

# 南方宝元债券型基金 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	南方宝元债券
基金主代码	202101
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2002 年 9 月 20 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	1,377,469,277.39 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“南方宝元”。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为开放式债券型基金，以债券投资为主，股票投资为辅，在保持投资组合低风险和充分流动性的前提下，确保基金安全及追求资产长期稳定增值。
投资策略	南方宝元债券型基金采取自上而下的投资策略，通过对宏观经济形势以及财政货币政策的深入分析，确定资产配置的指导原则，在此基础上依照收益率与风险特征对不同金融产品的投资比例进行合理配置，并随投资环境的变化及时做出调整。力争在控制利率风险与市场风险的同时，为投资者获取稳定收益。
业绩比较基准	南方宝元债券型基金采用“75%交易所国债指数+25%(上证 A 股指数+深证 A 股指数)”为业绩比较基准。
风险收益特征	南方宝元债券型基金属于证券投资基金中的低风险品种，其风险收益配

	比关系为低风险、适度收益。
--	---------------

## 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

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
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	104,906,753.71	358,997,114.94	-337,309,868.37
本期利润	82,141,944.85	357,042,907.56	-472,336,893.17
加权平均基金份额本期利润	0.0517	0.1665	-0.2136
本期基金份额净值增长率	4.91%	18.34%	-16.72%
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	0.1058	0.0588	-0.0964
期末基金资产净值	1,657,430,488.49	1,918,138,766.24	1,916,744,583.13
期末基金份额净值	1.2032	1.1671	0.9862

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

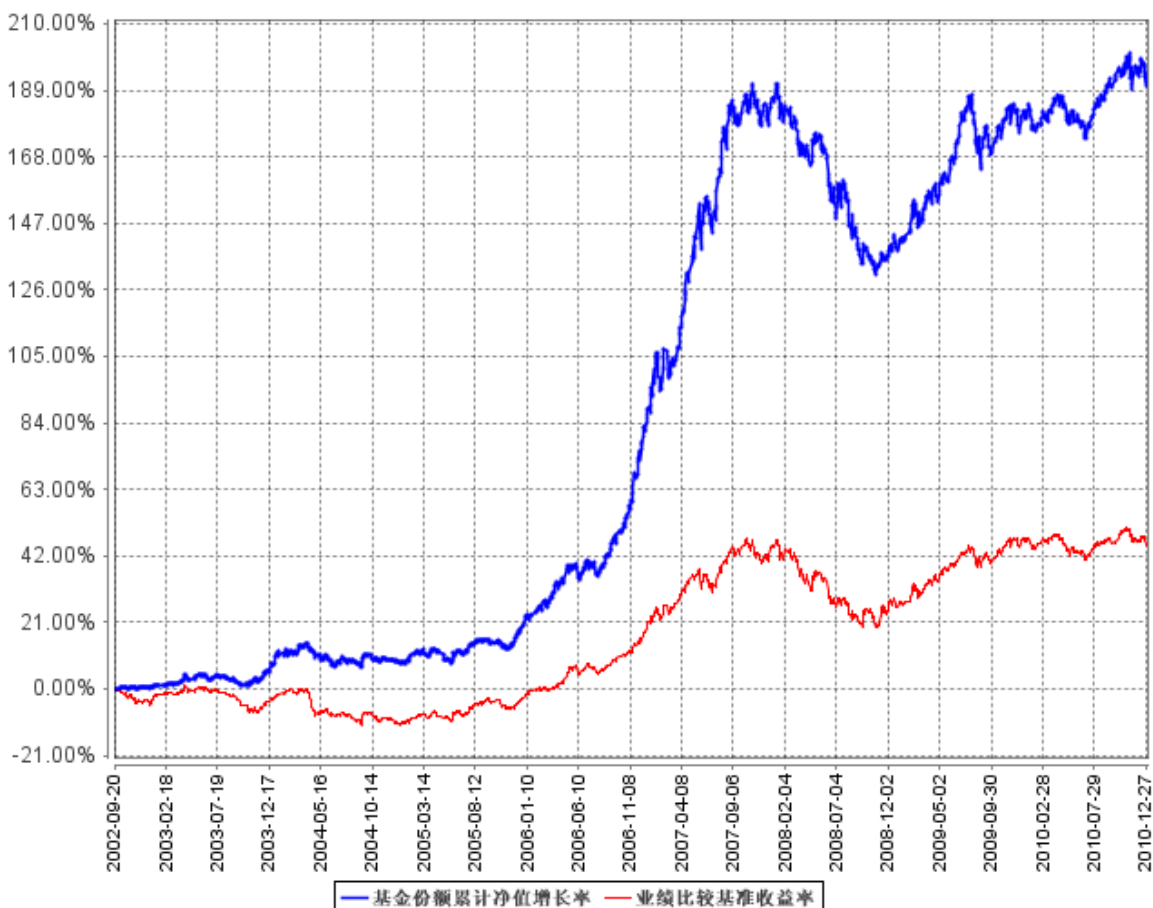
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.76%	0.61%	-0.17%	0.42%	0.93%	0.19%
过去六个月	7.66%	0.49%	3.79%	0.37%	3.87%	0.12%
过去一年	4.91%	0.45%	-0.67%	0.37%	5.58%	0.08%

