

序号	基金名称	基金代码	基金简称
62	恒泰证券股份有限公司		
63	华龙证券有限责任公司		
64	华鑫证券有限责任公司		
65	日信证券有限责任公司		
66	五矿证券有限公司		
67	大通证券股份有限公司		
68	天相投资顾问有限公司		
69	其他基金代销机构情况详见基金管理人发布的公告。		

**南方基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行基金定投优惠活动的公告**

为答谢广大客户长期以来对南方基金管理有限公(以下简称“本公司”)的支持与厚爱,经本公司与中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)协商一致,本公司现决定从2013年1月1日至2013年12月31日期间参与中国工商银行推出的“2013倾心回馈”基金定投优惠活动。现将有关事项公告如下:

一、活动时间  
2013年1月1日至2013年12月31日期间的全部法定交易日。

二、适用范围

序号	基金代码	基金名称
1	160105	南方积极配置证券投资基金
2	160106	南方高增长证券投资基金(前端)
3	160119	南方中证500指数证券投资基金(L0F)前端
4	160123	南方中证400指数证券投资基金(L0F)A类
5	202001	南方稳健成长证券投资基金
6	202002	南方稳健成长贰号证券投资基金
7	202003	南方绩优成长证券投资基金(前端)
8	202005	南方成长精选证券投资基金(前端)
9	202007	南方多元主题精选证券投资基金(前端)
10	202009	南方多元主题精选贰号证券投资基金(前端)
11	202011	南方中证500指数证券投资基金(前端)
12	202015	南方中证400指数证券投资基金(前端)
13	202017	南方深证成指交易型开放式证券投资基金(前端)
14	202019	南方中证红利指数证券投资基金(前端)
15	202021	中证南方小盘市值精选证券投资基金(前端)
16	202023	南方优选价值证券投资基金(前端)
17	202011	南方中证500指数证券投资基金
18	202081	南方全球精选配置证券投资基金

三、活动内容  
活动期间,投资人通过中国工商银行基金定投业务进行的上述基金定投均享有申购费率八折优惠,原申购费率不低于0.6%的,基金定投申购费率按折优惠(即申购费率=原申购费率×0.8,但优惠后申购费率不低于0.6%,原申购费率低于0.6%的,则按照原费率执行)。

四、其他事项  
1.本优惠活动用于在中国工商银行办理基金定投业务的新老客户,对于在本次优惠活动享有中国工商银行基金定投“老资格”优惠政策的老客户,在活动期间,其基金定投申购率一律按八折优惠;本次活动结束后,老客户基金定投优惠按照原标准实施。

2.凡在活动期间内的基金定投申购不享受以上优惠;因客户违约导致在优惠活动期间内基金定投申购不成功的定投业务以上优惠不适用。

3.本优惠仅针对处于正常申购期的指定开放基金。前端收费模式的申购手续费费率,不包括基金后端模式申购费率。基金转换所涉及的申购费率及处于转换期的开放式基金认购费率。

4.上述基金申购费率请详见各基金相关法律文件及本公司发布的相关业务公告。

5.上述优惠活动是否展期,以及是否新增参与费率优惠活动的基金产品,本公司将与中国工商银行协商后另行公告相关事宜。

6.中国工商银行保留对本次优惠活动的最终解释权,优惠活动期间,业务办理的相关规则及流程以中国工商银行的安排和规定为准。

五、风险提示  
1.投资人应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等基金法律文件,了解基金的风险收益特征,并根据自身的投资目标、投资经验、风险承受能力等判断基金是否与投资人的风险承受能力相适应。

2.投资人在应当充分了解基金定期限和持有期限制等情况下,定期对拟购买和持有基金进行投资,并了解基金净值波动是一种正常市场现象,也是定期定额投资并不能规避基金投资所固有的风险,不能保证基金获得收益,也不等于规避了投资的风险。

