南方现金增利基金 2006年半年度报告摘要

基金管理人:鹏华基金管理有限公司　基金托管人:中国工商银行股份有限公司

一、重要提示

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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行根据本基金合同规定, 于 2006 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告财务资料未经审计。

二、基金简介

(一)基金名称:南方现金增利基金

基金简称:南方现金增利

交易代码:202301

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2004 年 3 月 5 日

期末基金份额总额:19,929,205,905.17

(二)投资目标:本基金为具有高流动性、低风险和稳定收益的短期金融市场基金,在控制风险的前提下,力争为投资者提供稳定的收益。

投资策略:南方现金增利基金以“保持资产充分流动性,获取稳定收益”为资产配置目标,在战略资产配置上,主要采取利率走势预期与组合久期控制相结合的策略,在战术资产操作上,主要采取滚动投资、关键时期的时机抉择策略,并结合市场环境适时进行回购套利等操作。

业绩比较基准:本基金基准收益率 =1 年期银行定期存款收益率(税后)。

(三)基金管理人

法定名称:南方基金管理有限公司

注册及办公地址:深圳市深南大道 4009 号投资大厦 7 楼

邮政编码:518048

法定代表人:吴万善

信息披露负责人:鲍文革

联系电话:0755-82912000;

传真:0755-82912948

电子邮箱:manager@southernfund.com

(四)基金托管人

法定名称:中国工商银行股份有限公司

注册及办公地址:北京市复兴门内大街 55 号

邮政编码:100032

法定代表人:姜建清

信息披露负责人:庄为

联系电话:010-66107333;

传真:010-66106904

电子邮箱:custody@icbc.com.cn

(五)基金选定的信息披露报纸:中国证券报、上海证券报、证券时报

登载半年度报告正文的管理人网址:http://www.southernfund.com

基金半年度报告置备地点:基金管理人、基金托管人的办公地址

三、主要财务指标和基金净值表现

(一)主要财务指标

财务指标	2006年6月30日
1.本期净收益	341,192,881.19
2.期末基金资产净值	19,929,205,905.17
3.期末基金份额净值	1.0000
4.本期净值收益率	0.9707%
5.累计净值收益率	5.6919%

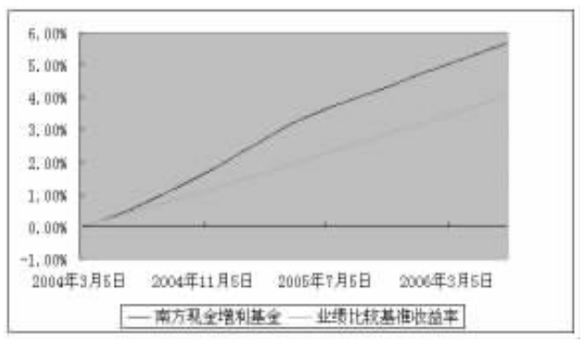
注:本基金收益分配是按月结转份额。

(二)基金净值表现

1、历史各时间段基金净值收益率与同期业绩基准收益率比较

阶段	基金净值收益率(1)	基金净值收益率标准差(2)	比较基准收益率(3)	比较基准收益率标准差(4)	(1)-(3)	(2)-(4)
过去 1 个月	0.1675%	0.0029%	0.1480%	0.0003%	0.0195%	0.0026%
过去 3 个月	0.4950%	0.0025%	0.4490%	0.0002%	0.0460%	0.0023%
过去 6 个月	0.9707%	0.0025%	0.8930%	0.0002%	0.0777%	0.0023%
过去 1 年	2.0107%	0.0025%	1.8000%	0.0003%	0.2107%	0.0022%
自基金成立起至今	5.6919%	0.0024%	4.0410%	0.0004%	1.6509%	0.0020%

2、自基金合同生效以来基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比



四、管理人报告

(一)基金管理人情况

南方基金管理有限公司是经中国证监会证监基金字[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。目前注册资本 15,000 万元人民币。股权结构为:华泰证券有限责任公司 45%、深圳市机场(集团)有限公司 30%、厦门国际信托投资有限公司 15%及兴业证券股份有限公司 10%。

截止 2006 年 6 月 30 日,南方基金管理有限公司管理资产规模达 610 多亿元,管理 4 只封闭式基金—分别为基金开元、基金天元、基金金元、基金隆元;7 只开放式基金—分别为南方稳健成长基金、南方宝元债券型基金、南方避险增值基金、南方现金增利基金、南方积极配置基金、南方高增长基金、南方多利中短债基金;以及全国社会保障基金的投资组合。

