

# 南方绩优成长股票型证券投资基金 2013 年 年度报告（摘要）

2013 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：2014 年 3 月 27 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 2014 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 2013 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

基金名称	南方绩优成长股票型证券投资基金
基金简称	南方绩优成长股票
基金主代码	202003
前端交易代码	202003
后端交易代码	202004
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 11 月 16 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	6,110,266,014.79 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“南方绩优”。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型基金，在适度控制风险并保持良好流动性的前提下，根据对上市公司的业绩质量、成长性与投资价值的权衡与精选，力争为投资者寻求超越基准的投资回报与长期稳健的资产增值。
投资策略	<p>本基金的股票投资主要采用“自下而上”的策略，通过对上市公司基本面的深入研究，基于对上市公司的业绩质量、成长性与投资价值的权衡，不仅重视公司的业绩与成长性，更注重公司的业绩与成长性的质量，精选中长期持续增长或未来阶段性高速增长、业绩质量优秀、且价值被低估的绩优成长股票作为主要投资对象。本基金的股票投资同时结合“自上而下”的行业分析，根据宏观经济运行、上下游行业运行态势与利益分配的观察来确定优势或景气行业，以最低的组合风险精选并确定最优质的股票组合。</p> <p>本基金将优先选择具有良好的行业增长空间，所处行业结构相对稳定，在产业链中处于优势地位或上下游运行态势好转，具有一定的垄断竞争优势，公司治理结构透明完善，管理水平领先的上市公司。</p>
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	预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金及货币市场基金。

### 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	2013 年	2012 年	2011 年
本期已实现收益	594,014,658.05	-479,205,880.81	-1,060,206,308.98
本期利润	1,098,185,280.06	557,077,007.33	-2,492,211,125.40
加权平均基金份额本期利润	0.1709	0.0784	-0.3124
本期基金份额净值增长率	14.59%	7.46%	-23.26%
3.1.2 期末数据和指标	2013 年末	2012 年末	2011 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0990	-0.1918	-0.1239
期末基金资产净值	7,873,894,134.42	7,689,980,382.74	7,953,270,580.35
期末基金份额净值	1.2886	1.1245	1.0464

