、长城久恒、银华保本增值、华夏现金增利、华宝兴业多策略增长、国泰金马稳健回报、银华–道琼斯88精选、上投摩根中国优势、东方龙、博时主题行业、华富竞争力优选、华宝兴业现金宝、上投摩根货币市场、华夏红利、博时稳定价值、银华核心价值、上投摩根阿尔法、中信红利精选、工银瑞信货币市场、长城消费增值、华宝上证180ETF、上投摩根双息平衡、泰达荷银效率优选、华夏深圳中小企业板ETF、交银施罗德稳健配置、华宝兴业收益增长、华富货币市场、工银瑞信精选平衡、鹏华价值优势、中信稳定双利、华安宏利、上投摩根成长先锋、博时价值增长贰号、海富通风格优势、银华富裕主题、华夏优势增长、信诚精萃成长、工银瑞信稳健成长、信达澳银领先增长、诺德价值优势、工银瑞信信用添利债券、国泰金鼎价值、富国天博、融通领先成长、华宝兴业行业精选、工银瑞信红利、泰达荷银市值优选、长城品牌优选、交银施罗德蓝筹、易方达增强回报、南方盛元红利、交银施罗德稳利等58只开放式证券投资基金。

## 三、相关服务机构

（一）销售机构

1、直销机构

名称：中信基金管理有限责任公司
住所：广东省深圳市笋岗路12号中民时代广场B座33层
办公地址：北京市朝阳区裕民路12号中国国际科技会展中心A座8层
法定代表人：王东明
直销中心地址：北京市朝阳区裕民路12号中国国际科技会展中心A座5层
直销咨询电话：（010）82251898
传 真：（010）82253378
联系人：刘妮

2、代销机构

（1）中国建设银行股份有限公司
住所：北京市西城区金融大街25号
办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人：郭树清
客户服务电话：95533
网站：www.ccb.com

（2）交通银行股份有限公司
住所：上海市浦东新区银城中路188号
办公地址：上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人：蒋超良
客户服务电话：95559
网站：www.bankcomm.com

（3）招商银行股份有限公司
住所：深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人：秦晓
客户服务电话：95555
电话：0755–26897526
传真：0755–26897560
联系人：刘薇

（4）中信银行股份有限公司
住所：北京市东城区朝阳门北大街富华大厦C座
办公地址：北京市东城区朝阳门北大街富华大厦C座
法定代表人：孔丹
客户服务电话：95558
电话：010–65550827
传真：010–65557020
联系人：宋晓明

（5）北京银行
住所：北京市西城区金融大街丙17号
法定代表人：阎冰竹
客户服务电话：010–96169
电话：010–66223248
传真：010–66223314
联系人：杨永杰

（6）中信证券股份有限公司
住所：北京朝阳区新源南路6号京城大厦
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
电话：010–84683893
传真：010–84865560
联系人：陈忠

（7）国泰君安证券股份有限公司
住所：上海市浦东新区商城路618号
办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29层
法定代表人：祝幼一
客户服务电话：400–8888–666
传真：021–38670666
联系人：芮敏祺

（8）中信建投证券有限责任公司
住所：北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址：北京市朝阳门内大街188号
法定代表人：张佑君
客户服务电话：400–8888108
电话：010–85130588
传真：010–65182261
联系人：权唐

（9）招商证券股份有限公司
住所：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38–45层
办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38–45层
法定代表人：宫少林
电话：0755–82943666
传真：0755–82943636
联系人：黄健

（10）中信万通证券有限责任公司
住所：青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层（1507–1510室）
办公地址：青岛市市南区东海西路28
法定代表人：史洁民
电话：0532–85022026
传真：0532–85022026
联系人：丁韶燕

（11）山西证券有限责任公司
住所：山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼
办公地址：山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼
法定代表人：侯巍
电话：0351–8686703
传真：0351–8686619
联系人：张治国

（12）中国银河证券股份有限公司
住所：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人：肖时庆
电话：010–66568047
传真：010–66568536
联系人：李洋

（13）海通证券股份有限公司
住所：上海市淮海中路98号
办公地址：上海市广东路689号
法定代表人：王开国
客户服务电话：400–8888–001
电话：021–23219000
传真：021–23219100
联系人：李笑鸣

（14）华泰证券股份有限公司
住所：南京市中山东路90号华泰证券大厦
办公地址：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：025–84457777–893
传真：025–84579763
联系人：程高峰

（15）中信金通证券有限责任公司
住所：浙江省杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座
办公地址：浙江省杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座
法定代表人：刘军
电话：0571–85783715
传真：0571–85783771
联系人：王勤

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。销售机构可以根据情况变化增加或者减少其销售城市（网点），并另行公告。

