南方多利增强债券型证券投资基金

招募说明书(更新)摘要

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:2009 年 2 月 28 日

重要提示

南方多利增强债券型证券投资基金由南方多利中短期债券投资基金转型而成。依据中国证监会 2007 年 8 月 24 日证监基金字[2007]242 号文核准的南方多利中短期债券投资基金基金份额持有人大会决议,南方多利中短期债券投资基金调整投资目标、范围和策略、修订基金合同,并更名为"南方多利增强债券型证券投资基金"。自 2007 年 8 月 28 日起,由《南方多利中短期债券投资基金基金合同》修订而成的《南方多利增强债券型证券投资基金基金合同》生效。

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。

在投资本基金前,投资者应全面了解本基金的产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对申购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策,获得基金投资收益,亦承担基金投资中出现的各类风险,包括:因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险,本基金的特定风险等等。投资有风险,投资者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资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

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 2009 年 2 月 28 日,有关财务数据和净值表现截止日 2008 年 12 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: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
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、厦门国际信托投资公司、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,华泰证券股份有限公司副总裁、现任联合证券董事长、党委书记。

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,兼任商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,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。

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投资研究。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。

郭文氢女士,独立董事,硕士。曾任北京市大成律师事务所律师,获中国证监会和司法部授予的证券执业律师资格;国际商会(ICC)中国律师团成员;参加司法部与英国法律事务大臣办公室中国优秀青年律师赴英培训项目;创办北京市同维律师事务所,现任北京市康达律师事务所合伙人律师。

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市场服务部总监。

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,男,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。

王宏远先生,副总经理,中共党员,公共管理学硕士。曾任职于美林证券股票研究部、Lazard 共同基金管理公司,任职南方基金管理有限公司期间,历任研究员、投资部副总监、总监、总经理助理,期间先后兼任天元基金、开元基金、南方稳健基金、稳健贰号基金的基金经理;现任南方基金管理有限公司副总经理。

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、南方避险增值基金经理、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,男,中共党员,工商管理硕士(MBA),历任华泰证券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为:2006 年 3 月至 2008 年 3 月,刘情剑、高峰;2008 年 3 月至今,高峰先生。

高峰先生,1972 年出生,理学博士,1998 年参加工作,曾任职于上海大学理学院、美国 SAS 软件研究所上海公司。2002 年加入南方基金,2008 年 1 月至今,兼任南方宝元基金经理。

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,副总经理王宏远先生,固定收益部总监李海鹏先生,投资部总监苏彦祝先生,邱国鹭先生。

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
传真:(010)66105798
联系人:蒋松云

(二)主要人员情况

截至 2008 年 12 月末,中国工商银行资产托管部共有员工 117 人,平均年龄 30 岁,95%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有研究生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 2008 年 12 月,托管证券投资基金 107 只,其中封闭式 8 只,开放式 99 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、产业基金、履约类产品、QFII 资产、QDII 资产等产品在内的托管业务体系。2008 年初,中国工商银行先后被《全球托管人》、《环球金融》、《财资》、《证券时报》和《上海证券报》等国际国内媒体评选为 2007 年度"中国最佳托管银行",自 2004 年以来,工商银行托管服务获得的该类奖项累计已经达到 12 项。

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: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)82763905
传真:(0755)82763900
联系人:刘皓

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
电话:010-66107900
传真:010-66107914
联系人:田耕

(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(长安兴融中心)
法定代表人:郭树清
联系人:王琳
电话:010-66275654
客户服务电话:95533
网址:www.ccb.com

(3)中国农业银行
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
客户服务电话:95599
公司网址:www.95599.cn

(4)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
客户服务电话:95555
传真:0755-83195049
联系人:王楠
网址:www.cmbchina.com

(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
电话:(021)58781234
传真:(021)58408842
联系人:曹榕
网址:www.bankcomm.com

(6)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:陶礼明
客户服务电话:95580
联系人:陈春林
传真:010-66415194
网址:www.psbc.com