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

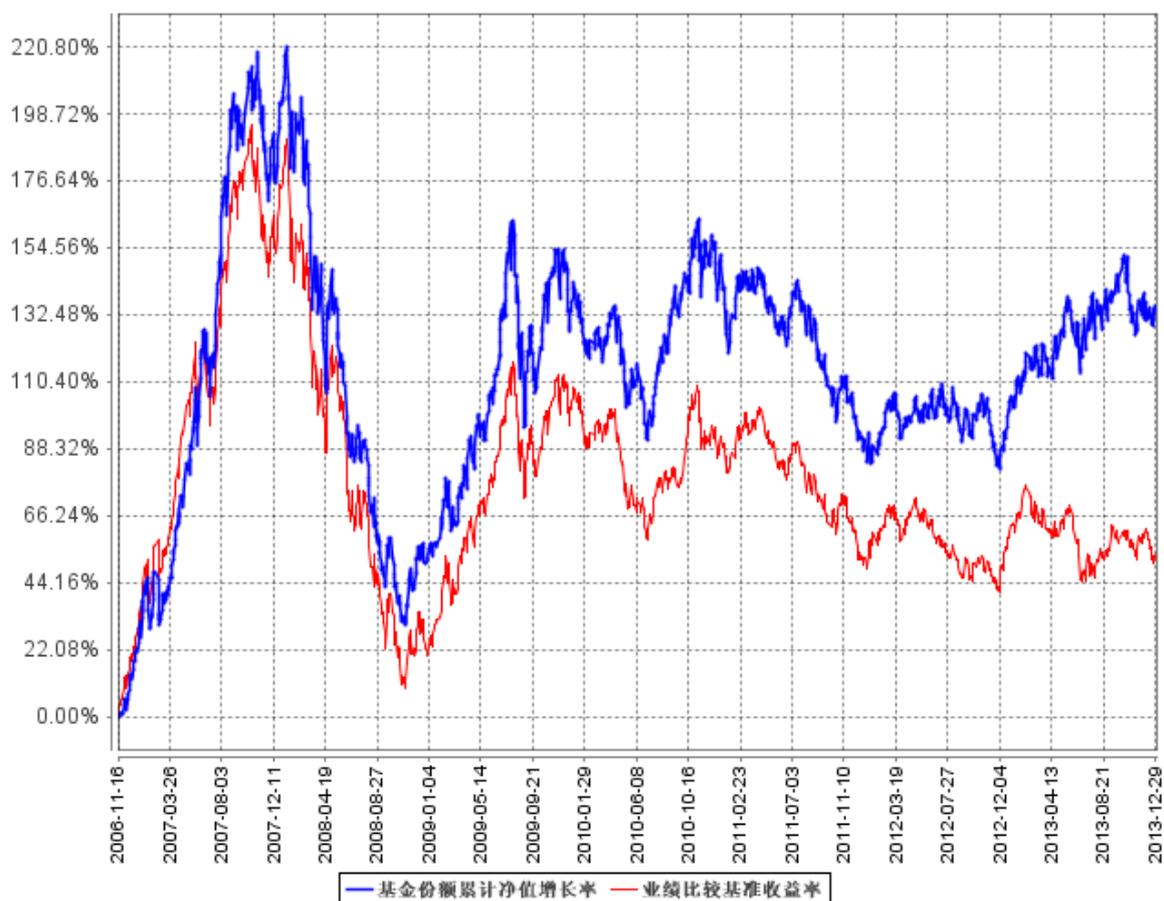
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-3.91%	1.17%	-2.45%	0.90%	-1.46%	0.27%
过去六个月	7.61%	1.28%	5.06%	1.03%	2.55%	0.25%
过去一年	14.59%	1.30%	-5.30%	1.11%	19.89%	0.19%
过去三年	-5.50%	1.15%	-18.57%	1.06%	13.07%	0.09%
过去五年	54.31%	1.37%	28.47%	1.24%	25.84%	0.13%
自基金合同生效起至今	135.38%	1.61%	54.31%	1.57%	81.07%	0.04%

### 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

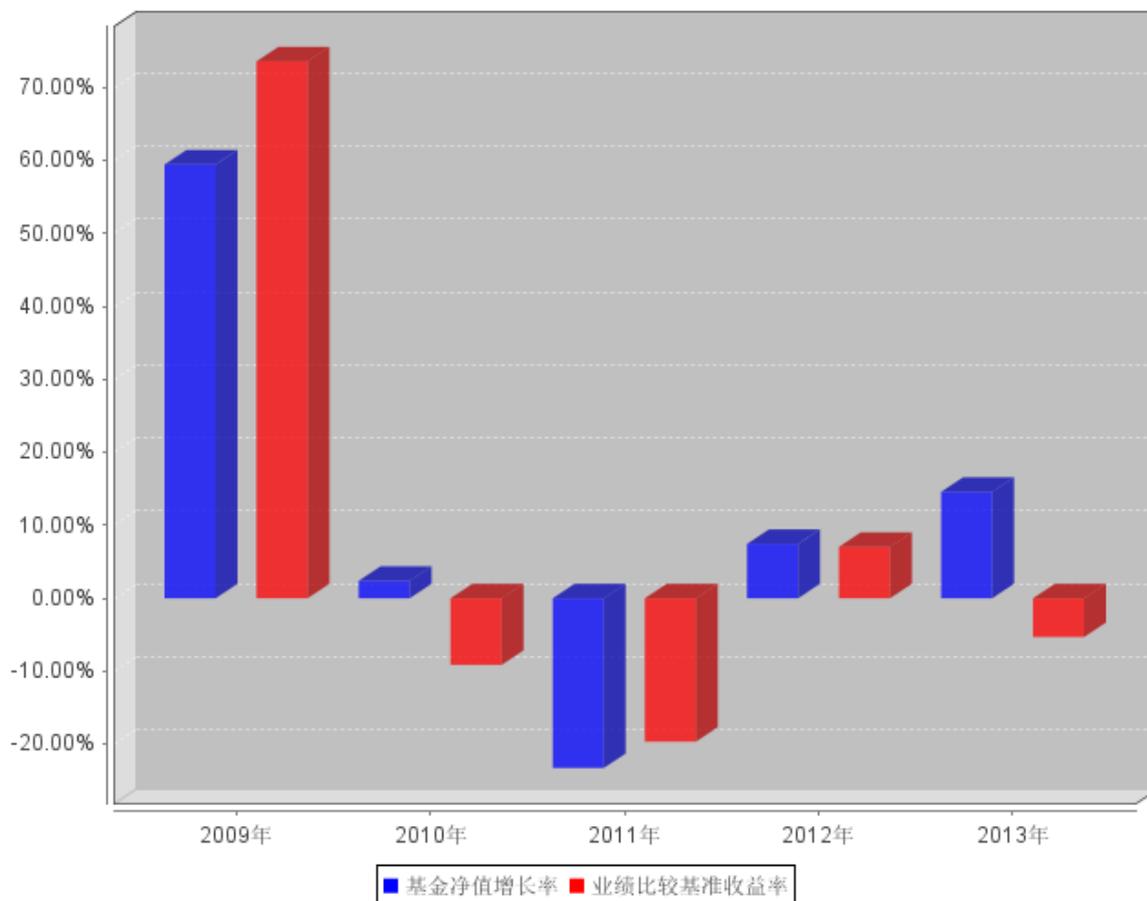
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：根据相关法律法规，本基金建仓期为基金合同生效之日起 3 个月。建仓期结束时，本基金各项资产配置比例达到基金合同的约定。

