

## 广发稳健增长开放式证券投资基金招募说明书【更新】摘要

(上接 C9版)  
电话:0791-6285337  
传真:0791-6289395  
客户服务电话:0791-6272572,6283827  
公司网址:www.gsfund.com

(63)名称:恒泰证券有限责任公司  
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:刘汝军  
联系人:常向东  
电话:0471-4913998  
传真:0471-4930707  
客户服务电话:0471-4961259  
公司网址:www.chht.com.cn  
(64)名称: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:谢亚凡、韩晓光  
电话:010-59226788  
传真:010-59226840  
客户服务电话:400-887-8827  
公司网址:www.ubssecurities.com  
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。

(二)注册登记机构  
名称:广发基金管理有限公司  
住所:广东省珠海市凤凰北路19号农商行大厦1208室  
法定代表人:马庆泉  
办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔32楼  
联系人:李尔华  
电话:020-89899129  
传真:020-89899175

(三)律师事务所和经办律师  
名称:国浩律师集团(广州)事务所  
住所:广东省广州市体育西路189号城建大厦9楼  
负责人:程霖  
电话:020-38799345  
传真:020-38799335  
经办律师:程霖、章小波  
联系人:程霖

(四)会计师事务所和经办注册会计师  
名称:深圳鹏城会计师事务所  
办公地址:深圳市东门南路2006号宝丰大厦5楼  
法人代表:饶克昌  
联系人:杨克昌  
电话:0755-82203222  
传真:0755-82237549  
经办注册会计师:杨克昌、侯立勋

广发稳健增长开放式证券投资基金  
五、基金的投资  
基金的投资目标  
在承担适度风险的基础上分享中国经济和证券市场的成长,寻求基金资产的长期稳健增长。

七、基金的投资范围  
本基金投资的标的包括国内依法公开发行的各类股票、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

其中股票投资对象主要为大盘绩优行业和规模适中、管理良好、具有竞争优势、有望成长为行业领袖的企业,分享中国经济的持续增长。债券投资包括国内依法公开发行、上市的国债、金融债、企业债和可转债等。

八、基金的投资策略  
(一)资产配置策略  
基于对宏观经济、政策及证券市场的现状和发展趋势的深入分析研究,以稳健投资的原则在股票、债券、现金之间进行资产配置,以降低投资风险,股票投资比例为65%,下限为3%。

(二)股票投资策略  
在股票投资上,运用优化成长投资方法投资于价格低于内在价值的股票。股票投资对象主要是大盘绩优行业和规模适中、管理良好、竞争优势明显、有望成长为行业领先企业的大上市公司。

具体的股票备选库构建程序如下:  
主要包括运用“广发财务危机预警模型”及根据相关规定筛选股票,以确保投资对象是财务稳健的公司,控制投资风险,在此基础上建立一级股票库。一级股票库股票数量为600-600只。

在一级股票库的基础上应用优化成长投资方法构建二级股票库,二级股票库的数目为200只左右。优化成长投资方法是指以合理的价格投资持续成长的大上市公司。该方法的定量分析指标为(p/e)vg和(n/p)vg,该方法的定性分析因素主要包括:

- 1.公司所处行业是否具有良好的发展前景;
- 2.公司是否具有良好的法人治理结构;
- 3.公司主营业务的市场需求总量是否有持续增长或者市场集中度、市场占有率是否有显著提高的可能;
- 4.公司的关键技术是否具有一定的垄断性和领先性;
- 5.公司的工艺水平、成本控制能力有无大幅度的提高的可能;
- 6.公司经营状况和财务状况是否稳健;
- 7.其他因素,如政府监管政策的变动、国际间产业转移等其他因素。

(三)债券投资策略  
在债券投资上,坚持稳健投资的策略,控制债券投资风险。具体包括利率预期策略、收益曲线策略、债券资产类别配置和债券分析。

本基金将在利率合理预期的基础上,通过久期管理,稳健地进行债券投资,控制债券投资风险。尤其是在预期利率上升的时候,严格控制,保持债券投资组合较小的久期,降低债券投资风险。