3.中国工商银行保留对本次优惠活动的最终解释权,优惠活动期间,业务办理的相关规则及流程以中国工商银行的安排和规定为准。

**南方基金管理有限公司关于旗下基金获配中工国际020511非公开发行A股的公告**

南方基金管理有限公(以下简称“本公司”)所管理的南方积极配置证券投资基金、南方中证红利股票证券投资基金、南方全球优选价值证券投资基金及中工国际工股股份有限公司非公开发行A股的认购,《中工国际工股股份有限公司关于2012年12月26日发布“中工国际工股股份有限公司非公开发行股票发行情况报告暨上市公告书”》,公布了本次非公开发行股票事项。

**(上投D46) 久期盯住**

久期盯住”策略是指投资组合久期与标的指数久期一致为目标,即满足:  

$$Duration_{index} = \sum_{t=1}^{30} w_t \cdot Duration_{bond,t}$$

$$Duration_{portfolio} = \sum_{t=1}^N w_t \cdot Duration_{bond,t}$$

$$Duration_{index} = or \approx Duration_{portfolio}$$

从而使得收益曲线平行移动的情况下,债券投资组合的指数趋势一致。

2. 比例盯住  
“比例盯住”主要是考虑到不同类属债券和不同期限债券收益波动情况的不一致,表现为组合利率、信用利差和期限利差的波动,导致本类属债券权重、期限权重与标的指数的权重比例不相匹配,减少期限利差和信用利差的影响因素。

**九、风险控制措施**

本基金为主动管理型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金、高于货币市场基金、本基金为数量化基金,主要依靠数量复制策略进行投资,具有与传统的主动管理型证券投资基金不同的市场风险和流动性风险。

**十、基金业绩比较基准**  
本基金业绩比较基准:中证500价格指数×95%+银行活期存款利率×5%

中证500指数包括沪深两市证券交易所市场,深圳证券市场以及上海证券交易所市场,反映中国内地的中盘股市场整体运行情况,是国内目前应用较为广泛的类股债券组合,如果有更权威、更能为市场普遍接受的金融指数推出,或是市场出现更合适的类股债券组合,本基金将根据法律法规,变更可以在中国证监备案变更后变更业绩比较基准并予以公告。

**十一、基金投资限制**

基金管理人承诺遵守基金管理人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。

基金管理人(中国工商银行股份有限公司)根据本基金合同规定,于2012年11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,保证报告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、勤勉尽责的原则履行受托职责,为基金份额持有人谋取最大利益,但并不代表其能保证投资人的投资,投资者风险自担,投资者须在做出投资决策前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2012年9月30日,投资资产在报告期末未持有股票。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
2	固定收益	-	-
3	应收证券清算款	427,079,000.00	98.26
4	其他资产	427,079,000.00	98.26
5	资产支持证券	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	309,000.39	0.07
8	其他资产	7,233,937.56	1.66
9	合计	434,621,967.95	100.00

本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具,包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、次级债券、政府机构债、地方政府债、资产支持证券、可分离交易可转债中的公司债部分、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的非金融企业债务融资工具,但限于中国证监会规定范围。本基金不直接从二级市场买入股票、权证,也不参与一级市场的新股、可转债询价和申购新股。本基金对固定收益金融工具的投资比例合计不低于基金资产的80%,其中对除国债和央行票据外的信用类固定收益金融工具的投资比例合计不低于基金固定收益类金融工具的80%。在开放期,本基金持有的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%,在非开放期,本基金不受上述的限制。应开放期流动性需要,为保护持有人利益,本基金可开放申购前三个工作日开放以及开放申购后的三个月内,调整市场情况需要,为保护持有人利益,基金管理人可根据实际情况,对基金的投资比例适当进行上下限限制。

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

**八、投资策略**

本基金以中长期利率趋势分析为基础,结合经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析,在开放申购期间原则上组合久期初期开始开放期适当匹配的基础上,实施积极的债券投资组合管理,以获取较高的债券组合投资收益。

1. 信用债投资策略  
本基金将重点投资于信用类债券,以提高组合收益能力。信用债相对央票、国债等利率产品的信用利差是本基金获取超额收益的来源,本基金将在基金内部信用评级的基础上和内部信用评级框架下,积极投资信用债券,获取信用利差带来的超额收益。

