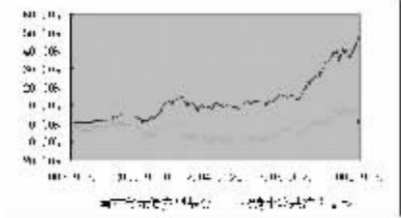


南方宝元债券型基金 2006年第三季度报告

一、重要提示
基金管理人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...



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...

二、基金产品概况
基金简称:南方宝元
基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2002年9月20日
期末基金份额总额:742,012,746.96

投资目标:本基金为开放式债券型基金,以债券投资为主,股票投资为辅...

业绩比较基准:南方宝元债券型基金采用“75%交易所国债指数+25%上证A股指数+深证A股指数”为业绩比较基准。

风险收益特征:南方宝元债券型基金属于证券投资基金中的低风险品种...

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

三、主要财务指标和基金净值表现

(一)主要财务指标

Table with 2 columns: 指标 (Indicator) and 金额 (Amount). Rows include 基金本期净收益, 加权平均基金份额本期净收益, etc.

重要提示:上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用...

(二)基金净值表现

1. 净值增长率与同期业绩基准收益率比较表

Table with 7 columns: 阶段 (Period), 净值增长率(1), 业绩基准收益率(2), 业绩比较基准收益标准差(3), etc.

2. 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势比较图

创新突出,处于生命周期上升期的成长型企业将给予重点关注。

五、投资组合报告

(一)期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 项目 (Item), 金额 (Amount), 占基金总资产的比例 (Percentage). Rows include 股票, 债券, 权证, etc.

(二)期末按行业分类的股票投资组合

Table with 3 columns: 行业分类 (Industry), 市值 (Market Value), 占基金资产净值比例 (Percentage). Rows include A 农、林、牧、渔业, B 采掘业, etc.

(三)期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量 (Quantity), 市值 (Market Value), 市值占净值比例 (Percentage).

(四)期末按券种分类的债券投资组合

Table with 3 columns: 债券类别 (Bond Category), 市值 (Market Value), 市值占净值比例 (Percentage). Rows include 国家债券, 央行票据, etc.

(五)期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 债券名称 (Bond Name), 市值 (Market Value), 市值占净值比例 (Percentage).

(六)投资组合报告附注

1. 本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的...

2. 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3. 期末其他资产构成

Table with 2 columns: 项目 (Item), 金额 (Amount). Rows include 交易保证金, 应收证券清算款, etc.

4. 期末持有的处于转股期的可转换债券

Table with 4 columns: 债券代码 (Bond Code), 债券名称 (Bond Name), 市值 (Market Value), 市值占净值比例 (Percentage).

5. 权证投资情况:无。

六、开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 期初基金份额总额, 期末基金份额总额.

七、备查文件目录

1. 《南方宝元债券型基金基金合同》。

2. 《南方宝元债券型基金托管协议》。

3. 南方宝元债券型基金 2006 年 3 季度报告原文。

4. 南方宝元债券型基金招募说明书。

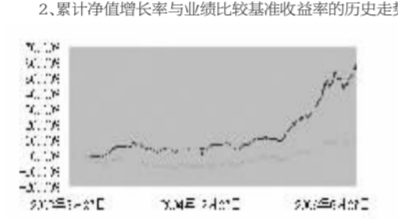
存放地点:深圳市深南大道 4009 号投资大厦 7 楼

查询方式:网站:http://www.southernfund.com

南方基金管理有限公司 二零零六年十月二十七日

南方避险增值基金 2006年第三季度报告

一、重要提示
基金管理人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...



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...

二、基金产品概况
基金简称:南方避险
基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2003年6月27日
期末基金份额总额:4,487,537,681.16

投资目标:本基金控制本金损失的风险,并在三年避险周期到期时力争基金资产的稳定增值。

投资策略:本基金参照优化后的恒定比例投资组合保险机制对风险资产上限进行动态调整...

在债券投资方面,一部分基金资产投资于剩余期限与避险周期基本匹配的债券并持有到期...

在股票投资方面,一方面注重股票趋势研究,发掘市场时机选择能力;另一方面,坚持个股精选...

业绩比较基准:中信国债指数+80%+中信综指*20%

风险收益特征:本基金为投资者控制本金损失的风险。

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

三、主要财务指标和基金净值表现

(一)主要财务指标

Table with 2 columns: 指标 (Indicator) and 金额 (Amount). Rows include 基金本期净收益, 加权平均基金份额本期净收益, etc.

重要提示:上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用...

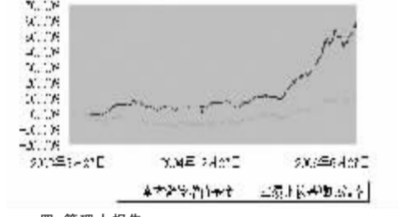
(二)基金净值表现

1. 净值增长率与同期业绩基准收益率比较表

Table with 7 columns: 阶段 (Period), 净值增长率(1), 业绩基准收益率(2), 业绩比较基准收益标准差(3), etc.

