

# 南方策略优化股票型证券投资基金 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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 3 月 24 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 2014 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	南方策略优化股票
基金主代码	202019
前端交易代码	202019
后端交易代码	202020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 3 月 30 日
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	737,168,481.26 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“南方策略”。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化手段优化投资策略，在积极把握证券市场及相关行业发展趋势的前提下精选优势个股进行投资，力争获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金投资策略包含资产配置、行业配置和个股选择等三个层面。基金管理人在综合分析经济周期、财政政策、市场环境等因素的基础上，采用定量和定性相结合的思路确定本基金的资产配置。针对本基金的行业配置策略，基金管理人开发了基于 lack-Litterman 模型的“南方量化行业配置模型”。在行业配置的基础上，进一步使用“南方多因子量化选股模型”，依据基本面、价值面、市场面和流动性等因素对股票进行综合评分，精选各行业具有超额收益能力或潜力的优势个股，构建本基金的股票组合。
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	本基金为股票型基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	张燕
	联系电话	0755-82763888	0755-83199084
	电子邮箱	manager@southernfund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-889-8899	95555

传真	0755-82763889	0755-83195201
----	---------------	---------------

## 2.4 信息披露方式

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

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2014 年	2013 年	2012 年
本期已实现收益	94,043,056.98	-7,981,417.25	-234,935,629.73
本期利润	217,210,652.65	-18,097,981.93	-16,662,749.78
加权平均基金份额本期利润	0.3079	-0.0210	-0.0161
本期基金份额净值增长率	48.40%	-3.69%	-1.96%
3.1.2 期末数据和指标	2014 年末	2013 年末	2012 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1783	-0.3736	-0.3496
期末基金资产净值	684,795,417.97	484,866,015.76	608,827,117.13
期末基金份额净值	0.929	0.626	0.650

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

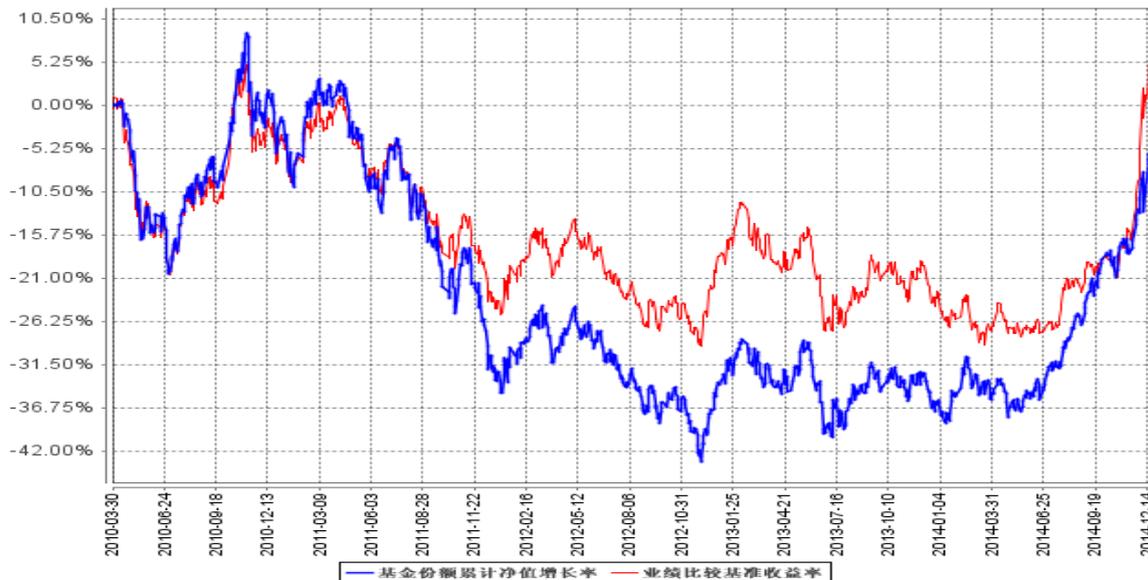
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	16.71%	1.38%	34.58%	1.32%	-17.87%	0.06%
过去六个月	41.19%	1.10%	49.01%	1.06%	-7.82%	0.04%
过去一年	48.40%	1.09%	41.16%	0.97%	7.24%	0.12%
过去三年	40.12%	1.21%	43.09%	1.04%	-2.97%	0.17%