债券的信用利差主要受两个方面的影响,一是市场信用利差曲线的走势;二是债券本身的变化。本基金通过对宏观经济走势、行业信用状况、信用债市场流动性风险、信用债供需情况等分析,判断市场信用利差曲线形态及行业走势,确定重点行业,各类型信用债的投资比例,信用债内部则根据各细分各信用债的相对信用等级,进行风险和信用利差选择,选择信用利差被低估、未来信用利差可能下降的信用债进行投资,相对信用等级差低,未来信用利差可能上升的信用债。

**② 收益互换策略**

收益互换策略是在代表债权、中短期利率收益非差异化,相同久期债券组合收益曲线产生变化时差异较大,通过同一类属下的收益曲线形态和期限结构变化进行分析,首先可确定债券组合的目标久期配置区域并确定采用何种策略,选择投资策略和债券品种,通过不同期间债券当期与历史利率的比较,可以及时识别、识别和动态变化的交易。

**③ 杠杆投资策略**

当前国内银行支持证券市场以信贷资产证券化产品为主,包括以银行贷款资产、住房抵押贷款等作为基础资产,为扩大收益来源,产证券化产品在“对基金资产净值及未来现金流分析,本基金将运用信贷资产证券化产品投资策略框架下,采用基本分析法和数量化模型相结合,对个券进行风险评估并择优后选择投资。本基金将严格控制投资支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。

基金管理人将采取有效管理措施,保障基金运作安排,防范流动性风险,满足开放期流动性需求。  
 ▲ 调整持仓结构,根据持仓久期和持仓资产状况,预估流动性需求,适当调整持仓结构,将部分流动性差的品种转换为流动性较好的品种。  
 ▲ 提前交易策略,减少赎回冲击。在开放前通过客户调研等方式大致了解流动性需求状况,相应调整整体仓位比例,为开放作好充分准备。

▲ 做好应付极端情况下巨额赎回的准备。在开放期根据市场情况,进行相应压力测试,制定开放期操作规范流程和应急预案,做好极端情况下巨额赎回的应对准备。其后每次开放申购赎回后下次开放申购赎回前,本基金将根据市场的发展,金融工具的丰富和交易方式的创新等,基金还将继续寻求其他投资机会,如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,本基金将在履行适当程序后,将其纳入投资范围并丰富组合投资策略。

**九、风险收益特征**

本基金为主动管理型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金。

**十、基金业绩比较基准**

本基金业绩比较基准:三年定期存款税后收益率。

在本基金合同生效首个工作日开放申购赎回前,上述“三年定期存款税后收益率”指基金合同生效当日中国人民银行公布执行的三年期金融机构人民币存款基准利率。其后每次开放申购赎回后下次开放申购赎回前,本基金将采用中国人民银行公布执行的三年期金融机构人民币存款基准利率。

**十一、投资组合报告**

基金管理人、基金托管人和基金销售机构在本报告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2012年11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,保证报告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2012年9月30日,投资资产在报告期末未持有股票。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
2	固定收益	1,749,258,750.80	97.68
3	其他资产	1,749,258,750.80	97.68
4	买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	1,027,088.27	0.06
6	其他资产	40,525,946.57	2.26
7	合计	1,790,811,785.64	100.00

2. 报告期末按行业分类的股权投资组合  
本基金本报告期末未持有股票。

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  
本基金本报告期末未持有股票。

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

根据中国证监会《证券投资基金信息披露管理办法》,关于基金投资非公开发行股票等受限证券有关问题的通知》有关规定,本公司现将南方积极配置证券投资基金、南方中证红利股票证券投资基金、南方全球优选价值证券投资基金非公开发行股票非公开发行情况公告如下:

基金名称	股票代码(股)	占总基金资产净值比例	公允价值占基金资产净值比例	限售期			
南方积极配置证券投资基金	1,237,400	25.02%	228.00	1.4859%	25,069,724.00	1.4889%	12个月
南方中证红利股票证券投资基金	1,484,900	30.02%	678.00	1.3201%	30,084,074.00	1.3227%	12个月
南方全球优选价值证券投资基金	6,186,898	125.09%	077.56	1.6582%	125,346,553.48	1.6614%	12个月

