

南方高增长证券投资基金 2006 年年度报告

基金管理人： 南方基金管理有限公司

基金托管人： 中国银行股份有限公司

送出日期：2007 年 3 月 27 日

重要提示

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。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2007 年 3 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、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。

本报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

目 录

一、基金简介	4
二、主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况	6
三、管理人报告	7
四、托管人报告	9
五、审计报告	11
六、财务会计报告	12
七、投资组合报告	25
八、基金份额持有人户数、持有人结构	30
九、开放式基金份额变动	31
十、重大事件揭示	31
十一、备查文件目录	33

第一章基金简介

（一）基金基本资料

- | | |
|-----------------|-------------------|
| 1、基金名称： | 南方高增长证券投资基金 |
| 2、基金简称： | 南方高增 |
| 3、基金交易代码： | 160106 |
| 4、基金运作方式： | 上市契约型开放式 |
| 5、基金合同生效日： | 2005 年 7 月 13 日 |
| 6、报告期末基金份额总额： | 11,712,008,124.34 |
| 7、基金合同存续期： | 无 |
| 8、基金份额上市的证券交易所： | 深圳证券交易所 |
| 9、上市日期： | 2005 年 9 月 21 日 |

（二）基金产品说明

- | | |
|-----------|---|
| 1、投资目标： | 本基金为股票基金，在适度控制风险并保持良好流动性的前提下，以具有高成长性的公司为主要投资对象，力争为投资者寻求最高的超额回报。 |
| 2、投资策略： | 作为以高增长为目标的股票基金，本基金在股票和可转债的投资中，采用“自下而上”的策略进行投资决策，以寻求超额收益。本基金选股主要依据南方基金公司建立的“南方高成长评价体系”，通过定量与定性相结合的评价方法，选择未来 2 年预期主营业务收入增长率和息税前利润增长率均超过 GDP 增长率 3 倍，且根据该体系，在全部上市公司中成长性和投资价值排名前 5% 的公司，或者是面临重大的发展机遇，具备超常规增长潜力的公司为主要投资对象，这类股票占全部股票市值的比例不低于 80%。 |
| 3、业绩比较基准： | 本基金股票投资部分的业绩比较基准采用上证综指，债券投资部分的业绩比较基准采用上证国债指数。作为股票基金，本基金的整体业绩比较基准可以表述为如下公式：
基金整体业绩基准 = 上证综指 × 90% + 上证国债指数 × 10% |
| 4、风险收益特征： | 本基金定位为股票基金，坚持积极投资、价值投资的理念，以具有高成长性的公司为主要投资对象，追求超额收益，因此属于证券投资基金中较高预期风险和较高预期收益的品种。 |

（三）基金管理人

- | | |
|-------|------------|
| 1、名称： | 南方基金管理有限公司 |
|-------|------------|

- 2、注册地址：深圳市深南大道 4009 号投资大厦 7 楼
 3、办公地址：深圳市深南大道 4009 号投资大厦 7 楼
 4、邮政编码：518048
 5、国际互联网址：www.nffund.com
 6、法定代表人：吴万善
 7、总经理：高良玉
 8、信息披露负责人：鲍文革
 9、联系电话：0755-82912000
 10、传真：0755-82912948
 11、电子邮箱：manager@nffund.com

(四) 基金托管人

- 1、名称：中国银行股份有限公司
 2、注册地址：北京西城区复兴门内大街 1 号
 3、办公地址：北京西城区复兴门内大街 1 号
 4、邮政编码：100818
 5、国际互联网址：<http://www.boc.cn>
 6、法定代表人：肖钢
 7、信息披露负责人：宁敏
 8、联系电话：010-66594977
 9、传真：010-66594942
 10、电子邮箱：tgxxpl@bank-of-china.com

(五) 信息披露

- 信息披露报纸名称：中国证券报、上海证券报、证券时报
 登载年度报告正文的管理人互联网网址：<http://www.nffund.com>

基金年度报告置备地点：基金管理人、基金托管人的办公地址

(六) 其他有关资料

- 1、聘请的会计师事务所
 名称：普华永道中天会计师事务所有限公司
 办公地址：上海湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
 2、基金注册登记机构
 名称：中国证券登记结算有限责任公司
 办公地址：北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

第二章 主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况

下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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

一、主要财务指标

序号	项目	2006 年	2005 年 07 月 13 日(基
----	----	--------	--------------------

			金合同生效日)至 2005 年 12 月 31 日止 期间
1	基金本期净收益	572,503,393.97	9,487,629.95
2	基金份额本期净收益	0.3912	0.0096
3	期末可供分配基金收益	201,055,563.36	13,698,066.66
4	期末可供分配基金份额收益	0.0172	0.0271
5	期末基金资产净值	14,587,407,750.76	539,628,299.54
6	期末基金份额净值	1.2455	1.0693
7	基金加权平均净值收益率	32.58%	0.96%
8	本期基金份额净值增长率	127.94%	6.93%
9	基金份额累计净值增长率	143.73%	6.93%

注：本基金合同生效日为 2005 年 7 月 13 日，2005 年度主要财务指标的计算期间为 2005 年 7 月 13 日至 2005 年 12 月 31 日。

二、 基金净值表现

1、本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表：

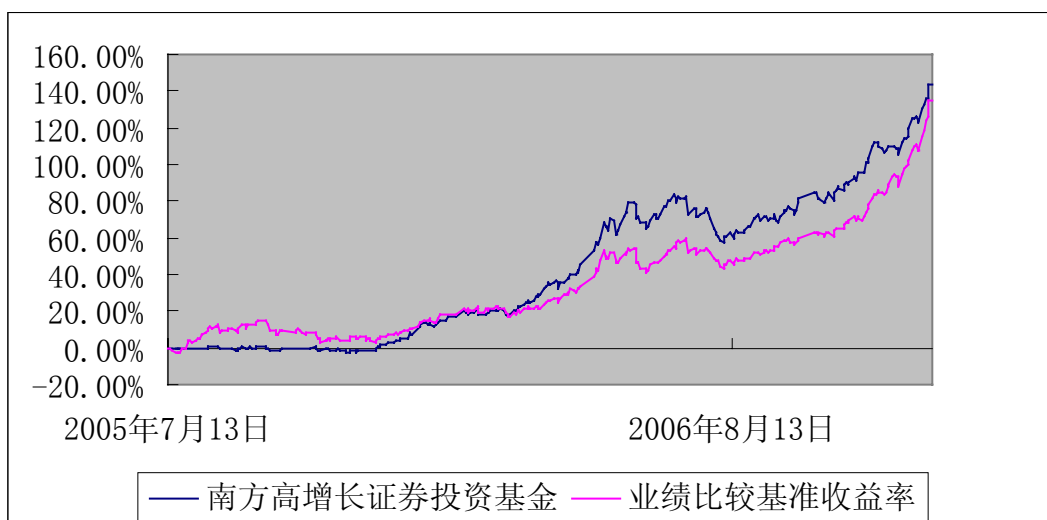
阶段	净值增长率 (1)	净值增长率 标准差 (2)	业绩比较基 准收益率 (3)	业绩比较基准收 益率标准差 (4)	(1) - (3)	(2) - (4)
过去三个月	34.25%	1.22%	46.49%	1.23%	-12.24%	-0.01%
过去六个月	35.15%	1.31%	53.05%	1.19%	-17.90%	0.12%
过去一年	127.94%	1.41%	112.86%	1.22%	15.08%	0.19%
自基金合同生效起至今	143.73%	1.20%	134.51%	1.15%	9.22%	0.05%

