

南方积极配置证券投资基金 2010 年年度报告摘要

2010 年 12 月 31 日

基金管理人：南方基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2011 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 03 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 01 月 01 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	南方积极配置股票 (LOF)
基金主代码	160105
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)
基金合同生效日	2004 年 10 月 14 日
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,935,045,994.13 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2004 年 12 月 20 日

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“南方积配”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票配置型基金，通过积极操作进行资产配置和行业配置，在时机选择的同时精选个股，力争在适度控制风险并保持良好流动性的前提下，为投资者寻求较高的投资收益。
投资策略	本基金秉承的是”积极配置”的投资策略。通过积极操作进行资产配置和行业配置，在此基础上选择个股，

	力争达到”在适度控制风险并保持良好流动性的前提下，为投资者寻求较高的投资收益”的投资目标。在本基金中，配置分为一级配置、二级配置和三级配置，其中一级配置就是通常所说的资产配置，二级配置是指股票投资中的行业配置，三级配置也就是个股选择。
业绩比较基准	本基金股票投资部分的业绩比较基准采用上证综指，债券投资部分的业绩比较基准采用上证国债指数。本基金定位在股票配置型基金，以股票投资为主，国债投资只是为了回避市场的系统风险，因此，本基金的整体业绩比较基准可以表述为如下公式：基金整体业绩基准=上证综指×85%+上证国债指数×15%
风险收益特征	本基金定位为股票配置型基金，强调采用积极策略通过三种配置（资产配置、行业配置和个股配置）进行投资，因此属于证券投资基金中较高预期风险和较高预期收益的品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

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

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2010 年	2009 年	2008 年
本期已实现收益	261,777,903.78	263,421,097.14	-753,560,903.49
本期利润	154,095,614.46	1,252,244,745.80	-2,935,719,458.70
加权平均基金份额本期利润	0.0689	0.4552	-0.9324
本期基金份额净值增长率	6.98%	53.23%	-50.51%

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	0.2783	0.2597	-0.1779
期末基金资产净值	2,473,623,470.41	3,031,932,842.39	2,474,473,870.04
期末基金份额净值	1.2783	1.2597	0.8221

