# 南方现金增利基金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01月01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 | 南方现金增利货币 | |
| 基金主代码 | 202301 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2004年3月5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 | 10,574,608,587.57 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称: | 南方现金增利货币A | 南方现金增利货币B |
| 下属分级基金的交易代码: | 202301 | 202302 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 5,220,195,209.84 | 5,354,413,377.73 |

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“南方现金”。

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金为具有高流动性、低风险和稳定收益的短期金融市场基金,在控制风险的前提下,力争为投资者提供稳定的收益。 |
| 投资策略 | 南方现金增利基金以“保持资产充分流动性,获取稳定收益”为资产配置目标,在战略资产配置上,主要采取利率走势预期与组合久期控制相结合的策略,在战术资产操作上,主要采取滚动投资、关键时期的时机抉择策略,并结合市场环境适时进行回购套利等操作。 |
| 业绩比较基准 | 本基金基准收益率=1年期银行定期存款收益率(税后)(至2008年8月26日)<br>本基金基准收益率=同期7天通知存款利率(税后)(自2008年8月27日起) |

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 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 南方现金增利货币A | 南方现金增利货币B | 南方现金增利货币A | 南方现金增利货币B | 南方现金增利货币A | 南方现金增利货币B |
| 本期已实现收益 | 91,895,825.53 | 82,739,736.65 | 163,751,344.65 | 23,992,235.82 | 392,447,813.87 | - |
| 本期利润 | 91,895,825.53 | 82,739,736.65 | 163,751,344.65 | 23,992,235.82 | 392,447,813.87 | - |
| 本期净值收益率 | 2.1458% | 2.3907% | 1.7435% | 1.0266% | 3.9326% | - |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2010 年 | | 2009 年 | | 2008 年 | |
| 期末基金资产净值 | 5,220,195,209.84 | 5,354,413,377.73 | 3,877,973,366.08 | 2,507,751,726.44 | 23,786,696,000.75 | - |
| 期末基金份额净值 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 | - |

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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2.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基金表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方现金增利货币A

| 阶段 | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差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 | 0.7127% | 0.0053% | 0.3456% | 0.0000% | 0.3671% | 0.0053% |
| 过去六个月 | 1.2931% | 0.0046% | 0.6924% | 0.0000% | 0.6008% | 0.0046% |
| 过去一年 | 2.1458% | 0.0039% | 1.3781% | 0.0000% | 0.7677% | 0.0039% |
| 过去三年 | 8.0541% | 0.0100% | 5.9689% | 0.0029% | 2.0852% | 0.0071% |
| 过去五年 | 13.7721% | 0.0082% | 10.9509% | 0.0025% | 2.8211% | 0.0056% |
| 自基金合同生效起至今 | 19.0927% | 0.0071% | 14.4997% | 0.0022% | 4.5931% | 0.0049% |

南方现金增利货币B

| 阶段 | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差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 | 0.7734% | 0.0053% | 0.3456% | 0.0000% | 0.4278% | 0.0053% |
| 过去六个月 | 1.4153% | 0.0046% | 0.6924% | 0.0000% | 0.7230% | 0.0046% |
| 过去一年 | 2.3907% | 0.0039% | 1.3781% | 0.0000% | 1.0126% | 0.0039% |
| 自基金合同生效起至今 | 3.4417% | 0.0062% | 1.9922% | 0.0000% | 1.4495% | 0.0062% |

注:本基金收益分配为按月结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金基准收益率=1年期银行定期存款收益率(税后)(至2008年8月26日)
本基金基准收益率=同期7天通知存款利率(税后)(自2008年8月27日起)

