南方宝元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

(2006 年第 12 号)

重要提示

南方宝元债券型证券投资基金(以下简称“南方宝元债券型基金”或“本基金”)经中国证券监督管理委员会证监基金字【2002】42 号文和证监基金字【2002】55 号文批准公开发行。根据当时生效的法律法规,本基金于 2002 年 9 月 20 日成立。

南方基金管理有限公司(“本基金管理人”或“基金管理人”或“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作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险,投资人申购基金时应认真阅读招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本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,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

本摘要根据本基金的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,应详细查阅本基金的基金合同。

本基金的基金合同已经根据 《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》及其它有关规定作了修订并已于中国证监会指定报刊或网站进行了公告。

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 2006 年 9 月 20 日,有关财务数据和净值表现截止日为 2006 年 9 月 30 日。

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:广东省深圳市福田中心区深南大道 4009 号投资大厦七楼

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)82912000

传真:(0755)82912948

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金字[1998]4 号文批准,由南方证券股份有限公司、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%。

(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,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、华泰证券有限责任公司发行部副经理、总经理助理、副总经理、总裁,现任华泰证券有限责任公司董事长兼党委副书记、南方基金管理有限公司董事长。

杨进军先生,董事,中共党员,客座教授,历任中共中央党史研究室办公厅副主任、中共深圳市委宣传部助理巡视员、深圳市经济体制改革办公室主任、党组书记兼深圳社科联副主席、深圳市企业改革与发展办公室主任。现任深圳市机场(集团)有限公司党委书记、董事长,深圳市机场股份有限公司董事长。

周明先生,董事,中共党员,经济学学士,高级会计师。历任中国人民银行厦门市分行国外业务部副科长、厦门市财政局处长、厦门市国资局副局长、厦门国际信托投资公司总经理,现任厦门国际信托投资有限公司董事长。

兰荣先生,董事,中共党员,经济学硕士,经济师。历任福建兴业银行计划资金部副总经理、证券业务部副总经理、福建兴业证券公司总裁,现任兴业证券股份有限公司董事长兼总裁。

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,华泰证券有限责任公司副总会计师,现任华泰证券有限责任公司副总裁。

汤大杰先生,董事,中共党员,经济师,博士研究生。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(集团)有限公司副总经理。

张涛先生,董事,中共党员,博士,经济师。历任华泰证券有限责任公司投资银行业务总部业务经理、上海投资银行部副总经理,现任华泰证券有限责任公司副总裁、党委委员。

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。

高尚全先生,独立董事,教授,高级研究员,博士生导师。历任东北人民政府机械局干部、一机部农机局干部、国务院农机办副组长、国家机械委处长、国家体改委副主任,现任中国经济体制改革研究会会长。

孙树义先生,独立董事,中共党员,学士学位,高级工程师。历任第四机械工业部副处长、电子工业部生产司处长、国家经委体改局处长、国家体改委生产体制司司长、中央财经领导小组办公室副主任、国家人事部副部长、中央企业工委副书记,现任中国企业联合会、中国企业家协会执行副会长,第十届全国政协委员。

陈小悦先生,独立董事,中共党员,博士,教授,博士生导师。历任清华大学经济管理学院党委副书记、院长助理,现任北京国家会计学院院长兼清华大学会计研究所所长。

戴昌久先生,独立董事,中共党员,硕士研究生。历任财政部条法司科员、德恒律师事务所律师,现任北京昌久律师事务所主任。

2、监事会成员

骆新都女士,监事会主席,经济学硕士,经济师。历任民政部外事处处长、南方证券公司副总裁、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监事会主席。

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、稽查监察部总经理,现任华泰证券有限责任公司计划财务部总经理。

潘明华先生,监事,学士学位,高级会计师。历任铁道部大桥工程局桥梁机械厂会计、分公司财务经理、深圳机场(集团)公司财务部科长,现任深圳机场股份有限公司财务部经理。

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、厦门国际信托投资有限公司财务部副经理、自营业务部经理,现任厦门国际信托投资有限公司财务部经理。

