

南方稳利 1 年定期开放债券型证券投资基金 2014 年年度报告 摘要

2014 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2015 年 3 月 26 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 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。

本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

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。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	南方稳利 1 年定期开放债券	
基金主代码	000086	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 7 月 23 日	
基金管理人	南方基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	3,143,734,242.03 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	南方稳利 1 年定期开放债券 A	南方稳利 1 年定期开放债券 C
下属分级基金的交易代码:	000086	000720
报告期末下属分级基金的份额总额	2,999,648,916.61 份	144,085,325.42 份

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“南方稳利”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和追求基金资产长期稳定的基础上，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金以中长期利率趋势分析为基础，结合经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，实施积极的债券投资组合管理，以获取较高的债券组合投资收益。
业绩比较基准	一年期定期存款税后收益率×140%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	林葛
	联系电话	0755-82763888	010-66060069
	电子邮箱	manager@southernfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-889-8899	95599
传真		0755-82763889	010-68121816

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	2014 年		2013 年 7 月 23 日(基金合同生效日)-2013 年 12 月 31 日	
	南方稳利 1 年定期开放债券 A	南方稳利 1 年定期开放债券 C	南方稳利 1 年定期开放债券 A	南方稳利 1 年定期开放债券 C
本期已实现收益	115,156,397.65	2,629,242.37	16,535,735.98	-
本期利润	130,833,618.59	2,695,343.15	4,119,092.93	-
加权平均基金份额本期利润	0.0475	0.0206	0.0048	-
本期基金份额净值增长率	10.78%	1.86%	0.00%	-
3.1.2 期末数据和指标	2014 年末		2013 年末	
	南方稳利 1 年定期开放债券 A	南方稳利 1 年定期开放债券 C	南方稳利 1 年定期开放债券 A	南方稳利 1 年定期开放债券 C
期末可供分配基金份额利润	0.0176	0.0175	0.0048	-
期末基金资产净值	3,061,618,791.12	146,689,992.62	849,742,828.51	-
期末基金份额净值	1.021	1.018	1.005	-

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。

4、本基金自 2013 年 07 月 23 日,自 2014 年 7 月 24 日起增加 C 类份额。

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

南方稳利1年定期开放债券A

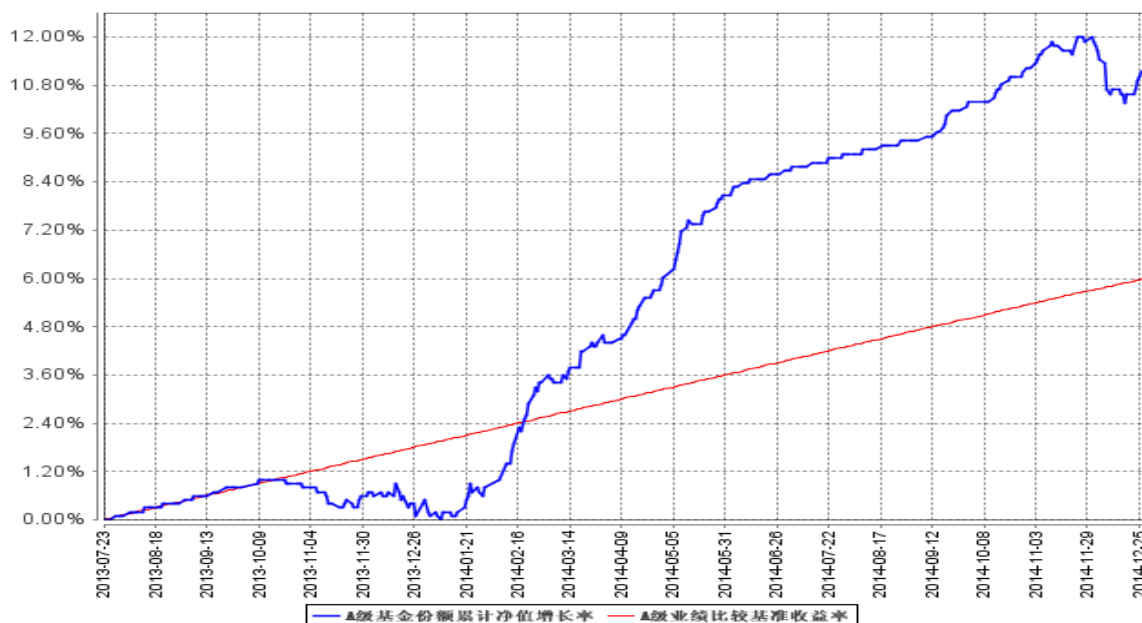
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.87%	0.12%	0.97%	0.01%	-0.10%	0.11%
过去六个月	2.45%	0.09%	2.00%	0.01%	0.45%	0.08%
过去一年	10.78%	0.11%	4.09%	0.01%	6.69%	0.10%
自基金合同生效起至今	11.34%	0.11%	6.03%	0.01%	5.31%	0.10%

