(上接D22版)

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
联系电话:0791-6289771
联系人:徐美云
公司网址: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
法定代表人:李工
联系人:唐泳
电话:0551-5161671
客户服务电话:0551-965184008096518
网址:www.hazq.com
(44)大同证券经纪有限责任公司
法定代表人:董祥
联系人:苏妮
邮政编码:030001
联系电话:0351-4167056
传真:0351-4192803
网址:www.dtsbc.com.cn
(45)华林证券有限责任公司
地址:珠海市拱北夏湾华平路96号二层202-203房
法定代表人:段文清
联系人:杨纱
联系电话:0755-83749624
客服电话:0755-82707866
公司网址:www.chinalions.com
(46)浙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
电话:010-83561165
传真:010-83561164
公司网址: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:蒋元真
联系电话:021-51539888
联系人:谢秀峰
公司网址:http://www.962518.com
客服电话: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
传真电话:010-85127917
客服热线:4006198888
公司网址:www.mszq.com
(49)东方证券股份有限公司
注册地址:上海浦东大道720号20楼
法定代表人:王益民
联系电话:021-68562200-3019
客服热线:021-962506
联系人:盛云
公司网址:www.dfzq.com.cn
(50)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号宏源证券
联系人:李巍
电话:010-88085338
客服电话:4008-000-562
公司网址:www.hysec.com
(51)友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单元
办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
法定代表人:牛冠兴
联系人:余江
开放式基金咨询电话:4008001001、020-96210
联系电话:0755-82558323
网址:www.essence.com.cn
(52)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:李涛
公司网址:http://www.longone.com.cn
客服电话:0519-88166222 021-52574550 0379-64902266
免费服务热线:400-888-8588
(53)西部证券股份有限公司
住所:西安市东新街232号陕西信托大厦16-17层
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
电话:029-87406488
传真:029-87406387
联系人:冯萍
网址:www.westsecu.com.cn
客户服务电话:029-95582
(54)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
客户咨询电话:0731-4403360
公司网址:www.cfzq.com
(55)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:刘汝军
电话:0471-4913998
传真:0471-4930707
联系人:常河东
客户服务电话:0471-4961259
网址:www.cnht.com.cn
(56)万联证券有限责任公司
注册地址:广州市中山二路18号广东电信广场36-37层
办公地址:广州市中山二路18号广东电信广场36-37层
法人代表:李舫金
联系人:罗创斌
联系电话:020-37865070
客服电话:400-8888-133
网址:www.wlzq.com.cn
(57)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
法定代表人:凤良志
公司电话:0551-2634400
传真:0551-2645709
网址:www.gyzq.com.cn
公司办公地址:安徽省合肥市寿春路179号
邮政编码:230001
(58)渝元证券股份有限公司
注册地址:海南省海口市南宝路36号证券大厦4层
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
电话:0755-83025695
传真:0755-83025625
联系人:金春
客服电话:4008-888-228
网址:www.jyzq.com.cn
(59)新商证券有限责任公司
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
电话:0571-87901963
联系人:吴颖
客户咨询电话:0571-87902079
网址:www.stocke.com
(60)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
电话:010-85679265
传真:010-85679535
客户服务电话:010-85679238 010-85679169
网址:www.cicc.com.cn
(61)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:高颂
电话:0755-83706665
传真:0755-83704195
客户服务热线:0755-83710885
公司网站:www.ytzq.net
(62)华鑫证券有限责任公司
注册地址:深圳市罗湖区深南东路5045号深业大厦25层2512、2513
办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28楼A01
法定代表人:王文学
联系人:杨小江
联系电话:0755-82083788
传真:0755-82083408
客服热线:021-62163333、029-68918888
网址:www.cfsc.com.cn
(63)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
法定代表人:卢长才
联系人:章茜
联系电话:0755-83199511
传真:0755-83199545
网址:www.csco.com.cn
(64)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
传真:021-50122200
客户服务热线:400-820-9898
公司网址:www.cnhbstock.com
(65)华龙证券有限责任公司
办公地址:甘肃省兰州市静宁路308号
法定代表人:李晓安
电话:0931-8888088
传真:0931-8490515
联系人:李昕田
客户服务热线:0931-4890619、4890618、4890100
网址:www.hlzqgs.com
(66)江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:洪明
联系人:张明
电话:010-88086830
网址:www.rxzq.com.cn
(67)国金证券股份有限公司
公司注册地址:成都市东城根上街95号
公司办公地址:成都市东城根上街95号
法定代表人:雷波
联系人:王丹
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
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
电话:0451-82336863
传真:0451-82287211
客户服务热线:400-666-2288
网址: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
传真:010-63080978
客服电话:400-800-8899
公司网址:www.cindasc.com
(70)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:北京市西城区月坛北街26号
法定代表人:丁之锁
联系人:梁宇
联系电话:010-58568007
传真:010-58568062
客户服务热线:010-58568118
公司网址:www.hrsec.com.cn
(71)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、8层
办公地址:福州市五四路157号新天地大厦7、8、10层
法定代表人:黄金琳
电话:0591-87841160
传真:0591-87841150
联系人:张腾
联系人电话:0591-87383623
开放式基金业务传真:0591-87383610
客服电话:96326(福建省外请加拨0591)
公司网址:www.gfhfzq.com.cn
(72)红塔证券股份有限公司
注册地址:云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼
办公地址:云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼
法定代表人:况雨林
联系人:刘晓明
联系电话:0871-3577888
公司网站:http://www.hongtastock.com
(73)中山证券股份有限公司
注册地址:广东省深圳市福田区益田路江苏大厦B栋15层
办公地址:深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心29层
法定代表人:吴永良
联系人:李玲
联系电话:0755-82570586
客服电话:0755-82943755
公司网站:http://www.zszq.com
(74)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
联系电话:010-66045446
客服电话:010-66045678
公司网站:www.txsec.com、www.txjijin.com
(75)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
以上代销银行和代销券商均代销本基金A级份额;代销银行中,除(2)中国建设银行股份有限公司、(5)交通银行股份有限公司、(8)广东发展银行股份有限公司、(12)兴业银行股份有限公司、(14)中国民生银行股份有限公司和(23)北京农村商业银行股份有限公司外,均代销本基金B级份额、代销券商全部代销本基金B级份额。
(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
广东华商律师事务所
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:单峰、薛竞

