南方稳健贰号证券投资基金招募说明书(更新)摘要

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

本招募说明书(更新)摘要内容截止日:2010年7月25日

重要提示

南方稳健贰号证券投资基金经中国证监会2006年6月13日证监基金字[2006]116号文核准募集,本基金的基金合同于2006年7月25日生效。

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。

投资有风险,投资者认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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。

本摘要根据基金合同编写,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》、《运作办法》、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。

本基金与南方稳健成长证券投资基金采用相同的投资目标、投资策略和投资理念,但在投资运作上完全独立。南方稳健成长证券投资基金的过往业绩不预示本基金的未来表现。本基金与南方稳健成长证券投资基金的未来业绩可能存在差异。

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2010年7月25日,有关财务数据和净值表现截止日为2010年6月30日。(财务数据未经审计。)

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
住所及办公地址: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
联系人:鲍文革

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:华泰证券股份有限公司45%、深圳市机场(集团)有限公司30%、厦门国际信托有限公司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(MBA),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、华泰证券股份有限公司发行部副经理、总经理助理、副总经理、总裁,现任华泰证券股份有限公司董事长兼党委副书记、南方基金管理有限公司董事长。

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,华泰证券股份有限公司副总会计师、华泰证券股份有限公司副总裁、现任华泰联合证券董事长、党委书记。

张涛先生,董事,中共党员,博士,经济师。历任华泰证券股份有限公司总裁秘书、上海投资银行业务部副总经理、深圳总部总经理兼深圳营业部总经理、总助兼董事会秘书,现任华泰证券股份有限公司副总裁。

汤大杰先生,董事,中共党员,博士。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。现任深圳市机场股份有限公司董事、深圳市机场(集团)有限公司副总经理。

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;深圳市商贸投资控股公司审计部部长、计财部部长、纪律委员,兼任商控实业有限公司党委书记、董事长、市商贸投资控股公司总裁助理;深圳市投资控股有限公司计划财务部部长;现任深圳市投资控股有限公司副总经理。

洪文瑾女士,董事,中共党员,工商管理硕士(EMBA)。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副经理、厦门建发信托投资公司副总经理、厦门建发信托投资公司副总经理,现任厦门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部总经理助理、证券投资部副总经理、总经理;投资总监;现任兴业证券股份有限公司副总裁。

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,现任南方基金管理有限公司总经理、党委书记。

张磊先生,独立董事,工商管理硕士(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(Yale Endowment)及美国新生市场投资基金(Emerging Markets Management,LLC),主要从事基金管理及投资研究。历任纽约证券交易所国际董事及中国首席代表,银华基金独立董事,创立纽约证券交易所大中华区办公室(香港)。现任HCM投资管理有限公司高级合伙人,耶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委员(副局级)。曾任中国留美金融学会理事;美国经济学会,美国金融研究会会员;Annals of Economics and Finance 编委。现为长江商学院金融教授,国家杰出青年基金获得者,香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。现任北京君佑律师事务所合伙人、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。历任江苏省姜堰税务局副局长,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、监事会成员

骆新都女士,监事长,经济学硕士,经济师。历任民政部外事处处长、南方证券有限公司副总裁、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职工监事、监事长。

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、稽查监察部副总经理、总经理,现任华泰证券股份有限公司计划财务部总经理。

周景民先生,监事,工学硕士、工商管理硕士(MBA),经济师,加拿大证券协会会员。历任三九企业集团三九贸易总公司财务管理部职员;深圳大鹏证券有限公司投资银行部项目经理;加拿大Simon Fraser University工商管理学院助教;广东美的企业集团战略发展部高级经理;招商局集团中国南山开发(集团)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、三明市财委、厦门信达股份有限公司财务部、厦门国际信托有限公司财务部副经理、自营业务部经理,现任厦门国际信托有限公司财务部经理。

郑城美先生,监事,中共党员,经济学硕士。曾任兴业证券南平营业部副总经理(主持工作)、兴业证券计划财务部副总经理(主持工作),现任兴业证券计划财务部总经理。

苏民先生,监事,工学硕士,工程师。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,现任南方基金管理有限公司电子商务部兼风险管理部总监。

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。

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。

郑文祥先生,副总经理,工商管理硕士。曾任职于湖北省荆州市农业银行、南方证券公司、国泰君安证券公司,任职南方基金管理有限公司期间,历任国债投资经理、专户理财部副总监、南方避险增值基金经理、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。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

本基金历任基金经理为:2006年7月至2007年3月,王宏远、谢爱龙、张雪松;2007年3月至2007年5月,王宏远、张雪松;2007年5月至2008年1月,王宏远、张雪松、冯皓;2008年1月至2008年4月,王宏远、冯皓;2008年4月至2010年1月,冯皓、马北雁;2010年1月至2010年2月,冯皓,马北雁,张慎平;2010年2月至2010年7月,马北雁,张慎平;2010年7月至今,马北雁,张慎平,李源海。

