

南方多利中短期债券投资基金

2007 年半年度报告

基金管理人：南方基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2007 年 8 月 29 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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 8 月 10 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告财务资料未经审计。

目 录

一、基金简介.....	4
二、主要财务指标和基金净值表现.....	5
三、管理人报告.....	5
四、托管人报告.....	7
五、财务会计报告.....	7
六、投资组合报告.....	12
七、基金份额持有人户数、持有人结构.....	16
八、开放式基金份额变动.....	16
九、重大事件揭示.....	16
十、备查文件目录.....	18

一、基金简介

(一) 基金名称：南方多利中短期债券投资基金

基金简称：南方多利

交易代码：202102

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2006 年 3 月 27 日

期末基金份额总额：520,866,062.00

(二) 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。

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。

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）。

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。

(三) 基金管理人

法定名称：南方基金管理有限公司

注册及办公地址：深圳市深南大道 4009 号投资大厦 7 楼

邮政编码：518048

法定代表人：吴万善

信息披露负责人：鲍文革

联系电话：0755-82912000

传真：0755-82912948

电子邮箱：manager@southernfund.com

(四) 基金托管人

法定名称：中国工商银行股份有限公司

注册及办公地址：北京市复兴门内大街 55 号

邮政编码：100032

法定代表人：姜建清

信息披露负责人：蒋松云

联系电话：010-66106720

传真：010-66106904

电子邮箱: songyun.jiang@icbc.com.cn

- (五) 基金选定的信息披露报纸: 中国证券报、上海证券报、证券时报
 登载半年度报告正文的管理人网址: <http://www.nffund.com>
 基金半年度报告置备地点: 基金管理人、基金托管人的办公地址

(六) 其他有关资料

注册登记机构名称: 南方基金管理有限公司

注册登记机构办公地址: 深圳市深南大道 4009 号投资大厦 7 楼

二、主要财务指标和基金净值表现

(一) 主要财务指标

财务指标	2007 年 6 月 30 日
1. 基金本期净收益	20,468,227.01
2. 基金份额本期净收益	0.0210
3. 期末可供分配基金收益	4,232,138.78
4. 期末可供分配基金份额收益	0.0081
5. 期末基金资产净值	524,066,462.08
6. 期末基金份额净值	1.0061
7. 基金加权平均净值收益率	2.09%
8. 本期基金份额净值增长率	1.45%
9. 基金份额累计净值增长率	3.46%

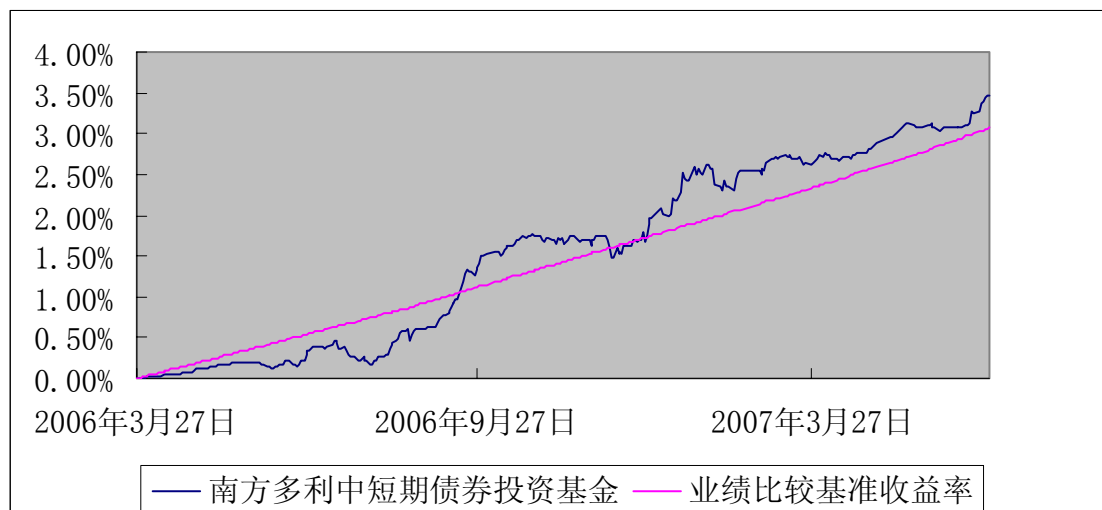
注: 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(二) 基金净值表现