庄园芳女士,监事,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,现任兴业证券股份有限公司副总裁。

苏民先生,监事,工程师。南京东南大学计算机应用专业硕士,上海交通大学管理工程与科学专业在读博士研究生。1994 年 7 月参加工作,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,现任公司运作保障部副总监。

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。

许小松先生,副总经理,男,中共党员,经济学博士,历任南京农业大学讲师、深圳证券交易所综合研究所副所长。现任南方基金管理有限公司副总经理、党委委员。

邓召明先生,副总经理,男,中共党员,经济学博士,讲师,历任北京理工大学管理与经济学院讲师、机电部兵器工业总公司主任科员、中国证监会处长。现任南方基金管理有限公司副总经理、党委委员、纪委书记。

俞文宏先生,副总经理,男,中共党员,工商管理硕士,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。

秦长奎先生,督察长,男,中共党员,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

王黎敏先生,1975 年生,注册金融分析师(CFA),中国人民银行研究生部毕业,金融学硕士,6 年基金从业经历。2000 年进入南方基金管理公司工作,先后担任研究部研究员、开元基金助理、天元基金助理、南方稳健成长基金助理、开元基金经理等职务。

5、投资决策委员会成员

总经理高良玉先生、副总经理许小松先生、投资部总监王宏远先生、固定收益部总监刘情剑先生。

二、基金托管人

(一)基金托管人概况

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

办公地址:北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人:姜建清

设立日期:1984 年 1 月 1 日

注册资本:人民币 286,509,130,026 元

联系电话:(010)66106912

联系人:蒋松云

(二)、主要人员情况

中国工商银行资产托管部共有员工 77 人, 平均年龄 30 岁,90%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,中国工商银行自成立以来始终坚持“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 2006 年 6 月,托管证券投资基金 63 只,其中封闭式 16 只,开放式 47 只。托管资产规模年均递增 73%。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、QFII 资产、履约类产品等十大类 14 项产品的托管业务体系。继 2004 年先后获得《亚洲货币》和《全球托管人》评选的“中国最佳托管银行”称号后,2005 年,又分别获得《财资》和《全球托管人》评选的“中国最佳托管银行”称号。

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1、直销机构

(1)南方基金管理有限公司

注册地址:广东省深圳市福田中心区深南大道 4009 号投资大厦七楼

法定代表人:吴万善

电话:(0755)82912592

传真:(0755)82913232

联系人:王世伟

(2)南方基金管理有限公司北京分公司

注册地址:北京西城区金融大街 19 号富凯大厦 17 层 B1702 室

法定代表人:吴万善

电话:(010)66573399

传真:(010)66573868

联系人:朱运东

(3)南方基金管理有限公司上海分公司

注册地址:上海市浦东南路 528 号上海证券大厦南塔 19 楼 1901 室

法定代表人:吴万善

电话:(021)68817000

传真:(021)68817654

联系人:杨继东

2. 代销机构

银行:

(1)中国工商银行

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

网址:www.icbc.com.cn

(2)上海浦东发展银行

注册地址:上海市浦东新区浦东南路 500 号

法定代表人:金运

电话:021-33054678

传真:021-63602431

联系人:倪苏云、汤嘉惠

(3) 招商银行

注册地址:深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人:秦晓

电话:95555

传真:0755-83195049

(4) 深圳发展银行

注册地址:深圳市深南东路 5047 号

法定代表人:法兰克纽曼(Frank N. Newman)

电话:(0755)82088888

传真:(0755)82080714

联系人:周勤、汪小茁、乔勇

客户服务电话:95501

(5)广东发展银行

注册地址:广州农林下路 83 号

法定代表人:李若虹

电话:020-38323704、38322730、38323206

传真:020-87311780

联系人:江璐、罗环宇

券商:

(1)华泰证券

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)84457777-882、721

联系人:袁红彬

客户咨询电话:025-84579897

网址:www.htsc.com.cn

(2)兴业证券

注册地址:福州市湖东路 99 号标力大厦

法定代表人:兰荣

电话:0591-7541476

客户服务热线:021-68419125

联系人:杨胜芳

网址:www.xyzq.com.cn

(3)国泰君安证券

注册地址:上海市浦东新区商城路 618 号

法定代表人:祝幼一

电话:021-62580818-177

传真:021-62583439

服务热线:4008888666 021-962588

联系人:芮敏祺

网址:www.gtja.com

(4)广发证券

办公地址:广州市天河北路 183 号大都会广场 36、38、41、42 楼

法定代表人:王志伟

电话:(020)87555888

传真:(020)87557985

联系人:肖中梅

网址:www.gf.com.cn

(5)联合证券

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:马国强

电话:0755-82493561

传真:0755-82492187

联系人:盛宗凌

网址:www.lhzq.com

(6)银河证券

注册地址: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:朱利

联系电话:(010)66568613、66568587

联系人:郭京华

公司网址:www.chinastock.com.cn

(7)海通证券

地址:上海市淮海中路 98 号

法定代表人:王开国

电话:021-53594566-4125 传真:021-53858549

联系人:金芸

网址:www.htsec.com

(8)国信证券

注册地址:深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层

法定代表人:胡继之

联系电话:0755-82130833-2181

传真:0755-82133302

联系人:林建闽

网址:www.guosen.com.cn

(9)招商证券

地址:深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 39-45 层

法定代表人:宫少林

电话:0755-82943511

传真:0755-82943237

联系人: 童建

客户服务热线:4008888111、0755-26951111

网址:www.newone.com.cn

(10)东方证券

注册地址:上海浦东大道 720 号 20 楼

法定代表人:肖时庆

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

(11)光大证券

注册地址:上海市浦东南路 528 号上海证券大厦南塔 15 楼

办公地址:上海市浦东新区浦东南路 528 号上海证券大厦北塔 2004 楼

法定代表人:王明权

电话: (021)68768800

传真: (021)68817271

联系人:刘晨

(12)东吴证券

注册地址:苏州市十梓街 298 号

法定代表人:吴永敏

联系电话:0512-65158588

客服热线:0512-96288

传真:0512-65158028

联系人:方晓丹

公司网址:www.dfzq.com.cn

(13)长江证券

注册地址:武汉市新华下路特 8 号

法定代表人:明云成

联系电话:021-63291352

服务热线:02765799883

传真:021-33130730

联系人:毕艇

公司网址:www.cz318.com.cn

(14)湘财证券

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:陈伟

网址:www.xcsc.com

(15)山西证券

注册地址:山西省太原市迎泽大街 282 号

法定代表人:吴晋安

联系电话:0351-8686766、0351-8686708

联系人:邹连星、刘文康

网址:www.i618.com.cn

(16)中信证券

住所:深圳市湖贝路 1030 号海龙王大厦

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

(17)申银万国证券股份有限公司

注册地址:上海市常熟路 171 号

法定代表人:王明权

联系电话:(021)54033888

联系人:黄维琳

(18)渤海证券有限责任公司

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

电话: (022)28451883

传真: (022)28451616

联系人:徐焕强

(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:吴张

电　话:020-87320991

传　真:020-87325036

联 系 人:王江川

客户服务热线:020-87320991、020-87320595

(20)长城证券有限责任公司

注册地址:深圳福田区深南大道 6008 特区报业大厦 14 层

法定代表人:魏云鹏

电　话:0755-83516094

联 系 人:高峰

客户服务热线:0755-82288968

(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)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

