# 南方恒元保本混合型证券投资基金2010年年度报告摘要

2010年12月31日

**基金管理人：南方基金管理有限公司**
**基金托管人：中国工商银行股份有限公司**
**报告送出日期：2011年3月29日**

## §1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2011年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2010年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 | 南方恒元保本混合 |
| 基金主代码 | 202211 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2008年11月12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 | 2,031,209,591.54 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“南方恒元”。

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金在严格控制风险的前提下，为投资者提供认购保本金额/申购保本金额的保证，并在此基础上力争基金资产的稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金资产配置策略分为两个层次：一层为对风险资产和无风险资产的配置，该层次以恒定比例组合保险策略为依据，即风险资产部分所能承受的损失最大不能超过无风险资产部分所产生的收益；另一层为对风险资产部分的配置策略。基金管理人将根据情况对这两个层次的策略进行调整。 |
| 业绩比较基准 | 3年期银行定期存款税后收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金为保本基金，属于证券投资基金中的低风险品种。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

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

2.4 信息披露方式

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

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2010年 | 2009年 | 2008年 |
|---|---|---|---|
| 本期已实现收益 | 345,582,166.96 | 131,247,065.94 | 4,563,558.26 |
| 本期利润 | 326,699,645.44 | 375,236,221.97 | 41,020,529.30 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.1314 | 0.1410 | 0.0180 |
| 本期基金份额净值增长率 | 12.28% | 13.47% | 1.80% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2010年末 | 2009年末 | 2008年末 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.1666 | 0.0311 | 0.0020 |
| 期末基金资产净值 | 2,542,953,859.69 | 3,093,772,128.23 | 2,475,239,544.24 |
| 期末基金份额净值 | 1.252 | 1.135 | 1.018 |

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 | 7.75% | 1.04% | 1.47% | 0.04% | 6.28% | 1.00% |
| 过去六个月 | 23.85% | 0.89% | 2.28% | 0.03% | 21.57% | 0.86% |
| 过去一年 | 12.28% | 0.95% | 3.90% | 0.02% | 8.38% | 0.93% |
| 自基金合同生效起至今 | 29.70% | 0.86% | 7.90% | 0.02% | 21.80% | 0.84% |

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

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

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 年度 | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 年度利润分配合计 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|
| 2010 | 0.2000 | 50,214,579.92 | - | 50,214,579.92 | |
| 2009 | 0.2000 | 55,098,535.10 | - | 55,098,535.10 | |
| 2008 | - | - | - | - | |
| 合计 | 0.4000 | 105,313,115.02 | - | 105,313,115.02 | |

## §4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

南方基金管理有限公司是经中国证监会证监基字〔1998〕4号文批准，由南方证券有限公司、厦门国际信托投资公司、广西信托投资公司共同发起设立。2000年，经中国证监会证监基金字〔2000〕78号文批准进行了增资扩股，注册资本达到1亿元人民币。2005年，经中国证监会证监基金字〔2005〕201号文批准进行增资扩股，注册资本达1.5亿元人民币。2010年，经证监许可〔2010〕1073号文核准深圳市机场（集团）有限公司将其持有的30%股权转让给深圳市投资控股有限公司。目前股权结构：华泰证券股份有限公司45%、深圳市投资控股有限公司30%、厦门国际信托有限公司15%及兴业证券股份有限公司10%。

截至报告期末，公司管理资产规模达1,800多亿元，管理2只封闭式基金——基金开元、基金天元；24只开放式基金——南方稳健成长基金、南方宝元债券型基金、南方避险增值基金、南方现金增利基金、南方积极配置基金、南方高增长基金、南方多利增强债券型基金、南方稳健成长贰号基金、南方绩优成长基金、南方成份精选基金、南方隆元产业主题基金、南方全球精选配置基金（QDII基金）、南方盛元红利股票型基金、南方优选价值股票型基金、南方恒元保本混合型基金、南方沪深300指数基金、南方中证500指数基金、深证成份交易型开放式指数基金、南方深证成份交易型开放式指数基金联接基金、南方策略优化股票型基金、中证南方小康产业交易型开放式指数基金、中证南方小康产业交易型开放式指数基金联接基金、南方广利回报债券型基金和南方金砖四国指数基金（QDII基金）；以及多个全国社保、企业年金和专户理财投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 蒋峰 | 本基金的基金经理 | 2008年11月12日 | - | 9 | 经济学博士，具有基金从业资格。曾任职于鹏华基金公司和宝盈基金公司，2003年11月至2006年11月，担任宝盈鸿阳证券投资基金经理。2007年加入南方基金，2007年6月至2010年12月，任南方避险基金经理；2008年1月至2009年2月，任南方宝元基金经理；2008年11月至今，任南方恒元基金经理，2010年10月至今，任南方盛元基金经理。 |

