南方成份精选股票型证券投资基金招募说明书(更新)摘要

重要提示南方成份精选股票型证券投资基金由金元证券投资基金转型而成。依据中国证监会 2007 年 4 月 23 日证监基金字 [2007] 126 号文核准的金元证券投资基金基金份额持有人大会决议,金元证券投资基金由封闭式基金转为开放式基金、调整存续期限,终止上市、调整投资目标、范围和策略、修订基金台同,并更名为南方成份精选股票型证券投资基金"自 2007 年 5 月 14 日起,由 ᢨ元证券投资基金基金合同 № 订而成的《构方成份精选股票型证券投资基金基金合同》上效。 南方基金管理有限公司(本基金管理人"或 整金管理人"或 管理人"》保证招募说明书的内容真实、准确、完整,中国证监会分本基金募集的核准,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,也不表明投资本基金没有风险。投资有风险,投资人中购基金时应认真阅读招募说明书。基金的过往业绩并不得示其未来表现。

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

》,也不保证或取权益。 本摘要根据基金合同和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 灭利、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《整金法》、《医作办法》、基 全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

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 2009 年 11 月 14 日, 有关财务数据和净值表现截止日为 2009 年 9 月 30 日 朱经审计)。

一、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:深圳市福田中心区福华一路6号免税商务大厦塔楼31、32、33层整层

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)82763888 传真: 0755)82763889 秋赤八: 起义平 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字 [1998]4 号文批准:由南方证券有限公

、量子公成分 是万善先生,董事长,中共党员,工商管理硕士 (MBA),高级经济师。 历任中国人民银行江苏省分行金

資管理網營理,深圳市机场股份有限公司投資发展階營理,深圳市机场,陳紅 有限公司投资经营部營埋。 現任深圳市机场股份有限公司董事,深圳市机场,康团 有限公司制设经理。 周建国先生,董事,中共党员,经济学硕士。历任某公社会计,团委书记,江西财经学院教师,企业财务 教研室负责人,会计系办公室主任,会计系副主任,成教处处长,深圳中旅信实业有限公司副总经理,深圳 市商贸投资股份公司计和部份、计划等部份、经常要求。有限公司要求书记、董事长、市商 贸投资密股公司司计和财务部份、经常经验。

。 洪文瑾女士,董事,中共党员,工商管理硕士 €MBA)。24年经济工作经验,其中15年金融从业经历。

洪文瑾女士、董事、中共党员、工商管理硕士 &MBA)。24 年经济工作经验, 其中 15 年金融从业经历。历任厦门建发集团有限公司财务部部经理。项门建发信托投资公司副总经理,项门建发信托投资公司副总经理,现任同时国际信托有限公司董事长。总经理。 庄园芳女士、董事、经济学硕士、经济师。历任福建兴业证券公司交易业务都总经理助理、证券投资部副总经理、总经理、投资总监、现任平地证券银份有限公司副总裁。 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、观任南方基金管理有限公司副总经理、党委书记。 张岳先生、独立董事、工商管理师士 MBA)及国际关系硕士、注册金融分析师 CFA),获得美国NASD Series 7 & 65 证书。曾工作于耶鲁大学投资基金办公室 Vale Endowmen)及美国新生市场投资基金 能需要调购 Markets Management。11.C)、主要从事基金管理及投资研究。历任纽约证券交易所国东董事及中国首席代表、银年基金独立董事、创立组织证券交易所大中年区办公室 僑港》。现任 HCM 投资管理有限公司高级合伙人、那鲁大学北京校友会副会长、纽约金融分析师协会的会员。现任任M 投资管理有限公司高级合伙人、那鲁大学北京校友会副会长、纽约金融分析师协会的会员。周春生先生、独立董事、博士、历任美国联邦储备委员会经济学家、美国加州大学及香港大学商学院教授、中国证监会规划发展委员会会委员等家、美国加州大学及香港大学商学院教授、中国证监会规划发展委员会会委员。等实、美国加州大学及香港大学商学院教授、1日国证监会规划发展委员会委员员。