注:基金资产净值、账面价值为2012年12月26日数据。

投资者可登陆本公司网站 www.affund.com,或拨打客户服务热线400-889-8899咨询相关信息。特此公告。

**南方基金管理有限公司 2012年12月28日**

**关于南方中国中小盘股票指数基金2013年境外主要市场节假日申购赎回安排的公告**

根据《中国中小盘股票指数证券投资基金 L0F 基金合同》、《南方中国中小盘股票指数证券投资基金 L0F 招募说明书》的有关规定,南方中国中小盘股票指数证券投资基金 L0F 申购赎回的开放日为深圳证券交易所和上海证券交易所的主要市场时间交易日的次日。本基金目前投资的主要市场为“中国中小盘股票指数成份股挂牌交易的主要证券市场,即香港交易所。本基金投资所处的主要市场外,如出现非正常停市,可能影响本基金投资运作,基金管理人可以暂停本基金的申购赎回。

为了保障基金平稳运作,保护持有人利益,南方基金管理有限公司决定对处于上海和深圳证券交易所交易日的下列2013境外主要市场节假日暂停本基金的申购、赎回及定投业务,并自下列节假日的下一工作日恢复本基金的日常申购、赎回和定投业务,届时将另行公告。

3月	3月29日和4月1日(复活节假日)
4月	17日(香港清明节)
5月	1日(香港特别行政区成立纪念日)
7月	14日(香港劳动节)
10月	14日(香港重阳节)
12月	24日、25日、26日(圣诞节假期,31日(新年假期))

若境外主要市场节假日发生发生变化,本基金管理人将进行相应调整并公告。若境外主要市场状况发生变化,或未来根据法律法规和基金合同的约定调整上述安排时,本基金管理人将另行调整并公告。投资者可访问南方基金管理有限公司网站 www.affund.com 或拨打全国免费客户服务热线 400-889-8899 咨询相关情况。敬请投资者及早做好交易安排,避免因假期原因带来不便。

**南方基金管理有限公司 二〇一二年十二月二十八日**

**关于南方金砖四国指数基金2013年境外主要市场节假日申购赎回安排的公告**

根据《南方金砖四国指数证券投资基金基金合同》、《南方金砖四国指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,南方金砖四国指数证券投资基金 L0F 申购赎回的开放日为上海证券交易所和深圳证券交易所的主要市场交易日的次日。本基金目前投资的主要市场为“中国中小盘股票指数成份股挂牌交易的主要证券市场,即香港交易所。本基金投资所处的主要市场外,如出现非正常停市,可能影响本基金投资运作,基金管理人可以暂停本基金的申购赎回。

为了保障基金平稳运作,保护持有人利益,南方基金管理有限公司决定对处于上海和深圳证券交易所交易日的下列2013境外主要市场节假日暂停本基金的申购、赎回及定投业务,并自下列节假日的下一工作日恢复本基金的日常申购、赎回和定投业务,届时将另行公告。

1月	21日(美国劳工节)
2月	18日(美国情人节)
3月	3月29日和4月1日(复活节假日)
4月	17日(香港清明节)
5月	1日(美国五月初五日),17日(香港劳动节),27日(美国劳工节),31日(美国劳动节)
7月	1日(香港特别行政区成立纪念日),31日(美国独立日)
8月	26日(美国劳动节)
9月	2日(美国劳动节)
10月	14日(香港重阳节)
11月	28日和29日(美国感恩节)
12月	24日、25日、26日(圣诞节假期),31日(新年假期)

若境外主要市场节假日发生发生变化,本基金管理人将进行相应调整并公告。若境外主要市场状况发生变化,或未来根据法律法规和基金合同的约定调整上述安排时,本基金管理人将另行调整并公告。投资者可访问南方基金管理有限公司网站 www.affund.com 或拨打全国免费客户服务热线 400-889-8899 咨询相关情况。敬请投资者及早做好交易安排,避免因假期原因带来不便。