自基金合同生效起至今	-5.25%	1.26%	9.18%	1.09%	-14.43%	0.17%
------------	--------	-------	-------	-------	---------	-------

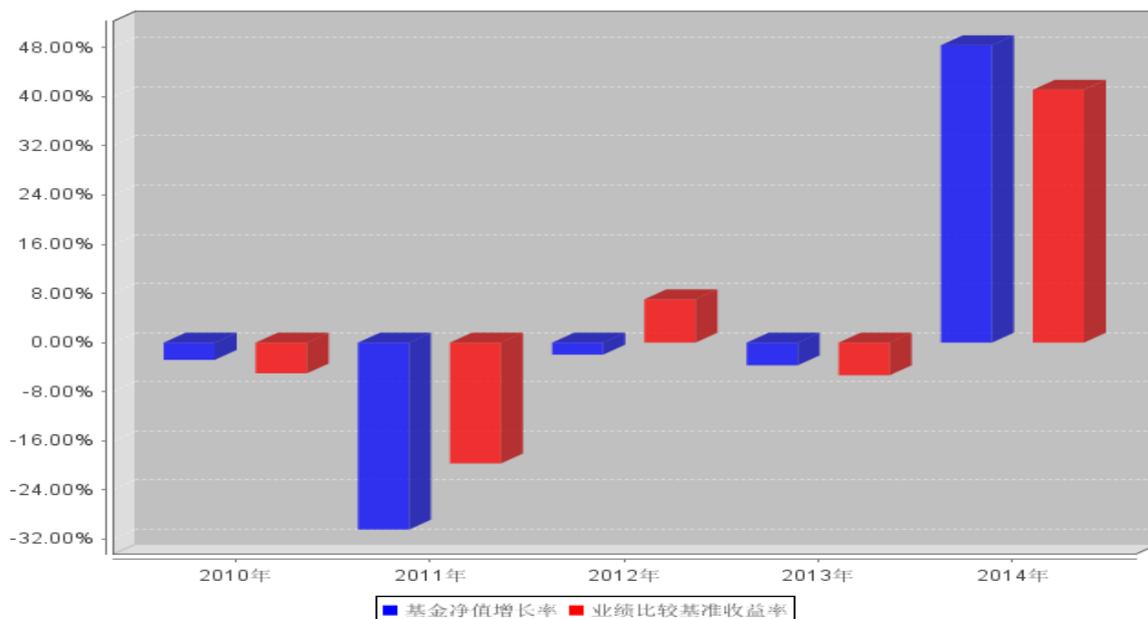
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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 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

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：本基金的基金合同生效日为 2010 年 3 月 30 日，基金合同生效当年按实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：无。

## §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		
杨德龙	本基金基金经理	2013 年 3 月 15 日	-	8 年	北京大学经济学硕士、清华大学工学学士，具有基金从业资格。2006 年加入南方基金，担任研究部高级行业研究员、首席策略分析师；2010 年 8 月至 2013 年 4 月，任小康 ETF 及南方小康基金经理；2011 年 9 月至今，任南方上证 380ETF 及联接基金基金经理；2013 年 3 月至今，任南方策略基金经理；2013 年 4 月至今，任南方 300 基金经理；2013 年 4 月至今，任南方开元沪深 300ETF 基金经理；2014 年 12 月至今，任南方恒生 ETF 基金经理。
罗文杰	本基金基金经理	2013 年 5 月 17 日	-	9 年	女，美国南加州大学数学金融硕士、美国加州大学计算机科学硕士，具有中国基金从业资格。曾先后任职于美国 Open Link Financial 公司、摩根斯坦利公司，从事量化分析工作。2008 年 9 月加入南方基金，

					任南方基金数量化投资部基金经理助理；2013 年 4 月至今，任南方 500 基金经理；2013 年 4 月至今，任南方 500ETF 基金经理；2013 年 5 月至今，任南方 300 基金经理；2013 年 5 月至今，任南方开元沪深 300ETF 基金经理；2013 年 5 月至今，任南方策略基金经理；2014 年 10 月至今，任 500 医药基金经理。
--	--	--	--	--	--

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《南方策略优化股票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

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，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

