

南方宝元债券型基金 2012 年年度报告摘要

2012 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

送出日期：2013 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示

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 2013 年 3 月 20 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 2012 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	1,010,821,578.24 份
基金合同存续期	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	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	2012 年	2011 年	2010 年
本期已实现收益	35,848,648.55	-13,332,105.16	104,906,753.71
本期利润	107,638,812.92	-56,594,092.80	82,141,944.85
加权平均基金份额本期利润	0.0944	-0.0437	0.0517
本期基金份额净值增长率	8.57%	-3.82%	4.91%
3.1.2 期末数据和指标	2012 年末	2011 年末	2010 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0852	0.0737	0.1058
期末基金资产净值	1,226,603,364.41	1,381,259,169.64	1,657,430,488.49
期末基金份额净值	1.2135	1.1376	1.2032

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

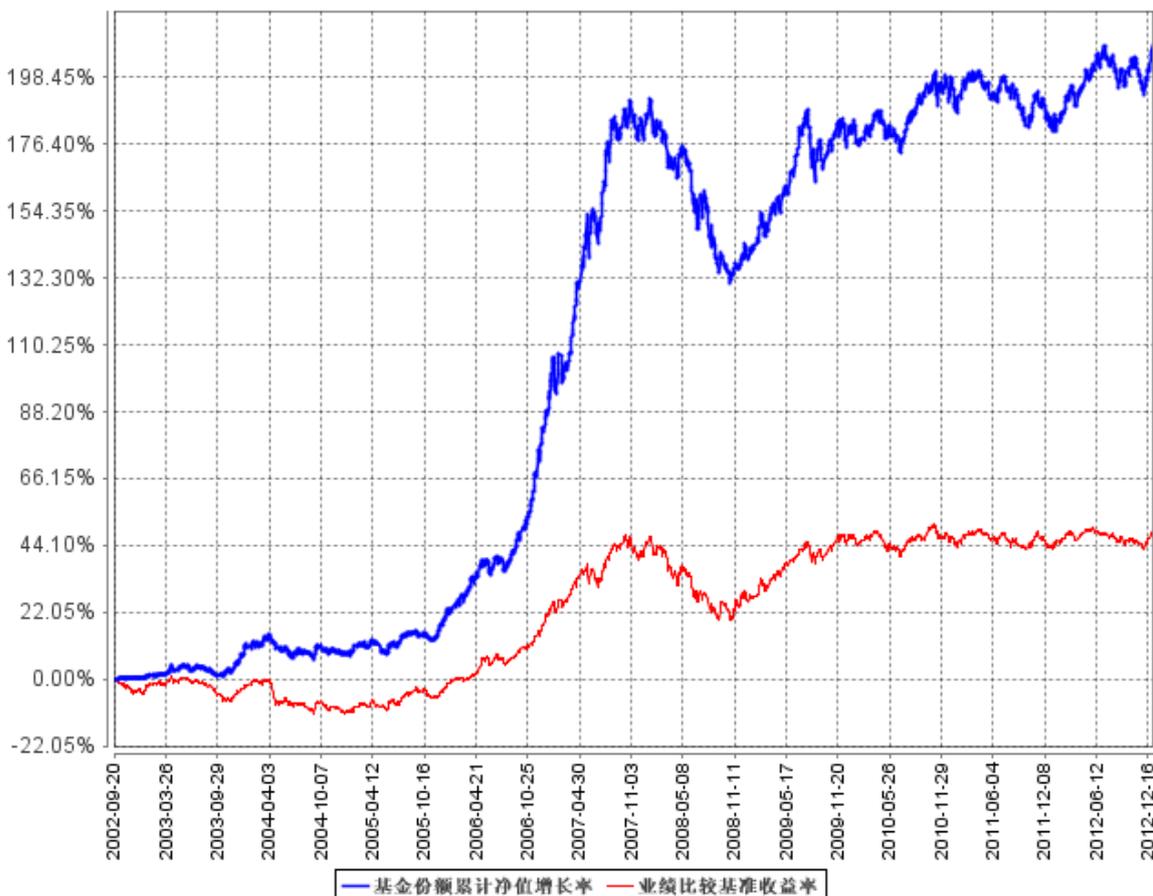
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	2.98%	0.38%	1.97%	0.29%	1.01%	0.09%
过去六个月	1.54%	0.39%	0.44%	0.29%	1.10%	0.10%
过去一年	8.57%	0.41%	3.11%	0.30%	5.46%	0.11%
过去三年	9.55%	0.42%	0.76%	0.33%	8.79%	0.09%