（二）注册与过户登记人

公司名称：中信基金管理有限责任公司
注册地址：广东省深圳市笋岗路12号中民时代广场B座33层
办公地址：北京市朝阳区裕民路12号中国国际科技会展中心A座8层
法定代表人：王东明
电话：（010）82028888
传真：（010）82253396
联系人：杨军智
客户服务专线：（010）82251898

（三）律师事务所和经办律师

名称：国浩律师集团（北京）事务所
地址：北京东城区建国门内大街贡院六号E座9层
负责人：张涌涛
电话：（010）65171188
传真：（010）65176800
经办律师：黄伟民、陈周
联系人：黄伟民、陈周

（四）会计师事务所和经办注册会计师

名称：安永华明会计师事务所
地址：北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城东三办公楼16层
法定代表人：葛明
电话：（010）65246688
传真：（010）85188298
经办注册会计师：张小东、成超
联系人：杨振辉

## 四、基金的名称

中信稳定双利债券型证券投资基金

## 五、基金的类别

债券型基金

## 六、基金的投资目标

本基金主要投资于固定收益类产品，投资目标是在强调本金稳妥的基础上，积极追求资产的长期稳定增值。

## 七、基金的投资方向

本基金主要投资于固定收益品种，包括国债、金融债、企业债、可转换债券、资产支持证券、央行票据、回购以及中国证监会批准的允许基金投资的其他固定收益类金融工具，此类投资不低于基金资产的80%。本基金可以通过参与新股申购和要约收购类股票套利等低风险的投资方式来提高基金收益水平，但此类投资比例不超过基金资产的20%。

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

## 八、基金的投资策略

1、投资依据

（1）国家有关法律、法规、规章和基金合同的有关规定。

（2）宏观经济发展环境和市场利率研判。

（3）各子类资产的收益、风险、流动性的配比关系。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。

2、投资管理程序

（1）研究部和股权投资部、固定收益投资部通过国内外宏观经济分析、货币政策走势分析以及市场资金面等因素就市场利率进行预测，并向投资管理委员会提交投资策略报告，为本基金的投资管理提供决策依据。

（2）投资管理委员会定期召开会议，并依据产品说明和研究结果确定各类资产配置。如遇重大事项，投资管理委员会及时召开临时会议做出决策。

（3）基金经理小组根据投资管理委员会的决议，参考上述报告，并结合自身对固定收益类市场的分析判断，形成基金投资计划并向交易部下达交易指令。

（4）交易部依据指令制定交易策略，进行具体品种的交易。

（5）研究部和监察部对投资组合进行风险监控，并提出调整建议，报股权投资部、固定收益投资部和投资管理委员会。

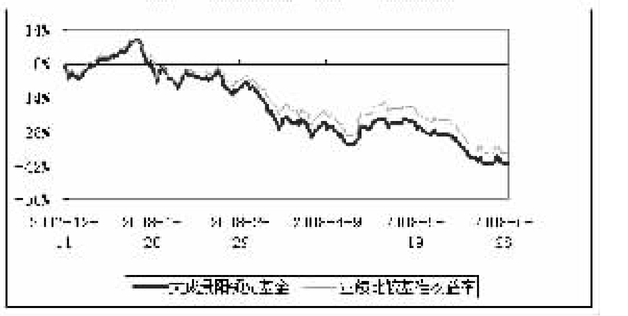
3、投资策略及投资组合管理的方法和标准

本基金根据宏观经济运行状况、货币政策走势及利率走势的综合判断，在控制利率风险、信用风险以及流动性风险等基础上，采取顺势策略控制组合久期的波动范围，充分运用各种套利策略提升组合的持有期收益率，实现基金的保值增值。

（1）资产配置

a.久期管理

本基金通过中信宏观及利率分析系统（如下图所示），对未来的经济和利率走势进行判断。为了充分地控制利率变动风险，在组合久期管理上本基金采取顺势策略，及时对债券投资组合进行调整，组合久期调整上限不超过5年。



b.类属配置

本基金根据国债、金融债、企业债、资产支持证券和可转换债券之间的相对价值，以其历史价格关系的数量分析为依据，同时兼顾特定类属收益的基本面分析。确定整个债券组合中类属债券投资比例。

c.期限结构配置

期限结构配置是债券投资中资产配置的另一个重要方面。在确定组合久期后，针对收益率曲线形态特征确定合理的组合期限结构。与期限结构配置相关的因素主要是市场利率水平的变化方向和幅度的大小，本基金将结合收益率曲线变化的预测，适当选择采用子弹组合、杠铃组合和梯形组合，在长期、中期和短期债券间进行动态调整，从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