注：1、任职日期指基金合同生效日；

2、离职日期为根据公司决定确定的解聘日期；

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《南方恒元保本混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金管理人没有管理与本基金投资风格相似的其他投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2010年，中国经济克服种种不利因素，继续保持高速增长的态势。但A股市场受以房地产紧缩政策为核心的持续紧缩政策预期的困扰表现不佳，沪深300全年下跌12.5%。市场结构方面，小盘股在创业板投资热潮的带动下表现突出，中证500较沪深300的表现差异创出历史新高，行业分化严重，电子元器件、医药、食品饮料、机械、有色、建材等行业大幅跑赢市场，金融、地产、钢铁等行业受宏观调控的影响全年大幅跑输市场。

A股市场呈现“先抑后扬”的态势。2010年上半年，A股市场在房地产调控及欧洲债务危机等因素的综合影响下，出现震荡下行的走势，沪深300下跌28%。从行业走势看，TMT板块、医药、食品饮料、农林牧渔等行业超额收益显著，黑色金属、煤炭、房地产、金融等受宏观调控预期的影响跑输大盘。上游投资品行业在对宏观经济看淡的预期下领先杀跌，随后下游行业和估值水平过高的中小盘股也难以支撑，纷纷出现了大幅调整的走势。债市在配置资金的推动下震荡走高，收益率水平小幅下降。

2010年下半年，A股市场在宏观政策预期逐步稳定和外部继续数量化宽松的影响下，市场震荡上行，沪深300上涨22%。三季度下游行业和中小盘股的升幅继续领先，而大股票在流动性尚不宽松的背景下只有部分行业中的个股出现比较明显的趋势。11月起市场风格转换的趋势逐渐酝酿，上游行业和中大盘股表现趋好，而前期部分涨幅较大、估值较高的板块相对受到一定压制。

2010年第1季度，本基金坚持在风险可控的前提下倚重股票市场的波段性操作来提高基金收益水平的思路，根据对市场的趋势判断，适度减持了金融、地产等受宏观政策收紧预期影响较大的行业的配置，自下而上地增持了部分1季报预期较好且估值水平收缩并不明显的个股。第2季度，我们虽然减低了受宏观政策收紧预期影响较大的周期性行业的配置，但市场悲观情绪所引发的调整使本基金录得了一定的净值减少，但我们仍通过自下而上地增持了部分稳定成长的个股，为随后出现的上涨过程中取得收益奠定了基础。2010年下半年，在“防守垫”得到快速改善的背景下，本基金迅速提高了权益类资产的配置比例，坚持自下而上的选股思路，并加大了主动操作的力度取得了较好的投资效果。由于所持股票在震荡向上的市场中获得了很好的上涨，特别是双汇发展和攀钢钒钛续复牌，下半年净值增长获得了较好的改善。在保本周期的第二年，在风险适度的原则下，本基金录得的净值增长率显著地战胜了三年期定期存款利率，基本实现了为基金持有人战胜通货膨胀的目标，并在此基础上努力寻找机会，提高收益水平，为基金持有人创造一个有竞争力的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2010年12月31日，本基金净值为1.252元，2010年度的净值增长率为12.28%，显著超越了3年期银行定期存款的收益水平。2010年9月，本基金已向基金持有人按每10份分红0.200元。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2011年，通货膨胀成为宏观经济和股市关注的主要问题。在关注民生和经济结构转型的政策逻辑下，防通胀逐渐成为政策主基调，对应的紧缩政策力度和节奏也成为左右市场走势十分重要的因素。由于政府采取措施增加供给，控制信贷，同时调整利率、准备金率、汇率抑制通胀预期，总需求有望呈现平稳回落的态势。就上半年而言，一、二月份可能是全年通胀的阶段性高点，同时也可能是全年政策密集度和叠加效应最为严厉的阶段。我们预计CPI有可能走出前高后低的走势，政策紧缩的基调也会随着通胀的回落而逐步放缓。货币政策步调会紧盯CPI来制定，为确保完成全年CPI控制在4%以内，在全年个别月份CPI冲高时，不排除继续采取加息等紧缩手段。