马北雁先生,农学博士,具有基金从业资格。曾先后担任广东省科学院助理研究员、平安证券研究所农业和食品饮料行业研究员、平安证券综合研究所行业公司部副总经理等职务。2005年9月加入南方基金,2008年4月至今,任南方稳健基金经理;2008年4月至今,任南稳贰号基金经理。

张慎平先生,注册金融分析师(CFA),经济学硕士,具有基金从业资格。2003年加入南方基金,负责石化化工、建筑建材行业研究,2008年1月至2010年1月,任南方积配基金经理;2008年4月至今,任南方成份基金经理;2010年1月至今,任南方稳健基金经理;2010年1月至今,任南稳贰号基金经理。

李源海先生,经济学硕士,具有基金从业资格。曾任职于中国银行深圳分行、湘财证券有限责任公司投资银行部及证券投资部;2002年起进入基金行业,历任万家基金管理有限公司(原天同基金管理有限公司)研究部高级经理、基金管理部基金经理;2004年9月至2005年10月任万家增强收益债券型证券投资基金(原天同保本增值证券投资基金)基金经理;2006年7月至2007年7月任申万巴黎收益宝货币市场基金基金经理;2006年2月至2009年8月,任申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金基金经理;2008年7月至2009年8月,任申万巴黎竞争优势股票型证券投资基金基金经理。2009年8月,加入南方基金,任职于产品开发部;2010年1月至今,担任南方基金投资部副总监、南方积配基金经理。2010年7月至今,任南稳贰号基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

总经理高良玉先生,副总经理郑文祥先生,总经理助理兼投资总监邱国鹭先生,专户投资管理部总监吕一凡先生,固定收益部总监李海鹏先生,研究部总监史博先生,投资部执行总监陈键先生。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人基本情况

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:010-66105799
联系人:蒋松云

(二)主要人员情况

截至2010年6月末,中国工商银行资产托管部共有员工121人,平均年龄30岁,95%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2010年6月,托管证券投资基金165只,其中封闭式9只,开放式156只。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、股权基金、QFII资产、QDII资产等产品在内的托管业务体系。2010年初,中国工商银行凭借在2009年国内外托管领域的杰出表现和品牌影响力,先后被英国《全球托管人》和香港《财资》评选为"2009年度中国最佳托管银行",本届《财资》评选首次设立了在亚太地区证券和基金服务领域有突出贡献的年度行业领导者奖项,中国工商银行资产托管部周月秋总经理荣获"年度最佳托管银行家"称号,是仅有的两位获奖人之一。自2004年以来,中国工商银行资产托管服务已经获得23项国内外大奖。

三、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
住所及办公地址: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
法定代表人:吴万善
电话:0755-82763905、82763906
传真:0755-82763900
联系人:张锐珊

2. 代销机构

代销银行:

(1)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
联系人:田耕
联系电话:010-66107900
客服电话:95588
公司网站:www.icbc.com.cn

(2)中国建设银行股份有限公司
注册地址: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
联系人:王琳
联系电话:010-66275654
客服电话:95533
公司网站:www.ccb.com

(3)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
客服电话:95599
公司网站: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
联系电话:010-66594905
客服电话:95566
公司网站:www.boc.cn

(5)交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
联系人:陈洁
联系电话:021-58781234
客服电话:95559
公司网站:www.bankcomm.com

(6)招商银行股份有限公司
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
联系人:邓炯鹏
客服电话:95555
公司网站:www.cmbchina.com

(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:北京市西城区金融大街3号金鼎大厦A座中国邮政储蓄银行
法定代表人:刘安东
联系人:陈春林
客服电话:95580
公司网站: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
联系电话:0571-96000888,020-38322222
客服电话:400-830-8003
公司网站:www.gdb.com.cn

(9)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:上海市中山东一路12号
法定代表人:吉晓辉
联系人:倪苏云、虞谷云
联系电话:021-61618888
客服电话:95528
公司网站:www.spdb.com.cn

(10)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
联系人:金蕾
联系电话:010-65557013
客服电话:95558
公司网站:http://bank.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
法定代表人:唐双宁
客服电话:95595(全国)
公司网站:www.cebbank.com

(12)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
联系人:姜聃
联系电话:0755-82088888
客服电话:95501
公司网站: www.sdb.com.cn

(13)上海银行股份有限公司
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:宁黎明
联系人:张萍
联系电话:021-68475888
客服电话:021-962888
公司网站:www.bankofshanghai.com

(14)中国民生银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址:北京市西城区西单教育街三号西楼1126
法定代表人:董文标
联系人:董云巍
联系电话:010-57092615
客服电话:95568
公司网站:www.cmbc.com.cn

(15)北京银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街丙17号
法定代表人:阎冰竹
联系人:谢小华
联系电话:010-66223587
客服电话:010-96169
公司网站:www.bankofbeijing.com.cn

(16)平安银行股份有限公司
注册地址:广东省深圳市深南中路1099号平安银行大厦
办公地址:广东省深圳市深南中路1099号平安银行大厦
法定代表人:孙建一
联系人:蔡宇洲
联系电话:0755-22197874
客服电话:4006699999
公司网站:http://bank.pingan.com

