

南方成份精选股票型证券投资基金 2010 年年度报告摘要

2010 年 12 月 31 日

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

报告送出日期：2011 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本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 2011 年 3 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2010 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	南方成份精选股票
基金主代码	202005
前端交易代码	202005
后端交易代码	202006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007 年 5 月 14 日
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
报告期末基金份额总额	11,944,144,943.73 份
基金合同存续期间	不定期

注：本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“南方成份”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在保持公司一贯投资理念基础上，通过对宏观经济和上市公司基本面的深入研究，采取定量和定性相结合方法，精选成份股，寻找驱动力型的领先上市公司，在控制风险的前提下追求获取超额收益。
投资策略	本基金在保持公司一贯投资理念的基础上，紧密把握和跟踪中国宏观经济周期、行业增长周期和企业成长周期，通过对行业的深入分析和上市公司基本面的研究，主要投资两类企业：1、驱动力型增长行业：通过对中国宏观经济的把握，根据对上下游行业运行态势与利益分配等因素的观察，考量行业增长周期，以确定对国民经济起主要驱动作用或作出重大贡献的行业/产业，从中优选代表性企业重点投资。2、行业领先型成

	长企业：强调处于企业成长生命周期的上升期，或面临重大的发展机遇，具备超常规增长潜力的上市公司。通过投资此两类公司，进而为本基金获取中长期稳健的资产增值。
业绩比较基准	80%×沪深 300 指数+20%×上证国债指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于风险收益配比较高的品种

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		南方基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	赵会军
	联系电话	0755-82763888	010-66105799
	电子邮箱	manager@southernfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-889-8899	95588
传真		0755-82763889	010-66105798

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2010 年	2009 年	2008 年
本期已实现收益	1,539,192,465.31	934,156,793.56	-6,094,953,817.10
本期利润	-908,355,538.83	5,653,932,971.79	-13,552,478,386.42
加权平均基金份额本期利润	-0.0708	0.3748	-0.7769
本期基金份额净值增长率	-6.56%	53.18%	-52.84%
3.1.2 期末数据和指标	2010 年末	2009 年末	2008 年末
期末可供分配基金份额利润	0.2097	0.1114	0.0404
期末基金资产净值	11,372,535,936.91	13,938,432,963.84	10,986,589,850.80
期末基金份额净值	0.9521	1.0392	0.6784

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2. 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额，不是当期发生数)。

3. 所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。

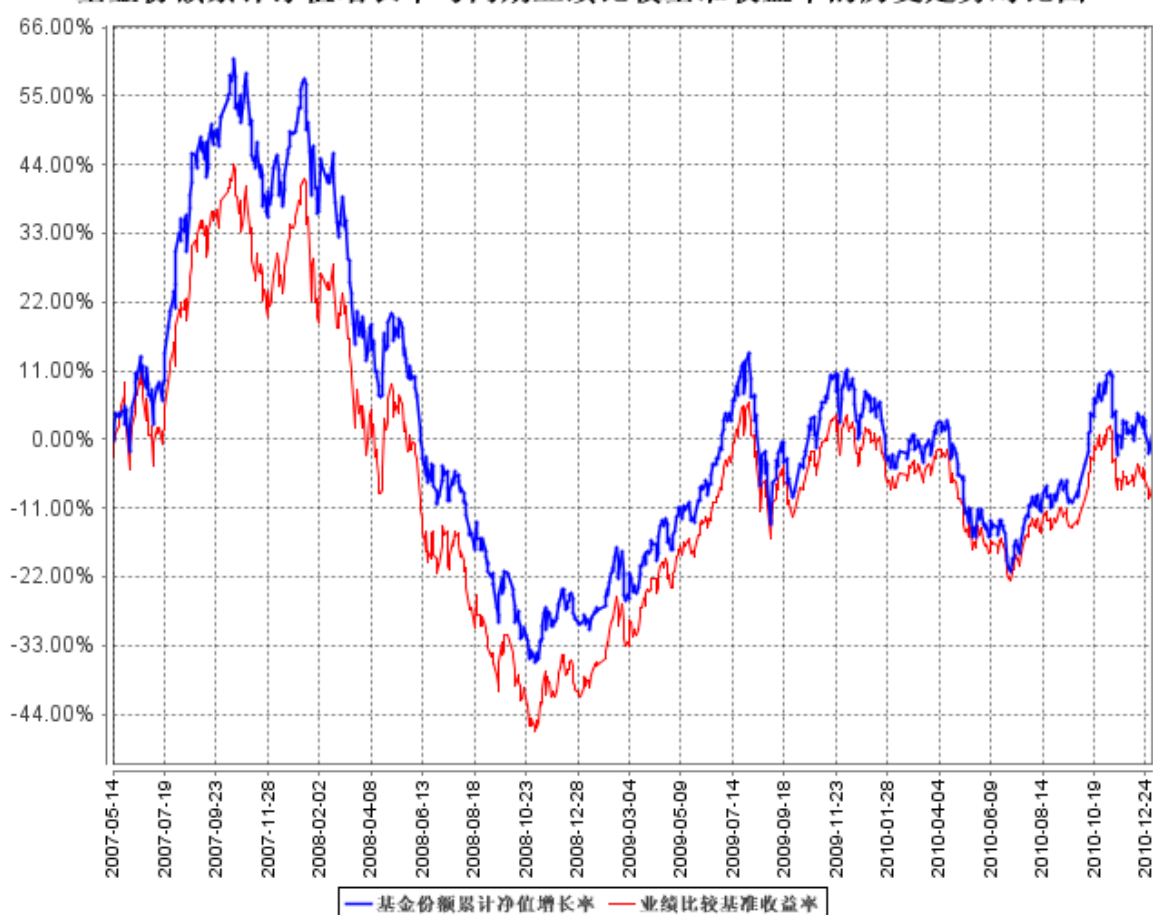
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 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	8.32%	1.69%	5.31%	1.42%	3.01%	0.27%
过去六个月	24.96%	1.46%	17.68%	1.24%	7.28%	0.22%
过去一年	-6.56%	1.47%	-9.12%	1.26%	2.56%	0.21%
过去三年	-32.49%	1.75%	-30.86%	1.86%	-1.63%	-0.11%
自基金转型 起至今	-2.90%	1.75%	-7.42%	1.86%	4.52%	-0.11%

