(上接D26版)

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
(58)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
(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.cicc.com.cn
(60)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
(61)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.founderse.com
(62)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:杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心1602室
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
(63)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
(64)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/
(65)那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
(66)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
(67)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
(68)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
(69)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
(70)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
(71)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
(72)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
(73)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、C01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、C01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
(74)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:孔伯杰
联系人:张霄宇
联系电话:010-88086830-669
公司网站:www.rxzq.com.cn
(75)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:wwww.stockren.com
(76)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
(77)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

南方绩优成长股票型证券投资基金

五、基金的类型

契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金为股票型基金,在适度控制风险并保持良好流动性的前提下,根据对上市公司的业绩质量、成长性与投资价值的权衡与精选,力争为投资者寻求超越基准的投资回报与长期稳健的资产增值。

七、基金的投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括投资于国内依法公开发行、上市的股票和债券以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具.股票投资是基于对上市公司业绩质量、成长性与投资价值的权衡,精选中长期持续增长或未来阶段性高速增长、业绩质量优秀、且价值被低估的绩优成长股票作为主要投资对象。债券投资主要包括国债、金融债、企业债与可转换债券等.其他金融工具投资主要包括剩余年限小于397天的债券、期限在一年以内的债券回购以及中央银行票据等货币市场工具以及权证等。

股票占基金资产的60%-95%,其中对绩优成长股票的投资不低于股票投资比例的80%;现金、债券、货币市场工具以及权证等其他金融工具占基金资产的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金资产净值的5%。

如法律法规或监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,可以将其纳入投资范围。

八、投资策略

(一)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。

(二)股票投资策略

本基金的股票投资主要采用"自下而上"的策略,通过对上市公司基本面的深入研究,基于对上市公司的业绩质量、成长性与投资价值的权衡,不仅重视公司的业绩与成长性,更注重公司的业绩与成长性的质量,精选中长期持续增长或未来阶段性高速增长、业绩质量优秀、且价值被低估的绩优成长股票作为主要投资对象。本基金的股票投资同时结合"自上而下"的行业分析,根据宏观经济运行、上下游行业运行态势与利益分配的观察来确定优势或景气行业,以最低的组合风险精选并确定最优质的股票组合。

1、绩优成长股票的定义

绩优成长股票是指具有如下特征的品种:

①被证监会行业分类标准,对各行业上市公司按PEG指标由低到高进行排序,选取各行业排名前30%的股票;

②ROE不低于6%的股票。

本基金将根据以上标准选择股票,构造绩优成长股备选库。

2、"自下而上"的个股选择

对绩优成长股备选库中的股票,本基金以定性和定量分析相结合的方法,精选个股,构建组合。

在定性分析中,本基金注重上市公司以下五个方面的情况:①行业增长空间;②行业结构;③上下游地位;④竞争优势;⑤管理能力.行业增长空间分析主要是按照行业发展四阶段理论,判断行业处于哪个发展阶段.行业结构分析主要考察行业集中度和上市公司行业地位,在行业竞争中上市公司受影响的程度.上下游地位分析主要考察企业所在行业的上下游运行态势与利益分配,决定企业在产业链中处于何种地位.竞争优势分析主要考察企业在规模经济、资源或政策垄断、技术创新、品牌、经营效率等方面是否具有竞争对手在中长期时间内难以模仿的显著优势.管理能力分析主要考察企业管理层是否重视股东利益,管理水平是否能适应企业竞争优势的维持与开拓,以及管理层激励考核方式。

通过定性分析,本基金将优先选择具有良好的行业增长空间,所处行业结构相对稳定,在产业链中处于优势地位或上下游运行态势好转,具有一定的垄断竞争优势,公司治理结构透明完善,管理水平领先的上市公司。

在定量分析中,本基金注重上市公司以下五个方面的指标:①盈利能力指标,如净资产收益率等。②盈利质量指标,如各项现金流指标等。③成长能力指标,如长期主营业务收入增长率等。④运营能力指标,如总资产周转率等。⑤负债水平指标,如资产负债率等。其中,本基金无其主重根据上市公司过去三年净资产收益率情况,结合公司未来基本面可能发生的变化,确定符合绩优成长股票特征的品种进行重点投资。

本基金对上述定性和定量指标建立了估值模型,通过对这些指标的综合分析评估,从中挑选出综合评分高的绩优成长股进行投资。

本基金将根据对宏观经济走向和市场发展态势的判断,以长期持有绩优成长股为主,辅以积极主动的波段操作。在操作过程中强调风险控制,及时剔除基本面恶化、短期估值水平过高的组合个股,并置换进更具投资价值的绩优成长股,对组合进行动态调整.本基金将对股票库中的股票进行跟踪维护,根据上市公司公开披露信息和本基金调研结果,定期按照本基金的投资理念,对上市公司重新进行排序评分,并及时剔除不符合标准的股票。