(二)基金经理小组情况

张纪林先生,基金经理,1971 年生,南开大学金融学博士,具有 9 年国内银行固定收益类证券投资从业经验,2 年国外银行固定收益类证券投资从业经验。2005 年 9 月起任职南方基金管理有限公司。

此外,现金增利基金管理小组还配备了若干名证券投资分析人员,协助基金经理从事基金的投资管理工作。

(三)报告期内基金运作的遵规守信情况

本报告期内, 本基金管理人严格遵守《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》和《证券投资基金销售管理办法》等有关法律法规及其各项实施准则、《南方现金增利证券投资基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

(四)报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

在国有银行改制、上市等已完成或即将完成的背景下,国内主体银行恢复了银行贷款的增长,上半年银行贷款增速过快,超过监管当局可接受范围;在十一五规划开局第一年,地方政府主导下的固定资产投资高涨,固定资产投资高位运行;周边市场连续加息,基于对年初货币市场资金过度充裕的考虑,为防范资产泡沫的过快膨胀,央行通过央票利率引导市场利率适度上行。

公布的固定资产投资增速、银行贷款增速、进出口数据表明,经济偏热的局面已经呈现。为此,人民银行采取了紧缩的“组合拳”,发行定向票据、公开市场操作、“窗口指导”、上调准备金率。在监管当局的紧缩意图下,1 年期央票利率已稳步上行至 2.60%以上。

A 股指数大幅上扬,新股 IPO 已经开闸,股市一、二级市场分流了部分债市资金,并迎来了大型 IPO 对货币基金流动性的考验。

基于对紧缩政策的预期,对债券市场潜在风险的回避,本基金采取了谨慎投资的策略,在部分组合资产陆续到期的情况下,在一级和二级市场投资了信用评级较高的短融,并在利率高位中标了一些期限较短的金融债。

对大型 IPO 于货币基金流动性的要求有着前瞻性的充分考虑, 本基金在大型 IPO 期间始终保持充足的流动性,并对收益合理、评级较高的短融作了适当配置。

为了维护现有持有人的利益,我们在上半年实现了一些盈利。2006 年上半年,南方现金增利基金净值收益率为 0.9707%。

(五)宏观经济和证券市场展望

我国金融市场融资渠道以银行贷款为主,国有银行占据了绝对主导地位。政府作为国有大银行的控股股东,对国有银行有很强影响力;国家最高领导层发出了控制固定资产投资过快增长的明确信号, 而各大银行已陆续境内外上市,作为上市公司有着追求利润的增长并增加全体股东回报的需求。在此背景下,国有银行将权衡各种因素,控制贷款适度、稳定增长。然而,各投资主体的融资渠道将逐渐多样化,新股 IPO 快速进行,各类票据、债券的发行量也呈快速增长。

在各监管当局明确的紧缩预期下,银行贷款增速有望趋于稳定,固定资产投资增速过快的局面有望改观。

人民币汇率将继续保持稳定适度的升值速度, 升值并非是解决问题的唯一手段,而出口退税、内外税制改革,环境成本纳入核算等都将是更有效手段,并有利于经济可持续发展。作为发展中国家,保持适度出口增长符合国情,有助于经济增长并有利于就业等各类民生问题的解决。

新股 IPO 将继续对债市产生重要影响, 货币市场资金过度宽裕的局面将会有所变化。各种原材料价格上涨推动 PPI 上行,存在 PPI 带动 CPI 的可能。但人民币持续升值,外汇占款推动货币投放的现象仍将存在,固定资产投资的高位运行,一定程度上将加剧产能过剩。

作为现金管理工具,南方现金增利基金管理组将把流动性风险、利率风险和信用风险的管理放在管理工作的首位,在控制风险的基础上,为投资者争取获得一定的投资回报。

五、托管人报告

南方现金增利基金托管人报告

2006 年上半年,本托管人在对南方现金增利基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规、基金合同,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

2006 年上半年,南方现金增利基金的管理人——南方基金管理有限公司在南方现金增利基金的投资运作、每万份基金净收益和 7 日年化收益率、基金收益分配、基金费用开支等问题上,严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

2006 年上半年, 南方现金增利基金在一季度出现过同日反向的情况,我行及时向南方基金管理公司发送提示函件, 南方基金管理公司在规定时间内及时对投资组合进行披露或调整,二季度未出现类似情况。