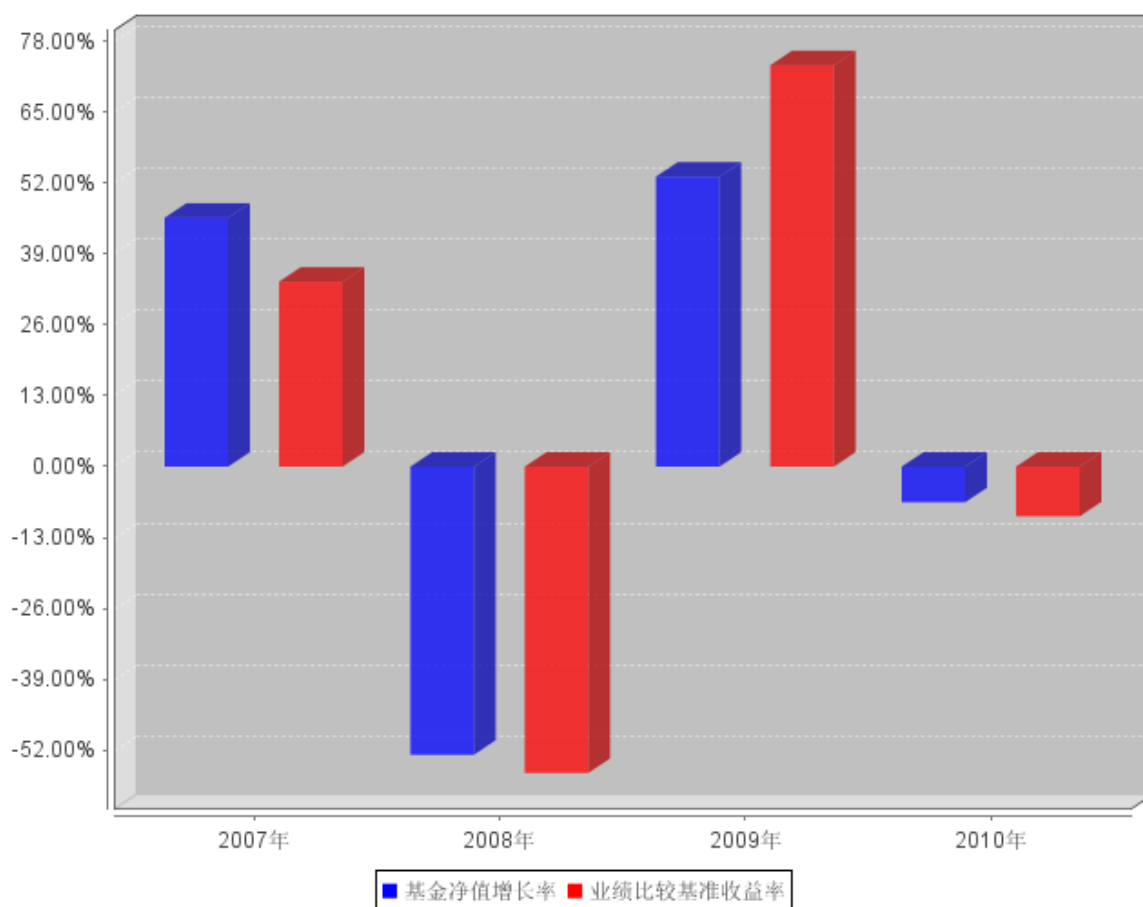
3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2010	0.2000	127,054,070.47	123,234,449.63	250,288,520.10	
2009	-	-	-	-	
2008	-	-	-	-	
合计	0.2000	127,054,070.47	123,234,449.63	250,288,520.10	