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。

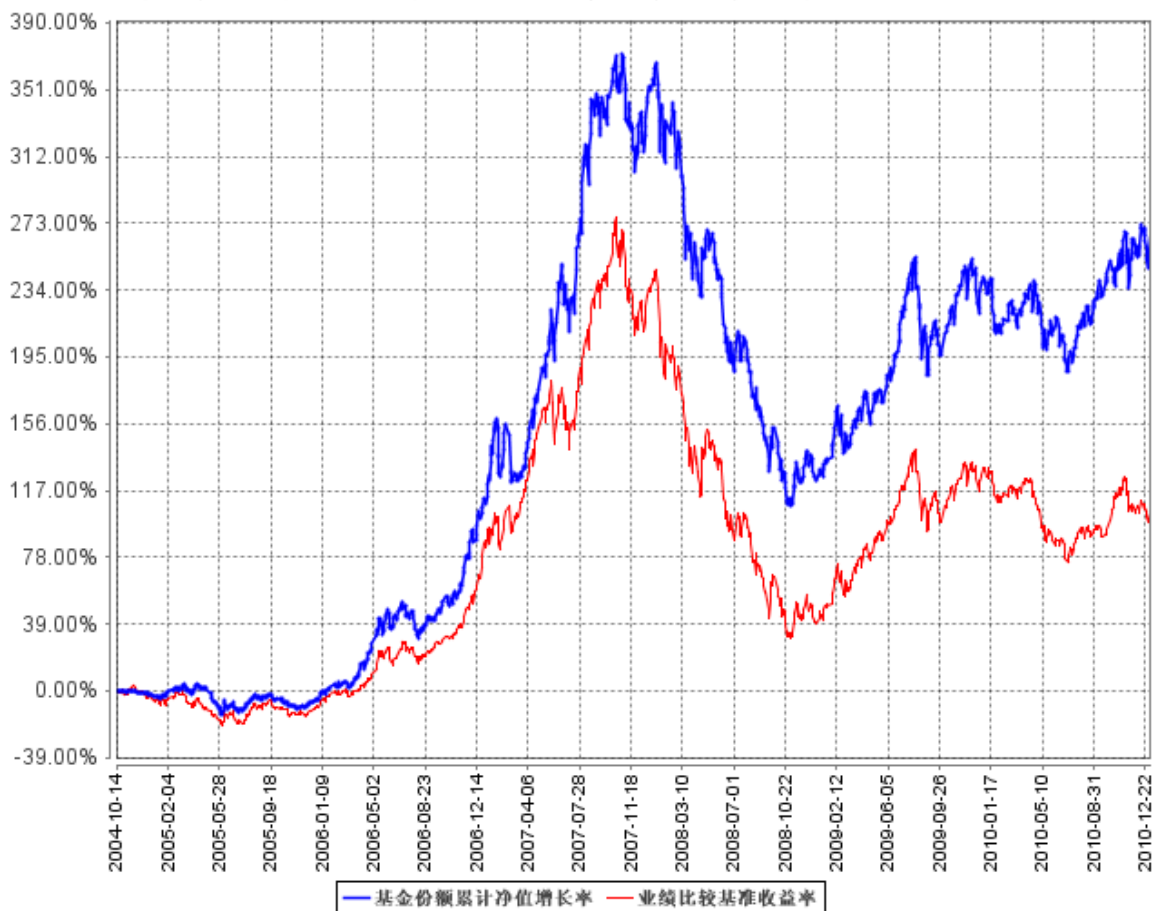
3.2 基金净值表现

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	6.23%	1.63%	4.91%	1.32%	1.32%	0.31%
过去六个月	24.37%	1.38%	14.60%	1.17%	9.77%	0.21%
过去一年	6.98%	1.33%	-11.60%	1.21%	18.58%	0.12%
过去三年	-18.88%	1.62%	-38.86%	1.84%	19.98%	-0.22%
过去五年	283.96%	1.67%	123.80%	1.74%	160.16%	-0.07%
自基金合同生效起至今	265.30%	1.54%	103.65%	1.64%	161.65%	-0.10%

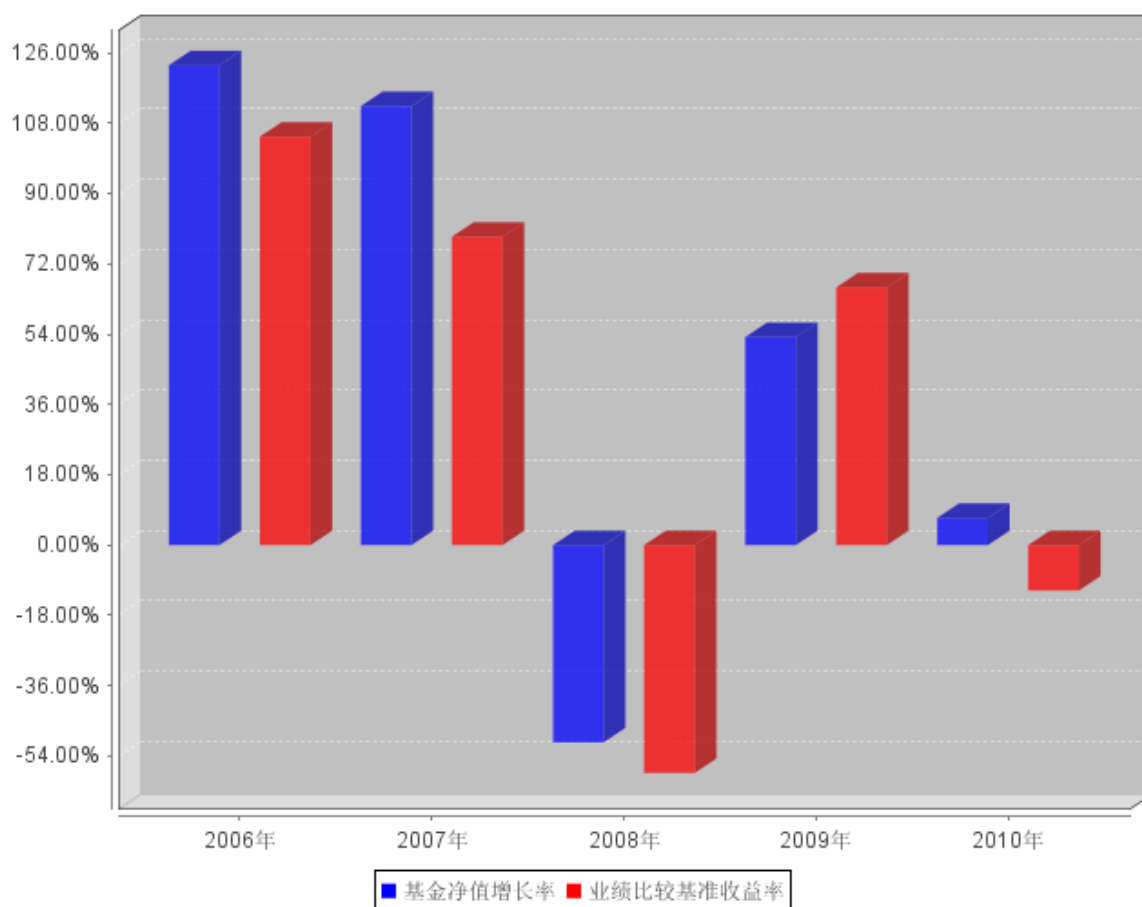
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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
2010	0.6000	59,414,309.31	75,959,053.85	135,373,363.16	
2009	-	-	-	-	
2008	3.0900	395,171,921.20	504,416,576.15	899,588,497.35	
合计	3.6900	454,586,230.51	580,375,630.00	1,034,961,860.51	