3.2.3 过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

| 南方现金增利货币A | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 年度 | 已按再投资形式转实收基金 | 直接通过应付赎回款转出金额 | 应付利润本年变动 | 年度利润分配合计 | 备注 |
| 2010年 | 74,897,365.12 | 12,357,706.26 | 4,640,754.15 | 91,895,825.53 | 注:本期分红十二次 |
| 2009年 | 184,874,849.23 | 27,683,198.26 | -48,806,702.84 | 163,751,344.65 | 注:本期分红十二次 |
| 2008年 | 313,202,983.99 | 35,032,167.12 | 44,212,662.76 | 392,447,813.87 | 注:本期分红十二次 |
| 合计 | 572,975,198.34 | 75,073,071.64 | 46,714.07 | 648,094,984.05 | |
| 南方现金增利货币B | | | | | |
| 年度 | 已按再投资形式转实收基金 | 直接通过应付赎回款转出金额 | 应付利润本年变动 | 年度利润分配合计 | 备注 |
| 2010年 | 72,374,365.98 | 6,202,416.55 | 4,162,954.12 | 82,739,736.65 | 注:本期分红十二次 |
| 2009年 | 21,389,966.70 | 414,245.99 | 2,188,023.13 | 23,992,235.82 | 注:本期分红五次 |
| 合计 | 93,764,332.68 | 6,616,662.54 | 6,350,977.25 | 106,731,972.47 | |

## §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 | | |
| 韩亚庆 | 本基金基金经理、固定收益部副总监 | 2008年11月11日 | - | 10 | 经济学硕士,具有基金从业资格。2000年开始从事固定收益类证券承销、研究与投资管理,曾任职于国家开发银行资金局、全国社会保障基金理事会投资部。2008年加入南方基金,2010年5月至今,担任固定收益部副总监;2008年11月至今,任南方现金基金经理;2010年11月至今,任南方广利基金经理。 |

注:1.此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日。

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、《南方现金增利基金基金合同》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

注: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,随着通胀自9月份起逐步走高、经济环比趋势的改善,央行自四季度起紧缩力度开始不断加大,特别是10月20日起的加息和存款准备金率的不断上调,货币市场收益率也开始经历系统性的上升,自之前的2%-2.10%的水平快速上升到年末3.40%-3.50%的水平,相关债券产品全年也呈现出前三季度稳定,四季度快速上升的特点。本基金在前三季度维持了较高的久期和仓位,获取了较好收益;第四季度,基金进行了减仓和久期调整,并积极布局了浮息债券。全年来看,基金在类属配置方面的工作较为出色,始终选择具有超额收益的资产类别进行重配,并运用多策略提高基金收益,但对四季度的加息准备不够,加息之后则进行了快速调整并积极获取新的市场机会。全年本基金依然坚持“稳健有序、积极主动”的投资风格,给基金投资者特别是长期持有本基金的投资者带来了较好回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期A级基金净值收益率为2.1458%,同期业绩比较基准收益率为1.3781%。B级基金净值收益率为2.3907%,同期业绩比较基准收益率为1.3781%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从经济政策对经济运行和资本市场的影响关系看,政策对经济运行周期的改变愈加迅速,而由于政策的出台动机、时机、程度和持续性具有易变性,这加大了经济运行的小周期性和不确定性。回顾2008年以来的全球及国内政策,这一形势和趋势都很明确。从国内经济看,货币政策、房产政策的力度已较大,在避免经济过热的同时,对总需求的抑制作用将逐步显现。因此,政策可能是前紧后松,而经济会有阶段性的回落但总体将平稳增长。从全年看,这一政策取向会使债券收益率处于高位的时间较长,既不会有明显的上升动力,也难以出现大幅的下降。我们仍需结合通胀、经济增长的变动趋势判断政策走向,最终作用于投资。在分析货币市场主要产品的收益率水平后,我们认为今年是2008年之后投资货币基金的好年份,因为主要产品的收益水平已处于相对高位,基金的运作空间也较大。因此,本基金将以久期管理为核心、以类属管理为重点,把握好市场趋势并获取各类产品阶段性的高收益,争取全年为投资者获取合理回报。

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

根据本基金合同约定,本基金的收益分配采取“每日分配、按月支付”的方式,即根据每日基金收益公告,以每万份基金单位收益为基准,为投资者每日计算当日收益并分配,每月集中以红利再投资方式支付收益。本报告期内应分配收益174,635,562.18元,实际分配收益174,635,562.18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现金增利基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关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,南方现金增利基金基金的管理人——南方基金管理有限公司在南方现金增利基金的投资运作、每万份基金净收益和7日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上,严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