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:张慎修

联系人:杨玲

电话:0755-83025430

客服电话:4008888818

公司网址:www.hx168.com.cn

(23)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:张劲春

电话:0769-82119353

公司网址:www.dgzq.com.cn

(24)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:章磊

电话:0755-83199511

公司网址.www.csco.com.cn

(25)中信建投证券有限责任公司

法定代表人:黎晓宏

注册地址:北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

开放式基金咨询电话:4008888108

联系人:权唐

公司网站: www.csc108.com

(26)金元证券有限责任公司

注册地址: 海南省海口市南宝路 36 号证券大厦 4 层

电话:0755-83025695

传真:0755-83025625

联系人: 金春

公司网址:www.jyzq.cn

(27)上海证券有限责任公司

地址: 上海市九江路 111 号

电话: 021-65087006

联系人:刘勇

(28)德邦证券有限责任公司

办公地址:上海市浦东南路 588 号浦发大厦 26 楼

法定代表人:王军

电话:021-68590808-8125

联系人:罗芳

客服电话:021-68590808-8119

网址:www.tebon.com.cn

(29)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—87406132

联系人:黄晓军

(30)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(同上)

(三)律师事务所和经办律师

北京天驰律师事务所

注册地址:北京朝阳区亚运村汇欣大厦 A 座 14 层

负责人:杨晓明

电话:(010)84991188

传真:(010)84990025

经办律师:杨晓明 邓辉 查扬

(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:上海市浦东新区东昌路 568 号

办公地址:上海湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼 (邮编:200021)

法人代表:杨绍信

电话:(021)61238888

传真:(021)61238800

经办注册会计师:汪棣 单峰

四、基金名称

南方宝元债券型基金

五、基金的类型

契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金为开放式债券型基金,以债券投资为主,股票投资为辅,在保持投资组合低风险和充分流动性的前提下,确保基金安全及追求资产长期稳定增值。

七、基金的投资方向

本基金的投资标的物为国内依法公开发行的各类债券、股票以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。作为债券型基金,本基金主要投资于各类债券,品种主要包括国债、金融债、企业债与可转换债券。债券投资在资产配置中的比例最低为 45%,最高为 95%;股票投资在资产配置中的比例不超过 35%。

八、投资策略

本基金将采取自上而下的投资策略对各种投资工具进行合理的配置。首先根据对宏观经济走势以及国家的财政政策与货币政策的分析,确定资产配置的指导原则,然后依照收益率与风险特征对不同市场以及不同投资工具的投资比例进行合理的配置,并随投资环境的变化及时作出调整,并注重采用多种投资手段,把握市场上的无风险套利机会,增加盈利性。

九、业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:75%交易所国债指数 +25%(上证 A 股指数 + 深证 A 股指数)

十、风险收益特征

本基金以债券投资为主,股票投资为辅,力求投资组合保持较低风险和充分流动性,确保基金安全及追求资产长期稳定增值。

十一、基金的投资组合报告(未经审计)

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根据本基金合同规定, 于 2006 年 10 月 18 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。

本投资组合报告所载数据截至 2006 年 9 月 30 日。

(一)期末基金资产组合情况

项　目	金　额	占基金总资产的比例
股票	309,915,735.96	25.83%
债券	751,802,569.45	62.66%
权证	--	--
银行存款及清算备付金合计	119,247,531.91	9.94%
其他资产	18,914,582.27	1.57%

(二)期末按行业分类的股票投资组合

行业分类	市值	占基金资产净值比例
A 农、林、牧、渔业	--	--
B 采掘业	27,160,000.00	3.03%
C 制造业	105,121,560.00	11.72%
C0 食品、饮料	311,700.00	0.03%
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	104,258,860.00	11.63%
C7 机械、设备、仪表	551,000.00	0.06%
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	9,338,112.00	1.04%
G 信息技术业	--	--
H 批发和零售贸易	--	--
I 金融、保险业	87,189,497.16	9.73%
J 房地产业	81,106,566.80	9.05%
K 社会服务业	--	--
L 传播与文化产业	--	--
M 综合类	--	--
合计	309,915,735.96	34.57%