§ 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%。

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		
李源海	本基金的基金经理	2010 年 1 月 30 日	-	9	经济学硕士，具有基金从业资格。曾任职于中国银行深圳分行、湘财证券有限责任公司投资银行部及证券投资部；2002 年起进入基金行业，历任万家基金管理有限公司（原天同基金管理有限公司）研究部高级经理、基金管理部基金经理；2004 年 9 月至 2005 年 10 月任万家增强收益债券型证券投资基金（原天同保本增值证券投资基金）基金经理；2006 年 7 月至 2007 年 7 月任申万巴黎收益宝货币市场基金基金经理；2006 年 2 月至 2009 年 8 月，任申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金基金经理；2008 年 7 月至 2009 年 8 月，任申万巴黎竞争优势股票型证券投资基金基金经理。2009 年 8 月，加入南方基金，任职于产品开发部；2010 年 1 月至今，担任南方基金投资部副总监、南方积配基金经理；2010 年 7 月至今，任南方稳健、南稳贰号基金经理。
张慎平	本基金	2008 年 1	2010 年 1	7	注册金融分析师（CFA），经济学硕士，具

	的基金 经理	月 14 日	月 30 日		有基金从业资格。2003 年加入南方基金，负责石化化工、建筑建材行业研究，2008 年 1 月至 2010 年 1 月，任南方积配基金经理；2008 年 4 月至 2011 年 2 月，任南方成份基金经理；2010 年 1 月至 2011 年 2 月，任南方稳健基金经理；2010 年 1 月至 2011 年 2 月，任南稳贰号基金经理。
--	-----------	--------	--------	--	---

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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《南方积极配置证券投资基金合同》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 年海外发达经济体继续维持宽松货币政策，经济复苏态势渐显。国内投资、消费等内需旺盛，伴随宏观政策退出预期和房地产调控政策，整体市场表现一般，稳定增长类、新兴产业板块涨幅较好。

本基金年初确定了注重成长、精选个股的投资策略，一直看好并重点配置了受益未来人口老龄化的医药、居民收入上升推动的中低端消费以及增长明确的信息服务和电网设备等，低配周期性行业。四季度，基金增加了煤炭、建材的配置，进一步提高了机械、节能环保和信息服务的持仓比例，适度降低了医药和商业零售等大消费的比例。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金全年实现了约 7% 的正收益，相较跌幅为-12.5% 的沪深 300 指数，有一定的超额收益，基金净值保持了较低的波动度。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，海外发达经济体复苏趋势将加快，新兴经济体通胀压力难以缓解。国内宏观政策仍将在控制通胀和保持经济增长之间进行平衡，会继续通过提高居民收入、控制房价等来扩大居民消费能力，产品质量上升的内在要求能带动制造业的装备升级。通过产业升级和产能控制，中国经济结构调整有了更大腾挪空间。

国家对房地产的调控，正在影响居民的资产配置比例，同时市场 IPO 等融资需求继续扩大。综合考虑，整体市场的估值水平将会上升，个股选择范围更加广阔，股票市场的投资风格将更加多元化。

对此，本基金继续根据业绩成长的确定性和估值的安全性两个标准进行组合构建，找寻具有核心竞争优势、行业景气度高、估值合理的个股，进一步培养投资的前瞻性，努力提高基金绩效。