（2）组合构建策略与方法

在确定基准久期的配置范围和每类属资产配置的范围以后，在每一类属债券内部，本产品采取一系列策略挑选适合的债券组成策略组合。本基金产品的组合构建策略主要包括：收益率曲线的骑乘套利策略，收益率曲线的形变套利策略和收益率变动在收益率曲线上的传递策略，来充分挖掘收益率曲线动态变化而带来的潜在的投资机会，提升投资组合的相对价值；同时应用跨市场、跨品种的套利策略以及新品种、新业务带来的无风险套利策略提高投资收益，实现基金的保值增值。

（3）债券选择标准

a. 债券的选择

在符合本基金产品资产配置策略和组合构建策略的条件下，根据已经确定的组合久期和期限结构配置来自下而上选择债券品种，在选择具体债券品种时，考虑如下方面：

▶收益率曲线的形状变动

▶单个债券的收益率和基准收益率曲线的偏离

▶债券品种的发行集中度和二级市场交易的集中度分析

▶中央银行公开市场的直接操作情况

b. 流动性分析

银行间债券市场和交易所债券市场的流动性不同，银行间债券市场的双边报价券种和非双边报价券种的流动性不同，不同发行量和发行集中度的债券的流动性不同，不同信用等级的债券流动性也有差异。确定债券组合时根据流动性情况调整组合，保证核心债券组合的流动性。

c. 信用分析

1年期以上债券，如果由国内评估机构进行评估后的信用等级为A+或同等信用，则可作为本基金的备选产品；1年期以内债券，如果由国内评估机构评估后获得该评级机构的最高信用评级，则可作为本基金的备选产品。此外，如果某债券获得了主管机构的豁免评级，可作为本基金的备选产品。

（4）含权债券投资

作为含权固定收益品种，国开行发行的投资人选择权/发行人选择权债券和交易所市场可转换债券均包含进可攻退可守的特征。本基金为保持纯债券基金的风险收益特征，将以其纯债价值作为评价的主要标准，以期权调整后的收益率水平(OAS)为基础，纳入固定收益品种考察。另外，由于可转换债券流动性较差，不具备询价基础，因此严格限制其投资比重。本基金限制可转换债券的投资比重不超过基金资产总值20%的比例，基金规模越小，此比例范围越小，以满足流动性需求。

（5）资产支持证券的投资

资产证券化产品作为固定收益证券的一种，该类产品具有如下特点：能够分享更多领域的债权资产带来的稳定收益；信用级别高且表现稳定；能获得比企业债更高的回报；流动性好。上述特点是本基金选择投资资产支持证券的原因。投资该类品种，关键在于建立科学的定价模型、分析债券风险确定风险补偿，本基金结合国内资产支持证券的特点，在合理的货币利率随机模型、提前还款和坏帐预估水平以及现有中标利差及即期利率期限结构等综合条件下运用蒙特卡罗模拟进行利率路径模拟，估计提前清偿率，确定现金流量，最后用期权定价模型进行合理定价。

（6）新股申购

从我国未来证券市场的发展来看，新老划断之后新股发行仍然会保持一定的数量与规模。由于一、二级市场价差的存在，参与新股申购能够取得较高的固定收益。通过对过往新股发行上市的数据分析，我们发现，新股上市首日卖出，可获得股票市场无风险的固定收益。本基金作为固定收益类产品，为获得目前股票市场存在的固定收益，将在充分研究新发股票基本面的前提下，参与新股的申购，在所得新股上市一个月内全部卖出。

（7）要约收购类股票投资

在收购人公告要约收购报告书后，被收购公司股价经历快速拉升过程之后，股价逐步稳定，距离收购截止日的价格波动幅度小于2%，达到固定收益可投资范围。本基金对于要约收购类股票的投资，仅限于从固定收益的角度出发，自收购人发布要约收购后进行投资。本基金作为固定收益类产品，为获得目前股票市场存在的固定收益，将在严格测算交易成本和投资收益率，充分研究和判断要约收购人的实力和收购意愿的前提下，参与要约收购类股票的投资。

（8）风险管理

本基金采用的风险管理工具是中信风险管理和绩效评估系统。债券投资管理过程中应对的风险主要包括市场风险和流动性风险。中信风险管理和绩效评估系统在久期、基点价值等传统风险指标的基础上，采用VaR度量市场风险；流动性风险的度量，对于交易所市场，采用组合的日收益率标准差和日均换手率等量化指标控制流动性；对于银行间市场，采用有效交易天数、有效交易量和买卖价差等相关指标。

## 九、基金的业绩比较标准

80%×中信全债指数+20%×税后一年期定期存款利率

将来如有更合适的指数推出，基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略，确定变更基金的比较基准或其权重构成。业绩比较基准的变更需经基金管理人与基金托管人协商一致，并在更新的招募说明书中列示。