(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

序 号	股票代码	股票名称	数　量	市　值	市值占净值比例
1	600036	招商银行	7,980,000	79,321,200.00	8.85%
2	000002	万 科 A	10,380,000	78,576,600.00	8.77%
3	000825	太钢不锈	11,380,000	70,556,000.00	7.87%
4	600028	中国石化	4,000,000	27,160,000.00	3.03%
5	600660	福耀玻璃	2,800,000	22,204,000.00	2.48%
6	000877	天山股份	2,680,000	11,229,200.00	1.25%
7	601006	大秦铁路	1,482,240	9,338,112.00	1.04%
8	601988	中国银行	2,362,852	7,868,297.16	0.88%
9	600048	保利地产	91,006	2,529,966.80	0.28%
10	000549	S 湘火炬	100,000	551,000.00	0.06%

(四)期末按券种分类的债券投资组合

债 券 类 别	市　值	市值占净值比例
国家债券	93,724,877.60	10.46%
央行票据投资	--	--
企业债券投资	11,000,000.00	1.23%
可转换债投资	34,287,612.90	3.82%
政策性银行金融债券	575,790,078.95	64.23%
金融债券	37,000,000.00	4.13%
债券投资合计	751,802,569.45	83.87%

(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

序 号	债券名称	市　值	市值占净值比例
1	05农发 04	170,887,578.95	19.06%
2	03国开 03	90,000,000.00	10.04%
3	04国开 01	50,124,500.00	5.59%
4	03进出口 01	50,000,000.00	5.58%
5	05国开 20	49,970,000.00	5.57%

(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,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

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

项　目	金　额
交易保证金	541,772.12
应收证券清算款	6,590,900.43
应收利息	9,974,403.85
应收申购款	1,807,505.87
合　计	18,914,582.27

4、期末持有处于转股期的可转换债券

债券代码	债券名称	市　值	市值占净值比	数　量
100795	国电转债	19,961,300.80	2.23%	180,940

5、权证投资情况: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)
2002.9.20-2002.12.31	0.50%	0.0006	-4.18%	0.0030	4.68%	-0.0024
2003年	7.10%	0.0025	1.24%	0.0031	5.86%	-0.0006
2004年	1.09%	0.0042	-8.00%	0.0040	9.09%	0.0002
2005年	10.47%	0.0035	8.65%	0.0036	1.82%	-0.0001
2006.1.1-2006.6.30	16.28%	0.0061	10.48%	0.0037	5.80%	0.0024
自基金成立起至今	48.55%	0.0039	9.88%	0.0035	38.67%	0.0004

十三、基金费用概览

(一)与基金运作有关的费用

1、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) 证券交易费用;(4) 基金信息披露费用;(5) 基金持有人大会费用;(6) 与基金相关的会计师费和律师费;(7)按照国家有关规定可以列入的其他费用。

2、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

在通常情况下,基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.75%的年费率计算,具体计算方法如下:

H=E×0.75%÷365

H 为每日应付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

本基金应给付基金托管人托管费, 按前一日的基金资产净值的 1.75‰的年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.75‰÷365

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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(一)中 3 到 7 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

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资产的损失,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

其他具体不列入基金费用的项目依据中国证监会有关规定执行。

4、基金管理人和基金托管人可磋商酌情降低基金管理费、基金托管费,下调前述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 3 个工作日在至少一种指定报刊和网站上刊登公告。

(二)与基金销售有关的费用

1、认购费

本基金的认购费率随认购金额的增加而递减,如下表所示:

认购金额(M)	认购费率
M<100 万	0.8%
100万≤M<1000 万	0.5%
M≥1000 万	0.3%

2、申购费

本基金的申购费率和认购费率相同,申购费率随申购金额的增加而递减。

3、赎回费

赎回费率为 0.3%。赎回费在扣除手续费后,余额不得低于赎回费总额的百分之二十五,并应当归入基金财产。

4、转换费

基金管理人已经开通了本基金与南方稳健成长基金、南方现金增利基金的转换,具体内容详见 2005 年 9 月 20 日发布的《南方基金管理有限公司关于开通南方现金增利基金转换业务及调整旗下基金转换业务规则的公告》。