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 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。2000年，经中国证监会证监基金字[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金字[2005]201号文批准进行增资扩股，注册资本达1.5亿元人民币。2010年，经证监许可[2010]1073号文核准深圳市机场（集团）有限公司将其持有的30%股权转让给深圳市投资控股有限公司。目前股权结构：华泰证券股份有限公司45%、深圳市投资控股有限公司30%、厦门国际信托有限公司15%及兴业证券股份有限公司10%。

截至报告期末,公司管理资产规模达 1,800 多亿元,管理 2 只封闭式基金——基金开元、基金天元; 24 只开放式基金——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、南方多利增强债券型基金、南方稳健成长贰号基金、南方绩优成长基金、南方成份精选基金、南方隆元产业主题基金、南方全球精选配置基金(QDII 基金)、南方盛元红利股票型基金、南方优选价值股票型基金、南方恒元保本混合型基金、南方沪深 300 指数基金、南方中证 500 指数基金、深证成份交易型开放式指数基金、南方深证成份交易型开放式指数基金联接基金、南方策略优化股票型基金、中证南方小康产业交易型开放式指数基金、中证南方小康产业交易型开放式指数基金联接基金、南方广利回报债券型基金和南方金砖四国指数基金(QDII 基金); 以及多个全国社保、企业年金和专户理财投资组合。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈键	本基金的基金经理	2010 年 10 月 16 日	-	10	硕士学历,具有基金从业资格。2000 年加入南方基金,历任行业研究员、基金经理助理,2003 年 11 月-2005 年 6 月,任南方宝元基金经理;2004 年 3 月-2005 年 3 月,任南方现金基金经理;2005 年 3 月-2006 年 3 月,任南方积配基金经理;2006 年 3 月至今,任天元基金经理;2008 年 2 月至 2010 年 10 月,任南方盛元基金经理。2010 年 10 月至今,任南方成份基金经理。
应帅	本基金的基金经理	2007 年 5 月 10 日	-	9	北大光华管理学院管理学硕士,具有基金从业资格。曾担任长城基金管理公司行业研究员,2007 年加入南方基金管理,2007 年 5 月至 2009 年 2 月,任南方宝元基金经理;2007 年 5 月至今,任南方成份基金经理。2010 年 12 月至今,任南方宝元基金经理。
张慎平	本基金的基金经理	2008 年 4 月 10 日	-	7	注册金融分析师(CFA),经济学硕士,具有基金从业资格。2003 年加入南方基金,负责石化化工、建筑建材行业研究,2008 年 1 月至 2010 年 1 月,任南方积配基金经理,2008 年 4 月至 2011 年 2 月,任南方成份基金经理。2010 年 1 月至 2011 年 2 月,任南方稳健、南稳贰号基金经理。
欧阳凡	本基金的基金经理助理	2008 年 1 月 14 日	-	4	北京大学金融学硕士,2007 年加入南方基金,现任 TMT 行业、中小股票首席研究员;2008 年 1 月至今,任南方

	理				绩优、南方成份基金经理助理。
吴国清	本基金的基金经理助理	2010年10月18日		3	清华大学经济学博士,2007年加入南方基金,现任有色金属行业首席研究员;2010年10月至今,任南方成份基金经理助理。