## 十、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金，高于货币市场基金。

## 十一、基金的投资组合报告

1、截至2008年6月30日期末基金资产组合情况

| 期末各类资产： | 金额（单位：人民币元） | 占基金总资产比例% |
|---|---|---|
| 股票 | 57,526,802.46 | 1.66 |
| 债券 | 2,848,664,374.87 | 82.28 |
| 权证 | 0.00 | 0.00 |
| 银行存款和清算备付金合计 | 505,664,608.18 | 14.60 |
| 其他资产 | 50,470,785.69 | 1.46 |
| 合计： | 3,462,326,571.20 | 100.00 |

2、截至2008年6月30日期末按行业分类的股票投资组合

| 行业分类 | 期末市值（单位：人民币元） | 占基金资产净值比例% |
|---|---|---|
| A 农、林、牧、渔业 | 326,815.28 | 0.01 |
| B 采掘业 | 4,781,343.50 | 0.15 |
| C 制造业 | 45,681,844.81 | 1.47 |
| C0 食品、饮料 | 0.00 | 0.00 |
| C1 纺织、服装、皮毛 | 235,096.40 | 0.01 |
| C2 木材、家具 | 0.00 | 0.00 |
| C3 造纸、印刷 | 240,669.26 | 0.01 |
| C4 石油、化学、塑胶、塑料 | 1,223,907.26 | 0.04 |
| C5 电子 | 452,628.00 | 0.01 |
| C6 金属、非金属 | 1,985,408.70 | 0.06 |
| C7 机械、设备、仪表 | 5,618,147.62 | 0.18 |
| C8 医药、生物制品 | 35,735,156.67 | 1.15 |
| C99 其他制造业 | 190,830.90 | 0.01 |
| D 电力、煤气及水的生产和供应业 | 0.00 | 0.00 |
| E 建筑业 | 0.00 | 0.00 |
| F 交通运输、仓储业 | 0.00 | 0.00 |
| G 信息技术业 | 1,261,844.00 | 0.04 |
| H 批发和零售贸易 | 1,074,994.10 | 0.03 |
| I 金融、保险业 | 0.00 | 0.00 |
| J 房地产业 | 0.00 | 0.00 |
| K 社会服务业 | 3,916,539.02 | 0.13 |
| L 传播与文化产业 | 483,421.75 | 0.03 |
| M 综合类 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 57,526,802.46 | 1.86 |

3、截至2008年6月30日期末基金投资前十名股票明细

| 股票代码 | 股票名称 | 数 量（股） | 期末市值（单位：人民币元） | 占基金资产净值比例% |
|---|---|---|---|---|
| 600351 | 亚宝药业 | 2,832,000 | 35,060,160.00 | 1.13 |
| 601958 | 金钼股份 | 280,925 | 4,781,343.50 | 0.15 |
| 002242 | 九阳股份 | 101,988 | 4,124,394.72 | 0.13 |
| 600236 | 桂冠电力 | 568,630 | 3,747,271.70 | 0.12 |
| 002251 | 步 步 高 | 22,142 | 1,074,994.10 | 0.03 |
| 002237 | 恒邦股份 | 21,890 | 896,833.30 | 0.03 |
| 002233 | 塔牌集团 | 81,297 | 788,580.90 | 0.03 |
| 002249 | 大洋电机 | 29,830 | 722,184.30 | 0.02 |
| 002252 | 上海莱士 | 27,141 | 674,996.67 | 0.02 |
| 002230 | 科大讯飞 | 17,585 | 529,132.65 | 0.02 |

4、截至2008年6月30日期末按品种分类的债券投资组合

| 品种分类 | 市值(单位：人民币元) | 占基金资产净值比例% |
|---|---|---|
| 国家债券投资 | 2,101,912,836.98 | 67.78 |
| 金融债券投资 | 664,083,000.00 | 21.41 |
| 可转换债投资 | 82,668,537.89 | 2.67 |
| 央行票据投资 | 0.00 | 0.00 |
| 企业债券投资 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 2,848,664,374.87 | 91.86 |

5、截至2008年6月30日期末基金投资前五名债券明细表

| 债券名称 | 市值(单位：人民币元) | 占基金资产净值比例% |
|---|---|---|
| 02国债⒂ | 368,829,836.70 | 11.89 |
| 05国债⑼ | 209,060,954.10 | 6.74 |
| 07国开20 | 198,260,000.00 | 6.39 |
| 07国债07 | 197,837,578.17 | 6.38 |
| 07进出11 | 197,560,000.00 | 6.37 |

6、投资组合报告附注

(1) 本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体均无被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

(2)基金投资的前十名股票中，未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

(3)其他资产的构成

| 资产项目 | 金额(单位：人民币元) |
|---|---|
| 存出保证金 | 608,108.06 |
| 应收利息 | 49,859,477.63 |
| 应收申购款 | 3,200.00 |
| 待摊费用 | 0.00 |
| 应收证券清算款 | 0.00 |
| 合计 | 50,470,785.69 |

