

南方策略优化混合型证券投资基金 2017 年年度报告摘要

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2018 年 03 月 29 日

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 2018 年 3 月 26 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 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	南方策略优化混合
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	南方基金管理股份有限公司
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	605,940,735.25 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 Black-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，精选各行业内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	$80\% \times \text{沪深 300 指数} + 20\% \times \text{上证国债指数}$
风险收益特征	本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、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		南方基金管理股份有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	常克川	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
注册地址		深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层	中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层	深圳深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		518048	518040

法定代表人	张海波	李建红
-------	-----	-----

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	报告期（2017 年 1 月 1 日-2017 年 12 月 31 日）	报告期（2016 年 1 月 1 日-2016 年 12 月 31 日）	报告期（2015 年 1 月 1 日-2015 年 12 月 31 日）
本期已实现收益	-69,891,778.85	96,124,290.63	302,506,084.69
本期利润	-23,779,529.17	25,786,183.23	240,933,392.17
加权平均基金份额本期利润	-0.0299	0.0568	0.5914
本期基金份额净值增长率	-2.01%	5.37%	62.43%
3.1.2 期末数据和指标	报告期(2017 年 12 月 31 日)	报告期(2016 年 12 月 31 日)	报告期(2015 年 12 月 31 日)
期末可供分配基金份额利润	0.4915	0.5845	0.3743
期末基金资产净值	943,959,069.66	1,495,630,752.69	452,965,216.82
期末基金份额净值	1.558	1.590	1.509

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。

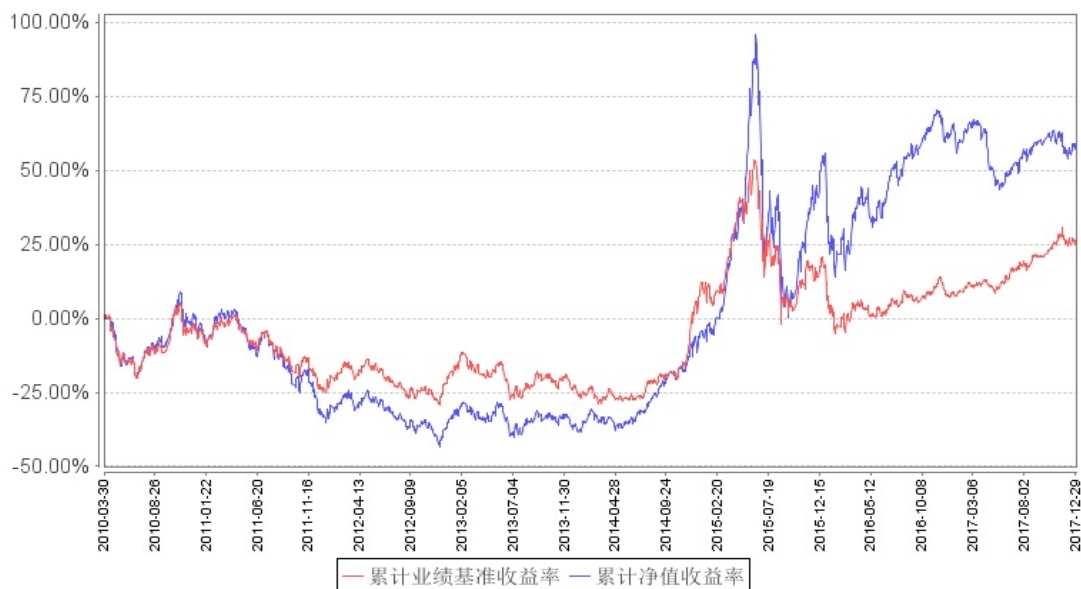
3.2 基金净值表现

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	净值增长率 ①	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	-0.70%	0.81%	4.09%	0.64%	-4.79%	0.17%
过去六个月	5.13%	0.71%	7.98%	0.56%	-2.85%	0.15%
过去一年	-2.01%	0.74%	17.32%	0.51%	-19.33%	0.23%
过去三年	67.71%	1.77%	15.27%	1.35%	52.44%	0.42%
过去五年	139.69%	1.57%	54.08%	1.24%	85.61%	0.33%
自基金合同生效起至今	58.90%	1.48%	26.10%	1.19%	32.80%	0.29%