注:1. 对基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,“离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期,对此后的非首任基金经理,“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3. 南方基金管理公司于2011年2月17日刊登调整基金经理的公告,免去张慎平先生南方成份精选股票型证券投资基金基金经理职务。调整后,南方成份精选股票型证券投资基金将由陈键先生、应帅先生共同管理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《南方成份精选股票型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,没有损害基金持有人利益。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。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,完善相应制度及流程,通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金管理人没有管理与本基金投资风格相似的其他投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金在上半年主要采取相对均衡的配置策略,仓位维持稳定。在行业配置方面,相对看好以内需增长为主要增长驱动力的消费、医药等内需型行业,行业内选股坚持寻找领先型成长企业的策略。进入下半年,随着市场在三季度触底反弹,以消费和医药为代表的内需型行业在短暂调整后开始大幅度回升,以汽车和工程机械为代表的低估值周期类板块在大幅度调整后获得了超额收益,而以金融地产、钢铁和航运为代表的周期类股票继续进行调整。本基金在相对均衡配置的情况下,超配了家电、汽车和消费品行业,仓位维持较高水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2010 年全年沪深 300 指数下跌 12.51%，成份精选净值增长率为-6.56%，业绩基准为-9.12%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2011 年一季度，中国宏观经济处于“高经济增长、高通胀压力”的运行态势中，一方面全球流动性仍然受到美国量化宽松货币政策的影响处于比较充裕状态，这一点从美国 10 年期国债收益率仍基本处于过去两年来的中轴水平，以及我国 2011 年 1 月份的新增外汇占款仍上升较快都可以观察出来，充裕的流动性在支持需求复苏的同时，也给全球带来了较大的通胀压力；另一方面，国内的经济增长动力强劲，工业企业盈利普遍改善，ROE 水平接近历史高位，进入 2011 年，部分行业的月度数据已经显示出相比 2010 年继续高速增长的良好态势。虽然政策面为了对冲通胀压力和防止资产泡沫，继续出台了上调存款准备金、加息、房产限购等一系列紧缩措施，货币市场利率水平也相对高企，但是股票市场并未出现恐慌下跌，表现出在流动性充裕和权重行业低估值下的韧性。

展望下一阶段，成份精选基金在选择驱动行业层面，将重点着眼于内需消费和先进制造两大领域，在行业内挖掘企业时，将着重寻找能够通过资源优势、品牌优势或管理优势，持续提高市场占有率和利润水平的领先企业。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括督察长、数量化投资部总监、监察稽核总监及基金会计负责人等。其中，超过三分之二以上的人员具有 10 年以上的基金从业经验，且具有风控、合规、会计方面的专业经验。同时，根据基金管理公司制订的相关制度，负责估值工作决策和执行的机构成员中不包括基金经理。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，本基金的收益分配原则为：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，全年分配比例不得低于年度可供分配收益的 90%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红，但未经确权的基金份额默认方式是红利再投资；基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述收益分配原则，本报告期内本基金在满足分红条件的情况下，于 2010 年 11 月 1 日进行了收益分配，每 10 份派 0.20 元。本基金将在满足分红条件的情况下继续安排分红。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2010年，本基金托管人在对南方成份精选股票型证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。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2010年，南方成份精选股票型证券投资基金的管理人——南方基金管理有限公司在南方成份精选股票型证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、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，南方成份精选股票型证券投资基金对基金份额持有人进行了一次利润分配，分配金额为250,288,520.10元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对南方基金管理有限公司编制和披露的南方成份精选股票型证券投资基金2010年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、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。

§ 6 审计报告

本基金 2010 年年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所有限公司审计，注册会计师签字出具了普华永道中天审字(2011)第 20314 号“标准无保留意见的审计报告”，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：南方成份精选股票型证券投资基金

报告截止日：2010年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.4.5	637,138,858.04	629,943,036.25
结算备付金		21,040,830.05	-
存出保证金		1,310,889.08	3,201,715.14
交易性金融资产		10,816,028,064.59	13,695,643,905.97
其中：股票投资		10,166,473,333.59	12,997,952,467.77
基金投资		-	-
债券投资		649,554,731.00	697,691,438.20