2、"自上而下"的行业选择

本基金的股票投资同时结合"自上而下"的行业分析,根据宏观经济运行、上下游行业运行态势与利益分配的观察来确定优势或景气行业,以最低的组合风险精选并确定最优质的股票组合。

在行业选择中,本基金注重以下四个方面的情况:①宏观经济景气状况及所处阶段,主要分析目前经济增长的构成、来源、景气状况,寻找在当前增长模式下增长空间和弹性最大的行业,寻找经济转型中受益程度最高的行业。②金融货币政策变化情况,主要根据不同阶段的利率、汇率、财政、货币政策、寻找阶段最优行业。③产业政策及发展环境的变化,主要根据国家不同阶段对不同产业的政策和环境,寻找受扶持、受鼓励、发展环境得到持续改善的行业,获取这一行业高速发展的机会。④行业所处的生命周期及其在产业链中的地位变化,主要是动态分析行业发展周期、与上下游关系与谈判地位,寻找产业链中由弱转强或优势扩大的行业。

(三)债券投资策略

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)等。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,采用久期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。

(四)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,并结合权证定价模型寻求其合理估值水平,主要考虑运用的策略包括:杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、实空保护性的认购权证策略、买入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,谨慎进行投资,追求较稳定的当期收益。

九、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:

80%×沪深300指数+20%×上证国债指数

如果指数编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称、或有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,经与基金托管人协商一致,本基金管理人有权对此基准进行调整并及时公告。

十、风险收益特征

本基金为股票型基金,因此,其预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金及货币市场基金。

十一、基金的投资组合报告 (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股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年12月9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。

本报告组合报告所载数据截至2011年9月30日。(未经审计)

(一)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	6,810,639,398.71	74.93
	其中:股票	6,810,639,398.71	74.93
2	固定收益投资	521,838,000.00	5.74
	其中:债券	521,838,000.00	5.74
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	678,001,337.00	7.46
	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	1,064,131,890.00	11.71
6	其他资产	14,868,133.49	0.16
7	合计	9,089,478,759.20	100.00

(二)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	采掘业	504,383,386.96	5.76
C	制造业	4,557,131,165.85	52.03
C0	食品、饮料	1,111,801,127.07	12.69
C1	纺织、服装、皮毛	196,788,696.03	2.25
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	290,281,028.24	3.31
C5	电子	502,402,252.65	5.74
C6	金属、非金属	567,579,394.80	6.48
C7	机械、设备、仪表	1,572,212,610.46	17.95
C8	医药、生物制品	316,066,056.60	3.61
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	979,000.00	0.01
E	建筑业	582,538,064.31	6.65
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	255,727,145.64	2.92
H	批发和零售贸易	211,604,262.24	2.42
I	金融、保险业	469,648,656.96	5.36
J	房地产业	101,361,162.00	1.16
K	社会服务业	46,324,154.75	0.53
L	传播与文化产业	80,942,400.00	0.92
M	综合类	-	-
	合计	6,810,639,398.71	77.76

(三)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	600111	包钢稀土	9,016,863	495,927,465.00	5.66
2	000858	五粮液	11,999,796	435,592,594.80	4.97
3	000001	深发展A	19,999,971	320,799,534.84	3.66
4	600406	国电南瑞	8,398,904	293,793,661.92	3.35
5	601668	中国建筑	80,650,030	272,597,101.40	3.11
6	600519	贵州茅台	1,383,657	263,711,187.63	3.01
7	002236	大华股份	5,966,008	254,032,620.64	2.90
8	601699	潞安环能	8,433,744	246,180,987.36	2.81
9	000651	格力电器	12,049,059	240,860,689.41	2.75
10	600195	中牧股份	11,775,705	218,086,056.60	2.49

(四)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	521,838,000.00	5.96
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	521,838,000.00	5.96

(五)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	1101018	11央票18	2,000,000	193,320,000.00	2.21
2	1101016	11央票16	1,600,000	154,672,000.00	1.77
3	1101022	11央票22	800,000	77,280,000.00	0.88
4	1101028	11央票28	600,000	57,936,000.00	0.66
5	1101020	11央票20	200,000	19,320,000.00	0.22

(六)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。

(七)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。

(八)投资组合报告附注

1.本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的情况。本基金投资的前十名证券的发行主体除五粮液(000858)外,没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

根据2011年5月27日宜宾五粮液股份有限公司(下称:五粮液,股票代码:000858)《宜宾五粮液股份有限公司关于收到中国证监会<行政处罚决定书>的公告》,中国证券监督管理委员会决定根据《中华人民共和国证券法》的有关规定,就五粮液①《关于四川省宜宾五粮液投资(咨)询有限责任公司对成都智溢塑胶制品有限公司在亚洲证券有限责任公司的证券投资款的〈澄清公告〉存在重大遗漏;②在中国科技证券有限责任公司的证券投资信息披露不及时、不完整;③2007年年度报告存在录入差错未及时更正;④未及时披露董事被司法羁押事项等,对五粮液给予警告,并处以60万元罚款。

