

南方恒元保本混合型证券投资基金

招募说明书（更新）摘要

2010年第1号

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5月12日

重要提示

本基金经中国证监会2008年9月5日证监许可[2008]1106号文核准募集，于2008年11月12日成立。

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。

本基金作为保本混合型基金，因特殊的组合保险策略在资产配置中将会有部分基金资产投资于股票市场，基金份额净值会随股票市场的变化而上下波动。认购并持有到期，投资者购买的基金份额存在着仅能收回本金的可能性。申购并持有到期，投资者购买的基金份额存在着仅能部分收回本金的可能性。未持有到期，投资者赎回时不能获得保本保证，将承担市场波动的风险。因此，投资者应根据自身的风险承受能力和预期收益，权衡选择适合自己的产品。本基金主要适合注重本金安全的低风险投资者和部分参与股票市场的稳健投资者。

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。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，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。

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财产，不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益，但为投资者提供认购保本金额/申购保本金额的保证，并由担保人提供不可撤销的连带责任担保。

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5月12日，有关财务数据和净值表现截止日为2010年3月31日（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

注册地址：广东省深圳市福田区中心区福华一路6号免税商务大厦塔楼31、32、33层整层

办公地址：广东省深圳市福田区中心区福华一路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，由南方证券有限公司、厦门国际信托有限公司、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，现任华泰证券股份有限公司副总裁、华泰联合证券董事长。

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，南方基金管理有限公司董事。

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；江西财经大学

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，兼任高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，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。

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相关研究。历任纽约证券交易所国际董事及中国首席代表，创立纽约证券交易所大中华区办公室（香港），银华基金独立董事。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。

丛培国先生，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、华泰证券股份有限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公司电子商务部总监兼风险管理部总监。

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，中共党员，工商管理硕士（MBA），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（MBA）。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（MBA）。历任华泰证券股份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：2008年11月至今，蒋峰。

蒋峰先生，经济学博士，具有基金从业资格。曾任职于鹏华基金公司和宝盈基金公司，2003年11月至2006年11月，担任宝盈鸿阳证券投资基金经理。2007年加入南方基金，2007年6月至今，任南方避险基金经理；2008年1月至2009年2月，任南方宝元基金基金经理；2008年11月至今，任南方恒元基金经理。

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3月末，中国工商银行资产托管部共有员工125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3月，托管证券投资基金152只，其中封闭式9只，开放式143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 22 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

注册地址：广东省深圳市福田区中心区福华一路6号免税商务大厦塔楼31、32、33层整层

办公地址：广东省深圳市福田区中心区福华一路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、（0755）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：曹榕

联系电话：021-58781234

客服电话：95599

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：王琳

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：北京市西城区宣武门西大街 131 号

法定代表人：刘安东

联系人：陈春林

客服电话：95580

公司网站：www.psbcc.com

（8）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：徐伟

联系电话：021-61618888

客服电话：95528

公司网站：www.spdb.com.cn

（9）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>

（10）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

（11）兴业银行股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 154 号

办公地址：福州市湖东路 154 号

法定代表人：高建平

联系人：陈晓瑾

联系电话：021-62677777

客服电话：95561

公司网站：www.cib.com.cn

（12）深圳发展银行股份有限公司

法定代表人：弗兰克纽曼（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：周勤

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：陈辛

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：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：董文标

联系人：李群

联系电话：010-58560666

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

电话：010-66226044、66223251

传真：010-66226045、66226047

联系人：王光伟

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）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

（18）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：钱庚旺

客服电话：96528，上海地区 962528

公司网站：www.nbc.com.cn

（19）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

（20）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：吴军阳

联系电话：0571-87659084

客服电话：95105665

公司网站：www.czbank.com

（21）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）400-66-96588，0532-85709799

公司网站：www.qdccb.com

（22）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

（23）北京农村商业银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区阜成门内大街 410 号

办公地址：北京市西城区阜成门内大街 410 号

法定代表人：乔瑞

联系人：刘雨喻

电话：010-66506138

客服电话：96198

公司网站：www.bjrcb.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） 上海农村商业银行股份有限公司