2、本基金合同生效以来基金份额净值变动情况，及与同期业绩比较基准的变动比较：

南方高增长证券投资基金累计份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的

历史走势对比图

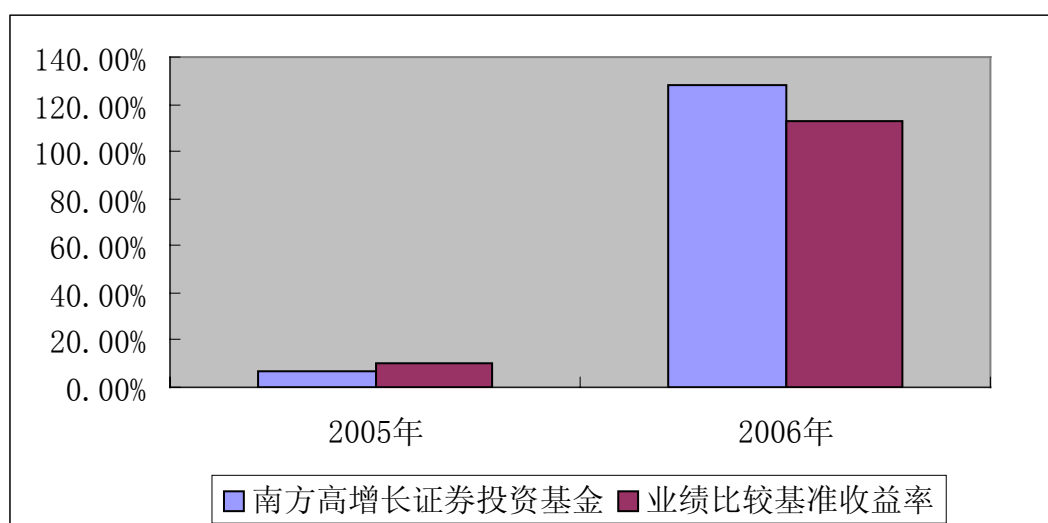
(2005 年 7 月 13 日至 2006 年 12 月 31 日)



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 83.43%，符合基金合同的要求。

3、自基金合同生效以来每年的净值增长率，及与同期业绩比较基准的收益率比较：

南方高增长证券投资基金净值增长率与业绩比较基准历史收益率的对比图



注：本基金合同生效日为 2005 年 7 月 13 日，2005 年度数据的计算期间为 2005 年 7 月 13 日至 2005 年 12 月 31 日。

三、自基金合同生效以来每年的基金收益分配情况

单位：元

年度	每 10 份基金份额分红数（至少保留三位小数）	备注
2005 年	--	本期未分红
2006 年	9.040	本期分红四次
合计	9.040	

第三章 管理人报告

第一节：基金管理人及基金经理情况

一、 基金管理人及其管理基金的经验

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。目前注册资本 15,000 万元人民币，股权结构为：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%。

截至报告期末，南方基金管理有限公司管理资产规模近 1,000 亿元，管理 4 只封闭式基金——分别为基金开元、基金天元、基金金元、基金隆元；9 只开放式基金——分别为南方稳健成长基金、南方宝元债券型基金、南方避险增值基金、南方现金增利基金、南方积极配置基金，南方高增长基金、南方多利中短债基金、南方稳健成长贰号和南方绩优成长基金；以及多只全国社会保障基金、企业年金的投资组合。

二、 基金经理或基金经理小组简介（姓名及主要经历）

吕一凡先生，基金经理，36 岁，经济学硕士，8 年证券从业经历。曾任深圳证券交易所综合研究所高级研究员。2000 年进入南方基金管理有限公司工作，先后从事研究、产品设计、基金投资等工作，历任基金开元基金经理（2003.11.17—2005.6.10）、南方稳健成长基金经理助理、基金隆元基金经理。

孙鲁闽先生，基金经理助理，32 岁，商学硕士，4 年证券从业经历。2003 年进入南方基金管理有限公司，先后从事研究、基金投资等工作。

南方高增长基金同时配有若干研究员协助基金经理进行行业分析和个股研究。

第二节：报告期内基金运作的遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《基金运作管理办法》和《证券投资基金销售管理办法》等有关法律法规及其各项实施准则、《南方高增长证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

第三节：报告期内基金投资策略和业绩表现的说明与解释

截至报告期末，本基金份额净值为 1.2455 元，本报告期份额净值增长率为 127.94%，同期业绩比较基准增长率为 112.86%。

2006 年成就了中国证券市场有史以来最大的一轮牛市。究其原因，可以归

结为经济增长、本币升值、估值偏低和制度变革四大因素。整个市场的热点也围绕着这些因素展开。

本年度是南方高增长基金的第一个完整年度，根据对前述市场驱动因素的分析，本基金在资产配置上坚持以股票持仓为主，全年的平均股票仓位维持在 90% 左右。

选股方面本基金以进入壁垒和估值水平为主要指标，重点选择有壁垒且估值低的品种，并重仓持有；在投资主题上倾向于投资人民币升值和自主创新相关公司。取得了良好的业绩，并成功在年底实现了扩募，基金规模有了质的提高。

第四节：对宏观经济、证券市场及行业走势等的简要展望

2007 年的市场运行将更为复杂。市场指数已经处于历史高点，大量优质股票的静态市盈率处于高位。在缺乏外力推动的前提下，A 股市场的未来走势将依赖于上市公司业绩的增长速度，而非象 2006 年那样有一个明显的价值回归的过程。因此，我们对 2007 年的股票市场保持清醒的认识，对于收益率的预期将比较理性。对于组合中已经存在的大量长期品种，在市场震荡过程中可能出现的滞涨有一定的心理准备。本基金将坚持过去的投资理念，积极寻找有壁垒、低估值的公司，并长期持有。

第五节：基金内部监察报告。

2006 年度，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察稽核部门按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1) 全面开展基金运作监察稽核工作，防范内幕交易，确保基金投资的独立性、公平性及合法合规

主要措施有：严格执行集中交易制度，各基金相互独立，交易指令由中央交易室统一执行完成；对控制阈值在电脑系统中进行事先设置并进行实时监控，杜绝出现违规的反向交易、交叉交易等行为；严格检查基金的投资决策、研究支持、交易过程是否符合规定的程序；通过以上措施，保证了投资遵循既定的投资决策程序与业务流程，保证了基金投资组合及个股投资符合比例控制的要求，确保了基金投资行为的独立、公平及合法合规。

(2) 完善公司各项内部管理制度，为风险管理奠定基础

本年度稽核部加强公司各项内部管理制度的制订、修订工作，对公司各业务部门的内部控制制度提出修改意见和建议，并关注制度的健全性和有效性，进一步完善了公司内控制度，达到更好地防范风险的目的。

(3) 开展反商业贿赂工作，从源头上控制销售风险

本年度，根据中国证监会和深圳证监局的要求，我公司积极开展了反商业

贿赂工作，对公司旗下基金的代销、直销业务进行了为期半年的自查自纠，涉及市场、财务、TA 各个方面，此项工作的开展，有利于更好地控制销售风险。

通过以上工作的开展，在本报告期内本基金运作过程中未发生关联交易、内幕交易，也不存在在本基金管理人管理的各基金之间的违规交叉交易，基金运作整体合法合规。在今后的工作中，本基金管理人承诺将一如既往的本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

第四章 托管人报告

本托管人依据《南方高增长证券投资基金基金合同》与《南方高增长证券投资基金托管协议》，自 2005 年 9 月 21 日起托管南方高增长证券投资基金（以下简称“本基金”）的全部资产。现根据《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号<年度报告的内容与格式>》及其他相关规定，出具本托管人报告。

1、本托管人在托管本基金期间，严格遵守《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》和其他有关法规、基金合同以及托管协议的规定，诚信地履行了基金托管人的职责，不存在损害本基金持有人利益的行为。

（1）本托管人履行安全保管基金资产的全部资产的职责，保证基金资产与自有资产等非基金资产严格分开，维护基金的独立账户，与本托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行了严格的分账管理。

（2）本基金的投资运作包括本基金在股票一级市场、股票二级市场、证券交易所债券市场以及银行间国债市场的交易等，本托管人严格根据相关法律法规、基金合同的规定执行基金管理人的投资指令，及时、准确地完成了本基金的各项资金清算交割。本托管人对于本基金的任何资产的运用、处分和分配，均具备正当依据。

（3）本托管人对与基金资产相关的重大合同原件、因履行基金托管人职责而生成或收悉的记录基金业务活动的原始凭证、记账凭证、基金账册、交易记录等有妥善的保管。

2、本托管人在 2006 年度依照《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》和其他有关法规、《南方高增长证券投资基金基金合同》及《南方高增长证券投资基金托管协议》对南方基金管理有限公司——本基金管理人的基金运作进行了必要的监督。

（1）其在基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面遵守了《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》、《证券投资基金会计核算办法》和其他有关法规、基金合同以及托管协议的规定；未发现其存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

（2）其对于基金份额的认购、申购、赎回等重要事项的安排符合基金合同等有关法律文件的规定。

（3）本托管人如实、及时、独立地向中国证监会提交了关于本基金投资运作方面的报告。

3、本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整。

中国银行股份有限公司

2007年3月22日

第五章 审计报告

审计报告

普华永道中天审字(2007)第 20201 号

南方高增长证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的南方高增长证券投资基金(以下简称“南方高增长基金”)会计报表，包括 2006 年 12 月 31 日的资产负债表、2006 年度的经营业绩表和基金净值变动表以及会计报表附注。