结合当前的估值水平，我们认为2011年的A股整体上走出震荡上行的可能性大。主要原因包括：（1）宏观经济继续保持快速增长，通胀可控的前提下，政策紧缩步伐或逐步放缓。但紧缩政策的力度和进度持续超预期将成为市场潜在的较大风险。（2）从流动性上看，由于资产配置效应，空前严厉的房地产紧缩政策或会导致部分原先投资于房地产的资金回流股市，同时考虑外汇占款的增加，边际资金的启动也会产生一定的杠杆效应，助推股市流动性。（3）从市场估值水平看，目前A股估值水平处于历史中低水平。过去一年多来，饱受金融危机摧残的发达国家股市复苏迹象明显，而我国快速发展的经济形势与股市的低迷形成强烈反差，因此，A股估值修复仍有空间。（4）企业盈利增长对A股市场形成较好的支撑，时间的推移对于消费、商业、医药等稳定成长行业的震荡向上是有利的，我们密切关注稳定增长类行业的配置机会。

去年以来中小股票飞涨，中证500相对沪深300屡创历史新高，从价值回归的角度，我们认为至少在上半年市场风格转换是大概率事件，低估值、涨幅小的蓝筹股值得特别关注。市场在一定区间内保持板块轮动的可能性大，在上涨初期，强周期的有色、煤炭、证券等行业跑赢市场的概率较大，利润稳定增长且估值偏低的汽车、家电、建材等行业也可能有较大的机会。同时，在劳动力成本持续上涨，经济增长方式转型的大背景下，我们持续看好中国优势制造业，如高铁、机械设备、电力设备、通讯设备等行业。上半年在通货膨胀的大背景下，上游资源类行业和一些定价能力强的企业值得重点关注。

本基金此轮保本周期将在2011年11月到期。由于本轮保本期限渐行渐近，为满足广大低风险投资者的风险收益需求，本基金于2011年2月25日暂停申购。随着本基金保本期限的逐步临近，我们有可能逐步转向谨慎，如果市场超越我们预期大幅上涨，本基金在2011年亦可能出现收益水平并不具有竞争力的风险，提请投资者关注。当然，我们将始终坚持根据市场变化调整资产结构，并力图捕捉可能的机会提高整体收益水平，争取使我们的三年综合回报满足低风险投资者的要求。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括督察长、数量化投资部总监、监察稽核总监及基金会计负责人等。其中，超过三分之二以上的人员具有10年以上的基金从业经验，且具有风控、合规、会计方面的专业经验。同时，根据基金管理公司制订的相关制度，负责估值工作决策和执行的机构成员中不包括基金经理。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，本基金的收益分配原则为：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6次，全年分配比例不得低于年度可供分配收益的20%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；本基金仅采取现金分红一种收益分配方式，不进行红利再投资；基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述收益分配原则，本基金本报告期按照基金合同约定分红比例计算的应分配金额为77,725,100.82元。本基金于2010年9月3日和2011年1月13日进行了收益分配，每10份合计派0.336元。

## §5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2010年，本基金托管人在对南方恒元保本混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2010年，南方恒元保本混合型证券投资基金的管理人——南方基金管理有限公司在南方恒元保本混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，南方恒元保本混合型证券投资基金对基金份额持有人进行了一次利润分配，分配金额为50,214,579.92元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对南方基金管理有限公司编制和披露的南方恒元保本混合型证券投资基金2010年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## §6 审计报告