(7)广东发展银行股份有限公司
注册地址:广州农林下路 83 号
法定代表人:李若虹
电话:020-38322542、38321207
传真:020-87311780
联系人:江璐、罗环宇

(8)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)
网址:www.cebbank.com

(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富华大厦 C 座
法定代表人:孔丹
电话:010-65541405
传真:010-65541281
联系人:秦莉
客服电话:95558
网址:http://bank.ecitic.com

(10)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
电话:021-61618888
传真:021-63602431
联系人:徐伟、汤嘉惠
客户服务热线:95528
公司网站:www.spdb.com.cn

(11)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
客户服务电话:95568
传真:010-83914283
联系电话:010-58560666
联系人:李群
公司网站:www.cmbc.com.cn

(12)深圳发展银行股份有限公司
法定代表人:法兰克纽曼(Frank N.Newman)
地址:深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦
邮政编码:518001
联系人:周勤
联系电话:0755-82088888
传真电话:0755-82080714
客户服务电话:95501
公司网址:www.sdb.com.cn

(13)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
网址:www.bankofbeijing.com.cn

(14)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 号商业银行大厦
法定代表人:黄立哲
电话:25879127
传真:25878304
联系人:霍兆龙
网站:www.18ebank.com

(15)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
电话:0769-22119061
传真:0769-22117730
联系人:胡昱
客户服务热线:96228
公司网站:www.dongguanbank.cn

(16)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
客户服务统一咨询电话:96528,上海地区 962528
传真:021-63586215
网址:www.nbcb.com.cn

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
电话:025-84457777-950、248
联系人:李金龙
客户咨询电话:025-84457777-950
网址:www.htsc.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:肖时庆
联系人:李洋
电话:010-66568047
客户服务电话:4008-888-888
网址:www.chinastock.com.cn

(3)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
传真:021-62583439
客户服务热线:400-8888-666
联系人:芮敏祺
网址:www.gtja.com

(4)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
注册资金:14.9 亿元人民币
客服电话:400-8888-123
业务联系电话:021-38565785
业务联系人:谢高得
兴业证券公司网站:www.xyzq.com.cn

(5)联合证券有限责任公司
办公地址:深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 10、24、25 层
法定代表人:马昭明
电话:400-8888-555
传真:0755-82492962
联系人:盛宗凌
网址:www.lhzq.com

(6)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
电话:021-23219000
传真:021-23219100
联系人:金芸、李笑鸣
客服电话:400-8888-001、021-95553
公司网址:www.htsec.com

(7)广发证券股份有限公司
法定代表人:王志伟
成立日期:1993 年 5 月 21 日
注册地址:广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼
办公地址:广东广州天河北路大都会广场 18、19、36、38、41 和 42 楼
联系人:肖中梅
统一客户服务热线:95575 或致电各地营业网点
开放式基金业务传真:(020)87555305
公司网站:广发证券网 www.gf.com.cn

(8)湘财证券有限责任公司
地址:长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼
法定代表人:陈学荣
电话:021-68634518
传真:021-68865938
联系人:钟康莺
网址:www.xcsc.com

(9)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
电话:0755-83516289
客户服务电话:0755-82288968、400-6666-888
网址:www.cc168.com.cn

(10)中信建投证券有限责任公司
法定代表人:张佑君
注册地址:北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼
联系人:魏明
开放式基金咨询电话:400-8888-108
公司网站:www.csc108.com

(11)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
法人代表人:何如
联系电话:0755-82130833
基金业务联系人:齐晓燕
联系电话:0755-82130833
传真:0755-82133302
全国统一客户服务电话:95536
公司网址:www.guosen.com.cn

(12)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
联系人:曹晔
电话:021-54033888
客户服务电话:021-962505
网址:www.sw2000.com.cn

(13)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
电话:0769-22119426
公司网址:www.dgzq.com.cn