**南方基金管理有限公司 二〇一二年十二月二十八日**

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	49,730,000.00	3.02
4	企业债券	49,730,000.00	3.02
5	企业短期融资券	879,539,750.00	29.12
6	中期票据	341,930,000.00	20.76
7	可转换债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,749,258,750.80	106.21

**8.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	04116007	11鲁HCP001	900,000	91,083,000.00	5.53
2	128236	12金阳MTN1	800,000	80,848,000.00	4.91
3	041154017	11光大CP004	700,000	71,015,000.00	4.31
4	041252010	12广汇CP01	700,000	70,360,000.00	4.27
5	122072	12国债(7)	600,000	61,974,000.00	3.76

6. 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序的前五名权证投资明细  
本基金本报告期末未持有权证。

**八、投资组合报告摘要**

1. 本基金报告期内前十名证券的发行主体本期没有出现在监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.2 本基金本报告期末未持有股票。

8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	70,942.80
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	40,221,899.13
5	应收申购款	201,386.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	31,723.94
8	其他	-
9	合计	40,525,946.57

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 报告期末前十名投资中存在流通受限情况的说明  
本基金本报告期末未持有受限资产。

**十二、基金的投资**

本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,也不保证保本。基金的投资业绩并不代表其未来表现。投资者有风险,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。

南方金利定期开放债券A						
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)	
2012.11-2012.9	1.60%	0.06%	1.66%	0.01%	-0.06%	0.05%
自基金成立起至今	1.60%	0.06%	1.66%	0.01%	-0.06%	0.05%

南方金利定期开放债券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)	
2012.11-2012.9	1.50%	0.05%	1.66%	0.01%	-0.16%	0.04%
自基金成立起至今	1.50%	0.05%	1.66%	0.01%	-0.16%	0.04%

**十三、基金费用概览**

1. 本基金费用运作有关的费用

(一) 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、律师费和诉讼费;  
 ⑤ 基金份额持有人大会费用;  
 ⑥ 基金的销售服务费;  
 ⑦ 基金的投资顾问费;  
 ⑧ C类基金份额的基金财产中计提的销售服务费;  
 ⑨ 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。

本基金终止清算时发生费用,按实际支出金额从基金财产中扣除。

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0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下:  

$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$
 H为每日应计提的管理费  
 E为前一日的基金资产净值  
 基金管理费按日计算,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,基金托管人复核无误后于次月第二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、公休等,支付日期顺延。

② 基金托管人的托管费  
 本基金托管费按前一日基金资产净值的0.18%的年费率计提。托管费的计算方法如下:  

$$H = E \times 0.18\% \div \text{当年天数}$$
 H为每日应计提的托管费  
 E为前一日的基金资产净值  
 基金托管费按日计算,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,基金托管人复核无误后于次月第二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、公休等,支付日期顺延。

③ 基金销售服务费  
 本基金A类基金份额的申购和赎回费用,由基金管理人承担,主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。  
 本基金B类基金份额的申购和赎回费用,由基金管理人承担,主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。  
 本基金C类基金份额的申购和赎回费用,由基金管理人承担,主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

④ 基金份额持有人大会费用  
 基金份额持有人大会费用,按照法律法规及基金合同的约定执行。

⑤ 基金的销售服务费  
 本基金A类基金份额的申购和赎回费用,由基金管理人承担,主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

⑥ 基金的投资顾问费  
 基金管理人根据基金合同及相关法律法规的规定,聘请投资顾问,投资顾问在做出投资决策前应向基金管理人提供投资建议,基金管理人根据基金合同及相关法律法规的规定,聘请投资顾问,投资顾问在做出投资决策前应向基金管理人提供投资建议。

⑦ 基金的其他费用  
 基金的其他费用,按照法律法规及基金合同的约定执行。

⑧ 基金的销售服务费  
 本基金A类基金份额的申购和赎回费用,由基金管理人承担,主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

⑨ 基金的销售服务费  
 本基金A类基金份额的申购和赎回费用,由基金管理人承担,主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

⑩ 基金的销售服务费  
 本基金A类基金份额的申购和赎回费用,由基金管理人承担,主要用于基金的市场推广