

南方天元新产业股票型证券投资基金 2016 年年度报告摘要

2016 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：2017 年 3 月 30 日

§1 重要提示

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 27 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 2016 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	南方天元新产业股票型证券投资基金
基金简称	南方天元新产业股票
场内简称	南方天元
基金主代码	160133
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2014 年 7 月 3 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	291,027,976.85 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	2014 年 8 月 25 日

注：1. 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“南方天元”。

2. 本基金转型日期为 2014 年 7 月 3 日，该日起原天元证券投资基金正式变更为南方天元新产业股票型证券投资基金。

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，采用自上而下和自下而上结合选股的模式，在我国经济转型的背景下，寻找传统行业中的新型企业和新兴产业中的优势企业，兼顾上市公司的安全边际，争取基金资产的长期、稳定增值。
投资策略	本基金管理人将综合运用定量分析和定性分析手段，对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估，并据此制定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例、调整原则和调整范围，定期或不定期地进行调整，以达到规避风险及提高收益的目的。

业绩比较基准	80%×沪深 300 指数收益率+20%×上证国债指数收益率
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，其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型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	郭明
	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

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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	2016 年	2015 年	2014 年 7 月 3 日 (基金合同生效日)- 2014 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-27,256,064.47	554,573,567.28	154,682,155.56
本期利润	-76,479,992.75	430,076,847.53	337,821,073.62
加权平均基金份额本期利润	-0.2338	0.8591	0.1960
本期加权平均净值利润率	-13.82%	51.08%	19.39%
本期基金份额净值增长率	-11.63%	54.55%	29.55%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	190,768,880.22	305,086,802.69	49,741,188.35
期末可供分配基金份额利润	0.6555	0.8835	0.0656
期末基金资产净值	501,882,764.82	674,243,716.18	957,368,738.70
期末基金份额净值	1.725	1.952	1.263

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. 本基金已于 2014 年 7 月 31 日对原天元证券投资基金退市时基金份额进行了折算,基金折算比例为 1:0.935496017。