### 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
2013	-	-	-	-	
2012	-	-	-	-	
2011	1.0670	288,501,988.37	564,348,555.96	852,850,544.33	
合计	1.0670	288,501,988.37	564,348,555.96	852,850,544.33	

## § 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

1998年3月6日，经中国证监会批准，南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理

公司正式成立，成为我国“新基金时代”的起始标志。

南方基金总部设在深圳，注册资本 1.5 亿元人民币。股东结构为：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%）；兴业证券股份有限公司（10%）。目前，公司在北京、上海、合肥、成都、深圳等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司（香港子公司）和南方资本管理有限公司（深圳子公司）。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至报告期末，南方基金管理有限公司（不含子公司）管理资产规模近 2,300 亿元，旗下管理 45 只开放式基金，1 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		
张原	本基金的基金经理	2010年2月12日	-	7	美国密歇根大学经济学硕士学位，具有基金从业资格。2006年4月加入南方基金，曾担任南方基金研究部机械及电力设备行业高级研究员，南方高增及南方隆元基金经理助理；2009年9月至2013年4月，任南方500基金经理；2010年2月至今，任南方绩优基金经理；2011年2月至今，任南方高增基金经理。
史博	本基金的基金经理、公司研究部总监	2011年2月17日	-	15	特许金融分析师（CFA），硕士学历，具有基金从业资格。曾任职于博时基金管理有限公司、中国人寿资产管理有限公司、泰达宏利基金管理有限公司。2004年7月-2005年2月，任泰达周期基金经理；2007年7月-2009年5月任泰达首选基金经理；2008年8月-2009年9月任泰达市值基金经理；2009年4月-2009年9月任泰达品质基金经理。2009年10月加入南方基金，现任南方基金研究部总监、投资决策委员会委员。2011年2月至今，任南方绩优基金经理。
熊琳	本基金的基金经理助理	2012年3月15日	-	7	上海财经大学财务管理硕士，具有基金从业资格；曾担任中投证券研究所资深分析师，并获得新财富排名第六；2010年5月加入南方基金，担任研究部电子设备及新能源行业高级研究员；2012年3月至今，任南方绩优基金经理助理。

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，除非首任基金经理外，“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。

## 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、《南方绩优成长股票型证券投资基金合同》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，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。