5、本基金的实际执行费率由基金管理人在基金合同规定的范围内调整。本基金的申购费率和赎回费率在更新的招募说明书中列示。基金管理人认为需要调整费率时,必须于新的费率开始实施日前的三个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上刊登公告。

(三)其他费用

本基金其他费用根据相关法律法规执行。

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,对本基金的招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

1.在“3、基金管理人”部分,对公司联系人、高级管理人员及投资决策委员会成员、基金经理及基金管理人内部控制制度等进行了更新。

2.在“4、基金托管人”部分,对托管人的主要人员情况及基金托管业务经营情况等进行更新。

3.在“5、相关服务机构”部分,对代销机构情况进行了部分更新。

4. 在“8、基金的投资”部分,补充了本基金最近一期投资组合报告的内容。

5.在“9、基金的业绩”这一章节,补充说明基金合同生效以来的投资业绩。

6. 在“21、其他应披露的事项”部分,对其他应披露的事项进行了更新。

7.对部分表述进行了更新。

南方基金管理有限公司

2006 年 11 月 4 日

证券代码:600638　股票简称:新黄浦　编号:临 2006-026

上海新黄浦置业股份有限公司董事会公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整,对公告的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏负连带责任。

关于公司收购北京广安世纪物业管理有限公司、租赁经营百花集团物业事项的后续进展情况公告如下:

一、公司于 2006 年 9 月 19 日召开第五届十三次董事会,会议审议通过了“关于收购北京广安世纪物业管理有限公司的议案:本公司以承债方式收购北京广安世纪物业管理有限公司 100%股权,从而取得北京大都市街南一楼 16034.14 平方米物业资产和南八楼 16728.46 平方米物业资产的所有权。其中本公司受让广安世纪公司 96%的股权,由本公司控股子公司管理公司受让广安世纪公司 4%的股权。该物业的房产证号:南一楼:京房权证崇股字第 00241 号,南八楼:京房权证崇股字 00188 号,物业的土地用途为商业、办公,使用期限(自 2001 年 8 月始)商业 40 年,办公 50 年。”

广安世纪公司已于 9 月底获取该物业的土地使用证, 南一楼土地证:京崇国用(2006)0035 号,南八楼土地证:京崇国用(2006)0036 号。同时,广安世纪公司股权变更登记注册手续已经工商管理部门办理完毕。

公告内容详见 2006 年 9 月 23 日的《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》,及上海证券交易所网站 http://www.sse.com.cn。

二、公司于 2005 年 11 月 23 日经公司五届六次董事会审议通过的“关于本公司租赁经营百花集团拥有的北京市海淀区中关村南大街 11 号院建筑面积为 30564.1㎡的房屋及其附属范围内的 17164.38㎡土地使用权。租赁期为二十年,租金总额为 20000 万元。”的议案,详见 2005 年 12 月 10 日的《上海证券报》、《中国证券报》, 及上海证券交易所网站 http://www.sse.com.cn。

根据公司与百花集团于 2005 年 11 月 23 日签署《房屋租赁合同》中的条款约定:百花集团应将该租赁物向有关登记机关申办抵押登记手续。百花集团已在 2005 年底在房屋管理部门办理了租赁登记手续, 领取了北京市海淀区建设委员会同意备案的《北京市房屋租赁(转租)登记备案表》(备案号为海淀(2005)第 0017 号)。由于北京市土地房屋管理部门的有关规定,不受理企业间办理房屋产权抵押登记手续,只受理银行办理房产抵押登记手续。因此,百花集团虽然已在 2005 年 12 月 30 日到房屋管理部门办理完毕房屋租赁登记手续,但至今仍无法办理租赁物抵押登记手续。