5. 本基金转型日期为 2014 年 7 月 3 日,截止报告期末,本基金转型后基金合同生效已满一年。

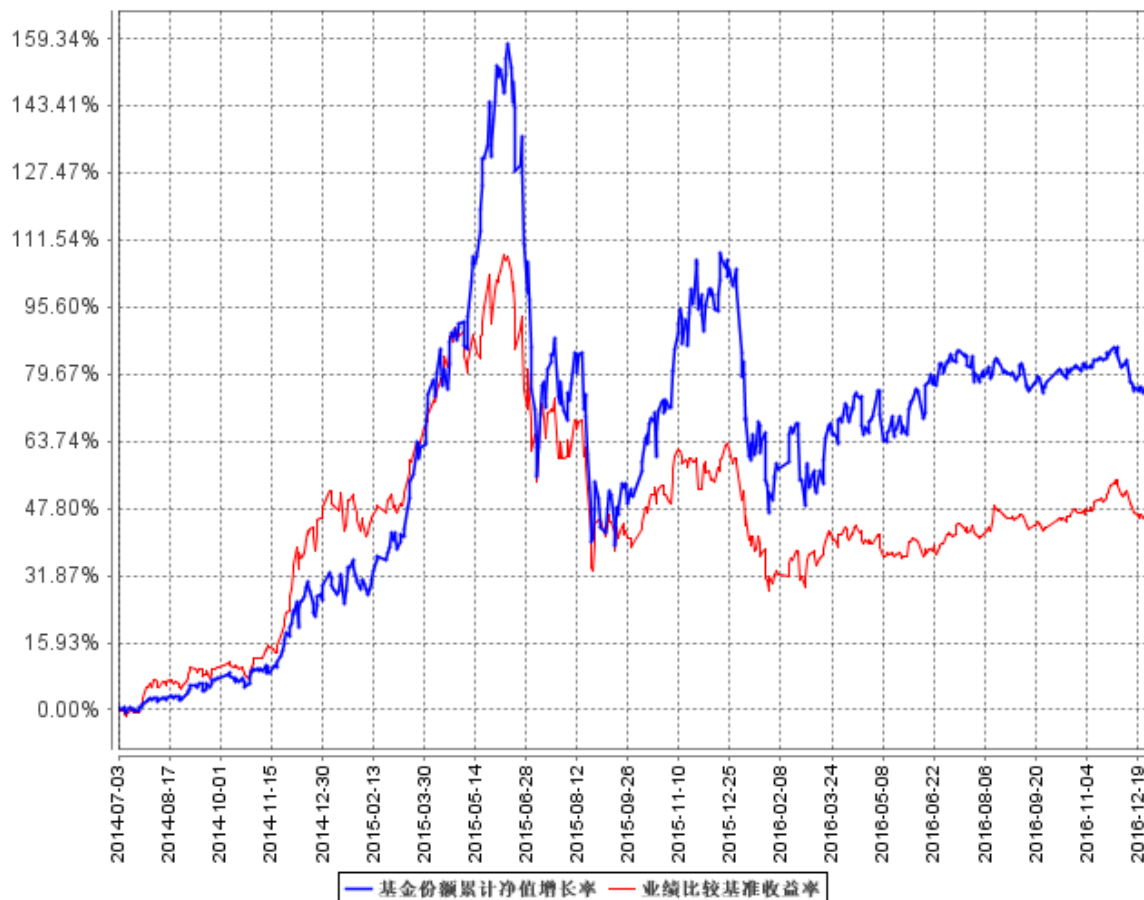
3.2 基金净值表现

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	-0.46%	0.63%	1.43%	0.57%	-1.89%	0.06%
过去六个月	-2.21%	0.73%	4.28%	0.61%	-6.49%	0.12%
过去一年	-11.63%	1.72%	-8.16%	1.12%	-3.47%	0.60%
自基金合同生效起至今	76.93%	2.02%	45.59%	1.52%	31.34%	0.50%

3.2.2 自基金转型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



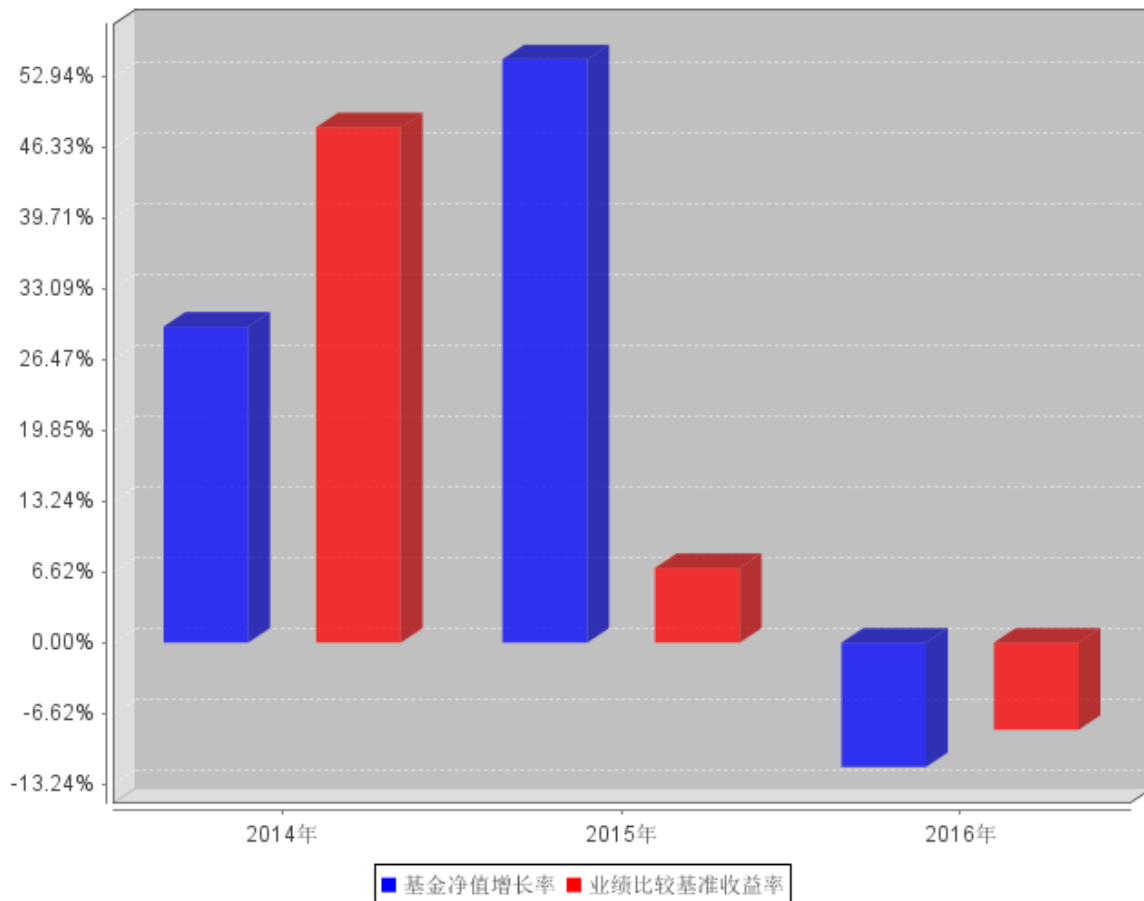
注:1、本基金转型日期为 2014 年 7 月 3 日,截止报告期末,本基金转型后基金合同生效已满一

