

南方高增长证券投资基金招募说明书(更新)摘要

(上接 C54 版)

行业分类	市值	占基金资产净值比例
A 农林牧渔业	0.00	0.00%
B 采掘业	854,937,510.20	15.46%
C 制造业	2,085,943,170.27	37.30%
C0 食品、饮料	292,463,316.90	5.23%
C1 纺织、服装、皮毛	0.00	0.00%
C2 木材、家具	30,295,672.00	0.54%
C3 造纸、印刷	0.00	0.00%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	196,426,269.96	3.51%
C5 电子	54,394,000.00	0.97%
C9 金属、非金属	854,807,223.70	15.29%
C7 机械、设备、仪表	583,446,901.58	10.42%
C8 医药、生物制品	46,391,543.04	0.83%
C99 其他制造业	27,818,242.59	0.50%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	0.00	0.00%
E 建筑业	136,227,004.80	2.26%
F 交通运输、仓储业	110,784,823.56	1.98%
G 信息技术业	0.00	0.00%
H 批发和零售贸易	304,670,035.68	5.45%
I 金融、保险业	1,029,683,532.98	18.41%
J 房地产业	327,503,697.56	5.85%
K 社会服务业	0.00	0.00%
L 传媒与文化产业	50,581,132.46	0.90%
M 综合类	0.00	0.00%
合计	4,859,400,906.60	87.61%

(三) 报告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	市值占基金资产净值比例
1	600036	招商银行	16,671,316	300,442,230.72	6.88%
2	600739	辽宁成大	9,055,739	294,944,556.76	4.02%
3	600000	浦发银行	9,950,916	218,920,152.00	3.91%
4	600150	中国船舶	2,749,919	207,811,378.83	3.72%
5	600960	福耀玻璃	30,000,000	189,900,000.00	3.40%
6	600619	贵州茅台	1,306,815	181,098,422.70	3.24%
7	601318	中国平安	3,589,783	177,325,310.58	3.17%
8	600019	宝钢股份	20,057,233	174,698,489.43	3.12%
9	000002	万科 A	17,681,325	159,308,738.25	2.85%
10	000041	深鸿基	12,694,284	154,943,960.30	2.77%

(四) 报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券品种	市值	市值占基金资产净值比例
1	国债	--	--
2	金融债	--	--
3	央行票据	472,581,000.00	8.45%
4	企业债	26,806,061.00	0.48%
5	可转债	--	--
6	其他	--	--
合计		499,387,061.00	8.93%

(上接 C53 版)

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例%
1	000033	神州数码	16,588,916	546,612,025.00	4.75
2	600036	招商银行	21,018,476	492,252,707.92	4.29
3	000069	华侨城 A	47,516,882	480,356,373.72	4.18
4	600000	浦发银行	19,008,021	418,176,462.00	3.64
5	600000	上海机场	21,018,400	332,511,088.00	2.89
6	600739	辽宁成大	24,324,233	297,512,434.06	2.60
7	600569	安阳钢铁	58,379,906	284,893,936.40	2.48
8	000063	中兴通讯	4,071,909	254,901,503.40	2.22
9	601388	工商银行	50,000,000	248,000,000.00	2.16
10	002024	苏宁电器	5,480,730	236,354,140.00	1.97

4、截至 2008 年 6 月 30 日按券种分类的债券投资组合

序号	债券品种	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例%
1	国债	0.00	0.00
2	金融债	772,058,000.00	6.72
3	企业债	122,801,088.00	1.07
4	可转换债券	1,124,230.40	0.01
合计		896,010,318.40	7.80

5、截至 2008 年 6 月 30 日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	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例%
1	07 央行票 91	397,300,000.00	3.37
2	08 石化债	197,901,606.20	0.94
3	08 央行票 46	56,089,000.00	0.84
4	08 央行票 49	56,089,000.00	0.84
5	08 央行票 73	56,089,000.00	0.84