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；本基金每

年收益分配次数最多为 4 次，年度收益分配比例不低于基金年度已实现收益的 50%；场外投资者可以选择现金分红或红利再投资；场内投资者只能选择现金分红；本基金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，年度收益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份额净值不能低于面值；每一基金份额享有同等分配权。

根据上述收益分配原则，本报告期本基金按照基金合同约定分红比例计算的应分配金额为 130,888,951.89 元，以 2010 年 12 月 31 日为收益分配基准日，折合每份基金份额 0.0676 元。本基金以 2010 年 12 月 31 日的可供分配利润为基准，于 2011 年 1 月 14 日向基金份额持有人每 10 份派 0.68 元。本基金 2010 年 3 月 15 日向基金份额持有人每 10 份派 0.60 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积极配置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，南方积极配置证券投资基金的管理人——南方基金管理有限公司在南方积极配置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，南方积极配置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 135,373,363.16 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积极配置证券投资基金 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 20309 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: 南方积极配置证券投资基金

报告截止日: 2010 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	7.4.7.1	214,058,966.35	388,524,610.52
结算备付金		8,895,986.69	3,827,258.55
存出保证金		2,815,804.95	1,348,780.49
交易性金融资产	7.4.7.2	2,208,989,963.39	2,782,417,722.08
其中: 股票投资		2,208,989,963.39	2,556,992,626.38
基金投资		-	-
债券投资		-	225,425,095.70
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	2,356,380.75
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		47,041,897.35	-
应收利息	7.4.7.5	60,014.77	1,891,257.31
应收股利		-	-
应收申购款		405,408.36	64,631.60
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,482,268,041.86	3,180,430,641.30
负债和所有者权益	附注号	本期期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	134,861,702.57

应付赎回款		2,054,621.29	5,342,359.38
应付管理人报酬		3,272,840.12	3,844,044.14
应付托管费		545,473.35	640,674.01
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,065,393.36	2,341,384.43
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	1,706,243.33	1,467,634.38
负债合计		8,644,571.45	148,497,798.91
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	1,935,045,994.13	2,406,913,555.62
未分配利润	7.4.7.10	538,577,476.28	625,019,286.77
所有者权益合计		2,473,623,470.41	3,031,932,842.39
负债和所有者权益总计		2,482,268,041.86	3,180,430,641.30

注：报告截止日 2010 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2783 元，基金份额总额 1,935,045,994.13 份。

7.2 利润表

会计主体：南方积极配置证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 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
一、收入		231,188,228.11	1,325,339,042.69
1. 利息收入		6,579,466.53	14,118,614.89
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,209,099.97	2,001,734.59
债券利息收入		4,049,544.85	12,116,880.30
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		320,821.71	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		331,257,453.68	321,013,127.11
其中：股票投资收益	7.4.7.12	317,310,852.41	292,738,620.93
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	1,905,119.30	1,242,237.77
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	982,455.22	-
股利收益	7.4.7.16	11,059,026.75	27,032,268.41
3. 公允价值变动收益（损失以“-”	7.4.7.17	-107,682,289.32	988,823,648.66

号填列)			
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	7.4.7.18	1,033,597.22	1,383,652.03
减: 二、费用		77,092,613.65	73,094,296.89
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	38,875,580.86	44,097,224.49
2. 托管费	7.4.10.2.2	6,479,263.43	7,349,537.38
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	31,262,915.22	21,154,408.06
5. 利息支出		-	17,315.98
其中: 卖出回购金融资产支出		-	17,315.98
6. 其他费用	7.4.7.20	474,854.14	475,810.98
三、利润总额		154,095,614.46	1,252,244,745.80
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		154,095,614.46	1,252,244,745.80

7.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 南方积极配置证券投资基金

本报告期: 2010年1月1日至2010年12月31日

单位: 人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	2,406,913,555.62	625,019,286.77	3,031,932,842.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	154,095,614.46	154,095,614.46
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)	-471,867,561.49	-105,164,061.79	-577,031,623.28
其中: 1. 基金申购款	199,282,180.29	25,421,249.24	224,703,429.53
2. 基金赎回款	-671,149,741.78	-130,585,311.03	-801,735,052.81
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)	-	-135,373,363.16	-135,373,363.16