(4) 截至2008年6月30日本基金期末持有处于转股期的可转换债券

| 债券代码 | 债券名称 | 期末市值（单位：人民币元） | 占基金资产净值比例% |
|---|---|---|---|
| 110598 | 大荒转债 | 39,194,961.60 | 1.26 |
| 110971 | 恒源转债 | 6,841,760.00 | 0.22 |
| 125709 | 唐钢转债 | 10,649,295.15 | 0.34 |

(5)本报告期内投资权证明细

①本报告期没有因股权分置改革被动持有权证

②本报告期因配售分离交易可转债而获得权证

| 权证代码 | 权证名称 | 数量（份） | 成本（单位：人民币元） |
|---|---|---|---|
| 580022 | 国电 CWB1 | 998,203 | 2,338,780.30 |
| 580023 | 康美 CWB1 | 489,140 | 813,823.20 |

③本报告期没有主动投资权证

(6)本报告期末本基金没有持有权证

(7)本报告期末本基金没有持有资产支持证券

## 十二、基金的业绩

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。

本基金合同生效日为2006年7月20日，基金合同生效以来的投资业绩与同期基准的比较如下表所示：

| 阶 段 | 基金净值增长率① | 基金净值增长率标准差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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2006.7.20–2006.12.31 | 3.74% | 0.08% | 1.32% | 0.04% | 2.42% | 0.04% |
| 2007.1.1–2007.12.31 | 21.77% | 0.28% | –0.22% | 0.04% | 21.99% | 0.24% |
| 2008.1.1–2008.6.30 | –1.94% | 0.26% | 2.06% | 0.05% | –4.00% | 0.21% |
| 自基金合同生效之日起至 2008.6.30 | 23.89% | 0.25% | 3.18% | 0.04% | 20.71% | 0.21% |

提示：过往业绩并不代表未来表现。

## 十三、费用概览

（一）与基金销售有关的费用

1、本基金不收取申购和定期定额申购费用。

2、本基金赎回费率不超过赎回金额的0.1%，赎回费率随赎回基金份额持有时间的增加而递减，具体费率如下：

| 持有期限 | 30日以内 | 30日（含）以上 |
|---|---|---|
| 赎回费率 | 0.1% | 0 |

赎回费用＝赎回份数×T日基金份额净值×赎回费率

3、转换费用

（1）由中信经典配置基金、中信红利精选基金向中信稳定双利基金的转换：

A、均仅收取转出基金的赎回费（中信经典配置基金、中信红利精选基金赎回费率一致），具体费用如下：

| 持有时间 | 赎回费率 |
|---|---|
| 一年以内 | 0.5% |
| 满一年（含）– 不满两年 | 0.35% |
| 满两年（含）– 不满三年 | 0.2% |
| 三年以上 | 0 |

B、同一笔转换业务中包含不同持有时间的基金份额，分别按照持有时间收取相应的赎回费用。

（2）由中信稳定双利基金向中信经典配置基金、中信红利精选基金的转换：

A、持有期限在30日以内的中信稳定双利基金向中信经典配置基金、中信红利精选基金转换，每笔转换收取中信稳定双利基金的赎回费及所转入基金的相应申购费，具体如下：

| 转换份额 | 交易费用 |
|---|---|
| 100万以下 | 0.1%赎回费 +1.5%申购费 |
| 100万以上（含 100 万）–200 万以下 | 0.1%赎回费 +1.2%申购费 |
| 200万以上（含 200 万）–500 万以下 | 0.1%赎回费 +0.8%申购费 |
| 500万以上（含 500 万） | 0.1%赎回费 + 每笔 500 元申购费 |

B、由持有期限超过30日（含30日）的中信稳定双利基金向中信经典配置基金、中信红利精选基金转换，每笔转换收取所转入基金的相应申购费，具体如下：

| 转换份额 | 交易费用 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 90天以下 | 91（含）天–365 天 | 366（含）天–730 天 | 731（含）天以上 |
| 100万以下 | 1.5% | 1.25% | 1% | 0 |
| 100万以上（含 100 万）–200 万以下 | 1.2% | 0.95% | 0.7% | 0 |
| 200万以上（含 200 万）–500 万以下 | 0.8% | 0.55% | 0.3% | 0 |
| 500万以上（含 500 万） | 每笔 500 元 | 每笔 500 元 | 每笔 500 元 | 0 |