过去五年	7.97%	0.51%	2.58%	0.46%	5.39%	0.05%
自基金合同生效起至今	209.22%	0.54%	48.67%	0.44%	160.55%	0.10%

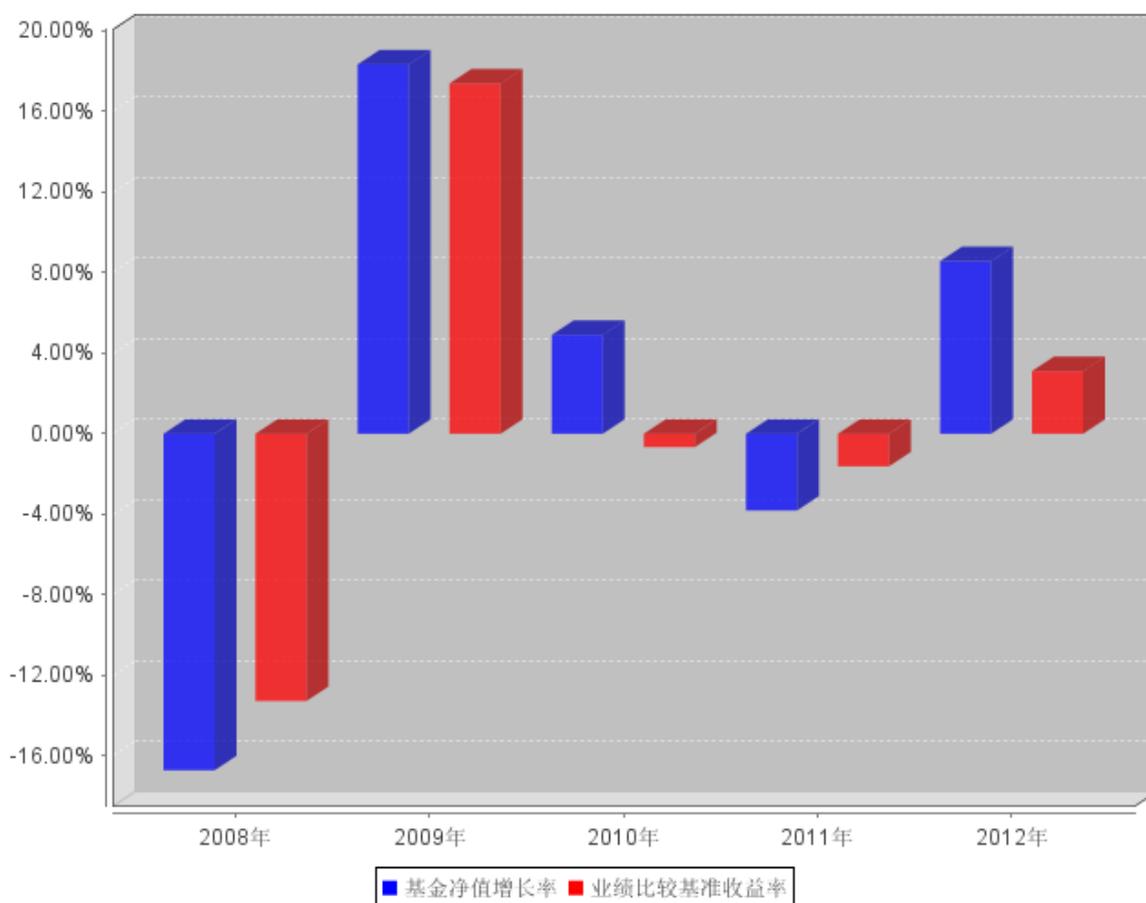
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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
2012	0.2000	5,936,812.51	18,284,395.19	24,221,207.70	
2011	0.2000	7,927,627.57	19,173,435.66	27,101,063.23	
2010	0.2000	11,088,300.79	20,859,578.30	31,947,879.09	
合计	0.6000	24,952,740.87	58,317,409.15	83,270,150.02	