6、投资组合报告附注

(1) 报告期内本基金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、处罚的股票。

(2) 报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

(3) 其他资产构成

其他资产明细	金额(元)
交易保证金	5,426,704.73
应收利息	15,311,943.31
应收申购款	10,073,440.73
应收证券清算款	889,096,623.96
合计	919,907,722.72

(4) 本报告期末本基金没有持有处于转股期的可转换债券,也没有投资资产支持证券。

(7) 本基金权证投资情况及截至 2008 年 6 月 30 日本基金持有权证情况

权证名称	本报告期末买入权证数量(元)	本报告期末卖出权证数量(元)	本报告期末持有权证数量(元)	本报告期末持有权证市值(元)	本报告期末持有权证市值占基金资产净值比例(%)
石化 CWB1	0.00	14,286,166	33,303,632.53	31,594,589.92	0.00
上海 CWB1	0.00	1,106,343	1,647,110.46	1,676,109.65	0.00
中航 CWB1	0.00	988,203	2,338,675.53	2,334,796.52	0.00
合计	0.00	16,402,712	37,289,418.52	36,006,596.39	0.00

本基金投资、持有权证的金額、比例等符合相关法律法规及中国证监会的相关规定。

十二、基金的业绩(未经审计)

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财产,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,投资人在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1、本基金基金合同生效以来的投资业绩与同期业绩的比较如下表所示(本报告中所列数据均未经审计):

(五) 报告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	市值占基金资产净值比例
1	08 央行票 28	182,562,000.00	3.26%
2	07 央行票 81	106,567,000.00	1.91%
3	07 央行票 71	97,000,000.00	1.73%
4	08 央行票 31	86,472,000.00	1.55%
5	08 央行票 68	26,806,061.00	0.48%

(六) 投资组合报告附注

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、处罚的股票。

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。

报告期末其他资产构成

项目	金额
交易保证金	6,989,280.02
应收证券清算款	43,942,150.21
应收利息	9,369,820.03
应收股利	470,963.48
其他应收款	--
应收申购款	2,029,140.54
合计	62,801,381.08

1、权证投资情况

(1) 本报告期内获得因投资分离交易的可转换债券发行人派发的权证情况。

序号	权证代码	权证名称	数量	市值	市值占基金净值比
1	580004	宝钢 CWB1	5,712,320	6,837,647.04	0.12%

(2) 本期无主动投资权证

(3) 本报告期末持有因投资分离交易的可转换债券发行人派发的权证情况。

序号	权证代码	权证名称	数量	市值	市值占基金净值比
1	580004	宝钢 CWB1	5,712,320	6,837,647.04	0.12%

2、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	市值	市值占基金资产净值比例
--	--	--	--	--

十二、基金的业绩

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,投资人在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1、净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

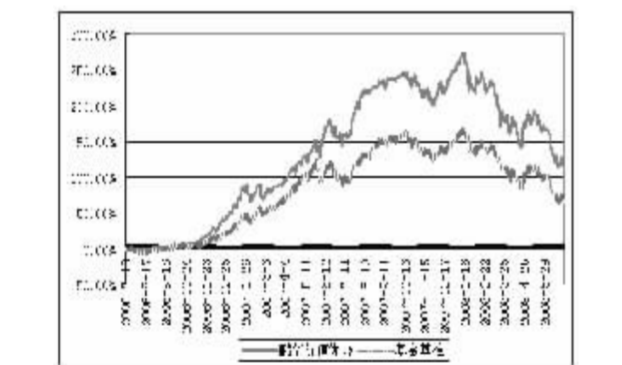
阶段	净值增长率(1)	净值增长率标准差(2)	业绩比较基准收益率(3)	业绩比较基准收益率标准差(4)	(1)-(3)	(2)-(4)
2005.7.13-2006.12.31	6.93%	0.54%	10.99%	1.00%	-4.06%	-0.46%
2006.1.1-2006.12.31	127.94%	1.41%	112.68%	1.22%	15.08%	0.19%
2007.1.1-2007.12.31	13.65%	2.03%	84.73%	1.98%	50.92%	0.95%
2008.1.1-2008.6.30	-43.76%	2.58%	-44.10%	2.61%	0.34%	-0.03%
自基金成立起至今	223.02%	1.81%	142.18%	1.78%	80.84%	0.03%