一、 管理层对会计报表的责任

按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《南方高增长证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制会计报表是南方高增长基金的基金管理人南方基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

- (1) 设计、实施和维护与会计报表编制相关的内部控制，以使会计报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；
- (2) 选择和运用恰当的会计政策；
- (3) 作出合理的会计估计。

二、 注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对会计报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范，计划和实施审计工作以对会计报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关会计报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的会计报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与会计报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及

评价会计报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

三、 审计意见

我们认为，上述会计报表已经按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《南方高增长证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制，在所有重大方面公允反映了南方高增长基金 2006 年 12 月 31 日的财务状况以及 2006 年度的经营成果和基金净值变动。

普华永道中天
会计师事务所有限公司

注册会计师 汪 棣

中国·上海市

注册会计师 张 立 纲

2007 年 3 月 21 日

第六章 财务会计报告

第一节：基金会计报表

一、 资产负债表

南方高增长证券投资基金 2006 年 12 月 31 日资产负债表

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

	附注	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
资产			
银行存款		1,848,648,923.63	103,250,830.12
结算备付金		12,418,056.48	3,149,533.07
交易保证金	6	638,549.15	1,114,104.60
应收证券清算款		117,914,804.25	32,297,809.88

应收利息	7	5,381,835.37	83,714.90
应收申购款		49,572,893.52	98,814.23
股票投资市值		12,170,723,501.63	434,744,896.05
其中：股票投资成本		10,212,808,695.13	405,960,319.22
债券投资市值		616,526,498.40	34,153,600.00
其中：债券投资成本		615,612,400.00	33,407,278.47
权证投资		25,250,563.26	-
其中：权证投资成本		19,349,252.01	-
资产总计		14,847,075,625.69	608,893,302.85

负债及持有人权益

负债

应付证券清算款		12,719,019.75	-
应付赎回款		211,399,599.91	67,280,177.36
应付赎回费		835,544.18	62,885.56
应付管理人报酬		16,539,225.85	820,900.34
应付托管费		2,756,537.63	136,816.71
应付佣金	9	14,316,022.61	634,223.34
其他应付款	10	1,002,425.00	250,000.00
预提费用	11	99,500.00	80,000.00
负债合计		259,667,874.93	69,265,003.31

持有人权益

实收基金	12	11,712,008,124.34	504,652,280.24
未实现利得	13	2,674,344,063.06	21,277,952.64
未分配基金净收益		201,055,563.36	13,698,066.66
持有人权益合计		14,587,407,750.76	539,628,299.54

(2006 年末基金份额资产净值：1.2455 元)

(2005 年末基金份额资产净值：1.0693 元)

负债及持有人权益总计		14,847,075,625.69	608,893,302.85
-------------------	--	--------------------------	-----------------------

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

二、经营业绩表及收益分配表

南方高增长证券投资基金 2006 年度经营业绩表及收益分配表

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

2005 年 7 月 13 日
(基金合同生效日)

		2006 年度	至 2005 年 12 月 31 日止期间
收入	附注		
股票差价收入/(损失)	14	571,631,629.04	(11,171,733.18)
债券差价收入	15	506,293.29	1,682,987.95
权证差价收入	16	12,125,764.96	18,685,828.19
债券利息收入		550,548.86	4,474,021.86
存款利息收入		3,394,394.27	1,545,825.81
股利收入		10,684,562.76	1,137,806.73
买入返售证券收入		136,211.97	146,680.00
其他收入	17	3,402,506.72	1,201,632.52
收入合计		602,431,911.87	17,703,049.88
费用			
基金管理人报酬		(25,124,533.87)	(6,920,406.01)
基金托管费		(4,187,422.18)	(1,153,400.96)
卖出回购证券支出		(151,232.88)	-
其他费用	18	(465,328.97)	(141,612.96)
其中：上市年费		(60,000.00)	(50,000.00)
信息披露费		(300,000.00)	-
审计费用		(75,000.00)	(80,000.00)
费用合计		(29,928,517.90)	(8,215,419.93)
基金净收益		572,503,393.97	9,487,629.95
加：未实现估值增值/(减值)变动数		1,935,199,317.79	29,530,898.36
基金经营业绩		2,507,702,711.76	39,018,528.31
基金净收益		572,503,393.97	9,487,629.95
加：年/期初基金净收益		13,698,066.66	-
本年/期申购基金份额的损益平准金		435,384,896.02	(574,843.54)
本年/期赎回基金份额的损益平准金		(101,512,543.37)	4,785,280.25
可供分配基金净收益		920,073,813.28	13,698,066.66
减：本年/期已分配基金净收益		(719,018,249.92)	-
未分配基金净收益		201,055,563.36	13,698,066.66

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

三、 基金净值变动表

南方高增长证券投资基金
2006 年度基金净值变动表
(除特别注明外, 金额单位为人民币元)

	2005 年 7 月 13 日 (基金合同生效日) 至 2005 年 2006 年度 12 月 31 日止期间	
年/期初基金净值	539,628,299.54	1,276,869,477.13
本年/期经营活动		
基金净收益	572,503,393.97	9,487,629.95
未实现估值增值/(减值)变动数	1,935,199,317.79	29,530,898.36
经营活动产生的基金净值变动数	2,507,702,711.76	39,018,528.31
本年/期基金份额交易		
基金申购款	15,090,138,508.23	152,649,000.38
其中: 分红再投资	85,213,323.81	-
基金赎回款	(2,831,043,518.85)	(928,908,706.28)
基金份额交易产生的基金净值变动数	12,259,094,989.38	(776,259,705.90)
本年/期向基金份额持有人分配收益		
向基金份额持有人分配收益产生的基金净值变动数	(719,018,249.92)	-
年/期末基金净值	14,587,407,750.76	539,628,299.54

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

第二节：年度会计报表附注

1 本基金的基本情况

南方高增长证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2005]第 82 号《关于同意南方高增长证券投资基金募集的批复》核准, 由南方基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方高增长证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契

约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,276,503,292.69 元，业经德勤华永会计师事务所有限公司德师京(验)报字(05)第 011 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《南方高增长证券投资基金基金合同》于 2005 年 7 月 13 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,276,869,477.13 份基金份额，其中认购资金利息折合 366,184.44 份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2005]第 82 号文审核同意，本基金 176,594,255.00 份基金份额于 2005 年 9 月 21 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方高增长证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具，其中股票(含可转换债券)的投资比例为 60%-95%。

2 本基金年度报告中会计报表的编制遵守基本会计假设。

3 会计报表编制基础

本基金的会计报表按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《南方高增长证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

4 主要会计政策、会计估计及其变更

(a) 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较会计报表的实际编制期间为 2005 年 7 月 13 日(基金合同生效日)至 2005 年 12 月 31 日。

(b) 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

(c) 记账基础和计价原则

本基金的记账基础为权责发生制。除股票投资、债券投资和权证投资按市值计价外，所有报表项目均以历史成本计价。

(d) 基金资产的估值原则

(i) 股票投资

上市交易的股票按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易收盘价估值。首次公开发行但未上市的股票，按成本估值；由于配股和非定向增发形成的暂时流通受限制的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值。

(ii) 债券投资

证券交易所市场实行净价交易的国债按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易收盘价估值。证券交易所市场未实行净价交易的企业债券及可转换债券按估值日市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值。银行间同业市场交易的债券和未上市流通的债券按成本估值。

(iii) 权证投资

从获赠确认日、买入成交日或因认购新发行分离交易可转债而取得的权证从实际取得日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证投资按估值日在证券交易所挂牌的该权证投资的市场交易收盘价估值；未上市交易的权证投资(包括配股权证)按公允价值估值。

(iv) 实际投资成本与估值的差异计入“未实现利得/(损失)”科目。

(v) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值，基金管理人应根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(e) 证券投资基金成本计价方法

(i) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资。股票投资成本按成交日应支付的全部价款入账。收到股权分置改革过程中由非流通股股东支付的现金对价，于股权分置方案实施复牌日冲减股票投资成本。

卖出股票于成交日确认股票差价收入/(损失)。出售股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

(ii) 债券投资

买入证券交易所交易的债券于成交日确认为债券投资；买入银行间同业市场交易的债券于实际支付价款时确认为债券投资。债券投资按成交日应支付的全部价款入账，其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本。认购新发行的分离交易可转债于成交日先按支付

的全部价款确认为债券投资，后于权证实际取得日按附注 3(e)(iii)所示的方法单独核算权证成本，并相应调整债券投资成本。

卖出证券交易所交易的债券于成交日确认债券差价收入/(损失)；卖出银行间同业市场交易的债券于实际收到全部价款时确认债券差价收入/(损失)。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