1、净值增长率与同期业绩基准收益率比较表

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 1 个月	0.36%	0.04%	0.24%	0.01%	0.12%	0.03%
过去 3 个月	0.69%	0.03%	0.68%	0.01%	0.01%	0.02%
过去 6 个月	1.45%	0.06%	1.29%	0.01%	0.16%	0.05%
过去 1 年	3.07%	0.05%	2.50%	0.01%	0.57%	0.04%
自基金成立起至今	3.46%	0.04%	3.07%	0.01%	0.39%	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



三、管理人报告

(一) 基金管理人情况

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达 1,550 亿元,管理 3 只封闭式基金——分别为基金开元、基金天元、基金隆元;10 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、南方绩优成长基金和南方成份精选基金;以及多只全国社会保障基金、企业年金的投资组合。

(二) 基金管理团队

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,曾任南方现金增利证券投资基金经理(2005 年 3 月 10 日至 2006 年 1 月 18 日),现任公司总经理助理兼固定收益部总监。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,曾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。此外,南方多利中短期债券投资基金配备了若干名证券投资分析人员,协助从事南方多利中短期债券投资基金的投资管理工作。

(三) 基金运作的合规守信情况

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》、《证券投资基金运作管理办法》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、《南方多利中短期债券投资基金合同》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。

（四）基金的投资策略和业绩表现说明

半年度市场分析：目前通货膨胀压力有所增加，固定资产反弹压力增大，再考虑到为了抑制将要或已形成的资本市场的泡沫，货币政策或将处于趋紧的状态。在这样的前提之下，债券市场尤其是中长期债券市场难有良好的表现，债券市场仍将承受一定升息的风险和流动性压力

（五）宏观经济和证券市场展望

由于基金以中短期债券为投资目标，力争为客户分享中短期债券收益。由于债券市场目前仍承受较大的压力，我们的对策是尽量回避利率和流动性风险，具体做法是降低放大倍数、投资短期债券和浮动利率债券。此外，为了更好的为投资者服务，本基金正积极准备转型，拟放宽债券投资限制以及增加打新股功能，为投资者争取稳定的超额收益。本基金投资管理组积极配合，力争确保基金稳定转型，在下一步投资运作中，我们将密切关注宏观形势，调整组合仓位，尤其是加强流动性管理，争取为投资者获取安全稳定的收益。

四、托管人报告

托管人报告

2007年上半年，本基金托管人在对南方多利中短期债券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

2007年上半年，南方多利中短期债券投资基金的管理人——南方基金管理有限公司在南方多利中短期债券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、90日年化净值增长率计算、基金收益分配、基金费用开支等问题上，严格遵循《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规和基金合同的有关规定。

本托管人依法对南方基金管理有限公司在2007年上半年所编制和披露的南方多利中短期债券投资基金年度报告中财务指标、净值收益率、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行股份有限公司资产托管部

2007年8月20日

五、财务会计报告（未经审计）

（一）会计报表

资产负债表

资产	附注	2007 年 6 月 30 日	2006 年 12 月 31 日
银行存款	4.1	97,152.29	389,557.36
清算备付金		4,000,433.82	48,457,719.35

交易保证金			250,000.00
应收证券清算款			19,336,897.34
应收利息	4.2	6,984,352.94	19,751,317.62
应收申购款		5,047,905.41	
其他应收款		7,716,548.49	127,079.52
债券投资市值	4.3	632,683,850.83	2,006,609,670.70
其中：债券投资成本		633,143,246.52	2,001,026,798.08
买入返售证券			159,993,600.00
资产总计		656,530,243.78	2,254,915,841.89
负债与持有人权益			
负债			
应付证券清算款			
应付赎回款		266,375.19	
应付赎回费		3,676.60	
应付管理人报酬		223,053.22	923,571.06
应付托管费		74,351.06	307,856.99
应付销售服务费		148,702.18	615,714.03
应付佣金			
应付收益		1,562,522.84	
应付利息		12,579.94	312,125.12
其他应付款	4.4	266,222.17	319,386.60
卖出回购证券款		129,708,400.00	578,218,000.00
预提费用	4.5	197,898.50	99,900.00
负债合计		132,463,781.70	580,796,553.80
持有人权益			
实收基金	4.6	520,866,062.00	1,663,147,642.98
未实现利得	4.7	-1,031,738.70	7,244,288.47
未分配基金净收益		4,232,138.78	3,727,356.64
持有人权益合计		524,066,462.08	1,674,119,288.09
负债及持有人权益总计		656,530,243.78	2,254,915,841.89