港城市大学客座教授。
王全洲先生、独立董事,中共党员、大学学历、中国人民大学会计专业研究生班毕业、注册会计师、资产 评估师、注册税务师。曾任北京市财政局会计处副处长、现任北京兴华会计师事务所董事长、主任会计师。 从培国先生、独立董事、法学硕士。历任北京大学法律系经济法教研室助教、副主任、美国加州大学洛 杉矶校区 UCLA 客座教授、北京大学副教授。现任北京省估律师事务所合伙人、事务所主任。 米志明先生、独立董事、本科、高级经济师、注册会计师。历任江苏省娄堰税务局副局长、扬州市税务局 副局长、扬州市财政局局长、党组书记、扬州市人民政府副秘书长、建设银行扬州市分行行长、党组书记、财 政部深圳专员办专员、巡视员。 2 监事会成局。

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, 服任南方基金管理有限公司职工监事, 监事长。 舒本娘女士, 监事, 学士学位, 会计师。历任熊猫电子集团公司财务处长, 华泰证券公司计划资金部副总经理, 德廷康, 定经理, 现任年泰证券股份有限公司计划财务部总经理。 周景民先生, 监事, 学士学位, 云前市建现在, 他别A. 经济师, 加拿大证券协会会员。历任三九企业集团、周景民先生, 监事, "学硕士、江南市建则在,但两个人会员。历任三九企业集团、四周易总公司。财务管理部职员,深切大师证券有限公司,投资银行部? 项目经理, 加查大 Simon? Fraser? University 工商管理学验证协业, 广东美的企业集团战场发展部。高级经理, 招商局集团中国南山开发 像团,公司研究发展部高级项目经理, 现任职于深圳市投资控股有限公司投资部。 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, 三明市财政局, 三时、市场股份有限公司财务部总型,现任厦门国际信托股份有限公司财务部总型,现任废口财务部总型。 第任兴业证券计划财务部副总经理 住持工作, 决处证券计划财务部副总经理, 住持工作, 决任兴业证券计划财务部副总经理。 1章证券深圳分公司电路部经到现理, 现任所方基金管理有限公司电子商务部总经理。

电脑部经理助理,現任南方基金管理有限公司电子商务部总监兼市场服务部总监。
3. 览至班及其他高级管理人员
高良玉先生、董事。这经理,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。
俞文宏先生、副总经理,中共党员、工商管理硕士《MBA》、经济师、历任江苏省投资公司业务经理、江苏国际启商公司部门经理、江苏省国际信托投资公司财金管银行部总经理、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。
郑文祥先生、副总经理、工商管理硕士《MBA》。曾任职丁湖北省荆州市农业银行、南方证券公司、国泰署安证券公司、任职南方基金管理有限公司制。历任国储投资经理、专户理财部副总监、南方避险基金经理、总经理助理兼养老金业务部总监、现任南方基金管理有限公司副总经理。
秦长奎先生、督察长、中共党员、工商管理硕士《MBA》。历任华泰证券有限公司营业部总经理、部门总经理。总经理、总经理的理兼养老金业务部总监、现任南方基金管理有限公司副总经理。

年 11 月至 2005 年 8 月, 孙志洪; 2005 年 8 月至 2006 年 3 月, 汪澈; 2006 年 3 月至 2007 年 5 月,王黎敏; 2007 年 5 月至 2008 年 1 月,应帅、王黎敏; 2008 年 1 月至 2008 年 4 月应帅; 2008 年 4 月至今应帅、张慎

2007年加入成于曾珠子的鲁珠子明江,李钊都邀外北京桥。曾且江下风盛逝至曾珠公中川北明允员, 2007年加入确方基金曾建和帮殴公司,2007年5月至 2009年2月,任南方复元基金签理。2007年 5月至 今,任南方成份基金经理。 张慎平、注册金融分析师(FA),经济学硕士,具有基金从业资格。2003年加入南方基金管理有限公司,负责石化化工、建筑建材行业研究。2008年1月至今,任南方积配基金经理。2008年4月至今,任南方

5、投资决策委员会成员

(一)基金托管人概况 名称:中国工商银行股份有限公司

名称:中国上简银行取份有限公司 注册地址:北京市西城区复兴门内大街 55 号 办公地址:北京市西城区复兴门内大街 55 号 法定代表人:姜建清 设立日期:1984年1月1日 注册资本:人民币 334.018.850.026 元 联系电话: 010 86105799