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现金增利基金2010年年度报告中财务指标、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

本基金本报告期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20308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察看审计报告全文。

## §7 年度财务报表

7.1资产负债表
会计主体:南方现金增利基金
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 | | 2,106,919,176.39 | 1,604,830,111.95 |
| 结算备付金 | | 3,014,090.91 | 23,641,904.76 |
| 存出保证金 | | 250,000.00 | 250,000.00 |
| 交易性金融资产 | | 5,918,918,273.28 | 4,054,868,856.94 |
| 其中:股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 5,858,918,273.28 | 3,994,868,856.94 |
| 资产支持证券投资 | | 60,000,000.00 | 60,000,000.00 |
| 衍生金融资产 | | - | - |
| 买入返售金融资产 | | 2,489,425,694.13 | 680,121,380.18 |
| 应收证券清算款 | | - | - |
| 应收利息 | | 75,024,739.19 | 31,431,847.45 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 295,113.21 | 7,100.00 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | | 30,000.00 | - |
| 资产总计 | | 10,593,877,087.11 | 6,395,151,201.28 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期期末<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 | | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 324,857.01 | 609,560.89 |
| 应付管理人报酬 | | 2,449,101.87 | 1,700,579.62 |
| 应付托管费 | | 742,152.09 | 515,327.14 |
| 应付销售服务费 | | 1,126,202.29 | 828,716.21 |
| 应付交易费用 | | 74,685.68 | 42,439.48 |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | 14,061,537.88 | 5,257,829.61 |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | | 489,962.72 | 471,655.81 |
| 负债合计 | | 19,268,499.54 | 9,426,108.76 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | | 10,574,608,587.57 | 6,385,725,092.52 |
| 未分配利润 | | - | - |
| 所有者权益合计 | | 10,574,608,587.57 | 6,385,725,092.52 |
| 负债和所有者权益总计 | | 10,593,877,087.11 | 6,395,151,201.28 |

注:报告截止日2010年12月31日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额10,574,608,587.57份,其中A级基金份额总额5,220,195,209.84份,B级基金份额总额5,354,413,377.73份。

7.2 利润表
会计主体:南方现金增利基金
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 | | 225,860,186.81 | 267,535,874.83 |
| 1.利息收入 | | 198,922,713.18 | 225,881,987.58 |
| 其中:存款利息收入 | | 49,127,432.77 | 69,872,438.98 |
| 债券利息收入 | | 132,862,936.72 | 139,185,379.09 |
| 资产支持证券利息收入 | | 2,026,674.50 | 2,118,004.52 |
| 买入返售金融资产收入 | | 14,905,669.19 | 14,706,164.99 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益(损失以“-”填列) | | 26,937,473.63 | 41,653,887.25 |
| 其中:股票投资收益 | | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | | 26,937,473.63 | 41,653,887.25 |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | | - | - |
| 股利收益 | | - | - |
| 3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | | - | - |
| 4. 汇兑收益(损失以"-"号填列) | | - | - |
| 5.其他收入(损失以“-”号填列) | | - | - |
| 减:二、费用 | | 51,224,624.63 | 79,792,294.36 |
| 1.管理人报酬 | | 25,888,214.74 | 38,610,333.47 |
| 2.托管费 | | 7,844,913.61 | 11,700,101.03 |
| 3.销售服务费 | | 11,075,551.34 | 26,581,263.66 |
| 4.交易费用 | | - | - |
| 5.利息支出 | | 5,879,089.23 | 2,373,954.47 |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | | 5,879,089.23 | 2,373,954.47 |
| 6.其他费用 | | 536,855.71 | 526,641.73 |
| 三、利润总额 | | 174,635,562.18 | 187,743,580.47 |
| 减:所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | | 174,635,562.18 | 187,743,580.47 |