注册地址： 上海市浦东新区浦东大道 981 号

办公地址： 上海市银城中路 8 号中融碧玉蓝天大厦 15 层

法定代表人： 胡平西

联系人： 周睿

联系电话： (021) 38576985

客服电话： (021) 962999

公司网站： www.srcb.com

代销券商和其他代销机构：

（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 99 号标力大厦

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、4008888555

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：北京市朝阳区门内大街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 层公司

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：天津市南开区滨水西道 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.njq.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：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 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：王少华

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：4008-888-999 或 027-85808318

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） 东吴证券有限责任公司

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：4008866338

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：覃清芳

联系电话：(0771) 5539262

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：杨小阳

联系人：刘权

联系电话：0755-82026521

客服电话：400-600-8008

公司网站：www.cjis.cn

（36） 江南证券有限责任公司

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.scstock.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22-25层

办公地址：重庆市渝中区临江支路2号合景国际大厦22-25层

法定代表人：范剑

联系人：徐雅筠

联系电话：023-63786060

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）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

（42）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

（43）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

（44）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

（45）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

（46）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

（47）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.msza.com

（48）东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山南路318号2号楼22层-29层

办公地址：上海市中山南路318号2号楼22层-29层

法定代表人：潘鑫军

联系人：吴宇

联系电话：021-63325888

客服电话：95503

公司网站：www.dfzq.com.cn

（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号宏源证券

联系人：李巍

联系电话：010-88085338

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：西安市东大街 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：刘汝军

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） 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

（58） 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

(59) 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

联系电话：0755-83706665

客服电话：0755-83710885

公司网站：www.ytzq.net

(60) 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

(61) 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.csc.com.cn

(62) 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

（63） 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

（64） 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

（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

联系电话：028-86690126

客服电话：4006-600109

公司网站：www.gjzq.com.cn

（66） 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

（67） 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

客服电话：400-800-8899

公司网站：www.cindasc.com

（68） 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

（69） 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

（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：莫晓丽

联系人电话：010-66045529

客服电话：010-66045678

公司网站：www.txsec.com，www.txjijin.com

（71）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

注册地址：广东省深圳市福田区中心区福华一路6号免税商务大厦塔楼31、32、33层整层

办公地址：广东省深圳市福田区中心区福华一路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）82763854

联系人：古和鹏

（三）担保人

中国投资担保有限公司

注册地址：北京市海淀区西三环北路100号金玉大厦写字楼9层

办公地址：北京市海淀区西三环北路100号金玉大厦写字楼9层

法定代表人：刘新来

电话：010-88822720

传真：010-68437040、010-88822729

联系人：李明燚

（四）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：薛竞、单峰

四、基金的名称

南方恒元保本混合型证券投资基金

五、基金的类别

保本混合型证券投资基金

六、基金的投资目标

本基金在严格控制风险的前提下，为投资者提供认购保本金额/申购保本金额的保证，并在此基础上力争基金资产的稳定增值。

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，包括国内依法发行上市的各类债券、股票以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金根据中国宏观经济情况和证券市场的阶段性变化，按照投资组合保险机制对债券和股票的投资比例进行动态调整。其中，现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。

本基金可投资于股指期货等金融衍生工具，有关投资比例限制等遵循届时有效的规定执行。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、基金的投资策略

本基金采用恒定比例投资组合保险方法（Constant-Proportion Portfolio Insurance, CPPI）来实现保本和增值的目标。恒定比例投资组合保险不仅能从投资组合资产配置的水平上消除投资到期时基金净值低于本金的可能性，而且能在一定程度上使保本基金分享股市整

