

Disclosure

南方避险增值基金 2008年年度报告摘要

2008年12月31日 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 送出日期:2009年03月28日

1.1 重要提示 基金管理人、基金托管人、基金销售机构... 基金管理人、基金托管人、基金销售机构...

了债券组合的久期,充分分享了债券市场这一阶段的上涨... 4.6 管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明

下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立... 7.4.3.1 股票交易 7.4.3.1.1 股票交易

2.1 基金基本情况

Table with 2 columns: Item (基金名称, 基金管理人, etc.) and Value (南方避险, 南方基金管理有限公司, etc.)

2.2 基金产品说明

Table with 2 columns: Item (投资目标, 投资策略, etc.) and Value (本基金以... 本基金主要投资于...)

2.3 基金管理人、基金托管人

Table with 2 columns: Item (名称, 姓名, 联系电话, etc.) and Value (南方基金管理有限公司, 魏文斌, etc.)

2.4 信息披露方式

基金年度报告正文的网址: http://www.nffund.com 基金年度报告备置地点: 基金管理人、基金托管人办公场所

2.5 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准: 中证全指指数收益率×80%+中国国债收益率×20%

2.6 基金业绩评价

本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... 基金管理人、基金托管人、基金销售机构...

3.1 主要会计数据和财务指标

Table with 2 columns: Item (本期期末余额, 上年同期期末余额, etc.) and Value (651,511,762.18, 3,855,692,831.72, etc.)

3.2 基金净值表现

Table with 2 columns: Item (过去三个月, 过去六个月, etc.) and Value (2.89%, 1.96%, etc.)

3.3 基金业绩比较基准

Table with 2 columns: Item (债券类资产, 股票类资产, etc.) and Value (671,668,721.60, 678,574,500.00, etc.)

3.4 基金费用

Table with 2 columns: Item (基金管理费, 基金托管费, etc.) and Value (1,144,576.02, 270,000.00, etc.)

3.5 基金资产净值及基金份额持有人

Table with 2 columns: Item (资产总计, 负债和所有者权益总计) and Value (4,804,021,060.30, 1,998,837,795.44, etc.)

3.6 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (期末持有人户数, 期末持有基金份额) and Value (52,146, 1,998,837,795.44, etc.)

3.7 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

3.8 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

3.9 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

3.10 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

3.11 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

3.12 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

3.13 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

3.14 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

3.15 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

3.16 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

3.17 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

3.18 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

3.19 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

3.20 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

3.21 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

3.22 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

3.23 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

3.24 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

3.25 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

3.26 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

3.27 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

3.28 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

3.29 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

3.30 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

3.31 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

3.32 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

3.33 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

3.34 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

3.35 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

3.36 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

3.37 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

3.38 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

3.39 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

3.40 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

3.41 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

3.42 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

3.43 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

3.44 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

3.45 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

3.46 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

3.47 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

3.48 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

3.49 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

3.50 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

3.51 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

3.52 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

3.53 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

3.54 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

3.55 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

3.56 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

3.57 基金持有人户数及持有基金份额

Table with 2 columns: Item (持有基金份额, 持有基金份额比例) and Value (1,998,837,795.44, 100%, etc.)

8.4.2 累计卖出金额超过期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期初基金资产净值比例(%)

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 2 columns: 买入股票成本(成交)总额, 卖出股票收入(成交)总额

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 5 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

8.6 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

Table with 5 columns: 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(%)

8.7 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

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

8.8 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

Table with 5 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 本基金投资的前十名证券中不存在发行主体信用评级为BBB级及以下,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.9.2 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。

8.9.3 其他投资品种

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 5 columns: 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(%)

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

Table with 5 columns: 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(%)

8.9.6 基金资产净值及基金份额持有人结构

Table with 2 columns: 持有户数, 持有基金份额, 持有基金份额比例

8.9.7 期末基金资产净值及基金份额持有人结构

Table with 2 columns: 持有户数, 持有基金份额, 持有基金份额比例

8.9.8 基金资产净值及基金份额持有人结构

Table with 2 columns: 持有户数, 持有基金份额, 持有基金份额比例

8.9.9 基金资产净值及基金份额持有人结构

Table with 2 columns: 持有户数, 持有基金份额, 持有基金份额比例

8.9.10 基金资产净值及基金份额持有人结构

Table with 2 columns: 持有户数, 持有基金份额, 持有基金份额比例

8.9.11 基金资产净值及基金份额持有人结构

Table with 2 columns: 持有户数, 持有基金份额, 持有基金份额比例

8.9.12 基金资产净值及基金份额持有人结构

Table with 2 columns: 持有户数, 持有基金份额, 持有基金份额比例

8.9.13 基金资产净值及基金份额持有人结构

Table with 2 columns: 持有户数, 持有基金份额, 持有基金份额比例

8.9.14 基金资产净值及基金份额持有人结构

Table with 2 columns: 持有户数, 持有基金份额, 持有基金份额比例

8.9.15 基金资产净值及基金份额持有人结构

Table with 2 columns: 持有户数, 持有基金份额, 持有基金份额比例

8.9.16 基金资产净值及基金份额持有人结构

Table with 2 columns: 持有户数, 持有基金份额, 持有基金份额比例

8.9.17 基金资产净值及基金份额持有人结构

Table with 2 columns: 持有户数, 持有基金份额, 持有基金份额比例

8.9.18 基金资产净值及基金份额持有人结构

Table with 2 columns: 持有户数, 持有基金份额, 持有基金份额比例

8.9.19 基金资产净值及基金份额持有人结构

Table with 2 columns: 持有户数, 持有基金份额, 持有基金份额比例