

# 南方盛元红利混合型证券投资基金 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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

基金简称	南方盛元红利混合
基金主代码	202009
前端交易代码	202009
后端交易代码	202010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 3 月 21 日
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,327,751,806.24 份
基金合同存续期	不定期

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“南方盛元”。

2、本基金合同生效后一年内为封闭式，基金合同生效满一年后转为开放式，本基金已于

2009 年 3 月 23 日转为开放式。

## 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为混合型基金，重点投资于具备持续良好盈利和分红能力、分红政策稳定的上市公司，以及高债息固定收益类投资品种。同时积极把握资本利得机会以拓展收益空间，力争为投资者谋求超越基准的投资回报与长期稳健的资产增值。
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	90%×上证红利指数+10%×上证国债指数
风险收益特征	本基金为混合型基金，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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	田青
	联系电话	0755-82763888	010-67595096
	电子邮箱	manager@southernfund.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-889-8899	010-67595096
传真		0755-82763889	010-66275853

## 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	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
--------------------	---

址	
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	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-148,454,234.13	547,312,624.28	363,325,959.43
本期利润	-351,273,644.34	634,295,197.34	378,591,998.59
加权平均基金份额本期利润	-0.2407	0.5503	0.2073
本期基金份额净值增长率	-21.49%	72.06%	27.05%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1236	0.4589	-0.0089
期末基金资产净值	1,163,667,274.62	1,762,853,874.09	1,428,945,929.62
期末基金份额净值	0.876	1.678	0.991

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

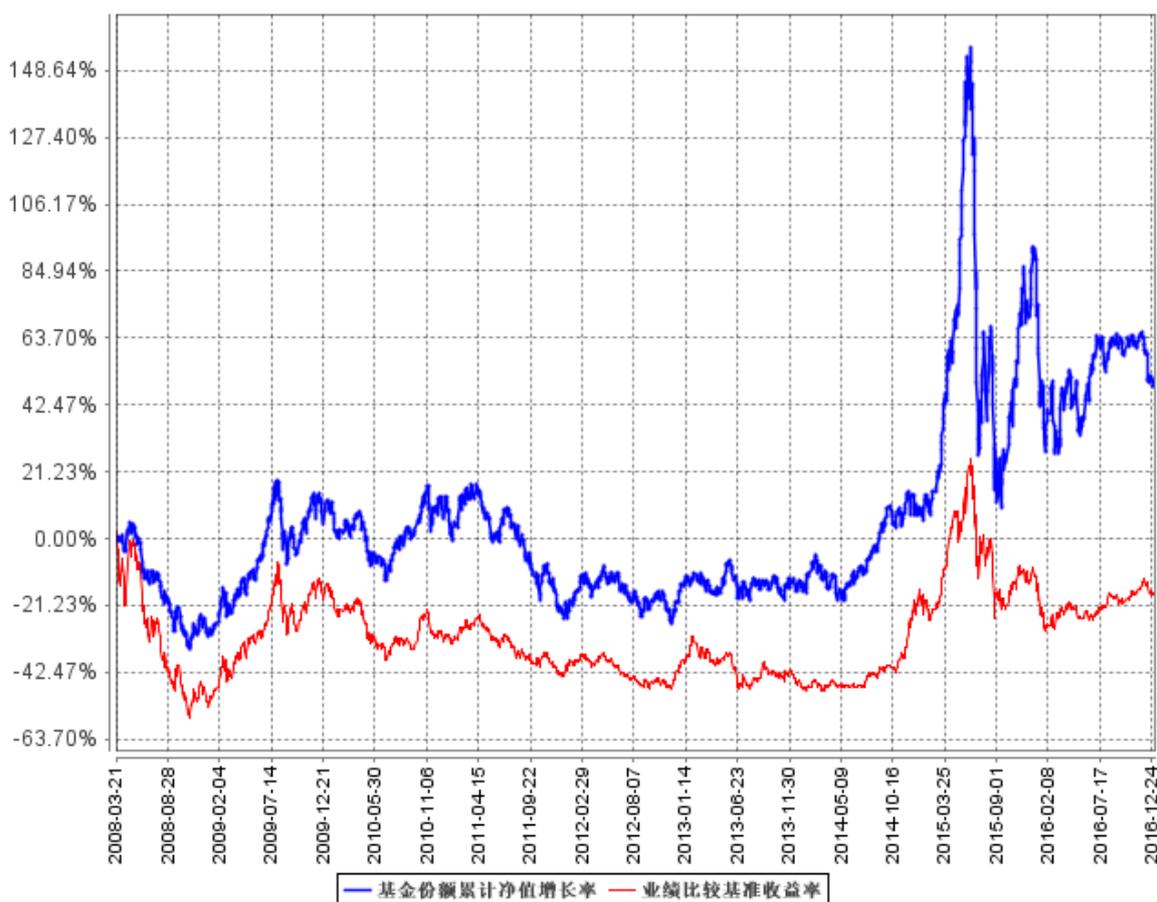
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-7.01%	0.88%	3.52%	0.65%	-10.53%	0.23%