本托管人依法对南方基金管理有限公司在 2006 年上半年所编制和披露的南方现金增利基金半年度报告中财务指标、净值收益率、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行股份有限公司资产托管部

2006 年 8 月 22 日

六、财务会计报告(未经审计)

(一)会计报表

资产负债表

资产	附注	2006年6月30日	2005年12月31日
银行存款	4.1	7,199,575,344.17	4,630,309,043.08
清算备付金		89,530,412.24	206,823,828.91
交易保证金		250,000.00	250,000.00
应收利息	4.2	172,156,931.61	97,293,807.65
应收申购款		1,095,173,094.68	778,183,572.40
债券投资市值		13,235,365,439.95	29,201,801,515.66
其中:债券投资成本		13,235,365,439.95	29,201,801,515.66
待回购证券			
买入返售证券		793,518,000.00	4,960,900,000.00
其他应收款	4.3	140,173.00	763,518.30
资产总计		22,585,709,395.65	39,876,325,286.00
负债与持有人权益			
负债			
应付证券清算款			
应付管理人报酬		7,036,833.98	10,893,174.15
应付托管费		2,132,373.92	3,300,961.87
应付持续销售费		5,330,934.79	8,252,404.68
应付佣金		-505,089.23	
应付收益		16,196,229.87	36,872,494.52
应付利息		2,145,886.03	55,564.70
其他应付款	4.4	1,118,834.05	297,490.00
卖出回购证券款		2,622,800,000.00	1,343,120,200.00
预提费用	4.5	247,487.07	154,500.00
负债合计		2,656,503,490.48	1,402,946,789.92
持有人权益			
实收基金	4.6	19,929,205,905.17	38,473,378,496.08
负债及持有人权益总计		22,585,709,395.65	39,876,325,286.00

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

经营业绩表

	附注	2006年1-6月	2005年1-6月
收入			
债券差价收入	4.7	72,039,863.43	116,887,083.86
债券利息收入		290,625,523.15	454,305,718.38
存款利息收入		77,224,556.14	668,998.08
买入返售证券收入		44,748,406.57	94,238,565.04
其他收入		162,511.25	
收入合计		484,800,860.54	666,100,365.36
费用			
基金管理人报酬	3.3	58,244,750.30	59,400,676.33
基金托管费	3.3	17,649,924.28	18,000,204.90
基金持续销售费	3.4	44,124,810.63	45,000,512.32
卖出回购证券支出		21,876,410.97	30,248,520.45
其他费用	4.8	1,712,083.17	1,030,510.33
其中:信息披露费		168,603.31	178,520.30
审计费用		74,383.76	75,219.28
费用合计		143,607,979.35	153,680,424.33
基金净收益及基金经营业绩		341,192,881.19	512,419,941.03
基金净收益		341,192,881.19	512,419,941.03
加:期初基金净收益		--	--
可供分配基金净收益		341,192,881.19	512,419,941.03
减:本期已分配基金净收益		341,192,881.19	512,419,941.03
未分配基金净收益		--	--

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

基金净值变动表

	附注	2006年1-6月	2005年1-6月
期初基金净值		38,473,378,496.08	19,202,418,287.84
本期经营活动			
基金净收益		341,192,881.19	512,419,941.03
经营活动产生的基金净值变动数		341,192,881.19	512,419,941.03
本期基金份额交易			
基金申购款		62,311,271,256.86	74,854,977,155.03
其中:分红再投资		332,265,587.25	476,812,680.61
基金赎回款		80,855,443,847.77	55,904,249,670.56
基金份额交易产生的基金净值变动数		-18,544,172,590.91	18,950,727,484.47
本期向基金份额持有人分配收益			
向基金持有人分配收益产生的净值变动数		341,192,881.19	512,419,941.03
期末基金净值		19,929,205,905.17	38,153,145,772.31

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

(二)会计报表附注

1、半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表完全一致。

2、本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

3、关联方关系及交易

(1)关联方关系情况

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、基金注册登记人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
华泰证券有限责任公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东
深圳市机场(集团)有限公司	基金管理人的股东
厦门国际信托投资有限公司	基金管理人的股东
兴业证券股份有限公司(“兴业证券”)	基金管理人的股东

(2)下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(3)关联方报酬

A、基金管理人报酬

支付基金管理人南方基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.33%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.33% / 当年天数。