四、基金名称
南方现金增利基金

五、基金的类型
契约型开放式

六、基金的投资目标
本基金为具有高流动性、低风险和稳定收益的货币市场基金,在控制风险的前提下,力争为投资者提供稳定的收益。

七、基金的投资方向
本基金的投资标的物包括剩余期限在397天以内(含397天)的债券,期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、债券回购、银行定期存款、大额存单、现金以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

八、投资策略
本基金可投资的大类资产主要为货币市场工具,这些金融工具的投资期限较短,因此本基金资产配置的目标是充分满足流动性的基础上考虑稳定的投资收益。本基金的战略资产配置部分,主要包括市场利率预期、基金组合平均剩余期限水平等由投资决策委员会根据宏观经济情况及未来资金面的判断决定。本基金的战术资产配置部分,主要包括交易市场和投资品种选择、关键时期的时机选择、回购套利、选择价格低估的央行票据和短期债券投资等将由基金经理根据当时的市场情况,充分利用公司研究资源和金融工程技术调整资产配置比例,以期达到优化配置效果。

九、业绩比较基准
本基金基准收益率=同期7天通知存款利率(税后)。

十、风险收益特征
本基金力求在保持资产高度流动性和低风险的基础上为投资者创造稳定收益。

十一、基金投资组合报告(未经审计)
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根据本基金合同规定,于2010年09月28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2010年6月30日(未经审计)。

1 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	固定收益投资	5,410,869,434.02	69.79
	其中:债券	5,350,869,434.02	69.01
	资产支持证券	60,000,000.00	0.77
2	买入返售金融资产	532,201,358.30	6.86
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	1,202,447,520.06	15.51
4	其他资产	607,745,893.63	7.84
5	合计	7,753,264,206.01	100.00

2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	2.12	
	其中:买断式回购融资	0.00	
2	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
	报告期末债券回购融资余额	119,999,820.00	1.57
	其中:买断式回购融资	0.00	0.00