(17)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
联系人:陈宇
联系电话:010-85238422
客服电话:95577
公司网站:www.hxb.com.cn

(18)东莞银行股份有限公司
注册地址:东莞市运河东一路193号
办公地址:东莞市运河东一路193号
法定代表 :廖玉林
联系人:胡昱
联系电话:0769-22119061
客服电话:0769-96228
公司网站:www.dongguanbank.cn

(19)宁波银行股份有限公司
注册地址:宁波市江东区中山东路294号
法定代表人:陆华裕
联系人:胡技勋
客服电话:96528,上海地区962528
公司网站:www.nbcb.com.cn

(20)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
联系人:江波
联系电话:0571-85108309
客服电话:0571-96523、4008888508
公司网站:www.hzbank.com.cn

(21)浙商银行股份有限公司
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:张达洋
联系人:毛真海
联系电话:0571-87659546
客服电话:95105665
公司网站:www.czbank.com

(22)青岛银行股份有限公司
注册地址:山东省青岛市市南区香港中路68号华普大厦(邮编266071)
办公地址:山东省青岛市市南区香港中路68号华普大厦(邮编266071)
法定代表人:张广鸿
客服电话:(青岛)96588,(全国)400-66-96588
公司网站:www.qdccb.com

(23)临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:王傢玉
联系人:寇廷柱
联系电话:0539-8304657
客服电话:400-699-6588
公司网站:www.lsbchina.com

(24)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
法定代表人:陈新民
联系人:骆芸
电话:027-82656224
客服电话:027-96558
公司网站:http://www.hkbchina.com

(25)江苏张家港农村商业银行股份有限公司
注册地址:张家港市杨舍镇人民中路66号
办公地址:张家港市杨舍镇人民中路66号
法定代表人:王自忠
联系人:姚珍珍
联系电话:0512-56968257
客服电话:0512-96065
公司网站:www.zrcbank.com

代销券商与其他代销机构:

(1)华泰证券股份有限公司
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
联系人:舒萌菲
联系电话:025-83290845
客服电话:95597
公司网站:www.chinatai.com.cn

(2)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
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:顾伟国
客服电话:4008-888-888
公司网站:www.chinastock.com.cn

(3)兴业证券股份有限公司
注册地址:福州市湖东路268号
办公地址:浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼21层
法定代表人:兰荣
联系人:谢高得
联系电话:021-38565785
客服电话:4008888123
公司网站:www.xyzq.com.cn

(4)广发证券股份有限公司
注册地址:广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316房)
办公地址:广东省广州天河北路大都会广场18、19、36、38、41和42楼
法定代表人:王志伟
联系人:黄岚
客服电话:95575
公司网站:www.gf.com.cn

(5)华泰联合证券有限责任公司
注册地址:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦10、24、25层
办公地址:深圳市福田区深南大道4011 号香港中旅大厦24、25楼
法定代表人:马昭明
联系人:庞晓芸
联系电话:0755-82492000
客服电话:95513
公司网站:www.lhzq.com

(6)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
办公地址:上海市浦东新区银城中路168号
法定代表人:祝幼一
电话:021-62580818-177
客服电话:4008888666
联系人:芮敏祺
公司网站:www.gtja.com

(7)中信证券股份有限公司
注册地址: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
联系人:陈忠
联系电话:010-84864818-63266
公司网站:www.cs.ecitic.com

(8)海通证券股份有限公司
注册地址: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
联系人:金芸、李笑鸣
联系电话:021-23219000
客服电话:400-8888-001、95553
公司网站:www.htsec.com

(9)中信建投证券有限责任公司
注册地址: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
联系人:魏明
联系电话:010-85130588
客服电话:4008888108
公司网站:www.csc108.com

(10)申银万国证券股份有限公司
注册地址:上海市常熟路171号
办公地址:上海市常熟路171号
法定代表人:丁国荣
联系电话:021-54033888
客服电话:021-962505
公司网站:www.sywg.com

(11)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
联系电话:0769-22119426
公司网站:www.dgzq.com.cn

(12)国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人:何如
联系人:齐晓燕
联系电话:0755-82130833
客服电话:95536
公司网站:www.guosen.com.cn

(13)招商证券股份有限公司
注册地址: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
联系人:黄健
联系电话:0755-82943666
客服电话:95565、4008888111
公司网站:www.newone.com.cn

(14)长城证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区深南大道特区报业大厦14、16、17层
办公地址:深圳市福田区深南大道特区报业大厦14、16、17层
法定代表人:黄耀华
联系人: 匡婷
联系电话:0755-83516289
客服电话: 0755-82288968;400-6666-888
公司网站:www.cc168.com.cn

(15)湘财证券有限责任公司
办公地址:湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
法定代表人:林俊波
联系人:钟康莺
联系电话: 021-68634518-8503
客服电话:400-888-1551
公司网站:www.xcsc.com

(16)中信金通证券有限责任公司
注册地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
法定代表人:刘军
联系人:俞会亮
联系电话:0571-85776115
客服电话:0571-96598
公司网站:www.bigsun.com.cn