年。

2、本基金建仓期为自基金合同生效之日起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.3 自基金转型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



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 6,500 亿元，旗下管理 116 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		
蒋秋洁	本基金 基金经 理	2015 年 6 月 16 日	-	8 年	女，清华大学光电工程硕士，具有基金从业资格。2008 年 7 月加入南方基金，历任产品开发部研发员、研究部研究员、高级研究员，负责通信及传媒行业研究；2014 年 3 月至 2014 年 12 月，任南方隆元基金经理助理；2014 年 6 月至 2014 年 12 月，任南方中国梦基金经理助理；2014 年 12 月至今，任南方消费基金经理；2015 年 6 月至今，任南方天元基金基金经理；2015 年 7 月至今，任南方隆元、南方消费活力的基金基金经理。
曹帆	本基金 基金经	2015 年	2016 年	8 年	中国人民大学经济学专业硕士，具有基金从业资格，2008 年 7 月加入南方基金，任研究部研究员、高级研究员，负责农

	理助理	2 月 26 日	7 月 11 日		林牧渔、食品饮料的行业研究；2015 年 2 月至今，任南方天元基金经理助理。
--	-----	----------------	----------------	--	---

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《南方天元新产业股票型证券投资基金合同》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。

公司每季度对旗下各组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析，对本报告期内，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、卖出溢价率、交易占比等因素进

行了综合分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

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 1 次，是由于指数型基金根据标的指数成份股结构被动调仓所致，相关投资组合经理已提供决策依据并留存记录备查。

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

2016 年，在稳增长政策的支持下，经济表现平稳，各项经济指标逐渐趋稳回升。虽然国庆地产政策实施后，30 城地产销售数据不断恶化，但在补库存和产能持续去化的过程中，工业企业盈利仍然在缓慢回升中。在流动性趋紧的环境下，国内经济企稳的持续度有待观察，仍需要春节后各项数据的验证。国际方面，特朗普上台带来了国际形势的不确定性，美国本土刺激计划和美国贸易政策改变都将深刻影响新兴市场国家的经济发展速度。

2016 年，上证综指下跌 12.3%，跑赢创业板指 15.4 个百分点，结构性行情明显。本基金在开年熔断的行情中，在契约允许范围内增加低贝塔个股的配置，并在市场回暖的过程中重点把握了新能源行业快速发展带来的投资机会；在稳增长的政策基调下，增加基建和地产产业链相关配置；同时在低利率环境下，把握高分红个股为代表的价值蓝筹的获利机会。

本基金密切关注市场环境的变化，秉承一贯风格，寻找景气度不断向上的行业进行配置，以求给投资者带来长期稳定的收益。本基金在第四季度保持中性仓位，将持仓结构向估值和行业地位具有优势的大盘蓝筹倾斜，同时精选估值合理的高成长个股进行布局。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2016 年，本基金净值增长率为-11.63%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年人民币汇率将转为乐观；同时，各项改革的加速推进，这都有助于提升风险偏好。综合看，基本面小幅改善有利于权益资产的表现。过去几年，中国产业结构经历了新兴产业推陈出新和传统产业转型出清的两大趋势。一方面，新技术、新模式在被快速创造、引入、迭代，另一方面传统行业在市场需求结构变化的过程中自我修复供需结构。在资本市场上，市场同样经历了新兴成长发展和传统经济复苏两波明显的结构性机会。从基本面上来讲，这两大产业结构趋势并没有完结。在新兴产业仍然快速、蓬勃发展的同时；传统产业经过多年调整，冗余产能逐步