(iii) 权证投资

获赠权证(包括配股权证)在确认日，按持有的股数及获赠比例计算并记录增加的权证数量；买入权证于成交日确认为权证投资，相应成本按成交日应支付的全部价款入账；因认购新发行的分离交易可转债而取得的权证在实际取得日，按权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证成本。

卖出权证于成交日确认权证差价收入/(损失)，出售权证的成本按移动加权平均法于成交日结转。

- (f) 待摊费用的摊销方法和摊销期限
待摊费用按直线法在实际受益期限内逐日摊销。

(g) 收入/(损失)的确认和计量

股票差价收入/(损失)于卖出股票成交日按卖出股票成交总额与其成本和相关费用的差额确认。

证券交易所交易的债券差价收入/(损失)于卖出成交日确认；银行间同业市场交易的债券差价收入/(损失)于实际收到全部价款时确认。债券差价收入/(损失)按应收取全部价款与其成本、应收利息和相关费用的差额确认。

权证差价收入于卖出权证成交日按卖出权证成交总额与其成本和相关费用的差额确认。

债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除适用情况下应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

股利收入按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额于除息日确认。

买入返售证券收入按融出资金额及约定利率，在证券持有期内采用直线法逐日计提。

(h) 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率逐日计提。

卖出回购证券支出按融入资金额及约定利率，在回购期限内采用直线法逐日计提。

(i) 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

(j) 未实现利得/(损失)

未实现利得/(损失)包括因投资估值而产生的未实现估值增值/(减值)和未实现利得/(损失)平准金。

未实现利得/(损失)平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现利得/(损失)平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列。

(k) 损益平准金

损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按未分配基金净收益/(累计基金净损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配基金净收益/(累计基金净损失)。

(l) 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，其中场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，场内基金份额持有人只能选择现金分红。在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多四次；全年基金收益分配比例不得低于年度基金已实现净收益的 50%。基金当期收益先弥补以前年度亏损后，方可进行当年收益分配。基金当年亏损，则不进行收益分配。基金收益分配后，基金份额净值不能低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从持有人权益转出。

- (m) 本年度无为处理对基金财务状况及基金运作有重大影响的事项而采取的其他会计政策和会计估计。
- (n) 本年度无会计政策、会计估计变更。
- (o) 本年度无重大会计差错。

5 主要税项

根据财政部、国家税务总局财税 [2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]11号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (a) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (b) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。
- (c) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50%计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20%代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。
- (d) 基金买卖股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税。
- (e) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

会计报表重要项目说明

6 交易保证金

	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
深圳结算保证金	500,000.00	975,555.45
权证交易保证金	138,549.15	138,549.15
	<u>638,549.15</u>	<u>1,114,104.60</u>

7 应收利息

	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
应收债券利息	4,833,039.19	50,147.95

应收银行存款利息	543,145.78	32,087.35
应收结算备付金利息	5,588.10	1,417.30
应收交易保证金利息	62.30	62.30
	<u>5,381,835.37</u>	<u>83,714.90</u>

8 待摊费用

截止 2006 年 12 月 31 日，待摊费用科目无余额。

9 应付佣金

	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
联合证券有限责任公司	3,818,911.29	46,873.45
中国银河证券有限责任公司	3,085,052.39	-
湘财证券有限责任公司	3,013,077.37	81,247.41
华泰证券有限责任公司	1,474,257.85	135,333.34
广州证券有限责任公司	1,056,385.90	-
申银万国证券股份有限公司	780,147.80	-
广发证券股份有限公司	625,271.04	64,098.45
兴业证券股份有限公司	234,099.03	-
西北证券有限责任公司	228,819.94	228,819.94
国信证券有限责任公司	-	77,850.75
	<u>14,316,022.61</u>	<u>634,223.34</u>

10 其他应付款

	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
应付券商席位保证金	1,000,000.00	250,000.00
其他	2,425.00	-
	<u>1,002,425.00</u>	<u>250,000.00</u>

11 预提费用

	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
审计费用	95,000.00	80,000.00
债券托管账户维护费	4,500.00	-
	<u>99,500.00</u>	<u>80,000.00</u>

12 实收基金

基金份额

基金面值

2005 年 12 月 31 日	504,652,280.24	504,652,280.24
本年申购	13,608,033,681.51	13,608,033,681.51
其中：红利再投资	80,662,530.92	80,662,530.92
本年赎回	(2,400,677,837.41)	(2,400,677,837.41)
2006 年 12 月 31 日	11,712,008,124.34	11,712,008,124.34

13 未实现利得

	未实现估值 增值/(减值)(a)	未实现利得 /(损失)平准金	合计
2005 年 12 月 31 日	29,530,898.36	(8,252,945.72)	21,277,952.64
本年净变动数	1,935,199,317.79	-	1,935,199,317.79
本年申购基金份额	-	1,046,719,930.70	1,046,719,930.70
其中：红利再投资	-	4,315,123.95	4,315,123.95
本年赎回基金份额	-	(328,853,138.07)	(328,853,138.07)
2006 年 12 月 31 日	1,964,730,216.15	709,613,846.91	2,674,344,063.06

(a) 未实现估值增值/(减值)按投资类别分项列示如下：

	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
股票投资	1,957,914,806.50	28,784,576.83
债券投资	914,098.40	746,321.53
权证投资	5,901,311.25	-
	1,964,730,216.15	29,530,898.36

14 股票差价收入/(损失)

	2006 年度	2005 年 7 月 13 日(基金 合同生效日)至 2005 年 12 月 31 日止期间
卖出股票成交总额	6,140,691,963.03	1,257,842,750.27
减：应付佣金总额	(5,146,619.36)	(1,053,369.45)
减：卖出股票成本总额	(5,563,913,714.63)	(1,267,961,114.00)
	571,631,629.04	(11,171,733.18)

本基金于本年度获得股权分置改革中由非流通股股东支付的现金对价共计 1,380,392.05 元(2005 期间：225,000.00 元)，已全额冲减股票投资成本。

15 债券差价收入

2006 年度 2005 年 7 月 13 日(基金

合同生效日)至 2005 年
12 月 31 日止期间

卖出及到期兑付债券结算金额	14,881,924.03	951,170,253.14
减: 应收利息总额	(40,422.00)	(10,520,212.59)
减: 卖出及到期兑付债券成本总额	(14,335,208.74)	(938,967,052.60)
	506,293.29	1,682,987.95

16 权证差价收入

2006 年度 2005 年 7 月 13 日(基金
合同生效日)至 2005 年
12 月 31 日止期间

卖出权证成交金额	15,568,149.64	18,685,828.19
减: 卖出权证成本总额	(3,442,384.68)	-
	12,125,764.96	18,685,828.19

17 其他收入

2005 年 7 月 13 日(基金
合同生效日)至 2005 年
12 月 31 日止期间

2006 年度

赎回基金补偿收入(a)	3,402,506.72	1,161,136.00
其他	-	40,496.52
	3,402,506.72	1,201,632.52

(a) 本基金的赎回费率按持有期间递减, 赎回费总额的25%归入基金资产。

18 其他费用

2005 年 7 月 13 日(基金
合同生效日)至 2005 年
12 月 31 日止期间

2006 年度

信息披露费	300,000.00	-
审计费用	75,000.00	80,000.00
上市年费	60,000.00	50,000.00
债券托管账户维护费	18,000.00	-
其他	12,328.97	11,612.96
	465,328.97	141,612.96

19 收益分配

	登记日	分红率	现金 形式发放	再投资 形式发放	发放红利 合计
2006 年度					
第一次中期分红	2006/01/18	每 10 份基金份额 0.50 元	26,670,127.04	467,336.93	27,137,463.97
第二次中期分红	2006/02/27	每 10 份基金份额 0.50 元	19,786,701.10	921,306.96	20,708,008.06
第三次中期分红	2006/03/27	每 10 份基金份额 0.57 元	23,988,802.79	1,603,944.19	25,592,746.98
第四次中期分红	2006/11/28	每 10 份基金份额 7.47 元	563,359,295.18	82,220,735.73	645,580,030.91
合计		每 10 份基金份额 9.04 元	633,804,926.11	85,213,323.81	719,018,249.92

20 重大关联方关系及关联交易

(a) 关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理有限公司(“南方基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金代销机构
华泰证券有限责任公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
厦门国际信托投资有限公司	基金管理人的股东
兴业证券股份有限公司(“兴业证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
深圳市机场(集团)有限公司	基金管理人的股东(2006 年 2 月 27 日起)
深圳市机场股份有限公司	基金管理人的原股东(2006 年 2 月 27 日之前)