南方稳利1年定期开放债券C

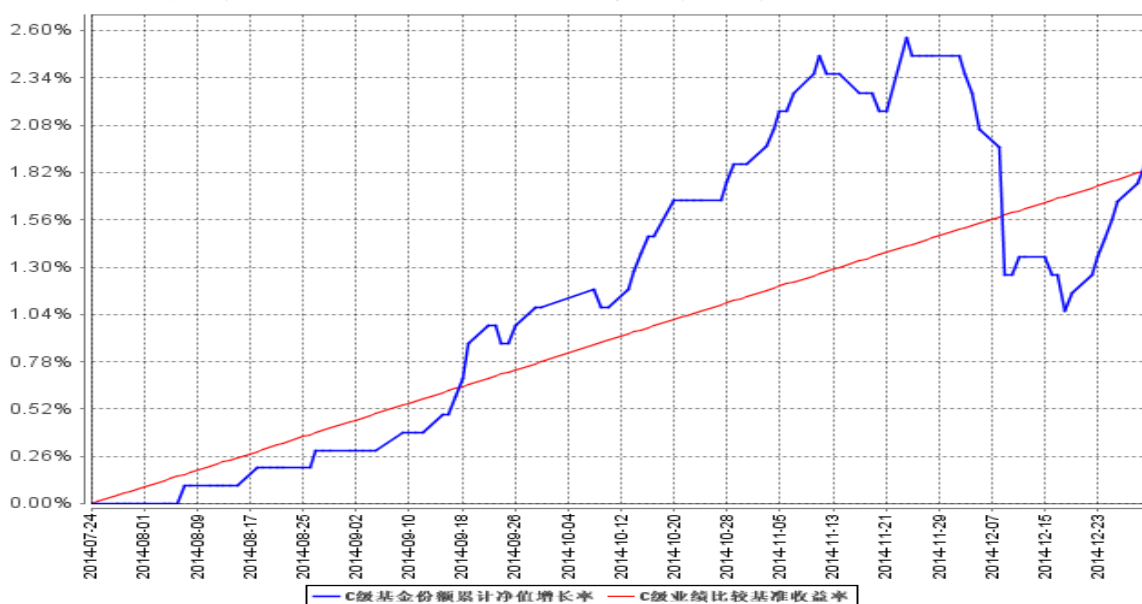
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.77%	0.13%	1.05%	0.01%	-0.28%	0.12%
过去六个月	1.86%	0.10%	1.84%	0.01%	0.02%	0.09%
自基金合同生效起至今	1.86%	0.10%	1.84%	0.01%	0.02%	0.09%