过去三年	3.39%	0.57%	1.13%	0.54%	2.26%	0.03%
过去五年	146.35%	0.67%	51.13%	0.52%	95.22%	0.15%
自基金合同生效起至今	196.12%	0.57%	46.56%	0.46%	149.56%	0.11%

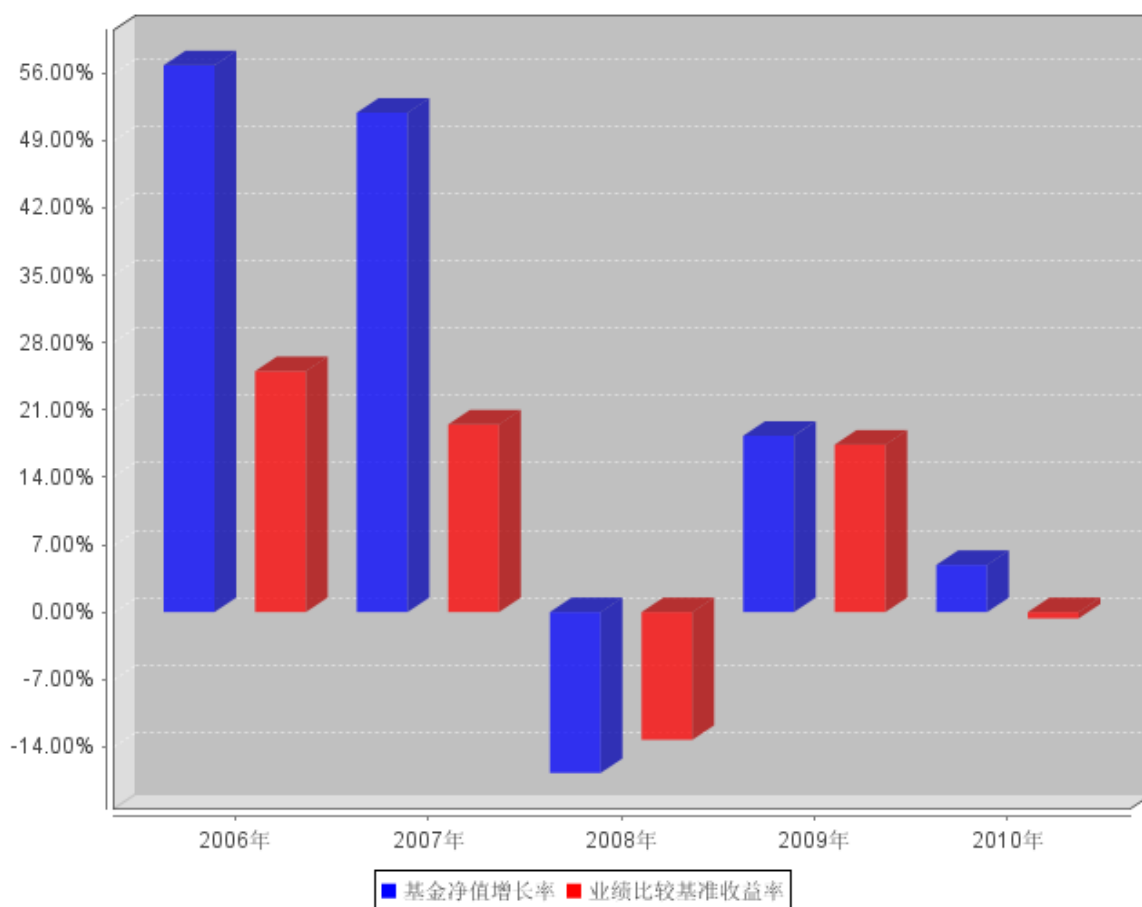
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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 过去五年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