九、业绩比较基准  
65%“中信标普300指数收益+35%”中信标普国债指数收益。

十、风险收益特征  
适度风险基础上的基金资产稳健增长。

十一、基金投资运作报告  
基金管理人中国工商银行根据本基金基金合同规定,于2008年8月25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。

本报告投资组合所披露截至2008年6月30日,本报告中所列财务数据未经审计。  
(一)期末基金资产配置组合

数据	币种(元)	占资产净值之比
银行存款	5,433,146,811.97	62.73%
债券	2,339,403,512.09	27.43%
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	702,363,194.76	8.24%
其他资产	50,603,630.66	0.59%
合计	8,524,628,157.47	100.00%

(二)期末按行业分类的股票投资组合

行业	市值	净值比
A.农林牧渔	-	-
B.制造业	707,529,093.06	8.32%
C.采矿业	1,166,631,541.26	13.68%
C0.食品饮料	32,115,284.88	0.38%
C1.纺织服装、鞋帽	80,198,177.44	0.94%
C2.木材、家具	34,348,633.48	0.40%
C3.造纸印刷	-	-
C4.石化、化工、塑胶、塑料	-	-
C5.医药、生物制品	18,401,810.94	0.22%
C6.金属、非金属	7,000,000	0.08%
C7.机械、设备、仪表	1,006,000,294.38	11.81%
C8.医药、生物制品	29,796,858.89	0.35%
C9.其他制造业	-	-
D.电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E.建筑业	-	-
F.交通运输、仓储业	206,209,871.86	2.43%
G.信息技术业	362,306,134.04	4.13%
H.批发和零售业	383,363,019.10	4.50%
I.房地产业	184,162,426.44	2.15%
J.金融、保险业	917,367,077.46	10.65%
K.社会服务业	-	-
L.商业贸易业	-	-
M.综合类	106,508,569.32	1.24%
合计	5,433,146,811.97	63.97%

(三)期末基金投资前十名股票明细

股票代码	股票名称	数(万股)	币(元)	市值占净值比
601019	浦发银行	17,068,513	434,480,339.11	5.12%
002024	苏宁电器	8,500,000	351,050,000.00	4.13%
600048	保利地产	24,050,000	324,434,560.00	3.82%
601880	紫金矿业	9,091,792	311,614,900.92	3.67%
600090	浦发银行	13,008,627	299,309,014.00	3.51%
600028	中国石化	7,000,000	299,200,000.00	3.50%
600035	中国铝业	30,566,500	277,238,150.00	3.28%
000003	中兴通讯	19,400,062	263,586,679.60	3.09%
000000	浦发银行	9,056,019	228,042,072.15	2.69%
600026	中海油服	10,120,000	209,244,271.86	2.46%

(四)期末按券种分类的债券投资组合

债券类别	债券市值(元)	占资产净值之比
交易所国债投资	489,750,000.00	5.68%
银行间国债投资	439,414,000.00	5.18%
央行票据投资	1,153,650,000.00	13.54%
其他债券投资	-	-
合计	2,082,814,000.00	24.40%

(五)期末债券投资前五名组合

(四)公司在一年内购买、出售重大资产或者担保金额超过公司最近一期经审计总资产30%;  
(五)公司为资产负债率超过70%的担保对象提供担保;  
(六)股权激励计划、员工持股计划、以及股东大会以普通决议方式会对公司产生重大影响的、需要以特别决议通过的有关事项。

4.期限:  
第一百二十一条 董事会确定资产项目(对外收购、收购出售资产、资产抵押、对外担保事项,委托理财、关联交易)的权限,建立严格的审查和决策程序;重大投资项目应当组织有关专家、专业人员进行评审,并报股东大会批准。

其中,对外收购、收购出售资产、资产抵押、对外担保事项、委托理财的权限如下:  
(一)金额超过300万元或占公司最近一期经审计净资产的5%(含5%)至10%之间的,应由公司董事会过半数通过方能生效;

