

(上接 D46 版)

合并所有者权益变动表 2009年1—6月									
单位:元 币种:人民币									
项目	本期金额						少数股东权益	所有者权益合计	
	股本	资本公积	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	其他			
一、上年年末余额	312,000,000.00	536,995,121.27	48,334,820.46	-102,713,419.77	182,130,490.86	976,745,012.82			
加:同一控制下企业合并产生的权益调整									
会计政策变更									
前期差错更正									
其他									
二、本年年初余额	312,000,000.00	536,995,121.27	48,334,820.46	-102,713,419.77	182,130,490.86	976,745,012.82			
三、本期增减变动金额(减少以“-”号填列)	6,405,000.00			25,513,691.40	-7,549,562.99	24,369,128.41			
(一)净利润				25,513,691.40					
(二)直接计入所有者权益的利得和损失	6,405,000.00								
1.可供出售金融资产公允价值变动净额	8,540,000.00								
2.权益法下被投资单位其他所有者权益变动的的影响									
3.与计入所有者权益项目相关的所得税影响	-2,135,000.00								
4.其他	6,405,000.00								
上述(一)和(二)小计									
(三)所有者投入和减少资本									
1.所有者投入资本									
2.股份支付计入所有者权益的金额									
3.其他									
(四)利润分配									
1.提取盈余公积									
2.提取一般风险准备									
3.对所有者或股东的分配									
4.其他									
(五)所有者权益内部结转									
1.资本公积转增资本(或股本)									
2.盈余公积转增资本(或股本)									
3.盈余公积弥补亏损									
4.其他									
四、本期期末余额	312,000,000.00	543,390,121.27	48,334,820.46	-77,199,728.37	174,580,927.87	1,001,114,141.23			

合并所有者权益变动表 2009年1—6月									
单位:元 币种:人民币									
项目	本期金额						少数股东权益	所有者权益合计	
	股本	资本公积	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	其他			
一、上年年末余额	240,000,000.00	676,898,224.24	48,334,820.46	40,371,307.10	141,684,751.86	1,147,289,103.66			
加:同一控制下企业合并产生的权益调整									
会计政策变更									
前期差错更正									
其他									
二、本年年初余额	240,000,000.00	676,898,224.24	48,334,820.46	40,371,307.10	141,684,751.86	1,147,289,103.66			
三、本期增减变动金额(减少以“-”号填列)	-18,235,102.97			15,758,847.49	10,419,856.66	-12,056,398.82			
(一)净利润				15,758,847.49	10,419,856.66	26,178,704.15			
(二)直接计入所有者权益的利得和损失	-18,235,102.97								
1.可供出售金融资产公允价值变动净额	-50,980,137.30								
2.权益法下被投资单位其他所有者权益变动的的影响									
3.与计入所有者权益项目相关的所得税影响	12,745,034.33								
4.其他	-18,235,102.97								
上述(一)和(二)小计									
(三)所有者投入和减少资本									
1.所有者投入资本									
2.股份支付计入所有者权益的金额									
3.其他									
(四)利润分配									
1.提取盈余公积									
2.提取一般风险准备									
3.对所有者或股东的分配									
4.其他									
(五)所有者权益内部结转									
1.资本公积转增资本(或股本)									
2.盈余公积转增资本(或股本)									
3.盈余公积弥补亏损									
4.其他									
四、本期期末余额	240,000,000.00	638,663,121.27	48,334,820.46	56,130,154.59	152,104,608.52	1,135,232,704.84			