过去五年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	11,088,300.79	20,859,578.30	31,947,879.09	
2009	-	-	-	-	
2008	0.5000	34,755,842.26	79,044,933.30	113,800,775.56	
合计	0.7000	45,844,143.05	99,904,511.60	145,748,654.65	

## § 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		
李璇	本基金的基金经理	2010 年 9 月 21 日	-	3	女，清华大学金融学学士、硕士，3 年基金行业从业经验，具有基金从业资格。2007 年加入南方基金管理有限公司固定收益部，担任信用债高级分析师。2010 年 9 月至今，担任南方多利、南方宝元基金经理。
蒋朋宸	本基金的基金经理	2009 年 2 月 10 日	-	6	北大生物化学硕士、美国哥伦比亚大学金融工程学硕士，具有基金从业资格。曾担任鹏华基金公司基金管理部分析师，2005 年加入南方基金，2008 年 4 月至 2010 年 12 月，任南方盛元基金经理；2008 年 4 月至今，任南方隆元基金经理；2009 年 2 月至今，任南方宝元债券基金经理。2010 年 12 月至今，任基金天元基金经理。
应帅	本基金的基金经理	2010 年 12 月 2 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，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。
高峰	本基金的基金经理	2008 年 1 月 14 日	2010 年 9 月 21 日	8	理学博士，具有基金从业资格。曾任职于上海大学理学院、美国 SAS 软件研究所上海公司，2002 年加入南方基金，2006 年 3 月至今，任南方多利基金经理；2008 年 1 月至今，

					任南方宝元基金经理。
--	--	--	--	--	------------

注：1. 此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日。

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。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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、《南方宝元债券型基金基金合同》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

2010 年，无论是世界经济还是资本市场，都是充满矛盾和统一的一个年度。美国为刺激经济增长，摆脱通缩，如预期的进行了二次定量宽松货币政策，导致美元持续贬值，大宗商品价格大幅度上涨。而在中国，则出现另一个景象，CPI 大幅上升，通货膨胀出现了难以控制的苗头，中国随之进行了加息等货币紧缩政策。

10 月份央行意外加息是债券市场的转折点，货币政策基调正式由“适度宽松”回归“稳健”，在资金面收紧和加息预期增强的双重压力下，债券收益率急剧上升。12 月，随着意外加息带来的市场紧张情绪的缓解，前期超调的收益率略有回落，12 月的再次加息对市场造成的影响已不大。此次货币政策回归稳健的目的主要是控制货币增速、调控通胀预期，我们认为，通胀仍将是下阶段债券市场关注的重点，预计 11 年上半年通胀水平将持续高位，政策放松的可能性较小。目前债券市场绝对收益率虽然已经较高，但在通胀压力和政策压力的作用下，收益率还将呈震荡上行的趋势，信用债的高收益将为收益率上行带来较好保护。在投资运作上，南方宝元债券型基金仍然对企业债保持了较高的关注度，同时也根据市场情况，对无风险债券的结构进行了调整，增加了含权类品种的投资。

股票操作方面，上半年我们以个股为主，集中在消费、机械和中小股方面，下半年我们进行了一定的调整，基于对有色能源价格的看好，本基金配置了有色和煤炭等个股。另外也看好十二五期间国家在环保方面的投入，对环保行业股票也进行了一定的投资。不过总体而言，稳定类股票还是占有较大比例，我们将秉承一贯风格，寻找

其中有价值的股票进行合理操作，以求给投资者带来长期稳定的收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.2032 元，本报告期基金净值增长率为 4.91%，同期业绩比较基准增长率为-0.67%。