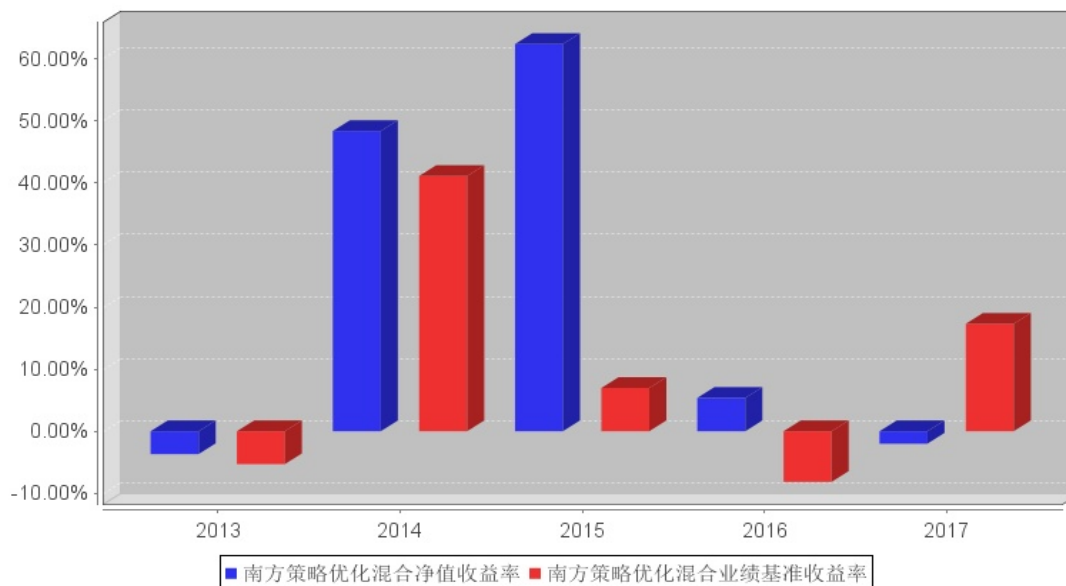
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

南方策略优化混合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

南方策略优化混合基金每年净值增长率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。

2018 年 1 月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司，注册资本金 3 亿元人民币。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%。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，南方基金管理股份有限公司（不含子公司）管理资产规模超 7,200 亿元，旗下管理 153 只开放式基金，多个全国社保、基本养老保险、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		
罗文杰	本基金基金经理	2017 年 11 月 9 日	—	12	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，曾任南方基金数量化投资部基金经理助理，现任指数投资部兼数量化投资部总经理；2013 年 5 月至 2015 年 6 月，任南方策略基金经理；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；

					<p>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；2014 年 10 月至今，任 500 医药基金经理；2015 年 2 月至今，任南方恒生 ETF 基金经理；2016 年 12 月至今，任南方安享绝对收益、南方卓享绝对收益基金经理；2017 年 7 月至今，任恒生联接基金经理；2017 年 8 月至今，任南方房地产联接、南方房地产 ETF 基金经理；2017 年 11 月至今，任南方策略、南方量化混合基金经理。</p>
雷俊	本基金基金经理	2015 年 6 月 16 日	2017 年 11 月 9 日	9	<p>北京大学智能科学系硕士，具有基金从业资格。2008 年 7 月加入南方基金，历任信息技术部投研系统研发员、数</p>

					<p>量化投资部高级研究员、数量化投资部总监助理；</p> <p>2014 年 12 月至 2016 年 4 月，任南方恒生 ETF 基金经理；2015 年 4 月至 2016 年 4 月，任南方中证 500 工业 ETF、南方中证 500 原材料 ETF 基金经理；2015 年 6 月至 2016 年 7 月，任改革基金、高铁基金、南方 500 信息基金经理；</p> <p>2015 年 4 月至 2017 年 11 月，任大数据 100 基金经理；2015 年 6 月至 2017 年 11 月，任南方策略优化、大数据 300、南方量化成长的基金经理；</p> <p>2017 年 8 月至 2017 年 11 月，任南方量化混合基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