出清，供需回到平衡点附近，龙头企业优势更加明显。站在这个时点，从股票投资来讲，大量传统产业企业净利率和 ROE 处在历史周期的底部，当需求小幅越过平衡点超过供给时，加上过去几年龙头公司不断扩大市场份额，使得这类公司具有业绩和估值的双重弹性，及股价的明显超额收益。本基金将重点配置这类传统行业龙头。另一方面，经过多年的发展，中国在通信、铁路、电器、汽车等方面已经成长出具有国际或区域竞争力的优势企业；同时在全球制造业链条中，大量中国制造业企业通过技术升级和管理优化，能够不断提升产业地位和定价权。这些具有比较优势的行业和企业，具有长期的成长能力和发展空间，能够穿越周期带来长期的超额回报。与此同时，我们关注到，现阶段市场对于成长股的成长性和估值的要求已经达到比较苛刻的状态，部分优质成长股估值已经基本修复到位，随着时间进一步消化估值，一旦市场风险偏好有所改善，优质成长股将重新开启很好的投资机会。

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，本基金管理人根据法律法规、监管要求的变化和业务发展情况，围绕重合规守底线、抓规范促发展，坚持从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，积极推动主动合规风控管理，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，本基金管理人结合新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展情况，不断推动完善相关制度流程的建立、健全，及时贯彻落实新的监管要求，并开展了互联网金融相关业务风险自查、信息技术专项自查等多项内控自查工作，进一步完善了公司的内控体系；对公司投研交易、市场销售、后台运营及人员管理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，推动公司合规、内控体系的健全完善；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，持续完善投资合规风控制度流程和系统，积极配合各类新产品、新业务，重点加强内幕交易防控以及对高风险品种和业务的投资合规风险评估及相关控制措施的研究与落实，有效确保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，积极组织了多项法律法规、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，督促落实销售适当性管理制度；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；深入贯彻风险为本的反洗钱工作原则，优化反洗钱资源配置，加大反洗钱投入力度，购置外部专业机构制裁名单数据库，积极推进符合基金业务特征的可疑交易监控模型和方法，健全创新业务洗钱风险评估机制，各项反洗钱工作进一步完善；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，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、风险管理部总监及运作保障部总监等等。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，每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 10%，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，登记在登记系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，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。登记在证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；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；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，本报告期本基金未有收益分配事项。

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

本报告期内，本基金托管人在对南方天元新产业股票型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

本报告期内，南方天元新产业股票型投资基金的管理人——南方基金管理有限公司在南方天元新产业股票型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，南方天元新产业股票型投资基金未进行利润分配。

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天元新产业股票型投资基金 2016 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 2016 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(2017)第 21479 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：南方天元新产业股票型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	45,057,601.42	97,690,231.82
结算备付金	1,164,643.44	4,112,166.79
存出保证金	208,401.84	810,197.86
交易性金融资产	403,387,723.66	574,121,304.96
其中：股票投资	403,387,723.66	574,121,304.96
基金投资	-	-
债券投资	-	-
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	50,000,000.00	-
应收证券清算款	4,592,960.95	1,986,722.82
应收利息	48,918.14	19,941.97
应收股利	-	-
应收申购款	6,725.66	55,844.97

递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	504,466,975.11	678,796,411.19
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2016年12月31日	2015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	-	-
应付赎回款	177,362.76	595,347.46
应付管理人报酬	646,913.18	904,798.86
应付托管费	107,818.84	150,799.81
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	646,451.26	1,969,249.56
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,005,664.25	932,499.32
负债合计	2,584,210.29	4,552,695.01
所有者权益:		
实收基金	311,113,884.60	369,156,913.49
未分配利润	190,768,880.22	305,086,802.69
所有者权益合计	501,882,764.82	674,243,716.18
负债和所有者权益总计	504,466,975.11	678,796,411.19