(二)金额占公司最近一期经审计净资产的10%(含10%)至15%之间的,应由公司董事会三分之二通过方能生效;

(三)金额占公司最近一期经审计净资产的15%(含15%)以上的,应由公司董事会三分之二通过并提交股东大会一般决议通过方能生效。

关联交易事项(获赠现金资产和提供担保除外)金额在3000万元以下,或占公司最近一期经审计净资产的0.5%以下,且占公司最近一期经审计总资产的5%以下,且占公司最近一期经审计净资产的0.5%以下,应当履行报告义务,不需相关交易事项的中介机构,对交易标的进行资产评估,并须经交易提交股东大会审议。

修改为:  
第一百二十三条 董事会确定资产项目(对外收购、收购出售资产、资产抵押、对外担保事项,委托理财、关联交易)的权限,建立严格的审查和决策程序;重大投资项目应当组织有关专家、专业人员进行评审,并报股东大会批准。

其中,对外收购、收购出售资产、资产抵押、委托理财的权限如下:  
(一)金额超过300万元或占公司最近一期经审计净资产的5%(含5%)至10%之间的,应由公司董事会过半数通过方能生效;

(二)金额占公司最近一期经审计净资产的10%(含10%)至15%之间的,应由公司董事会三分之二通过方能生效;

(三)金额占公司最近一期经审计净资产的15%(含15%)以上的,应由公司董事会三分之二通过并提交股东大会一般决议通过方能生效。

关联交易事项(除内幕交易和第四十一条和其他相关法律法规规定的应由股东大会审议之外的对外担保行为,对外担保事项,除内幕交易和第四十一条和其他相关法律法规规定的应由股东大会审议之外的对外担保行为,对外担保事项(获赠现金资产和提供担保除外)金额在3000万元以下,或占公司最近一期经审计净资产的0.5%以下,应由公司董事会三分之二通过方能生效;金额在3000万元以上的,且占公司最近一期经审计总资产的5%以上,应当履行报告义务,不需相关交易事项的中介机构,对交易标的进行资产评估,并须经交易提交股东大会审议。

5.期限:  
第一百二十三条 董事会依据重大事项集体决策及有效监督原则授权董事长闭会期间,行使以下职权:

1.单一资产项目(关联交易除外)总额在300万元以下或占公司最近一次经审计总资产5%以下的,经严格调查、论证后,由董事长兼总经理处理;决定;

2.对重大经营合同,由总经理提出方案,经总经理审核后,董事长可授权总经理签订;

3.公司对外投资事项由控股子公司派员加入董事、监事的事项,相应的候选人可由董事长提名,董事会决定推荐。

修改为:  
第一百二十三条 董事会依据重大事项集体决策及有效监督原则,授权董事长在董事会闭会期间,行使以下职权:

1.单一资产项目(关联交易除外)总额在300万元以下或占公司最近一次经审计总资产5%以下的,经严格调查、论证后,由董事长兼总经理处理;决定;

2.对重大经营合同,由总经理提出方案,经总经理审核后,董事长可授权总经理签订;

3.公司对外投资事项由控股子公司派员加入董事、监事的事项,相应的候选人可由董事长提名,董事会决定推荐。

除上述条款外,《公司章程》其他条款均有效。  
证券简称:国统股份 编号:2008-050

新疆国统管道股份有限公司  
关联交易采购公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

一、关联交易概述

1. 交易内容

2. 交易背景

3. 交易目的

4. 交易程序

5. 关联交易的影响

6. 独立董事意见

7. 监事会意见

8. 备查文件

9. 备查文件

10. 备查文件

11. 备查文件

12. 备查文件

13. 备查文件

债券名称	数量	币(元)	市值占净值比
08国债24	6,000,000	576,480,000.00	6.79%
21国债06	5,000,000	499,750,000.00	5.88%
08国债13	3,000,000	299,340,000.00	3.51%
08国债16	3,000,000	298,300,000.00	3.49%
08国债33	3,000,000	298,270,000.00	3.49%