根据南方基金管理有限公司于 2006 年 3 月 10 日发布的公告，经公司股东会审议通过，并报经中国证监会证监基金字(2005)201 号文批准，公司股东深圳市机场股份有限公司将其持有的南方基金管理有限公司 30%股权转让给深圳市机场(集团)有限公司。

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(b) 通过关联方席位进行的证券交易及交易佣金

	2006 年度 成交量	占本年成交量 的比例
华泰证券：		
买卖股票	3,016,674,726.55	14.12%
买卖权证	2,035,938.50	5.08%
兴业证券：		
买卖股票	299,165,993.61	1.40%
	佣金	占本年佣金总量

		的比例
华泰证券	2,360,567.92	13.70%
兴业证券	234,099.03	1.36%

2005 年 7 月 13 日(基金合同生效日)

至 2005 年 12 月 31 日止期间

	成交量	占本年成交量的比例
华泰证券： 买卖股票	1,070,041,779.13	36.52%
华泰证券	837,318.51	35.56%

上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券和权证交易不计佣金。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

(c) 基金管理人报酬

支付基金管理人南方基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

本基金在本年度需支付基金管理人报酬 25,124,533.87 元(2005 期间：6,920,406.01 元)。

(d) 基金托管费

支付基金托管人中国银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：
日基金托管费＝前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

本基金在本年度需支付基金托管费 4,187,422.18 元(2005 期间：1,153,400.96 元)。

(e) 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。基金托管人于 2006 年 12 月 31 日保管的银行存款余额为 1,848,648,923.63 元(2005 年：103,250,830.12 元)。本年度由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 3,345,556.50 元(2005 期间：1,514,934.96 元)。

(f) 与关联方通过银行间同业市场进行的债券交易

本基金在本年度与基金托管人中国银行通过银行间同业市场进行的债券交易如下：

	2005 年 7 月 13 日(基金 合同生效日)至 2005 年 2006 年度 12 月 31 日止期间
买入债券结算金额	181,136,787.81 -

(g) 关联方持有的基金份额

	2006 年 12 月 31 日			2005 年 12 月 31 日		
	基金份额	净值	占总份额 的比例	基金份额	净值	占总份额的 比例
南方基金	50,005,000.00	62,281,227.50	0.43%	50,005,000.00	53,470,346.50	9.91%

本报告期内南方基金管理公司持有本基金份额未有变化。

本报告期内南方基金管理公司主要股东及其控制机构在期末未持有本基金份额。

21 流通受限制不能自由转让的基金资产

- (a) 本基金截至 2006 年 12 月 31 日止持有以下因股权分置改革而暂时停牌的股票，这些股票将在股权分置改革规定的程序结束后复牌。

股票代码	股票名称	停牌 日期	年末估值 单价	复牌 日期	复牌开盘 单价	数量	年末成本 总额	年末估值 总额
方案实施阶段停牌：								
000549	S 湘火炬	06/12/19	8.90	未知	未知	28,381,547	238,186,187.31	252,595,768.30
000895	S 双汇	06/06/01	31.17	未知	未知	645,558	10,687,960.06	20,122,042.86
合 计							248,874,147.37	272,717,811.16

- (b) 基金可使用以基金名义开设的股票账户，比照个人投资者和一般法人、战略投资者参与新股认购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股或增发新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

本基金截至 2006 年 12 月 31 日止投资的流通受限制的股票情况如下：

股票代码	股票名称	成功申购日期	可流通日期	申购价格	估值方法	年末估值单价	数量	年末成本总额	年末估值总额
601628	中国人寿	06/12/28	07/04/09	18.88	成本法	18.88	2,977,750	56,219,920.00	56,219,920.00

22 资产负债表日后事项

无。

第七章：投资组合报告

一、报告期末基金资产组合情况

项 目	金 额	占基金资产总值的比例
股 票	12,170,723,501.63	81.97%
债 券	616,526,498.40	4.15%
权 证	25,250,563.26	0.17%
银行存款和清算备付金合计	1,861,066,980.11	12.53%
其他资产	173,508,082.29	1.18%
合 计	14,847,075,625.69	100.00%

二、报告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	0.00	0.00%
B 采掘业	777,512,711.72	5.33%
C 制造业	4,870,264,673.39	33.38%
C0 食品、饮料	691,753,921.42	4.74%
C1 纺织、服装、皮毛	0.00	0.00%
C2 木材、家具	0.00	0.00%
C3 造纸、印刷	231,766,196.49	1.59%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	544,733,232.38	3.73%
C5 电子	109,020,000.00	0.75%
C6 金属、非金属	1,596,932,087.00	10.95%
C7 机械、设备、仪表	1,603,746,679.20	10.99%
C8 医药、生物制品	92,312,556.90	0.63%
C99 其他制造业	0.00	0.00%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	290,250,000.00	1.99%
E 建筑业	58,266,264.00	0.40%
F 交通运输、仓储业	189,054,923.46	1.30%
G 信息技术业	90,699,952.60	0.62%
H 批发和零售贸易	225,555,766.72	1.55%
I 金融、保险业	4,306,996,243.38	29.53%
J 房地产业	1,332,968,898.56	9.14%
K 社会服务业	0.00	0.00%

L 传播与文化产业	29,154,067.80	0.20%
M 综合类	0.00	0.00%
合计	12,170,723,501.63	83.43%

三、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有股票明细

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	601398	工商银行	225,350,000	1,397,170,000.00	9.58%
2	600036	招商银行	74,000,000	1,210,640,000.00	8.30%
3	600030	中信证券	39,889,201	1,092,166,323.38	7.49%
4	000002	万 科 A	52,501,224	810,618,898.56	5.56%
5	600016	民生银行	54,000,000	550,800,000.00	3.78%
6	000402	金 融 街	31,000,000	522,350,000.00	3.58%
7	000858	五 粮 液	22,000,000	502,700,000.00	3.45%
8	000039	中集集团	22,501,660	423,931,274.40	2.91%
9	600309	烟台万华	16,951,723	410,740,248.29	2.82%
10	600028	中国石化	43,350,406	395,355,702.72	2.71%
11	600583	海油工程	11,022,700	382,157,009.00	2.62%
12	600011	华能国际	45,000,000	290,250,000.00	1.99%
13	600660	福耀玻璃	19,516,717	288,261,910.09	1.98%
14	600066	宇通客车	19,500,000	256,815,000.00	1.76%
15	000549	S 湘火炬	28,381,547	252,595,768.30	1.73%
16	000651	格力电器	20,000,000	237,400,000.00	1.63%
17	600308	华泰股份	17,004,123	231,766,196.49	1.59%
18	000951	中国重汽	9,000,000	225,000,000.00	1.54%
19	000825	太钢不锈	16,756,711	218,842,645.66	1.50%
20	600808	马钢股份	47,882,328	215,470,476.00	1.48%
21	600150	沪东重机	6,000,643	190,820,447.40	1.31%
22	601111	中国国航	35,018,854	180,347,098.10	1.24%
23	000550	江铃汽车	12,000,000	148,800,000.00	1.02%
24	000619	海螺型材	17,794,553	133,992,984.09	0.92%
25	600686	金龙汽车	7,499,695	127,944,796.70	0.88%
26	600019	宝钢股份	13,476,334	116,705,052.44	0.80%
27	002032	苏 泊 尔	5,981,488	115,442,718.40	0.79%
28	000559	万向钱潮	26,847,609	113,833,862.16	0.78%
29	600739	辽宁成大	6,200,330	110,551,883.90	0.76%
30	002045	广州国光	7,900,000	109,020,000.00	0.75%
31	002084	海鸥卫浴	4,532,893	100,947,527.11	0.69%
32	000623	吉林敖东	2,788,899	92,312,556.90	0.63%
33	600519	贵州茅台	1,025,350	90,056,490.50	0.62%
34	000012	南 玻 A	6,568,660	72,255,260.00	0.50%
35	002081	金 螳 螂	2,427,761	58,266,264.00	0.40%