过去六个月	-6.31%	0.97%	9.42%	0.68%	-15.73%	0.29%
过去一年	-21.49%	1.97%	-6.33%	1.22%	-15.16%	0.75%
过去三年	71.64%	2.30%	50.41%	1.65%	21.23%	0.65%
过去五年	90.33%	1.96%	44.30%	1.49%	46.03%	0.47%
自基金合同生效起至今	48.18%	1.79%	-17.28%	1.67%	65.46%	0.12%

注：本基金的业绩比较基准为 90%×上证红利指数+10%×上证国债指数。

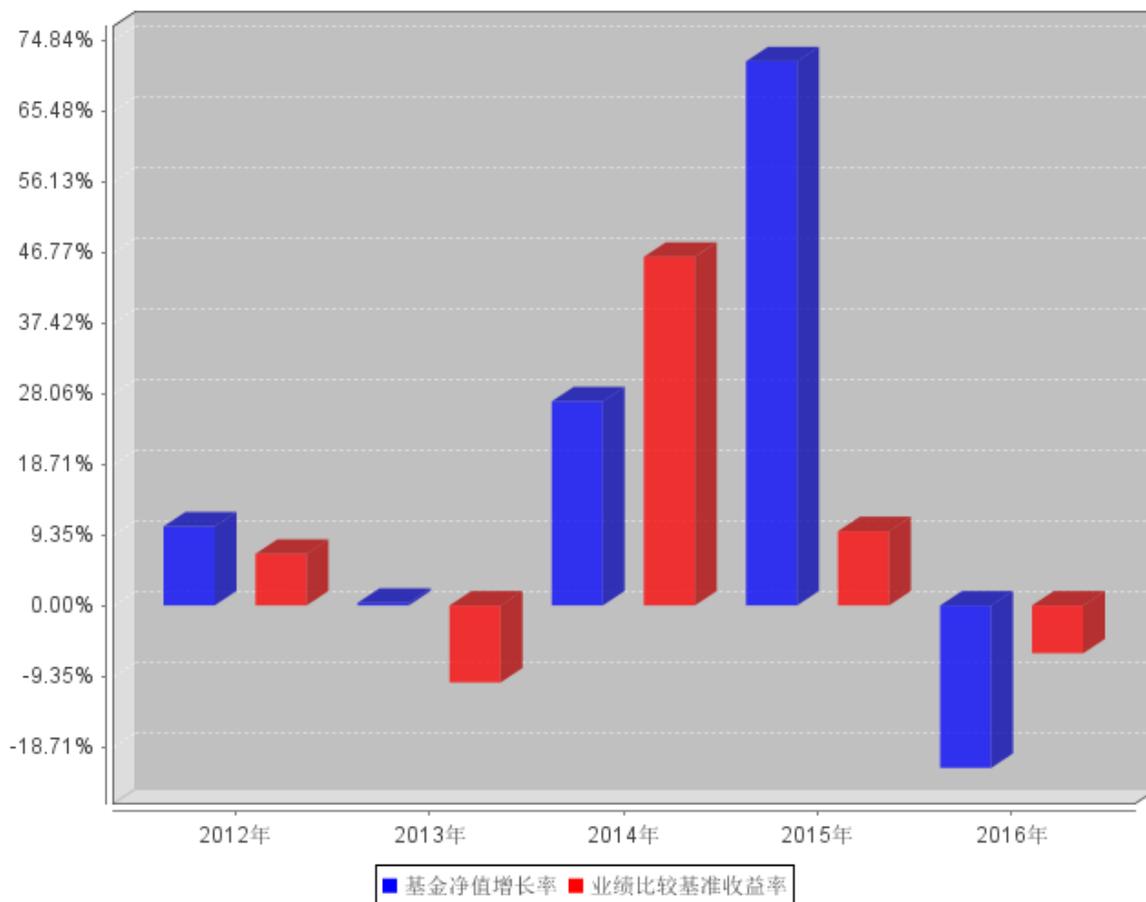
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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
2016	4.4700	319,541,877.82	160,433,522.50	479,975,400.32	
2015	0.2000	16,521,782.75	6,573,725.76	23,095,508.51	
2014	0.0500	5,342,311.48	1,926,638.68	7,268,950.16	
合计	4.7200	341,405,972.05	168,933,886.94	510,339,858.99	