注:1、报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。2、在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%

3 期末基金组合剩余期限

3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	123
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	154
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	99

注:本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过180天

3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	21.07	1.57
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	4.19	-
2	30天(含)-60天	16.40	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	9.96	-
3	60天(含)-90天	16.40	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.58	-
4	90天(含)-180天	14.58	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.46	-
5	180天(含)-397天(含)	28.02	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	96.47	1.57

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	摊余成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	303,413,929.45	3.98
3	金融债券	1,008,732,863.42	13.24
	其中:政策性金融债	810,749,609.90	10.64
4	企业债券	677,409,474.67	8.89
5	企业短期融资券	3,361,313,166.48	44.10
6	其他	-	-
7	合计	5,350,869,434.02	70.21
8	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	1,310,159,318.06	17.19

5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	068007	06首都机场债	2,700,000	262,658,821.60	3.45
2	1081025	10鞍钢CP01	2,400,000	240,040,624.41	3.15
3	071304	07华夏02浮	2,000,000	197,983,253.52	2.60
4	0981228	09振华CP01	1,800,000	179,966,424.80	2.36
5	0801035	08央票35	1,600,000	162,721,982.63	2.14
6	0981184	09中油股CP02	1,600,000	160,159,279.64	2.10
7	1081106	10光明CP01	1,400,000	140,017,407.29	1.84
8	090306	09进出06	1,300,000	130,640,802.04	1.71
9	050229	05国开29	1,300,000	130,458,729.98	1.71
10	0980147	09中航工债浮	1,200,000	119,628,853.56	1.57

6 影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	102
报告期内偏离度的最高值	0.4373%
报告期内偏离度的最低值	0.2334%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.3048%

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	119004	澜电03	600,000	60,000,000.00	0.79

8 投资组合报告附注

8.1 基金计价方法说明。
本基金采用"摊余成本法"计价,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内平均摊销,每日计提收益。

8.2 若本报告期内货币市场基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券,应声明本报告期内是否存在该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。
本报告期内本基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券,但不存在该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

8.3 声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、处罚的情形。

8.4 其他资产构成

序号	其他资产	金额(元)
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	507,160,164.39
3	应收利息	54,711,004.87
4	应收申购款	45,549,724.37
5	其他应收款	75,000.00
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	607,745,893.63

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。

A级

阶段	份额净值收益率(1)	份额净值收益率标准差(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)
2004.3.5-2004.12.31	2.26%	0.16%	1.32%	0.00%	0.94%	0.16%
2005.1.1-2005.12.31	2.4948%	0.0027%	1.8000%	0.0003%	0.6948%	0.0024%
2006.1.1-2006.12.31	1.9638%	0.0019%	1.8800%	0.0005%	0.0838%	0.0014%
2007.1.1-2007.12.31	3.2640%	0.0046%	2.7150%	0.0018%	0.5490%	0.0028%
2008.1.1-2008.12.31	3.9326%	0.0148%	3.1080%	0.0032%	0.8246%	0.0116%
2009.1.1-2009.12.31	1.7435%	0.0069%	1.3781%	0.0001%	0.3654%	0.0068%
2010.1.1-2010.6.30	0.8419%	0.0025%	0.6810%	0.0000%	0.1609%	0.0025%
自基金合同生效起至今	17.5126%	0.0072%	13.7173%	0.0023%	3.7953%	0.0049%

B级

阶段	份额净值收益率(1)	份额净值收益率标准差(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)
2009.7.22-2009.12.31	1.0266%	0.0096%	0.6093%	0.0000%	0.4173%	0.0096%
2010.1.1-2010.6.30	0.9618%	0.0025%	0.6810%	0.0000%	0.2808%	0.0025%
自基金合同生效起至今	1.9982%	0.0068%	1.2909%	0.0000%	0.7073%	0.0068%

注:本基金收益每月集中支付并按1元面值结转为基金份额
自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比