(六) 本基金本报告末无权证投资。  
(七) 投资组合报告附注

1. 本基金持有的每只股票的价值均不超过基金资产净值的10%。  
2. 报告期内本基金投资的前十名股票的发行主体未被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

3. 本基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。  
4. 本基金本报告期末其他资产构成包括买入保证金3,351,168.50元,应收利息34,889,619.97元,应收申购款12,362,850.19元,合计为50,603,630.66元。  
5. 截至2008年6月30日,本基金持有的处于转股期的可转换债券明细:

债券代码	债券名称	币(元)	市值占净值比
120900	招商转债	74,071,800.00	0.87%
120901	国投转债	17,076,033.62	0.20%
120909	招商转债	164,731,676.67	1.92%

6. 本报告期末本基金所获得的权证投资,其数量与成本总额列示如下:

权证代码	权证名称	权证数量(份)	成本总额(元)	期末余额(元)	期末市值(元)
580019	石化CWB1	1,327,347	3,076,387.41	-	-

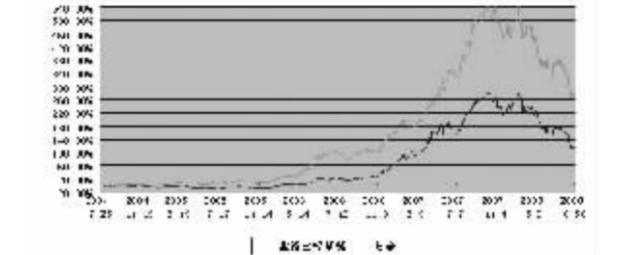
7. 本报告期末本基金未持有资产支持证券。  
二、基金业绩

本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。基金的实际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。基金业绩数据截至2008年6月30日。

1. 本基金报告期单位净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

阶段	净值增长率(%)	净值增长率与业绩比较基准收益率的差额(%)	(1)-(2)	(1)-(3)	(2)-(4)
2004.7.20-2004.12.31	-0.51%	0.0064	-4.73%	0.0087	4.22%
2005.1-2005.12.31	16.07%	0.0047	-0.02%	0.0088	17.70%
2006.1-2006.12.31	15.43%	0.0177	80.65%	0.0082	45.98%
2007.1-2007.12.31	138.78%	0.0138	104.73%	0.0154	52.22%
2008.1-2008.6.30	-38.06%	0.0231	-28.34%	0.0159	-16.11%
自基金合同生效以来	273.60%	0.0144	113.53%	0.0126	162.03%

2. 本基金自基金合同生效以来单位基金资产净值的变动与同期业绩比较基准比较图



注:(1) 业绩比较基准:65%“中信标普300指数收益+35%”中信标普国债指数收益。  
(2) 本基金图示期间为2004年7月23日至2008年6月30日。

三、基金的费用  
(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) 证券交易费用;  
(4) 基金信息披露费用;  
(5) 基金银行划款手续费;  
(6) 基金合同生效后与基金相关的会计师费与律师费;  
(7) 按照国家有关规定可以列入的其他费用。

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  
本基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提。管理费率的计算方法如下:  
 $H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$   
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,基金托管人复核后于次月首两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

(2) 基金托管人的托管费  
基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:  
 $H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$

四、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余额。基金资产净值由基金管理人计算,基金托管人复核。基金管理人应当每日计算基金资产净值,并定期公告。

五、基金收益分配原则  
(一) 基金收益分配原则  
1. 基金收益分配方式为现金分红和红利再投资;  
2. 基金收益分配应尊重基金份额持有人的利益,在不影响基金份额持有人利益的前提下,基金管理人可调整收益分配原则;基金管理人有权决定基金收益分配方案;  
3. 基金收益分配时,基金管理人将采取必要措施,以确保基金收益分配的及时性、准确性和完整性;基金管理人有权决定基金收益分配方案;  
4. 基金收益分配时,基金管理人将采取必要措施,以确保基金收益分配的及时性、准确性和完整性;基金管理人有权决定基金收益分配方案;