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.725 元，基金份额总额 291,027,976.85 份。

7.2 利润表

会计主体：南方天元新产业股票型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入	-60,940,389.94	459,199,040.60
1. 利息收入	741,677.78	862,567.23
其中：存款利息收入	709,566.66	860,747.38
债券利息收入	-	1,819.85
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	32,111.12	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-12,634,736.48	581,598,757.07
其中：股票投资收益	-15,528,723.67	575,480,251.64
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	2,025,652.86
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	2,893,987.19	4,092,852.57
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-49,223,928.28	-124,496,719.75
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	176,597.04	1,234,436.05
减：二、费用	15,539,602.81	29,122,193.07

1. 管理人报酬	8,298,431.26	12,593,504.44
2. 托管费	1,383,071.86	2,098,917.45
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	5,424,295.69	13,974,174.36
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	433,804.00	455,596.82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-76,479,992.75	430,076,847.53
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-76,479,992.75	430,076,847.53

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方天元新产业股票型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016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）	369,156,913.49	305,086,802.69	674,243,716.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-76,479,992.75	-76,479,992.75
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-58,043,028.89	-37,837,929.72	-95,880,958.61

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	9,806,195.18	5,389,871.89	15,196,067.07
2. 基金赎回款	-67,849,224.07	-43,227,801.61	-111,077,025.68
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)	311,113,884.60	190,768,880.22	501,882,764.82
项目	上年度可比期间		
	2015年1月1日至2015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)	810,201,124.39	147,167,614.31	957,368,738.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	430,076,847.53	430,076,847.53
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)	-441,044,210.90	-272,157,659.15	-713,201,870.05
其中：1. 基金申购款	26,289,390.30	19,505,688.46	45,795,078.76
2. 基金赎回款	-467,333,601.20	-291,663,347.61	-758,996,948.81
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)	-	-	-

五、期末所有者权益（基金净值）	369,156,913.49	305,086,802.69	674,243,716.18
-----------------	----------------	----------------	----------------

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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.1.1 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。

7.4.1.2 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[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2015]101号《关于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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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，股票的股息、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，暂免征收个人所得税。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、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	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(“兴业证券”)	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

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：无。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付 的管理费	8,298,431.26	12,593,504.44
其中：支付销售机构的 客户维护费	694,400.74	850,506.21

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 1.50% 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 1.50% / 当年天数。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付 的托管费	1,383,071.86	2,098,917.45

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月

	12 月 31 日	31 日
基金合同生效日（ 2014 年 7 月 3 日）持有的 基金份额	20,475,711.00	41,475,711.00
期初持有的基金份额	-	-
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	20,475,711.00	21,000,000.00
期末持有的基金份额	-	20,475,711.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	5.9300%

注：本基金管理人南方基金本期赎回本基金的交易委托华泰证券办理，适用赎回费率为 0.50%。

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：于本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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	45,057,601.42	675,887.07	97,690,231.82

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.5 利润分配情况

注：本基金本报告期内无利润分配。

7.4.6 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.6.1 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
300508	维宏股份	2016-04-12	2017-04-12	新股流通受限	20.08	121.49	2,799	56,203.92	340,050.51	-
603228	景旺电子	2016-12-22	2017-01-06	新股未上市	23.16	23.16	2,182	50,535.12	50,535.12	-
603035	常熟汽饰	2016-12-22	2017-01-06	新股未上市	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
002840	华统股份	2016-12-22	2017-01-06	新股未上市	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016-12-22	2017-01-06	新股未上市	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
603186	华正新材	2016-12-22	2017-01-06	新股未上市	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
603032	德新交运	2016-12-22	2017-01-06	新股未上市	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-
300586	美联新材	2016-12-22	2017-01-06	新股未上市	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	2016-12-30	2017-01-06	新股未上市	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-
300588	熙菱信息	2016-12-22	2017-01-06	新股未上市	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