本基金在本报告期需支付基金管理人报酬 58,244,750.30 元 (2005 年 1-6 月 59,400,676.33 元)。

B、基金托管费

支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日基金托管费 = 前一日基金资产净值 X0.10% / 当年天数。

本基金在本报告期需支付基金托管费 17,649,924.28 元 (2005 年 1-6 月 18,000,204.90 元)。

(4) 基金持续销售费

支付基金销售机构的基金持续销售费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给南方基金管理有限公司,再由南方基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:日基金持续销售费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

本基金在本报告期需支付基金持续销售费 44,124,810.63 元 (2005 年 1-6 月 30 日止期间:45,000,512.32 元)。

(5)与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本期与基金托管人中国工商银行股份有限公司通过银行间同业市场进行的债券(含回购)交易情况:

	2006年1-6月	2005年1-6月
买入债券结算金额	39,845,149,509.29	1,737,578,800.00
卖出债券结算金额	44,855,019,366.87	2,004,173,071.43
卖出回购证券协议金额	32,160,686,900.00	29,302,041,550.00
卖出回购证券利息支出	5,629,365.00	4,886,094.06

(6) 关联方持有的基金份额

	2006年6月30日		2005年6月30日	
	基金份额	占总份额比例	基金份额	占总份额比例
厦门国际信托投资有限公司	7,483.79	0.00%	211,275,458.28	1.06%
南方基金管理有限公司	23,577,829.70	0.06%	53,331,117.21	0.27%
	23,585,313.49	0.06%	264,606,575.49	1.33%

4、流通受限制不能自由转让的基金资产

本基金截至 2006 年 6 月 30 日止从事银行间同业市场债券回购交易形成的卖出回购证券款余额 2,622,800,000.00 元,系以如下债券作为抵押:

债券名称	回购到期日	期末计价	数量	摊余成本总额
04国开 12	2006-7-10	99.99	8,520,000	851,914,800.00
06苏国信 CP01	2006-7-10	100.44	1,000,000	100,440,000.00
06皖高速 CP01	2006-7-10	100.01	1,600,000	160,016,000.00
06苏国信 CP02	2006-7-10	100.00	1,000,000	100,000,000.00
05苏交通 CP02	2006-7-3	99.07	650,000	64,395,500.00
05淮南矿 CP01	2006-7-3	98.75	1,200,000	118,500,000.00
06首创集 CP01	2006-7-3	98.30	900,000	88,470,000.00
06莱钢 CP01	2006-7-3	97.56	1,000,000	97,560,000.00
06酒钢 CP01	2006-7-3	100.17	950,000	95,161,500.00
06南车 CP01	2006-7-3	97.20	900,000	87,480,000.00
06央票 32	2006-7-3	99.74	3,100,000	309,194,000.00
06中电信 CP01	2006-7-3	100.11	7,500,000	750,825,000.00
合 计			28,320,000	2,823,956,800.00

七、投资组合报告

(一)报告期末基金资产组合

资产组合	金额(元)	占基金总资产的比例
债券投资	13,235,365,439.95	58.60%
买入返售证券 其中:买断式回购的买入返售证券	793,518,000.00 --	3.51% --
银行存款和清算备付金合计	7,289,105,756.41	32.27%
其他资产	1,267,720,199.29	5.61%
合计	22,585,709,395.65	100.00%

注:银行存款和清算备付金合计中包括 6,900,000,000.00 元商业银行定期存款投资。

(二)报告期债券回购融资情况

序号	项 目	金额(元)	占基金资产净值的比例%
1	报告期内债券回购融资余额	441,916,754,500.00	7.54%
	其中:买断式回购融入的资金	--	--
2	报告期末债券回购融资余额	2,622,800,000.00	13.16%
	其中:买断式回购融入的资金	--	

(三)基金投资组合平均剩余期限

1、投资组合平均剩余期限基本情况

项 目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	145
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	163
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	77

2、期末投资组合平均剩余期限期分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天内	16.02%	13.16%
2	30天(含)-60 天	16.55%	--
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	8.00%	--
3	60天(含)-90 天	17.89%	--
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	3.94%	--
4	90天(含)-180 天	10.65%	--
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.30%	--
5	180天(含)-397 天(含)	45.86%	--
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	6.07%	--
合 计		106.97%	13.16%