本基金2010年年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所有限公司审计，注册会计师签字出具了普华永道中天审字（2011）第20319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：南方恒元保本混合型证券投资基金
报告截止日：2010年12月31日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末<br>2010年12月31日 | 上年度末<br>2009年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 13,484,913.77 | 21,773,525.06 |
| 结算备付金 | | 2,933,760.14 | 6,901,358.88 |
| 存出保证金 | | 1,218,884.19 | 2,187,638.52 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 2,503,769,076.95 | 3,020,991,190.84 |
| 其中：股票投资 | | 1,547,332,754.44 | 2,068,518,470.82 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 956,436,322.51 | 952,472,720.02 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 7.4.7.3 | - | 45,550,000.00 |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | 33,902,163.25 | - |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 11,200,414.55 | 7,578,369.91 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 1,510,367.72 | 2,809,951.46 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 2,568,019,580.57 | 3,107,792,034.67 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末<br>2010年12月31日 | 上年度末<br>2009年12月31日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 7.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | 18,073,730.25 | - |
| 应付赎回款 | | 1,477,440.12 | 8,731,052.65 |
| 应付管理人报酬 | | 2,811,931.30 | 3,440,367.21 |
| 应付托管费 | | 432,604.81 | 529,287.27 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 2,056,500.11 | 981,060.90 |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 213,514.29 | 338,138.41 |
| 负债合计 | | 25,065,720.88 | 14,019,906.44 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 2,031,209,591.54 | 2,726,893,841.64 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | 511,744,268.15 | 366,878,286.59 |
| 所有者权益合计 | | 2,542,953,859.69 | 3,093,772,128.23 |
| 负债和所有者权益总计 | | 2,568,019,580.57 | 3,107,792,034.67 |

注：报告截止日2010年12月31日，基金份额净值1.252元，基金份额总额2,031,209,591.54份。

7.2 利润表

会计主体：南方恒元保本混合型证券投资基金
本报告期：2010年1月1日 至 2010年12月31日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期<br>2010年1月1日至2010年12月31日 | 上年度可比期间<br>2009年1月1日至2009年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 一、收入 | | 383,606,502.41 | 432,857,551.07 |
| 1.利息收入 | | 23,375,331.48 | 42,993,204.83 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 526,230.45 | 1,159,732.09 |
| 债券利息收入 | | 22,773,428.84 | 41,833,472.74 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 75,672.19 | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 373,426,578.06 | 138,030,559.72 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.12 | 364,387,698.11 | 136,622,596.74 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | -1,795,999.74 | -9,478,695.71 |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.14 | - | - |
| 股利收益 | 7.4.7.15 | 10,834,879.69 | 10,886,658.69 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.16 | -18,882,521.52 | 243,989,156.03 |
| 4. 汇兑收益（损失以"-"号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17 | 5,687,114.39 | 7,844,630.49 |
| 减：二、费用 | | 56,906,856.97 | 57,621,329.10 |
| 1.管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 36,524,477.16 | 36,924,662.51 |
| 2.托管费 | 7.4.10.2.2 | 5,619,150.36 | 5,680,717.29 |
| 3.销售服务费 | | - | - |
| 4.交易费用 | 7.4.7.18 | 13,652,555.58 | 12,512,453.10 |
| 5.利息支出 | | 693,328.17 | 2,067,558.62 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 693,328.17 | 2,067,558.62 |
| 6.其他费用 | 7.4.7.19 | 417,345.70 | 435,937.58 |
| 三、利润总额 | | 326,699,645.44 | 375,236,221.97 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 326,699,645.44 | 375,236,221.97 |

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方恒元保本混合型证券投资基金
本报告期：2010年1月1日 至 2010年12月31日

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2010年1月1日至2010年12月31日 | | |
|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 2,726,893,841.64 | 366,878,286.59 | 3,093,772,128.23 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 326,699,645.44 | 326,699,645.44 |
| 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） | -695,684,250.10 | -131,619,083.96 | -827,303,334.06 |
| 其中：1.基金申购款 | 443,672,382.05 | 51,056,034.36 | 494,728,416.41 |
| 2.基金赎回款 | -1,139,356,632.15 | -182,675,118.32 | -1,322,031,750.47 |
| 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） | - | -50,214,579.92 | -50,214,579.92 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 2,031,209,591.54 | 511,744,268.15 | 2,542,953,859.69 |
| 项目 | 上年度可比期间<br>2009年1月1日至2009年12月31日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 2,431,502,854.54 | 43,736,689.70 | 2,475,239,544.24 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 375,236,221.97 | 375,236,221.97 |
| 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） | 295,390,987.10 | 3,003,910.02 | 298,394,897.12 |
| 其中：1.基金申购款 | 1,735,587,031.96 | 127,729,727.77 | 1,863,316,759.73 |
| 2.基金赎回款 | -1,440,196,044.86 | -124,725,817.75 | -1,564,921,862.61 |
| 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） | - | -55,098,535.10 | -55,098,535.10 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 2,726,893,841.64 | 366,878,286.59 | 3,093,772,128.23 |