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

A级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



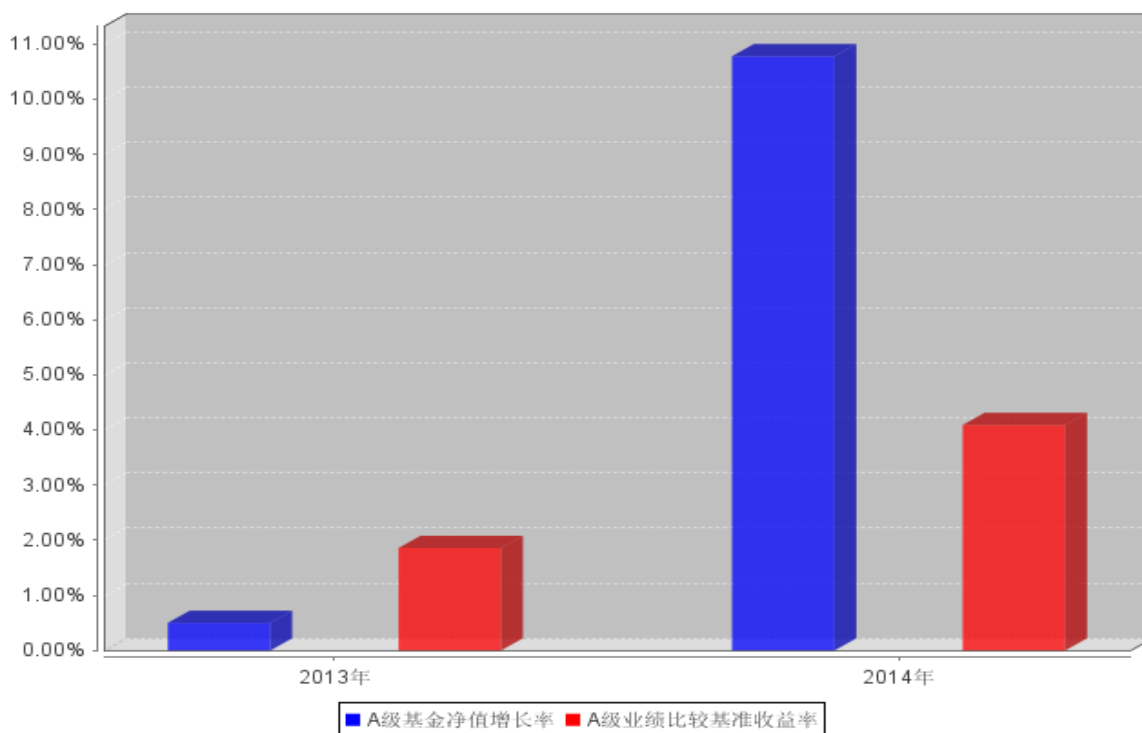
C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



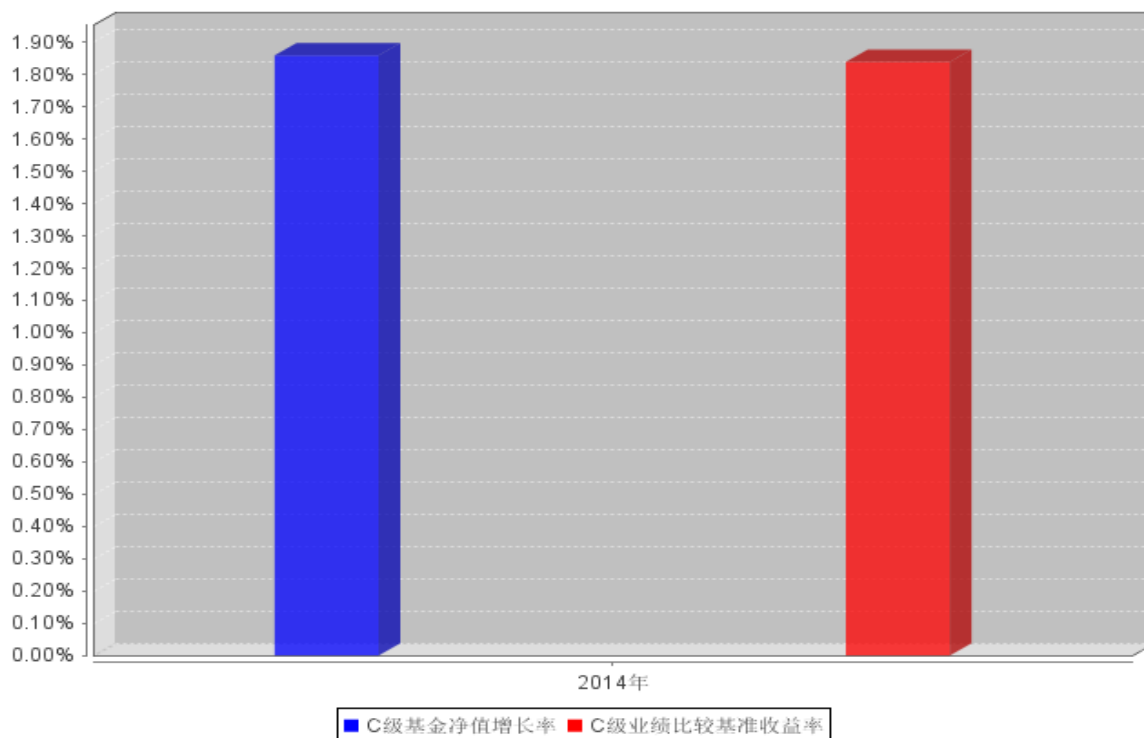
注：1. 本基金的基金合同生效日为 2013 年 7 月 23 日。本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。
 2. 本基金自 2014 年 7 月 24 日起增加 C 类收费模式，原有收费模式称为 A 类。

