（上接D49版）

客服电话：400-8866-567
网址：http://www.avicsec.com/
（67）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
（68）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
（69）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.cicc.com.cn
（70）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
办公地址：山西省太原市长治路111号山西世贸中心A座F12、F13
法定代表人：董祥
联系人：薛津
电话：0351-4130322
传真：0351-4192803
客服电话：4007121212
网址：http://www.dtsbc.com.cn
（71）万正证券股份有限公司
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
（72）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
（73）西部证券股份有限公司
注册地址：陕西省西安市东新街232号陕西信托大厦16-17层
办公地址：陕西省西安市东新街232号陕西信托大厦1层
法定代表人：刘建武
联系人：冯萍
电话：029-87406488
传真：029-87424426
客服电话：95582
网址：http://www.westsecu.com/
（74）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
（75）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：邱培玲
联系电话：010-5832 8366
客服电话：400-887-8827
公司网站：www.ubssecurities.com
（76）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
（77）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
（78）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
电话：028-86690126
传真：028-86690126
客服电话：4006600109
网址：www.gjzq.com.cn
（79）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
（80）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：庞介民
联系人：常向东
联系电话：0471-4979037
网址：www.cnht.com.cn
（81）华龙证券有限责任公司
注册地址：兰州市城关区静宁路308号
办公地址：兰州市城关区东岗西路638号财富大厦4楼
法定代表人：李晓安
联系人：李杨
电话：0931-8784502
传真：0931-4890628
客服电话：4006-89-8888
网址：www.hlzqgs.com
（82）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：黄旭成
电话：0755-82083788
传真：0755-82083408
客服电话：021-32109999，029-68918888
网址：www.cfsc.com.cn
（83）信证证券有限责任公司????
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：张雪宇
联系电话：010-88086830-669
公司网站：www.rxzq.com.cn
（84）中天证券有限责任公司
注册地址：沈阳市和平区光荣街23甲
办公地址：沈阳市和平区光荣街23甲
法定代表人：李学琦
联系人：范守卫
联系电话：024-23268079
客服电话：4006180315
公司网站：www.stockren.com
（85）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：林爽
客服电话：010-66045678
传真：010-66045500
公司网址：http://www.txsec.com
公司基金网网址：https://jijin.txsec.com
（86）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C类基金份额，代销银行中除中国农业银行、邮储银行、广东发展银行、北京银行外均代销本基金A类基金份额；代销券商中除民生证券、东方证券、华西证券、华林证券、国元证券、中金公司、新时代证券、瑞银证券外均代销本基金A类基金份额。

（二）注册登记机构

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
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

广东华瀚律师事务所
注册地址：深圳市振华路402栋中联大厦511室
负责人：李兆良
电话：0755-83205718 13602620622
传真：0755-83203576
经办律师：杨忠、戴瑞冬

（四）会计师事务所和经办注册会计师

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
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：陈熹
经办会计师：薛竞、陈熹

四、基金名称

南方多利增强债券型证券投资基金

五、基金的类型

契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金属于债券型基金，投资目标是在债券稳定收益的基础上，通过股票一级市场申购等投资手段积极投资，获取高于投资基准的收益。

七、基金的投资方向

本基金主要投资于债券类金融工具。债券类金融工具包括国债、央行票据、金融债、信用等级为投资级的企业债（包括可转债）、资产支持证券、债券回购等法律法规或中国证监会允许投资的固定收益品种。上述资产投资比例不低于基金资产的80%。

本基金也可投资于非债券类金融工具。本基金不直接在二级市场买入股票、权证等权益类资产，但可以参与一级市场新股申购，并持有因在一级市场申购所形成的股票以及因可转债转股所形成的股票。本基金还可以持有股票所派发的权证，可分离债券产生的权证，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他非债券类品种。上述资产的投资比例不超过基金资产的20%。因上述原因持有的股票和权证等资产，本基金将在其可交易之日起的90个交易日内卖出。

本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

此外，如法律法规或中国证监会允许基金投资其他品种的，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围。

八、投资策略

1、债券投资策略。

首先我们根据宏观经济分析、资金面动向分析和投资人行为分析判断未来利率期限结构变化，并充分考虑组合的流动性管理的实际情况，配置债券组合的久期和债券组合结构；其次，结合信用分析、流动性分析、税收分析等综合影响确定债券组合的类属配置；再次，在上述基础上利用债券定价技术，进行个券选择，选择被低估的债券进行投资。在具体投资操作中，我们采用骑乘操作、放大操作、换券操作等灵活多样的操作方式，获取超额的投资收益。