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，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则，投资管理制度和细则，集中交易管理办法，公平交易操作指引，异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。本报告期内，两两组合间单日、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的情况存在，并且交易占优比也没有明显异常，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5次，是由于投资组合接受投资者申赎后被动增减仓位以及指数型基金成份股调整所致，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

2017 年是大盘蓝筹的牛市，却是中小盘个股的熊市。代表超大盘上证 50 上涨 25.08%，代表大盘的沪深 300 上涨 21.78%，而代表中盘的中证 500 则下跌 0.2%，代表小盘的中证 1000 更是跌去了 17.35%。众多量化基金由于按照过去的经验将业绩基准定位于中证 500，因而大多数都没有取得正收益。本基金 2017 年在大盘蓝筹上配置较低，全年收益-2.01%，跑输了基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2017 年，本基金净值增长-2.01%，同期业绩比较基准增长 17.32%。

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，我们认为在 2017 年表现较好的价值和盈利因子在 2018 年会继续有较好的表现。在风格上，大盘价值风格仍然占优，中小盘成长股的高估值还有可能继续挤水分，在市场发生根本性风格转换前，坚持价值投资的方式是比较稳妥和有利可图的。

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。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，组成人员包括副总经理、督察长、权益研究部总经理、指数投资部总经理、现金投资部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。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。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。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；若投资人选择不选择， 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

本报告期内，本基金托管人——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 2017 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(2018)第 22754 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：南方策略优化混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	54,535,418.29	135,093,667.58
结算备付金	3,203,458.23	7,223,244.41
存出保证金	258,912.35	313,302.15
交易性金融资产	891,713,203.21	1,359,791,002.84
其中：股票投资	891,483,003.21	1,359,791,002.84
基金投资	—	—
债券投资	230,200.00	—
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	—	50,000,000.00
应收证券清算款	—	—
应收利息	14,176.26	27,060.15
应收股利	—	—
应收申购款	1,274,068.27	3,199,039.69
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—

资产总计	950,999,236.61	1,555,647,316.82
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2017 年 12 月 31 日	2016 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	—	50,000,000.00
应付赎回款	4,511,210.67	4,720,940.07
应付管理人报酬	1,195,636.43	1,881,203.72
应付托管费	199,272.72	313,533.96
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	728,798.74	2,726,995.07
应交税费	—	—
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	405,248.39	373,891.31
负债合计	7,040,166.95	60,016,564.13
所有者权益:		
实收基金	605,940,735.25	940,541,009.46
未分配利润	338,018,334.41	555,089,743.23
所有者权益合计	943,959,069.66	1,495,630,752.69
负债和所有者权益总计	950,999,236.61	1,555,647,316.82

7.2 利润表

会计主体：南方策略优化混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日 至 2016 年 12 月 31 日
一、收入	18,362,471.89	46,251,479.01
1. 利息收入	1,580,732.62	649,307.42
其中：存款利息收入	764,197.59	517,842.53
债券利息收入	93.17	0.88
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	816,441.86	131,464.01
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-31,313,410.90	115,459,504.43
其中：股票投资收益	-47,511,753.70	111,980,476.58
基金投资收益	—	—
债券投资收益	87,321.05	1,990.32
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	16,111,021.75	3,477,037.53
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	46,112,249.68	-70,338,107.40
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	1,982,900.49	480,774.56
减：二、费用	42,142,001.06	20,465,295.78
1. 管理人报酬	18,522,526.83	9,848,289.21
2. 托管费	3,087,087.75	1,641,381.44
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	20,110,858.84	8,599,273.06

5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	421,527.64	376,352.07
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-23,779,529.17	25,786,183.23
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-23,779,529.17	25,786,183.23