注：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：

| 高良玉 | 鲍文革 | 鲍文革 |
|---|---|---|
| 基金管理公司负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

7.4 报表附注

7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告完全一致。

7.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.2.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.2.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.2.3 差错更正的说明

无。

7.4.3 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---|---|
| 南方基金管理有限公司（“南方基金公司”） | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”） | 基金托管人、基金代销机构 |
| 华泰证券股份有限公司（“华泰证券”） | 基金管理人的股东、基金代销机构 |
| 兴业证券股份有限公司（“兴业证券”） | 基金管理人的股东、基金代销机构 |
| 厦门国际信托有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 深圳市投资控股有限公司（1） | 基金管理人的股东（2010年9月10日起） |
| 深圳市机场（集团）有限公司（1） | 基金管理人的原股东（2010年9月10日前） |

注：（1）根据基金管理人南方基金公司2009年第一次临时股东会会议决议以及中国证监会证监许可〔2010〕1073号《关于核准南方基金管理有限公司变更股权的批复》核准，深圳市投资控股有限公司受让深圳市机场（集团）有限公司持有的南方基金公司30%的股权，南方基金公司于2010年9月10日完成了工商登记变更手续。

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2010年1月1日至2010年12月31日 | | 上年度可比期间<br>2009年1月1日至2009年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例（%） | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例（%） |
| 华泰证券 | 239,574,944.72 | 2.76 | 608,321,313.90 | 6.99 |
| 兴业证券 | 340,012,444.55 | 3.92 | 521,626,738.41 | 5.99 |

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<br>2010年1月1日至2010年12月31日 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例（%） | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例（%） |
| 华泰证券 | 203,638.36 | 2.55 | 105,395.30 | 5.13 |
| 兴业证券 | 276,262.13 | 3.46 | 135,029.05 | 6.58 |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2009年1月1日至2009年12月31日 | | | |
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例（%） | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例（%） |
| 华泰证券 | 507,978.50 | 6.99 | - | - |
| 兴业证券 | 423,826.99 | 5.83 | 8,301.75 | 0.85 |

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

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

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2010年1月1日至2010年12月31日 | 上年度可比期间<br>2009年1月1日至2009年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 36,524,477.16 | 36,924,662.51 |
| 其中：支付给销售机构的客户维护费 | 4,618,132.31 | 4,485,880.64 |

注：支付基金管理人南方基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.3%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 1.3% / 当年天数。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2010年1月1日至2010年12月31日 | 上年度可比期间<br>2009年1月1日至2009年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 5,619,150.36 | 5,680,717.29 |

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0.2%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 0.2% / 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

单位：人民币元

| 银行间市场交易的各关联方名称 | 本期<br>2010年1月1日至2010年12月31日 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 中国工商银行 | - | - | - | - | 1,198,310,070.00 | 300,613.27 |
| 银行间市场交易的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2009年1月1日至2009年12月31日 | | | | | |
| | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 中国工商银行 | - | 50,169,426.58 | - | - | 1,800,016,500.00 | 346,995.81 |

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

注：无。

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<br>2010年1月1日至2010年12月31日 | | 上年度可比期间<br>2009年1月1日至2009年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国工商银行 | 13,484,913.77 | 467,187.81 | 21,773,525.06 | 1,038,643.61 |

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：无。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.5 期末（2010年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 7.4.12.1.1 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 |
| 601118 | 海南橡胶 | 10/12/30 | 11/04/07 | 网下申购 | 5.99 | 5.99 | 939,053 | 5,624,927.47 | 5,624,927.47 | - |
| 601933 | 永辉超市 | 10/12/09 | 11/03/15 | 网下申购 | 23.98 | 31.24 | 69,252 | 1,660,662.96 | 2,163,432.48 | - |
| 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 |
| 7.4.12.1.3 受限证券类别：权证 | | | | | | | | | | |
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量（单位：份） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 038011 | 攀钢AGP1 | 09/05/06 | 11/04/25 | 非上市交易认沽权证 | - | - | 20,000,000.00 | - | - | - |