十三、基金费用概览
(一)与基金运作有关的费用
1、与基金运作有关费用的种类:
(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)基金持续销售费用;(5)基金信息披露费用;(6)基金持有人大会费用;(7)与基金相关的会计师费和律师费;(8)按照国家有关规定可以列入的其他费用。
2、与基金运作有关费用计提方法、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,本基金的管理费按前一日基金资产净值0.33%的年费率计算,计算方法如下:
H=E×0.33%÷当年天数
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)基金托管人的托管费
在通常情况下,本基金的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计算,计算方法如下:
H=E×0.10%÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日基金资产净值
基金托管人的托管费每日计算,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取,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。
(3)上述(一)中(4)到(8)项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公告。
(二)与基金销售有关的费用
1、认购费
本基金的认购费率为0。
2、申购费
本基金的申购费率为0。
3、赎回费
本基金的赎回费率为0。
4、持续销售费
在通常情况下,本基金A级基金份额的持续销售费年费率为0.25%,B级基金份额的持续销售费年费率为0.01%。各级基金份额的持续销售费计提的计算方法如下:
H=E×R÷当年天数
H为每日应计提的持续销售费
E为前一日该级基金资产净值
R为该级基金份额的持续销售费率
基金管理人可以调整对各级基金份额计提的持续销售费率,但各级持续销售费年费率最高不超过0.25%。基金管理人必须在开始调整之日前3个工作日至少在一种中国证监会指定的媒体上刊登公告。
各级基金份额持续销售费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送持续销售费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中划出,经登记结算机构代付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。
5、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,转换费的有关规定详见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》和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》。
6、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第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。
(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"基金管理人概况"和"主要人员情况"进行了更新。
2、在"基金托管人"部分,对"主要人员情况"和"基金托管业务经营情况"进行了更新。
3、在"相关服务机构"部分,对代销机构信息进行了更新。
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"部分,对基金的业绩进行了更新。
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、对其他表述进行了更新。

南方基金管理有限公司
二〇一〇年十月二十二日

(上接D21版)

(75)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:刘权
电话:0755-82026521
传真:0755-82026539
网址:www.cjis.cn
(76)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:北京市建国门外大街甲6号SK大厦
法定代表人:李剑阁
联系人:王雪筠
客服电话:010-85679238、010-85679169
网址:www.cicc.com.cn
(77)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39层
法定代表人:唐新宇
客户服务电话:4006208888
联系人:张静
电话:021-68604866-8309
传真:021-50372474
网址:www.bocichina.com.cn
(78)中原证券股份有限公司
地址:郑州市经三路15号广汇国际贸易大厦
法定代表人:石保上
客服电话:0371-967218、4008139666
联系人:程月艳、耿铭
网址:www.ccnew.com
(79)西南证券股份有限公司
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
客服电话:4008096096
联系人:徐雅芮、杨再巧
网址:www.swsc.com.cn
(80)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
法定代表人:杨炯洋
客户服务热线:4008 888 818
联系人:金达勇
电话:0755-83025723
传真:0755-83025991
网址:www.hx168.com.cn
(81)德邦证券有限责任公司
办公地址:上海市浦东新区福山路500号城建大厦26楼(邮政编码:200122)
法定代表人:王军
客服电话:021-68761616-8125
电话:021-68761616
传真:021-68767981
网址:www.tebon.com.cn
(82)财富证券有限责任公司
办公地址:湖南长沙芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26层
法人代表:周晖
客户服务热线:0731-84403319
联系人:胡智
电话:0731-84779521
传真:0731-84403439
网址:www.cfzq.com
(83)申银万国证券股份有限公司
通讯地址:上海市常熟路171号
法定代表人:丁国荣
客服电话:021-962505
联系人:黄维琳、曹晔
电话:021-54033888
传真:021-54038844
网址:www.sywg.com
(84)华林证券有限责任公司
办公地址:珠海市拱北夏湾华平路96号二层202-203房
法定代表人:段文清
客服电话:0750—3160388各地营业部客户服务电话
联系人:杨纱
电话:0755-82707855
传真:0755-82707850
网址:www.chinalions.com
(85)华龙证券有限责任公司
注册地址:甘肃省兰州市静宁路308号
法定代表人:李晓安
联系人:李昕田
联系电话:0931-8490208
甘肃省客服电话:96668
网址:www.hlzqgs.com
(二)注册登记机构
名称:大成基金管理有限公司
住所:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
办公地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦33层
法定代表人:张树忠
电话:0755-83183388
传真:0755-83195239
联系人:范璞
(三)律师事务所和经办律师
名称:北京市金杜律师事务所
注册地址:北京市朝阳区东三环中路7号财富中心写字楼A座40层
办公地址:北京市朝阳区东三环中路7号财富中心写字楼A座40层
负责人:王玲
电话:0755-22163333
传真:0755-22163390
经办律师:靳庆军、宋萍萍
联系人:宋萍萍
(四)会计师事务所和经办注册会计师
公司名称:安永华明会计师事务所
注册地址:北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层
办公地址:北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层
法定代表人:葛明
经办注册会计师:张小东、樊淑华
电话:010-58153000
传真:010-85188298
联系人:涂珮施