本基金2014年度主要采用量化方法选取具有超额收益的价值股和成长股进行投资，取得了较好的收益，全年净值增长率达到48.40%，同期沪深300指数上涨51.66%，中证500指数上涨39.01%，创业板指数上涨12.83%。全年市场呈现出较频繁的风格轮动，我们以同类基金平均配置水平为标准，基本上避免了风格大幅错配带来的风险。特别是4季度在沪港通、降息等事件带来的金融股和价值股的暴涨行情中，我们及时地加大了相关板块的配置，使得基金的业绩在全年都保持了稳健的特征。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2014年，本基金净值增长48.40%，同期业绩比较基准增长41.16%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014年中国经济运行基本平稳，美国经济复苏较为强劲，但日本、欧盟等主要经济体仍在通缩的阴影中，普遍采取极度宽松的货币政策来刺激经济。中国2014年全年GDP增长率7.4%，创下了1990年以来的新低，政府在稳增长和调结构的矛盾中艰难的寻求平衡。在近期一系列较差的经济数据公布后，可以预见的是，2015年中国的货币政策将以宽松为主，市场普遍预期全年将多次降准和降息，这对提升股票市场的估值水平和吸引力都是有好处的。

## 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：本基金收益分配应遵循下列原则：每一基金份额享有同等分配权；若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即：基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值，基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年最多 12 次，每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日可供分配利润的 10%；. 基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。基金份额持有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；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。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，本报告期末有收益分配事项。

#### 4.8 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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基

金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

## 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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、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，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## §6 审计报告

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 20360 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：南方策略优化股票型证券投资基金

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
<b>资产：</b>		
银行存款	38,610,128.53	15,856,902.24
结算备付金	4,709,671.57	833,333.33
存出保证金	98,813.41	19,098.36
交易性金融资产	628,184,912.38	455,201,625.82
其中：股票投资	627,532,699.28	435,068,853.42
基金投资	-	-
债券投资	652,213.10	20,132,772.40

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	13,000,000.00	-
应收证券清算款	10,103,216.81	14,707,218.79
应收利息	11,358.99	174,841.76
应收股利	-	-
应收申购款	465,006.91	211,536.55
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	695,183,108.60	487,004,556.85
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2014年12月31日</b>	<b>2013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	4,024,735.75	-
应付赎回款	3,272,587.42	543,390.91
应付管理人报酬	895,566.73	637,062.72
应付托管费	149,261.12	106,177.12
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,768,557.65	694,708.12
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	276,981.96	157,202.22
负债合计	10,387,690.63	2,138,541.09
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	737,168,481.26	774,110,911.69
未分配利润	-52,373,063.29	-289,244,895.93
所有者权益合计	684,795,417.97	484,866,015.76
负债和所有者权益总计	695,183,108.60	487,004,556.85

注：报告截止日 2014 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.929 元，基金份额总额 737,168,481.26 份。

## 7.2 利润表

会计主体：南方策略优化股票型证券投资基金

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 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	229,807,933.63	-5,783,850.21
1. 利息收入	2,044,543.17	2,072,346.23
其中：存款利息收入	182,894.12	115,053.67
债券利息收入	740,861.14	962,749.50
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,120,787.91	994,543.06
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	104,381,943.10	2,188,719.67
其中：股票投资收益	100,934,283.32	-7,026,384.48
基金投资收益	-	-
债券投资收益	140,368.56	17,580.00
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	3,307,291.22	9,197,524.15
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	123,167,595.67	-10,116,564.68
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	213,851.69	71,648.57
<b>减：二、费用</b>	12,597,280.98	12,314,131.72
1. 管理人报酬	7,500,520.64	8,454,649.38
2. 托管费	1,250,086.78	1,409,108.19
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	3,464,940.94	2,075,091.54
5. 利息支出	-	2,401.60
其中：卖出回购金融资产支出	-	2,401.60
6. 其他费用	381,732.62	372,881.01
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	217,210,652.65	-18,097,981.93
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	217,210,652.65	-18,097,981.93