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

经营业绩表及收益分配表

		2007 年 1-6 月	2006 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2006 年 6 月 30 日止期间
收入	附注		
股票差价收入			
债券差价收入	4.8	9,279,513.73	2,545,239.43
权证差价收入			
债券利息收入		18,204,934.15	33,026,799.07
存款利息收入		311,968.90	3,385,002.89
股利收入			
买入返售证券收入		182,522.34	5,141,885.62
其他收入			

收入合计		27,978,939.12	44,098,927.01
费用			
基金管理人报酬		2,223,659.73	8,522,047.27
基金托管费		741,219.88	2,840,682.44
基金销售服务费		1,482,439.90	5,681,364.87
卖出回购证券支出		2,781,382.05	1,957,884.52
其他费用	4.9	282,010.55	326,531.24
其中：交易费用		47,065.31	158,853.21
信息披露费		148,767.52	87,428.16
审计费用		44,630.98	41,142.72
费用合计		7,510,712.11	19,328,510.34
基金净收益		20,468,227.01	24,770,416.67
加：未实现估值增值变动数		-6,042,268.31	-995,760.64
基金经营业绩		14,425,958.70	23,774,656.03
本期基金净收益		20,468,227.01	24,770,416.67
加：期初未分配基金净收益		3,727,356.64	
加：本期申购基金单位的损益平准金		3,753,017.05	1,124,757.08
减：本期赎回基金单位的损益平准金		10,038,916.43	6,869,238.59
可供分配基金净收益		17,909,684.27	19,025,935.16
减：本期已分配基金净收益		13,677,545.49	9,327,430.61
期末未分配净收益		4,232,138.78	9,698,504.55

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

基金净值变动表

	2007 年 1-6 月	2006 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2006 年 6 月 30 日止期间
附注		
期初基金净值	1,674,119,288.09	8,977,113,995.82
本期经营活动		
基金净收益	20,468,227.01	24,770,416.67
未实现估值增值/(减值)变动数	-6,042,268.31	-995,760.64
经营活动产生的基金净值变动数	14,425,958.70	23,774,656.03
本期基金单位交易		
基金申购款	645,092,340.86	1,956,925,114.49
其中：分红再投资金额	2,949,790.77	1,226,551.89
基金赎回款	-1,795,893,580.08	-6,875,014,643.81
基金单位交易产生的基金净值变动数	-1,150,801,239.22	-4,918,089,529.32
本期向持有人分配收益	13,677,545.49	9,327,430.61
期末基金净值	524,066,462.08	4,073,471,691.92

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

（二）会计报表附注

- 1、半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表完全一致。
- 2、本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。
- 3、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	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	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

(b) 本基金在本报告期内未通过关联方席位进行的证券交易

(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 0.45% 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 $\times$ 0.45% / 当年天数。

本基金在本期需支付基金管理人报酬 2,223,659.73 元（2006 年 3 月 27 日至 2006 年 6 月 30 日止期间：8,522,047.27 元）。

(d) 基金托管费

支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.15% 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 $\times$ 0.15% / 当年天数。

本基金在本期需支付基金托管费 741,219.88 元（2006 年 3 月 27 日至 2006 年 6 月 30 日止期间：2,840,682.44 元）。

(e) 基金销售服务费

支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值 0.30% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给南方基金公司，再由南方基金公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日基金销售服务费 = 前一日基金资产净值 $\times$ 0.30% / 当年天数。本基金在本期需支付基金销售服务费 1,482,439.90 元（2006 年 3 月 27 日至 2006 年 6 月 30 日止期间：5,681,364.87 元）。