## §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		
张旭	本基 金基 金经 理	2012 年 11 月 23 日	-	8 年	中山大学金融学博士学位，注册金融分析师（CFA），具有基金从业资格。2008 年加入南方基金，曾任金融及地产行业研究员、高级策略研究员、南方盛元基金经理助理；2012 年 3 月至 2014 年 12 月，任南方消费基金经理；2012 年 11 月至今，任南方盛元基金经理；2015 年 1 月至今，任南方产业活力基金经理；2016 年 8 月至今，任南方转型混合基金经理。

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《南方盛元红利混合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，没有发生损害基金持有人利益的情形。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 年上证综指跌 12.3%，创业板指跌 27.7%，是继 2014-2015 年市场大涨之后的回调整理。

从时间纬度看，在年初市场熔断快速下跌后，上证综指走出了震荡向上的趋势，而同期创业板指数则呈震荡下跌趋势。从市场表现的结构分化来看，回顾 2016 年，股市表现出明显的脱虚向实趋势，估值较高的新兴产业估值回落，传统行业、内生增长、合理估值成为重要的选股主线，走出了分化明显的结构性行情。这与宏观政策层面推动的供给侧改革、资本市场内在运行规律和监管导向紧密相关，也是市场在震荡格局中相对偏低的风险偏好使然。

报告期内，本基金在围绕改革红利的投资主线布局同时，会结合市场环境关注具有真实业绩增长、行业复苏带来的投资机会，以及新兴产业中股价经过较长时间回归，基本面依然具有成长空间的个股，把握业绩逐步兑现后估值修复的投资机会。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金份额净值增长率为-21.49%，同期业绩基准涨幅-6.33%。

#### 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，党的十九大将胜利召开，以供给侧改革、国企改革、区域发展战略和一带一路等为代表的深化改革政策将持续深入推进，为中国经济提供新的持续发展动力，也为资本市场提供更多的投资机遇。美国新一届政府上任后推行新的内政外交政策，美联储货币政策收紧趋势下，对国际局势影响深远，对国内相关产业的发展趋势带来新的外部变量，需要用新的视角来审视各产业发展机遇和冲击。资本市场的制度变革和完善同样会对市场带来重大影响，在降杠杆、防范资产价格泡沫的整体监管思路指引下，IPO 常态化以及再融资政策新规对市场各方行为导向意义重大，伴随着大陆香港两地市场互联互通的深入，两地市场资金和投资逻辑的相互渗透将长远影响着市场环境和定价基础，在这一系列资本生态的变化中对我们的选股逻辑也提出了新的要求。

新的一年，我们坚守以改革红利为投资主线，积极布局具有类似于美股具有趋势性长牛基因的品种，围绕产业结构转型升级和产权结构转型开展投资研究工作。同时在新的市场环境下，对于产业结构转型升级逻辑的筛选标准会更加严格，更加注重产业方向性、团队稳定性和业绩持续性，以国企改革为代表的产权结构转型升级的线索值得深入研究，对于具有良好内生业绩成长和合理估值的品种需要加强研究。我们在防范风险的同时会精选优势行业和优质企业，努力为投资者创造良好回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服

务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括副总经理、研究部总监、数量化投资部总监、风险管理部总监及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。

#### 4.7 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：本基金的每份基金份额享有同等分配权；在满足分红条件的前提下，本基金每季度至少分红一次，每年最多分配 12 次，全年分配比例不得低于年度已实现收益的 90%；本基金封闭期内只采取现金分红的方式；封闭期届满后，本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除息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；封闭期届满后，当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额；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，方可进行当期收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；法律法规或监管机构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。

本报告期内 2016 年 1 月 20 日已分配数（每 10 份基金份额派发红利 4.47 元）为以往年度收益分配。

#### 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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金实施的利润分配为 479,975,400.32 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

本托管人复核审查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。

## §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 21510 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：南方盛元红利混合型证券投资基金