四、基金的名称
大成行业轮动股票型证券投资基金

五、基金的类型
契约型

六、基金的运作方式
开放式

七、基金的投资目标
利用行业轮动效应,优化行业配置,获取超额投资收益,实现基金资产长期稳健增值。

八、基金的投资范围
本基金的投资对象为具有较好流动性的金融工具,包括国内依法发行交易的股票、债券、权证及法律、法规或监管机构允许基金投资的其他金融工具。

九、基金的投资策略
本基金将重点围绕我国经济周期动力机制与发展规律,研究我国国民经济发展过程中的结构化特征,捕捉行业轮动效应下的投资机会,自上而下的实施大类资产间的战略配置和股票类别间的战术配置,精选优质行业的优质股票,获取超额投资收益,实现基金资产的长期稳健增值。
行业轮动策略是本基金的核心投资策略,其在战略层面上升为经济景气轮动策略,指导本基金实施大类资产配置;其在战术层面形成以行业轮动为主,区域轮动和主题轮动为辅的组合投资策略,指导本基金实施股票资产类别配置;其在个股层面具化为实际的以费彻大类资产配置和股票类别资产配置为指导原则的个股精选策略。
1.大类资产配置
大量的实践经验表明,经济运行在客观上存在周期波动、经济的复苏、过热、滞胀和衰退并非突然发生,往往表现为各种经济变量在不同经济阶段不断演化、传递、扩散进而逐步展开的特征。经济波动过程中的潜在趋势可以通过表征经济增长和通货膨胀两个维度的特征指标反映出来。采用定量和定性相结合的方法,对特征指标进行时间序列分析和横向比较分析,有助于刻画宏观经济的运行状况、预测经济景气周期的未来走势。
行业轮动与宏观经济运行规律密不可分,经济景气轮动是行业轮动的决定因素,行业轮动是经济景气轮动的具体体现。经济景气轮动策略是本基金贯彻行业轮动投资理念,实施大类资产配置的重要依据。在经济景气轮动策略的基础上,本基金还将结合对股票市场与债券市场相对投资价值的分析,在基金合同约定的投资范围内,采用积极主动的策略,配置、调整投资组合中股票资产、债券资产和现金资产的构成比例,降低组合风险,提高投资收益率。
2.股票投资策略
(1)股票资产类别配置策略
本基金将在大类资产配置框架下,实施积极的股票资产类别配置策略,注重对产业结构、区域结构、资源结构、需求结构等因素的深入分析,挖掘行业运行规律,优化行业配置效率,捕捉行业轮动效应下各类型股票的投资机会。
本基金股票类别配置策略具体表现为行业轮动配置策略以及由此衍生出的区域轮动配置策略和主题轮动配置策略等,通过不断寻找上述策略的最佳契合点,适时调整、灵活配置股票投资组合,达到获取超额投资收益,实现基金资产长期稳健增值的投资目标。
1)行业轮动配置策略
在宏观经济周期的不同阶段或经济发展的不同时期,资源供给和产品需求、国家产业政策、国际间生产比较优势、国家和区域产业梯度转移等要素的变化,使得我国各行业景气程度存在差异;行业发展速度、节奏和盈利能力各不相同;景气状态在不同行业间交替出现,继而形成行业轮动效应。利用这种经济规律,对上述行业轮动决定要素进行深入分析,结合我国资本市场运行特点,识别行业轮动特征,预测行业轮动趋势,据此对股票资产实施行业配置,可以获得理想的投资收益。
2)区域轮动配置策略