(四)报告期末债券投资组合

1、按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	成本(元)	占基金资产净值的比例
1	国家债券	--	--
2	金融债券	5,308,849,606.68	26.64%
	其中:政策性金融债	3,424,559,306.66	17.18%
3	央行票据	859,522,592.46	4.31%
4	企业债券	6,809,276,176.62	34.17%
5	资产支持证券	257,717,064.19	1.29%
	合计	13,235,365,439.95	66.41%
	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	3,735,574,207.74	18.74%

2、基金投资前十名债券明细

序号	债券名称	债券数量(张)		成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
		自有投资	买断式回购		
1	04国开 17	15,800,000		1,593,464,390.27	8.00%
2	04建行 03 浮	12,000,000		1,209,492,350.08	6.07%
3	04国开 12	11,000,000		1,099,853,333.35	5.52%
4	06中电信 CP01	10,000,000		1,001,073,924.23	5.02%
5	05中行 02 浮	6,700,000		674,797,949.94	3.39%
6	06农发 07	6,200,000		619,991,506.85	3.11%
7	06央票 32	4,400,000		438,839,560.40	2.20%
8	06央票 15	3,040,000		302,674,041.26	1.52%
9	网通 02	2,000,000		197,718,121.06	0.99%
10	05粤交通 CP01	1,720,000		170,726,905.05	0.86%

(五)“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项 目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.5%(含)以上的次数	--
报告期内偏离度的绝对值在 0.25%(含)-0.5%间的次数	66
报告期内偏离度的最高值	0.4007%
报告期内偏离度的最低值	0.0100%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2578%

(六) 投资组合报告附注

1、基金计价方法说明:本基金采用“摊余成本法”计价,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内平均摊销,每日计提收益。

2、本报告期内本基金持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券, 该类浮动利率债券的摊余成本有超过当日基金资产净值的 20%的情况:

序号	发生日期	占基金净值比例
1	2006-6-22	20.81%
2	2006-6-29	21.08%

3、本报告期内无需要说明的证券投资决策程序。

4、其他资产的构成

序号	其他资产	金额(元)
1	交易保证金	250,000.00
2	应收利息	172,156,931.61
3	应收申购款	1,095,173,094.68
4	其他应收款	140,173.00
合计		1,267,720,199.29

5、报告期末持有资产支持证券明细

序号	债券名称	债券数量(张)	成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	网通 02	2,000,000.00	197,718,121.06	0.99%
2	澜电 03	600,000.00	59,998,943.13	0.30%

八、基金份额持有人户数、持有人结构

项 目	户 / 份额	占总份额的比例
基金份额持有人户数	196,791	---
平均每户持有基金份额	101,270.92	---
机构投资者持有的基金份额	5,586,278,447.46	28.03%
个人投资者持有的基金份额	14,342,927,457.71	71.97%

九、开放式基金份额变动

(一)基金合同生效日基金份额总额:8,049,850,114.32

(二)本期基金份额的变动情况

期初基金份额总额	38,473,378,496.08
期间基金总申购份额	62,311,271,256.86
期间基金总赎回份额	80,855,443,847.77
期末基金份额总额	19,929,205,905.17

十、重大事件揭示

1、本报告期内未召开持有人大会。

2、 基金托管人的专门基金托管部门在本报告期内没有发生重大人事变动。

3、基金管理人在本报告期内重大人事变动情况:①基金管理人于 2006 年 1 月 20 日发布关于董事变更的公告: 经南方基金管理有限公司股东会议选举,杨进军先生、汤大杰先生任公司董事,陈虹、崔绍先不再担任公司董事。

4、基金财产、基金托管业务在本报告期内没有发生诉讼事项。

5、本报告期内本基金投资策略未改变。

6、本基金以单位面值 1.00 元固定单位净值交易方式,每日计算当日收益并全部分配,每月以红利再投资方式集中支付累计收益,即按单位面值 1.00 元转为基金份额(本基金收益分配是按月结转份额)。

6、本报告期内本基金未更换会计师事务所。

7、基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚的任何情形。

8、报告期内偏离度的绝对值未发生在 0.5%(含)以上的情况

9、本基金租用证券公司专用交易席位的有关情况

(1)证券公司名称及席位数量、债券回购交易及支付佣金情况

券商名称	席位数量	债券回购成交金额	占成交总额比例	支付佣金	占佣金总量比例
天同证券有限责任公司	2	40,175,300,000.00	50.96%	-375,429.00	49.58%
金信证券有限责任公司	1	38,666,200,000.00	49.04%	-381,809.23	50.42%
光大证券股份有限公司	1	--	---	---	---
银河证券股份有限公司	2	--	---	---	---
合计	6	78,841,500,000.00	100.00%	-757,238.23	100.00%