公司法定代表人:杨国平 主管会计工作负责人:宋敏璇 会计机构负责人:王礼明

母公司所有者权益变动表

2009年1—6月

单位:元 币种:人民币									
项目	本期金额						少数股东权益	所有者权益合计	
	股本	资本公积	减:库存股	盈余公积	未分配利润	其它			
一、上年年末余额	312,000,000.00	536,997,761.08		48,334,820.46	-15,849,470.38	881,483,111.16			
加:会计政策变更									
前期差错更正									
其他									
二、本年初余额	312,000,000.00	536,997,761.08		48,334,820.46	-15,849,470.38	881,483,111.16			
三、本期增减变动金额(减少以“-”号填列)	6,405,000.00				19,672,839.72	26,077,839.72			
(一)净利润					19,672,839.72	19,672,839.72			
(二)直接计入所有者权益的利得和损失	6,405,000.00					6,405,000.00			
1.可供出售金融资产公允价值变动净额	8,540,000.00					8,540,000.00			
2.权益法下被投资单位其他所有者权益变动的的影响									
3.与计入所有者权益项目相关的所得税影响	-2,135,000.00					-2,135,000.00			
4.其他	6,405,000.00					6,405,000.00			
(三)所有者投入和减少资本									
1.所有者投入资本									
2.股份支付计入所有者权益的金额									
3.其他									
(四)利润分配									
1.提取盈余公积									
2.对所有者或股东的分配									
3.其他									
(五)所有者权益内部结转									
1.资本公积转增资本(或股本)									
2.盈余公积转增资本(或股本)									
3.盈余公积弥补亏损									
4.其他									
四、本期期末余额	312,000,000.00	543,402,761.08		48,334,820.46	3,823,369.34	907,560,950.88			

(上接 D45 版)

信达律师事务所
注册地:广东省深圳市深南中路东风大厦21层
负责人:靳庆民
电话:0755-3243108
传真:0755-3243108
经办律师:靳庆民 靳云燕
四、会计师事务所和注册会计师
普华永道中天会计师事务所有限公司
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦1604-1608室
办公地址:上海市湖南路202号普华永道中11楼
法定代表人:杨绍华
联系电话:021-23238888
传真:021-23238800
联系人:单峰
经办注册会计师:汪棣 单峰
四、基金名称
南方避险增值基金
五、基金的投资目标
六、基金的投资范围
七、基金的投资策略
八、投资决策
九、基金管理人承诺
十、基金管理人承诺
十一、基金管理人承诺
十二、基金管理人承诺
十三、基金管理人承诺
十四、基金管理人承诺
十五、基金管理人承诺
十六、基金管理人承诺
十七、基金管理人承诺
十八、基金管理人承诺
十九、基金管理人承诺
二十、基金管理人承诺
二十一、基金管理人承诺
二十二、基金管理人承诺
二十三、基金管理人承诺
二十四、基金管理人承诺
二十五、基金管理人承诺
二十六、基金管理人承诺
二十七、基金管理人承诺
二十八、基金管理人承诺
二十九、基金管理人承诺
三十、基金管理人承诺
三十一、基金管理人承诺
三十二、基金管理人承诺
三十三、基金管理人承诺
三十四、基金管理人承诺
三十五、基金管理人承诺
三十六、基金管理人承诺
三十七、基金管理人承诺
三十八、基金管理人承诺
三十九、基金管理人承诺
四十、基金管理人承诺
四十一、基金管理人承诺
四十二、基金管理人承诺
四十三、基金管理人承诺
四十四、基金管理人承诺
四十五、基金管理人承诺
四十六、基金管理人承诺
四十七、基金管理人承诺
四十八、基金管理人承诺
四十九、基金管理人承诺
五十、基金管理人承诺
五十一、基金管理人承诺
五十二、基金管理人承诺
五十三、基金管理人承诺
五十四、基金管理人承诺
五十五、基金管理人承诺
五十六、基金管理人承诺
五十七、基金管理人承诺
五十八、基金管理人承诺
五十九、基金管理人承诺
六十、基金管理人承诺
六十一、基金管理人承诺
六十二、基金管理人承诺
六十三、基金管理人承诺
六十四、基金管理人承诺
六十五、基金管理人承诺
六十六、基金管理人承诺
六十七、基金管理人承诺
六十八、基金管理人承诺
六十九、基金管理人承诺
七十、基金管理人承诺
七十一、基金管理人承诺
七十二、基金管理人承诺
七十三、基金管理人承诺
七十四、基金管理人承诺
七十五、基金管理人承诺
七十六、基金管理人承诺
七十七、基金管理人承诺
七十八、基金管理人承诺
七十九、基金管理人承诺
八十、基金管理人承诺
八十一、基金管理人承诺
八十二、基金管理人承诺
八十三、基金管理人承诺
八十四、基金管理人承诺
八十五、基金管理人承诺
八十六、基金管理人承诺
八十七、基金管理人承诺
八十八、基金管理人承诺
八十九、基金管理人承诺
九十、基金管理人承诺
九十一、基金管理人承诺
九十二、基金管理人承诺
九十三、基金管理人承诺
九十四、基金管理人承诺
九十五、基金管理人承诺
九十六、基金管理人承诺
九十七、基金管理人承诺
九十八、基金管理人承诺
九十九、基金管理人承诺
一百、基金管理人承诺