依据《北京市城市房地产转让管理办法》第十五条规定,“转让已出租的房地产的,受让人应当继续履行原租赁合同。但房地产出租前已依法抵押,为实现该抵押权转让房地产的,受让人不承担继续履行原租赁合同的义务。”《城市房地产抵押管理办法》第二十一条规定,“以已出租的房地产抵押的,抵押人应当将租赁情况告知抵押权人,并将抵押情况告知承租人。原租赁合同继续有效。”由此可见,即使公司承租的房产发生转让、抵押等情况,也不影响公司承租权力的履行。

百花集团承诺,在没有办理房产抵押登记手续的情况下,百花集团仍会严格履行《房屋租赁合同》规定的义务,确保公司承租权益有效行使。

特此公告。

上海新黄浦置业股份有限公司董事会

二〇〇六年十一月三日

证券代码:600638　股票简称:新黄浦　编号:临 2006-027

上海新黄浦置业股份有限公司董事会澄清公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整,对公告的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏负连带责任。

关于就近日《证券市场周刊》刊登《新黄浦:溢价 99 倍收购北京广安世纪的玄机》文章,公司将有关事项澄清如下:

一、公司在 2006 年 9 月 23 日公告收购北京广安世纪事项时, 公告了《关于收购北京广安世纪物业管理有限公司暨购买北京大都市街南一、八楼的分析报告》及附件《北京大都市街南一、八楼未来 20 年收入预测表》。根据该预测表, 公司预计南一楼、南八楼的租金收入 2006 年为 3250 万元,2007 年为 4048 万元,2008 年为 4250 万元,2009 年为 4520 万元, 相应的租金收益率分别为 5.92%、7.36%、7.73%、8.22%。作为一个投资性房地产项目,其收益不仅来源于租金收益,还来源于长期升值收益。

为了准确地反应今年及今后几年的南一楼、南八楼的经营情况,公司预测了在不考虑财务费用情况下的南一楼、南八楼经营情况。公司在公告中明确指出,在不考虑财务费用的情况下,预计 2006 年、2007 年、2008 年税前利润分别为 1351 万元、2696 万元、2797 万元。如果我们要获得包括财务费用情况下的税前利润,则可根据假设的各年度财务费用来进行简单计算也是较粗略的。因此不存在误导投资者的问题,也不存在“新黄浦关于广安世纪的盈利预测是经不起推敲的”问题。

根据《企业会计准则第 3 号——投资性房地产》的相关规定,自 2007 年 1 月 1 日开始,“采取公允价值计量的,不对投资性房地产计提折旧或进行摊销, 应当以资产负债表日投资性房地产的公允价值为基础调整其账面价值,公允价值与原帐面价值之间的差额计入当期损益。”公司通过收购广安世纪而间接收购的南一楼和南八楼,作为投资性房地产,拟采取公允价值计量,故按准则不再计提折旧,这样的处理应该不存在“虚增利润的嫌疑”。

二、公司已按规则详细披露了北京广安世纪的股东背景情况,并指出广安世纪公司与公司不存在关联关系。广安世纪公司的股东为北京中企天经济技术开发有限公司 (占 55.56%), 上海京泰经济发展有限公司 (占 44.44%)。中企天公司 93.05%的股权由南宁新广联农业科技发展公司持有,其余 6.95%股权为自然人吕红结、李骞、苏志刚所持有;南宁新广联农业科技发展公司为集体企业。京泰公司的股东为北京中企天经济技术开发有限公司(持有 70%股份)和自然人凌永兴(持有 30%股份)。

《周刊》则对此提出质疑,称北京广安世纪与新黄浦并非“不构成关联交易”。其理由为 S 南控股(000716)2000 年 7 月 3 日的一则公告。该公告显示,南宁新广联为广联(南宁)投资股份有限公司的关联方,广联投资正是新黄浦第一大股东上海新华闻投资有限公司的股东。

为弄清南宁新广联是否与广联