3.2.3 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比较

A级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



C级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



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

南方稳利1年定期开放债券A					
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
2014	0.9000	112,692,359.47	4,580,224.48	117,272,583.95	
2013	-	-	-	-	
合计	0.9000	112,692,359.47	4,580,224.48	117,272,583.95	

南方稳利1年定期开放债券C					
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
2014	0.2000	2,803,172.71	81,260.83	2,884,433.54	
2013	-	-	-	-	
合计	0.2000	2,803,172.71	81,260.83	2,884,433.54	

§ 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3亿元人民币。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3,000亿元，旗下管理57只开放式基金，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		
李璇	本基金基金经理	2013年7月23日	-	7年	女，清华大学金融学学士、硕士，注册金融分析师（CFA），具有基金从业资格。2007年加入南方基金，担任信用债高级分析师，现任固定收益部总监助理。2010年9月至2012年6月，担任南方宝元基金经理；2012年12月至2014年9月，担任南方安心基金经理；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；2013年7月至今，担任南方稳利基金经理。

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，“离任日期”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。

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》等有关法律法规、中国证监会和《南方稳利 1 年定期开放债券型证券投资基金基金合同》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，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。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

本基金管理人根据《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，建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则，投资管理制度和细则，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，两两组合同单日、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，未发现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 7 次，其中 6 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，1 次是由于指数型基金接受投资者申赎后被动增减仓位所致。

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

2014 年经济整体下行压力较大，主要受房地产和制造业固定资产投资下行拖累。5-7 月在稳增长推动下经济企稳回升，但 8 月工业增加值同比增速跌破 7%，大幅低于市场预期，10 月之后房地产销售在政策放松驱动下回暖，11、12 月信贷加速投放，但经济整体维持弱势运行。通胀方面，2014 年全年 CPI 同比增长 2.0%，较 2013 年明显下降，PPI 环比持续为负。2014 年货币政策整体偏宽松，体现了政府对经济的托底态度。央行二季度定向降准，下半年连续 4 次下调公开市场正回购操作利率，并在 11 月非对称降息，陆续采取各种方式释放宽松信号，引导社会融资成本下行，同时通过 SLO、SLF、MLF 等创新型货币工具投放基础货币，债券市场流动性状况较 2013 年明显好转，回购利率中枢大幅下行。在经济走弱、通胀走低、货币政策宽松的大背景下，2014 年债券全年走出牛市行情，10 年国债和 10 年金融债收益率分别下行 100bp 和 150bp，信用债受诸多风险事件惊险过关的刺激以及 43 号文带来的城投债兜底预期的提升，市场风险偏好不断提高，至 11 月底收益率下行幅度达 200-300bp，直到 12 月份中证登调整质押式回购政策的黑天鹅事件发生，市场对城投债的看多情绪逆转，收益率大幅回调，回吐了部分前期上涨。

投资运作上，南方稳利 1 年定期开放基金全年以信用债为主要持仓，同时配有一定的利率债仓位进行波段操作。组合在年初时配置了较高的债券仓位和久期，在上半年的债券牛市中获取了较好的资本利得和票息收益。考虑到基金第一个运作期间将于 7 月份结束，同时随着牛市的进行，我们也认为宽货币向宽信用过渡的不确定性在增加，不宜承担过高的利率风险，因此组合从 5 月份开始降低久期和仓位，减持了与开放期不匹配的品种，增持了与开放期相匹配的短期品种。8 月 14 日进入下一个运作周期后，组合进入新的建仓期，新增配置以中短期信用债和中长期利率债为主，利率债主要是秉承波段操作思路，为组合贡献了一定资本利得，信用债主要以获取持有收益为主。由于下半年基本处于建仓期，整体久期和仓位偏低，因而未能充分享受 8-11 月的债券牛市收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期南方稳利 1 年定期开放 A 级基金净值增长率为 10.78%，同期业绩比较基准增长率为 4.09%；南方稳利 1 年定期开放 C 级基金净值增长率为 1.86%，同期业绩比较基准增长率为 1.84%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2015 年，中国经济“新常态”，政府对经济增速下行的容忍度提高，重点放在结构改革，