§ 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%。公司在北京、上海、合肥等地设有分公司，在香港设有子公司--南方东英资产管理有限公司。

截至报告期末，公司管理资产规模近 2,300 亿元，旗下管理 37 只开放式基金，2 只封闭式基金，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		
蒋朋宸	本基金的基金经理	2009 年 2 月 10 日	-	8	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	-	11	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 2012 年 11 月，任南方成份基金经理；2010 年 12 月至今，任南方宝元基金经理；2012 年 11 月至今，任南方稳健基金经理；2012 年 11 月至今，任南稳贰号基金经理。
李璇	本基金的基金经理	2010 年 9 月 21 日	2012 年 6 月 7 日	4	女，清华大学金融学学士、硕士，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 2012 年 6 月，担任南方宝元基金经理；2010 年 9 月至今，担任南方多利基金经理；2012 年 5 月至今，担任南方金利基金经理。

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 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，制定了研究报告审核流程，股票、债券、基金等证券池管理制度和细则，投资决策委员会议事规则，集中交易管理办法，公平交易操作指引，异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

4.3.2 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。公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。本报告期内，两两组合间单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为0的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，不存在不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

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。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为17次。其中，14次是由于指数型基金根据标的指数成份股调整而被动调仓所致；2次是由于基金接受投资者大额申赎后，被动增减仓位或组合配置所致；1次是由于社保201组合调整，选择

期限与收益匹配较好的债券进行投资的需要。

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

2012 年股票市场全年显现大幅度震荡格局，最终收尾略有上涨。从风格板块来看，大小市值、成长价值都有所体现。金融地产、医药电子和环保都表现出了较高超额收益，估值修复和成长溢价的投资方法均有所收获。2012 年最为明显的是，政策风险在投资当中越来越得到重视。禁酒令等政策的出台，直接导致了白酒行业出现了比较大的跌幅，而受益于治理环境污染的政策支持，环保板块涨幅较大。本基金下半年出现了重大的调整，基于政策对白酒影响的不确定性在增大，白酒的行业配置进行了大比例的下调，增加了金融股的配置。本基金偏好于稳定增长类品种，但在白酒长期稳定增长逻辑受到破坏之后，开始增加低估值板块，包括金融地产家电汽车等。

2012 年经济与企业盈利触底回升，CPI 也处于较低水平，但对来年的反弹有所担忧。2012 年三季度降准预期落空后，银行间市场资金面维持紧平衡状态，四季度则比较宽松。在此背景下，债券市场全年采取持有策略。债券投资运作上，本基金持有的纯债为组合收益带来了正贡献。其中对信用债保持了较高的关注，在一级市场积极参与信用债投资，在二级市场对信用债的结构进行调整，获取了超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2012 年沪深 300 指数增长率为 7.55%，基金净值增长率为 8.57%，业绩基准为 3.11%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计 2013 年经济将温和复苏，通胀水平略有上升，企业盈利会有所恢复性增长。但货币政策可能会更加稳健，财政政策基本保持不变。总体而言，本基金预计 2013 年证券市场会好于 2012 年。在市场结构方面，强周期品种如煤炭有色仍将保持谨慎，看好稳定增长类如医药、食品饮料以及低估值品种金融地产。

债券经历了 2012 年的牛市之后，对 2013 年看法偏谨慎。去年货币策略为宽松，CPI 今年下半年有可能会有一定风险，二、三季度债市投资风险大于机会。未来投资方向以控制风险为主，获取持有票息收益，倾向于信用债的投资。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，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，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1) 进一步完善公司各项内部管理制度

本年度监察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。

(2) 定期监察稽核工作与专项稽核工作相结合

按照证监会的要求对公司投资、研究、交易、信息技术、基金会计、注册登记、人力资源、基金销售等主要业务进行定期稽核工作。同时，对投资研究、信息技术、基金直销、后台运营等相关业务开展了专项稽核工作，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性等。

(3) 采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，加强了对日常投资运作的管理和监控，保证投资遵循既定的投资决策程序与业务流程，基金投资组合及个股投资符合比例控制的要求，严格执行分级授权制度，保证基金投资独立、公平。