(17)渤海证券股份有限公司
办公地址:天津市南开区宾水西道8号
注册地址:天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
法定代表人:张志军
联系人:王兆权
联系电话:022-28451861
客服电话: 4006515988
公司网站:www.bhzq.com

(18)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
联系人:胥春阳
联系电话:025-83364032
公司网站:www.njzq.com.cn

(19)国联证券股份有限公司
注册地址:江苏省无锡市县前东街168号
法定代表人:雷建辉
联系人:徐欣
联系电话:0510-82831662
客服电话:0510-82588168
公司网站:www.glsc.com.cn

(20)光大证券股份有限公司
注册地址: 上海市静安区新闸路1508号
办公地址: 上海市静安区新闸路1508号
法定代表人: 徐浩明
联系人:刘晨
联系电话: 021-22169999
客服电话:10108998
公司网站:www.ebscn.com

(21)东北证券股份有限公司
注册地址:长春市自由大路1138号
办公地址:长春市自由大路1138号
法定代表人:矫正中
联系人: 潘锴
联系电话:0431-85096709
客服电话:4006000686,0431-85096733
公司网站:www.nesc.cn

(22)广州证券有限责任公司
注册地址:广州市先烈中路69号东山广场主楼十七楼
办公地址:广州市先烈中路69号东山广场主楼十七楼
法定代表人:吴志明
联系人:林洁茹
联系电话:020-87322668
客服电话: 020-961303
公司网站:www.gzs.com.cn

(23)国都证券有限责任公司
注册地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
办公地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
法定代表人:常喆
联系人:黄静
联系电话:010-84183333
客服电话:400-818-8118
公司网站:www.guodu.com

(24)齐鲁证券有限公司
注册地址:山东省济南市经十路128号
办公地址:山东省济南市经十路128号
法定代表人:李玮
联系人: 傅咏梅
联系电话:0531-81283728
客服电话: 95538
公司网站:www.qlzq.com.cn

(25)中信万通证券有限责任公司
注册地址:青岛市崂山区香港东路316号
办公地址:青岛市东海西路28号
法定代表人:张智河
联系人:吴忠超
联系电话:0532-85022326
客服电话:0532-96577
公司网站:www.zxwt.com.cn

(26)山西证券股份有限公司
注册地址: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
联系人:张治国
联系电话:0351-8686703
客服电话:400-666-1618
公司网站:www.i618.com.cn

(27)长江证券股份有限公司
注册地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人:胡运钊
联系人:李良
联系电话:027-65799999
客服电话:95579或4008-888-999
公司网站:www.95579.com

(28)华西证券有限责任公司
注册地址:四川省成都市陕西街239号华西证券大厦
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:杨炯洋
联系人:金达勇
联系电话:0755-83025723
客服电话:4008888818
公司网站:www.hx168.com.cn

(29)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: 深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25层
法定代表人:刘学民
联系人:王立洲
联系电话:0755-25832494
公司网站: www.fcsc.cn

(30)中原证券股份有限公司
注册地址:郑州市经三路15号广汇国际贸易大厦
办公地址:郑州市郑东新区商务外环路10号
法定代表人:石保上
联系人:程月艳、耿铭
联系电话:0371—65585670
客服电话:967218、400-813-9666
公司网站:www.ccnew.com

(31)中银国际证券有限责任公司
注册地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39F
法定代表人:平岳
联系人:张静
联系电话:021-68604866
公司网站:www.bocichina.com

(32)东吴证券股份有限公司
注册地址:苏州工业园区翠园路181号商旅大厦
法定代表人:吴永敏
联系人:方晓丹
联系电话:0512-65581136
客服电话:0512-33396288
公司网站: http://www.dwzq.com.cn

(33)平安证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
办公地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
法定代表人:杨宇翔
联系人: 周璐
联系电话: 0755-22626172
客服电话: 4008816168
公司网站:http://www.pingan.com

(34)国海证券有限责任公司
注册地址:广西南宁市滨湖路46号
办公地址:广西南宁市滨湖路46号
法定代表人:张雅锋
联系人:武斌
联系电话:0775-83707413
客服电话:4008888100(全国)、96100(广西)
公司网站:www.ghzq.com.cn

(35)中国建银投资证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层至20层
办公地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层至20层
法定代表人:杨明辉
联系人:杨瑞芳
联系电话:0755-82026511
客服电话: 400-600-8008
公司网站:www.cjis.cn

(36)中航证券有限公司
注册地址:江西省南昌市抚河北路291号
办公地址:江西省南昌市抚河北路291号
法定代表人:杜航
联系人:余雅娜
联系电话:0791-6768763
客服电话:400-8866-567
公司网站: www.avicsec.com

(37)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
联系电话:010-59226788
客服电话:400-887-8827
公司网站:www.ubssecurities.com

(38)德邦证券有限责任公司
注册地址:上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼
办公地址:上海市福山路500号城建大厦26楼
法定代表人:方加春
联系人:罗芳
联系电话:021-68761616
客服电话:4008888128
公司网站:www.tebon.com.cn