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

(2005 年 7 月 13 日至 2008 年 6 月 30 日)

成立时间	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年7月18日至2006年12月31日	49.93%	0.89%	24.09%	0.93%	25.84%	-0.04%
2007年1月1日至2007年12月31日	131.64%	1.92%	102.06%	1.59%	29.58%	0.33%
2008年1月1日至2008年6月30日	-37.70%	2.62%	-33.23%	2.17%	-4.47%	0.45%
自基金合同生效至2008年6月30日	116.38%	1.96%	67.40%	1.65%	48.98%	0.31%

2、基金合同生效以来本基金份额净值的变动情况,并与同期业绩比较基准的变动进行比较:



注 1: 本基金业绩比较基准 = 中综综指 × 70% + 中信标普国债指数 × 30%;
注 2: 本基金基金合同于 2006 年 7 月 18 日生效;
注 3: 本基金业绩截止日为 2008 年 6 月 30 日。

十三、基金的费用

(一) 与基金运作有关的费用

1、与基金运作有关的费用的种类

(1) 基金管理人的管理费;

(2) 基金托管人的托管费;

(3) 基金财产划支付的费用;

(4) 基金合同生效后的信息披露费用;

(5) 基金份额持有人大会费用;

(6) 基金合同生效后的会计师费和律师费;

(7) 基金的转换费用;

(8) 按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

上述基金费用由基金托管人根据有关法规和本基金合同约定、招募说明书等法律文件的规定,按费用的实际支出金额支付,列入当期基金费用。国家另有规定的从其规定。

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

基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月 2 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

基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

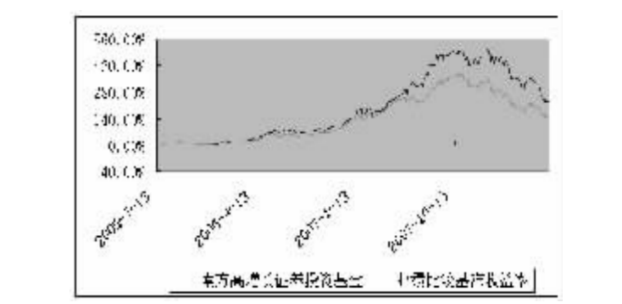
E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月 2 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

(3) 基金销售有关的费用

1、认购费

本基金的认购金额包括认购费用和净认购金额,认购费率不高于 1.2%。



注: 根据本基金合同,本基金的投资标的物包括国内依法公开发行的各类股票、债券及其他金融工具,其中股票(含可转债)的投资比例为 60%—95%。截止报告期末,本基金股票投资比例为 87.61%,符合基金合同的要求。

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) 基金的证券交易费用;(4) 基金合同生效以后的信息披露费用;(5) 基金份额持有人大会费用;(6) 基金合同生效以后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

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 1.5% 年费率计提。

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人复核后于次月 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

(2) 基金托管人的托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.25% 年费率计提。

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

(3) 本条第(一)款第 3 至第 7 项费用

由基金管理人根据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。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产中列支。

3、不列入基金费用的项目

基金管理人及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,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。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产中列支。

4、基金托管人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费,无须召开基金份额持有人大会。

(二) 与基金销售有关的费用

1、认购费

本基金的认购金额包括认购费用和净认购金额,认购费率不高于 1.2%。

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人复核后于次月 2 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

(3) 本条第 1 款第(3)至第(8)项费用由基金管理人及基金托管人根据有关法规、中国证监会的规章及相应协议的规定,按费用实际支出金额支付,列入当期基金费用。

(二) 与基金销售有关的费用

1、申购费

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等发生的各项费用。

本基金采取金额申购的方式,场外、场内的申购费率相同,具体费率如下:

申购金额(M元)	申购费率
M<50万	1.50%
50万<M<=50万	1.20%
200万<M<=500万	0.75%
500万<M<=1000万	0.50%
M>=1000万	每笔 1000元