附力基金管理有限公司 注册地址: 深圳市福田中心区福华一路 6 号免税商务大厦塔楼 31、32、33 层整层 注定代表人: 吴万善 电话: 0755 82763905 传真: 0755 82763900 版系人。 点性选择 邓岭岬 南方基金管理有限公司

联系人:卢艳萍、张锐珊 2、代销机构:

(4) 户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 电话:010-66107900

传真:010-66107914

2)中国建设银行股份有限公司

② 开国建设银行股份有限公司 注册地址:北京市西城区融大省 25 号 办公地址:北京市西城区副市口大街 1 号院 1 号楼 低安兴融中心) 法定代表人:郭树清 电话:010-66275654 安计图8 44 注:4 68523

客户服务电话: 95533

各广版7世记: 93333 例址:www.ceb.com 6)中国农业银行股份有限公司 注册地址:北京市东城区建国门内大街 69号 办公地址:北京市东城区建国门内大街 69号 法定代表人:项俊波 客户服务电话: 95599 侧址:www.ebbins.com

网址:www.abchina.com 4)中国银行股份有限公司 地址:北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人: 肖钢

电话:010-66594905 客户服务电话:95566 公司网址:www.boc.cn 6) 冷通银行股份有限公司 办公地址:上海市银城中路 188 号 法定代表人:胡怀邦

电话: 021)58781234

电话: 021 88781234 传真: 021 58408842 联系人: 曹榕 网班: www.bankcomm.com 6 招商银行般份有限公司 注册地址: 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

传真:0755-83195049

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

内容截止日:2009年11月14日

7)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

传真:010-66415194 网址:www.psbc.com 8)广东发展银行股份有限公司 注册地址:广州市农林下路 83 号 法定代表人:董建岳

宏定代表代:重建语 电话:0571-96000888,020-38322222 专真:020-87031195 网站:www.gdb.com.cn ②)上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址:上海市浦东新区浦东南路 500 号办公地址:上海市市山东一路 12 号 法定代表人:吉晓辉 联系人:徐伟、汤嘉惠 客户服务热线:95528

司网站:www.spdb.com 00)中信银行股份有限公司

注册地址:北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座 法定代表人, 孔丹

电话:010-65557013 传真:010-65550827

[日本:IUI-O530302] 阿班: http://hank.ecitic.com 11) 中国光大银行股份有限公司 注册地址:北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦 法亚代表人.唐双宁 客版电话:95595 全国)

网址:www.cebbank.com (12)兴业银行股份有限公 注册地址:福州市湖东路 154 号 办公地址:福州市湖东路 154号

法定代表人: 高建平 电话:021-62677777 客户服务电话:95561 公司网站: www.cib.com.cn (13)深圳发展银行股份有限公司

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:0755-8208888 传真电话:0755-82080714 客户服务电话:95501

公司网址: www.sdb.com.cn (14)上海银行股份有限公司 (44)上海银行取份有限公司 注册地址:上海市浦东新区银城中路 168 号 办公地址:上海市浦东新区银城中路 168 号 法定代表人,陈辛 联系人,张粹 联系人,张特

传真:021-68476111 客户服务热线:021-962888 各戶服分然表;(021-962888 例批:www.bankofshanghai.com 0.5)中国民生银行股份有限公司 1去册地此:北京市西城区复兴门内大街 2 号 办公地址:北京市西城区复兴门内大街 2 号 法定代表人,董文总

传真:010-83914283 联系电话:010-58560666 联系人:李群

电话:010-66226044、66223251 传真:010-66226045、66226047

一一/ 不聚日取份有限公司 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 由注 电话:25879127

特員:288/8304 联系人:霍兆龙 网站:www.18ebank.com (8) 华夏银行股份有限公司 注册地址:北京市东城区建国门内大街 22 号 办公地址:北京市东城区建国门内大街 22 号 法定代表人:翟鸿祥

(19)东莞银行股份有限

办公地址:东莞市运河东一路 193 号 电话:0769-22119061 传真:0769-22117730 传真:0769-22117730 联系人:胡昱 客户服务热线:96228

公司网站:www.dongguanbank.en **20**)宁波镍行股份有限公司 注册地址:宁波市江东区中山东路 294 号 法定代表人:陆华裕

法定代表人:和平市 联系人:钱庚旺 客户服务统一咨询电话:96528,上海地区 962528 网址:www.nbcb.com.cn 21)杭州银行股份有限公司

办公地址:中国.杭州凤起路 432 号 法定代表人:马时雍

联系电话:0571-85108309 传真:0571-85151339 客户服务热线:0571-96523、4008888508 で同网址:www.hzbank.com.en