(2)本期租用证券公司席位的变更情况

本期新增 1 家证券公司的 2 个席位:银河证券股份有限公司(上海席位、深圳席位)

10、已在临时报告中披露过的本报告期内发生的其他重要事项

序号	其他重要事项	披露日期
1	南方基金管理有限公司关于南方现金增利基金实施有条件申购的公告	2006-06-26
2	南方基金增加广发银行为代销机构的公告	2006-06-24
3	南方现金增利基金关于资产支持证券投资方案的公告	2006-05-30
4	南方基金关于增加中信银行为南方现金增利基金代销机构的公告	2006-03-27
5	南方基金管理有限公司关于调整基金经理的公告	2006-03-16
6	南方基金管理有限公司关于注册资本变更及股东出资转让的公告	2006-03-10
7	关于南方现金增利基金春节假期前暂停申购的公告	2006-01-21
8	南方基金关于有条件受理申购南方现金增利基金的公告	2006-01-14
9	南方基金管理有限公司增加申银万国证券股份有限公司为南方现金增利基金代销机构的公告	2006-01-06

投资者对本报告书若有疑问,可咨询本基金管理人。

咨询电话:0755-400-889-8899

公司网站:http://www.southernfund.com

南方基金管理有限公司

二零零六年八月二十五日

光大证券股份有限公司 关于注销武钢股份认购权证的公告

依照上海证券交易所发布的《关于证券公司创设武钢股份权证有关事项的通知》,光大证券股份有限公司向上海证券交易所申请注销武钢认购权证并已获核准, 中国证券登记结算有限责任公司上海分公司已办理相应登记手续。本公司此次获准注销的武钢认购权证数量为 600 万份,该权证的条款与原武钢认购权证(交易简称武钢 JTB1、交易代码 580001、行权代码 582001)的条款完全相同。

本公司此次注销的武钢认购权证的注销生效日期为 2006 年 8 月 25 日 (相关信息请登录光大证券网 www.ebscn.com 查询)。

特此公告。

光大证券股份有限公司

2006 年 8 月 25 日

景顺长城新兴成长股票型证券投资基金 开放日常赎回业务的公告

景顺长城新兴成长股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)基金合同已于 2006 年 6 月 28 日起正式生效,并于 2006 年 8 月 4 日起开始办理日常申购业务。根据《景顺长城新兴成长股票型证券投资基金基金合同》与《景顺长城新兴成长股票型证券投资基金招募说明书》的有关规定,景顺长城基金管理有限公司定于 2006 年 8 月 29 日开始办理本基金(基金代码:260108)的日常赎回业务。

本基金办理日常申购业务的销售机构为:

1)直销机构:景顺长城基金管理有限公司。

2)代销机构:中国工商银行股份有限公司、中国农业银行、中国光大银行、长城证券有限责任公司、招商证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、中国银河证券有限责任公司、申银万国股份有限公司。

风险提示: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,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。投资者投资于本基金时应认真阅读本基金的基金合同、招募说明书。敬请投资者留意投资风险。

特此公告。

景顺长城基金管理有限公司

2006 年 8 月 25 日

南方基金管理有限公司关于旗下基金 投资 G 津滨(000897)非公开发行股票的公告

根据中国证券监督管理委员会《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》要求,我公司发布公告如下:

由我司管理的南方稳健成长贰号证券投资基金和南方稳健成长证券投资基金, 参加了 G 津滨(000897)非公开定向增发,分别认购其股份 5750 万股与 500 万股(锁定期为本次发行完成后 12 个月)。截至 8 月 23 日收盘,南方稳健成长贰号证券投资基金持有该股票本次非公开发行部分的成本为 20,010 万元,账面价值为 27,945 万元,分别占基金资产净值的 3.71%和 5.17%;南方稳健成长证券投资基金持有该股票本次非公开发行部分的成本为 1740 万元, 账面价值为 2430 万元,分别占基金资产净值的 0.66%和 0.92% 。

投资者可登陆我公司网站(www.southernfund.com),或拨打客户服务电话 400-889-8899 咨询相关信息。

特此公告。

南方基金管理有限公司

2006 年 8 月 24 日