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方策略优化股票型证券投资基金

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）	774,110,911.69	-289,244,895.93	484,866,015.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	217,210,652.65	217,210,652.65
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）	-36,942,430.43	19,661,179.99	-17,281,250.44
其中：1. 基金申购款	386,807,273.09	-73,741,853.10	313,065,419.99
2. 基金赎回款	-423,749,703.52	93,403,033.09	-330,346,670.43
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）	737,168,481.26	-52,373,063.29	684,795,417.97
项目	上年度可比期间 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）	936,072,025.64	-327,244,908.51	608,827,117.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-18,097,981.93	-18,097,981.93
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）	-161,961,113.95	56,097,994.51	-105,863,119.44
其中：1. 基金申购款	33,136,366.61	-11,335,786.40	21,800,580.21
2. 基金赎回款	-195,097,480.56	67,433,780.91	-127,663,699.65
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）	774,110,911.69	-289,244,895.93	484,866,015.76
-----------------	----------------	-----------------	----------------

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：

_____ 杨小松	_____ 徐超	_____ 徐超
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

#### 7.4.1.1 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。

#### 7.4.1.2 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。

#### 7.4.1.3 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。

## 7.4.2 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，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。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。

### 7.4.3 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
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	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。

### 7.4.4 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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 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	875,655,257.15	38.43%	676,416,289.64	50.57%

##### 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 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	774,881.24	38.02%	770,762.87	43.58%
关联方名称	上年度可比期间 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	598,562.96	49.86%	342,207.27	49.27%

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 2014年1月1日至2014年 12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月 31日
	当期发生的基金应支付的管理费	7,500,520.64
其中：支付销售机构的客户维护费	2,237,493.55	2,524,637.03

注：支付基金管理人南方基金管理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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}。$$

##### 7.4.4.2.2 基金托管费

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1月1日至2013年12月 31日
	当期发生的基金应支付的托管费	1,250,086.78

注：支付基金托管人招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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

**7.4.4.2.3 销售服务费**

注：无。

**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**

注：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自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
	2014年1月1日至2014年12月31日	2013年1月1日至2013年12月31日
基金合同生效日（2010年3月30日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	50,003,000.06	50,003,000.06
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	50,003,000.06	-
期末持有的基金份额	-	50,003,000.06
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	6.4600%

**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		上年度可比期间	
	2014年1月1日至2014年12月31日		2013年1月1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
招商银行	38,610,128.53	110,054.78	15,856,902.24	91,323.10

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，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
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	002089	新海宜	配股	124,819	450,596.59
上年度可比期间 2013 年 1 月 1 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
-	-	-	-	-	-

#### 7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

注：无。

#### 7.4.5 期末（2014 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

注：无。

##### 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
300252	金信诺	2014 年 11 月 11 日	重大事项	43.40	2015 年 1 月 28 日	46.99	68,300	1,955,155.10	2,964,220.00	-
000035	中国天楹	2014 年 12 月 24 日	重大资产重组	12.64	2015 年 2 月 11 日	13.50	205,583	2,549,841.56	2,598,569.12	-
600105	永鼎股份	2014 年 10 月 13 日	重大事项	9.86	2015 年 1 月 16 日	10.67	251,800	2,127,249.89	2,482,748.00	-
002323	中联电气	2014 年 10 月 22 日	重大资产重组	21.95	2015 年 1 月 21 日	24.15	100,400	1,758,366.12	2,203,780.00	-
000070	特发信息	2014 年 9 月 15 日	重大资产重组	11.01	-	-	199,600	2,100,932.64	2,197,596.00	-
000514	渝开发	2014 年 11 月 27 日	重大资产重组	7.08	-	-	276,209	1,413,463.89	1,955,559.72	-
300315	掌趣	2014 年	重大事项	19.58	2015 年	17.41	98,400	1,854,030.85	1,926,672.00	-