公司/河县:www.nabank.com.cn C2 附前縣行股份有限公司 注册地址:浙江省杭州市庆春路 288 号 办公地址:浙江省杭州市庆春路 288 号 法定代表人:殊达洋 联系人:吴军阳 联系电话:0571-87659084 传言:0571-87659084

传真:0571-87659188 客户服务热线:95105665 公司网址:www.czbank.com 23)青岛银行股份有限公司

26.7/南项城市近处户标公司 注册地址:山东省青岛市市南区香港中路 68 号华普大厦 鄉編 266071) 办公地址:山东省青岛市市南区香港中路 68 号华普大厦 鄉編 266071) 法人代表,张广鸿 客服热线: 傅岛)96588, 侩国)400-66-96588,0532-85709799

网址:www.qdccb.com **Q4**)临商银行股份有限公司 四. 加商银行股份有限公司 注册地址:山东省临沂市沂蒙路 336 号 办公地址:山东省临沂市沂蒙路 336 号 法定代表人:王僚王 联系人:竞延注 联系人:克隆廷注 联系人:克隆廷注 联系人:克隆江 传真: 0539)8304657

客户服务热线:400-699-6588 各户服务系统议:400-699-6588 公司网址:www.lbschina.com 65 比京农村商业银行股份有限公司 注册地址:北京市西城区单成门内大街 410 号 办公地址:北京市西城区单成门内大街 410 号 法定代表人:乔瑞 世老人: 如归西岭 电话:010-66506138

客户服务热线:96198 26)汉口银行股份有限公司 注册地址: 江汉区建设大道 933 号武汉商业银行大厦 办公地址: 江汉区建设大道 933 号武汉商业银行大厦

电话:027-82656224 传真:027-82656236 客服热线:027-96558 公司网址:http://www.hkbchina.com 07)上海灰村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路 8 号中融碧玉蓝天大厦 15 层 法定代表人:李秀仑 歷名。上层海径

联系电话: 021)38576977 网址:www.srcb.com 代销券商及其他代销机构: 联系电话:028-86690125 传真:028-86690126 网址:www.gjzq.com.cn 客服电话:028-95105111 68 江海证券有限公司 住所:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

电话:027-82656224

注册地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56号 办公地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号 法定代表人:孙名扬 电话:0451-82336863

传真:0451-82287211 客户服务热线:400-666-2288 例址:www.jhzq.com.cn 69 /信达证券股份有限公司 注册地址:北京市西城区三里河东路 5 号中商大厦 10 层

办公地址:北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层 法定代表人:张志刚 联系人:唐静 联系电话:010-88656100 传真:010-88656290 客户服务热线:400-800-8899

公司网址:www.cindas (40)大州北京時间時限公司 注册地址:北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701 办公地址:北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 4 层 法定代表人:林义相

传真: 010)66045500 联系人:莫晓丽 联系人电话: 010 %6045529 公司网站: www.txsec.com 、www.txjijin.com (二)注册登记机构

中心区福华一路6号免税商务大厦塔楼31、32、33层整层

传真: 0755)82763889 联系人:代庆红 仁 津师事务所和经办律师

上海源泰律师事务所 注册地址:上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

传真: 021)51150398 经办律师:廖海、吕红 (四)会计师事务所和经办注册会计师 普华永道中天会计师事务所有限公 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:上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼 法定代表人:杨绍信

联系电话:021-23238888 传真:021-23238800 联系人:单峰 经办注册会计师:薛竞、单峰 四、基金名称

五、基金的类型

八、投资策略

x基金在保持公司一贯投资理念基础上,通过对宏观经济和上市公司基本面的深入研究,采取定量和 目结合方法,精选成份股,寻找驱动力型的领先上市公司,在控制风险的前提下追求获取超额收益。 七、基金的投资范围 本基金投资的标的物为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市的股票、债券及中国