#### 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 年仍然是全球宏观经济复杂多变的一年。首先，世界范围内的经济结构失衡仍然没有好转的迹象。以美欧为首的发达经济体依然将以释放流动性，超发货币作为金融危机后实现复苏的主要手段；而广大发展中国家不得不采取相对紧缩的政策来应对过剩流动性冲击导致的经济过热及通货膨胀。其次，国内经济在“发展方式转变”，“结构转型”的大趋势大背景下，面临着经济增速放缓的挑战以及同时具备输入型和结构型特点的通货膨胀的压力。抗通胀，保民生，促转变，稳增长成为 2011 年经济工作的重点和主线。

对于资本市场，我们保持相对乐观的态度。尽管经济复苏看起来还会有波折，但总体趋势是比较明确的。资本市场尽管可能更多体现为震荡，但总体上保持上行趋势。2011 年，我们将更加重视业绩增长的稳定性和估值之间的配比。因此消费类行业以及机械、家电仍是我们投资的主要方向。

#### 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：基金收益分配比例按有关规定制定；投资者可以选择现金分红方式或分红再投资的分红方式，以投资者在分红权益登记日前的最后一次选择的方式为准，投资者选择分红的默认方式为现金分红；基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；基金当期收益应先弥补上期亏损后，才可进行当期收益分配；在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年至少分配一次，但若成立不满 3 个月则不进行收益分配，年度分配在基金会计年度结束后的 4 个月内完成；基金收益分配后基金单位资产净值不能低于面值；每一基金单位享有同等分配权。

根据上述收益分配原则，本基金于 2011 年 1 月 19 日进行了收益分配，每 10 份基金份额派 0.20 元。本基金 2010 年 3 月 17 日向基金份额持有人每 10 份派 0.20 元为以往年度的收益分配。



## § 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宝元债券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，南方宝元债券型证券投资基金的管理人——南方基金管理有限公司在南方宝元债券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，南方宝元债券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31,947,879.09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宝元债券型证券投资基金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 20306 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：南方宝元债券型基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.4.5	57,167,094.34	39,555,785.46
结算备付金		8,897,788.09	9,578,064.52
存出保证金		745,844.63	803,791.35
交易性金融资产		1,896,212,961.17	2,120,783,670.01
其中：股票投资		570,115,015.01	598,170,030.47
基金投资		-	-
债券投资		1,326,097,946.16	1,522,613,639.54
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		4,556,196.03	-
应收利息		17,315,752.43	20,116,190.44
应收股利		-	-
应收申购款		385,076.81	1,155,509.55
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,985,280,713.50	2,191,993,011.33
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期期末 2010年12月31日</b>	<b>上年度末 2009年12月31日</b>
<b>负债:</b>			
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		320,001,580.00	250,000,210.00
应付证券清算款		-	15,611,218.85
应付赎回款		2,048,388.13	4,377,340.20
应付管理人报酬		1,135,862.33	1,340,204.78
应付托管费		265,034.54	312,714.43
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		2,094,637.64	990,836.57
应交税费		256,858.10	256,858.10
应付利息		108,673.68	20,483.97
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		1,939,190.59	944,378.19
负债合计		327,850,225.01	273,854,245.09
<b>所有者权益:</b>			
实收基金		1,377,469,277.39	1,643,464,853.85
未分配利润		279,961,211.10	274,673,912.39
所有者权益合计		1,657,430,488.49	1,918,138,766.24
负债和所有者权益总计		1,985,280,713.50	2,191,993,011.33

注：报告截止日 2010 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2032 元，基金份额总额 1,377,469,277.39 份。

## 7.2 利润表

会计主体：南方宝元债券型基金

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
<b>一、收入</b>		111,318,662.41	388,209,727.86
1. 利息收入		53,515,901.93	62,374,714.47
其中：存款利息收入		480,740.93	763,492.08