信达律师事务所
注册地:广东省深圳市深南中路东风大厦21层
负责人:靳庆民
电话:0755-3243108
传真:0755-3243108
经办律师:靳庆民 靳云燕
四、会计师事务所和注册会计师
普华永道中天会计师事务所有限公司
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦1604-1608室
办公地址:上海市湖南路202号普华永道中11楼
法定代表人:杨绍华
联系电话:021-23238888
传真:021-23238800
联系人:单峰
经办注册会计师:汪棣 单峰
四、基金名称
南方避险增值基金
五、基金的投资目标
六、基金的投资范围
七、基金的投资策略
八、投资决策
九、基金管理人承诺
十、基金管理人承诺
十一、基金管理人承诺
十二、基金管理人承诺
十三、基金管理人承诺
十四、基金管理人承诺
十五、基金管理人承诺
十六、基金管理人承诺
十七、基金管理人承诺
十八、基金管理人承诺
十九、基金管理人承诺
二十、基金管理人承诺
二十一、基金管理人承诺
二十二、基金管理人承诺
二十三、基金管理人承诺
二十四、基金管理人承诺
二十五、基金管理人承诺
二十六、基金管理人承诺
二十七、基金管理人承诺
二十八、基金管理人承诺
二十九、基金管理人承诺
三十、基金管理人承诺
三十一、基金管理人承诺
三十二、基金管理人承诺
三十三、基金管理人承诺
三十四、基金管理人承诺
三十五、基金管理人承诺
三十六、基金管理人承诺
三十七、基金管理人承诺
三十八、基金管理人承诺
三十九、基金管理人承诺
四十、基金管理人承诺
四十一、基金管理人承诺
四十二、基金管理人承诺
四十三、基金管理人承诺
四十四、基金管理人承诺
四十五、基金管理人承诺
四十六、基金管理人承诺
四十七、基金管理人承诺
四十八、基金管理人承诺
四十九、基金管理人承诺
五十、基金管理人承诺
五十一、基金管理人承诺
五十二、基金管理人承诺
五十三、基金管理人承诺
五十四、基金管理人承诺
五十五、基金管理人承诺
五十六、基金管理人承诺
五十七、基金管理人承诺
五十八、基金管理人承诺
五十九、基金管理人承诺
六十、基金管理人承诺
六十一、基金管理人承诺
六十二、基金管理人承诺
六十三、基金管理人承诺
六十四、基金管理人承诺
六十五、基金管理人承诺
六十六、基金管理人承诺
六十七、基金管理人承诺
六十八、基金管理人承诺
六十九、基金管理人承诺
七十、基金管理人承诺
七十一、基金管理人承诺
七十二、基金管理人承诺
七十三、基金管理人承诺
七十四、基金管理人承诺
七十五、基金管理人承诺
七十六、基金管理人承诺
七十七、基金管理人承诺
七十八、基金管理人承诺
七十九、基金管理人承诺
八十、基金管理人承诺
八十一、基金管理人承诺
八十二、基金管理人承诺
八十三、基金管理人承诺
八十四、基金管理人承诺
八十五、基金管理人承诺
八十六、基金管理人承诺
八十七、基金管理人承诺
八十八、基金管理人承诺
八十九、基金管理人承诺
九十、基金管理人承诺
九十一、基金管理人承诺
九十二、基金管理人承诺
九十三、基金管理人承诺
九十四、基金管理人承诺
九十五、基金管理人承诺
九十六、基金管理人承诺
九十七、基金管理人承诺
九十八、基金管理人承诺
九十九、基金管理人承诺
一百、基金管理人承诺