(14)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
电话:0755-82943666
传真:0755-82943636
联系人:黄健
客户服务热线:95565、400-8888-111

(15)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
联系电话:010-84864818-63266
联系人:陈忠

(16)中信金通证券有限责任公司
注册地址:杭州市中河南路 11 号万凯庭院商务楼 A 座
办公地址:杭州市中河南路 11 号万凯庭院商务楼 A 座
法定代表人:王勤
开放式基金咨询电话:0571-96598
联系人:0571-85783715
联系电话:0571-85783715
公司网址:www.96598.com.cn

(17)渤海证券股份有限公司
注册地址:天津市经济技术开发区第一大街 29 号
办公地址:天津市河西区宾水道 3 号
法定代表人:张志军
联系人:王兆权
电话:022-28451861
客户服务电话:022-28455588
网址:www.bhzq.com

(18)国联证券股份有限公司
注册地址:江苏省无锡市县前东街 8 号
法定代表人:范炎
联系人:袁丽萍
电话:0510-2831662
客服电话:0510-82588168
公司网址:www.glsc.com.cn

(19)广州证券有限责任公司
办公地址:广州市先烈中路 69 号东山广场主楼五楼
法定代表人:吴志明
电话:020-87322668
传真:020-87325036
联系人:樊刚正
客户服务热线:020-961303
公司网址:www.gzs.com.cn

(20)光大证券股份有限公司
注册地址:上海市静安区新闸路 1508 号
办公地址:上海市静安区新闸路 1508 号
法定代表人:徐浩明
联系人:刘晨
电话:021-68816000
传真:021-68815009
客户服务热线:10108998
公司网址:www.ebscn.com

(21)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
电话:025-83364032
联系人:胥春阳
公司网址:www.njzq.com.cn

(22)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
电话:0531-81283728
客户服务电话:95538
网址:www.qlzq.com.cn

(23)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:史洁民
联系电话:0532-85022026
传真:0532-85022026
联系人:丁韶燕
公司网址:www.zxwt.com.cn
客户咨询电话:0532-96577

(24)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:李树
联系人:高新宇
电话:85096709
客户服务电话:0431-96688-0、0431-85096733
网址:www.nesc.cn

(25)信泰证券有限责任公司
办公地址:南京市长江路 88 号
法定代表人:钱凯法
电话:025-84784765
传真:025-84784830
联系人:舒萌菲
公司网址:www.thope.com

(26)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
联系电话:021-68604866
联系人:张静
公司网址:www.bocichina.com

(27)财通证券经纪有限责任公司
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
电话:0571-87925129
客户服务电话:0571-96336
网址:www.ctsec.com

(28)山西证券股份有限公司
办公(注册)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
成立时间:1988 年 7 月
客服电话:400-666-1618
联系人:张治国
联系电话:0351-8686703
传真:0351-8686619
网址:www.i618.com.cn

(29)江南证券有限责任公司
法定代表人:姚江涛
地址:江西省南昌市抚河北路 291 号
邮政编码:330008
联系人:余雅娜
联系电话:0791-6768763
传真电话:0791-6789414
客服电话:0791-6768763
公司网址:www.scstock..com

(30)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 单元
办公地址:深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元
法定代表人:牛冠兴
联系人:余江
开放式基金咨询电话:400-8001-001、020-96210
联系电话:0755-82558323
网址:www.essence.com.cn

(31)大同证券经纪有限责任公司
法定代表人:董祥
联系人:苏妮
邮政编码:030001
联系电话:0351-4167056
传真:0351-4192803
网址:www.dtsbc.com.cn

(32)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:胡关金
联系人:张有德
电话:0755-83025046
客服电话:400-8888-818
公司网址:www.hx168.com.cn

(33)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
客户服务电话:400-8888-100(全国)、96100(广西)
网址:www.ghzq.com.cn