(4) 继续做好反商业贿赂工作，从源头上控制销售风险

本年度，我公司积极开展反商业贿赂工作，对公司旗下基金的代销、直销业务进行自查，此项工作有利于更好地控制销售风险。

(5) 对各业务部门进行了相关法律法规培训和职业道德培训

本年度，我公司采取外聘专家和内部专业人士相结合的方式，对各业务部门进行了相关法律法规培训和职业道德培训，进一步提高了我司从业人员的合规素质和职业道德修养。

(6) 全面参与新产品设计、新业务拓展工作，负责日常合同审查，监督客户投诉处理。积极参与证监会新规定出台前的讨论并提出修改建议。

(7) 信息披露和投资者关系管理工作

完成各基金及公司的各项信息披露工作，保证所披露信息的真实性、准确性和完整性；重视

媒体监督和投资者关系管理工作。

(8) 积极配合人民银行开展反洗钱工作，按要求进行可疑交易的报送。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、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。

4.7 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。

4.8 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。

根据上述分配原则，本基金于 2013 年 1 月 16 日进行了收益分配，每 10 份基金份额派 0.20 元。本报告期内已分配数（每 10 份基金份额派发红利 0.20 元）为以往年度收益分配。

§ 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

2012 年, 本基金托管人在对南方宝元债券型基金的托管过程中, 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

2012 年, 南方宝元债券型基金的管理人——南方基金管理有限公司在南方宝元债券型基金的投资运作、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, 南方宝元债券型基金对基金份额持有人进行了 1 次利润分配, 分配金额为 24, 221, 207. 70 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基金 2012 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 2012 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(2013)第 20013 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: 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.4.5	27,173,354.55	19,750,014.27
结算备付金		5,084,712.28	6,037,779.13
存出保证金		466,808.92	647,452.84
交易性金融资产		1,444,395,672.19	1,640,719,221.39
其中：股票投资		414,670,723.88	416,079,274.21
基金投资		-	-
债券投资		1,029,724,948.31	1,224,639,947.18
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		-	38,810,329.13
应收利息		19,282,540.85	21,203,354.96
应收股利		-	-
应收申购款		269,241.60	20,527.91
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,496,672,330.39	1,727,188,679.63
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 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		245,000,000.00	334,999,740.00
应付证券清算款		19,561,057.91	5,569,537.05
应付赎回款		1,693,871.21	1,495,473.53
应付管理人报酬		761,772.86	889,879.33
应付托管费		177,747.00	207,638.51
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		295,453.17	345,112.84
应交税费		-	-
应付利息		187,741.54	30,253.90
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		2,391,322.29	2,391,874.83
负债合计		270,068,965.98	345,929,509.99
所有者权益：			
实收基金		1,010,821,578.24	1,214,160,899.31
未分配利润		215,781,786.17	167,098,270.33

所有者权益合计		1,226,603,364.41	1,381,259,169.64
负债和所有者权益总计		1,496,672,330.39	1,727,188,679.63

注：报告截止日 2012 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2135 元，基金份额总额 1,010,821,578.24 份。

7.2 利润表

会计主体：南方宝元债券型基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
一、收入		131,684,249.98	-28,960,551.21
1. 利息收入		57,372,835.05	57,204,994.80
其中：存款利息收入		477,983.52	356,949.40
债券利息收入		56,894,851.53	56,848,045.40
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,251,273.39	-43,372,575.75
其中：股票投资收益		-21,007,005.85	-52,147,001.92
基金投资收益		-	-
债券投资收益		17,014,264.57	3,743,029.91
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		6,244,014.67	5,031,396.26
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		71,790,164.37	-43,261,987.64
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		269,977.17	469,017.38
减：二、费用		24,045,437.06	27,633,541.59
1. 管理人报酬	7.4.4.2.1	9,993,292.82	11,383,704.70
2. 托管费	7.4.4.2.2	2,331,768.47	2,656,197.77
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		1,914,766.96	4,104,383.40
5. 利息支出		9,375,208.22	9,065,435.55
其中：卖出回购金融资产支出		9,375,208.22	9,065,435.55
6. 其他费用		430,400.59	423,820.17
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		107,638,812.92	-56,594,092.80