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。

7.4.6.2 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	复牌开盘价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300100	双林股份	2016年11月7日	重大资产重组	34.00	2017年1月25日	30.60	676,575	22,920,473.44	23,003,550.00	-
300088	长信科技	2016年9月12日	重大资产重组	15.80	-	-	238,600	3,865,868.92	3,769,880.00	-
603986	兆易创新	2016年9月19日	重大资产重组	177.97	2017年3月13日	195.77	1,133	26,353.58	201,640.01	-
300518	盛讯达	2016年12月13日	重大资产重组	113.46	-	-	1,306	29,019.32	148,178.76	-
002798	帝王洁具	2016年11月2日	重大资产重组	67.00	2017年1月17日	60.34	1,056	11,161.92	70,752.00	-
300537	广信材料	2016年10月12日	重大资产重组	48.79	2017年1月13日	43.91	1,024	9,410.56	49,960.96	-
002635	安洁科技	2016年11月8日	重大资产重组	36.40	2017年2月8日	33.50	179	6,171.75	6,515.60	-

注：本基金截至 2016 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。

7.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事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	403,387,723.66	79.96
	其中：股票	403,387,723.66	79.96
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	50,000,000.00	9.91
	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	46,222,244.86	9.16
7	其他各项资产	4,857,006.59	0.96
8	合计	504,466,975.11	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	5,751,574.00	1.15
C	制造业	289,729,124.57	57.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	26,848,893.78	5.35

E	建筑业	15,559,694.00	3.10
F	批发和零售业	61,836.06	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	9,458.68	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,262,881.47	1.05
J	金融业	53,284,684.10	10.62
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,807,980.00	0.56
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	4,071,597.00	0.81
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	403,387,723.66	80.37

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通股票投资。

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	601689	拓普集团	1,203,600	35,409,912.00	7.06
2	601166	兴业银行	1,837,339	29,654,651.46	5.91
3	000651	格力电器	1,061,500	26,134,130.00	5.21

4	000725	京东方 A	8,591,300	24,571,118.00	4.90
5	300100	双林股份	676,575	23,003,550.00	4.58
6	600886	国投电力	2,909,166	19,404,137.22	3.87
7	601939	建设银行	3,130,700	17,031,008.00	3.39
8	002035	华帝股份	533,499	13,844,299.05	2.76
9	600068	葛洲坝	1,406,200	12,922,978.00	2.57
10	000100	TCL 集团	3,806,300	12,560,790.00	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	600886	国投电力	80,990,793.28	12.01
2	601939	建设银行	65,514,358.47	9.72
3	601166	兴业银行	35,957,141.14	5.33
4	601689	拓普集团	32,607,350.61	4.84
5	300100	双林股份	27,615,494.89	4.10
6	000625	长安汽车	27,027,375.39	4.01
7	000651	格力电器	26,369,262.66	3.91
8	000686	东北证券	24,722,907.33	3.67
9	600547	山东黄金	23,743,521.19	3.52
10	000725	京东方 A	22,638,112.00	3.36
11	002508	老板电器	19,825,563.11	2.94
12	000333	美的集团	19,458,372.03	2.89
13	300078	思创医惠	17,822,969.16	2.64
14	002643	万润股份	17,754,539.83	2.63

15	601069	西部黄金	16,737,824.42	2.48
16	002188	巴士在线	16,009,813.98	2.37
17	000418	小天鹅A	15,430,055.84	2.29
18	600519	贵州茅台	15,290,980.37	2.27
19	601857	中国石油	15,123,959.30	2.24
20	002179	中航光电	15,122,273.41	2.24
21	002108	沧州明珠	14,884,332.72	2.21
22	300367	东方网力	14,774,250.31	2.19
23	600386	北巴传媒	14,248,396.60	2.11
24	600075	新疆天业	13,832,381.77	2.05
25	000100	TCL 集团	13,645,032.99	2.02

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	600886	国投电力	62,540,601.83	9.28
2	601939	建设银行	43,776,501.03	6.49
3	002466	天齐锂业	35,033,149.53	5.20
4	600547	山东黄金	31,410,181.72	4.66
5	000625	长安汽车	28,927,068.99	4.29
6	300230	永利股份	24,881,869.12	3.69
7	601988	中国银行	23,918,194.39	3.55
8	002508	老板电器	23,873,945.89	3.54
9	000686	东北证券	23,798,099.26	3.53
10	002643	万润股份	22,267,721.93	3.30
11	002458	益生股份	18,412,681.34	2.73