(34)华鑫证券有限责任公司
注册地址:深圳市罗湖区深南东路 5045 号深业大厦 25 层 2512、2513
办公地址:上海市肇嘉浜路 750 号
法定代表人:王文学
联系人:杨小江
联系电话:021-64339000-826
传真:021-64374849
客服热线:021-62163333、029-68918888
网址:www.cfsc.com.cn

(35)银泰证券经纪有限责任公司
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:高颂
电话:0755-83706665
传真:0755-83704195
客户服务热线:0755-83710885
公司网站:www.ytzq.net

(36)中原证券股份有限公司
注册地址:许昌市南关大街 38 号
办公地址:郑州市经三路 15 号广汇国贸 11 楼
法定代表人:石保上
开放式基金咨询电话:0371-967218
开放式基金业务传真:0371-65585665
联系人:程月艳
联系电话:0371-65585670
网址:www.ccnew.com、www.zyzq.cn

(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
传真:010-59226840
客服电话:400-887-8827
网址:www.ubssecurities.com

(38)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
电话:0755-25832494
公司网址:www.fcsc.cn

(39)国都证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田中心区金田路 4028 号荣超经贸中心 26 层 11、12
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
法定代表人:王少华
联系人:黄静
客户服务电话:400-818-8118
网址:www.guodu.com

(40)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
电话:021-68761616
传真:021-68767981
业务联系人:罗芳
客服电话:400-8888-128
公司网站:www.tebon.com.cn

(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:江西省南昌市永叔路 15 号信达大厦 10-13 楼
法定代表人:管荣升
联系电话:0791-6289771
联系人:徐美云
公司网址:www.gsstock.com

(42)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:蒋元真
联系电话:021-51539888
联系人:谢秀峰
公司网址:www.962518.com
客服电话:021-962518

(43)上海远东证券有限公司
注册地址:上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 5 楼
办公地址:上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 5 楼
法定代表人:田德军
联系人:高滋生
客户服务电话:021-58788888-310
网址:www.ydstock.com

(44)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
法定代表人:李工
联系人:唐泳
电话:0551-5161671
客户服务电话:0551-96518、400-8096-518
网址:www.hazq.com

(45)华林证券有限责任公司
地址:珠海市拱北夏湾华平路 96 号二层 202-203 房
法定代表人:段文清
联系人:杨玲
联系电话:0755-83749624
客服电话:0755-82707866
公司网址:www.chinalions.com

(46)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
客户咨询电话:0731-4403360
公司网址:www.cfzq.com

(47)民生证券有限责任公司
注册地址:北京市朝阳门外大街 16 号中国人寿大厦 1901 室
法定代表人:岳献春
电话:010-85252664
联系人:张颢
客服电话:400-6198-888
公司网址:www.mszq.com.cn

(48)西部证券股份有限公司
地址:西安市东新街 232 号陕西信托大厦 16-17 层
法定代表人:刘建武
电话:029-87406172
传真:029-87406387
客服热线:029-96708
联系人:黄晓军
网址:www.westsecu.com.cn

(49)宏源证券股份有限公司
注册地址:新疆维吾尔自治区乌鲁木齐市建设路 2 号
办公地址:北京市海淀区西直门北大街甲 43 号金运大厦 B 座 6 层
联系人:魏海
电话:010-62267799
公司网站:www.ehongyuan.com.cn

(50)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:杨卓颖
电话:023-63786397
网址:www.swsc.com.cn

(51)万联证券有限责任公司
注册地址:广州市中山二路 18 号广东电信广场 36-37 层
办公地址:广州市中山二路 18 号广东电信广场 36-37 层
法人代表:李舫金
联系人:李俊
联系电话:020-37865026
客服电话:400-8888-133
网址:www.wlzq.com.cn

(52)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
客户服务热线:4008-888-999、027-85808318
联系人:李良
电话:021-63219781
传真:021-51062920
长江证券客户服务网站:www.95579.com