资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		150,000,000.00	41,665,997.10
应收利息		8,749,938.35	380,492.99
应收股利		-	-
应收申购款		1,574,581.95	494,972.29
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		11,635,843,162.06	14,371,330,119.74
负债和所有者权益	附注号	本期期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	350,063,354.90
应付证券清算款		227,410,559.79	30,887,191.61
应付赎回款		3,451,733.22	20,244,617.75
应付管理人报酬		14,679,666.57	17,744,382.97
应付托管费		2,446,611.08	2,957,397.18
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		14,119,634.23	9,488,969.07
应交税费		427,228.96	427,228.96
应付利息		-	46,312.29
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		771,791.30	1,037,701.17
负债合计		263,307,225.15	432,897,155.90
所有者权益:			
实收基金		3,726,487,485.53	4,184,537,955.08
未分配利润		7,646,048,451.38	9,753,895,008.76
所有者权益合计		11,372,535,936.91	13,938,432,963.84
负债和所有者权益总计		11,635,843,162.06	14,371,330,119.74

注：报告截止日 2010 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9521 元，基金份额总额 11,944,144,943.73 份。

7.2 利润表

会计主体：南方成份精选股票型证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日

一、收入		-644,149,773.91	5,958,160,694.07
1. 利息收入		15,141,329.48	50,734,159.26
其中：存款利息收入		3,509,105.49	3,874,181.30
债券利息收入		11,411,893.69	46,859,977.96
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		220,330.30	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,787,747,508.00	1,186,672,199.74
其中：股票投资收益		1,684,174,139.05	1,063,239,357.05
基金投资收益		-	-
债券投资收益		1,589,924.46	26,547,926.34
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	250,440.70
股利收益		101,983,444.49	96,634,475.65
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-2,447,548,004.14	4,719,776,178.23
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		509,392.75	978,156.84
减：二、费用		264,205,764.92	304,227,722.28
1. 管理人报酬	7.4.4.2.1	176,946,572.39	200,606,940.29
2. 托管费	7.4.4.2.2	29,491,095.47	33,434,490.17
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		57,210,409.64	69,145,584.85
5. 利息支出		67,175.03	548,860.57
其中：卖出回购金融资产支出		67,175.03	548,860.57
6. 其他费用		490,512.39	491,846.40
三、利润总额		-908,355,538.83	5,653,932,971.79
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-908,355,538.83	5,653,932,971.79

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方成份精选股票型证券投资基金

本报告期：2010年1月1日至2010年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	4,184,537,955.08	9,753,895,008.76	13,938,432,963.84
二、本期经营活动产生的基	-	-908,355,538.83	-908,355,538.83

金净值变动数（本期利润）			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-458,050,469.55	-949,202,498.45	-1,407,252,968.00
其中：1. 基金申购款	161,811,094.44	351,054,030.55	512,865,124.99
2. 基金赎回款	-619,861,563.99	-1,300,256,529.00	-1,920,118,092.99
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-250,288,520.10	-250,288,520.10
五、期末所有者权益（基金净值）	3,726,487,485.53	7,646,048,451.38	11,372,535,936.91
	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日		
项目	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	5,052,636,416.73	5,933,953,434.07	10,986,589,850.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,653,932,971.79	5,653,932,971.79
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-868,098,461.65	-1,833,991,397.10	-2,702,089,858.75
其中：1. 基金申购款	106,209,621.08	202,350,259.05	308,559,880.13
2. 基金赎回款	-974,308,082.73	-2,036,341,656.15	-3,010,649,738.88
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	4,184,537,955.08	9,753,895,008.76	13,938,432,963.84

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

高良玉
基金管理公司负责人

鲍文革
主管会计工作负责人

鲍文革
会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明
本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告完全一致。

7.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.2.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.2.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.2.3 差错更正的说明

无。

7.4.3 关联方关系

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
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
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
厦门国际信托有限公司	基金管理人的股东
深圳市投资控股有限公司(i)	基金管理人的股东(2010年9月10日起)
深圳市机场(集团)有限公司(i)	基金管理人的原股东(2010年9月10日前)

注：(i) 根据基金管理人南方基金公司 2009 年第一次临时股东会会议决议以及中国证监会证监许可[2010]1073 号《关于核准南方基金管理有限公司变更股权的批复》核准，深圳市投资控股有限公司受让深圳市机场(集团)有限公司持有的南方基金公司 30%的股权，南方基金公司于 2010 年 9 月 10 日完成了工商登记变更手续。

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例(%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例(%)
兴业证券	1,546,672,542.41	4.20	-	-
华泰证券	1,173,999,301.38	3.19	10,183,316,721.16	22.60