## 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

2013 年，我国经济增长跌宕起伏，A 股市场的表现更多受到国内因素的影响，并主要由改革预期推动。年初市场对新一届班子改革政策和改革红利以及对城镇化等主题充满了憧憬，但随着主要经济指标低于年初投资者预期，呈现先抑后扬的态势。在稳增长措施和企业补库存的推动下，从三季度开始，我国各项经济指标才出现环比回暖，四季度陆续出台的宏观数据表明经济增速仍属于温和复苏，随着十八届三中全会决议的公布，市场信心扭转向上。行业表现上，2013 年成长股大幅上涨，创业板指数上涨 82.73%，主板则受地产、金融板块影响表现落后，结构性行情依然明显。

回顾 2013 年全年的操作，我们在仓位和持仓结构上较好地注重了控制，继续优化行业配置及个股组合。保持电子、计算机等成长行业的高配置，精选政策受益行业及个股投资机会，并继续关注盈利增长稳定和业绩超预期的公司，总体上述操作对基金绩效带来正面效果。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2013 年全年，南方绩优成长基金净值增长 14.59%，同期基金基准增长-5.30%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中长期来看，由于我国经济发展过程中积累的深层次问题和矛盾越来越突出，经济结构调整将比较漫长，既有第二产业整体产能过剩所倒逼的产业内部转型升级，又有第二、三产业之间正在稳步引导推进的产业结构比例优化。同时，企业经营也呈现出一些新的趋势性特点，生产要素中各要素成本刚性上升制约了简单的规模化扩张，资金要素对企业盈利的影响越来越明显，竞争所面临的外部环境随时有可能受到创新性、颠覆性商业模式的冲击。在经济增长达到一种新的平衡之前，企业经营将可能呈现出不同产业间结构化分化、企业内部经营逆转或形成新的增长点等多种模式和特点。鉴于此，未来 3-5 年，我们将更多的精力放在寻找结构、板块行情和规避阶段性下跌、把握阶段性上行的机会上。

整体看好 2014 年机会，但是很难出现系统性行情。外围发达经济体市场持续复苏势头确立，国内宏观政策受调结构的影响，市场风险偏好可能会随着三中全会决议逐步实施所带来的改革红利显著提升。但不同于往年的是，新兴国家货币市场风险正在积累，我国宏观调控底线思维带来的政策变动，将使市场投资者不断被动调整预期。企业所面临宏观经济形势的复杂性仍将对企业盈利的回升构成压力，并显著分化不同产业、不同行业间微观企业的盈利表现。

投资思路，2014 年我们将重点优选相对确定性高、真正具有成长性的个股投资机会，同时

关注受益于经济转型、竞争力不断提升地中游制造业，注重观察市场可能发生的冲击而保持灵活仓位，努力为持有人创造超额收益。

#### 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，组成人员包括副总经理、研究部总监、数量化投资部总监、风险管理部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。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。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，投资人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；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。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金不符合基金合同约定的收益分配条件，未有收益分配事项。

## § 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

2013 年，本基金托管人在对南方绩优成长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

2013 年，南方绩优成长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绩优成长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。

## 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绩优成长股票型证券投资基金 2013 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

## 6.1 审计报告基本信息

本基金 2013 年年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师签字出具了普华永道中天审字(2014)第 21236 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：南方绩优成长股票型证券投资基金

报告截止日：2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	631,985,447.64	441,475,775.06
结算备付金	14,976,275.27	3,236,512.74
存出保证金	4,371,547.16	3,140,539.81
交易性金融资产	6,626,242,507.35	7,248,794,538.94
其中：股票投资	6,152,983,964.85	6,991,685,354.94
基金投资	-	-
债券投资	473,258,542.50	257,109,184.00
资产支持证券投资	-	-

衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	498,721,668.09	-
应收证券清算款	113,565,787.40	14,687,591.17
应收利息	5,584,149.12	1,282,232.10
应收股利	28,000.00	-
应收申购款	1,617,661.79	477,541.44
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	7,897,093,043.82	7,713,094,731.26
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2013年12月31日</b>	<b>2012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	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	6,742,589.79	5,849,575.04
应付管理人报酬	9,975,920.96	9,158,215.10
应付托管费	1,662,653.48	1,526,369.17
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	4,575,230.34	4,882,502.58
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	242,514.83	1,697,686.63
负债合计	23,198,909.40	23,114,348.52
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	6,110,266,014.79	6,838,438,121.92
未分配利润	1,763,628,119.63	851,542,260.82
所有者权益合计	7,873,894,134.42	7,689,980,382.74
负债和所有者权益总计	7,897,093,043.82	7,713,094,731.26