(53)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:北京市西城区月坛北街 2 号月坛大厦 15 层
法定代表人:马金声
联系人:戴荻
电话:010-68084591
传真:010-68084986
公司网站:www.xsdzq.cn

(54)国金证券股份有限公司
公司注册地址:成都市东城根上街 95 号
公司办公地址:成都市东城根上街 95 号
法定代表人:雷波
联系人:王丹
联系电话:028-86690125
传真:028-86690126
网址:www.gjzq.com.cn
客服电话:028-95105111

(55)东吴证券有限责任公司
注册地址:苏州市石路爱河桥路 28 号
办公地址:苏州市石路爱河桥路 28 号
法定代表人:吴永敏
联系人:方晓丹
电话:0512-65581136
客户服务电话:0512-65588066
网址:www.dwzq.com.cn

(56)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 号投资广场 18 楼
办公地址:上海市浦东新区东方路 989 号中达广场 17 楼
法定代表人:朱科敏
联系人:程学军
电话:021-50586660-8853
传真:021-50586660-8881
网址:www.longone.com.cn
客户服务热线:021-52574550、0519-88166222、0379-64902266
免费服务热线:400-888-8588

(57)金元证券股份有限公司
注册地址:海南省海口市南宝路 36 号证券大厦 4 层
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
电话:0755-83025695
传真:0755-83025625
联系人:金春
客服电话:4008-888-228
网址:www.jyzq.com.cn

(58)世纪证券有限责任公司
办公地址:深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 41 层
法人代表:段强
联系人:刘军辉
电话:0755-83199511
公司网址:www.csco.com.cn

(59)方正证券有限责任公司
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:邢铁英
开放式基金咨询电话:95571
开放式基金业务传真:0731-2882332
公司网站:www.foundersc.com

(60)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
电话:010-85679265
传真:010-85679535
客户服务电话:010-85679238、010-85679169
网址:www.ciccs.com.cn

(61)平安证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦三层
办公地址:深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦三层
法定代表人:陈敬达
联系人:袁月
电话:0755-22627802
客户服务电话:95511
网址:pa18.com.cn

(62)华龙证券有限责任公司
办公地址:甘肃省兰州市静宁路 308 号
法定代表人:李晓安
电话:(0931)8888088
传真:(0931)4890515
联系人:李昕田
客户服务热线:(0931)4890619、4890618、4890100
网址:www.hlzqgs.com

(63)浙商证券有限责任公司
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
电 话:(0571)87901963
联系人:吴颖
客户咨询电话:0571-87902079
网址:www.stocke.com

(64)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
电话:0471-4913998
传真:0471-4930707
联系人:常向东
客户服务电话:0471-4961259
网址:www.cnht.com.cn

(65)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
法定代表人:凤良志
公司电话:0551-2634400
传真:0551-2645709
网址:www.gyzq.com.cn
公司办公地址:安徽省合肥市寿春路 179 号
邮政编码:230001

(66)东方证券股份有限公司
注册地址:上海浦东大道 720 号 20 楼
法定代表人:王益民
联系电话:021-68562200-3019
客服热线:021-962506
联系人:盛云
公司网址:www.dfzq.com.cn

(67)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:洪明
联系人:张明
电话:010-88086830
网址:www.rxzq.com.cn

(68)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:北京市西城区金融街 5 号新盛大厦 B 座 4 层
法人代表:林义相
联系人:陈少震
联系电话:010-66045522
客服电话:010-66045678
网址: www.txsec.com、www.txjijin.com

(69)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

名称:南方基金管理有限公司
注册地址: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)82763888
传真:(0755)82763889
联系人:代庆红

(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

普华永道中天会计师事务所有限公司
注册地址:上海市浦东新区沈家弄 325 号(邮编:200137)
办公地址:上海市淮海中路 333 号瑞安广场 12 楼(邮编:200021)
法人代表:Kent Watson
电话:(021)23238888
传真:(021)23238800
联系人: 陈兆欣
经办注册会计师:汪棣、张立纲