(39)西南证券股份有限公司
注册地址:重庆市渝中区临江支路2号合景国际大厦A幢
办公地址:重庆市渝中区临江支路2号合景国际大厦A幢
法定代表人:王珠林
联系人: 米兵
联系电话: 023-63786922
客服电话: 4008096096
公司网站:www.swsc.com.cn

(40)财通证券有限责任公司
注册地址:杭州市解放路111号金钱大厦
办公地址:杭州市解放路111号金钱大厦
法定代表人:沈继宁
联系人: 乔骏
联系电话: 0571-87925129
客服电话: 0571-96336(上海地区:962336)
公司网站:www.ctsec.com

(41)方正证券有限责任公司
注册地址:湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22—24层
办公地址:湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22—24层
法定代表人:雷杰
联系人:彭博
联系电话:0731-85832343
客服电话:95571
公司网站:www.foundersc.com

(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: 江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦4楼
法定代表人:管荣升
联系人:徐美云
联系电话:0791-6289771
公司网站:www.gsstock.com

(43)华安证券有限责任公司
注册地址:安徽省合肥市长江中路357号
办公地址:安徽省合肥市阜南路166号润安大厦A座24-32层
法定代表人:李工
联系人:甘霖
联系电话:0551-5161821
客服电话:96518,4008096518
公司网站:www.hazq.com

(44)大同证券经纪有限责任公司
注册地址:山西省大同市大北街13号
法定代表人:董祥
联系人:苏妮
联系电话:0351-4167056
客服电话:4007121212
公司网站:www.dtsbc.com.cn

(45)华林证券有限责任公司
办公地址:深圳市福田区民田路178号华融大厦6楼
法定代表人:段文清
联系人: 杨玲
联系电话: 0755-82707888
客服电话: 400-880-2888
公司网站: www.chinalions.com

(46)新时代证券有限责任公司
注册地址: 北京市西城区月坛北街2号月坛大厦15层
办公地址: 北京市西城区金融街1号A座8层
法定代表人:马金声
联系人:朱雪雁
联系电话:010-83561165
公司网站:www.xsdzq.cn

(47)上海证券有限责任公司
注册地址:上海市西藏中路336号
法定代表人:郁忠民
联系电话:021-51539888
联系人:张瑾
公司网站:www.shzq.com
客服电话:4008918918,021-962518

(48)民生证券有限责任公司
注册地址:北京市朝阳区朝阳门外大街16号中国人寿大厦1901室
办公地址:北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心16层
法定代表人:岳献春
联系人:赵明
联系电话:010-85127622
客服电话:4006198888
公司网站:www.mszq.com

(49)宏源证券股份有限公司
注册地址:新疆乌鲁木齐市文艺路233号
办公地址: 北京市西城区太平桥大街19号
法定代表人:冯戎
联系人: 李巍
联系电话: 010-88085858
客服电话:4008-000-562
公司网站:www.hysec.com

(50)安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02
办公地址:深圳市福田区深南大道凤凰大厦1栋9层
法定代表人:牛冠兴
联系人:陈剑虹
联系电话:0755-82558305
客服电话:4008001001
公司网站: www.essence.com.cn

(51)东海证券有限责任公司
注册地址:江苏省常州市延陵西路59号常信大厦18楼
办公地址:江苏省常州市延陵西路59号常信大厦18楼
法定代表人:朱科敏
联系人:霍晓飞
客服电话:400-888-8588(全国),0519-88166222(常州),021-52574550(上海),0379-64902266(洛阳)
公司网站: www.longone.com.cn

(52)西部证券股份有限公司
办公地址:西安市东新街232号陕西信托大厦16-17层
法定代表人:刘建武
联系人:冯萍
联系电话:029-87406488
客服电话:029-95582
公司网站:www.westsecu.com.cn

(53)财富证券有限责任公司
注册地址:长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼
办公地址:长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼
法定代表人:周晖
联系人:郭磊
客服电话:0731-4403360
公司网站:www.cfzq.com

(54)恒泰证券股份有限公司
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:鞠瑾
联系人:常向东
联系电话: 0471-4913998
客服电话: 0471-4961259
公司网站:www.cnht.com.cn

(55)万联证券有限责任公司
注册地址:广州市中山二路18号电信广场36、37层
办公地址:广州市中山二路18号电信广场36、37层
法定代表人:张建军
联系人: 罗创斌
联系电话:020-37865070
客服电话: 400-8888-133
公司网站:www.wlzq.com.cn

(56)国元证券股份有限公司
注册地址:安徽省合肥市寿春路179号
办公地址:合肥市花园街花园宾馆14楼
法定代表人:凤良志
联系电话:0551-2634400
客服电话:全国统一热线95578,4008888777,安徽省内热线96888
公司网站:www.gyzq.com.cn

(57)金元证券股份有限公司
注册地址:海口市南宝路36号证券大厦4楼
办公地址:深圳市深南大道4001号时代金融中心17层
法定代表人:陆涛
联系人:金春
联系电话:0755-83025695
客服电话: 4008-888-228
公司网站: www.jyzq.com.cn