注：1. 攀钢AGP1的可流通日为行权起始日，行权期为2011年4月25日至2011年4月29日。

2. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 600518 | 康美药业 | 10/12/28 | 配股停牌 | 19.71 | 11/01/06 | 17.29 | 3,298,002 | 60,267,998.63 | 65,003,619.42 | - |

注：本基金截至2010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

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 | 1,547,332,754.44 | 60.25 |
| | 其中：股票 | 1,547,332,754.44 | 60.25 |
| 2 | 固定收益投资 | 956,436,322.51 | 37.24 |
| | 其中：债券 | 956,436,322.51 | 37.24 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 4 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 5 | 银行存款和结算备付金合计 | 16,418,673.91 | 0.64 |
| 6 | 其他各项资产 | 47,831,829.71 | 1.86 |
| 7 | 合计 | 2,568,019,580.57 | 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 | 5,624,927.47 | 0.22 |
| B | 采掘业 | 52,605,000.00 | 2.07 |
| C | 制造业 | 1,048,488,475.19 | 41.23 |
| C0 | 食品、饮料 | 201,320,786.05 | 7.92 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | - | - |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 造纸、印刷 | - | - |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | - | - |
| C5 | 电子 | - | - |
| C6 | 金属、非金属 | 406,313,060.56 | 15.98 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 375,851,009.16 | 14.78 |
| C8 | 医药、生物制品 | 65,003,619.42 | 2.56 |
| C99 | 其他制造业 | - | - |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 51,154,832.05 | 2.01 |
| E | 建筑业 | 23,200,000.00 | 0.91 |
| F | 交通运输、仓储业 | - | - |
| G | 信息技术业 | 77,677,725.54 | 3.05 |
| H | 批发和零售贸易 | 2,163,432.48 | 0.09 |
| I | 金融、保险业 | 82,382,226.82 | 3.24 |
| J | 房地产业 | 79,750,017.25 | 3.14 |
| K | 社会服务业 | - | - |
| L | 传播与文化产业 | 31,427,342.40 | 1.24 |
| M | 综合类 | 92,858,775.24 | 3.65 |
| | 合计 | 1,547,332,754.44 | 60.85 |

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 | 000629 | *ST钒钛 | 20,000,000 | 230,800,000.00 | 9.08 |
| 2 | 000425 | 徐工机械 | 1,942,546 | 111,113,631.20 | 4.37 |
| 3 | 000400 | 许继电气 | 3,048,498 | 101,454,013.44 | 3.99 |
| 4 | 600805 | 悦达投资 | 6,347,148 | 92,858,775.24 | 3.65 |
| 5 | 000895 | 双汇发展 | 919,802 | 80,022,774.00 | 3.15 |
| 6 | 600406 | 国电南瑞 | 1,077,959 | 77,677,725.54 | 3.05 |
| 7 | 600518 | 康美药业 | 3,298,002 | 65,003,619.42 | 2.56 |
| 8 | 600585 | 海螺水泥 | 2,116,542 | 62,818,966.56 | 2.47 |
| 9 | 000712 | 锦龙股份 | 2,931,509 | 51,154,832.05 | 2.01 |
| 10 | 000581 | 威孚高科 | 1,320,379 | 49,052,079.85 | 1.93 |