注：报告截止日 2013 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2886 元，基金份额总额 6,110,266,014.79 份。

## 7.2 利润表

会计主体：南方绩优成长股票型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	1,290,015,355.47	725,045,612.89
1. 利息收入	27,604,012.97	21,584,184.81
其中：存款利息收入	5,647,092.14	5,228,048.46
债券利息收入	12,756,172.60	12,923,345.21
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	9,200,748.23	3,432,791.14
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	757,727,323.63	-333,196,512.57
其中：股票投资收益	684,757,690.51	-397,705,768.93
基金投资收益	-	-
债券投资收益	4,829,864.58	764,294.60
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	68,139,768.54	63,744,961.76
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	504,170,622.01	1,036,282,888.14
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	513,396.86	375,052.51
<b>减：二、费用</b>	191,830,075.41	167,968,605.56
1. 管理人报酬	119,820,561.82	115,510,283.53
2. 托管费	19,970,093.67	19,251,713.81
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	51,571,417.93	32,737,707.38
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	468,001.99	468,900.84
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	1,098,185,280.06	557,077,007.33
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	1,098,185,280.06	557,077,007.33

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方绩优成长股票型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 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）	6,838,438,121.92	851,542,260.82	7,689,980,382.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,098,185,280.06	1,098,185,280.06
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）	-728,172,107.13	-186,099,421.25	-914,271,528.38
其中：1. 基金申购款	351,238,096.27	91,783,215.98	443,021,312.25
2. 基金赎回款	-1,079,410,203.40	-277,882,637.23	-1,357,292,840.63
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）	6,110,266,014.79	1,763,628,119.63	7,873,894,134.42
项目	上年度可比期间 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）	7,600,775,903.06	352,494,677.29	7,953,270,580.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	557,077,007.33	557,077,007.33
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）	-762,337,781.14	-58,029,423.80	-820,367,204.94
其中：1. 基金申购款	137,189,372.84	10,972,816.86	148,162,189.70
2. 基金赎回款	-899,527,153.98	-69,002,240.66	-968,529,394.64
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）	6,838,438,121.92	851,542,260.82	7,689,980,382.74

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>杨小松</u>	<u>邓见梁</u>	<u>邓见梁</u>
基金管理人负责人	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、会计估计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 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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 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支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### 7.4.4 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
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（“厦门信托”）	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
南方资本管理有限公司	基金管理人的子公司
南方东英资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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。

#### 7.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.5.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	1,727,079,303.17	5.18%	2,289,116,506.36	10.69%
兴业证券	2,319,577,145.25	6.95%	515,542,199.27	2.41%

##### 7.4.5.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013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	1,531,881.46	5.11%	-	-
兴业证券	2,052,597.00	6.85%	242,987.66	5.34%
关联方名称	上年度可比期间 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	2,026,995.49	10.97%	686,704.18	14.08%
兴业证券	438,708.12	2.37%	219,572.14	4.50%

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。

## 7.4.5.2 关联方报酬

### 7.4.5.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	119,820,561.82	115,510,283.53
其中：支付销售机构的客户维护费	14,550,156.73	13,917,547.63

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。

### 7.4.5.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	19,970,093.67	19,251,713.81

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。

### 7.4.5.3 各关联方投资本基金的情况

无。

### 7.4.5.4 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	
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日		2012 年 1 月 1 日至 2012 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	631,985,447.64	5,352,131.59	441,475,775.06	5,087,200.21

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。

#### 7.4.5.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.5.6 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.6 利润分配情况

无。

#### 7.4.7 期末（2013年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.7.1 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

7.4.12.1.1 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
002236	大华股份	2013年5月29日	2014年5月31日	非公开发行流通受限	33.60	37.93	6,000,000	201,600,000.00	227,580,000.00	-
600509	天富热电	2013年3月21日	2014年3月19日	非公开发行流通受限	7.55	8.55	4,000,000	30,200,000.00	34,200,000.00	-