36	601628	中国人寿	2,977,750	56,219,920.00	0.39%
37	000061	农产品	4,271,448	54,460,962.00	0.37%
38	000729	燕京啤酒	5,166,820	50,479,831.40	0.35%
39	600761	安徽合力	2,066,916	45,988,881.00	0.32%
40	000877	天山股份	8,838,279	45,075,222.90	0.31%
41	600271	航天信息	1,062,064	37,182,860.64	0.25%
42	000063	中兴通讯	916,860	35,849,226.00	0.25%
43	600037	歌华有线	1,172,730	29,154,067.80	0.20%
44	000869	张裕A	569,963	28,395,556.66	0.19%
45	600511	国药股份	1,408,143	24,515,769.63	0.17%
46	000895	S双汇	645,558	20,122,042.86	0.14%
47	600628	新世界	1,733,756	18,204,438.00	0.12%
48	600694	大商股份	606,421	17,822,713.19	0.12%
49	600973	宝胜股份	1,390,076	17,667,865.96	0.12%
50	600004	白云机场	1,154,884	8,707,825.36	0.06%
51	000837	秦川发展	504,764	4,547,923.64	0.03%
		股票投资合计:		12,170,723,501.63	83.43%

四、报告期内股票投资组合的重大变动

(一) 报告期内累计买入价值超出期初基金资产净值 2%的股票明细

序号	股票代码	股票名称	累计买入金额(元)	占期初基金资产净值的比例
1	601398	工商银行	1,181,738,100.68	218.99%
2	600036	招商银行	1,139,331,762.74	211.13%
3	600030	中信证券	1,108,971,455.29	205.51%
4	000002	万科A	878,532,870.62	162.80%
5	600016	民生银行	520,260,490.81	96.41%
6	000402	金融街	519,872,431.50	96.34%
7	000858	五粮液	469,531,582.07	87.01%
8	600028	中国石化	449,124,275.98	83.23%
9	000039	中集集团	432,100,253.39	80.07%
10	600050	中国联通	418,003,851.30	77.46%
11	600309	烟台万华	379,877,561.56	70.40%
12	600660	福耀玻璃	369,839,723.79	68.54%
13	600583	海油工程	351,755,228.65	65.18%
14	600019	宝钢股份	320,994,401.13	59.48%
15	000549	S湘火炬	282,844,974.34	52.41%
16	600011	华能国际	277,340,521.96	51.39%
17	000651	格力电器	253,528,457.71	46.98%
18	000825	太钢不锈	240,250,193.31	44.52%
19	600066	宇通客车	235,536,726.07	43.65%
20	600808	马钢股份	203,685,144.77	37.75%

21	600308	华泰股份	200,636,564.47	37.18%
22	601111	中国国航	185,969,494.56	34.46%
23	000951	中国重汽	175,028,885.70	32.44%
24	600104	上海汽车	170,731,221.14	31.64%
25	600150	沪东重机	163,049,317.72	30.22%
26	000898	鞍钢股份	150,785,024.97	27.94%
27	002024	苏宁电器	144,645,218.49	26.80%
28	600519	贵州茅台	139,905,745.86	25.93%
29	000619	海螺型材	138,485,278.09	25.66%
30	000550	江铃汽车	134,981,183.60	25.01%
31	600739	辽宁成大	134,650,480.88	24.95%
32	600694	大商股份	134,099,084.25	24.85%
33	600004	白云机场	127,737,003.73	23.67%
34	002032	苏泊尔	123,126,273.68	22.82%
35	000559	万向钱潮	115,911,879.99	21.48%
36	000623	吉林敖东	113,477,293.64	21.03%
37	600686	金龙汽车	107,939,602.35	20.00%
38	000063	中兴通讯	104,657,089.77	19.39%
39	600418	江淮汽车	103,500,499.28	19.18%
40	002045	广州国光	103,388,718.52	19.16%
41	002084	海鸥卫浴	96,537,657.22	17.89%
42	600269	赣粤高速	90,623,495.41	16.79%
43	600058	五矿发展	77,818,430.38	14.42%
44	600900	长江电力	75,412,846.71	13.97%
45	000012	南玻A	66,494,736.68	12.32%
46	000729	燕京啤酒	61,051,526.61	11.31%
47	002081	金螳螂	59,379,470.51	11.00%
48	000927	一汽夏利	57,824,590.48	10.72%
49	601628	中国人寿	56,219,920.00	10.42%
50	600761	安徽合力	55,604,254.19	10.30%
51	600009	上海机场	51,989,228.61	9.63%
52	000061	农产品	50,175,814.15	9.30%
53	600628	新世界	45,294,763.04	8.39%
54	000877	天山股份	42,392,492.80	7.86%
55	600688	S上石化	41,306,017.57	7.65%
56	000027	深能源A	39,414,587.18	7.30%
57	600271	航天信息	36,557,579.64	6.77%
58	600717	天津港	36,245,467.43	6.72%
59	002048	宁波华翔	35,263,149.23	6.53%
60	000069	华侨城A	35,200,807.30	6.52%
61	600005	武钢股份	34,949,978.01	6.48%

62	600037	歌华有线	34,679,518.09	6.43%
63	600511	国药股份	34,649,144.80	6.42%
64	000869	张裕A	34,354,712.16	6.37%
65	000792	盐湖钾肥	34,141,030.32	6.33%
66	002073	青岛软控	33,805,225.55	6.26%
67	600276	恒瑞医药	33,267,412.54	6.16%
68	600415	小商品城	33,210,619.52	6.15%
69	600887	伊利股份	31,494,023.17	5.84%
70	600219	南山铝业	30,958,402.97	5.74%
71	000001	S 深发展 A	30,359,522.22	5.63%
72	000581	威孚高科	30,221,542.22	5.60%
73	600547	山东黄金	29,441,069.29	5.46%
74	000527	美的电器	27,789,721.67	5.15%
75	002007	华兰生物	27,243,446.20	5.05%
76	600386	北京巴士	26,545,878.78	4.92%
77	000024	招商地产	24,190,155.43	4.48%
78	601333	广深铁路	23,740,640.00	4.40%
79	000807	云铝股份	23,530,972.80	4.36%
80	600000	浦发银行	23,424,392.48	4.34%
81	000987	广州友谊	23,097,418.72	4.28%
82	000625	长安汽车	22,988,633.06	4.26%
83	002085	万丰奥威	22,876,373.73	4.24%
84	600169	太原重工	21,928,122.08	4.06%
85	000568	泸州老窖	20,675,935.49	3.83%
86	000410	沈阳机床	20,241,922.43	3.75%
87	000933	神火股份	19,767,169.45	3.66%
88	000759	武汉中百	19,289,195.09	3.57%
89	000562	宏源证券	18,794,253.23	3.48%
90	600500	中化国际	18,275,258.42	3.39%
91	600973	宝胜股份	17,441,290.73	3.23%
92	600649	原水股份	17,330,427.44	3.21%
93	002059	世博股份	16,896,281.56	3.13%
94	600348	国阳新能	16,603,615.15	3.08%
95	000528	柳工	16,142,233.14	2.99%
96	600085	同仁堂	15,666,112.96	2.90%
97	000906	S 南建材	15,234,918.31	2.82%
98	000900	现代投资	14,862,311.88	2.75%
99	600729	重庆百货	14,440,387.80	2.68%
100	000538	云南白药	14,278,789.88	2.65%
101	600858	银座股份	11,555,814.69	2.14%
102	600322	天房发展	11,380,270.64	2.11%

103	000956	中原退市	11,235,152.45	2.08%
104	000897	津滨发展	11,127,627.30	2.06%
105	000709	唐钢股份	11,111,351.00	2.06%

(二) 报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值 2% 的股票明细

序号	股票代码	股票名称	累计卖出金额(元)	占期初基金资产净值的比例
1	600050	中国联通	464,722,397.18	86.12%
2	601398	工商银行	452,140,218.48	83.79%
3	000002	万 科 A	277,211,485.31	51.37%
4	600030	中信证券	228,412,711.03	42.33%
5	600019	宝钢股份	221,888,082.86	41.12%
6	600036	招商银行	211,619,251.32	39.22%
7	600104	上海汽车	172,832,929.46	32.03%
8	000898	鞍钢股份	153,297,062.54	28.41%
9	600028	中国石化	153,074,573.76	28.37%
10	600660	福耀玻璃	147,733,184.53	27.38%
11	002024	苏宁电器	141,186,496.43	26.16%
12	600004	白云机场	131,941,808.51	24.45%
13	000858	五 粮 液	119,433,157.78	22.13%
14	600418	江淮汽车	113,810,240.13	21.09%
15	600016	民生银行	113,332,400.52	21.00%
16	600694	大商股份	107,681,028.55	19.95%
17	000063	中兴通讯	104,008,283.63	19.27%
18	600269	赣粤高速	85,217,583.82	15.79%
19	000825	太钢不锈	77,710,474.36	14.40%
20	600900	长江电力	74,456,131.76	13.80%
21	600058	五矿发展	73,797,101.38	13.68%
22	000623	吉林敖东	70,274,107.44	13.02%
23	600519	贵州茅台	62,700,179.51	11.62%
24	600348	国阳新能	58,295,926.30	10.80%
25	000927	一汽夏利	57,683,227.58	10.69%
26	600009	上海机场	53,029,631.11	9.83%
27	000027	深能源 A	51,668,807.20	9.57%
28	600688	S 上石化	50,807,935.99	9.42%
29	600887	伊利股份	50,060,558.27	9.28%
30	600879	火箭股份	49,054,638.33	9.09%
31	000549	S 湘火炬	47,960,526.62	8.89%
32	600739	辽宁成大	46,594,172.76	8.63%
33	000039	中集集团	45,348,802.68	8.40%
34	600583	海油工程	44,001,785.04	8.15%
35	601333	广深铁路	40,227,875.44	7.45%