预计经济增长目标可能适度下调。一季度信贷投放加速效果逐步显现，石油等大宗商品价格下跌使得部分制造业企业盈利能力上升，经济可能出现阶段性企稳，但二季度经济增速基数高，地方政府债务清理衔接问题可能导致财政悬崖，经济面临阶段性失速风险。通胀方面，全球经济放缓对 CPI 和 PPI 形成压制，猪周期暂未启动，预计 2015 年全年 CPI 同比 1.7%-1.9%，略低于 2014 年，PPI 已连续 35 个月同比下滑，目前看市场面临的是通缩风险而非通胀风险。经济基本面对债市而言偏乐观，货币政策也预计将维持偏宽松的基调，仍存在降息和降准的可能。未来债券市场收益率下行的主要机会来自经济阶段性失速或者通胀持续低于预期带来的货币政策再次大幅放松，需要根据经济基本面和货币政策变化波段操作，捕捉资本利得机会。但是也需要防范货币政策由宽货币向宽信用转变、中低评级产业债资质恶化、以及地方政府债务黑天鹅事件等风险因素对债券市场造成的冲击。南方稳利 1 年定期开放基金未来的投资将仍以信用债为主，谨慎选择信用状况较好的公司和债券进行投资，利率债则结合对经济基本面和货币政策的判断以波段操作为主。组合将于 8 月份结束本运作周期，我们将择机适当增加久期与开放期匹配的品种的仓位、降低久期较长的品种的仓位。

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，本基金管理人严格遵守相关法律法规，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。

本报告期内，本基金管理人开展了基金管理公司内控自查、基金从业人员证券投资行为自查等多项内控自查工作，制定或修订了关联交易管理、员工证券投资管理 etc 内部制度，进一步完善了公司的内控体系；对公司投研交易、市场销售、后台运营等业务开展了定期或专项稽核，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性；采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，加强对日常投资运作的管理和监控，督促投研交易业务的合规开展；针对新出台的法律法规和监管要求，积极组织多项法律法规、职业道德培训以及合规考试，不断提高从业人员的合规素质和职业道德修养；全面参与新产品设计、新业务拓展工作；严格审查基金宣传推介材料，及时检查基金销售业务的合法合规情况；完成各项信息披露工作，保证所披露信息的真实性、准确性和完整性；监督客户投诉处理，重视媒体监督和投资者关系管理。

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，顺应“放松管制、加强监管”的监管形势，积极健全内部管理制度，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，切实保护基金资产的安全与利益。

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，组成人员包括副总经理、权益投资总监、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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于 2014 年 7 月 24 日新增了 C 类份额，并修改了基金合同相应条款。

(1) 合同原文中“三、基金收益分配原则”：

“1、1、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。若本基金每个封闭期结束日（不含）之前的第 15 个工作日当日收市后每 10 份基金份额可分配利润金额高于 0.1 元（含），则本基金在 15 个工作日之内进行收益分配。每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 50%。若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；”

“4、每一基金份额享有同等分配权；”

(2) 增加 C 类份额后，合同原文中“三、基金收益分配原则”：

“1、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。若本基金每个封闭期结束日（不含）之前的第 15 个工作日当日收市后某类基金份额类别每 10 份基金份额可分配利润金额高于 0.1 元（含），则本基金在 15 个工作日之内进行该基金份额类别的收益分配。各基金份额类别每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 50%。若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；”

“4、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；”

本报告期内第一季度末满足分红条件，本基金于2014年4月14日进行了收益分配（A类每10份基金份额派发红利0.20元）；本报告期内第二季度末满足分红条件，本基金于2014年7月16日进行了收益分配（A类每10份基金份额派发红利0.50元）；本报告期内第三季度末满足分红条件，本基金于2014年11月07日进行了收益分配（A类、C类每10份基金份额派发红利0.20元）；本报告期内第四季度末满足分红条件，本基金于2015年2月06日进行了收益分配（A类、C类每10份基金份额均派发红利0.15元）。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—南方基金管理有限公司2014年1月1日至2014年12月31日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，南方基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，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

本托管人认为，南方基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

本基金 2014 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(2015)第 20385 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: 南方稳利 1 年定期开放债券型证券投资基金