体性上涨的好处。

CPPI 是国际通行的一种投资组合保险策略，它主要是通过数量分析，根据市场的波动来调整、修正风险资产的可放大倍数（风险乘数），以确保投资组合在一段时间以后的价值不低于事先设定的某一目标价值，从而达到对投资组合保值增值的目的。无风险资产一般是指固定收益类资产，风险资产一般是指股票等权益类资产。在基金资产可放大倍数的管理上，基金管理人的金融工程小组在定量分析的基础上，根据 CPPI 数理机制、历史模拟和目前市场状况定期出具保本基金资产配置建议报告，给出放大倍数的合理上限的建议，供基金管理人投资决策委员会和基金经理作为基金资产配置的参考。

如在本基金存续期内市场出现如股指期货等新的金融衍生产品且在开放式基金许可的投资范围之内，本基金管理人保留调整保本投资策略的权利。

本基金的投资策略分资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、权证投资策略和股指期货投资策略等。

1、资产配置策略

本基金资产配置策略分为两个层次：一层为对风险资产和无风险资产的配置，该层次以恒定比例组合保险策略为依据，即风险资产部分所能承受的损失最大不能超过无风险资产部分所产生的收益；另一层为对风险资产部分的配置策略。基金管理人将根据情况对这两个层次的策略进行调整。

2、股票投资策略

本基金注重对股市趋势的研究，在股票投资限额之下，发挥时机选择能力，控制股票市场下跌风险，分享股票市场成长收益。

本基金依据稳健投资、风险第一的原则，以低风险性、在保本期限内具备中期上涨潜力为主要原则，构建股票组合，同时兼顾股票的流动性。首先按照风险性由低至高、中期上涨潜力由高至低和流动性由高到低对股票池内的股票进行排名，累加三项排名得到综合排名，取综合排名靠前的股票构建股票组合，进行组合投资。

本基金通过选择风险低的股票，保证组合的稳定性；通过选择具中期上涨潜力的股票，保证组合的收益性；通过分散投资、组合投资和流动性管理，降低个股集中性风险和流动性风险。

3、债券投资策略

本基金的债券投资策略主要包括以下几方面：

- （1）持有相当数量剩余期限与避险周期相近的国债、金融债，其中一部分严格遵循持

有到期原则，首要考虑收益性，另一部分兼顾收益性和流动性。这部分投资可以保证债券组合收益的稳定性，尽可能地控制利率、收益率曲线等各种风险。

（2）综合考虑收益性、流动性和风险性，进行积极投资。这部分投资包括中长期的国债、金融债，信用等级为 AAA 以上的企业债，以及中长期逆回购等等。积极性策略主要包括根据利率预测调整组合久期、选择低估值债券进行投资、把握市场上的无风险套利机会，利用杠杆原理以及各种衍生工具，增加盈利性、控制风险等等，以争取获得适当的超额收益，提高整体组合收益率。

（3）利用银行间市场和交易所市场现券存量进行国债回购所得的资金积极参与新股申购和配售，以获得股票一级市场可能的投资回报。

（4）利用未来可能推出的利率远期、利率期货、利率期权等金融衍生工具，有效地规避利率风险。

4、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，结合权证定价模型寻求其合理估值水平，并积极利用正股和权证之间的不同组合来套取无风险收益。

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。

5、股指期货投资策略

如在本基金存续期内市场出现如股指期货等新的金融衍生产品且在开放式基金许可的投资范围之内，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准：3 年期银行定期存款税后收益率。

十、基金的风险收益特征

本基金为保本基金，属于证券投资基金中的低风险品种。

十一、基金的投资组合报告（如无特别说明以下单位均为元）

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 月 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 2010 年 3 月 31 日（未经审计）。

（一）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	2,117,725,050.81	68.46
	其中：股票	2,117,725,050.81	68.46
2	固定收益投资	903,928,962.60	29.22
	其中：债券	903,928,962.60	29.22
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	34,526,000.00	1.12
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	13,567,327.67	0.44
6	其他资产	23,636,205.10	0.76
7	合计	3,093,383,546.18	100.00