	科技	7月14日			2月16日						
002675	东诚药业	2014年10月10日	重大事项	24.18	-	-	77,600	1,586,552.07	1,876,368.00	-	
600664	哈药股份	2014年12月31日	重大事项	8.68	2015年2月17日	9.45	135,531	987,409.33	1,176,409.08	-	
002663	普邦园林	2014年12月9日	重大事项	14.40	2015年3月17日	15.84	81,600	1,101,082.00	1,175,040.00	-	
600649	城投控股	2014年11月3日	重大资产重组	7.23	-	-	153,400	1,029,368.84	1,109,082.00	-	
002558	世纪游轮	2014年10月27日	重大资产重组	31.65	-	-	31,002	835,907.07	981,213.30	-	
002464	金利科技	2014年12月8日	重大资产重组	17.56	2015年1月19日	15.80	51,700	900,552.80	907,852.00	-	
002324	普利特	2014年10月8日	重大资产重组	19.90	2015年1月14日	21.89	44,200	738,817.97	879,580.00	-	
002507	涪陵榨菜	2014年12月22日	重大事项	28.80	2015年3月23日	31.68	29,703	775,526.45	855,446.40	-	
300144	宋城演艺	2014年12月19日	重大资产重组	30.12	2015年3月18日	33.13	27,139	687,973.41	817,426.68	-	
600090	啤酒花	2014年9月9日	重大资产重组	8.13	-	-	100,400	739,320.00	816,252.00	-	
300160	秀强股份	2014年10月13日	重大资产重组	16.35	2015年1月5日	14.72	42,600	449,734.76	696,510.00	-	
300196	长海股份	2014年12月18日	重大资产重组	23.51	2015年2月16日	21.33	27,502	494,654.31	646,572.02	-	
002050	三花股份	2014年10月27日	重大事项	13.57	2015年1月27日	14.93	46,101	576,352.28	625,590.57	-	
300186	大华农	2014年12月29日	重大事项	7.87	-	-	66,700	557,481.97	524,929.00	-	
002308	威创股份	2014年12月29日	重大事项	8.25	2015年2月4日	9.08	60,800	477,894.75	501,600.00	-	
600318	巢东股份	2014年9月29日	重大资产重组	11.20	2015年2月6日	12.32	36,400	375,475.00	407,680.00	-	

600487	亨通光电	2014年 10月 30日	重大事项	18.95	2015年 1月19日	20.60	20,000	286,846.00	379,000.00	-
601299	中国北车	2014年 10月 27日	重大资产重组	7.34	2014年 12月 31日	7.10	46,000	233,456.95	337,640.00	1
300244	迪安诊断	2014年 10月 13日	重大事项	43.93	2015年 1月9日	44.00	7,683	337,645.66	337,514.19	-
600761	安徽合力	2014年 12月 26日	重大事项	15.65	2015年 1月6日	16.60	20,100	222,001.59	314,565.00	-
601766	中国南车	2014年 10月 27日	重大资产重组	6.62	2014年 12月 31日	6.38	46,487	201,124.51	307,743.94	1
002482	广田股份	2014年 12月 10日	重大事项	15.13	2015年 1月6日	16.64	19,200	278,153.57	290,496.00	-
000501	鄂武商A	2014年 12月 24日	重大事项	15.82	2015年 1月16日	17.20	14,481	180,148.39	229,089.42	-
300216	千山药机	2014年 12月2日	重大资产重组	37.00	2015年 2月3日	40.70	5,500	205,220.97	203,500.00	-
000925	众合机电	2014年 12月 31日	重大事项	21.40	2015年 1月12日	21.65	9,124	116,075.98	195,253.60	-
600580	卧龙电气	2014年 12月8日	重大事项	10.48	2015年 1月14日	11.12	18,500	155,367.61	193,880.00	-
000968	煤气化	2014年 12月 30日	重大资产重组	9.07	-	-	20,100	145,427.00	182,307.00	-
002009	天奇股份	2014年 10月 20日	重大资产重组	16.30	2015年 1月28日	17.93	8,500	126,689.20	138,550.00	-
000413	东旭光电	2014年 11月 25日	重大事项	7.67	2015年 1月28日	8.44	15,700	104,073.00	120,419.00	-
600754	锦江股份	2014年 11月 10日	重大资产重组	25.11	2015年 1月19日	27.00	3,900	66,787.44	97,929.00	-
601216	内蒙君正	2014年 12月1日	重大资产重组	10.44	2015年 1月7日	11.10	9,220	62,865.00	96,256.80	-
002170	芭田股份	2014年 12月	重大事项	9.00	2015年 1月5日	9.38	10,300	54,812.00	92,700.00	-