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		107,638,812.92	-56,594,092.80

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：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 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）	1,214,160,899.31	167,098,270.33	1,381,259,169.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	107,638,812.92	107,638,812.92
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）	-203,339,321.07	-34,734,089.38	-238,073,410.45
其中：1. 基金申购款	104,867,925.65	16,935,493.03	121,803,418.68
2. 基金赎回款	-308,207,246.72	-51,669,582.41	-359,876,829.13
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）	-	-24,221,207.70	-24,221,207.70
五、期末所有者权益（基金净值）	1,010,821,578.24	215,781,786.17	1,226,603,364.41
项目	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 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）	1,377,469,277.39	279,961,211.10	1,657,430,488.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-56,594,092.80	-56,594,092.80
三、本期基金份额交易产	-163,308,378.08	-29,167,784.74	-192,476,162.82

生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	332,121,698.74	60,690,925.10	392,812,623.84
2. 基金赎回款	-495,430,076.82	-89,858,709.84	-585,288,786.66
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)	-	-27,101,063.23	-27,101,063.23
五、期末所有者权益(基金净值)	1,214,160,899.31	167,098,270.33	1,381,259,169.64

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：

<u>吴万善</u>	<u>鲍文革</u>	<u>鲍文革</u>
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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.2.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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

注：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 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011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	-	-	193,551,800.78	7.29%
华泰联合证券	-	-	101,137,668.84	3.81%

7.4.4.1.2 权证交易

注：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 2012年1月1日至2012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	-830.00	-0.08%	-830.00	-0.28%
关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011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	161,170.51	7.29%	11,940.14	3.58%
华泰联合证券	85,783.09	3.88%	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，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的净额列示。权证交易不计佣金。

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
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	9,993,292.82	11,383,704.70
其中：支付销售机构的客户维护费	212,845.05	244,555.44

注：支付基金管理人南方基金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 X 0.75% / 当年天数。

7.4.4.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,331,768.47	2,656,197.77

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 X 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 2012 年 1 月 1 日至 2012 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	-	32,771,402.05	-	-	-	-
上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 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	-	30,026,150.16	-	-	120,000,000.00	65,278.63
华泰联合证券	40,040,672.79	-	-	-	-	-

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**

注：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

注：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 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011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	27,173,354.55	215,397.80	19,750,014.27	239,748.36

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 2012年1月1日至2012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
华泰联合证券	122117	11 闽高速	新债承销	60,000	6,000,000.00
兴业证券	122117	11 闽高速	新债承销	60,000	6,000,000.00
华泰联合证券	1280131	12 杭城投债	新债承销	200,000	20,000,000.00
华泰联合证券	1280027	12 鞍山城投债	新债承销	100,000	10,000,000.00
上年度可比期间 2011年1月1日至2011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
华泰联合证券	122079	11 上港 02	新债承销	200,000	20,000,000.00
华泰联合证券	1180122	11 吉利债	新债承销	100,000	10,000,000.00
华泰联合证券	122065	11 上港 01	新债承销	600,000	60,000,000.00
华泰联合证券	1180094	11 常城建债	新债分销	100,000	10,000,000.00
华泰证券	1180085	11 晨鸣控股债	新债分销	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（2012 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
002241	歌尔声学	2012年4月11日	2013年4月12日	非公开发行	24.69	34.34	400,000	9,876,000.00	13,736,000.00	-
000826	桑德环境	2012年12月31日	2013年1月9日	配股	12.71	22.99	105,304	1,338,413.84	2,420,938.96	-

注：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
000002	万科A	2012年12月26日	公告重大事项	10.62	2013年1月21日	11.13	1,900,000	16,360,548.40	20,178,000.00	-
000527	美的电器	2012年8月27日	临时停牌	9.18	未知	未知	435,000	4,740,843.00	3,993,300.00	-