债券利息收入		53,006,658.81	61,553,954.37
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		28,502.19	57,268.02
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		79,141,500.03	325,121,477.41
其中：股票投资收益		77,181,915.58	321,305,660.06
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-988,643.96	-5,063,911.16
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	824,460.97
股利收益		2,948,228.41	8,055,267.54
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-22,764,808.86	-1,954,207.38
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		1,426,069.31	2,667,743.36
<b>减：二、费用</b>		29,176,717.56	31,166,820.30
1. 管理人报酬	7.4.4.2.1	13,867,610.95	17,681,596.69
2. 托管费	7.4.4.2.2	3,235,775.95	4,125,705.91
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		7,569,182.27	6,905,627.79
5. 利息支出		4,092,957.93	2,027,180.96
其中：卖出回购金融资产支出		4,092,957.93	2,027,180.96
6. 其他费用		411,190.46	426,708.95
<b>三、利润总额</b>		82,141,944.85	357,042,907.56
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		82,141,944.85	357,042,907.56

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方宝元债券型基金

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）	1,643,464,853.85	274,673,912.39	1,918,138,766.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	82,141,944.85	82,141,944.85
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）	-265,995,576.46	-44,906,767.05	-310,902,343.51
其中：1. 基金申购款	635,621,838.01	110,920,677.89	746,542,515.90

2. 基金赎回款	-901,617,414.47	-155,827,444.94	-1,057,444,859.41
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)	-	-31,947,879.09	-31,947,879.09
五、期末所有者权益(基金净值)	1,377,469,277.39	279,961,211.10	1,657,430,488.49
项目	上年度可比期间 2009年1月1日至2009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)	1,943,515,686.73	-26,771,103.60	1,916,744,583.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	357,042,907.56	357,042,907.56
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)	-300,050,832.88	-55,597,891.57	-355,648,724.45
其中: 1. 基金申购款	2,330,239,356.83	271,023,371.08	2,601,262,727.91
2. 基金赎回款	-2,630,290,189.71	-326,621,262.65	-2,956,911,452.36
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)	1,643,464,853.85	274,673,912.39	1,918,138,766.24

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	鲍文革	鲍文革
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	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	基金托管人、基金代销机构

银行”)	
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)
华泰联合证券有限责任公司(“华泰联合证券”)	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司、基金代销机构

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(%)
华泰证券	813,405,090.14	16.47	406,381,292.16	9.16
华泰联合证券	369,724,323.70	7.48	588,996,241.40	13.27

###### 7.4.4.1.2 权证交易

无。

###### 7.4.4.1.3 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 (%)
华泰证券	688,276.12	16.68	653,383.78	31.33
华泰联合证券	314,265.00	7.62	291,945.12	14.00
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	335,890.14	9.02	28,916.92	2.94
华泰联合证券	500,641.98	13.44	22,704.96	2.31

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	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
当期发生的基金应支付的管理费	13,867,610.95	17,681,596.69
其中：支付给销售机构的客户维护费	321,947.89	411,056.53

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 0.75% 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 × 0.75% / 当年天数。

##### 7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

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
当期发生的基金应支付的托管费	3,235,775.95	4,125,705.91

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 0.175% 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 × 0.175% / 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	-	10,180,230.14	-	-	-	-
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	-	-	-	-	330,000,000.00	74,322.68

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固有资金投资本基金的情况

无。

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 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	
	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	57,167,094.34	382,644.68	39,555,785.46	634,593.05

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	122059	10重钢债	新债分销	200,000	20,000,000.00
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
兴业证券	098035	09闽交控债	新债承销	100,000	10,000,000.00

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
601118	海南橡胶	2010年12月30日	2011年4月7日	网下申购	5.99	5.99	307,886	1,844,237.14	1,844,237.14	-
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	-
601126	四方股	2010年12	2011年	网下申购	23.00	31.11	26,982	620,586.00	839,410.02	-

	份	月 28 日	3 月 31 日							
合计								3,650,993.84	4,228,933.76	

## 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
122058	10 豫园债	2010 年 12 月 27 日	2011 年 1 月 6 日	新债申购	100.00	100.00	300,000	30,000,000.00	30,000,000.00	-
1080178	10 玉溪开投债 01	2010 年 12 月 30 日	2011 年 1 月 17 日	新债申购	100.00	100.00	200,000	20,000,000.00	20,000,000.00	-
合计	-	-	-	-	-	-	-	50,000,000.00	50,000,000.00	-