7.4.4.1.2 权证交易

无。

7.4.4.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日

	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例 (%)
兴业证券	1,256,681.68	4.08	1,167,556.52	8.27
华泰证券	973,556.51	3.16	458,066.50	3.24
关联方名称	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例 (%)
华泰证券	8,655,773.37	22.90	1,049,359.05	11.06
兴业证券	-	-	-	-

注：1. 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和经手费后的净额列示。

2. 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等。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010 年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	176,946,572.39	200,606,940.29
其中：支付给销售机构的客户维护费	25,796,318.01	28,999,139.84

注：支付基金管理人南方基金公司的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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12 月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31 日
当期发生的基金应支付的托管费	29,491,095.47	33,434,490.17

注：支付基金托管人中国工商银行的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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2010年1月1日至2010年12月31日

银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行	-	-	-	-	500,080,000.00	87,185.30

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2007 年 5 月 14 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	85,535,431.62	85,535,431.62
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	85,535,431.62	85,535,431.62
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.72%	0.64%

7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期		上年度可比期间	
	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日		2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	637,138,858.04	3,335,487.29	629,943,036.25	3,614,997.59

注：本基金的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。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期					
2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：份）	总金额

华泰证券	601288	农业银行	首次公 开发行	15,797,424	42,337,096.32
上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:份)	总金额
华泰证券	601117	中国化学	首次公 开发行	2,435,680	13,225,742.40

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.5 期末(2010年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.5.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601933	永辉超市	2010年12月9日	2011年3月15日	网下申购	23.98	31.24	49,465	1,186,170.70	1,545,286.60	
600998	九州通	2010年10月27日	2011年2月9日	网下申购	13.00	14.55	89,034	1,157,442.00	1,295,444.70	
601126	四方股份	2010年12月28日	2011年3月31日	网下申购	23.00	31.11	26,982	620,586.00	839,410.02	
合计	-	-	-	-	-	-	-	2,964,198.70	3,680,141.32	

7.4.5.1.2 受限证券类别:债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注

7.4.5.1.3 受限证券类别:权证										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:份)	期末成本总额	期末估值总额	备注

注:基金可使用以基金名义开设的股票账户,选择网上或者网下一种方式进行新股申购。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,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外,基金还可作为特定投资者,认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票,所认购的股票自发行结束之日起12个月内不得转让。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600518	康美药业	2010年12月28日	配股停牌	19.71	2011年1月6日	17.29	9,561,672	139,687,899.06	188,460,555.12	-
600816	安信信托	2010年6月2日	重大事项公告	13.60	未知	未知	9,148,394	182,280,420.80	124,418,158.40	-
600664	哈药股份	2010年12月29日	资产重组	22.57	2011年2月16日	24.83	1,923,800	43,903,009.50	43,420,166.00	-
合计	-	-	-	-	-	-	-	365,871,329.36	356,298,879.52	-

注：本基金截至 2010 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	10,166,473,333.59	87.37
	其中：股票	10,166,473,333.59	87.37
2	固定收益投资	649,554,731.00	5.58
	其中：债券	649,554,731.00	5.58
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	658,179,688.09	5.66
6	其他各项资产	161,635,409.38	1.39
7	合计	11,635,843,162.06	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	943,278,058.93	8.29
C	制造业	5,081,609,024.56	44.68
C0	食品、饮料	1,500,623,083.48	13.20

C1	纺织、服装、皮毛	20,177,659.32	0.18
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	234,788,808.60	2.06
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	888,700,779.05	7.81
C7	机械、设备、仪表	1,689,366,802.09	14.85
C8	医药、生物制品	704,676,871.86	6.20
C99	其他制造业	43,275,020.16	0.38
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	327,634,632.59	2.88
F	交通运输、仓储业	104,811,350.69	0.92
G	信息技术业	379,589,766.59	3.34
H	批发和零售贸易	593,566,478.93	5.22
I	金融、保险业	2,025,007,972.72	17.81
J	房地产业	649,404,353.73	5.71
K	社会服务业	4,012,473.20	0.04
L	传播与文化产业	12,708,937.50	0.11
M	综合类	44,850,284.15	0.39
	合计	10,166,473,333.59	89.39