		25 日								
002018	华信国际	2014 年 11 月 19 日	重大资产重组	13.99	2015 年 3 月 6 日	15.39	6,400	53,025.55	89,536.00	-
600844	丹化科技	2014 年 12 月 15 日	重大事项	7.60	2015 年 1 月 7 日	8.25	10,600	64,949.23	80,560.00	-
600623	双钱股份	2014 年 12 月 1 日	重大资产重组	14.52	2015 年 3 月 24 日	15.97	5,300	62,417.00	76,956.00	-
002386	天原集团	2014 年 12 月 19 日	重大事项	9.38	2015 年 1 月 7 日	10.00	8,000	60,773.00	75,040.00	-
002168	深圳惠程	2014 年 11 月 28 日	重大资产重组	10.13	2015 年 1 月 28 日	9.51	7,300	53,323.50	73,949.00	-
002184	海得控制	2014 年 11 月 27 日	重大事项	21.82	2015 年 1 月 26 日	20.00	2,000	31,073.51	43,640.00	-
300011	鼎汉技术	2014 年 11 月 24 日	重大资产重组	17.25	2015 年 2 月 3 日	18.98	1,900	30,630.46	32,775.00	-
300269	联建光电	2014 年 12 月 30 日	重大事项	36.13	2015 年 1 月 7 日	35.00	55	1,915.23	1,987.15	-
300192	科斯伍德	2014 年 11 月 17 日	重大资产重组	9.23	-	-	120	1,061.45	1,107.60	-
600716	凤凰股份	2014 年 12 月 12 日	重大事项	9.58	2015 年 1 月 12 日	8.79	25	220.06	239.50	-
300237	美晨科技	2014 年 12 月 8 日	重大事项	30.00	2015 年 1 月 13 日	29.68	2	50.23	60.00	-
000719	大地传媒	2014 年 12 月 26 日	重大资产重组	16.55	-	-	1	16.14	16.55	-

注：1、本基金截至 2014 年 12 月 31 日持有的中国北车、中国南车已于本期末复牌，但交易仍不活跃、流通仍受限，因此仍作为流通受限股票。

2、本基金截至 2014 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

注：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	627,532,699.28	90.27
	其中：股票	627,532,699.28	90.27
2	固定收益投资	652,213.10	0.09
	其中：债券	652,213.10	0.09
	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	13,000,000.00	1.87
	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	43,319,800.10	6.23
7	其他各项资产	10,678,396.12	1.54
8	合计	695,183,108.60	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,164,371.60	0.17
B	采矿业	6,431,723.65	0.94
C	制造业	253,190,789.35	36.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,461,292.18	1.53
E	建筑业	56,455,400.66	8.24
F	批发和零售业	9,973,108.43	1.46
G	交通运输、仓储和邮政业	1,288,932.60	0.19
H	住宿和餐饮业	97,929.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	20,677,001.33	3.02
J	金融业	205,755,290.91	30.05

K	房地产业	46,578,703.30	6.80
L	租赁和商务服务业	1,392,700.62	0.20
M	科学研究和技术服务业	1,025,585.00	0.15
N	水利、环境和公共设施管理业	6,142,012.66	0.90
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	482,666.39	0.07
R	文化、体育和娱乐业	5,865,151.60	0.86
S	综合	550,040.00	0.08
	合计	627,532,699.28	91.64

### 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	601818	光大银行	3,178,610	15,511,616.80	2.27
2	601318	中国平安	206,081	15,396,311.51	2.25
3	601390	中国中铁	1,606,844	14,943,649.20	2.18
4	000776	广发证券	546,700	14,186,865.00	2.07
5	600000	浦发银行	902,372	14,158,216.68	2.07
6	600999	招商证券	486,730	13,759,857.10	2.01
7	000686	东北证券	677,518	13,536,809.64	1.98
8	600016	民生银行	1,239,592	13,486,760.96	1.97
9	600015	华夏银行	999,643	13,455,194.78	1.96
10	601166	兴业银行	814,462	13,438,623.00	1.96

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	002673	西部证券	18,916,308.51	3.90
2	000776	广发证券	16,432,609.78	3.39