报告截止日: 2014 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
资产:		
银行存款	1,129,652.32	220,853,728.90
结算备付金	6,457,168.38	27,259,682.66
存出保证金	12,933.47	83,344.10
交易性金融资产	3,613,392,927.90	1,676,540,089.57
其中: 股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	3,613,392,927.90	1,676,540,089.57
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	1,338,114.46
应收利息	36,532,082.10	25,944,264.95
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,657,524,764.17	1,952,019,224.64
负债和所有者权益	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 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	446,057,770.91	1,101,429,544.41
应付证券清算款	-	23,316.77
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	1,902,850.73	505,532.17
应付托管费	543,671.64	144,437.75
应付销售服务费	49,723.72	-
应付交易费用	18,290.72	285.64
应交税费	-	-
应付利息	361,672.71	73,279.39
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	282,000.00	100,000.00
负债合计	449,215,980.43	1,102,276,396.13
所有者权益：		
实收基金	3,143,734,242.03	845,712,895.33
未分配利润	64,574,541.71	4,029,933.18
所有者权益合计	3,208,308,783.74	849,742,828.51
负债和所有者权益总计	3,657,524,764.17	1,952,019,224.64

注：报告截止日2014年12月31日，基金份额总额3,143,734,242.03份，其中A类基金份额总额为2,999,648,916.61份，基金份额净值1.021元；C类基金份额总额为144,085,325.42份，基金份额净值1.018元。

7.2 利润表

会计主体：南方稳利1年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年7月23日(基金合同生效日)至2013年12月31日
一、收入	167,307,379.31	12,846,223.24
1.利息收入	115,214,138.00	24,581,480.92
其中：存款利息收入	10,684,647.39	8,752,480.86
债券利息收入	93,489,993.71	15,694,728.08
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	11,039,496.90	134,271.98
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	35,211,362.10	481,469.71

其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	35,211,362.10	481,469.71
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	15,743,321.72	-12,416,643.05
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	1,138,557.49	199,915.66
减：二、费用	33,778,417.57	8,727,130.31
1. 管理人报酬	12,517,281.29	2,643,858.64
2. 托管费	3,576,366.14	755,388.18
3. 销售服务费	237,310.10	-
4. 交易费用	48,814.54	1,681.14
5. 利息支出	16,913,847.36	5,137,527.81
其中：卖出回购金融资产支出	16,913,847.36	5,137,527.81
6. 其他费用	484,798.14	188,674.54
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	133,528,961.74	4,119,092.93
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	133,528,961.74	4,119,092.93

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方稳利1年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014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）	845,712,895.33	4,029,933.18	849,742,828.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	133,528,961.74	133,528,961.74
三、本期基金份额交易产生的基金净	2,298,021,346.70	47,172,664.28	2,345,194,010.98

值变动数 (净值减少以“-”号填列)			
其中: 1. 基金申购款	2,976,206,374.02	60,190,883.13	3,036,397,257.15
2. 基金赎回款	-678,185,027.32	-13,018,218.85	-691,203,246.17
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)	-	-120,157,017.49	-120,157,017.49
五、期末所有者权益(基金净值)	3,143,734,242.03	64,574,541.71	3,208,308,783.74
项目	上年度可比期间 2013 年 7 月 23 日(基金合同生效日)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)	855,619,519.69	-	855,619,519.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	4,119,092.93	4,119,092.93
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)	-9,906,624.36	-89,159.75	-9,995,784.11
其中: 1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-9,906,624.36	-89,159.75	-9,995,784.11
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)	845,712,895.33	4,029,933.18	849,742,828.51

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>徐超</u>	<u>徐超</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 基金基本情况

南方稳利 1 年定期开放债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]253 号《关于核准南方稳利 1 年定期开放债券型证券投资基金募集的批复》核准,由南方基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方稳利 1 年定期开放债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 855,296,120.75 元,业经普华永道