基金管理人对上述股票的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

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。

3.其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,963,169.03
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,941,614.39
5	应收申购款	963,350.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,868,133.49

4.本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债券。

5.本基金本报告期末前十名股票中流通受限情况。

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600406	国电南瑞	209,880,000.00	2.40	非公开发行

注:本基金本报告期末前十名股票中除上述股票不存在流通受限情况。

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
2006.11.16-2006.12.31	21.13%	1.22%	25.77%	1.25%	-4.64%	-0.03%
2007年度	149.22%	2.05%	117.93%	1.84%	31.29%	0.21%
2008年度	-49.47%	2.10%	-56.18%	2.44%	6.71%	-0.34%
2009年度	59.48%	1.86%	73.61%	1.64%	-14.13%	0.22%
2010年度	2.38%	1.38%	-9.12%	1.26%	11.50%	0.12%
2011.01.01-2011.09.30	-16.02%	1.08%	-13.57%	1.01%	-2.45%	0.07%
自基金成立起至今	109.16%	1.77%	63.78%	1.75%	45.38%	0.02%

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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×1.5%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,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管理费划款指令,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。

②基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.25%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

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付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

③上述一、基金费用的种类中第3-7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

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、费用调整

基金管理费、基金托管费率或基金销售费率等费率(但根据法律法规的要求提高该等报酬费率标准的除外),须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率,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依照《信息披露办法》的有关规定在至少一种指定媒体上公告。

5、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

(二)与基金销售有关的费用

1、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:

前端收费:

购买金额(M)	申购费率
M<100万	1.5%
100万≤M<500万	0.9%
500万≤M<1000万	0.3%
M≥1000万	每笔1000元

后端收费(其中1年为365天):

持有期限(N)	申购费率
N<1年	1.8%
1年≤N<2年	1.5%
2年≤N<3年	1.2%
3年≤N<4年	0.8%
4年≤N<5年	0.4%
N≥5年	0

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:

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。

2、赎回费

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)	赎回费率
N<1年	0.5%
1年≤N<2年	0.3%
N≥2年	0

赎回费的25%归基金资产所有。

3、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2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。

4、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,具体内容详见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》及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》。

(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》及其他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,对基金管理人主要人员情况进行了更新。

2、在"基金托管人"部分,对托管人"基金托管人概况"、"主要人员情况"、"基金托管业务经营情况"、"基金托管人的内部控制制度"和"基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序"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进行了更新。

4、删除了"基金的募集"和"基金合同的生效"两个章节,并相应调整了其他章节的序号。

5、补充了本基金上市交易的时间。

6、补充了本基金开放申购赎回业务的时间及开通定期定额业务的相关情况。

7、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。

8、在"基金的业绩"部分,补充了本基金最近一期的业绩报告。

9、对"基金份额持有人服务"进行了更新。

10、对"其他应披露事项"进行了更新。

南方基金管理有限公司
二〇一一年12月28日

(上接D28版)

(54)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
(55)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
(56)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.founderse.com
(57)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:杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心1602室
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
(58)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
(59)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/
(60)那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
(61)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
(62)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
(63)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
(64)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
(65)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
(66)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
(67)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
(68)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、C01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、C01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
(69)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:孔伯杰
联系人:张霄宇
联系电话:010-88086830-669
公司网站:www.rxzq.com.cn
(70)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
(71)其他基金代销机构情况详见基金管理人发布的相关公告。
(二)场内代销机构
场内代销机构是指具有基金代销业务资格、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位,具体名单详见发售公告。
(三)注册登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
注册地址:北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人:金颖
电话:010-59378982
传真:010-59378907
联系人:程爽
(四)律师事务所
名称: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
(五)会计师事务所
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

南方中证50债券指数证券投资基金(LOF)

五、基金的类型

债券型证券投资基金

六、基金的投资目标

本基金采用被动式指数化投资,通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段,以实现对标的指数的有效跟踪。

七、基金的投资范围

本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具,包括中证50债券指数的成份券及其备选成份券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。其中,中证50债券指数成份券及其备选成份券的投资比例不低于基金资产净值的90%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

八、投资策略

本基金为被动式指数基金,采用最优复制法,主要以标的指数的成份券构成为基础,综合考虑跟踪效果、操作风险等因素构建组合,并根据本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性以及银行间和交易所债券交易特性及交易惯例等情况,进行取整和替代优化,以保证对标的指数的有效跟踪。

当预期成份券发生调整时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因市场流动性不足时,或因债券交易特性及交易惯例等因素影响跟踪标的指数效果时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人将对投资组合管理进行适当变通和调整,构建替代组合。由于本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性、债券交易特性及交易惯例等因素的影响,本基金组合中个券权重和券种与标的指数成份券和券种间将存在差异。

在正常市场情况下,力争本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年跟踪误差不超过2%。如因指数编制规则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。

(一)资产配置策略

为实现紧密跟踪标的指数的投资目标,本基金将以不低于基金资