(f) 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的活期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。基金托管人于 2007 年 6 月 30 日保管的活期银行存款余额为 97,152.29 元（2006 年 6 月 30 日：988,935.27 元）。本期由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 184,032.54 元（2006 年 3 月 27 日至 2006 年 6 月 30 日止期间：2,006,394.00 元）。

(g) 与关联方通过银行间同业市场进行的债券交易

本基金在本期与基金托管人中国工商银行通过银行间同业市场进行的债券交易如下：

	2007 年 1-6 月	2006 年 3 月 27 日(基金)
--	--------------	---------------------

		合同生效日) 至 2006 年 6 月 30 日止期间
债券交易金额		2,302,287,132.05
卖出回购证券协议金额	114,100,000.00	200,008,200.00
卖出回购证券利息支出	39387.95	8,877.08

4、基金会计报表重要项目说明

(1) 银行存款

	2007 年 6 月 30 日	2006 年 6 月 30 日
活期银行存款	97,152.29	988,935.27
定期银行存款		300,000,000.00
	97,152.29	300,988,935.27

(2) 应收利息

	2007 年 6 月 30 日	2006 年 6 月 30 日
应收债券利息	5,908,931.65	41,133,709.06
应收活期银行存款利息	108.78	825.65
应收清算备付金利息	1,620.18	6,417.45
应收资产支持证券利息	1,073,692.33	427,825.88
应收定期银行存款利息		1,236,328.66
	6,984,352.94	42,805,106.70

(3) 投资估值增值

	2007 年 6 月 30 日	2006 年 6 月 30 日
债券投资	-459,395.69	-995,760.64
	-459,395.69	-995,760.64

(4) 其他应付款

	2007 年 6 月 30 日	2006 年 6 月 30 日
结算服务费	10,060.00	20,080.00
交易手续费	6,162.17	50,074.64
券商席位保证金	250,000.00	250,000.00
	266,222.17	320,154.64

(5) 预提费用

	2007 年 6 月 30 日	2006 年 6 月 30 日
审计费用	44,630.98	41,142.72
信息披露费	148,767.52	87,428.16
债券账户维护费	4,500.00	4,500.00
	197,898.50	133,070.88

(6) 实收基金

	2007 年 6 月 30 日	2006 年 6 月 30 日
期初数	1,663,147,642.98	
本期认购		8,977,113,995.82
本期申购	640,256,776.29	1,955,751,823.02
本期赎回	1,782,538,357.27	6,869,735,241.82

期末数	520,866,062.00	4,063,130,577.02
-----	----------------	------------------

(7) 未实现利得

	2007 年 6 月 30 日	2006 年 6 月 30 日
期初数	7,244,288.47	
未实现估值增值/(减值)变动数	-6,042,268.31	-995,760.64
本期申购基金单位的未实现损益平准金	1,082,547.52	48,534.39
本期赎回基金单位的未实现损益平准金	3,316,306.38	1,589,836.60
期末数	-1,031,738.70	642,610.35

(8) 债券差价收入

	2007 年 1-6 月	2006 年 3 月 27 日(基金合同生效日)至 2006 年 6 月 30 日止期间
卖出债券成交总额	2,246,053,582.90	6,943,276,643.83
减: 卖出债券成本总额	2,204,715,997.02	6,909,201,429.60
应收利息	32,058,072.15	31,529,974.80
债券差价收入	9,279,513.73	2,545,239.43

(9) 其他费用

	2007 年 1-6 月	2006 年 1-6 月
信息披露费	148,767.52	87,428.16
审计费用	44,630.98	41,142.72
交易费用	47,065.31	158,853.21
银行汇划费用	32,546.74	38,207.15
其他	9,000.00	900.00
	282,010.55	326,531.24

5、期末流通转让受到限制的基金资产

本基金截至 2007 年 6 月 30 日止从事银行间同业市场的债券回购交易形成的卖出回购证券款余额 129,708,400.00 元, 系以如下债券作为抵押:

债券名称	回购到期日	期末摊余成本单价	数量	期末摊余成本总额
06 农发 05	2007/07/02	99.80	1,337,200	133,450,248.11
合计				133,450,248.11