（1）宏观分析策略。本基金以国内外的宏观经济走势与国家的财政与货币政策方向为出发点，采取自上而下的分析方法，评估未来投资环境的变化趋势。在宏观经济方面，本基金将密切关注经济运行的质量与效率，把握领先指标，预测未来走势；对于国家推行的财政与货币政策，本基金将深入分析其对未来宏观经济运行以及投资环境的影响。作为债券型基金，本基金将重点关注未来的利率变化趋势，因此，对宏观经济运行中的价格指数与中央银行的货币供给与利率政策研判将成为投资决策的基本依据，为资产配置提供具有前瞻性的指导。

（2）骑乘策略。

当市场利率期限结构向上倾斜并且相对较陡时，投资并持有债券一段时间，随着时间推移，债券剩余年限减少，市场同样年限的债券收益率较低，这时将债券按市场价格出售，投资者除了获得债券利息以外，还可以获得资本利得。在多数情况下，这样的骑乘操作策略可以获得比持有到期更高的收益。

（3）杠杆放大策略。

杠杆放大操作即利用回购等方式融入资金，并购买相对剩余年限长的债券，以期获取超额收益的操作方式。目前市场资金面充裕，回购利率较低，为杠杆放大操作提供了良好的市场机会。

（4）换券策略。

我们综合考虑利率期限结构、流动性、信用级别等因素对债券进行定价，以此为基础上，在属性相近的债券中，选择买入相对被低估的债券，卖出相对被高估的债券，进行换券操作。对于专业投资者，由于具有一定的投资规模，具备较强的议价能力，加上专业的定价技术，通过换券操作可以获得较好的超额收益。

（5）可转换债券投资策略

可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金将选择公司基本面优良的可转换债券进行投资，并采用期权定价模型等数量化估值工具进行定价。本基金持有的可转换债券可以转换为股票。

（6）资产支持证券等品种投资策略

包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等在内的资产支持证券，其定价受市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，采用数量化模型辅助确定其内在价值。

2、新股投资策略。

目前股票发行价格与二级市场价格之间存在一定的价差，新股申购成为一种风险较低的投资方式。本基金通过对宏观经济以及上市公司的基本面深入研究，并结合金融工程数量化模型，对于拟发行上市的新股等权益类资产进行合理估值，制定相应的申购和择时卖出策略。

九、业绩比较基准

本基金业绩比较基准为中央国债登记结算公司中债总指数（全价）。

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

本基金为债券型基金，属证券投资基金中的低风险品种，预期收益高于货币市场基金，风险低于混合型基金。

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2011年9月7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。

本投资组合报告所载数据截至2011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	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	94,361,058.01	8.75
	其中：股票	94,361,058.01	8.75
2	固定收益投资	909,767,597.40	84.39
	其中：债券	909,767,597.40	84.39
	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	12,820,882.32	1.19
6	其他各项资产	61,119,626.83	5.67
7	合计	1,078,069,164.56	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	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	15,248,000.00	2.09
B	采掘业	-	-
C	制造业	45,235,555.76	6.21
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	14,446,782.03	1.98
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	6,998,896.80	0.96
C6	金属、非金属	8,114,976.10	1.11
C7	机械、设备、仪表	15,674,900.83	2.15
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	739,736.48	0.10
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	15,470,400.00	2.12
H	批发和零售贸易	11,129,765.77	1.53
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	6,537,600.00	0.90
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	94,361,058.01	12.95

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	占基金资产净值比例（%）
1	300167	迪威视讯	660,000	15,470,400.00	2.12
2	300189	神农大丰	800,000	15,248,000.00	2.09
3	601566	九牧王	668,523	14,446,782.03	1.98
4	300173	松德股份	884,000	11,394,760.00	1.56
5	601010	文峰股份	617,977	11,129,765.77	1.53
6	000630	铜陵有色	336,721	8,114,976.10	1.11
7	300162	雷曼光电	277,734	6,998,896.80	0.96
8	300187	永清环保	120,000	6,537,600.00	0.90
9	601799	星宇股份	229,007	4,280,140.83	0.59
10	601199	江南水务	50,288	739,736.48	0.10

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	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	48,295,000.00	6.63
3	金融债券	89,725,700.00	12.32
	其中：政策性金融债	89,725,700.00	12.32
4	企业债券	543,853,744.55	74.65
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	227,893,152.85	31.28
8	其他	-	-
9	合计	909,767,597.40	124.88

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	占基金资产净值比例（%）
1	110015	石化转债	624,370	67,338,304.50	9.24
2	113001	中行转债	634,880	67,030,630.40	9.20
3	1101018	11央票18	500,000	48,295,000.00	6.63
4	080216	08国开16	400,000	40,740,000.00	5.59
5	122867	11石城投	300,000	30,864,000.00	4.24

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

注：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

注：本基金本报告期末未持有权证。

8、投资组合报告附注

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、处罚的情形。

8.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	49,566,220.63
3	应收股利	-
4	应收利息	11,174,369.81
5	应收申购款	129,036.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	61,119,626.83