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 2009 年 3 月 25 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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2008 年 10 月 1 日起至 2008 年 12 月 31 日止。

1. 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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	1,329,683,375.58	98.35
	其中:债券	1,224,061,246.75	90.53
	资产支持证券	105,622,128.83	7.81
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	2,863,075.11	0.21
6	其他资产	19,489,564.36	1.44
7	合计	1,352,036,015.05	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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	-	-
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
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	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	-	-

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(元)	占基金资产净值比例(%)
-	-	-	-	-	-

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	124,083,062.40	9.65
2	央行票据	78,488,000.00	6.11
3	金融债券	725,526,700.00	56.44
	其中:政策性金融债	625,276,700.00	48.64
4	企业债券	254,057,281.35	19.76
5	企业短期融资券	-	0.00
6	可转债	41,906,203.00	3.26
7	其他	-	0.00
8	合计	1,224,061,246.75	95.23

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	080217	08国开 17	1,500,000	156,750,000.00	12.19
2	080310	08进出 10	1,300,000	134,849,000.00	10.49
3	050603	05中行 02 浮	1,000,000	100,250,000.00	7.80
4	0801106	08央票 106	800,000	78,488,000.00	6.11
5	080006	08国债 06	500,000	57,520,000.00	4.47

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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	119002	澜 电 01	660,000	65,799,188.30	5.12
2	119003	澜 电 02	330,000	32,993,672.53	2.57
3	119005	浦建收益	200,000	6,829,268.00	0.53

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

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 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	12,164,477.56
5	应收申购款	7,075,086.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,489,564.36

8.4 报告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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	125709	唐钢转债	10,147,000.00	0.79

8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中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)
2007.8.28-2007.12.31	7.04%	0.25%	-0.21%	0.11%	7.25%	0.14%
2008.1.1-2008.12.31	3.37%	0.20%	14.89%	0.21%	-11.52%	-0.01%
自基金转型起至今	10.65%	0.21%	14.65%	0.19%	-4.00%	0.02%

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)持续销售费;
(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:

$H = E \times 0.6\% \div$ 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:

$H = E \times 0.2\% \div$ 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

本基金的申购费率为 0。

2、赎回费

本基金赎回费率最高不超过 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

本基金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:

$H = E \times 0.3\% \div$ 当年天数

H 为每日应付的持续销售费

E 为前一日的基金资产净值

持续销售费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送持续销售费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中划出,经登记结算机构代付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

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。

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、对"第三部分 基金管理人"和"第四部分 基金托管人"的情况进行了更新。
2、在"第五部分 相关服务机构"部分,对本基金的代销机构进行了更新。
3、在"第七部分 基金的投资"部分,补充了本基金最近一期投资组合报告和基金的业绩。
4、对"第十九部分 其他应披露事项"进行了更新。
5、对部分其他表述进行了更新。

南方基金管理有限公司
二〇〇九年四月四日

股票代码:000686　股票简称:东北证券　公告编号:2009-008

东北证券股份有限公司限售股份解除限售提示性公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

特别提示:

1. 东北证券股份有限公司股权分置改革方案于 2007 年 8 月 27 日实施,公司持股 5%以下非流通股股东所持股份至 2008 年 8 月 27 日限售期已满;

2. 本次申请解除限售股份股东锦州市顺成商贸公司实际可上市流通股份数量为 1,478,816 股,占总股本比例为 0.25%;

3. 本次限售股份可上市流通日为 2009 年 4 月 8 日。

一、股权分置改革方案概述

东北证券股份有限公司(简称"东北证券"或"本公司")股权分置改革方案为:本公司定向回购并注销中油锦州所持其全部股份,以新增股份吸收合并东北证券,以资本公积金向全体股东转增股份,除原流通股股东以外的其他股东将部分转增股份送与原流通股股东。具体内容包括:

(1)本公司以截至 2006 年 9 月 30 日经审计的全部资产及负债扣除 1000 万元现金为对价,定向回购并注销中国石油锦州石油化工公司持有的其 86,825,481 股非流通股。

(2)同时,上市公司吸收合并东北证券有限责任公司,以新增股份的方式向东北证券有限责任公司全体股东支付合并对价,合并后本公司为存续公司,原东北证券有限责任公司注销。

本次吸收合并的基准日为 2006 年 9 月 30 日,本公司流通股 2006 年 9 月 29 日停牌前 20 个交易日的均价为 9.29 元/股,以此作为本次吸收合并时本公司新增股份的价格。东北证券有限责任公司整体作价 23 亿元,本公司向东北证券有限责任公司全体股东支付 247,578,040 股,由东北证券有限责任公司股东按照各自的股权比例分享。吸收合并后公司总股本增加到 322,885,075 股。

(3)吸收合并后,本公司以资本公积金向全体股东转增股份,每 10 股转增 8 股,转增后股本总额为 581,193,135 股。

(4)除原流通股股东外的其他股东将部分转增股份送与原流通股股东作为对价,相当于流通股股东每 10 股转增 12 股,除原流通股股东外的其他股东每 10 股转增 6.9144 股。

本公司股权分置改革方案 2007 年 2 月 5 日经相关股东会议审议通过,于 2007 年 8 月 27 日实施后复牌。

二、本次可上市流通限售股份持有人做出的各项承诺及履行情况

本公司原非流通股股东锦州市商业房屋开发公司由于已办理工商注销手续,未能参与提出本公司股权分置改革动议,其送股对价 94,913 股由吉林亚泰(集团)股份有限公司先行垫付。

至 2008 年 8 月 27 日,锦州市商业房屋开发公司持有的东北证券股份距本公司实施股权分置改革已满一年时间。

根据辽宁省人民政府国有资产监督管理委员会《关于同意锦州市商业房屋开发公司所持东北证券国有股份无偿划转给锦州市顺城商贸公司的批复》(辽国资产权[2008]158 号),将锦州市商业房屋开发公司持有的东北证券股份有限公司国有股份 1,573,729 股(含应偿股权对价 94,913 股)无偿划转给锦州市顺成商贸公司持有,股权性质仍为国有法人股。股份过户登记手续已于 2008 年 10 月 13 日办理完毕。

根据《锦州市顺成商贸公司与吉林亚泰(集团)股份有限公司关于东北证券股份有限公司股权分置改革垫付对价的偿还协议》,锦州市顺成商贸公司以其持有的东北证券 94,913 股股份偿还吉林亚泰(集团)股份有限公司在本公司股权分置改革过程中为锦州市商业房屋开发公司垫付的股份对价,股份过户登记手续已于 2008 年 12 月 24 日办理完毕。

三、本次限售股份可上市流通安排

1、本次限售股份可上市流通日期为 2009 年 4 月 8 日。

2、本次可上市流通股份的总数为 1,478,816 股,占公司股份总数 0.25%。

3、本次限售股份可上市流通情况如下:

序号	限售股份持有人名称	持有限售股份数(股)	本次可上市流通股数(股)	本次可上市流通股数占限售股份总数的比例(%)	本次可上市流通股数占无限售股份总数的比例(%)	本次可上市流通股数占公司总股本的比例(%)	冻结的股份数量(股)
1	锦州市顺成商贸公司	1,478,816	1,478,816	0.36	0.84	0.25	0
	合计	1,478,816	1,478,816	0.36	0.84	0.25	0

四、股本结构变化和股东持股变化情况

1. 本次解除限售前后的股本结构如下:

股份类型	本次限售股份上市流通前		本次变动数	本次限售股份上市流通后	
	股数	比例		股数	比例
一、有限售条件的流通股					
1、国家持股					
2、国有法人持股	194,842,867	33.52	-1,478,816	193,364,051	33.27
3、境内一般法人持股	211,191,692	36.34	0	211,191,692	36.34
4、境内自然人持股					
5、境外法人持股					
6、境外自然人持股					
7、内部职工股					
8、高管股份					
9. 机构投资者配售股份					
有限售条件的流通股合计	406,034,559	69.86	-1,478,816	404,555,743	69.61
二、无限售条件的流通股					
1. 人民币普通股	175,158,576	30.14	1,478,816	176,637,392	30.39
2. 境内上市的外资股					
3. 境外上市的外资股					
4. 其他					
无限售条件的流通股合计	175,158,576	30.14	1,478,816	176,637,392	30.39
三、股份总数	581,193,135	100	0	581,193,135	100

五、股东持股变化情况及历次限售情况

1、本次解除限售股东自公司股改实施后至今持股变化情况:

序号	限售股份持有人名称	股改实施日持有股份情况		本次解限前已解限股份情况		本次解限前未解限股份情况		股份数量变化沿革
		数量(股)	占总股本比例(%)	数量(股)	占总股本比例(%)	数量(股)	占总股本比例(%)	
1	锦州市顺成商贸公司	0	0	0	0	1,478,816	0.25	2008年10月13日,锦州市商业房屋开发公司所持有的东北证券股份有限公司国有股份1,573,729股(含应偿股权对价94,913股)无偿划转给锦州市顺成商贸公司; 2008年12月24日,锦州市顺成商贸公司以其持有的东北证券94,913股股份偿还吉林亚泰(集团)股份有限公司在本公司股权分置改革过程中为锦州市商业房屋开发公司垫付的股份对价。
	合计	0	0	0	0	1,478,816	0.25	

2、股改实施后至今公司解除限售情况:

序号	刊登《限售股份上市流通提示性公告》的日期	该次解限涉及的股东数量	该次解限的股份总数量(股)	该次解限股份占当时总股本的比例(%)
1	2008年 8 月 23 日	9	23,524,174	4.04

六、保荐机构核查意见书的结论性意见

1、本次申请解除股份限售的股东锦州市顺成商贸公司已经按照《锦州市顺成商贸公司与吉林亚泰(集团)股份有限公司关于东北证券股份有限公司股权分置改革垫付对价的偿还协议》,以其持有的东北证券 94,913 股股份偿还吉林亚泰(集团)股份有限公司在上市公司股权分置改革中为锦州市商业房屋开发公司垫付的股份对价。

2、本次申请解除股份限售的股东不存在对上市公司的非经常性资金占用或上市公司对该股东的违规担保等损害上市公司利益的行为。

3、本次申请解除限售股份符合《中华人民共和国公司法》、《中华人民共和国证券法》、《关于上市公司股权分置改革的指导意见》、《上市公司股权分置改革管理办法》及《深圳证券交易所股权分置改革工作备忘录第 16 号——解除限售》等法律法规及规范性文件的有关规定,符合解除限售的条件。

七、其他事项

1、本次申请限售股份上市流通的限售股份持有人是否存在对公司的非经营性资金占用情况

□是　√否;

若存在违规情况,应当说明违规的具体情况、改正计划和措施;

2、本次申请限售股份上市流通的限售股份持有人是否存在公司对该股东的违规担保情况

□是　√否;

若存在违规情况,应当说明违规的具体情况、改正计划和措施;

3、本次申请限售股份上市流通的限售股份持有人是否存在违规买卖公司股票的行为;

□是　√否;

若存在违规行为,应当说明违规的具体情况、改正计划和措施;

4、解除股份限售的持股 1%以上的股东已提交知悉并严格遵守《证券法》、《上市公司收购管理办法》、《上市公司解除限售存量股份转让指导意见》和本所有关业务规则的承诺文件

□是　√不适用;

八、备查文件

1、解除股份限售申请表
2、保荐机构核查意见书

东北证券股份有限公司董事会
2009 年 4 月 3 日