六、投资组合报告

(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	632,683,850.83	96.37%
银行存款和清算备付金合计	4,097,586.11	0.62%
其他资产	19,748,806.84	3.01%
合计	656,530,243.78	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	54,548,661.30	10.41%

金融债券	369,189,763.67	70.45%
央行票据	49,595,356.35	9.46%
企业债券	17,382,599.90	3.32%
资产支持证券	141,967,469.61	27.09%
合计	632,683,850.83	120.73%

(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	199,532,702.81	38.07%
2	06 农发 05	169,657,060.86	32.37%
3	澜电 01	65,799,188.30	12.56%
4	06 央票 76	49,595,356.35	9.46%
5	澜 电 02	32,993,672.53	6.30%

(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
应收利息	6,984,352.94
其他应收款	7,716,548.49
应收申购款	5,047,905.41
合 计	19,748,806.84

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	65,799,188.30	12.56%
2	119003	澜 电 02	330,000	32,993,672.53	6.30%
3	119005	浦建收益	200,000	13,170,732.00	2.51%
4	119006	宁建 01	300,000	30,003,876.78	5.73%

七、基金份额持有人户数、持有人结构

项 目	户/份额	占总份额的比例
基金份额持有人户数	16,907	
平均每户持有基金份额	30,807.72	
机构投资者持有的基金份额	7,038,172.30	1.35%
个人投资者持有的基金份额	513,827,889.70	98.65%

八、开放式基金份额变动

(一) 基金合同生效日基金份额总额：8,977,113,995.82

(二) 本期基金份额的变动情况

期初基金份额总额	1,663,147,642.98
期间基金总申购份额	640,256,776.29
期间基金总赎回份额	1,782,538,357.27

期末基金份额总额	520,866,062.00
----------	----------------

九、重大事件揭示

- 1、本报告期内未召开持有人大会。
- 2、基金托管人的专门基金托管部门在本报告期内没有发生重大人事变动。
- 3、基金管理人在本报告期内没有发生重大人事变动。
- 4、本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项
- 5、本报告期内本基金投资策略未改变。
- 6、本基金于本报告期内收益分配情况：

分红日期	基金份额分红金额
2007/01/31	0.004
2007/03/01	0.002
2007/03/30	0.002
2007/04/26	0.002
2007/05/28	0.002
2007/06/29	0.003

- 7、本报告期内本基金未更换会计师事务所。
- 8、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。
- 9、本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、支付佣金情况

券商名称	席位数量	支付佣金	占佣金总量比例
中国银河证券有限责任公司	2	-20,200.97	100.00%
合 计	2	-20,200.97	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
中国银河证券有限责任公司	955,673,097.30	100.00%	4,615,000,000.00	100.00%
合 计	955,673,097.30	100.00%	4,615,000,000.00	100.00%

(3) 本期租用证券公司席位变更情况：无。

- 10、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	关于增加交通银行代销南方稳健成长等 8 只基金并开办旗下基金定期定额申购业务的公告	2007-06-20
2	关于旗下基金在中国工商银行开展转换业务的公告	2007-06-07
3	关于旗下基金在直销网点开展转换业务的公告	2007-06-07
4	关于增加北京银行为南方稳健成长基金等 7 只开放式基金代销机构的公告	2007-05-30
5	关于增加华林证券为代销机构的公告	2007-04-12
6	关于 2007 年 4 月 10 日基金净值揭示的临时公告	2007-04-11
7	关于增加新时代证券为代销机构的公告	2007-04-06

8	关于增加江南证券为代销机构的公告	2007-03-12
9	南方现金增利基金和南方多利中短期债券基金春节前暂停申购的公告	2007-02-13
10	关于增加大同证券为代销机构的公告	2007-02-08
11	关于增加东海证券有限责任公司为代销机构的公告	2007-02-05

十、备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方多利中短期债券投资基金的文件。
- 2、南方多利中短期债券投资基金基金合同。
- 3、南方多利中短期债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。

投资者对本报告书若有疑问，可咨询本基金管理人。

客服电话：400-889-8899

公司网站：<http://www.nffund.com>

南方基金管理有限公司
二零零七年八月二十九日