## 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
无										

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	600,000	12,609,780.33	11,826,000.00	-
600816	安信信托	2010 年 6 月 2 日	公告重大事项	13.60	未知	未知	324,946	4,698,978.08	4,419,265.60	-
合计								<b>17,308,758.41</b>	<b>16,245,265.60</b>	

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

## 7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2010 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 120,001,580.00 元，是以如下债券作为抵押：



金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
100234	10 国开 34	2010 年 1 月 6 日	100.41	1,250,000	125,512,500.00
合计				-	125,512,500.00

#### 7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2010 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 200,000,000.00 元，于 2011 年 1 月 5 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

## § 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	570,115,015.01	28.72
	其中：股票	570,115,015.01	28.72
2	固定收益投资	1,326,097,946.16	66.80
	其中：债券	1,326,097,946.16	66.80
	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	66,064,882.43	3.33
6	其他各项资产	23,002,869.90	1.16
7	合计	1,985,280,713.50	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	1,844,237.14	0.11
B	采掘业	27,348,926.40	1.65
C	制造业	252,366,237.63	15.23
C0	食品、饮料	53,490,891.00	3.23
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	8,522,500.00	0.51
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	79,074,040.94	4.77
C7	机械、设备、仪表	62,785,447.08	3.79

C8	医药、生物制品	48,493,358.61	2.93
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	19,224,000.00	1.16
F	交通运输、仓储业	7,614,853.74	0.46
G	信息技术业	71,639,925.64	4.32
H	批发和零售贸易	37,085,004.62	2.24
I	金融、保险业	71,708,525.20	4.33
J	房地产业	18,886,088.80	1.14
K	社会服务业	32,123,235.04	1.94
L	传播与文化产业	30,273,980.80	1.83
M	综合类	-	-
	合计	570,115,015.01	34.40

### 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	002238	天威视讯	1,113,014	30,273,980.80	1.83
2	601607	上海医药	1,300,000	28,392,000.00	1.71
3	000568	泸州老窖	660,990	27,034,491.00	1.63
4	600362	江西铜业	550,000	24,843,500.00	1.50
5	000826	桑德环境	696,592	23,245,275.04	1.40
6	000895	双汇发展	227,700	19,809,900.00	1.20
7	600585	海螺水泥	664,982	19,736,665.76	1.19
8	601318	中国平安	350,000	19,656,000.00	1.19
9	601601	中国太保	849,924	19,463,259.60	1.17
10	600000	浦发银行	1,500,000	18,585,000.00	1.12

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	600000	浦发银行	108,782,434.30	5.67
2	000729	燕京啤酒	69,564,688.35	3.63
3	601166	兴业银行	68,329,813.87	3.56
4	600518	康美药业	57,249,719.43	2.98
5	600425	青松建化	47,936,638.36	2.50

6	600547	山东黄金	45,656,694.03	2.38
7	000507	珠海港	41,416,705.12	2.16
8	600362	江西铜业	40,304,289.72	2.10
9	000021	长城开发	33,276,751.45	1.73
10	002011	盾安环境	31,249,757.63	1.63
11	600642	申能股份	30,146,440.16	1.57
12	601607	上海医药	29,049,092.32	1.51
13	000826	桑德环境	28,879,751.85	1.51
14	600036	招商银行	28,833,805.33	1.50
15	600825	新华传媒	28,372,205.74	1.48
16	000568	泸州老窖	28,184,875.92	1.47
17	600028	中国石化	26,601,047.15	1.39
18	002376	新北洋	26,428,146.13	1.38
19	000937	冀中能源	26,323,593.40	1.37
20	601268	二重重装	25,254,722.92	1.32

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	600518	康美药业	87,787,928.42	4.58
2	601166	兴业银行	79,944,985.38	4.17
3	600000	浦发银行	78,006,050.71	4.07
4	000425	徐工机械	67,612,953.06	3.52
5	000729	燕京啤酒	58,753,757.97	3.06
6	600547	山东黄金	58,262,470.29	3.04
7	600036	招商银行	46,400,223.01	2.42
8	000012	南玻A	42,880,217.57	2.24
9	000507	珠海港	41,003,613.29	2.14
10	600425	青松建化	41,002,103.06	2.14
11	000021	长城开发	38,062,868.72	1.98
12	600048	保利地产	33,515,263.20	1.75
13	600642	申能股份	32,231,755.19	1.68
14	600028	中国石化	32,077,018.19	1.67
15	600739	辽宁成大	29,791,233.28	1.55
16	002011	盾安环境	28,916,594.89	1.51