36	600005	武钢股份	37,911,377.24	7.03%
37	002048	宁波华翔	36,146,782.57	6.70%
38	600276	恒瑞医药	36,064,123.59	6.68%
39	000792	盐湖钾肥	36,038,944.82	6.68%
40	000024	招商地产	36,023,918.18	6.68%
41	600011	华能国际	35,562,756.70	6.59%
42	000069	华侨城A	35,269,089.41	6.54%
43	000729	燕京啤酒	35,143,543.25	6.51%
44	600415	小商品城	34,003,186.50	6.30%
45	002073	青岛软控	33,140,206.27	6.14%
46	600386	北京巴士	31,310,033.27	5.80%
47	600547	山东黄金	31,302,869.61	5.80%
48	000651	格力电器	31,295,026.25	5.80%
49	600219	南山铝业	30,679,635.74	5.69%
50	600717	天津港	30,545,110.48	5.66%
51	600628	新世界	30,488,744.69	5.65%
52	000061	农产品	29,365,578.10	5.44%
53	002007	华兰生物	29,277,864.80	5.43%
54	000581	威孚高科	28,727,494.04	5.32%
55	000527	美的电器	26,875,038.45	4.98%
56	000001	S 深发展 A	26,747,757.16	4.96%
57	601111	中国国航	26,602,316.54	4.93%
58	000568	泸州老窖	26,589,420.27	4.93%
59	000402	金融街	26,442,150.28	4.90%
60	000987	广州友谊	25,803,543.87	4.78%
61	000410	沈阳机床	25,743,372.04	4.77%
62	000807	云铝股份	25,391,048.13	4.71%
63	600000	浦发银行	24,828,029.74	4.60%
64	000625	长安汽车	24,019,489.73	4.45%
65	600761	安徽合力	23,408,694.43	4.34%
66	000550	江铃汽车	23,026,347.42	4.27%
67	002085	万丰奥威	22,318,939.48	4.14%
68	000759	武汉中百	22,274,037.38	4.13%
69	000933	神火股份	20,875,487.56	3.87%
70	600169	太原重工	20,744,779.96	3.84%
71	600500	中化国际	20,274,124.50	3.76%
72	000088	盐田港	19,402,494.75	3.60%
73	000528	柳工	16,899,195.66	3.13%
74	000562	宏源证券	16,876,980.86	3.13%
75	002059	世博股份	16,699,566.33	3.09%
76	600649	原水股份	16,447,662.03	3.05%

77	600859	王府井	16,172,892.99	3.00%
78	600729	重庆百货	15,868,554.19	2.94%
79	000538	云南白药	15,218,019.37	2.82%
80	600085	同仁堂	15,097,510.03	2.80%
81	600143	金发科技	15,035,923.42	2.79%
82	000970	中科三环	14,870,558.60	2.76%
83	000906	S 南建材	14,815,783.10	2.75%
84	600037	歌华有线	14,280,013.07	2.65%
85	000900	现代投资	13,695,719.25	2.54%
86	600875	东方电机	12,874,037.35	2.39%
87	600383	金地集团	12,676,492.98	2.35%
88	000956	中原退市	12,614,022.98	2.34%
89	600511	国药股份	12,565,153.07	2.33%
90	000897	津滨发展	12,559,951.71	2.33%
91	601991	大唐发电	12,107,649.60	2.24%
92	600827	友谊股份	11,869,819.54	2.20%
93	000709	唐钢股份	11,821,447.04	2.19%
94	600361	华联综超	11,718,393.45	2.17%
95	600322	天房发展	11,109,191.87	2.06%
96	600858	银座股份	11,077,536.00	2.05%
97	600048	保利地产	10,992,229.70	2.04%
98	600549	厦门钨业	10,916,147.09	2.02%
99	600007	中国国贸	10,848,870.56	2.01%
100	600600	青岛啤酒	10,801,533.77	2.00%

(三) 报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

买入股票成本总额	卖出股票收入总额
15,372,142,482.59	6,140,691,963.03

五、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	金融债	611,000,400.00	4.19%
2	可转债	5,526,098.40	0.04%
	合计	616,526,498.40	4.23%

六、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	06 进出 05	379,888,270.00	2.60%
2	04 进出 02	121,176,720.00	0.83%
3	06 农发 14	99,938,000.00	0.69%

4	06 农发 08	9,997,410.00	0.07%
5	上电转债	5,526,098.40	0.04%

七、本基金报告期内未投资资产支持证券。

八、权证投资情况

因股权分置改革被动持有权证投资情况如下：

序号	权证代码	权证名称	数 量	成本总额	市值	市值占基金资产净值比例%	获得方式
1	580007	长电 CWB1	600,000.00	--	--	--	被动获得
2	038006	中集 ZYP1	805,000.00	--	--	--	被动获得
3	580990	茅台 JCP1	608,000.00	--	--	--	被动获得
4	038008	钾肥 JTP1	200,220.00	--	--	--	被动获得
5	580997	招行 CMP1	2,100,000.00	--	--	--	被动获得

因投资分离交易的可转换债券发行人派发的权证情况如下：

序号	权证代码	权证名称	数 量	成本总额
1	580011	中化 CWB1	2,364,600.00	3,442,384.68

报告期持有的因主动投资持有权证投资情况如下：

序号	权证代码	权证名称	买入数量	买入成本总额	卖出数量	卖出收入总额
1	580005	万华 HXB1	1,291,794.00	21,932,351.07	157,498.00	2,583,099.06

序号	权证代码	权证名称	期末结存数量	期末成本总额	期末市值	市值占基金资产净值比例
1	580005	万华 HXB1	1,134,296.00	19,349,252.01	25,250,563.26	0.17%

九、投资组合报告附注

- 1、报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。
- 2、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股票。
- 3、基金其他资产的构成

其他资产	金额（元）
交易保证金	638,549.15
应收利息	5,381,835.37
应收股利	--
应收证券清算款	117,914,804.25
应收申购款	49,572,893.52
合 计	173,508,082.29

4、基金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	期末市值（人民币元）	市值占基金资产净值比例
----	------	------	------------	-------------

-	-	-	-	-
---	---	---	---	---

5、本报告期内未有基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

第八章：基金份额持有人情况

一、 报告期末基金份额持有人户数

报告期末基金份额持有人户数：	313,130
报告期末平均每户持有的基金份额：	37,403.02

二、 报告期末基金份额持有人结构

项目	数量	占总份额的比例
基金份额总额：	11,712,008,124.34	100.00%
其中：机构投资者持有的基金份额	585,275,487.49	5.00%
个人投资者持有的基金份额	11,126,732,636.85	95.00%

三、 报告期末本基金前十名持有人明细（上市交易部分）

序号	持有人名称	持有份额	占总份额的比例
1	南方基金管理有限公司	50,005,000.00	0.43%
2	翁金海	9,342,000.00	0.08%
3	联合证券有限责任公司	9,231,515.00	0.08%
4	上海福鼎置业发展有限公司	7,738,485.00	0.07%
5	陈显骢	7,700,000.00	0.07%
6	吴丽琼	6,388,000.00	0.05%
7	黄冬梅	4,671,150.00	0.04%
8	李玉茹	4,643,291.00	0.04%
9	苗春波	4,633,291.00	0.04%
10	戴建春	4,536,895.00	0.04%

第九章：开放式基金份额变动情况

本基金份额变动情况如下：

单位：份

基金合同生效日的基金份额总额	1,276,869,477.13
本报告期期初基金份额总额	504,652,280.24
本报告期期间总申购份额	13,608,033,681.51
本报告期期间总赎回份额	2,400,677,837.41
本报告期期末基金份额总额	11,712,008,124.34