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
<b>资产：</b>		
银行存款	147,692,050.09	223,250,925.84
结算备付金	3,315,595.11	7,004,704.38
存出保证金	478,103.07	1,313,195.20
交易性金融资产	1,035,907,038.72	1,595,996,116.33
其中：股票投资	976,013,038.72	1,595,996,116.33

基金投资	-	-
债券投资	59,894,000.00	-
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	-	-
应收利息	814,051.81	45,978.29
应收股利	-	-
应收申购款	994,078.78	4,018,505.56
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,189,200,917.58	1,831,629,425.60
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2016年12月31日</b>	<b>2015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	20,795,800.98	56,879,095.83
应付赎回款	853,019.73	5,087,964.68
应付管理人报酬	1,546,152.93	2,143,863.25
应付托管费	257,692.16	357,310.55
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,783,638.39	4,100,525.17
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-

递延所得税负债	-	-
其他负债	297,338.77	206,792.03
负债合计	25,533,642.96	68,775,551.51
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	1,327,751,806.24	1,050,756,121.34
未分配利润	-164,084,531.62	712,097,752.75
所有者权益合计	1,163,667,274.62	1,762,853,874.09
负债和所有者权益总计	1,189,200,917.58	1,831,629,425.60

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.876 元，基金份额总额 1,327,751,806.24 份。

## 7.2 利润表

会计主体：南方盛元红利混合型证券投资基金

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
<b>一、收入</b>	-315,991,386.32	687,621,769.74
1. 利息收入	1,424,156.51	2,156,008.28
其中：存款利息收入	1,129,325.99	890,098.69
债券利息收入	19,810.96	1,265,909.59
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	275,019.56	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-115,844,654.60	596,044,349.95
其中：股票投资收益	-119,890,999.35	591,453,179.87
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	274,600.00
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	4,046,344.75	4,316,570.08
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-202,819,410.21	86,982,573.06
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	1,248,521.98	2,438,838.45
<b>减：二、费用</b>	<b>35,282,258.02</b>	<b>53,326,572.40</b>
1. 管理人报酬	20,160,750.41	23,819,172.94
2. 托管费	3,360,125.05	3,969,862.21
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	11,330,783.99	25,113,118.91
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	430,598.57	424,418.34
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-351,273,644.34</b>	<b>634,295,197.34</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-351,273,644.34</b>	<b>634,295,197.34</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方盛元红利混合型证券投资基金

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）	1,050,756,121.34	712,097,752.75	1,762,853,874.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-351,273,644.34	-351,273,644.34
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）	276,995,684.90	-44,933,239.71	232,062,445.19
其中：1. 基金申购款	1,390,276,772.03	-108,032,578.09	1,282,244,193.94
2. 基金赎回款	-1,113,281,087.13	63,099,338.38	-1,050,181,748.75
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）	-	-479,975,400.32	-479,975,400.32
五、期末所有者权益（基金净值）	1,327,751,806.24	-164,084,531.62	1,163,667,274.62
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）	1,441,723,161.38	-12,777,231.76	1,428,945,929.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	634,295,197.34	634,295,197.34
三、本期基金份额交易产	-390,967,040.04	113,675,295.68	-277,291,744.36

生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	1,674,885,345.32	1,114,684,769.72	2,789,570,115.04
2. 基金赎回款	-2,065,852,385.36	-1,001,009,474.04	-3,066,861,859.40
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)	-	-23,095,508.51	-23,095,508.51
五、期末所有者权益(基金净值)	1,050,756,121.34	712,097,752.75	1,762,853,874.09

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 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

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、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	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(“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

##### 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 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	
	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	243,791,152.09	3.28%	657,813,751.86	3.97%
兴业证券	608,232,501.99	8.19%	1,559,720,427.74	9.41%

##### 7.4.4.1.2 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 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 2016年1月1日至2016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	227,044.75	3.34%	227,044.75	12.73%
兴业证券	554,283.93	8.15%	332,859.12	18.67%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	598,872.11	4.01%	-	-
兴业证券	1,396,382.85	9.35%	77,562.13	1.89%

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。

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	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	20,160,750.41	23,819,172.94
其中：支付销售机构的客户维护费	3,955,479.85	4,657,909.67

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 1.5% 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	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	3,360,125.05	3,969,862.21

注：支付基金托管人中国建设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**

注：本报告期及上年度可比期间无各关联方投资本基金的情况。

**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
	中国建设银行	147,692,050.09	1,033,119.43	223,250,925.84

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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**