注：本基金截至 2012 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**

无。

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2012 年 12 月 31 日止, 本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 245,000,000.00 元, 于 2013 年 1 月 7 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券, 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	414,670,723.88	27.71
	其中: 股票	414,670,723.88	27.71
2	固定收益投资	1,029,724,948.31	68.80
	其中: 债券	1,029,724,948.31	68.80
	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	32,258,066.83	2.16
6	其他各项资产	20,018,591.37	1.34
7	合计	1,496,672,330.39	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	-	-
C	制造业	209,566,341.71	17.09
C0	食品、饮料	111,512,118.08	9.09
C1	纺织、服装、皮毛	22,920.00	0.00
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-

C5	电子	36,461,388.78	2.97
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	38,476,275.00	3.14
C8	医药、生物制品	23,093,639.85	1.88
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	8,561,890.00	0.70
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	23,241,986.45	1.89
H	批发和零售贸易	4,514,418.00	0.37
I	金融、保险业	82,870,594.59	6.76
J	房地产业	51,616,316.81	4.21
K	社会服务业	34,299,176.32	2.80
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	414,670,723.88	33.81

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	1,352,335	47,872,659.00	3.90
2	600000	浦发银行	2,918,358	28,950,111.36	2.36
3	600519	贵州茅台	129,089	26,982,182.78	2.20
4	000858	五粮液	867,810	24,498,276.30	2.00
5	000002	万科 A	1,900,000	20,178,000.00	1.65
6	600406	国电南瑞	1,006,415	16,132,832.45	1.32
7	600104	上汽集团	810,000	14,288,400.00	1.16
8	002241	歌尔声学	400,000	13,736,000.00	1.12
9	000069	华侨城 A	1,800,000	13,500,000.00	1.10
10	600036	招商银行	899,950	12,374,312.50	1.01

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	17,112,062.73	1.24
2	600266	北京城建	16,156,231.13	1.17
3	002241	歌尔声学	15,851,966.72	1.15
4	600369	西南证券	15,204,168.29	1.10
5	600585	海螺水泥	14,474,303.28	1.05
6	300128	锦富新材	13,819,595.19	1.00
7	601318	中国平安	13,567,500.00	0.98
8	000527	美的电器	13,553,843.85	0.98
9	000002	万科 A	13,255,146.88	0.96
10	000826	桑德环境	13,115,982.77	0.95
11	600000	浦发银行	12,907,802.90	0.93
12	600406	国电南瑞	12,646,862.18	0.92
13	600104	上汽集团	12,272,243.92	0.89
14	600031	三一重工	12,271,704.11	0.89
15	000895	双汇发展	11,980,141.67	0.87
16	600837	海通证券	11,914,063.78	0.86
17	000651	格力电器	10,914,566.14	0.79
18	002294	信立泰	10,655,131.91	0.77
19	000069	华侨城 A	10,624,702.04	0.77
20	600518	康美药业	10,583,395.76	0.77

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	600036	招商银行	23,868,852.90	1.73
2	601088	中国神华	22,377,709.85	1.62
3	600517	置信电气	17,265,900.64	1.25

4	002294	信立泰	16,151,196.17	1.17
5	600048	保利地产	14,405,066.60	1.04
6	601669	中国水电	14,012,158.72	1.01
7	600585	海螺水泥	13,756,704.41	1.00
8	601601	中国太保	12,955,793.04	0.94
9	000568	泸州老窖	12,656,423.49	0.92
10	600369	西南证券	12,456,462.64	0.90
11	300090	盛运股份	12,165,608.13	0.88
12	600030	中信证券	12,034,839.94	0.87
13	600739	辽宁成大	10,943,370.45	0.79
14	002508	老板电器	10,918,711.75	0.79
15	601566	九牧王	10,379,200.25	0.75
16	002154	报喜鸟	10,252,609.78	0.74
17	000069	华侨城 A	10,141,123.91	0.73
18	000651	格力电器	9,862,458.72	0.71
19	600104	上汽集团	9,734,584.08	0.70
20	000527	美的电器	9,666,470.39	0.70

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	599,589,276.55
卖出股票收入（成交）总额	647,598,397.37

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	-	-
3	金融债券	321,872,500.00	26.24
	其中：政策性金融债	261,138,000.00	21.29
4	企业债券	647,287,448.31	52.77
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	60,565,000.00	4.94