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方策略优化混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日 至 2017 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)	940,541,009.46	555,089,743.23	1,495,630,752.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期净利润)	-	-23,779,529.17	-23,779,529.17
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)	-334,600,274.21	-193,291,879.65	-527,892,153.86
其中：1. 基金申购款	743,786,421.00	414,143,634.47	1,157,930,055.47
2. 基金赎回款	-1,078,386,695.21	-607,435,514.12	-1,685,822,209.33
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）	605,940,735.25	338,018,334.41	943,959,069.66
项目	上年度可比期间		
	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）	300,223,083.71	152,742,133.11	452,965,216.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	25,786,183.23	25,786,183.23
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）	640,317,925.75	376,561,426.89	1,016,879,352.64
其中：1. 基金申购款	924,317,325.34	522,321,527.69	1,446,638,853.03
2. 基金赎回款	-283,999,399.59	-145,760,100.80	-429,759,500.39
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）	940,541,009.46	555,089,743.23	1,495,630,752.69

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：

第 17 页 共 37 页

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

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

本报告期无会计政策变更。

7.4.2.2 会计估计变更的说明

根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，本基金自2017年12月25日起改为按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。该估值技术变更对本基金无影响。

7.4.2.3 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。

7.4.3 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。

7.4.4 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)	基金管理人、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:1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 根据《南方基金管理有限公司法定名称变更的公告》，公司名称由“南方基金管理有限公司”变更为“南方基金管理股份有限公司”，公司股权结构等事项未发生变化，并已于 2018 年 1 月 4 日在深圳市市场监督管理局完成相应变更登记手续。

7.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.5.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日		2016 年 1 月 1 日 至 2016 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	6,999,793,380.69	52.93	3,289,857,584.02	54.79

7.4.5.1.2 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

7.4.5.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期			
	2017 年 1 月 1 日 至 2017 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	6,404,854.72	52.99	424,278.53	58.22
关联方名称	上年度可比期间			
	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	3,018,399.40	54.68	2,601,110.22	95.38

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。

7.4.5.2 关联方报酬

7.4.5.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日 至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	18,522,526.83	9,848,289.21
其中：支付销售机构的客户维护费	4,902,954.17	2,289,248.82

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 × 1.50% / 当年天数。

7.4.5.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日 至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,087,087.75	1,641,381.44

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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

7.4.5.3 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。

7.4.5.4 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。

7.4.5.5 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 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日 至 2016 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
招商银行股份有限公司	54,535,418.29	624,851.89	135,093,667.58	465,871.46

注：本基金由基金托管人招商银行保管的银行存款，按银行约定利率计息。

7.4.5.6 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。

7.4.5.7 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。

7.4.6 期末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
002923	润都股份	2017-12-28	2018-01-05	新股认购	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	-

603161	科华 控股	2017-12-28	2018-01-05	新股 认购	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-
7.4.12.1.2 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
128029	太阳 转债	2017-12-22	2018-01-16	新债 确认	100.00	100.00	2,302	230,200.00	230,200.00	-

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
000006	深振 业 A	2017- 09-11	重大 资产 重组	9.85	2018-03- 08	8.87	92,700	784,421.07	913,095.00	
000007	全新 好	2017- 10-09	重大 资产 重组	16.66	2018-03- 09	13.50	29,800	462,731.00	496,468.00	
000022	深赤 湾 A	2017- 11-20	重大 资产 重组	24.14	-	-	64	1,769.73	1,544.96	
000034	神州 数码	2017- 09-29	重大 资产 重组	21.60	-	-	34,600	682,025.00	747,360.00	
000056	皇庭 国际	2017- 11-01	重大 资产	13.27	-	-	27,400	346,388.62	363,598.00	