中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2013)第 465 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方稳利 1 年定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2013 年 7 月 23 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 855,619,519.69 份,其中认购资金利息折合 323,398.94 份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《南方稳利 1 年定期开放债券型证券投资基金基金合同》的相关规定,本基金以定期开放的方式运作,即本基金以运作周期和自由开放期相结合的方式运作。本基金以 1 年为一个运作周期,每个运作周期为自基金合同生效日(含)或每个自由开放期结束之日的次日(含)起至 1 年后的对日的期间。在每个运作周期结束后进入自由开放期。在自由开放期内,本基金采取开放运作模式,投资人可办理基金份额申购、赎回或其他业务。在首个运作周期中,本基金的受限开放期为基金合同生效日起每三个月的对日。在第二个及以后的运作周期中,本基金的受限开放期为该运作周期首日起每三个月的对日。本基金的每个受限开放期为 1 个工作日。在每个受限开放期,本基金将开放赎回,但对赎回数量进行控制,确保赎回数量占该受限开放期前一日基金份额总数的 10%以内(含 10%)。当赎回数量占比超过该受限开放期前一日基金份额总数的 10%,则对赎回申请的确认按照前一日基金份额总数的 10%占该日实际赎回申请的比例进行部分确认。在每个受限开放期,本基金一般不接受申购申请。基金管理人可根据本基金的运作状况或市场情况开放本基金的申购业务,并可对申购设定上限或设定比例确认规则等。在每个运作周期内,除受限开放期以外,均为封闭期。在封闭期内,本基金不接受基金份额的申购和赎回。

根据《关于南方稳利 1 年定期开放债券型证券投资基金增加收费模式并修改基金合同的公告》和《南方稳利 1 年定期开放债券型证券投资基金招募说明书》,自 2014 年 7 月 24 日起,本基金根据申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取前端申购费用的称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取申购费用的称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存,分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方稳利 1 年定期开放债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具,包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债、地方政府债、资产支持证券、中小企业私募债券、可分离交易可转债中的债券部分、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金对固定收益类金融工具的投资比例合计不低于基金资产的 80%,其中对信用类固定收益金融工具的投资比例合计不低于基

金固定收益类金融工具的 80%。本基金不直接从二级市场买入股票、权证、可转债等，也不参与一级市场的新股、可转债申购或增发新股。本基金的业绩比较基准为：一年期定期存款税后收益率×140%。

本财务报表由本基金的基金管理人南方基金管理有限公司于 2015 年 3 月 24 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《南方稳利 1 年定期开放债券型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2014 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.4.1 会计政策变更的说明

财政部于 2014 年颁布《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号——合营安排》、《企业会计准则第 41 号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第 2 号——长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号——职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》、《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》以及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》，要求除《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》自 2014 年度财务报表起施行外，其他准则自 2014 年 7 月 1 日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

7.4.4.2 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。

7.4.4.3 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。

7.4.5 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》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，包括买卖债券的差价收入，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，应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。

7.4.6 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
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
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
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。

7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.7.1.1 股票交易

注：无。

债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2013 年 7 月 23 日 (基金合同生效日) 至 2013 年 12 月 31 日	
	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 成交总额的 比例
华泰证券	88,127,256.46	8.01%	29,461,801.61	3.10%

债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年7月23日(基金合同生效日)至 2013年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
华泰证券	4,657,661,000.00	5.12%	797,931,000.00	3.16%

7.4.7.1.2 权证交易

注：无。

7.4.7.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014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	-10,176.81	90.78%	-12,544.55	86.60%
关联方名称	上年度可比期间 2013年7月23日(基金合同生效日)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	-2,367.74	72.30%	-2,367.74	72.30%

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。

7.4.7.2 关联方报酬

7.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12 月31日	上年度可比期间 2013年7月23日(基金合同生效日) 至2013年12月31日
当期发生的基金应支付	12,517,281.29	2,643,858.64

的管理费		
其中：支付销售机构的客户维护费	5,572,952.14	1,197,830.12

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0.7%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 0.7% / 当年天数。

7.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年12月31日	2013年7月23日(基金合同生效日)至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,576,366.14	755,388.18

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值0.2%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 0.2% / 当年天数。

7.4.7.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2014年1月1日至2014年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方稳利1年定期开放债券A	南方稳利1年定期开放债券C	合计
中国农业银行	-	62,019.62	62,019.62
南方基金	-	2,958.08	2,958.08
华泰证券	-	9.18	9.18
合计	-	64,986.88	64,986.88

注：自2014年7月24日起，支付销售机构的C类基金份额销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给南方基金，再由南方基金计算并支付给各基金销售机构。A类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：

日销售服务费=前一日C类基金份额基金资产净值 X 0.40% / 当年天数。

7.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

7.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.7.4.1 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。

7.4.7.4.2 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。

7.4.7.5 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 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年7月23日(基金合同生效日)至 2013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
中国农业银行	1,129,652.32	283,456.32	853,728.90	60,081.08