（二）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	-	-
B	采掘业	136,409,361.20	4.54
C	制造业	1,236,425,895.98	41.13
C0	食品、饮料	282,213,619.75	9.39
C1	纺织、服装、皮毛	83,542,638.92	2.78
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	29,582,556.57	0.98
C5	电子	17,563,286.70	0.58
C6	金属、非金属	276,556,368.57	9.20
C7	机械、设备、仪表	514,860,277.56	17.13
C8	医药、生物制品	22,136,803.36	0.74

C99	其他制造业	9,970,344.55	0.33
D	电力、煤气及水的生产和供应业	1,520,088.42	0.05
E	建筑业	14,380,000.00	0.48
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	228,939,090.80	7.62
H	批发和零售贸易	63,918,759.86	2.13
I	金融、保险业	154,100,705.92	5.13
J	房地产业	89,484,872.20	2.98
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	192,546,276.43	6.41
	合计	2,117,725,050.81	70.45

（三）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	000629	攀钢钢钒	20,000,000	166,800,000.00	5.55
2	600406	国电南瑞	4,376,112	150,406,969.44	5.00
3	600031	三一重工	3,256,776	110,437,274.16	3.67
4	600519	贵州茅台	691,260	109,744,437.60	3.65
5	000425	徐工机械	2,914,321	108,908,175.77	3.62
6	600805	悦达投资	7,327,030	102,358,609.10	3.41
7	600123	兰花科创	2,102,695	84,444,231.20	2.81
8	600132	重庆啤酒	2,419,908	70,419,322.80	2.34
9	002048	宁波华翔	4,009,179	57,732,177.60	1.92
10	601166	兴业银行	1,442,342	53,251,266.64	1.77

（四）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	196,700,000.00	6.54
3	金融债券	262,276,000.00	8.73
	其中：政策性金融债	262,276,000.00	8.73
4	企业债券	444,952,962.60	14.80
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	903,928,962.60	30.07

（五）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	0901036	09 央票 36	2,000,000	196,700,000.00	6.54

2	080221	08 国开 21	1,600,000	159,616,000.00	5.31
3	126012	08 上港债	833,830	82,090,563.50	2.73
4	126014	08 国电债	900,480	78,170,668.80	2.60
5	126001	06 马钢债	628,350	61,326,960.00	2.04

（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

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

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	038011	攀钢 AGP1	20,000,000	34,526,000.00	1.15

（八）投资组合报告附注

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。

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。

3、其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,762,136.29
2	应收证券清算款	11,989,047.02
3	应收股利	-
4	应收利息	7,969,131.13
5	应收申购款	1,915,890.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,636,205.10

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。

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)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600132	重庆啤酒	70,419,322.80	2.34	重大事项停牌

6、投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

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)
2008.11.12~2008.12.31	1.80%	0.13%	0.52%	0.01%	1.28%	0.12%
2009.1.1~2009.12.31	13.47%	0.84%	3.31%	0.01%	10.16%	0.83%
2010.1.1~2010.3.31	-0.09%	0.90%	0.79%	0.01%	-0.88%	0.89%
自基金成立至今	15.41%	0.81%	3.85%	0.01%	11.56%	0.80%

十三、基金费用概览

(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、基金的银行汇划费用；
- 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。

(二) 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1.3%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.3\% \div \text{当年天数}$$

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。

保本期内，担保费用由基金管理人从基金管理费收入中列支。

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2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 2\% \div \text{当年天数}$$

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 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。

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“投资决策委员会成员”进行了更新。
- 2、在“基金托管人”部分，对基金托管人的“主要人员情况”、“基金托管业务经营情况”及“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”部份，对本基金的基金份额发售机构及其他服务机构进行了更新。
- 4、在“基金的投资”部份，补充了本基金最近一期投资组合报告和基金的业绩。
- 5、在“基金份额持有人服务”部份，对主要服务内容进行了更新。
- 6、对“其他应披露事项”进行了更新。
- 7、对部份其他表述进行了更新。

南方基金管理有限公司
二〇一〇年六月二十五日