南方多利中短期债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

重要提示

本基金经中国证监会 2006 年 2 月 21 日证监基金字[2006]29 号文核准募集。

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。

投资有风险,投资者认购(或申购)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。

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。

本基金为中短期债券投资基金。中短期债券投资基金不等于货币市场基金。

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 2007 年 3 月 31 日,有关财务数据和净值表现截止日 2007 年 3 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: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

本基金历任基金经理为:2006 年 3 月至今,刘情剑、高峰。

刘情剑先生,1961 年生,中共党员,南开大学经济学硕士,注册会计师,1981 年参加工作,曾任职海南汇通国际信托投资公司、国泰君安证券股份有限公司。2003 年 5 月起就职南方基金管理有限公司,现任公司总经理助理兼固定收益部总监兼南方现金增利基金基金经理。具有基金从业资格。

高峰先生,1972 年生,复旦大学理学博士。1998 年参加工作,曾任职上海大学、美国 SAS 软件研究所上海公司。2002 年 3 月起就职南方基金管理有限公司,现任南方基金管理公司南方宝元债券型基金基金助理。具有基金从业资格。

刘情剑先生曾经担任过下列基金的基金经理:2005 年 3 月至 2006 年 1 月, 南方现金增利基金;2006 年 3 月至今,南方多利中短债基金。刘情剑先生和高峰先生目前未兼任其他基金的基金经理。

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。

6、上述人员之间不纯在近亲属关系。

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:010-66106912
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 12 月,托管证券投资基金 73 只,其中封闭式 16 只,开放式 57 只。托管资产规模年均递增超过 70%。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、履约类产品等十一大类 16 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

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)82912936
传真:(0755)82913232
联系人:汤艺娜

2、代销机构

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
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)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、汪小苗、乔勇
客户服务电话:95501

(4)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:0755-83195487
传真:0755-83195049

(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

(6)深圳市商业银行
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:0755-25879127
传真:0755-25878304
联系人:罗秀云

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:张小波
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: 童婕
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:张治国
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;曹晔

(18)中信万通证券有限责任公司
注册地址:青岛市东海路 28 号
法定代表人:史洁民
联系电话:0532-5023457
联系人:丁韶燕

(19)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

(20)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:曾洋
客户服务热线:020-87320991、020-87320595

(21)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

(22)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

(23)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

(24)平安证券有限责任公司
办公地址:深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦三楼
法定代表人:叶黎成
联 系 人:余江 庄维佳
电话:0755-82450826,22622287
传真:0755-82433794
全国统一客户服务热线:95511
公司网址:www.pa18.com

(25)华安证券有限责任公司
办公地址:安徽省合肥市阜南路 166 号
法定代表人:汪永平
联系人:唐泳
电话:0551-5161666
公司网址:www.huaans.com.cn

(26)中原证券有限责任公司
注册地址:郑州市经三路 15 号广汇国贸大厦 10 楼
办公地址:郑州市经三路 15 号广汇国贸大厦 10 楼
法定代表人:张建刚
联系人:陈利民
电话:0371-5585610
网址:www.ccnew.com.cn

(27)国都证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区华强北路赛格广场 45 层
办公地址:北京市东城区安外大街 2 号安贞大厦 3 层
法定代表人:王少华
业务联系人:马泽承
联系电话:010-64482828-390
客户服务热线:800-810-8809
公司网站:http://www.guodu.com

(28)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

(29)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:童怡腾
电话:0769-82119353
公司网址:www.dgzq.com.cn

(30)国元证券有限责任公司
注册地址:安徽省合肥市寿春路 179 号
联系人:李蔡
电话: 0551-2634400-1112
客服电话: 4008-888-777
公司网址:www.gyzq.com.cn

(31)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
法定代表人:刘学民
联系人:杨柳
电话:0755-25832686
公司网址: www.firstcapital.com.cn

(32)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:010-85252626
联系人: 杨甦华
客服电话: 0371-7639999
公司网址:www.mszq.com.cn

(33)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:万齐志
公司网址:www.gsstock.com

(34)金通证券有限责任公司
注册地址:浙江省杭州市凤起路 108 号
法定代表人:应士歌
联系人:龚小军
公司网址:www.bigsun.com.cn

(35)国联证券有限责任公司
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:0510-2588168
公司网址:www.glsc.com.cn

(36)东北证券有限责任公司
注册地址:长春市人民大街 138-1 号
法定代表人:李书
联系人:高新宇
联系电话:0431-5069710
公司网址: www.nesc.cn

(37)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

(38)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

(39)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
公司网站: www.csc108.com
联系人:权唐