注：本基金的活期存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.7.6 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 2014年1月1日至2014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	1480053	14 莆田城投债	新债分销	200,000	20,000,000.00
上年度可比期间 2013年7月23日(基金合同生效日)至2013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	041372007	13 锡产业 CP002	新债分销	100,000	10,000,000.00

7.4.7.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.8 期末(2014年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

7.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

7.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2014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446,057,770.91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
1480580	14大连融达债	2015年1月7日	100.29	1,010,000	101,292,900.00
101456082	14贵州高速MTN001	2015年1月12日	98.63	1,000,000	98,630,000.00
101459064	14陕交建MTN002	2015年1月5日	100.45	818,000	82,168,100.00
1480580	14大连融达债	2015年1月8日	100.29	505,000	50,646,450.00
041461051	14悦达CP002	2015年1月12日	100.18	300,000	30,054,000.00
071421004	14渤海证券CP004	2015年1月12日	99.91	300,000	29,973,000.00
071441003	14恒泰证券CP003	2015年1月12日	99.86	300,000	29,958,000.00
041460112	14巢湖CP001	2015年1月12日	98.97	300,000	29,691,000.00
合计				4,533,000	452,413,450.00

7.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2014年12月31日止,本基金无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。

§ 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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	3,613,392,927.90	98.79
	其中:债券	3,613,392,927.90	98.79
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-

4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	7,586,820.70	0.21
7	其他各项资产	36,545,015.57	1.00
8	合计	3,657,524,764.17	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

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

注：本基金本报告期末未持有股票。

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

注：本基金本报告期末未持有股票。

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

注：本基金本报告期末未持有股票。

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	333,057,000.00	10.38
	其中：政策性金融债	333,057,000.00	10.38
4	企业债券	597,821,927.90	18.63
5	企业短期融资券	1,898,657,000.00	59.18
6	中期票据	783,857,000.00	24.43
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	3,613,392,927.90	112.63

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	1480580	14 大连融达债	1,600,000	160,464,000.00	5.00
2	140358	14 进出 58	1,200,000	123,996,000.00	3.86
3	011452002	14 南航 SCP002	1,000,000	100,700,000.00	3.14
4	101455035	14 中建材 MTN002	1,000,000	100,240,000.00	3.12
5	071401013	14 招商 CP013	1,000,000	100,060,000.00	3.12

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

-

8.12.3 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	12,933.47
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	36,532,082.10
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	36,545,015.57

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

§ 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

份额级别	持有人户数	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)	额	持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
南方稳利 1 年定 期开放债券 A	23,662	126,770. 73	5,338,471.0 2	0.18%	2,994,310,445.59	99.82%
南方稳利 1 年定 期开放债券 C	825	174,648. 88	-	-	144,085,325.42	100.00 %
合计	24,487	128,383. 81	5,338,471.0 2	0.17%	3,138,395,771.01	99.83%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	南方稳利 1 年定 期开放债券 A	23,528.61	0.0008%
	南方稳利 1 年定 期开放债券 C	-	0.0000%
	合计	23,528.61	0.0008%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金份额，本基金基金经理未持有本基金份额。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方稳利 1 年定 期开放债券 A	南方稳利 1 年定 期开放债券 C
基金合同生效日（2013 年 7 月 23 日）基金份 额总额	855,619,519.69	-
本报告期期初基金份额总额	845,712,895.33	-
本报告期基金总申购份额	2,831,904,977.23	144,301,396.79
减：本报告期基金总赎回份额	677,968,955.95	216,071.37
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-” 填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,999,648,916.61	144,085,325.42

注：本基金自 2014 年 7 月 24 日起增加 C 类份额。

§ 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

报告期内，因中国农业银行股份有限公司（以下简称“本行”）工作需要，任命余晓晨先生主持本行托管业务部/养老金管理中心工作。余晓晨先生的基金行业高级管理人员任职资格已在中国基金业协会备案。

除此之外，本报告期内，本基金的基金管理人、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，无涉及基金管理业务、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（特殊普通合伙）。本年度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 82,000 元。该审计机构已提供审计服务的连续年限为 2 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	
国泰君安	1	-	-	-1,940.95	13.40%	-
华泰证券	1	-	-	-12,544.55	86.60%	-

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
国泰君安	1,011,893,602.02	91.99%	86,384,300,000.00	94.88%	-	-
华泰证券	88,127,256.46	8.01%	4,657,661,000.00	5.12%	-	-

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。