			重组							
000401	冀东水泥	2017-11-21	重大资产重组	13.79	2018-01-15	15.17	63,900	1,167,322.51	881,181.00	
000547	航天发展	2017-10-30	重大事项	10.26	-	-	95,600	1,113,485.40	980,856.00	
000564	供销大集	2017-11-28	重大资产重组	4.78	-	-	58,700	380,781.64	280,586.00	
000688	建新矿业	2017-09-06	重大事项	10.95	2018-02-07	9.86	102,500	768,068.46	1,122,375.00	
000695	滨海能源	2017-10-09	重大资产重组	11.73	2018-01-15	10.73	21,400	245,213.00	251,022.00	
002366	台海核电	2017-12-06	重大资产重组	26.45	-	-	79,100	2,474,987.00	2,092,195.00	
002442	龙星化工	2017-12-19	重大事项	12.51	2018-01-03	12.50	51	662.53	638.01	
002470	金正大	2017-10-25	重大事项	9.15	2018-02-09	8.24	1,574,500	12,941,279.23	14,406,675.00	
002919	名臣健康	2017-12-28	重大事项	35.26	2018-01-02	38.79	821	10,311.76	28,948.46	
300159	新研股份	2017-11-23	重大资产重组	10.40	2018-03-22	8.62	204,900	2,436,651.00	2,130,960.00	
300730	科创信息	2017-12-25	重大事项	41.55	2018-01-02	45.71	821	6,863.56	34,112.55	
600309	万华	2017-	重大	37.94	-	-	137,400	5,476,732.00	5,212,956.00	

	化学	12-05	资产重组							
600332	白云山	2017-10-31	重大资产重组	32.14	2018-01-08	30.15	272,500	7,532,463.56	8,758,150.00	
600485	信威集团	2016-12-26	重大资产重组	14.59	-	-	30,800	519,910.00	449,372.00	
600664	哈药股份	2017-09-28	重大资产重组	5.81	2018-02-27	6.00	85	492.22	493.85	

注：本基金截至 2017 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。

7.4.7 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 852,293,435.59 元，属于第二层次的余额为 39,419,767.62 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 1,311,867,369.41 元，第二层次

47,923,633.43 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至 2017 年 12 月 31 日止的财务状况和经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	891,483,003.21	93.74
	其中：股票	891,483,003.21	93.74
2	固定收益投资	230,200.00	0.02
	其中：债券	230,200.00	0.02
	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	57,738,876.52	6.07
7	其他各项资产	1,547,156.88	0.16
8	合计	950,999,236.61	100.00

8.2 报告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	1,665,090.00	0.18
B	采矿业	23,133,463.00	2.45
C	制造业	487,709,904.11	51.67
D	电力、热力、燃气及水生产和	22,424,653.25	2.38

	供应业		
E	建筑业	45,957,389.80	4.87
F	批发和零售业	31,857,694.00	3.37
G	交通运输、仓储和邮政业	29,500,053.67	3.13
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,336,916.47	2.26
J	金融业	150,656,617.62	15.96
K	房地产业	64,277,118.80	6.81
L	租赁和商务服务业	8,317,714.60	0.88
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	4,646,387.89	0.49
S	综合	—	—
	合计	891,483,003.21	94.44

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000725	京东方 A	5,377,100	31,133,409.00	3.30
2	000002	万科 A	800,900	24,875,954.00	2.64
3	000651	格力电器	490,100	21,417,370.00	2.27

4	601390	中国中铁	2,422,300	20,323,097.00	2.15
5	600522	中天科技	1,341,700	18,703,298.00	1.98
6	600016	民生银行	1,879,700	15,770,683.00	1.67
7	600519	贵州茅台	22,400	15,623,776.00	1.66
8	601998	中信银行	2,417,900	14,990,980.00	1.59
9	600015	华夏银行	1,658,700	14,928,300.00	1.58
10	601169	北京银行	2,066,504	14,775,503.60	1.57

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	601166	兴业银行	57,591,931.39	3.85
2	000651	格力电器	41,363,303.47	2.77
3	600016	民生银行	41,327,145.96	2.76
4	601390	中国中铁	40,300,066.05	2.69
5	601668	中国建筑	38,537,777.05	2.58
6	600015	华夏银行	38,517,190.02	2.58
7	601328	交通银行	36,400,055.73	2.43
8	000001	平安银行	35,908,725.69	2.40
9	000498	山东路桥	32,876,355.06	2.20
10	600522	中天科技	32,147,691.99	2.15
11	600104	上汽集团	30,713,381.92	2.05
12	600261	阳光照明	29,297,794.65	1.96
13	600900	长江电力	27,664,698.88	1.85
14	601169	北京银行	26,839,276.30	1.79
15	601238	广汽集团	25,832,584.91	1.73