(二) 基金收益分配程序  
1. 基金收益分配方案经基金管理人制定,并经基金托管人复核;  
2. 基金收益分配方案经基金管理人制定,并经基金托管人复核;  
3. 基金收益分配方案经基金管理人制定,并经基金托管人复核;

(三) 基金收益分配的公告  
基金收益分配方案经基金管理人制定,并经基金托管人复核,基金管理人应当及时公告。

(四) 基金收益分配的支付方式  
基金收益分配方式为现金分红和红利再投资,基金管理人应当及时公告。

(五) 基金收益分配的税务处理  
基金收益分配时,基金管理人将采取必要措施,以确保基金收益分配的及时性、准确性和完整性;基金管理人有权决定基金收益分配方案;

(六) 基金收益分配的会计处理  
基金收益分配时,基金管理人将采取必要措施,以确保基金收益分配的及时性、准确性和完整性;基金管理人有权决定基金收益分配方案;

(七) 基金收益分配的审计  
基金收益分配时,基金管理人将采取必要措施,以确保基金收益分配的及时性、准确性和完整性;基金管理人有权决定基金收益分配方案;

(八) 基金收益分配的披露  
基金收益分配时,基金管理人将采取必要措施,以确保基金收益分配的及时性、准确性和完整性;基金管理人有权决定基金收益分配方案;

(九) 基金收益分配的变更  
基金收益分配时,基金管理人将采取必要措施,以确保基金收益分配的及时性、准确性和完整性;基金管理人有权决定基金收益分配方案;

(十) 基金收益分配的终止  
基金收益分配时,基金管理人将采取必要措施,以确保基金收益分配的及时性、准确性和完整性;基金管理人有权决定基金收益分配方案;

(十一) 基金收益分配的生效  
基金收益分配时,基金管理人将采取必要措施,以确保基金收益分配的及时性、准确性和完整性;基金管理人有权决定基金收益分配方案;

(十二) 基金收益分配的无效  
基金收益分配时,基金管理人将采取必要措施,以确保基金收益分配的及时性、准确性和完整性;基金管理人有权决定基金收益分配方案;

(十三) 基金收益分配的撤销  
基金收益分配时,基金管理人将采取必要措施,以确保基金收益分配的及时性、准确性和完整性;基金管理人有权决定基金收益分配方案;

(十四) 基金收益分配的变更  
基金收益分配时,基金管理人将采取必要措施,以确保基金收益分配的及时性、准确性和完整性;基金管理人有权决定基金收益分配方案;

(十五) 基金收益分配的终止  
基金收益分配时,基金管理人将采取必要措施,以确保基金收益分配的及时性、准确性和完整性;基金管理人有权决定基金收益分配方案;

(十六) 基金收益分配的无效  
基金收益分配时,基金管理人将采取必要措施,以确保基金收益分配的及时性、准确性和完整性;基金管理人有权决定基金收益分配方案;

(十七) 基金收益分配的撤销  
基金收益分配时,基金管理人将采取必要措施,以确保基金收益分配的及时性、准确性和完整性;基金管理人有权决定基金收益分配方案;

(十八) 基金收益分配的变更  
基金收益分配时,基金管理人将采取必要措施,以确保基金收益分配的及时性、准确性和完整性;基金管理人有权决定基金收益分配方案;

(十九) 基金收益分配的终止  
基金收益分配时,基金管理人将采取必要措施,以确保基金收益分配的及时性、准确性和完整性;基金管理人有权决定基金收益分配方案;

(二十) 基金收益分配的无效  
基金收益分配时,基金管理人将采取必要措施,以确保基金收益分配的及时性、准确性和完整性;基金管理人有权决定基金收益分配方案;