（3）在中信稳定双利基金、中信现金优势基金之间的转换：

A、由中信现金优势基金向中信稳定双利基金转换不收取任何费用；

B、由中信稳定双利基金向中信现金优势基金转换，仅收取中信稳定双利基金的赎回费，具体费用如下：

| 持有期限 | 30日以内 | 30日（含）以上 |
|---|---|---|
| 赎回费率 | 0.1% | 0 |

（4）转换后的基金份额重新计算持有时间，转换之前的持有时间不累计计算。

（5）通过本公司的网上或电话等电子交易系统进行本公司旗下基金的转换业务，具体费用如下：

| 业务名称 | 交易费用 |
|---|---|
| 由中信经典配置基金、中信红利精选基金向中信稳定双利基金的转换 | 仅收取转出基金的赎回费。 |
| 持有 30 日以内的中信稳定双利基金向中信经典配置基金、中信红利精选基金的转换 | 收取转出基金的赎回费 0.1%及转入基金的申购费 0.6%。 |
| 由持有 30 日（含）以上的中信稳定双利基金向中信经典配置基金、中信红利精选基金的转换 | 仅收取转入基金的申购费 0.6%。 |
| 由中信现金优势基金向中信稳定双利基金的转换 | 费用为 0。 |
| 由中信稳定双利基金向中信现金优势基金的转换 | 持有 30 日以内收取转出基金的赎回费 0.1%；<br>持有 30 日（含）以上费用为 0。 |

4、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，所收取赎回费全部归入基金资产。

（二）与基金运作有关的费用

与基金运作有关的费用包括：基金管理人的管理费；基金托管人的托管费；基金的销售服务费；基金财产拨划支付的银行费用；基金合同生效后的基金信息披露费用；基金合同生效后的与基金相关的会计师费和律师费；基金份额持有人大会费用；基金的证券交易费用；以及其它按照国家有关规定可以在基金资产中列支的其它费用。

上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

（1）基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

H＝E×年管理费率÷当年天数，本基金年管理费率为0.65%

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

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3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

（2）基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

H＝E×年托管费率÷当年天数，本基金年托管费率为0.20%

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

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3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）基金的销售服务费

基金销售服务费用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等。本基金管理人将通过定期的审计和监察稽核监督基金销售服务费的支出和使用情况，确保其用于约定的用途。

在通常情况下，本基金基金份额的销售服务年费率为0.40%，计算方法如下：

基金份额的销售服务费计提的计算公式如下：

H＝E×年销售服务费率÷当年天数

H为每日应计提的销售服务费

E为前一日的基金资产净值

基金的销售服务费每日计提，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3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金销售机构，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

（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。基金募集期间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。

## 十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）及其他有关规定，对本基金招募说明书作如下更新：

（一）"三、基金管理人"部分，变更投资管理委员会成员。

（二）"四、基金托管人"部分，对基金托管人的基本情况及相关业务经营情况进行了更新。

（三）"五、相关服务机构"部分，更新了部分销售机构及经办律师的部分信息。

（四）"九、基金的投资"部分，"基金投资组合报告"部分，增加了最近一期基金投资组合报告。

（五）"十、基金的业绩"部分，增加了最近一期基金业绩和同期业绩比较基准的表现。

（六）"二十二、其他应披露事项"部分，更新最近期间披露事项内容。

上述内容仅为摘要，须与本《招募说明书》（正文）所载之详细资料一并阅读。

中信基金管理有限责任公司
签署日期：2008年8月25日

---

证券代码：600664　股票简称：S哈药　编号：临2008—044

# 哈药集团股份有限公司A股市场相关股东会议表决结果公告

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。

一、重要内容提示

1、本次会议召开期间无增加、否决或修改提案情况。

2、《哈药集团股份有限公司股权分置改革方案实施公告》将于完成有关审批程序后发布于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及上海证券交易所网站，2008年8月22日后本公司股票继续停牌；

3、本公司股票复牌时间详见《哈药集团股份有限公司股权分置改革方案实施公告》。

二、会议召开情况

（一）会议召开时间

1、现场会议召开时间：2008年8月22日下午1:30

2、网络投票时间：2008年8月20日、2008年8月21日、2008年8月22日，每日9:30至11:30，13:00至15:00

（二）现场会议召开地点：黑龙江省哈尔滨市道里区友谊路431号

（三）股权登记日：2008年8月14日

（四）会议召集人：哈药集团股份有限公司董事会

（五）现场会议主持人：董事长郝伟先生

（六）会议方式：本次会议采取现场投票、委托投票与网络投票相结合的方式，本次大会通过上海证券交易所（下称"上交所"）交易系统向A股流通股股东提供网络形式的投票平台，A股流通股股东可以在网络投票时间内通过上述网络投票平台行使表决权。