(40)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

(41)上海证券有限责任公司
注册地址:上海市九江路 111 号
法定代表人:蒋元真
联系电话:021-65076608*557
传真:021-65081069
联系人:刘永
网址:http://www.962518.com

(42)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
网址:www.westsecu.com.cn

(43)东海证券有限责任公司
地址:上海市浦东新区东方路 989 号中达广场 13 楼
法定代表人:顾森贤
电话:021-50586660
传真:021-50586660-8880
联系人:邵一明
网址:http://www.longone.com.cn

(44)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

(45)国海证券有限责任公司
办公地址:中国广西南宁市滨湖路 46 号
联系人:覃清芳
开放式基金咨询电话:(0771)96100、0771-5539262
开放式基金业务传真:(0771)5539033
公司网站:国海证券网 http://www.ghzq.com.cn

(46)齐鲁证券
联系人:傅咏梅
电话:0531-82024184
公司网址: www.qlzq.com.cn

(47)新时代证券有限责任公司
注册地址:北京市海淀区成府路 298 号方正大厦二层
办公地址:北京市西城区麟阁路 95 号尚信大厦 6、7 层
法定代表人:李文义
联系人:戴荻
电话:010-66423531
公司网站:http://www.xsdzq.cn

(48) 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::http://www.scstock..com/

(49)大同证券有限责任公司
联系人:吴守洲
公司网址: www.dtsbc.com.cn

(50)华林证券有限责任公司
注册地址:广东省江门市港口路 1 号
法定代表人:高洪星
联系人: 杨玲
联系电话: 0755-83749454
客服电话: 0755-83749248
公司网址: www.chinalions.com

(49)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

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

南方多利中短期债券投资基金

五、基金的类型

契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金属于高信用等级债券基金,投资目标是在债券稳定收益的基础上通过积极投资获取高于投资基准的收益。

七、基金的投资方向

本基金投资范围为固定收益类金融工具,具体包括国债、央行票据、金融债、信用等级为投资级的企业债、债券回购、银行存款、大额存单以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具。

上述个券剩余期限控制在 7 年以内(含 7 年)。组合平均剩余年限在每个交易日均控制在 3 年以内(含 3 年)。

八、投资策略

总体而言,我们采用自上而下的债券投资策略。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。

九、业绩比较基准

本基金业绩比较基准为两年期定期存款利率(税后)。

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

本基金为高信用等级的债券基金,组合平均剩余年限在每个交易日均控制在 3 年以内(含 3 年),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,风险低于中期债券基金。

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 2007 年 4 月 16 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。

本投资组合报告所载数据截至 2007 年 3 月 31 日(未经审计)。

(一)期末基金资产组合情况

项　　目	金　额	占基金总资产的比例
债券投资	1,405,564,817.37	95.77%
银行存款和清算备付金合计	14,734,393.60	1.00%
其他资产	47,428,926.84	3.23%
合计	1,467,728,137.81	100.00%

(二)期末按券种分类的债券投资组合

债券类别	金　额	占基金净值比例
国家债券	401,946,478.60	39.20%
金融债券	607,988,860.95	59.29%
央行票据	147,772,603.00	14.41%
企业债券	99,058,162.68	9.66%
资产支持证券	148,798,712.14	14.51%
合计	1,405,564,817.37	137.07%

(三)基金投资前五名债券明细

序号	债券名称	金　额	占基金净值比例
1	06农发 10	348,451,776.15	33.98%
2	06农发 05	168,951,946.74	16.48%
3	20国债⑷	163,278,529.40	15.92%
4	06央票 76	147,772,603.00	14.41%
5	21国债⑿	139,730,720.30	13.63%

(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,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

2、期末其他资产构成

项　目	金　额
应收证券交易清算款	19,998,112.50
应收利息	21,722,626.98
其他应收款	25,000.00
应收申购款	5,683,187.36
合　计	47,428,926.84

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过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

序号	代码	名称	数　量	金　额	占净值比例
1	119002	澜 电 01	660,000	65,772,315.09	6.41%
2	119003	澜 电 02	330,000	32,993,121.52	3.22%
3	119005	浦建收益	200,000	20,000,000.00	1.95%
4	119006	宁建 01	300,000	30,033,275.53	2.93%

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）
2006.3.27-2006.12.31	1.98%	0.04%	1.76%	0.00%	0.22%	0.04%
2007.1.1-2007.3.31	0.76%	0.07%	0.61%	0.01%	0.15%	0.06%
自基金成立起至今	2.75%	0.05%	2.37%	0.01%	0.38%	0.04%

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) 基金信息披露费用; (5)与基金相关的会计师费和律师费; (6) 基金持有人大会费用; (7)基金的证券交易费用; (8) 按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

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 0.45%的年费率计算,计算方法如下:

H=E×0.45%÷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

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,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 0.15%的年费率计算,计算方法如下:

H=E×0.15%÷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

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

(3)上述一、基金费用的种类中第 4-8 项费用由基金托管人根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,从基金财产中支付。

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、认购费

本基金的认购费率为 0。

2、申购费

本基金的申购费率为 0。

3、赎回费

本基金的赎回费率为 0。

4、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×0.3%÷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

持续销售费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送持续销售费划款指令,基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。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。

5、转换费

为方便基金份额持有人,未来在各项技术条件和准备完备的情况下,投资者可以选择在本基金和本基金管理人管理的其他基金之间进行基金转换。基金转换的数额限制、转换费率等具体规定可以由基金管理人届时另行规定并公告。

6、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第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,对本基金的原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“基金经理”进行了更新。增加了本基金历任基金经理信息及任期时间,增加了本基金经理同时兼任其他基金的情况和兼任年限。

2、在“4、基金托管人”部分,对“基金托管人概况”进行了更新,将注册资本更新为人民币 334,018,850,026 元。

3、在“5、相关服务机构”部分,对代销机构的情况进行了更新。

4、在“7、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“(八)、基金的业绩”部分,对基金的业绩进行了更新。

6、对“19、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

证券简称:伊力特　股票代码:600197　临:2007-008

新疆伊力特实业股份有限公司
第三届第九次董事会决议公告

2007年 4 月 26 日,公司发出以通讯方式召开董事会第三届第九次会议的通知,截止 2007 年 5 月 6 日,应参加表决的董事 8 人,实际参加表决的董事 8 人,有效表决票共计 8 张,符合《公司法》和《公司章程》的有关规定,会议审议通过了以下决议:关于组建新疆伊力特煤化工有限责任公司的议案。

公司与新疆生产建设兵团农四师七十一团共同出资设立新疆伊力特煤化工有限责任公司(以下简称“伊力特煤化工公司”,最终以工商行政管理部门核准的名称为准),该公司主要从事 60 万吨矿井改造的开发建设。根据公司与七十一团签订的协议,伊力特煤化工公司注册资本金为 5,000 万元人民币,其中七十一团投资货币资金 2,450 万元,占总股本的 49%;本公司投资货币资金 2,550 万元,占总股本的 51%。为维持七十一团在项目建设期间经济的正常运转,在伊力特煤化工公司建设 60 万吨矿井改造项目期间,七十一团原焦化厂的煤焦炉和两对煤矿井仍属七十一团经营管理,经营所得归七十一团。60 万吨矿井改造完成后,为便于资源综合利用和经营管理,七十一团将原焦化厂的煤焦炉和两对煤矿井及生产经营性设备经中介机构评估确认后的价值,投资入股到伊力特煤化工公司,本公司按照股本比例投入相应货币资金,双方增资后所占股份比例保持不变。公司投资该项目可创造较好的经济效益和社会效益,符合公司的发展战略,有利于公司的长远发展。

新疆伊力特实业股份有限公司
董 事 会
二零零七年五月六日

富国基金管理有限公司增加上海证券有限责任公司为富国天博基金代销机构的公告

根据富国基金管理有限公司与上海证券有限责任公司(以下简称“上海证券”)签署的销售代理补充协议,2007 年 5 月 11 日起,上海证券开始代理销售富国基金管理公司旗下富国天博创新主题股票型证券投资基金。

即日起,投资者可在上海证券公司各网点办理相关基金的开户、申购和赎回等业务。投资者也可以通过以下途径咨询有关情况:

上海证券网站:www.962518.com

上海证券咨询电话:962518

特此公告

富国基金管理有限公司
二00七年五月十一日

长盛基金管理有限公司
关于长盛动态精选证券投资基金
暂停申购和转换转入业务的公告

鉴于长盛基金管理有限公司(以下简称“本公司”)管理的长盛动态精选证券投资基金(以下简称“长盛动态精选基金”)持有的部分股票处于股权分置改革完成并即将复牌阶段,预计对基金份额净值的影响较大,为切实保护现有基金份额持有人利益,本公司决定自 2007 年 5 月 14 日起,暂停长盛动态精选基金的申购和转换转入业务。

恢复长盛动态精选基金的正常申购和转换转入业务的时间,本公司将另行公告。

在暂停长盛动态精选基金的申购及转换转入业务期间,赎回及转出业务正常进行。请基金份额持有人关注在基金资产净值可能被低估的原因未消除之前赎回基金份额可能导致部分损失的风险。

投资者可以登录本公司网站(www.csfunds.com.cn)或拨打客户服务电话:400-888-2666 咨询基金相关信息。

特此公告。

长盛基金管理有限公司
2007年 5 月 11 日