证监会允许基础设计的1940/共年1847的以下的3速配上来,包含国内代达公开发打工印的股票、颁券及平国证监会允许基础投资的其他金融工具。其中,股票投资以沪深 300 成份股以及上市未满 1 年,但符合其他进入沪深 300 指数条件的新上市公司为投资范围。 进入沪深 300 指数条件的新上市公司为投资范围。 本基金投资组合为;股票占基金资产的 60%—95%,其中对驱动力型增长行业以下是以企业和行业领土基础投资组合为;股票占据金资产 先型成长企业股票的投资不同。 生型成长企业股票的投资不同。 共型成长企业股票的投资不同。 共型成长企业股票的投资不同。 其占基金资产的5%—40%,其中,基金保留的现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基

並於(丁中國的)3%。如此神法規或監管机构以后允许本基金投资其他品种。基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳人投资范围,如法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制的,基金管理人可相应调整本基金的投资比例上限,不需经基金份额持有人大会审议。

1、资产配置策略 本基金管理人将综合运用定量分析和定性分析手段、对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未 来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估,并据此制定本基金在股票。债券、现金等资 产之间的配置比例、调整原则和调整范围、定期或不定期地进行调整,以达到规避风险及提高收益的目的。

尤比和置₂₋₃个驱动力型增长行业中的代表企业,投资比例占股票市值部分的30%±10%。此外选择 其他行业中符合行业领先型的成长企业为投资对象,这部分企业占股票市值部分的70%±10%

(7) 驱动力型增长行业:指对国民经济起主要驱动作用或作出重大贡献的行业产业。 通过对中国宏观经济的把握,根据对上下游行业运行态势与利益分配等因素的观察,考量行业增长周 期,以确定对国民经济起主要驱动作用或作出重大贡献的行业产业。从中优选代表性企业重点投资。

预期行业平均增长率超过 GDP 增长率 2-3 倍。

行业代表企业: 市场份额居同行业上市企业的前3位。

营业收入和净利润增长率不低于同行业上市公司平均水平。 2 / 行业领先型成长企业:强调处于企业成长生命周期的上升期,或面临重大的发展机遇,具备超常规

是依赖相放式的外延式扩张,而是追求有效率的成长,体现为边际投资收益率高于股东必要回报水平

预期主营业务收入增长率或息税前利润增长率超过 20% 1989年上海34279以入时在平年以息民间用利即增长率超过 20%。 净药产收益率应当高于股东必要投资回报水平(从上市公司平均净资产收益率度量) PEG 处于上市公司中的较低水平。

3、顷牙汉页束略 本基金可投资的债券品种包括国债、金融债和企业债 (包括可转换债)。本基金将在研判利率走势的基 础上做出最佳的资产配置及风险控制。在选择债券品种时、本基金重点分析债券发行人的债信品质包括发行机构以及保证机构的偿债能力、财务结构与安全性,并根据对不同期限品种的研究、构造收益率曲线、采用人期(furation)模型构造最佳债券期限组合,降低利率风险;对可转债的投资、结合对股票走势的判断。

4、权证投资策略 本基金在进行权证投资时,将通过对权证标的证券基本面的研究。并结合权证完价模型寻求其合理估

值水平、主要考虑运用的资格包括、托干管路、价值控制策略、统利保护策略、价差策略、双向权证策略、类空保护性的认购权证策略、买人保护性的认沽权证策略等。 本公司将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征、通过资产配置、品种与类属选择、谨慎进 的当期收益。 力, 业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为; 沪深 300 指数×80%+上证国债指数×20%。 本基金为股票型基金,在考虑了基金股票组合的投资标的、构建流程以及市场上各个股票指数的编制 方法和历史情况后,我们选定沪深 300 指数作为本基金股票组合的业绩基准,债券组合的业绩基准则采用 物工四//1017工证国际目录。 加里公后注律注扣发生亦化 或老指数编制单价值正计管编制该指数或面改指数名称 或老有面权成

如本了旧公中记录中记录中记录之主义: "或者自我系编师中记序记上并来编师设置成实足设备或无论、或者自关代数的,更能为市场普遍接受的业绩比较基准性出,或者目示场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。 十、风险收益特征 34**0 至 75 证** 51 股票型基金,属于风险收益配比较高的品种。

本基金方取等必免意。属于风险取益配比较高的品种。 十一、基金的投资组合报告(朱登审计) 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,并对其内 答的真实性、推确性和完整性承担个别及连带责任。 基金任管人中国工商银行根据本基金合同规定。于2009年12月4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。 本投资组合报告所载数据截至 2009 年 9 月 30 日 休经审计)。