区域经济是宏观经济的战略支撑,区域经济的发展状况也是宏观经济的缩影。我国各区域在资源禀赋、产业结构、区位优势、经济发展程度等方面存在明显差异,当原材料价格、人力成本、出口规模、国家区域政策等因素发生变化时,某些区域的独特优势将促使区域景气程度上升,相应的也会涌现一批受惠于区域整合、城市化、工业化、经济转型进程的行业。综合考虑各种经济因素和政策因素,有助于把握区域景气轮动循环的最大可能性,并据此作为股票资产行业配置的重要依据,提升投资组合获利能力。
3)主题轮动配置策略
行业轮动和区域轮动作为中国经济发展的两条主线,是本基金实施股票行业配置的主要依据。同时,本基金还将重点关注对我国证券市场可能产生重要影响的主题事件,以主题轮动配置策略作为股票行业配置策略的补充,进一步拓展获取超额收益的途径。
(2)个股精选策略
本基金的投资策略偏重大类资产配置和股票资产类别配置,而个股选择实际是对于行业配置策略的具体落实。本基金将在股票资产类别配置策略的框架下,精选优质股票构建投资组合,在获取股票行业配置收益的同时,最大化个股投资收益。
在个股选择过程中,本基金将基于行业配置的要求,从股票备选库中选择在流通市值等方面最具行业代表性的股票,在剔除存在明显风险而不适于本基金投资的股票后,确保基金股票资产的50%以上由相应行业中流通市值位于前15位的股票构成。本基金还将根据各个行业的不同行业特征,综合考虑PEG、PB和PS等指标以及行业研究员的研究成果,适当选择行业中其他优质个股构建投资组合,最终达到更为有效的实现股票类别配置策略的目标。
3.债券投资策略
本基金主要通过利率预测分析、收益率曲线变动分析、债券信用分析、收益率利差分析等策略配置债券资产,力求在保证基金资产总体的安全性、流动性的基础上获取稳定收益。
(1)利率预测分析
准确预测未来利率走势能为债券投资带来超额收益。当预期利率下调时,适当加大组合中长久期债券的投资比例,为债券组合获取价差收益;当预期利率上升时,减少长久期债券的投资,降低债券组合的久期,以控制利率风险。
(2)收益率曲线变动分析
收益率曲线会随着时间、市场情况、市场主体的预期变化而改变。本基金通过预测收益率曲线形状的变化,调整债券组合内部品种的比例,获得投资收益。
(3)债券信用分析
本基金通过对债券的发行者、流动性、所处行业等因素进行深入、细致的调研,准确评价债券的违约概率,提早预测债券评级的改变,捕捉价格优势或套利机会。
(4)收益率利差分析
本基金将在预测和分析同一市场不同板块之间、不同市场的同一品种之间、不同市场不同板块之间的收益率利差的基础上,采取积极投资策略,选择适当品种,获取投资收益。
4.其他金融工具投资策略
(1)本基金将在控制投资风险和保障基金财产安全的前提下,对权证进行投资。权证投资策略主要包括以下几个方面:
1)采用市场公认的多种期权定价模型对权证进行定价,作为权证投资的价值基准;
2)根据权证标的股票基本面的研究估值,结合权证理论价值进行权证趋势投资;
3)利用权证衍生工具的特性,通过权证与证券的组合投资,达到改善组合风险收益特征的目的,包括但不限于杠杆交易策略、看跌保护组合策略等。
(2)本基金将在充分考虑收益性、流动性和风险特征的基础上,积极运用监管机构允许基金投资的其他金融工具,以期降低组合风险,锁定既有收益,在一定程度上实现基金资产的保值、增值。

十、基金的业绩比较基准
80%×沪深300指数+20%×中证综合债券指数
本基金作为股票型基金,股票资产占基金资产的比例范围为60%-95%,固定收益类证券和