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000568	泸州老窖	11,922,202	487,618,061.80	4.29
2	600362	江西铜业	10,125,930	457,388,258.10	4.02
3	000527	美的电器	19,729,223	343,288,480.20	3.02
4	600036	招商银行	25,871,066	331,408,355.46	2.91
5	000063	中兴通讯	10,923,093	298,200,438.90	2.62
6	601318	中国平安	4,601,320	258,410,131.20	2.27
7	000002	万科A	31,093,471	255,588,331.62	2.25
8	600875	东方电气	7,201,573	251,334,897.70	2.21
9	600739	辽宁成大	8,331,074	250,931,948.88	2.21
10	600887	伊利股份	6,430,134	246,016,926.84	2.16

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 <http://www.nffund.com> 的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000568	泸州老窖	481,934,281.04	3.46
2	600362	江西铜业	426,382,365.65	3.06
3	601939	建设银行	315,493,297.47	2.26
4	000063	中兴通讯	307,411,733.60	2.21
5	600015	华夏银行	287,212,148.42	2.06
6	000002	万科 A	283,167,200.01	2.03
7	601318	中国平安	275,939,993.47	1.98
8	000001	深发展 A	268,158,077.88	1.92
9	601988	中国银行	265,073,704.15	1.90
10	000651	格力电器	252,892,952.04	1.81
11	600887	伊利股份	252,486,950.12	1.81
12	600875	东方电气	246,840,555.03	1.77
13	600348	国阳新能	245,225,727.80	1.76
14	600547	山东黄金	236,086,254.65	1.69
15	000527	美的电器	223,571,380.44	1.60
16	600489	中金黄金	221,162,553.03	1.59
17	600048	保利地产	218,135,274.84	1.56
18	000983	西山煤电	214,009,657.52	1.54
19	000039	中集集团	213,529,758.26	1.53
20	000024	招商地产	207,142,239.70	1.49

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600000	浦发银行	521,054,810.71	3.74
2	000001	深发展 A	515,123,235.10	3.70
3	600030	中信证券	363,105,576.74	2.61
4	000983	西山煤电	351,266,443.48	2.52
5	000009	中国宝安	349,322,560.20	2.51
6	600016	民生银行	342,655,788.36	2.46
7	600837	海通证券	323,706,615.89	2.32
8	600019	宝钢股份	312,595,742.89	2.24
9	600348	国阳新能	306,714,796.20	2.20

10	600015	华夏银行	302,821,938.44	2.17
11	601088	中国神华	299,331,004.68	2.15
12	000758	中色股份	293,164,810.51	2.10
13	000528	柳 工	273,337,907.42	1.96
14	600036	招商银行	255,419,365.79	1.83
15	601988	中国银行	250,619,163.56	1.80
16	601628	中国人寿	246,896,024.15	1.77
17	600089	特变电工	241,852,952.84	1.74
18	000898	鞍钢股份	238,389,534.16	1.71
19	000039	中集集团	230,089,222.49	1.65
20	600221	海南航空	222,819,965.51	1.60

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	17,467,891,046.65
卖出股票收入（成交）总额	19,509,564,522.94

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	344,870,000.00	3.03
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	304,684,731.00	2.68
7	其他	-	-
8	合计	649,554,731.00	5.71

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113001	中行转债	2,732,450	300,186,957.00	2.64
2	1001015	10 央行票据 15	2,000,000	195,760,000.00	1.72
3	0801017	08 央行票据 17	1,000,000	100,120,000.00	0.88
4	1001005	10 央票 05	500,000	48,990,000.00	0.43

5	110011	歌华转债	36,600	4,497,774.00	0.04
---	--------	------	--------	--------------	------

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 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。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,310,889.08
2	应收证券清算款	150,000,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	8,749,938.35
5	应收申购款	1,574,581.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	161,635,409.38

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113001	中行转债	300,186,957.00	2.64

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
----	------	------	-------------	---------------	----------

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
574,960	20,773.87	261,602,936.47	2.19%	11,682,542,007.26	97.81%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	495,801.88	0.0042%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2007年5月14日)基金份额总额	500,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	13,412,270,384.92
本报告期基金总申购份额	518,640,553.14
减:本报告期基金总赎回份额	1,986,765,994.33
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	11,944,144,943.73

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人、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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

2009年6月18日,中国国际经济贸易仲裁委员会向我公司送达通知,南方稳健成长贰号证券投资基金的基金份额持有人袁近秋就该基金2007年度的基金分红问题,对我公司提出了仲裁申请,要求本公司赔偿其红利损失及相应利息共计66586.52元,退还管理费2041.49元,争议标的总额为人民币68628.01元。