五、期末所有者权益（基金净值）	1,935,045,994.13	538,577,476.28	2,473,623,470.41
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）	3,010,044,383.60	-535,570,513.56	2,474,473,870.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,252,244,745.80	1,252,244,745.80
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）	-603,130,827.98	-91,654,945.47	-694,785,773.45
其中：1. 基金申购款	389,637,539.07	10,125,584.31	399,763,123.38
2. 基金赎回款	-992,768,367.05	-101,780,529.78	-1,094,548,896.83
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）	2,406,913,555.62	625,019,286.77	3,031,932,842.39

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>高良玉</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、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

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、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金代销机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
兴业证券股份有限公司(“兴业证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
厦门国际信托有限公司	基金管理人的股东
深圳市投资控股有限公司(i)	基金管理人的股东(2010年9月10日起)
深圳市机场(集团)有限公司(i)	基金管理人的原股东(2010年9月10日前)
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	2,199,676,396.78	10.79	1,585,116,907.72	11.54
华泰联合证券	5,247,023,148.80	25.73	4,514,329,329.50	32.68

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	1,853,047.26	10.89	-	-
华泰联合证券	4,362,014.97	25.64	35,096.66	3.29

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	1,347,341.30	11.69	173,038.02	7.39
华泰联合证券	3,825,855.87	33.18	1,438,485.27	61.45

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12 月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31 日
	当期发生的基金应支付的管理费	38,875,580.86
其中：支付给销售机构的客户维护费	3,942,706.40	4,255,670.27

注：支付基金管理人南方基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年

	12月31日	12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	6,479,263.43	7,349,537.38

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

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

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2010年1月1日至2010年12月31日	2009年1月1日至2009年12月31日
基金合同生效日（2004年10月14日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	97,018,160.00	97,018,160.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	97,018,160.00	97,018,160.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	5.01%	4.03%

7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2010年1月1日至2010年12月31日		2009年1月1日至2009年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	214,058,966.35	2,095,365.93	388,524,610.52	1,926,946.12

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2010年1月1日至2010年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:份)	总金额
华泰证券	601288	农业银行	新股发行	2,787,780	7,471,250.40

上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:份)	总金额
华泰证券	601117	中国化学	新股发行	730,704	3,967,722.72

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
002534	杭锅股份	2010年12月31日	2011年4月11日	网下申购	26.00	26.00	1,000,000	26,000,000.00	26,000,000.00	-
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	29,679	711,702.42	927,171.96	-

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
无										

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。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,208,989,963.39	88.99
	其中：股票	2,208,989,963.39	88.99
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	222,954,953.04	8.98
6	其他各项资产	50,323,125.43	2.03
7	合计	2,482,268,041.86	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	9,016,151.14	0.36
B	采掘业	126,078,747.16	5.10
C	制造业	1,382,359,116.99	55.88
C0	食品、饮料	186,594,539.24	7.54
C1	纺织、服装、皮毛	76,949,194.80	3.11
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	105,549,803.05	4.27

C5	电子	24,350,005.48	0.98
C6	金属、非金属	202,953,074.21	8.20
C7	机械、设备、仪表	612,350,216.12	24.76
C8	医药、生物制品	169,846,104.09	6.87
C99	其他制造业	3,766,180.00	0.15
D	电力、煤气及水的生产和供应业	50,902,358.50	2.06
E	建筑业	34,440,337.35	1.39
F	交通运输、仓储业	19,599,868.08	0.79
G	信息技术业	199,131,104.18	8.05
H	批发和零售贸易	92,367,341.55	3.73
I	金融、保险业	132,425,551.17	5.35
J	房地产业	100,889,977.83	4.08
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	61,779,409.44	2.50
	合计	2,208,989,963.39	89.30

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	002154	报喜鸟	2,419,786	76,949,194.80	3.11
2	601699	潞安环能	1,278,138	76,228,150.32	3.08
3	002073	软控股份	2,742,814	73,205,705.66	2.96
4	000895	双汇发展	838,971	72,990,477.00	2.95
5	600079	人福医药	2,815,606	71,741,640.88	2.90
6	000425	徐工机械	1,231,761	70,456,729.20	2.85
7	600585	海螺水泥	2,272,047	67,434,354.96	2.73
8	600298	安琪酵母	1,493,733	66,142,497.24	2.67
9	600271	航天信息	2,342,637	64,445,943.87	2.61
10	600415	小商品城	1,763,111	61,779,409.44	2.50

