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:2008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。

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2008年2月28日,有关财务数据和净值表现截止日2007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,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。

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,现任厦门国际信托有限公司厦门国际信托投资有限公司董事长兼总经理。

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(其资格已提交监管部门审核),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。

王金洲先生,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。

郭文魁女士,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。

周显民先生,监事,工学硕士、工商管理硕士,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。

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。

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:2007年8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,复旦大学经学博士。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,现任南方多利增强债券型基金和南方宝元债券型基金基金经理,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2007年8月,南方多利中短债基金。高峰先生曾经担任过下列基金的基金经理:2006年3月至2007年8月,南方多利中短债基金。

刘情剑先生目前未兼任其他基金的基金经理。高峰先生目前兼任南方宝元债券型基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

总经理高良玉先生、固定收益部总监刘情剑先生、养老金业务部总监郑文祥先生。

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

截至2007年12月末,中国工商银行资产托管部共有员工98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2007年12月,托管证券投资基金82只,其中封闭式11只,开放式71只。托管资产规模年均递增超过90%。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。继先后获得《亚洲货币》和《全球托管人》评选的"2004年度中国最佳托管银行"称号、《财资》和《全球托管人》评选的"2005年度中国最佳托管银行"称号后,中国工商银行又分别摘取《环球金融》、《财资》杂志"2006年度中国最佳托管银行"桂冠。

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:汤艺娜

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

住所: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)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:蒋超良

电话:(021)58781234

传真:(021)58408842

联系人:曹榕

网址:www.bankcomm.com

(5)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

(6)中国民生银行股份有限公司

注册地址:北京市东城区正义路4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、吴海鹏

公司网站:www.cmbc.com.cn

(7)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

(8)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:020-38323704、38322730、38323206

传真:020-87311780

联系人:江璐、罗环宇

(9)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

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

(10)深圳发展银行

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

(11)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

(12)深圳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

代销券商:

(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、张小波

客户咨询电话:025-84579897

网址:www.htsc.com.cn

(2)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:上海市陆家嘴东路166号中保大厦

法定代表人:兰荣

联系人:杨盛芳

电话:021-68419974

客户服务电话:021-68419393-1259

网址:www.xyzq.com.cn

(3)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

(4)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:4008888666

联系人:芮敏祺

网址:www.gtja.com

(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:4008888555

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

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

(8)国信证券有限责任公司

注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦

法定代表人:何如

联系人:林建阁

电话:0755-82130833

客户服务电话:800-810-8868

网址:www.guosen.com.cn

(9)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

开放式基金咨询电话:4008888108

公司网站:www.csc108.com

联系人:魏明

(10)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

(11)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

(12)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

(13)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、4008888111

(14)中信证券股份有限公司

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

(15)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

(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:刘军

开放式基金咨询电话:0571-96598

开放式基金业务传真:0571-85783771

联系人:龚晓军

联系电话:0571-85783750

公司网址:www.96598.com.cn

(17)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

联系人:王兆权

电话:022-28451861

客户服务电话:022-28455588

网址:www.bhzq.com

(18)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

(19)光大证券有限责任公司

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:上海市浦东新区浦电路438号双鸽大厦6楼

法定代表人:王明权

电话:(021)68768800

传真:(021)68817271

联系人:刘晨

客户服务热线:10108998

公司网址:www.ebscn.com

(20)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:蒋春阳

公司网址:www.njzq.com.cn

(21)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:史法民

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

(22)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

网址:www.nesc.cn

(23)财通证券经纪有限责任公司

注册地址:杭州市解放路111号

法人代表:陈海晓

业务联系电话:0571-87925129

传真:0571-87925129

联系人:乔骏

客服电话:0571-96336

网址:www.ctsec.com

(24)山西证券有限责任公司

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

(25)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:0510-82588168

公司网址:www.glsc.com.cn

(26)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

(27)安信证券股份有限公司

注册地址:深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层、28层A02单元

办公地址:深圳市深南大道2028号中国凤凰大厦1号楼7层

法定代表人:牛冠兴

联系人:吴跃辉

电话:0755-82558332

客户服务电话:0755-82825555

网址:http://www.axzq.com.cn

(28)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

(29)万联证券有限责任公司

注册地址:广州市东山区东风东路836号东峻广场34-35层

办公地址:广州市中山二路18号广东电信广场37层

法人代表:李勍金

联系人:李俊

联系电话:020-37865026

客服电话:020-37865009

网址:www.wlzq.com.cn

(30)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

(31)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:4008888818

公司网址:www.hx168.com.cn

(32)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

(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:4008888100(全国)、96100(广西)

网址:http://www.ghzq.com.cn

(34)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

咨询电话:0371-967218

传真:0371-65585670

联系人:陈利民　程月艳

联系电话:0371-65585670

(35)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

(36)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

(37)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:上海市浦东新区浦东南路588号浦发大厦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:4008888128

公司网址:www.tebon.com.cn

(38)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

(39)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:唐冰

电话:0551-5161666

公司网址:www.huaans.com.cn

(40)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:0755-83749624

客服电话:0755-83749248

公司网址:www.chinalions.com

(41)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

(42)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:4006198888

公司网址:www.mszq.com.cn

(43)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

(44)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

(45)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

联系电话:021-63219781

服务热线:4008-888-999

传真:021-33130730

联系人:李良

公司网址:www.95579.com

(46)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:戴获

电话:010-68084591

传真:010-68084986

公司网站:www.xsdzq.cn

(47)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

法定代表人:吴永敏

电话:0512-65581136

传真:0512-65588021

联系人:方晓丹

客户服务电话:0512-96288

网址:www.dwzq.com.cn

(48)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

(49)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

通讯地址:深圳市深南大道4001号时代金融中心17楼

法定代表人:陆涛

电话:0755-83025666

传真:0755-83025625

联系人:金春

客户服务热线:4008-888-228

公司网址:http://www.jyzq.cn

(50)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

(51)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:同上

法定代表人:陈歌达

联系人:袁月

电话:0755-22627802

客户服务电话:95511

网址:pa18.com.cn

(52)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

(53)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

(54)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

(55)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

(56)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:021-65081063

联系人:谢秀峰

公司网址:http://www.962518.com

客服电话:021-962518

(57)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

(58)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)63863388

传真:(021)63863300

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2008年1月15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。

本投告财务资料有关财务数据和净值表现截止日2007年12月31日(未经审计)。

1、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	122,767,730.33	7.23%
债券	1,398,044,808.23	82.29%
权证	6,609,083.55	0.39%
银行存款及清算备付金合计	96,144,852.32	5.66%
其他资产	75,369,975.63	4.43%
合计	1,698,936,450.06	100.00%

2、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	47,971,858.32	2.83%
C 制造业	2,206,369.06	0.13%
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	1,571,570.98	0.09%
C6 金属、非金属	95,610.00	0.01%
C7 机械、设备、仪表	539,188.08	0.03%
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	7,094,461.44	0.42%
E 建筑业	33,607,859.34	1.98%
F 交通运输、仓储业	——	——
G 信息技术业	2,324,162.99	0.14%
H 批发和零售贸易	849,439.41	0.05%
I 金融、保险业	27,635,751.00	1.63%
J 房地产业	——	——
K 社会服务业	1,077,828.77	0.06%