注：基金可作为特定投资者，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。

##### 7.4.7.2 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
600686	金龙汽车	2013年11月18日	重大事项未公告	8.91	2014年3月20日	9.60	15,600,000	112,504,589.31	138,996,000.00	-
300012	华测检测	2013年11月15日	公告重大事项	16.15	2014年1月23日	17.77	1,596,936	23,174,466.71	25,790,516.40	-

注：本基金截至2013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。

## § 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	6,152,983,964.85	77.91
	其中：股票	6,152,983,964.85	77.91
2	固定收益投资	473,258,542.50	5.99
	其中：债券	473,258,542.50	5.99
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	498,721,668.09	6.32
	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	646,961,722.91	8.19
6	其他各项资产	125,167,145.47	1.58
7	合计	7,897,093,043.82	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	采矿业	-	-
C	制造业	3,909,540,557.12	49.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	121,148,841.07	1.54
E	建筑业	172,964,719.20	2.20
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	900,717,326.41	11.44
J	金融业	486,252,617.91	6.18
K	房地产业	8,256,874.50	0.10
L	租赁和商务服务业	19,116,413.74	0.24
M	科学研究和技术服务业	25,790,516.40	0.33

N	水利、环境和公共设施管理业	483,682,000.00	6.14
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	25,514,098.50	0.32
S	综合	-	-
	合计	6,152,983,964.85	78.14

### 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	002236	大华股份	14,700,000	583,236,000.00	7.41
2	300070	碧水源	11,800,000	483,682,000.00	6.14
3	002415	海康威视	21,000,000	482,580,000.00	6.13
4	601318	中国平安	9,825,628	410,023,456.44	5.21
5	600703	三安光电	11,000,000	272,690,000.00	3.46
6	000917	电广传媒	14,444,406	235,588,261.86	2.99
7	600406	国电南瑞	14,085,940	209,457,927.80	2.66
8	000977	浪潮信息	4,000,000	180,920,000.00	2.30
9	002241	歌尔声学	4,499,852	157,854,808.16	2.00
10	600887	伊利股份	4,000,000	156,320,000.00	1.99

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	601166	兴业银行	1,017,655,501.16	13.23
2	600030	中信证券	677,246,683.44	8.81
3	600111	包钢稀土	560,255,899.09	7.29
4	600016	民生银行	436,639,619.85	5.68
5	002024	苏宁云商	396,029,100.24	5.15

6	601318	中国平安	351,856,645.70	4.58
7	600036	招商银行	347,176,272.64	4.51
8	000002	万科 A	308,211,121.27	4.01
9	600518	康美药业	267,367,263.62	3.48
10	601788	光大证券	262,337,240.81	3.41
11	601328	交通银行	260,712,447.65	3.39
12	000917	电广传媒	250,575,664.53	3.26
13	000049	德赛电池	248,062,200.18	3.23
14	002008	大族激光	242,946,406.29	3.16
15	002241	歌尔声学	240,500,472.57	3.13
16	600196	复星医药	224,202,917.41	2.92
17	600000	浦发银行	223,206,014.82	2.90
18	600703	三安光电	215,139,519.01	2.80
19	002236	大华股份	201,600,000.00	2.62
20	603000	人民网	193,636,447.61	2.52
21	601006	大秦铁路	186,002,873.03	2.42
22	600887	伊利股份	175,056,041.18	2.28
23	000977	浪潮信息	170,202,509.71	2.21
24	000100	TCL 集团	166,130,574.41	2.16
25	000970	中科三环	159,650,452.72	2.08
26	000527	美的电器	154,611,851.15	2.01

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	601166	兴业银行	987,101,684.21	12.84
2	600030	中信证券	655,501,063.29	8.52
3	600111	包钢稀土	578,773,894.29	7.53
4	600016	民生银行	421,894,012.48	5.49
5	600036	招商银行	394,532,929.48	5.13
6	002236	大华股份	364,268,902.94	4.74
7	600519	贵州茅台	357,984,861.43	4.66
8	002241	歌尔声学	334,430,202.68	4.35
9	000858	五粮液	332,057,025.00	4.32