(58)浙商证券有限责任公司
注册地址:浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6-7楼
办公地址:浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6-7楼
法定代表人:吴承根
联系人:谢项辉
联系电话:0571-87901053
客服电话:967777
公司网站:www.stocke.com.cn

(59)中国国际金融有限公司
注册地址: 北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
办公地址: 北京市建国门外甲6号SK大厦
法定代表人:李剑阁
联系人:王雪筠
联系电话:010-85679265
客服电话:(010)85679238 (010)85679169
公司网站:www.ciccs.com.cn

(60)银泰证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区竹子林四路紫竹七道18号光大银行大厦18楼
办公地址:深圳市福田区竹子林四路紫竹七道18号光大银行大厦18楼
法定代表人:黄冰
联系电话:0755-83706665
客服电话:0755-83710885
公司网站:www.ytzq.net

(61)华鑫证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元
办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元
法定代表人:王文学
联系人:杨小江
联系电话:0755-82083788
客服电话:021-32109999,029-68918888
公司网站:www.cfsc.com.cn

(62)世纪证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦41/42层
办公地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦41/42层
法定代表人:卢长才
联系人:张婷
联系电话:0755-83199599
客服电话:0755-83199509
公司网站:www.csco.com.cn

(63)华宝证券有限责任公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路166号未来资产大厦23楼
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路166号未来资产大厦23楼
法定代表人:陈林
联系人:严俊权
联系电话:021-50122222
客服电话:400-820-9898
公司网站:www.cnhbstock.com

(64)华龙证券有限责任公司
办公地址:兰州市城关区静宁路138号东四楼
法定代表人:李晓安
联系人:李昕田
联系电话:0931-8888088
客服电话:96668(甘肃)
公司网站:www.hlzqgs.com

(65)日信证券有限责任公司
注册地址:内蒙古呼和浩特市新城区锡林南路18号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号长安兴融中心西座11层
法定代表人:孔佑杰
联系人: 张霄宇
联系电话:010-88086830-669
公司网站:www.rxzq.com.cn

(66)国金证券股份有限公司
注册地址:成都市东城根上街95号
办公地址:成都市东城根上街95号
法定代表人:冉云
联系人:金喆
联系电话:028-86690126
客服电话:4006-600109
公司网站:www.gjzq.com.cn

(67)江海证券有限公司
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
联系人:徐世旺
联系电话:0451-82336863
客服电话:400-666-2288
公司网站:www.jhzq.com.cn

(68)信达证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼信达金融中心
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼信达金融中心
法定代表人:张志刚
联系人:唐静
联系电话:010-63081000
客服电话:400-800-8899
公司网站:www.cindasc.com

(69)华融证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区月坛北街26号
办公地址:北京市西城区金融大街8号A座3层
法定代表人:丁之锁
联系人:梁宇
联系电话:010-58568007
客服电话:010-58568118
公司网站:www.hrsec.com.cn

(70)广发华福证券有限责任公司
注册地址:福州市五四路157号新天地大厦7-10层
办公地址:福州市五四路157号新天地大厦7-10层
法定代表人:黄金琳
联系人:张腾
联系人电话:0591-87383623
客服电话:96326(福建省外请加拨0591)
公司网站:www.gfhfzq.com.cn

(71)天相投资顾问有限公司
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
联系人:潘鸿
联系人电话:010-66045446
客服电话:010-66045678
公司网站: www.txsec.com ,www.txjijin.com

(72)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

南方基金管理有限公司
住所及办公地址: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
法定代表人:吴万善
电话:(0755)82763849
传真:(0755)82763889
联系人:古和鹏

(三)律师事务所和经办律师

名称:广东华瀚律师事务所
注册地址:深圳市罗湖区笋岗东路1002号宝安广场A座16楼G.H室
负责人:李兆良
电话:(0755)82687860
传真:(0755)82687861
经办律师:杨忠、戴瑞冬

(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:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法人代表:杨绍信
电话:(021)23238888
传真:(021)23238800
经办注册会计师:薛竞 单峰

四、基金名称

南方稳健贰号证券投资基金

五、基金的类型

契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金为稳健成长型基金,在控制投资风险并保持基金投资组合良好的流动性的前提下,力求使该为投资者提供稳健和长期稳定的资本利得。

七、基金的投资方向

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金投资的其他金融工具。其中又以上市公司所发行的股票为投资重点。本基金投资的主要对象为业绩优良并能稳定增长的上市公司的股票和具有较大成长潜力的上市公司的股票。

八、投资策略

在股票投资方面,本基金根据上市公司的获利能力和成长潜力,主要可以区分为价值型股票和成长型股票。本基金明确界定了价值型和成长型股票的特征,并依据该特征分别构造一个投资组合。本基金投资于这两个组合内股票的比例不低于股票投资部分的80%。

1、价值型股票投资组合

本基金价值型股票投资组合的对象主要是业绩优良并能持续稳定增长的上市公司。本基金将主要通过代表股东真实价值的经济附加值(ECONOMIC VALUE ADDED 或EVA)指标体系进行选择,即以EVA为基础,建立一个上市公司投资价值评分体系,并重点选择连续两年EVA排名靠前的公司进行投资。