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	600141	兴发集团	177,120,518.66	5.84
2	600036	招商银行	151,976,798.59	5.01
3	002154	报喜鸟	141,843,871.93	4.68
4	601318	中国平安	141,818,770.55	4.68
5	601601	中国太保	134,678,656.23	4.44
6	600028	中国石化	134,080,569.11	4.42
7	600298	安琪酵母	130,048,063.23	4.29
8	600000	浦发银行	123,256,587.97	4.07
9	601169	北京银行	121,807,309.48	4.02
10	600395	盘江股份	119,650,177.50	3.95
11	600498	烽火通信	116,512,763.35	3.84
12	600067	冠城大通	113,869,938.22	3.76
13	601699	潞安环能	110,783,891.80	3.65
14	600123	兰花科创	110,525,463.33	3.65
15	600348	国阳新能	99,624,583.76	3.29
16	600079	人福医药	99,195,253.29	3.27
17	601166	兴业银行	96,579,726.55	3.19
18	002007	华兰生物	93,182,247.14	3.07
19	600111	包钢稀土	91,973,970.83	3.03
20	600271	航天信息	91,810,797.62	3.03
21	600415	小商品城	91,102,896.25	3.00
22	600585	海螺水泥	86,331,765.83	2.85
23	000858	五粮液	85,186,602.39	2.81
24	000983	西山煤电	82,873,546.33	2.73
25	600016	民生银行	81,478,722.75	2.69
26	002063	远光软件	80,899,212.47	2.67
27	600858	银座股份	78,472,251.95	2.59
28	000811	烟台冰轮	78,159,397.13	2.58
29	600519	贵州茅台	77,752,032.34	2.56
30	600416	湘电股份	77,546,692.49	2.56
31	000060	中金岭南	75,838,302.67	2.50
32	000425	徐工机械	74,543,916.18	2.46
33	002073	软控股份	74,166,036.78	2.45
34	600267	海正药业	73,745,411.73	2.43

35	000630	铜陵有色	73,074,450.72	2.41
36	002123	荣信股份	72,986,321.78	2.41
37	601088	中国神华	72,860,960.93	2.40
38	600362	江西铜业	69,779,973.45	2.30
39	600993	马应龙	66,782,674.33	2.20
40	000528	柳工	66,285,777.28	2.19
41	600015	华夏银行	65,875,256.27	2.17
42	000826	桑德环境	65,561,569.13	2.16
43	600511	国药股份	64,842,544.75	2.14
44	002266	浙富股份	61,285,787.92	2.02
45	601788	光大证券	60,908,577.23	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	600028	中国石化	184,575,728.01	6.09
2	600036	招商银行	171,327,323.56	5.65
3	601169	北京银行	152,718,447.79	5.04
4	600141	兴发集团	151,324,082.92	4.99
5	600000	浦发银行	138,709,247.43	4.57
6	601318	中国平安	134,448,728.29	4.43
7	601166	兴业银行	132,243,147.69	4.36
8	600519	贵州茅台	125,012,689.38	4.12
9	601601	中国太保	120,599,285.21	3.98
10	002142	宁波银行	117,207,128.63	3.87
11	000983	西山煤电	113,253,244.99	3.74
12	600348	国阳新能	112,610,086.56	3.71
13	002007	华兰生物	109,885,498.87	3.62
14	600395	盘江股份	108,098,662.31	3.57
15	000024	招商地产	106,278,825.45	3.51
16	600089	特变电工	101,245,559.50	3.34
17	000623	吉林敖东	98,651,138.17	3.25
18	600016	民生银行	98,551,787.73	3.25
19	002063	远光软件	98,047,067.23	3.23

20	600067	冠城大通	96,056,884.85	3.17
21	601088	中国神华	94,960,503.69	3.13
22	600123	兰花科创	92,965,507.49	3.07
23	000858	五粮液	91,366,037.85	3.01
24	002154	报喜鸟	87,542,449.51	2.89
25	600111	包钢稀土	86,582,831.80	2.86
26	600858	银座股份	85,083,068.96	2.81
27	600079	人福医药	83,921,636.44	2.77
28	601939	建设银行	82,302,999.45	2.71
29	000528	柳工	81,579,667.26	2.69
30	600406	国电南瑞	77,802,404.02	2.57
31	600690	青岛海尔	77,331,784.11	2.55
32	600416	湘电股份	75,465,207.34	2.49
33	600785	新华百货	75,339,130.23	2.48
34	600298	安琪酵母	74,341,129.49	2.45
35	600498	烽火通信	73,624,957.60	2.43
36	000422	湖北宜化	73,007,114.45	2.41
37	600585	海螺水泥	71,512,041.21	2.36
38	000063	中兴通讯	71,221,482.57	2.35
39	000826	桑德环境	70,886,886.55	2.34
40	601628	中国人寿	69,540,364.75	2.29
41	601111	中国国航	68,204,699.19	2.25
42	000425	徐工机械	68,018,307.49	2.24
43	600266	北京城建	66,551,233.73	2.20
44	000401	冀东水泥	65,918,479.52	2.17
45	600739	辽宁成大	64,768,239.95	2.14
46	600547	山东黄金	64,513,212.45	2.13
47	600015	华夏银行	63,298,628.66	2.09