（七）本次会议的召集、召开符合《中华人民共和国公司法》、《上市公司股东大会规范意见》、《上市公司股权分置改革管理办法》等法律法规和本公司章程的规定。

三、会议出席情况

本公司股份总数为1,242,005,473股，其中非流通股股份总数为431,705,866股，流通A股股份总数为810,299,607股。

1、总体出席情况

参加本次会议现场投票、委托董事会投票、通过网络投票表决的本公司股东（包括代理人）共1,586人，代表股份1,026,769,090股，占本公司股份总数的82.67%。

2、非流通股股东出席情况

参加本次会议的非流通股股东代表共1人，代表股份431,705,866股，占本公司非流通股股份总数的100%，占本公司股份总数的34.76%。

3、流通股股东出席情况

参加本次会议现场投票、委托董事会投票、通过网络投票表决的本公司流通股股东（包括代理人）共1,585人，代表股份595,063,224股，占本公司流通股股份总数的73.44%，占本公司股份总数的47.91%。

其中：现场投票表决及委托董事会投票表决的流通股股东（包括代理人）共3人，代表股份84,816,223股，占本公司流通股股份总数的10.47%，占本公司股份总数的6.83%；通过网络投票表决的流通股股东共1,582人，代表股份510,247,001股，占本公司流通股股份总数的62.97%，占本公司股份总数的41.08%。

4、本公司部分董事、监事、高级管理人员及保荐机构代表、见证律师参加了本次会议。

四、议案审议情况

本次会议审议了《哈药集团股份有限公司股权分置改革方案》，详情请参阅本公司于2008年8月11日在上海证券交易所网站(www.sse.com.cn)上公布的《哈药集团股份有限公司股权分置改革方案说明书》(修订稿)。

五、议案表决情况

本次会议以记名投票方式对《哈药集团股份有限公司股权分置改革方案》进行了表决。参加本次会议的有表决权股份总数为1,026,769,090股，其中非流通股股份总数为431,705,866股，流通股股份总数为595,063,224股。

1、总体表决情况

同意983,508,582股，占参加本次会议有表决权股份总数的95.7867%；

反对43,212,907股，占参加本次会议有表决权股份总数的4.2086%；

弃权47,601股，占参加本次会议有表决权股份总数的0.0047%。

2、非流通股股东表决情况

同意431,705,866股，占参加本次会议非流通股股份总数的100%；

反对0股，占参加本次会议非流通股股份总数的0%；

弃权0股，占参加本次会议非流通股股份总数的0%。

3、流通股股东表决情况

同意551,802,716股，占参加本次会议流通股股份总数的92.73%；

反对43,212,907股，占参加本次会议流通股股份总数的7.26%；

弃权47,601股，占参加本次会议流通股股份总数的0.01%。

4、参加表决的前十大流通股股东表决情况

| 序号 | 股东名称 | 持股总数 | 表决结果 |
|---|---|---|---|
| 1 | 中国建银投资有限责任公司 | 178,892,665 | 同意 |
| 2 | 南方证券有限公司 | 84,810,063 | 同意 |
| 3 | 中国证券投资者保护基金有限责任公司 | 32,973,446 | 同意 |
| 4 | 中国农业银行上海市分行 | 15,871,020 | 同意 |
| 5 | 上海市五角场农村信用合作社联合社 | 13,881,416 | 同意 |
| 6 | 深圳市创新投资集团有限公司 | 13,500,000 | 同意 |
| 7 | 中国建设银行–华夏红利混合型开放式证券投资基金 | 13,271,077 | 同意 |
| 8 | 中国农业银行–大成创新成长混合型证券投资基金 | 12,106,461 | 同意 |
| 9 | 青岛港（集团）有限公司 | 11,565,400 | 同意 |
| 10 | 上海市浦东环线工程建设公司 | 11,562,987 | 反对 |

5、表决结果

本次会议审议的《哈药集团股份有限公司股权分置改革方案》已经参加表决的股东所持表决权的三分之二以上同意，并经参加表决的流通股股东所持表决权的三分之二以上同意，相关股东会议通过了该方案。