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 | 600519 | 贵州茅台 | 165,077,099.63 | 5.34 |
| 2 | 601166 | 兴业银行 | 147,061,900.29 | 4.75 |
| 3 | 000400 | 许继电气 | 112,273,788.53 | 3.63 |
| 4 | 600395 | 盘江股份 | 101,533,867.91 | 3.28 |
| 5 | 000425 | 徐工机械 | 98,775,177.26 | 3.19 |
| 6 | 002048 | 宁波华翔 | 84,450,638.19 | 2.73 |
| 7 | 600805 | 悦达投资 | 84,193,513.29 | 2.72 |
| 8 | 000933 | 神火股份 | 82,197,929.04 | 2.66 |
| 9 | 600031 | 三一重工 | 77,228,411.51 | 2.50 |
| 10 | 600406 | 国电南瑞 | 74,677,125.77 | 2.41 |
| 11 | 600518 | 康美药业 | 74,007,191.88 | 2.39 |
| 12 | 600547 | 山东黄金 | 69,922,956.56 | 2.26 |
| 13 | 002238 | 天威视讯 | 68,359,227.38 | 2.21 |
| 14 | 600312 | 平高电气 | 62,914,391.98 | 2.03 |
| 15 | 000895 | 双汇发展 | 62,487,365.71 | 2.02 |
| 16 | 000581 | 威孚高科 | 61,797,139.21 | 2.00 |
| 17 | 600000 | 浦发银行 | 61,772,121.23 | 2.00 |
| 18 | 000712 | 锦龙股份 | 61,354,627.53 | 1.98 |
| 19 | 000839 | 中信国安 | 59,839,461.83 | 1.93 |
| 20 | 600416 | 湘电股份 | 54,538,476.74 | 1.76 |

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 | 600519 | 贵州茅台 | 261,139,655.45 | 8.44 |
| 2 | 600406 | 国电南瑞 | 219,925,383.16 | 7.11 |
| 3 | 600031 | 三一重工 | 143,031,672.13 | 4.62 |
| 4 | 601166 | 兴业银行 | 137,038,068.63 | 4.43 |
| 5 | 600132 | 重庆啤酒 | 107,975,736.62 | 3.49 |
| 6 | 000425 | 徐工机械 | 97,652,990.90 | 3.16 |
| 7 | 600547 | 山东黄金 | 89,613,791.92 | 2.90 |
| 8 | 600805 | 悦达投资 | 86,179,017.11 | 2.79 |
| 9 | 002048 | 宁波华翔 | 82,780,791.96 | 2.68 |
| 10 | 600395 | 盘江股份 | 79,744,165.05 | 2.58 |
| 11 | 600159 | 大龙地产 | 79,415,421.58 | 2.57 |
| 12 | 000933 | 神火股份 | 74,174,554.85 | 2.40 |
| 13 | 002269 | 美邦服饰 | 72,698,205.10 | 2.35 |
| 14 | 002154 | 报喜鸟 | 71,142,716.84 | 2.30 |
| 15 | 601169 | 北京银行 | 65,314,582.70 | 2.11 |
| 16 | 600256 | 广汇股份 | 64,394,911.03 | 2.08 |
| 17 | 600739 | 辽宁成大 | 62,515,193.23 | 2.02 |
| 18 | 600000 | 浦发银行 | 61,796,981.61 | 2.00 |
| 19 | 600660 | 福耀玻璃 | 60,965,682.82 | 1.97 |
| 20 | 600019 | 宝钢股份 | 59,057,248.71 | 1.91 |

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 | 3,890,858,270.70 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 4,798,652,214.31 |

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 | 246,955,000.00 | 9.71 |
| 3 | 金融债券 | 258,407,000.00 | 10.16 |
| | 其中：政策性金融债 | 258,407,000.00 | 10.16 |
| 4 | 企业债券 | 451,074,322.51 | 17.74 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 可转债 | - | - |
| N-1 | 其他 | - | - |
| N | 合计 | 956,436,322.51 | 37.61 |

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

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 | 080221 | 08国开21 | 1,600,000 | 158,032,000.00 | 6.21 |
| 2 | 1001060 | 10央票60 | 1,500,000 | 146,565,000.00 | 5.76 |
| 3 | 0801047 | 08央行票据47 | 1,000,000 | 100,390,000.00 | 3.95 |
| 4 | 126012 | 08上港债 | 833,830 | 82,999,438.20 | 3.26 |
| 5 | 126014 | 08国电债 | 900,480 | 79,215,225.60 | 3.12 |

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 权证代码 | 权证名称 | 数量（份） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 038011 | 攀钢AGP1 | 20,000,000 | - | - |

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 1,218,884.19 |
| 2 | 应收证券清算款 | 33,902,163.25 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 11,200,414.55 |
| 5 | 应收申购款 | 1,510,367.72 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 47,831,829.71 |