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	9,941,505,311.89
卖出股票收入（成交）总额	10,501,911,666.2

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

无余额。

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

无余额。

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

无余额

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

无余额

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没有超出基金合同规定的备选股票库。

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	2,815,804.95
2	应收证券清算款	47,041,897.35
3	应收股利	-
4	应收利息	60,014.77
5	应收申购款	405,408.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	50,323,125.43

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

§ 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
112, 267	17, 236. 11	108, 967, 958. 18	5. 63%	1, 826, 078, 035. 95	94. 37%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	南方基金管理有限公司	57, 015, 420. 00	50.25%
2	赵惠云	700, 000. 00	0.62%
3	曹建敏	500, 000. 00	0.44%
4	吴彦冰	483, 198. 00	0.43%
5	冯健全	430, 000. 00	0.38%
6	唐进宇	388, 901. 00	0.34%
7	张琳	350, 000. 00	0.31%
8	陈忠芳	318, 611. 00	0.28%
9	于艳	300, 000. 00	0.26%
10	肖鹰	281, 999. 00	0.25%

注：持有人为场内持有人。

9.3 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	4, 014, 402. 22	0. 21%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2004 年 10 月 14 日 ）基金份额总额	3, 535, 576, 439. 25
本报告期期初基金份额总额	2, 406, 913, 555. 62
本报告期基金总申购份额	199, 282, 180. 29
减：本报告期基金总赎回份额	671, 149, 741. 78

本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,935,045,994.13

§ 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

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。经证监会审批，晏秋生任基金托管人的资产托管部副总经理。

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

本报告期内本基金未更换会计师事务所，本年度应支付给普华永道中天会计师事务所有限公司审计费用94,000.00元，该审计机构已提供审计服务的连续年限为5年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰联合	3	5,247,023,148.80	25.73%	4,374,999.79	25.67%	-
华宝证券	1	2,275,185,963.05	11.16%	1,933,718.60	11.35%	-
华泰证券	2	2,170,046,000.31	10.64%	1,844,535.57	10.82%	-
中信建投	1	2,120,374,916.74	10.40%	1,802,307.47	10.58%	-
国联证券	1	1,588,012,543.55	7.79%	1,290,270.51	7.57%	-
广发证券	3	1,366,746,725.61	6.70%	1,127,558.66	6.62%	-
国泰君安	2	1,090,662,489.66	5.35%	886,172.48	5.20%	-
湘财证券	1	1,043,486,628.84	5.12%	847,840.91	4.98%	-
中信证券	2	1,002,089,387.85	4.91%	844,386.65	4.95%	-
光大证券	1	873,479,565.67	4.28%	742,048.12	4.35%	-
渤海证券	1	667,579,231.21	3.27%	542,412.20	3.18%	-
中金公司	1	428,360,890.90	2.10%	364,105.56	2.14%	-
银河证券	2	395,001,029.85	1.94%	335,747.91	1.97%	-
国都证券	1	77,528,811.61	0.38%	65,898.05	0.39%	-
海通证券	1	18,284,378.98	0.09%	15,541.51	0.09%	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	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。

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

华泰联合	61,150,600.00	29.27%	310,000,000.00	54.39%	-	-
华宝证券	18,377,563.75	8.80%	-	-	-	-
华泰证券	75,922,245.30	36.34%	-	-	-	-
中信建投	2,405,264.30	1.15%	140,000,000.00	24.56%	2,479,750.57	100.00%
国联证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	10,214,833.50	4.89%	-	-	-	-
国泰君安	382,886.03	0.18%	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	40,463,824.00	19.37%	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	120,000,000.00	21.05%	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-

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。