5.1 报告期末基金资产组合情况			
序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	3,331,029,453.84	28.91
	其中:股票	3,331,029,453.84	28.91
2	固定收益投资	4,962,147,840.44	43.07
	其中:债券	4,381,182,610.38	42.37
	资产支持证券	80,965,230.06	0.70
3	金融衍生品投资	92,964,000.00	0.81
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	30,582,385.27	0.27
6	其他资产	3,104,695,159.23	26.95
7	合计	11,521,418,838.78	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合			
代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	14,950,000.00	0.14
C	制造业	2,113,534,084.72	20.00
CD	食品、饮料	222,474,950.81	2.11
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	47,404,064.12	0.45
CS	医药	-	-
C6	金属、非金属	1,305,654,635.33	12.36
C7	机械、设备、仪表	384,510,659.10	3.64
C8	医药、生物制品	153,089,775.36	1.45
C9	其他制造业	-	-
D	电力、煤气、水生产和供应业	-	-
E	建筑业	114,537,631.71	1.08
F	交通运输、仓储业	226,008,579.00	2.14
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售业	73,439,369.64	0.69
I	金融、保险业	474,307,847.81	4.49
J	房地产业	227,443,224.04	2.15
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	86,808,776.32	0.82
M	综合类	-	-
	合计	3,331,029,453.84	31.52

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细				
代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000629 攀钢钒钛	60,000.00	490,200.000	4.64
2	000959 首钢股份	45,977.14	276,782.587	2.62
3	000898 鞍钢股份	19,408.999	256,004.696	2.42
4	000400 许继电气	11,121.966	203,309.538	1.92
5	600019 宝硕股份	27,727.300	195,200.192	1.85
6	600519 贵州茅台	1,256.281	185,942.150	1.76
7	600312 平安高电	12,334.998	181,201.620	1.71
8	000001 深发展 A	7,342.922	166,222.558	1.52
9	600479 千金药业	7,861.797	136,009.088	1.29
10	601318 中国平安	2,433.092	120,740.332	1.14

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细			
序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国寿债	665,307,962.10	6.30
2	央行票据	519,349,000.00	4.91
3	金融债	2,790,636,000.00	26.41
4	其中:政策性金融债	2,627,452,000.00	24.86
5	企业债	905,889,648.28	8.57
6	企业短期融资券	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	4,881,182,610.38	46.19

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细					
序号	证券代码	证券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	060443	06粤交13	4,000.000	402,360,000.00	3.81
2	080223	08国开23	3,600.000	358,200,000.00	3.39
3	010217	01国开17	3,000.000	312,360,000.00	2.96
4	080221	08国开21	3,000.000	300,750,000.00	2.85
5	040211	04国开11	3,000.000	300,300,000.00	2.84

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细					
序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	119010	天亿收益	800.000	40,020,957.80	0.38
2	119005	澜电 02	390.000	38,993,052.26	0.37
3	119005	浦银收益	200.000	1,951,220.000	0.02

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细					
序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	038001	宝钢钢权	60,000.000	92,964,000.000	0.88

5.8 投资组合报告附注			
序号	名称	金额(元)	
1	存出保证金	-	2,015,439.43
2	应收证券清算款	-	182,160,000.00
3	应收股利	-	683,719.86
4	应收利息	-	88,708,543.58
5	应收申购款	-	2,830,857.56
6	其他应收款	-	270,000.00
7	待摊费用	-	-
8	其他	-	-
9	合计	-	3,104,695,159.23

5.8.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况			
5.8.2 本基金持有的处于转股期的可转换债券明细			
5.8.3 其他资产构成			
序号	名称	金额(元)	
1	存出保证金	-	2,015,439.43
2	应收证券清算款	-	182,160,000.00
3	应收股利	-	683,719.86
4	应收利息	-	88,708,543.58
5	应收申购款	-	2,830,857.56
6	其他应收款	-	270,000.00
7	待摊费用	-	-
8	其他	-	-
9	合计	-	3,104,695,159.23