第十章：重大事件揭示

- (一) 本报告期内未召开持有人大会。
- (二) 基金管理人在本报告期内重大人事变动情况：基金管理人于 2006 年 1 月 20 日发布关于董事变更的公告：经南方基金管理有限公司股东会议选举，杨进军先生、汤大杰先生任公司董事，陈虹、崔绍先不再担任公司董事。基金财产、基金托管业务在本报告期内没有发生诉讼事项。
- (三) 本报告期内基金托管人的基金托管部门未有重大人事变动。
- (四) 本报告期内本基金投资策略未改变。
- (五) 本报告期内本基金收益分配情况：
- ①本基金于 2006 年 1 月 18 日(权益登记日)对基金持有人分配红利，每 10 份基金单位 0.50 元。
- ②本基金于 2006 年 2 月 27 日(权益登记日)对基金持有人分配红利，每 10 份基金单位 0.50 元。
- ③本基金于 2006 年 3 月 27 日(权益登记日)对基金持有人分配红利，每 10 份基金单位 0.57 元。
- ④本基金于 2006 年 11 月 28 日(权益登记日)对基金持有人分配红利，每 10 份基金单位 7.47 元。
- (六) 本报告期内本基金会计师事务所改聘为普华永道中天会计师事务所，本年度支付给普华永道中天会计师事务所有限公司审计费用 75,000.00 元，该审计机构已提供审计服务的连续年限为 1 年。
- (七) 基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚的任何情形。
- (八) 基金租用证券公司专用交易席位的有关情况。

(1) 证券公司名称及席位数量、股票交易及支付佣金情况

券商名称	席位数量	股票成交金额	占成交总额比例	支付佣金	占佣金总量比例
广发证券股份有限公司	1	1,569,520,429.82	7.35%	1,286,957.52	7.47%
联合证券有限责任公司	1	5,465,323,904.83	25.58%	4,481,548.51	26.01%
湘财证券有限责任公司	1	4,123,834,116.45	19.30%	3,381,530.48	19.63%
华泰证券有限责任公司	1	3,016,674,726.55	14.12%	2,360,567.92	13.70%
国信证券有限责任公司	1	240,295,307.40	1.12%	197,042.10	1.14%
西北证券有限责任公司	1	--	--	--	--
中国银河证券有限责任公司	1	4,407,186,142.31	20.63%	3,448,646.12	20.02%
广州证券有限责任公司	1	1,289,470,919.26	6.04%	1,056,385.90	6.13%
兴业证券股份有限公司	1	299,165,993.61	1.40%	234,099.03	1.36%
中原证券股份有限公司	1	--	--	--	--
长江证券有限责任公司	1	--	--	--	--
申银万国证券有限公司	1	951,407,323.74	4.45%	780,147.80	4.53%
中信建投证券有限责任公司	1	--	--	--	--
齐鲁证券有限公司	1	--	--	--	--
合 计		21,362,878,863.97	100.00%	17,226,925.38	100.00%

(2) 债券、债券回购交易情况

券商名称	债券成交金额	占成交 总额比例	债券回购 成交金额	占成交 总额比例
广发证券股份有限公司	4,080,250.30	24.11%	--	--
联合证券有限责任公司	--	--	--	--
湘财证券有限责任公司	12,843,062.70	75.89%	--	--
华泰证券有限责任公司	--	--	88,350,000.00	31.26%
国信证券有限责任公司	--	--	--	--
西北证券有限责任公司	--	--	--	--
中国银河证券有限责任公司	--	--	--	--
广州证券有限责任公司	--	--	194,300,000.00	68.74%
兴业证券股份有限公司	--	--	--	--
中原证券股份有限公司	--	--	--	--
长江证券有限责任公司	--	--	--	--
申银万国证券有限公司	--	--	--	--
中信建投证券有限责任公司	--	--	--	--
齐鲁证券有限公司	--	--	--	--
合 计	16,923,313.00	100.00%	282,650,000.00	100.00%

(3) 权证交易情况

券商名称	权证成交金额	占成交 总额比例
广发证券股份有限公司	10,641,677.61	26.55%
联合证券有限责任公司	5,673,303.03	14.15%
湘财证券有限责任公司	9,103,459.94	22.71%
华泰证券有限责任公司	2,035,938.50	5.08%
国信证券有限责任公司	1,208,506.74	3.01%
西北证券有限责任公司	--	--
中国银河证券有限责任公司	659,184.83	1.64%
广州证券有限责任公司	10,761,296.91	26.85%
兴业证券股份有限公司	--	--
中原证券股份有限公司	--	--
长江证券有限责任公司	--	--
申银万国证券有限公司	--	--
中信建投证券有限责任公司	--	--
齐鲁证券有限公司	--	--
合 计	40,083,367.56	100.00%

(4) 本期租用证券公司席位的变更情况

本期新增 7 家证券公司的 7 个席位：广州证券有限责任公司（上海席位），兴业证券股份有限公司（深圳席位），中原证券股份有限公司（上海席位），长江证券有限责任公司（深圳席位），申银万国证券有限公司（上海席位），中信建投证券有限责任公司（深圳席位），齐鲁证券有限公司（上海席位）。

(5) 专用席位的选择标准和程序

根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》(证监基字<1998>29 号)的有关规定, 我公司制定了租用证券公司专用交易席位的选择标准和程序:

A: 选择标准

- 1、公司经营行为规范, 财务状况和经营状况良好;
- 2、公司具有较强的研究能力, 能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告;
- 3、公司内部管理规范, 能满足基金操作的保密要求;
- 4、建立了广泛的信息网络, 能及时提供准确的信息资讯服务。

B: 选择流程

公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比, 并根据评比的结果选择席位:

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座;
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实, 投资建议是否准确;
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

(八) 已在临时报告中披露过的本报告期内发生的其他重要事项(信息披露报纸为: 中国证券报、上海证券报、证券时报)

序号	其他重要事项	披露日期
1	南方基金管理有限公司增加开放式基金代销机构的公告	2006-12-19
2	关于恢复南方高增长基金申购业务的公告	2006-12-13
3	南方高增长基金(LOF)场内交易价格异常波动的提示性公告	2006-12-04
4	关于南方高增长基金提前结束限量持续销售活动的公告	2006-12-01
5	南方基金管理有限公司增加开放式证券投资基金代销机构的公告	2006-11-29
6	关于开展南方高增长基金限量持续销售活动的公告	2006-11-23
7	南方基金管理有限公司关于网上交易系统开通中国建设银行网上支付的公告	2006-11-09
8	交通银行关于网上银行基金申购费率优惠的公告	2006-10-30
9	南方基金管理有限公司关于增加德邦证券为基金代销机构的公告	2006-8-31
10	南方基金管理有限公司增加招商银行为南方现金增利、多利、积极配置和高增长等基金代销机构的公告	2006-8-31
11	关于重新开放申购南方稳健成长基金和南方高增长基金的公告	2006-8-04
12	南方基金管理有限公司关于开展网上交易费率优惠活动的公告	2006-7-31
13	南方基金增加西部证券为基金代销机构的公告	2006-7-03
14	南方基金管理有限公司关于开通上海银联、广州好易联网上交易的公告	2006-7-01
15	南方基金增加浦发银行为南方稳健等基金代销机构的公告	2006-6-26
16	南方基金关于暂停申购南方稳健成长基金和南方高增长基金的公告	2006-6-06
17	南方基金管理公司关于统一账户类业务确认数据发送时间的公告	2006-4-15
18	《南方基金关于推出南方高增长基金后端收费及持续销售的公告》的补充公告	2006-3-30
19	南方基金关于推出南方高增长基金后端收费及持续销售的公告	2006-3-29

20	南方基金关于开通南方积极配置基金与南方高增长基金转换的公告	2006-3-29
21	南方基金管理有限公司关于注册资本变更及股东出资转让的公告	2006-3-10
22	南方基金关于暂停申购南方积极配置基金和南方高增长基金的公告	2006-2-24

第十一章：备查文件

一、备查文件目录：

- 1、中国证监会批准设立南方高增长证券投资基金的文件。
- 2、南方高增长证券投资基金基金合同。
- 3、南方高增长证券投资基金托管协议。
- 4、中国证监会批准设立南方基金管理有限公司的文件。
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告。

二、存放地点：深圳市深南大道 4009 号投资大厦 7 楼

网址：投资者对本报告书若有疑问，可咨询本基金管理人南方基金管理有限公司。

咨询电话：400-889-8899

公司网站：<http://www.nffund.com>

南方基金管理有限公司

2007 年 3 月 27 日