注：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**

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		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	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2016 年1月 20日	2016年 1月 20日	2016 年 1月 20日	4.4700	319,541,877.82	160,433,522.50	479,975,400.32	
合 计	-	-	-	4.4700	319,541,877.82	160,433,522.50	479,975,400.32	

## 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

7.4.6.1.1 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
601375	中原证券	2016 年 12 月 20 日	2017 年 1 月 3 日	新股流通受限	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603228	景旺电子	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 6 日	新股流通受限	23.16	23.16	3,491	80,851.56	80,851.56	-
603877	太平鸟	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 9 日	新股流通受限	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
300583	赛托生物	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 6 日	新股流通受限	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
603689	皖天然气	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	新股流通受限	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-
603035	常熟汽饰	2016 年	2017 年	新股流通受限	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-

		12月 27日	1月 5日							
603266	天龙 股份	2016 年 12月 30日	2017 年 1月 10日	新股流 通受限	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-
002840	华统 股份	2016 年 12月 29日	2017 年 1月 10日	新股流 通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩 股份	2016 年 12月 28日	2017 年 1月 6日	新股流 通受限	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
603032	德新 交运	2016 年 12月 27日	2017 年 1月 5日	新股流 通受限	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-
300586	美联 新材	2016 年 12月 26日	2017 年 1月 4日	新股流 通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里 马	2016 年 12月 30日	2017 年 1月 10日	新股流 通受限	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-
300588	熙菱 信息	2016 年 12月	2017 年 1月	新股流 通受限	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

		27 日	5 日							
--	--	------	-----	--	--	--	--	--	--	--

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	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002745	木林森	2016 年 7 月 15 日	重大资产重组	36.49	-	-	267,300	9,396,844.70	9,753,777.00	-

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

注：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	976,013,038.72	82.07
	其中：股票	976,013,038.72	82.07
2	固定收益投资	59,894,000.00	5.04
	其中：债券	59,894,000.00	5.04
	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	151,007,645.20	12.70
7	其他各项资产	2,286,233.66	0.19
8	合计	1,189,200,917.58	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	64,308,409.44	5.53
B	采矿业	33,399,242.64	2.87
C	制造业	553,507,044.31	47.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,071,917.66	1.72

E	建筑业	42,958,243.99	3.69
F	批发和零售业	96,960,694.98	8.33
G	交通运输、仓储和邮政业	7,431,458.68	0.64
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,076,118.52	2.93
J	金融业	106,780.00	0.01
K	房地产业	10,001,614.00	0.86
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	69,510,504.40	5.97
S	综合	43,681,010.10	3.75
	合计	976,013,038.72	83.87

### 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	002445	中南文化	5,696,289	85,501,297.89	7.35
2	002502	骅威文化	5,380,070	69,510,504.40	5.97
3	300143	星河生物	2,519,922	64,308,409.44	5.53
4	300325	德威新材	8,778,020	58,461,613.20	5.02
5	000881	大连国际	1,600,037	43,681,010.10	3.75
6	600382	广东明珠	2,380,018	43,316,327.60	3.72

7	300238	冠昊生物	1,200,651	40,041,710.85	3.44
8	300161	华中数控	1,200,024	31,200,624.00	2.68
9	600628	新世界	2,000,026	28,260,367.38	2.43
10	002167	东方锆业	2,000,000	27,100,000.00	2.33

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	300143	星河生物	85,714,939.05	4.86
2	600565	迪马股份	75,642,405.80	4.29
3	002502	骅威文化	71,676,678.83	4.07
4	002421	达实智能	62,524,016.98	3.55
5	000423	东阿阿胶	61,114,557.82	3.47
6	002303	美盈森	59,746,875.93	3.39
7	300449	汉邦高科	57,813,136.99	3.28
8	002482	广田集团	57,480,309.26	3.26
9	002445	中南文化	57,441,550.73	3.26
10	000890	法尔胜	55,605,688.02	3.15
11	300238	冠昊生物	55,244,169.39	3.13
12	300325	德威新材	54,402,880.13	3.09
13	000881	大连国际	53,442,188.25	3.03
14	002170	芭田股份	51,225,650.30	2.91
15	300093	金刚玻璃	49,161,972.25	2.79
16	002675	东诚药业	47,002,659.38	2.67
17	000070	特发信息	46,644,285.03	2.65
18	002402	和而泰	43,172,162.85	2.45