2、成长型股票投资组合

成长型股票基本特征为,公司主导产品或服务在市场竞争中具有明显优势,使其经营业绩快速成长,主要表现为主营收入和主营业务利润的连续快速增长,从而为股东带来更大的价值,但这类股票往往由于市盈率较高,股价波动较大,因此风险相对也较高,尤其是在快速增长阶段临近结束时。本基金的成长型股票组合重点投资于未来连续两年预期主营业务收入及营业利润增长率高于我国国内生产总值(GDP)平均增长率2倍以上的公司股票,其中尤其重视具备较强股本扩张能力的公司。

在债券投资方面,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信用品质,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,采用久期(duration)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,发现其套利机会。

(二)投资决策

1、决策依据

(1)国家有关法律、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。这是基金投资决策的基础;
(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作出投资决策,是本基金维护投资者利益的重要保障。

2、决策程序

(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资产配置比例、恒定比例投资组合保险机制中各项参数的选择与调整等提出指导性意见。

(2)进行市场调研:证券分析人员根据各咨询机构提供的研究报告以及其他信息来源,选定重点关注的股票范围;在重点关注的股票范围内根据自己的调查研究选出有投资价值的股票向基金经理做出投资建议;根据基金经理提出的要求对上市公司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制定的投资原则前提下,遵循恒定比例投资组合保险机制,根据证券分析人员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:基金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、投资组合

本基金的投资组合将遵循以下限制:

1、投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的80%;

2、投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的20%;

3、本基金持有一家上市公司的股票,其市值不得超过基金资产净值的10%;

4、本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券,不得超过该证券的10%;

5、本基金不得违反本基金合同关于投资范围、投资策略和投资比例的约定;

6、本基金投资股权分置改革中产生的权证,在任何交易日买入的总金额,不超过上一交易日基金资产净值的0.5%,基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%,本公司管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%。其它权证的投资比例,遵从法规或监管部门的相关规定;

7、基金财产参与股票发行申购,本基金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发行股票的总量;

8、本基金买卖基金管理人、基金托管人的控股股东在承销期内担任副主承销商或分销商的证券,以及非控股股东在承销期内担任主承销商的证券,必须获得投资决策委员会批准,报法律、监察稽核部备案,并按规定履行信息披露义务;

9、相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制;

如法律法规或监管部门取消上述限制性规定,履行适当程序后,本基金不受上述规定的限制。

由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内,但基金管理人应在10个交易日内进行调整,以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

九、业绩比较基准

本基金业绩比较基准为上证综合指数×80%+上证国债指数×20%。

若未来市场发生变化导致此业绩基准不再适用,基金管理人可根据市场发展状况及本基金的投资范围和投资策略,调整本基金的业绩比较基准。业绩基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致,并在更新的招募说明书中列示。

十、风险收益特征

本基金为混合基金,属证券投资基金中的风险收益适中的品种。

十一、基金投资组合报告

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2010年8月20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。

本投资组合报告所载数据截至2010年6月30日(未经审计)。

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	3,385,550,261.90	67.16
	其中:股票	3,385,550,261.90	67.16
2	固定收益投资	1,149,241,601.20	22.80
	其中:债券	1,149,241,601.20	22.80
	资产支持证券	–	–
3	金融衍生品投资	–	–
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	471,712,653.69	9.36
6	其他资产	34,493,544.35	0.68
7	合计	5,040,998,061.14	100.00

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	27,748,382.35	0.55
B	采掘业	322,196,050.20	6.41
C	制造业	1,190,750,952.20	23.68
C0	食品、饮料	249,098,925.57	4.95
C1	纺织、服装、皮毛	7,580,250.00	0.15
C2	木材、家具	–	–
C3	造纸、印刷	15,113,060.00	0.30
C4	石油、化学、塑胶、塑料	98,122,372.80	1.95
C5	电子	50,849,470.42	1.01
C6	金属、非金属	190,889,557.39	3.80
C7	机械、设备、仪表	478,073,625.55	9.51
C8	医药、生物制品	88,271,468.07	1.76
C99	其他制造业	12,752,222.40	0.25
D	电力、煤气及水的生产和供应业	165,710,076.63	3.30
E	建筑业	102,067,190.00	2.03
F	交通运输、仓储业	172,024,304.77	3.42
G	信息技术业	97,067,889.15	1.93
H	批发和零售贸易	89,434,841.00	1.78
I	金融、保险业	1,010,054,185.69	20.09
J	房地产业	126,752,250.81	2.52
K	社会服务业	48,700,223.00	0.97
L	传播与文化产业	15,672,096.00	0.31
M	综合类	17,371,820.10	0.35
	合计	3,385,550,261.90	67.33