12	601069	西部黄金	17,254,506.37	2.56
13	002141	蓉胜超微	17,204,754.17	2.55
14	600303	曙光股份	16,578,045.11	2.46
15	600386	北巴传媒	16,337,891.44	2.42
16	601857	中国石油	16,031,547.85	2.38
17	002630	华西能源	15,922,741.29	2.36
18	603008	喜临门	15,909,859.50	2.36
19	600075	新疆天业	15,879,833.22	2.36
20	600519	贵州茅台	15,853,970.32	2.35
21	002284	亚太股份	15,459,445.22	2.29
22	300017	网宿科技	15,362,653.87	2.28
23	000983	西山煤电	15,113,533.23	2.24
24	002108	沧州明珠	15,042,264.35	2.23
25	002188	巴士在线	15,003,905.65	2.23
26	000418	小天鹅A	14,820,803.74	2.20
27	300367	东方网力	14,335,658.92	2.13
28	300078	思创医惠	14,180,808.94	2.10
29	601699	潞安环能	13,549,302.69	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	1,730,291,025.40
卖出股票收入（成交）总额	1,836,271,954.75

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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 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	208,401.84
2	应收证券清算款	4,592,960.95
3	应收股利	-
4	应收利息	48,918.14
5	应收申购款	6,725.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	4,857,006.59

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

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	300100	双林股份	23,003,550.00	4.58	重大事项

§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
22,260	13,074.03	19,938,712.86	6.85%	271,089,263.99	93.15%

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	太平人寿保险有限公司	17,306,762.00	6.12%
2	程梦茜	3,977,506.00	1.41%
3	王友刚	3,104,330.00	1.10%
4	赵小骥	2,445,574.00	0.87%
5	欧阳艳芬	2,342,576.00	0.83%
6	江阴华联商厦有限公司	2,000,000.00	0.71%
7	戴瑜	2,000,000.00	0.71%
8	陈艳芳	1,683,893.00	0.60%
9	刘剑	1,664,800.00	0.59%
10	陆正辉	1,451,141.00	0.51%

9.3 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	323,533.87	0.1112%

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

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究 部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014年7月3日）基金份额总额	3,000,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	345,324,643.19
本报告期基金总申购份额	9,173,466.04
减:本报告期基金总赎回份额	63,470,132.38
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	291,027,976.85

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

根据南方基金管理有限公司第七届董事会第一次会议审议通过，并按规定向中国证券监督管理委员会深圳监管局备案，基金管理人于 2016 年 10 月 20 日发布公告，自 2016 年 10 月 18 日起，张海波先生担任本基金管理人董事长，吴万善先生不再担任本基金管理人董事长。

基金管理人于 2016 年 10 月 20 日发布公告，南方基金管理有限公司（以下简称“公司”）第六届董事会任期届满，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 2016 年第一次临时会议选举产生了公司第七届董事会。

根据南方基金管理有限公司第六届董事会第二十八次会议审议通过，并按规定向中国证券投资基金业协会报备，基金管理人于 2016 年 10 月 19 日发布公告，自 2016 年 10 月 17 日起，郑文祥先生不再担任本基金管理人副总经理。

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，无涉及基金管理业务、基金财产的诉讼。

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 55,000.00 元，该审计机构提供审计服务的第 3 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	
平安证券	2	1,198,004,994.28	33.63%	1,104,374.13	33.75%	-
广州证券	1	636,711,701.78	17.87%	580,237.30	17.73%	-
申万宏源	2	514,530,168.25	14.44%	470,215.11	14.37%	-
银河证券	2	394,066,190.21	11.06%	359,112.84	10.98%	-
光大证券	1	203,144,138.00	5.70%	189,184.66	5.78%	-
海通证券	1	198,514,287.62	5.57%	180,906.12	5.53%	-
国信证券	2	137,608,863.38	3.86%	128,154.36	3.92%	-
方正证券	1	129,923,131.36	3.65%	120,997.66	3.70%	-
中银国际	1	88,900,097.35	2.50%	82,792.74	2.53%	-
中金公司	1	61,420,056.49	1.72%	55,972.59	1.71%	-
中银建投	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-

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
平安证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	50,000,000.00	100.00%	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

中金公司	-	-	-	-	-	-
中银建投	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-