19	600382	广东明珠	42,902,489.86	2.43
20	300486	东杰智能	42,120,513.04	2.39
21	002243	通产丽星	36,386,344.87	2.06
22	600518	康美药业	36,236,902.34	2.06
23	002358	森源电气	36,120,188.21	2.05
24	601198	东兴证券	35,824,359.74	2.03

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	002402	和而泰	175,256,161.16	9.94
2	300325	德威新材	97,565,540.97	5.53
3	600400	红豆股份	77,766,951.74	4.41
4	001979	招商蛇口	75,462,953.49	4.28
5	300187	永清环保	74,900,992.45	4.25
6	600565	迪马股份	71,781,154.85	4.07
7	000423	东阿阿胶	67,630,826.50	3.84
8	300449	汉邦高科	64,525,304.17	3.66
9	002303	美盈森	63,855,324.17	3.62
10	002482	广田集团	61,383,201.11	3.48
11	000890	法尔胜	60,519,052.76	3.43
12	600160	巨化股份	58,627,879.55	3.33
13	000426	兴业矿业	56,508,280.07	3.21
14	002094	青岛金王	54,919,528.05	3.12
15	000070	特发信息	53,332,221.52	3.03
16	002170	芭田股份	48,011,118.15	2.72

17	300093	金刚玻璃	46,541,919.70	2.64
18	002421	达实智能	44,496,844.66	2.52
19	002113	天润数娱	42,646,640.27	2.42
20	002224	三力士	40,288,718.61	2.29
21	300486	东杰智能	38,741,850.25	2.20
22	002675	东诚药业	36,226,049.24	2.05

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	3,569,869,179.90
卖出股票收入（成交）总额	3,867,109,837.95

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	59,894,000.00	5.15
	其中：政策性金融债	59,894,000.00	5.15
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	59,894,000.00	5.15

**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	150417	15 农发 17	300,000	30,054,000.00	2.58
2	160308	16 进出 08	200,000	19,888,000.00	1.71
3	120234	12 国开 34	100,000	9,952,000.00	0.86

**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投资。

**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除东方锆业(002167)，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。根据 2016 年 1 月 23 日东方锆业科技股份有限公司（下称东方锆业，股票代码：002167）《东方锆业科技股份有限公司关于收到〈行政处罚决定书〉的公告》，东方锆业于近日收到了《中国证券监督管理委员会行政处罚决定书》（【2016】6 号），东方锆业违反了《证券法》相关规定，被给予警告并罚款 30 万元。基金管理人对上述股票的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

**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	478,103.07
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	814,051.81
5	应收申购款	994,078.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,286,233.66

**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
61,399	21,624.97	4,307,444.58	0.32%	1,323,444,361.66	99.68%

**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	282,969.30	0.0213%

**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**

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	0
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（2008年3月21日）基金份额总额	6,217,055,191.10
本报告期期初基金份额总额	1,050,756,121.34
本报告期基金总申购份额	1,390,276,772.03
减：本报告期基金总赎回份额	1,113,281,087.13
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	1,327,751,806.24

**§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、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 91,000 元。该审计机构已提供审计服务的连续年限为 9 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	

民族证券	1	3,218,163,936.47	43.32%	2,932,718.47	43.10%	-
中金公司	1	950,679,735.21	12.80%	866,356.68	12.73%	-
安信证券	1	808,241,240.18	10.88%	752,714.43	11.06%	-
兴业证券	1	608,232,501.99	8.19%	554,283.93	8.15%	-
招商证券	1	469,116,553.93	6.31%	427,506.59	6.28%	-
中泰证券	1	445,273,167.04	5.99%	414,680.71	6.09%	-
宏信证券	1	273,186,305.09	3.68%	248,954.90	3.66%	-
华泰证券	1	243,791,152.09	3.28%	227,044.75	3.34%	-
国泰君安	1	234,580,898.11	3.16%	213,773.69	3.14%	-
第一创业	1	94,723,230.29	1.27%	88,216.42	1.30%	-
银河证券	1	83,475,017.26	1.12%	77,742.44	1.14%	-
中邮证券	1	-	-	-	-	-
银泰证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
天源证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
诚浩证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	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
民族证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	2,008,000,000.00	65.92%	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	430,000,000.00	14.12%	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	608,000,000.00	19.96%	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-
银泰证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
天源证券	-	-	-	-	-	-

申万宏源	-	-	-	-	-	-
诚浩证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-