2010年3月26日,中国国际经济贸易仲裁委员会向我公司送达(2010)中国贸仲京裁字第0152号《裁决书》,驳回申请人袁近秋的赔偿请求,具体裁决如下:(一)被申请人应向南方稳健成长贰号证券投资基金退还管理费计人民币702.71元。(二)本案仲裁费为人民币5011元,由申请人承担人民币1002.20元,由被申请人承担人民币4008.80元。(三)驳回申请人的其他仲裁请求。

2010年10月28日,北京市第一中级人民法院向我公司送达通知,袁近秋向该院申请撤销中国国际经济贸易仲裁委员会于2010年3月25日作出的(2010)中国贸仲京裁字第0152号仲裁裁决。

2010年12月7日,经审理,北京市第一中级人民法院向我公司送达(2010)一中民特字第16746号《民事裁定书》,具体裁定如下:

驳回袁近秋提出的撤销中国国际经济贸易仲裁委员会作出的(2010)中国贸仲京

裁字第 0152 号仲裁裁决的申请。

案件受理费四百元，由袁近秋负担。

本裁定为终审裁定。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内聘请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 164,000 元。该审计机构已提供审计服务的连续年限为 5 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券股份有限公司	1	6,017,822,278.10	16.35%	4,989,844.20	16.21%	终止深圳交易单元 更换上海交易单元
中国银河证券股份有限公司	2	4,817,133,209.22	13.09%	3,993,015.37	12.97%	更换上海深圳交易单元
国泰君安证券股份有限公司	1	4,296,201,152.36	11.68%	3,651,755.52	11.86%	更换上海交易单元
华林证券华林证券有限责任公司	1	3,014,847,982.30	8.19%	2,562,607.11	8.33%	
申银万国证券股份有限公司	1	2,588,603,942.69	7.03%	2,102,889.42	6.83%	新增深圳交易单元
渤海证券股份有限公司	1	2,008,643,394.01	5.46%	1,632,035.50	5.30%	新增深圳交易单元
安信证券股份有限公司	1	1,713,558,518.74	4.66%	1,456,516.97	4.73%	
东方证券股份有限公司	0	1,694,175,387.99	4.60%	1,440,040.24	4.68%	已取消
兴业证券股份有限公司	1	1,546,672,542.41	4.20%	1,256,681.68	4.08%	新增深圳交易单元
东北证券股份有限公司	1	1,503,316,345.73	4.09%	1,277,817.01	4.15%	新增上海交易单元
广发证券股份有限公司	1	1,368,744,871.94	3.72%	1,163,432.42	3.78%	新增上海交易单元
中国国际金融有限公司	0	1,323,281,977.45	3.60%	1,124,786.81	3.65%	已取消
光大证券股份有限公司	1	1,174,125,032.11	3.19%	998,005.47	3.24%	新增上海交易单元
华泰证券股份有限公司	1	1,173,999,301.38	3.19%	973,556.51	3.16%	新增深圳交易单元 终止上海交易单元
中信建投证券有限责任公司	1	1,127,785,437.55	3.06%	958,609.07	3.11%	新增上海交易单元
齐鲁证券有限公司	1	807,235,506.00	2.19%	677,352.80	2.20%	新增深圳交易单元 终止上海交易单元
国金证券股份有限公司	1	478,306,566.74	1.30%	406,555.08	1.32%	新增上海交易单元
国信证券股份有限公司	1	143,192,738.52	0.39%	116,344.92	0.38%	新增上海交易单元

国都证券有限责任公司	0	-	-	-	-	已取消
财通证券有限责任公司	0	-	-	-	-	已取消
国盛证券有限责任公司	0	-	-	-	-	已取消
华融证券股份有限公司	0	-	-	-	-	已取消
世纪证券有限责任公司	0	-	-	-	-	已取消
华鑫证券有限责任公司	0	-	-	-	-	已取消
江南证券有限责任公司	0	-	-	-	-	已取消
南京证券有限责任公司	0	-	-	-	-	已取消
中信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增深圳交易单元

注：为节约交易单元资源，我公司在交易所交易系统升级的基础上，对同一银行托管基金进行了席位整合。

本基金原使用的交易单元为 20 个，报告期内更新为 18 个。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	311,472.00	4.03%	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华林证券华林证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
申银万国证券股份有限公司	7,418,909.94	95.96%	-	-	-	-
渤海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	1,256.00	0.02%	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

国都证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
财通证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华融证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
世纪证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华鑫证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
江南证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
南京证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

注：交易单元的选择标准和程序

根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

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。