3	601818	光大银行	15,047,739.20	3.10
4	000686	东北证券	14,707,629.68	3.03
5	601318	中国平安	14,409,226.29	2.97
6	600999	招商证券	13,202,102.75	2.72
7	601988	中国银行	12,440,368.00	2.57
8	600015	华夏银行	12,247,859.63	2.53
9	600000	浦发银行	11,472,217.67	2.37
10	600016	民生银行	11,163,202.80	2.30
11	601336	新华保险	11,102,992.22	2.29
12	601390	中国中铁	10,940,353.78	2.26
13	601166	兴业银行	10,472,119.69	2.16
14	601668	中国建筑	9,306,877.67	1.92
15	601628	中国人寿	8,377,693.32	1.73
16	601800	中国交建	8,355,574.59	1.72
17	600837	海通证券	8,188,606.80	1.69
18	600030	中信证券	7,727,821.56	1.59
19	601328	交通银行	7,366,803.00	1.52
20	002177	御银股份	6,575,014.70	1.36

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	002673	西部证券	15,401,311.30	3.18
2	600000	浦发银行	11,563,149.07	2.38
3	601998	中信银行	11,393,126.15	2.35
4	601166	兴业银行	10,995,511.50	2.27
5	601318	中国平安	10,129,222.46	2.09
6	002462	嘉事堂	9,802,230.49	2.02
7	600015	华夏银行	7,830,275.48	1.61
8	600016	民生银行	7,709,538.61	1.59
9	000413	东旭光电	7,687,793.35	1.59
10	601988	中国银行	7,630,462.98	1.57
11	300173	松德股份	7,497,701.48	1.55
12	002194	武汉凡谷	6,836,308.19	1.41

13	000776	广发证券	6,673,603.40	1.38
14	300202	聚龙股份	6,402,981.03	1.32
15	000686	东北证券	6,196,791.32	1.28
16	300351	永贵电器	6,029,017.16	1.24
17	002548	金新农	5,848,789.91	1.21
18	000519	江南红箭	5,832,819.68	1.20
19	600967	北方创业	5,818,249.61	1.20
20	002089	新海宜	5,812,077.99	1.20

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	1,123,900,222.42
卖出股票收入（成交）总额	1,155,376,234.85

注：买入股票成本、卖出股票成本均按照买卖成交金额（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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	652,213.10	0.10
8	其他	-	-
9	合计	652,213.10	0.10

### 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	110011	歌华转债	2,630	348,922.10	0.05
2	113501	洛钼转债	2,390	303,291.00	0.04

**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股指期货交易情况说明**

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

**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

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。

**8.12.3 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	98,813.41
2	应收证券清算款	10,103,216.81
3	应收股利	-
4	应收利息	11,358.99
5	应收申购款	465,006.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,678,396.12

**8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110011	歌华转债	348,922.10	0.05

**8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

**§9 基金份额持有人信息****9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
17,071	43,182.50	143,838,361.08	19.51%	593,330,120.18	80.49%

**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	629,469.33	0.0854%

**9.3 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：本公司的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理均未持有本基金份额。

**§10 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（2010年3月30日）基金份额总额	2,173,254,149.88
---------------------------	------------------

本报告期期初基金份额总额	774,110,911.69
本报告期基金总申购份额	386,807,273.09
减:本报告期基金总赎回份额	423,749,703.52
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	737,168,481.26

## §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

2014年11月14日,本基金托管人发布《关于招商银行股份有限公司姜然基金托管人高级管理人员任职资格及吴晓辉离任的公告》,吴晓辉同志不再担任招商银行股份有限公司总行资产托管部总经理职务;聘任姜然同志为招商银行股份有限公司总行资产托管部总经理。

本报告期内,本基金的基金管理人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

本报告期内本基金未更换会计师事务所。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55,000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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
华泰证券	2	875,655,257.15	38.43%	774,881.24	38.02%	-
广发证券	1	563,363,779.02	24.72%	498,526.09	24.46%	-
国信证券	1	472,600,906.57	20.74%	430,241.55	21.11%	-
银河证券	1	345,561,081.39	15.16%	314,599.97	15.44%	-
中投证券	1	21,568,648.49	0.95%	19,635.97	0.96%	-
华创证券	1	-	-	-	-	-

注：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专用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席位：

- (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
华泰证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	2,320.00	9.68%	3,049,500,000.00	43.24%	-	-
银河证券	-	-	2,914,200,000.00	41.32%	-	-

中投证券	21,636.30	90.32%	1,088,800,000.00	15.44%	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-