10	002024	苏宁云商	319,209,911.63	4.15
11	000024	招商地产	311,880,282.53	4.06
12	601169	北京银行	284,973,053.75	3.71
13	002294	信立泰	272,728,133.75	3.55
14	000002	万科 A	262,637,305.04	3.42
15	601788	光大证券	252,107,621.63	3.28
16	600196	复星医药	246,932,098.14	3.21
17	601328	交通银行	242,888,150.63	3.16
18	600518	康美药业	232,858,581.54	3.03
19	600048	保利地产	218,652,646.19	2.84
20	600199	金种子酒	202,526,946.61	2.63
21	600000	浦发银行	201,617,350.95	2.62
22	600999	招商证券	182,568,344.46	2.37
23	002422	科伦药业	181,260,983.66	2.36
24	600383	金地集团	175,415,190.12	2.28
25	000049	德赛电池	173,146,785.79	2.25
26	601901	方正证券	171,024,628.81	2.22
27	600104	上汽集团	168,838,712.68	2.20
28	300070	碧水源	164,164,361.40	2.13
29	300315	掌趣科技	163,979,013.76	2.13
30	600015	华夏银行	163,320,293.65	2.12
31	600256	广汇能源	154,556,151.92	2.01

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	15,791,327,191.59
卖出股票收入（成交）总额	17,816,212,325.70

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	416,016,000.00	5.28

	其中：政策性金融债	416,016,000.00	5.28
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	57,242,542.50	0.73
8	其他	-	-
9	合计	473,258,542.50	6.01

## 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	090417	09 农发 17	1,700,000	167,076,000.00	2.12
2	130243	13 国开 43	1,500,000	148,950,000.00	1.89
3	130201	13 国开 01	1,000,000	99,990,000.00	1.27
4	113005	平安转债	533,730	57,242,542.50	0.73

## 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

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

## 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 8.11 投资组合报告附注

### 8.11.1

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。

### 8.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

**8.11.3 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	4,371,547.16
2	应收证券清算款	113,565,787.40
3	应收股利	28,000.00
4	应收利息	5,584,149.12
5	应收申购款	1,617,661.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	125,167,145.47

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**8.11.4 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。

**8.11.5 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	002236	大华股份	227,580,000.00	2.89	非公开发行

注：本基金本报告期末前十名股票中除上述股票外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
261,861	23,334.01	317,168,521.72	5.19%	5,793,097,493.07	94.81%

**9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,518,300.51	0.0248%

注：本公司基金投资和研究部门负责人未持有本基金份额，本公司高级管理人员持有本基金份额的数量区间为 10 万份至 50 万份（含），本基金基金经理没有持有本基金份额。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2006 年 11 月 16 日）基金份额总额	12,477,494,128.02
本报告期期初基金份额总额	6,838,438,121.92
本报告期基金总申购份额	351,238,096.27
减：本报告期基金总赎回份额	1,079,410,203.40
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	6,110,266,014.79

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

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

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。

基金管理人于 2013 年 7 月 27 日发布公告，南方基金管理有限公司（以下简称“公司”）第五届董事会任期届满，根据《公司法》、《证券投资基金管理公司管理办法》等法律法规和《公司章程》的规定，公司股东会 2013 年第一次临时会议（以下简称“本次公司股东会临时会议”）选举产生了公司第六届董事会。公司第六届董事会由 13 名董事组成，其中由本次公司股东会临时会议选举产生 12 名（包括独立董事 5 名），经营管理层董事 1 名将由公司董事会聘任的公司总经理担任。公司本次股东会临时会议选举产生的公司第六届董事会 12 名董事为：吴万善先生、张涛先生、姜健先生、余钢先生、项建国先生、李自成先生、庄园芳女士、姚景源先生、李心丹先生、周锦涛先生、郑建彪先生、周蕊女士。

经中国证券监督管理委员会证监许可【2013】1087 号文核准，基金管理人于 2013 年 8 月 22 日发布公告，自 2013 年 8 月 22 日起，杨小松转任公司总经理职务，不再担任公司督察长职务；