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)	占基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	15,296,216	199,003,770.16	3.96
2	601318	中国平安	3,372,603	157,871,546.43	3.14
3	000895	双汇发展	2,287,623	99,671,734.11	1.98
4	600048	保利地产	8,679,151	88,787,714.73	1.77
5	000776	广发证券	2,457,200	75,681,760.00	1.51
6	000001	深发展 A	4,116,215	72,074,924.65	1.43
7	601988	中国银行	19,373,062	65,674,680.18	1.31
8	600016	民生银行	10,777,041	65,201,098.05	1.30
9	601111	中国国航	6,274,545	64,502,322.60	1.28
10	000858	五 粮 液	2,644,237	64,069,862.51	1.27

4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	297,720,000.00	5.92
3	金融债券	773,484,000.00	15.38
	其中:政策性金融债	773,484,000.00	15.38
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	可转债	78,037,601.20	1.55
7	其他	–	–
8	合计	1,149,241,601.20	22.85

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	080220	08国开 20	7,000,000	693,770,000.00	13.80
2	0901040	09央票 40	1,500,000	147,255,000.00	2.93
3	0801017	08央行票据 17	1,000,000	101,390,000.00	2.02
4	113001	中行转债	771,580	78,037,601.20	1.55
5	080225	08国开 25	500,000	50,005,000.00	0.99

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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细

本基金本报告期末未持有权证。

8 投资组合报告附注

8.1 申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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、处罚的情形。

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 申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

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	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,973,246.14
2	应收证券清算款	8,985,705.28
3	应收股利	1,163,201.73
4	应收利息	19,656,304.40
5	应收申购款	715,086.80
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	34,493,544.35

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601318	中国平安	157,871,546.43	3.14	重大事项公告
2	000895	双汇发展	99,671,734.11	1.98	重大事项公告
3	600048	保利地产	88,787,714.73	1.77	非公开发行锁定期
4	000001	深发展 A	72,074,924.65	1.43	重大事项公告

十二、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。

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)
2006.7.25 – 2006.12.31	42.07%	1.11%	45.48%	1.01%	-3.41%	0.10%
2007.1.1-2007.12.31	117.75%	1.69%	73.30%	1.76%	44.45%	-0.07%
2008.1.1-2008.12.31	-52.99%	1.98%	-55.71%	2.28%	2.72%	-0.30%
2009.1.1-2009.12.31	41.82%	1.42%	61.49%	1.52%	-19.67%	-0.10%
2010.1.1-2010.6.30	-19.98%	1.18%	-21.52%	1.16%	1.54%	0.02%
自基金成立起至今	65.04%	1.61%	41.52%	1.74%	23.52%	-0.13%

十三、基金费用概览

(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)基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;
4)基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费;
5)基金份额持有人大会费用;
6)基金的证券交易费用;
7)银行汇划费用;
8)按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。

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

在通常情况下,基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计算,具体计算方法如下:

H=E×1.5%÷当年天数
H为每日应付的基金管理费
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。

2)基金托管费

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×2.5‰÷当年天数
H为每日应支付的基金托管费
E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

上述一、基金费用的种类中第4-6项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

3、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、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;
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
3、基金合同生效前的相关费用,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用;
4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(二)与基金销售有关的费用

1、申购费率按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	2.0%
100万≤M<500 万	1.6%
500万≤M<1000 万	1.0%
M≥1000 万	1000元

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中,

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
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1万元申购本基金,对应费率为2.0%,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:

净申购金额 = 10,000/(1+2.0%) = 9803.92元
申购费用 = 10,000-9803.92= 196.08元
申购份额 = 9803.92/1.0168 = 9641.93份

即:投资者投资1万元申购本基金,假设申购当日基金份额净值为1.0168元,则可得到9641.93份基金单位。

2、赎回费

赎回费率为0.5%,赎回费的25%归基金资产所有。

赎回费 = 赎回当日基金份额净值×赎回份额×赎回费率
赎回金额 = 赎回当日基金份额净值×赎回份额-赎回费

例、某投资者赎回本基金1万份基金单位,赎回费率为0.5%,假设赎回当日基金份额净值是1.0168元,则其可得到的赎回金额为:

赎回费用 = 1.0168×10,000×0.5% = 50.84元
赎回金额 = 1.0168×10,000-50.84 = 10,117.16元

即:投资者赎回本基金1万份基金单位,假设赎回当日基金份额净值是1.0168元,则其可得到的赎回金额为10,117.16元。

3、转换费

基金管理人已开通本基金与基金管理人旗下其他基金间的转换,具体业务规则详见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》、2007年8月30日发布的《南方基金关于旗下基金在部分代销机构开展转换业务的公告》和2007年6月7日发布的《南方基金关于旗下基金在直销网点开展转换业务的公告》。

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报刊或网站上刊登公告。

(三)其他费用

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

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"基金管理人"部分,对"基金经理"和"投资决策委员会委员"信息进行了更新。
2、在"基金托管人"部分,对"主要人员情况"、"基金托管业务经营情况"和"基金托管人的内部控制制度"进行了更新。
3、在"相关服务机构"部分,对代销机构和注册登记机构联系人信息进行了部分更新。
4、在"基金的投资组合报告"部分,更新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,更新了"净值增长率与同期业绩基准收益率比较表"。
6、对"基金份额持有人服务"进行了更新。
7、对"其他应披露事项"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
二〇一〇年九月二日