8.9.4 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。

8.9.5 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 | 600518 | 康美药业 | 65,003,619.42 | 2.56 | 配股停牌 |

## §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 |
| 25,922 | 78,358.52 | 13,635,244.45 | 0.67% | 2,017,574,347.09 | 99.33% |

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

| 项目 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|---|---|---|
| 基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金 | 289,587.66 | 0.0143% |

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---|---|
| 基金合同生效日（2008年11月12日）基金份额总额 | 2,210,560,398.03 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 2,726,893,841.64 |
| 本报告期基金总申购份额 | 443,672,382.05 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 1,139,356,632.15 |
| 本报告期期末基金份额总额 | 2,031,209,591.54 |

## §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

本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门在本报告期内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

2009年6月18日，中国国际经济贸易仲裁委员会向我公司送达通知，南方稳健成长贰号证券投资基金的基金份额持有人袁近秋就该基金2007年度的基金分红问题，对我公司提出了仲裁申请，要求本公司赔偿其红利损失及相应利息共计66586.52元，退还管理费2041.49元，争议标的总额为人民币68628.01元。

2010年3月26日，中国国际经济贸易仲裁委员会向我公司送达（2010）中国贸仲京裁字第0152号《裁决书》，驳回申请人袁近秋的赔偿请求，具体裁决如下：（一）被申请人应向南方稳健成长贰号证券投资基金退还管理费计人民币702.71元。（二）本案仲裁费为人民币5011元，由申请人承担人民币1002.20元，由被申请人承担人民币4008.80元。（三）驳回申请人的其他仲裁请求。

2010年10月28日，北京市第一中级人民法院向我公司送达通知，袁近秋向该院申请撤销中国国际经济贸易仲裁委员会于2010年3月25日作出的（2010）中国贸仲京裁字第0152号仲裁裁决。

2010年12月7日，经审理，北京市第一中级人民法院向我公司送达（2010）一中民特字第16746号《民事裁定书》，具体裁定如下：

驳回袁近秋提出的撤销中国国际经济贸易仲裁委员会作出的（2010）中国贸仲京裁字第0152号仲裁裁决的申请。

案件受理费四百元，由袁近秋负担。

本裁定为终审裁定。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金基金合同生效日为2008年11月12日，聘请的事务所为普华永道中天会计师事务所有限公司。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有限公司审计费用100,000.00元。该审计机构已提供审计服务的连续年限为2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 | |
| 光大证券 | 1 | 1,570,307,778.54 | 18.10% | 1,334,751.27 | 18.38% | - |
| 国信证券 | 2 | 1,558,383,586.33 | 17.97% | 1,284,153.44 | 17.68% | |
| 中投证券 | 1 | 1,085,567,647.72 | 12.51% | 922,725.35 | 12.70% | |
| 平安证券 | 2 | 1,033,312,662.65 | 11.91% | 858,527.09 | 11.82% | |
| 长江证券 | 1 | 803,344,868.64 | 9.26% | 683,481.35 | 9.41% | |
| 广发证券 | 1 | 799,193,835.56 | 9.21% | 649,350.03 | 8.94% | |
| 中银国际 | 1 | 584,268,492.10 | 6.74% | 496,627.14 | 6.84% | - |
| 兴业证券 | 1 | 340,012,444.55 | 3.92% | 276,262.13 | 3.80% | |
| 申银万国 | 2 | 267,602,784.26 | 3.09% | 226,390.90 | 3.12% | |
| 华泰证券 | 2 | 239,574,944.72 | 2.76% | 203,638.36 | 2.80% | |
| 方正证券 | 1 | 193,445,736.60 | 2.23% | 164,429.23 | 2.26% | |
| 湘财证券 | 1 | 154,851,255.91 | 1.79% | 125,818.44 | 1.73% | |
| 国泰君安 | 2 | 44,412,295.75 | 0.51% | 37,750.48 | 0.52% | |
| 中信建投 | 2 | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 1 | - | - | - | - | - |

注：为节约交易单元资源，我公司在交易所交易系统升级的基础上，对同一银行托管基金进行了席位整合。

本基金本报告期租用证券公司交易单元情况如下：专用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。