8.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113001	中行转债	67,030,630.40	9.20
2	110003	新钢转债	16,897,985.00	2.32
3	125709	唐钢转债	8,354,897.84	1.15
4	125731	美丰转债	7,609,808.64	1.04
5	126729	燕京转债	7,023,527.78	0.96
6	110011	歌华转债	5,684,762.70	0.78
7	110007	博汇转债	5,022,065.00	0.69
8	110009	双良转债	2,243,800.00	0.31
9	110078	澄星转债	1,190,700.00	0.16

8.5 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	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	601566	九牧王	14,446,782.03	1.98	新股锁定
2	601010	文峰股份	11,129,765.77	1.53	新股锁定

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。

南方多利A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
2009.9.23-2009.12.31	4.66%	0.32%	-0.28%	0.04%	4.94%	0.28%
2010.1.1-2010.12.31	4.45%	0.25%	-0.87%	0.10%	5.32%	0.15%
2011.1.1-2011.6.30	-1.29%	0.29%	-0.43%	0.08%	-0.86%	0.21%
自基金转型至今	7.92%	0.27%	-1.58%	0.09%	9.50%	0.18%

南方多利C

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
2007.8.28-2007.12.31	7.04%	0.25%	-1.22%	0.11%	8.26%	0.14%
2008.1.1-2008.12.31	3.37%	0.20%	11.01%	0.21%	-7.64%	-0.01%
2009.1.1-2009.12.31	3.42%	0.27%	-4.44%	0.11%	7.86%	0.16%
2010.1.1-2010.12.31	4.11%	0.25%	-0.87%	0.10%	4.98%	0.15%
2011.1.1-2011.6.30	-1.44%	0.29%	-0.43%	0.08%	-1.01%	0.21%
自基金转型至今	17.41%	0.25%	3.42%	0.14%	13.99%	0.11%

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）特许销售费；
（4）证券交易费用；
（5）银行汇划费用；
（6）基金信息披露费用；
（7）基金持有人大会费用；
（8）与基金相关的会计师费和律师费；
（9）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0.6%的年费率计算，计算方法如下：

H=E×0.6%÷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0.2%的年费率计算，计算方法如下：

H=E×0.2%÷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“1、与基金运作有关费用的种类”中（4）到（9）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

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。

4、基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率或持续销售费等相关费率。调高基金管理费率、基金托管费率或持续销售费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率或或持续销售费率，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2个工作日在至少一家指定报刊和网站公告并报中国证监会备案。

（二）与基金销售有关的费用

1、申购费

本基金C类基金份额的申购费率为零，但从本类别基金资产中计提持续销售费；A类基金份额收取申购费，但不从本类别基金资产中计提持续销售费。

本基金申购费率如下：

费率种类	A类基金份额		C类基金份额
申购费率	购买金额（M）	前端申购费率	0
	M<100万	0.8%	
	100万≤M<500万	0.5%	
	500万≤M<1000万	0.1%	
	M≥1000万	每笔1000元	

2、赎回费

本基金A类、C类基金份额的赎回费率均最高不超过0.1%。持有期限在30日以内的基金份额，赎回费率为0.1%；持有期限超过30日（含30日）的基金份额，不收取赎回费用。

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，其中不低于25%的部分归入基金财产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

3、持续销售费

持续销售费主要用于支付销售机构佣金、以及基金管理人的基金行销广告费、促销活动费、持有人服务费等。本基金A类不收取持续销售费，C类基金份额的持续销售费按前一日基金资产净值的0.3%年费率计提。持续销售费的计算方法如下：

H=E×0.3%÷当年天数
H为每日应付的持续销售费
E为前一日的C类基金份额的基金资产净值

持续销售费每日计算，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持续销售费划款指令，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付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率或持续销售费等相关费率。

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，根据国际金融机构的惯例，基金管理人于2011年4月18日正式启用高级管理层职位职衔体系“总裁序列”。相较之前，原总经理职衔，现变更为总裁；原副总经理/总经理助理职衔，现变更为副总裁/总裁助理。据此变化，对“生要人员情况”相关信息进行了更新；公司增聘了副总裁，对“总经理及其他高级管理人员”相关信息进行了更新；同时还对“基金经理”工作履历进行了更新。。

2、在“基金托管人”部分，对托管人情况进行了更新。
3、在“相关服务机构”部分，更新了本基金代销机构的信息。
4、在“基金的投资”部分，更新了本基金最近一期投资组合报告的内容。
5、在“基金份额持有人服务”部分，对部分服务内容进行了更新。
6、对“其他应披露事项”进行了更新。
7、对部分其他表述进行了更新。