金额(元) 11,376,407,672.7 1 权益投资 500,633,887.00 其中:债券 500,633,887.00 3.92 资产支持证券

买人返售金融资 其中:买断式回购的买人返售金融资 5 银行存款和结算备付金合 10,082,814.5 12,774,018,926.80 100.00 公允价值(元) 占基金资产净值比例 行业类别

| | ., | | (%) |
|-----|----------------|-------------------|-------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | |
| В | 采掘业 | 1,055,528,733.72 | 8.29 |
| С | 制造业 | 3,610,939,781.49 | 28.3 |
| C0 | 食品、饮料 | 127,513,834.32 | 1.00 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | - | |
| C2 | 木材、家具 | - | |
| C3 | 造纸、印刷 | 889,148.16 | 0.0 |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 557,211,508.56 | 4.3 |
| C5 | 电子 | 336,090.15 | 0.0 |
| C6 | 金属、非金属 | 1,381,176,505.41 | 10.84 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 1,239,212,656.34 | 9.7. |
| C8 | 医药、生物制品 | 304,600,038.55 | 2.39 |
| C99 | 其他制造业 | - | |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 118,316,478.00 | 0.93 |
| Е | 建筑业 | 481,279,579.02 | 3.78 |
| F | 交通运输、仓储业 | 829,725,836.92 | 6.5 |
| G | 信息技术业 | 336,495,850.43 | 2.6 |
| Н | 批发和零售贸易 | 421,664,618.20 | 3.3 |
| I | 金融、保险业 | 3,569,266,508.24 | 28.0 |
| J | 房地产业 | 719,658,434.96 | 5.63 |
| K | 社会服务业 | 233,531,851.80 | 1.83 |
| L | 传播与文化产业 | - | - |
| M | 综合类 | - | - |
| | 合计 | 11,376,407,672.78 | 89.30 |

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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 例(%) |
|----|--------|-------|------------|----------------|------|
| 1 | 600016 | 民生银行 | 73,749,920 | 497,074,460.80 | 3.90 |
| 2 | 600015 | 华夏银行 | 48,509,283 | 494,794,686.60 | 3.88 |
| 3 | 000001 | 深发展 A | 24,495,535 | 490,155,655.35 | 3.85 |
| 4 | 600036 | 招商银行 | 32,652,327 | 482,601,393.06 | 3.79 |
| 5 | 600000 | 浦发银行 | 23,607,215 | 463,881,774.75 | 3.64 |
| 6 | 600048 | 保利地产 | 12,432,900 | 299,881,548.00 | 2.35 |
| 7 | 600837 | 海通证券 | 19,957,972 | 263,245,650.68 | 2.07 |
| 8 | 600030 | 中信证券 | 9,939,583 | 248,588,970.83 | 1.95 |
| 9 | 600739 | 辽宁成大 | 8,980,845 | 246,793,620.60 | 1.94 |
| 10 | 000069 | 华侨城 A | 12,539,890 | 231,987,965.00 | 1.82 |

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

| | the street of the | | |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
| 1 | 国家债券 | - | |
| 2 | 央行票据 | 498,350,000.00 | 3.9 |
| 3 | 金融债券 | - | |
| | 其中:政策性金融债 | - | |
| 4 | 企业债券 | 966,428.00 | 0.0 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | |
| 6 | 可转债 | 1,317,459.00 | 0.0 |
| 7 | 其他 | - | |
| 8 | 合计 | 500,633,887.00 | 3.9 |

占基金资产净值比例 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元)

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

0901045 09央票 45 5,000,000 498,350,000.00 110006 10,790 1,317,459.00 3 126019 09长虹债 13,460 966,428.00 6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明纸 权证代码 权证名称 数量(份) 公允价值(元)

8.1 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。 8.2 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。

8.3 其他资产构成 序号 5,817,787.43 1 存出保证金 应收证券清算款 3 应收股利 4 应收利息 728.078.90 361,084.17 5 应收申购款 3,175,864.0 7 待摊费用 8 其他 10,082,814.57

8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。 8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

流通受限部分的公 允价值(元 序号 股票代码 股票名称 流通受限情况说明 1 600048 保利地产 299,881,548.00 二、基金的业绩 基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,