(二十一) 基金收益分配的撤销  
基金收益分配时,基金管理人将采取必要措施,以确保基金收益分配的及时性、准确性和完整性;基金管理人有权决定基金收益分配方案;

(二十二) 基金收益分配的变更  
基金收益分配时,基金管理人将采取必要措施,以确保基金收益分配的及时性、准确性和完整性;基金管理人有权决定基金收益分配方案;

(二十三) 基金收益分配的终止  
基金收益分配时,基金管理人将采取必要措施,以确保基金收益分配的及时性、准确性和完整性;基金管理人有权决定基金收益分配方案;

(二十四) 基金收益分配的无效  
基金收益分配时,基金管理人将采取必要措施,以确保基金收益分配的及时性、准确性和完整性;基金管理人有权决定基金收益分配方案;

(二十五) 基金收益分配的撤销  
基金收益分配时,基金管理人将采取必要措施,以确保基金收益分配的及时性、准确性和完整性;基金管理人有权决定基金收益分配方案;

(二十六) 基金收益分配的变更  
基金收益分配时,基金管理人将采取必要措施,以确保基金收益分配的及时性、准确性和完整性;基金管理人有权决定基金收益分配方案;

(二十七) 基金收益分配的终止  
基金收益分配时,基金管理人将采取必要措施,以确保基金收益分配的及时性、准确性和完整性;基金管理人有权决定基金收益分配方案;

(二十八) 基金收益分配的无效  
基金收益分配时,基金管理人将采取必要措施,以确保基金收益分配的及时性、准确性和完整性;基金管理人有权决定基金收益分配方案;

(二十九) 基金收益分配的撤销  
基金收益分配时,基金管理人将采取必要措施,以确保基金收益分配的及时性、准确性和完整性;基金管理人有权决定基金收益分配方案;

(三十) 基金收益分配的变更  
基金收益分配时,基金管理人将采取必要措施,以确保基金收益分配的及时性、准确性和完整性;基金管理人有权决定基金收益分配方案;

(三十一) 基金收益分配的终止  
基金收益分配时,基金管理人将采取必要措施,以确保基金收益分配的及时性、准确性和完整性;基金管理人有权决定基金收益分配方案;

(三十二) 基金收益分配的无效  
基金收益分配时,基金管理人将采取必要措施,以确保基金收益分配的及时性、准确性和完整性;基金管理人有权决定基金收益分配方案;

(三十三) 基金收益分配的撤销  
基金收益分配时,基金管理人将采取必要措施,以确保基金收益分配的及时性、准确性和完整性;基金管理人有权决定基金收益分配方案;

(三十四) 基金收益分配的变更  
基金收益分配时,基金管理人将采取必要措施,以确保基金收益分配的及时性、准确性和完整性;基金管理人有权决定基金收益分配方案;

(三十五) 基金收益分配的终止  
基金收益分配时,基金管理人将采取必要措施,以确保基金收益分配的及时性、准确性和完整性;基金管理人有权决定基金收益分配方案;

(三十六) 基金收益分配的无效  
基金收益分配时,基金管理人将采取必要措施,以确保基金收益分配的及时性、准确性和完整性;基金管理人有权决定基金收益分配方案;

(三十七) 基金收益分配的撤销  
基金收益分配时,基金管理人将采取必要措施,以确保基金收益分配的及时性、准确性和完整性;基金管理人有权决定基金收益分配方案;

(三十八) 基金收益分配的变更  
基金收益分配时,基金管理人将采取必要措施,以确保基金收益分配的及时性、准确性和完整性;基金管理人有权决定基金收益分配方案;

(三十九) 基金收益分配的终止  
基金收益分配时,基金管理人将采取必要措施,以确保基金收益分配的及时性、准确性和完整性;基金管理人有权决定基金收益分配方案;

(四十) 基金收益分配的无效  
基金收益分配时,基金管理人将采取必要措施,以确保基金收益分配的及时性、准确性和完整性;基金管理人有权决定基金收益分配方案;

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