南方基金管理有限公司
二〇一一年九月三十日

（上接D51版）

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
（55）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
（56）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.cicc.com.cn
（57）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
办公地址：山西省太原市长治路111号山西世贸中心A座F12、F13
法定代表人：董祥
联系人：薛津
电话：0351-4130322
传真：0351-4192803
客服电话：4007121212
网址：http://www.dtsbc.com.cn
（58）万正证券股份有限公司
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
（59）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
（60）西部证券股份有限公司
注册地址：陕西省西安市东新街232号陕西信托大厦16-17层
办公地址：陕西省西安市东新街232号陕西信托大厦1层
法定代表人：刘建武
联系人：冯萍
电话：029-87406488
传真：029-87424426
客服电话：95582
网址：http://www.westsecu.com/
（61）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
（62）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：邱培玲
联系电话：010-5832 8366
客服电话：400-887-8827
公司网站：www.ubssecurities.com
（63）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
（64）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
（65）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
电话：028-86690126
传真：028-86690126
客服电话：4006600109
网址：www.gjzq.com.cn
（66）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
（67）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：庞介民
联系人：常向东
联系电话：0471-4979037
网址：www.cnht.com.cn
（68）华龙证券有限责任公司
注册地址：兰州市城关区静宁路308号
办公地址：兰州市城关区东岗西路638号财富大厦4楼
法定代表人：李晓安
联系人：李杨
电话：0931-8784502
传真：0931-4890628
客服电话：4006-89-8888
网址：www.hlzqgs.com
（69）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：黄旭成
电话：0755-82083788
传真：0755-82083408
客服电话：021-32109999，029-68918888
网址：www.cfsc.com.cn
（70）信证证券有限责任公司
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：张雪宇
联系电话：010-88086830-669
公司网站：www.rxzq.com.cn
（71）中天证券有限责任公司
注册地址：沈阳市和平区光荣街23甲
办公地址：沈阳市和平区光荣街23甲
法定代表人：李学琦
联系人：范守卫
联系电话：024-23268079
客服电话：4006180315
公司网站：www.stockren.com
（72）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：林爽
客服电话：010-66045678
传真：010-66045500
公司网址：http://www.txsec.com
公司基金网网址：https://jijin.txsec.com
其他具有开放式代销资格的证券公司请向当地营业网点查询。

（二）、登记结算机构

名称：南方基金管理有限公司
地址：深圳市福田中心区福华一路六号免税商务大厦塔楼31、32、33层整层
法定代表人：吴万善
联系人：古和鹏
电话：0755-82763849
传真：0755-82763868

（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

名称：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1318号星展银行大厦6楼
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：陈熹
经办会计师：薛竞、陈熹

四、基金名称

中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金

五、基金的类型

契约型开放式

六、基金的投资目标

通过投资于小康ETF，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

七、基金的投资方向

本基金主要投资于小康ETF、标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股、新股、债券、股指期货及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中投资于小康ETF的比例不少于基金资产净值的90%，基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金还可以投资于中国证监会允许基金投资的其它金融工具。待其他衍生金融产品推出以后，基金管理人可以在控制风险的前提下运用衍生金融产品进行投资。

八、投资策略

本基金为完全被动式指数基金，以小康ETF作为其主要投资标的，方便特定的客户群通过本基金投资小康ETF。本基金并不参与小康ETF的管理。

（一）资产配置策略

为实现投资目标，本基金将以不低于基金资产净值90%的资产投资于小康ETF。其余资产可投资于标的指数成份股、备选成份股、非成份股、新股、债券、股指期货及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，其目的是为了使本基金在应付申购赎回的前提下，更好地跟踪标的指数。

在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.3%，年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

（二）目标ETF投资策略

1、投资组合的构建

基金合同生效后，本基金将主要按照标的指数成份股的基准权重构建股票组合，并在建仓期内将股票组合换购成小康ETF，使本基金投资于小康ETF的比例不少于基金资产净值的90%。

2、投资组合的投资方式

本基金投资小康ETF的两种方式如下：

（1）申购和赎回：小康ETF开放申购赎回后，以股票组合进行申购赎回。

（2）二级市场方式：小康ETF上市交易后，在二级市场进行小康ETF基金份额的交易。

本基金将通过《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》允许的方式申购赎回小康ETF份额。目前本基金申购赎回小康ETF份额通过租用小康ETF申购赎回代理券商的交易单元进行。

当小康ETF申购、赎回或交易模式进行了变更或调整，本基金也将作相应的变更或调整，无须召开基金份额持有人大会。

（三）成份股、备选成份股投资策略

本基金对成份股、备选成份股的投资目的是为准备构建股票组合以申购小康ETF。因此对可投资于成份股、备选成份股的资金头寸，主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

（四）债券投资策略

本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略，根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化，并利用债券定价技术，进行个券选择，同时着重考虑基金的流动性管理需要，选取到期日在一年以内的政府债券进行配置。

（五）股指期货及其他金融衍生品的投资策略

本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对现货和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值