17	600825	新华传媒	28,791,018.11	1.50
18	600553	太行水泥	27,337,657.39	1.43
19	601888	中国国旅	26,990,892.92	1.41
20	601766	中国南车	26,898,514.36	1.40

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	2,437,550,890.72
卖出股票收入（成交）总额	2,517,825,601.43

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	100,390,000.00	6.06
3	金融债券	473,215,100.00	28.55
	其中：政策性金融债	413,340,000.00	24.94
4	企业债券	752,492,846.16	45.40
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	1,326,097,946.16	80.01

#### 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	100234	10 国开 34	2,300,000	230,943,000.00	13.93
2	080216	08 国开 16	1,300,000	134,537,000.00	8.12
3	0801047	08 央行票据 47	1,000,000	100,390,000.00	6.06
4	126011	08 石化债	721,560	64,233,271.20	3.88
5	100228	10 国开 28	500,000	47,860,000.00	2.89

#### 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	745,844.63
2	应收证券清算款	4,556,196.03
3	应收股利	-
4	应收利息	17,315,752.43
5	应收申购款	385,076.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,002,869.90

### 8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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
54,147	25,439.44	164,086,540.29	11.91%	1,213,382,737.10	88.09%

### 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	170.80	0.0000%

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2002 年 9 月 20 日 ）基金份额总额	4,902,664,980.80
本报告期期初基金份额总额	1,643,464,853.85
本报告期基金总申购份额	635,621,838.01
减：本报告期基金总赎回份额	901,617,414.47
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,377,469,277.39

## § 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 80,000 元。该审计机构已提供审计服务的连续年限为 9 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	
国信证券股份有限公司	1	1,001,162,723.11	20.27%	812,136.89	19.69%	
华泰证券股份有限公司	2	813,405,090.14	16.47%	688,276.12	16.68%	
齐鲁证券有限公司	1	692,652,649.52	14.02%	588,749.62	14.27%	
广发证券股份有限公司	2	654,378,270.62	13.25%	552,961.79	13.40%	
招商证券股份有限公司	1	411,634,645.39	8.33%	349,404.69	8.47%	
上海证券有限责任公司	1	370,183,870.37	7.49%	300,776.82	7.29%	
华泰联合证券有限责任公司	1	369,724,323.70	7.48%	314,265.00	7.62%	
国泰君安证券股份有限公司	2	230,066,339.17	4.66%	186,931.08	4.53%	
申银万国证券股份有限公司	2	143,957,626.46	2.91%	122,156.87	2.96%	
中信建投证券有限责任公司	2	109,338,896.16	2.21%	88,837.94	2.15%	
西部证券股份有限公司	1	80,341,036.40	1.63%	68,233.96	1.65%	
信达证券股份有限公司	1	43,075,423.42	0.87%	36,614.29	0.89%	
中国银河证券股份有限公司	2	19,827,027.74	0.40%	16,109.55	0.39%	
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	
华安证券有限责任公司	1	-	-	-	-	

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。

本基金本报告期租用证券公司交易单元情况如下：信达证券新增 1 个（上海）。

### 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
国信证券股份有限公司	74,623,687.98	28.44%	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	102,224,711.51	38.96%	1,295,100,000.00	14.26%	-	-
齐鲁证券有限公司	386,825.81	0.15%	2,155,000,000.00	23.72%	-	-
广发证券股份有限公司	13,950,941.76	5.32%	2,359,900,000.00	25.98%	-	-
招商证券股份有限公司	47,622,169.87	18.15%	1,675,000,000.00	18.44%	-	-
上海证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华泰联合证券有限责任公司	-	-	410,000,000.00	4.51%	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

申银万国证券股份有限公司	18,587,313.61	7.08%	430,000,000.00	4.73%	-	-
中信建投证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	5,005,480.14	1.91%	410,000,000.00	4.51%	-	-
信达证券股份有限公司	-	-	270,000,000.00	2.97%	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	80,000,000.00	0.88%	-	-
华安证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

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。