16	600019	宝钢股份	25,726,977.43	1.72
17	601988	中国银行	25,304,162.00	1.69
18	000703	恒逸石化	24,632,628.90	1.65
19	002493	荣盛石化	24,235,307.22	1.62
20	000541	佛山照明	24,137,589.87	1.61

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	601166	兴业银行	60,932,588.99	4.07
2	601328	交通银行	49,452,635.36	3.31
3	600016	民生银行	42,428,605.35	2.84
4	601668	中国建筑	41,471,405.96	2.77
5	000498	山东路桥	41,093,519.18	2.75
6	600900	长江电力	39,140,595.94	2.62
7	600015	华夏银行	34,666,721.81	2.32
8	000001	平安银行	32,021,079.11	2.14
9	002081	金螳螂	30,520,688.88	2.04
10	600644	乐山电力	29,814,875.91	1.99
11	601238	广汽集团	28,942,596.43	1.94
12	601318	中国平安	28,719,095.34	1.92
13	600438	通威股份	28,295,229.08	1.89
14	601818	光大银行	28,148,062.00	1.88
15	002014	永新股份	28,128,401.89	1.88
16	600483	福能股份	27,965,863.08	1.87
17	600261	阳光照明	27,817,068.76	1.86

18	600104	上汽集团	27,257,509.27	1.82
19	600000	浦发银行	27,173,939.30	1.82
20	600213	亚星客车	26,728,702.83	1.79

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	6,383,095,656.03
卖出股票收入(成交)总额	6,850,004,151.64

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	-	-
	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(可交换债)	230,200.00	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	230,200.00	0.02

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

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	128029 SZ	太阳转债	2,302	230,200.00	0.02

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	258,912.35
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	14,176.26
5	应收申购款	1,274,068.27
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,547,156.88

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。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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	户均持有的	持有人结构
-------	-------	-------

(户)	基金份额	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 (%)
220,656	2,746.09	27,410,804.94	4.52	578,529,930.31	95.48

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	76,021.18	0.0125

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 (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	940,541,009.46
本报告期基金总申购份额	743,786,421.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,078,386,695.21
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	605,940,735.25

§ 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

2017 年 1 月 23 日南方基金管理有限公司第七届董事会第二次会议，审议通过秦长奎因任期届满，工作调整的原因不再担任公司副总经理职务。

2017 年 12 月 8 日南方基金管理股份有限公司（筹）第一届董事会第一次会议，审议通过聘任史博担任公司副总经理。

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 91,000.00 元。该审计机构已提供审计服务的连续年限为 7 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、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	
华泰证券	2	6,999,793,380.69	52.93%	6,404,854.72	52.99%	-

广发证券	1	4,652,732,256.35	35.18%	4,240,056.91	35.08%	—
银河证券	1	1,232,586,565.65	9.32%	1,133,144.31	9.37%	—
西藏东财	1	334,115,926.59	2.53%	304,474.52	2.52%	—
方正证券	1	5,796,734.35	0.04%	5,281.09	0.04%	—
万联证券	1	—	—%	—	—%	—
国信证券	1	—	—%	—	—%	—
华创证券	1	—	—%	—	—%	—

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。

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	成交金额	占当期债券回购成交总额的	成交金额	占当期权证成交总额的

		比例		比例		比例
方正证券	34,742.41	3.42%	—	—%	—	—%
广发证券	—	—%	—	—%	—	—%
国信证券	—	—%	—	—%	—	—%
华创证券	—	—%	—	—%	—	—%
华泰证券	244,067.94	24.02%	1,185,000,000.00	33.48%	—	—%
万联证券	—	—%	—	—%	—	—%
西藏东财	198,741.04	19.56%	484,000,000.00	13.68%	—	—%
银河证券	538,550.14	53.00%	1,870,000,000.00	52.84%	—	—%
方正证券	34,742.41	3.42%	—	—%	—	—%