7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,029,724,948.31	83.95

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	1180007	11 渝城投债	600,000	61,284,000.00	5.00
2	080216	08 国开 16	500,000	51,640,000.00	4.21
3	126011	08 石化债	500,000	48,000,000.00	3.91
4	110411	11 农发 11	400,000	40,868,000.00	3.33
5	080212	08 国开 12	400,000	40,036,000.00	3.26

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注：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

注：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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现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、处罚的情形。

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	466,808.92
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	19,282,540.85
5	应收申购款	269,241.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,018,591.37

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

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
1	000002	万科 A	20,178,000.00	1.65	筹划重大事项
2	002241	歌尔声学	13,736,000.00	1.12	非公开发行锁定

§ 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
49,761	20,313.53	17,876,989.72	1.77%	992,944,588.52	98.23%

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	174.47	0.00%

§ 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	1,214,160,899.31
本报告期基金总申购份额	104,867,925.65
减：本报告期基金总赎回份额	308,207,246.72
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,010,821,578.24

§ 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

根据公司第五届董事会第二十二次会议审议通过，并经中国证监会证监许可{2012}1550号文批准，基金管理人于2012年11月24日发布公告，聘任杨小松为公司督察长。

根据公司第五届董事会第二十二次会议审议通过，并向中国基金业协会报备，基金管理人于2012年11月24日发布公告，聘任秦长奎为公司副总经理，同时辞去公司督察长职务。

经中国证监会基金部【2013】13号文函复，基金管理人于2013年1月5日发布公告，自2013年1月1日起，高良玉不再担任公司总经理职务，由董事长吴万善代为履行公司总经理职务。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门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

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

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 83,000 元。该审计机构已提供审计服务的连续年限为 11 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	
申银万国证券股份有限公司	2	335,549,269.50	27.15%	290,769.10	27.58%	-
华安证券股份有限公司	1	218,168,333.01	17.65%	184,640.16	17.51%	-
广发证券股份有限公司	2	213,619,401.96	17.28%	179,298.50	17.00%	-
中信建投证券股份有限公司	2	180,063,018.84	14.57%	152,004.27	14.42%	-
信达证券股份有限公司	1	92,144,454.84	7.46%	79,561.19	7.55%	-
招商证券股份有限公司	1	77,595,816.48	6.28%	67,706.05	6.42%	-
海通证券股份有限公司	1	52,959,382.67	4.28%	46,233.25	4.38%	-
国信证券股份有限公司	1	14,506,188.26	1.17%	11,786.30	1.12%	-
西部证券股份	1	13,891,270.36	1.12%	12,646.52	1.20%	-

有限公司						
上海证券有限 责任公司	1	13,787,930.11	1.12%	11,202.72	1.06%	-
齐鲁证券有限 公司	1	8,652,684.48	0.70%	7,220.89	0.68%	-
中国银河证券 股份有限公司	2	8,560,058.72	0.69%	6,955.05	0.66%	-
国泰君安证券 股份有限公司	2	6,475,450.85	0.52%	5,261.34	0.50%	-
华泰证券股份 有限公司	2	-	-	-830.00	-0.08%	-

注：本基金本报告期租用证券公司交易单元无变化。

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
申银万国证券 股份有限公司	67,044,086.86	23.48%	1,544,000,000.00	4.43%	-	-
华安证券股份 有限公司	100,933,505.69	35.34%	20,416,000,000.00	58.55%	-	-
广发证券股份 有限公司	10,843,868.84	3.80%	857,800,000.00	2.46%	-	-
中信建投证券 股份有限公司	21,840,762.83	7.65%	423,000,000.00	1.21%	-	-
信达证券股份 有限公司	-	-	5,005,500,000.00	14.36%	-	-
招商证券股份 有限公司	20,391,744.83	7.14%	3,976,000,000.00	11.40%	-	-
海通证券股份 有限公司	-	-	1,688,000,000.00	4.84%	-	-
国信证券股份 有限公司	-	-	32,000,000.00	0.09%	-	-
西部证券股份 有限公司	-	-	55,000,000.00	0.16%	-	-
上海证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券有限 公司	12,035,802.75	4.21%	872,000,000.00	2.50%	-	-
中国银河证券	-	-	-	-	-	-

股份有限公司						
国泰君安证券 股份有限公司						
华泰证券股份 有限公司	52,502,320.00	18.38%				

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。