由鲍文革担任公司督察长职务。

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

本报告期内本基金未更换会计师事务所，本报告期内支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用 137,000.00 元，该审计机构已提供审计服务的连续年限为 7 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

因基金管理人管理的南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金（“开元 300ETF”）在集中申购期超过沪深 300 指数自然权重大比例接受停牌的永泰能源股票换购，然后在建仓期大比例卖出超过沪深 300 自然权重的部分股票，致使基金资产受到较大损失，2013 年 4 月 19 日中国证监会向公司下发了《关于对南方基金管理有限公司采取责令整改等措施的决定》（【2013】18 号）的行政监管措施决定书，认为基金管理人在开元 300ETF 投资过程中未能履行谨慎勤勉义务，内部控制方面存在内部控制制度建设薄弱，缺乏 ETF 募集期股票换购的相关制度规定；合规及风控管理未能覆盖 ETF 基金投资环节；关于永泰能源的相关决策未能留痕等。鉴于上述情况，按照《证券投资基金管理公司管理办法》第七十五条的规定，中国证监会责令公司进行为期 3 个月的整改，在整改期间暂停受理和审核公司所有新产品和新业务申请。

基金管理人于 2013 年 4 月 24 日发布了《南方开元沪深 300ETF 基金持有人补偿公告》，对开元 300ETF 超比例接受永泰能源股票换购给相关基金份额持有人造成的经济损失进行了补偿，实际补偿金额为 47,996,008.62 元。

同时，基金管理人就公司内部管理、合规及风险控制制度建设、ETF 募集及投资管理程序方面的问题进行了一一整改，并向中国证监会及其深圳监管局提交了整改报告，目前已完成整改工作、经监管部门现场检查并验收合格。

除上述情况外，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	
中信证券		24,341,953,355.07	13.02%	3,929,728.25	13.11%	-
华创证券		13,783,747,542.97	11.34%	3,348,239.82	11.17%	-
招商证券		22,785,145,491.67	8.35%	2,526,037.12	8.43%	-
中信建投		22,473,223,634.90	7.41%	2,220,367.14	7.41%	-
兴业证券		12,319,577,145.25	6.95%	2,052,597.00	6.85%	-
华西证券		12,156,869,552.82	6.47%	1,963,607.83	6.55%	-
中投证券		11,869,915,515.97	5.61%	1,654,689.03	5.52%	-
华泰证券		31,727,079,303.17	5.18%	1,531,881.46	5.11%	-
广发证券		11,469,586,133.60	4.41%	1,337,910.96	4.46%	-
海通证券		21,446,114,431.42	4.34%	1,316,546.15	4.39%	-
国泰君安		21,409,673,953.08	4.23%	1,247,423.20	4.16%	-
申银万国		11,290,048,989.41	3.87%	1,141,566.20	3.81%	-
中金公司		11,257,282,515.87	3.77%	1,144,626.90	3.82%	-
联讯证券	1	957,145,730.21	2.87%	871,378.30	2.91%	-
宏源证券	2	846,333,513.60	2.54%	770,504.51	2.57%	-
齐鲁证券	2	648,622,003.43	1.94%	590,504.20	1.97%	-
国信证券	2	571,137,425.65	1.71%	519,963.12	1.74%	-
红塔证券	1	557,740,774.05	1.67%	493,546.08	1.65%	-
东吴证券	1	467,712,855.84	1.40%	425,802.03	1.42%	-
瑞银证券	1	343,378,398.35	1.03%	312,609.30	1.04%	-
湘财证券	1	262,853,881.22	0.79%	232,600.04	0.78%	-
方正证券	1	221,691,873.87	0.66%	201,827.64	0.67%	-
大同证券	1	147,715,883.94	0.44%	130,714.52	0.44%	-
华宝经纪	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-

注：1、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。

2、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

- a、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- b、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；
- c、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- d、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交易单元：

- a、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；
- b、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；
- c、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。

### 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
中信证券	-	-	100,000,000.00	20.00%	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	18,723,069.80	37.94%	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	21,987,000.00	44.56%	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	8,632,800.00	17.50%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

海通证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	400,000,000.00	80.00%	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-
华宝经纪	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-