也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细 阅读本基金的招募说明书 (1)-(3) (2)-(4)2007.5.14-2007.12.31 43.85% 1.82% 9.94% -0.059 1.77% 33.91% 2008.1.1-2008.12.31 1.96% -56.18% 2.44% 3.34% -0.48%

50.66%

-11.59%

1.72% -20.26%

自基金转型起至今 十三、基金费用概览

2009.1.1-2009.09.30

←)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)基金杆管人的杆管费: (3)证券交易费用: (4) 基金信息披露费用; 6)基金持有人大会费用; 6)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。 2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1.79%

1.87%

(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的基金资产净值的15%的年费率计算,计算方法加下。 H=E×1.5%÷当年天数 H 为每日应计提的基金管理费

30.40%

-11.54%

E 为前一日的基金资产净值 基金管理人的管理费每日计提,按月支付,由基金托管人于次月首两个工作日内从基金资产中一次 性支付给基金管理人, 若遇法定节假日、休息日等, 支付日期顺延。

本基金应给付基金托管人托管费,按前一日的基金资产净值的2.5%的年费率计提。计算方法如下: H=E×0.25%÷当年天数 H 为每日应计提的基金托管费

产中一次性支取, 若遇法定节假日、休息日等, 支付日期顺延。 β)上述 ←)中 β 闰 β 顶费用由基金托管人根据其它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。 3、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。 4、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

E为前一日的基金资产净值

仁)与基金销售有关的费用 本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。本基金申购费分为前端收费和后端收费两种模式。前 端申购费率最高不高于1.5%,且随申购金额的增加而递减,后端申购费率最高不高于1.8%,且随持有时 间的增加而递减,如下表所示:

购买金额(M) 申购费率 100万≤M<500 500万≤M<1000 0.3% 毎笔 1000 M≥1000 万 后端收费 供中1年为365天):

持有期限(N) 申购费率 1年≤N<2 2年≤N<3年 1.2% 3年≤N<4 ± 0.8% 4年≤N<5 ± N≥5 年 若投资者选择缴纳前端申购费用,则申购份额的计算公式为:

申购份额 = 净申购金额/申购当日基金份额净值。 赎回费率不高于 0.5%, 随申请份额持有时间增加而递减 (其中 1 年为 365 天)。 具体如下表所示: 申请份额持有时间(N) N<1 年 0.5% 1年≤N<2 ^全 0.3%

N≥2年 回费在扣除手续费后,余额不得低于赎回费总额的百分之二十五,并应当归人基金财产 3、转换费

转换费的相关规定详见 2007 年 8 月 30 日发布的 《南方基金管理有限公司关于旗下基金在部分代销机构 开展转换业务的公告》、2008 年 3 月 11 日发布的《南方基金管理有限公司关于调整旗下基金转换业务规 则的公告》和其他有关基金转换公台 4、本基金的实际执行费率由基金管理人在基金合同规定的范围内调整。本基金的申购费率和赎回费 率在更新的招募说明书中列示。基金管理人认为需要调整费率时,必须于新的费率开始实施日前的三个工 作日在至少一种中国证监会指定的媒体上刊登公告。

基金管理人已开通本基金与基金管理人旗下部分基金在直销机构和部分代销机构的基金转换业务,

本基金其他费用根据相关法律法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明

净申购金额 = 申购金额/(1+申购费率)

申购费用 = 申购金额-净申购金额

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基 金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,结合本基金管理人对 本基金实施的投资管理活动,对本基金的原招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

1、在 基金托管人"部分,对基金托管人的 生要人员情况"及 基金托管业务经营情况"进行了更新。 2、在 相关服务机构"部分,对代销银行、代销券商和其他代销机构名单、会计师事务所信息进行了更 3、在 基金份额的申购和赎回"部分,对最低赎回份额限制进行了更新。

4、在 基金的投资"部分,补充了本基金最近一期投资组合报告的内容。

5、在 基金的业绩"这一章节,补充说明最近一期的投资业绩。 6、在 基金份额持有人的服务"部分,对基金份额持有人的服务的相关内容进行了更新 7、对 其他应披露的事项"进行了更新。

8、对部分表述进行了更新。

南方基金管理有限公司 2009年12月25日