六、律师见证情况

本次相关股东会议由北京共和律师事务所胡晓华律师、赵苗苗律师进行全过程见证并出具法律意见书，认为：

本次会议的召集、召开、表决程序符合相关法律、法规和关于股权分置改革规范性文件的规定，出席会议人员的资格合法、有效，本次会议通过的决议合法、有效。

七、备查文件

1、哈药集团股份有限公司股权分置改革相关股东会议决议；

2、北京市共和律师事务所关于哈药集团股份有限公司股权分置改革相关股东会会议的法律意见书。

3、《哈药集团股份有限公司股权分置改革方案说明书》(修订稿)。

特此公告。

哈药集团股份有限公司董事会
2008年8月22日

---

证券简称：南方航空　证券代码：600029　公告编号：临2008–27

# 中国南方航空股份有限公司2007年度资本公积金转增股本实施公告

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：

◆本公司以2007年12月31日的总股本4,374,178,000股为基数，以资本公积金每10股转增5股，每股转增0.5股。

◆资本公积金转增股本时，有限售条件股所获股份为有限售条件股，新增股份的限售期与原有限售条件股一致；无限售条件股所获股份为无限售条件股。

◆股权登记日：2008年8月28日

◆除权日：2008年8月29日

◆新增无限售条件股上市日：2008年9月1日

一、通过资本公积金转增股本方案的股东大会情况

中国南方航空股份有限公司2007年度资本公积金转增股本方案已经2008年6月25日2007年度股东大会和2008年第一次H股类别股东大会、2008年第一次A股类别股东大会审议通过，并经商务部批复同意(商资批[2008]1094号)。本公司以2007年12月31日的总股本4,374,178,000股为基数，按照每10股转5股，向全体股东转增2,187,089,000股，转增后的总股数为6,561,267,000股。

二、资本公积金转增股本方案

1、发放年度：2007年度

2、发放范围：于2008年8月28日下午3时上海证券交易所收市后，在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司登记在册的A股股东。

3、本次分配以4,374,178,000股为基数，向全体股东每10股转增5股，实施后总股本为6,561,267,000股，增加2,187,089,000股，转增后的总股数为6,561,267,000股。

4、分派对象：截止2008年8月28日（A股股权登记日）下午上海证券交易所收市后，在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司登记在册的全体股东。

三、实施日期

1、股权登记日：2008年8月28日

2、除权日：2008年8月29日

3、新增可流通股份上市流通日：2008年9月1日

四、资本公积金转增股本实施办法

本次派送的资本公积金转增股本由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司通过其计算机网络，根据股权登记日在册的股东持股数，按转增比例自动计入股东账户。转增股本过程中产生的不足1股的部分，按小数点后尾数大小排序向股东依次送1股，直至实际送转股份总数与本次送转股份总数一致。如果尾数相同者多于余股数，则由电脑抽签派送。

五、股本变化情况表

单位：股

| | 本次变动前 | | 公积金转股 | 本次变动后 | |
|---|---|---|---|---|---|
| | 数量 | 比例（%） | | 数量 | 比例（%） |
| 一、有限售条件股份 | | | | | |
| 1.国家持股 | 2,200,000,000 | 50.3 | 1,100,000,000 | 3,300,000,000 | 50.3 |
| 二、无限售条件流通股份 | | | | | |
| 1.人民币普通股 | 1,000,000,000 | 22.86 | 500,000,000 | 1,500,000,000 | 22.86 |
| 3.境外上市的外资股 | 1,174,178,000 | 26.84 | 587,089,000 | 1,761,267,000 | 26.84 |
| 三、股份总数 | 4,374,178,000 | 100 | 2,187,089,000 | 6,561,267,000 | 100 |

六、本公司实施资本公积金转增股本方案后，按新股本总数6,561,267,000股摊薄计算的2007年度每股收益为0.28元(按中国会计准则)。

七、咨询事项

咨询机构：中国南方航空股份有限公司董事会秘书办公室
咨询电话：020–86124462
传真：020–86659040
邮编：510405
地址：广州市机场路278号

八、备查文件

1、南方航空2007年度股东大会决议公告；

2、南方航空2008年第一次H股和第一次A股类别股东大会决议公告；

3、《商务部关于同意中国南方航空股份有限公司增加注册资本等事项的批复》(商资批[2008]1094号)。

中国南方航空股份有限公司董事会
2008年8月22日

---

证券代码：600143　证券简称：金发科技　公告编号：临2008–37

# 金发科技股份有限公司股票交易异常波动公告

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。

一、公司股票交易异常波动的具体情况

截至2008年8月22日上海证券交易所收市，公司股票价格连续三个交易日(2008年8月20日、21日、22日)内收盘价格跌幅偏离值累计达到20%。

二、公司关注并核实的相关情况

经向公司控股股东袁志敏先生书面函证并得到回复函。截止目前及未来三个月内没有对"金发科技"进行股权转让、重大资产重组等将对公司股价产生重大影响的事宜。

三、不存在应披露而未披露的重大信息的声明

经核查，截止公告日，本公司董事会确认，本公司没有任何根据《上海证券交易所股票上市规则》等有关规定应予以披露而未披露的事项或与该事项有关的筹划、商谈、意向、协议等，董事会也未获悉本公司有根据《上海证券交易所股票上市规则》等有关规定应予披露而未披露的、对本公司股票及其衍生品种交易价格产生较大影响的信息。

四、风险提示

《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和上海证券交易所网站是公司选定的信息披露报纸和信息披露网站，本公司发布的信息以在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和上海交易所网站为准，敬请广大投资者理性投资，注意投资风险。

特此公告。

金发科技股份有限公司
董 事 会
2008年8月25日