2. 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势比较图

2. 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势比较图



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...

四、管理人报告

(一)基金管理团队
苏彦祝先生,基金经理,30岁,1998年获得清华大学工学学士学位...

(二)基金运作的遵规守信情况
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》...

(三)基金的投资策略和业绩表现说明
整个季度,投资者是在对宏观经济数据的预测与可能由此引致进一步宏观调控的忧虑中度过...

(四)期末按行业分类的股票投资组合

Table with 3 columns: 行业分类 (Industry), 市值 (Market Value), 占基金资产净值比例 (Percentage).

(五)期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量 (Quantity), 市值 (Market Value), 市值占净值比例 (Percentage).

(一)期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 项目 (Item), 金额 (Amount), 占基金总资产的比例 (Percentage).

(二)期末按行业分类的股票投资组合

Table with 3 columns: 行业分类 (Industry), 市值 (Market Value), 占基金资产净值比例 (Percentage).

(三)期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量 (Quantity), 市值 (Market Value), 市值占净值比例 (Percentage).

(四)期末按券种分类的债券投资组合

Table with 3 columns: 债券类别 (Bond Category), 市值 (Market Value), 市值占净值比例 (Percentage).

(五)期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 债券名称 (Bond Name), 市值 (Market Value), 市值占净值比例 (Percentage).

(六)投资组合报告附注

1. 本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的...

2. 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3. 期末其他资产构成

Table with 2 columns: 项目 (Item), 金额 (Amount). Rows include 交易保证金, 应收证券清算款, etc.

4. 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 债券代码 (Bond Code), 债券名称 (Bond Name), 市值 (Market Value), 市值占净值比例 (Percentage).

5. 权证投资情况:无。

6. 报告期末持有的资产支持证券明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 代码 (Code), 名称 (Name), 数量 (Quantity), 金额 (Amount), 占净值比例 (Percentage).

七、备查文件目录

1. 《南方避险增值基金基金合同》。

2. 《南方避险增值基金招募说明书》。

3. 《南方避险增值基金托管协议》。

4. 南方避险增值基金 2006 年 3 季度报告原文。

存放地点:深圳市深南大道 4009 号投资大厦 7 楼

查询方式:网站:http://www.southernfund.com

南方基金管理有限公司 二零零六年十月二十七日

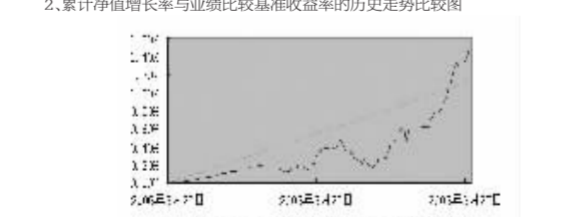
南方多利中短期债券投资基金 2006年第三季度报告

一、重要提示
基金管理人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...

1. 净值增长率与同期业绩基准收益率比较表

Table with 7 columns: 阶段 (Period), 净值增长率(1), 业绩基准收益率(2), 业绩比较基准收益标准差(3), etc.

2. 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势比较图



注:自基金合同生效日至本报告期末本基金运作时间未满一年。

四、管理人报告

(一)基金管理团队
刘倩倩先生,1961年生,中共党员,南开大学经济学硕士,注册会计师...

(二)基金运作的遵规守信情况
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》...

(三)基金的投资策略和业绩表现说明
整个上半年,出于对经济过热风险的考虑,央行采用了升息、上调准备金率和定向央行票据等货币政策工具...

今年上半年,出于对经济过热风险的考虑,央行采用了升息、上调准备金率和定向央行票据等货币政策工具...

(四)投资组合报告附注

1. 本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的...

2. 期末其他资产构成

Table with 2 columns: 项目 (Item), 金额 (Amount). Rows include 应收利息, 其他应收款, etc.

3. 报告期内本基金投资组合平均剩余期限符合合同约定。

4. 报告期内本基金影子定价与摊余成本法确定的基金资产净值未出现超出合同约定的重大偏离。

5. 报告期末持有的资产支持证券明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 代码 (Code), 名称 (Name), 数量 (Quantity), 金额 (Amount), 占净值比例 (Percentage).

六、开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 期初基金份额总额, 期末基金份额总额.

七、备查文件目录

1. 《南方多利中短期债券投资基金基金合同》。

2. 《南方多利中短期债券投资基金招募说明书》。

3. 《南方多利中短期债券投资基金托管协议》。

4. 南方多利中短期债券投资基金 2006 年 3 季度报告原文。

存放地点:深圳市深南大道 4009 号投资大厦 7 楼

查询方式:网站:http://www.southernfund.com

南方基金管理有限公司 二零零六年十月二十七日