7.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:南方现金增利基金
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) | 6,385,725,092.52 | - | 6,385,725,092.52 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 174,635,562.18 | 174,635,562.18 |
| 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) | 4,188,883,495.05 | - | 4,188,883,495.05 |
| 其中:1.基金申购款 | 44,899,309,600.25 | - | 44,899,309,600.25 |
| 2.基金赎回款 | -40,710,426,105.20 | - | -40,710,426,105.20 |
| 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) | - | -174,635,562.18 | -174,635,562.18 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 10,574,608,587.57 | - | 10,574,608,587.57 |
| 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) | 23,786,696,000.75 | - | 23,786,696,000.75 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 187,743,580.47 | 187,743,580.47 |
| 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) | -17,400,970,908.23 | - | -17,400,970,908.23 |
| 其中:1.基金申购款 | 41,502,608,553.30 | - | 41,502,608,553.30 |
| 2.基金赎回款 | -58,903,579,461.53 | - | -58,903,579,461.53 |
| 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) | - | -187,743,580.47 | -187,743,580.47 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 6,385,725,092.52 | - | 6,385,725,092.52 |

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 |
| 华泰联合证券有限责任公司(“华泰联合证券”) | 基金管理人的股东华泰证券的控股子公司、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(“厦门国际信托”) | 基金管理人的股东 |
| 深圳市投资控股有限公司(i) | 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(i) | 基金管理人的原股东(2010年9月10日前) |

注:(i) 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。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 股票交易

注:无。

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

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<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 | 25,888,214.74 | 38,610,333.47 |
| 其中:支付给销售机构的客户维护费 | 4,660,870.66 | 7,630,159.37 |

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0.33%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 0.33% / 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 | 7,844,913.61 | 11,700,101.03 |

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0.1%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 0.1% / 当年天数。

7.4.4.2.3 销售服务费

单位:人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2010年1月1日至2010年12月31日 | | |
|---|---|---|---|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 南方现金增利货币A | 南方现金增利货币B | 合计 |
| 中国工商银行 | 5,550,782.13 | 20,788.26 | 5,571,570.39 |
| 南方基金公司 | 1,107,373.80 | 261,110.72 | 1,368,484.52 |
| 兴业证券 | 100,687.69 | 779.50 | 101,467.19 |
| 华泰证券 | 77,148.87 | - | 77,148.87 |
| 华泰联合证券 | 73,286.75 | 223.66 | 73,510.41 |
| 合计 | 6,909,279.24 | 282,902.14 | 7,192,181.38 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2009年1月1日至2009年12月31日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 南方现金增利货币A | 南方现金增利货币B | 合计 |
| 中国工商银行 | 9,268,413.05 | 809.39 | 9,269,222.44 |
| 南方基金公司 | 5,205,699.04 | 103,389.22 | 5,309,088.26 |
| 华泰证券 | 477,331.25 | - | 477,331.25 |
| 兴业证券 | 718,597.92 | 46.58 | 718,644.50 |
| 华泰联合证券 | 372,800.21 | 113.99 | 372,914.20 |
| 合计 | 16,042,841.47 | 104,359.18 | 16,147,200.65 |

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给南方基金公司,再由南方基金公司计算并支付给各基金销售机构。A级基金份额和B级基金份额约定的销售服务费年费率分别为0.25%和0.01%。销售服务费的计算公式为:

日销售服务费=前一日基金资产净值 X约定年费率 / 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

| 本期<br>2010年1月1日至2010年12月31日 | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 银行间市场交易的各关联方名称 | 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 | 141,307,994.38 | 301,771,945.47 | - | - | 2,957,000,000.00 | 146,269.29 |
| 华泰联合证券 | 40,012,591.78 | - | 348,600,000.00 | 86,740.61 | - | - |
| 华泰证券 | 20,040,000.00 | 20,083,242.19 | - | - | - | - |
| 上年度可比期间<br>2009年1月1日至2009年12月31日 | | | | | | |
| 银行间市场交易的各关联方名称 | 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 | 397,350,468.63 | 859,802,059.18 | - | - | 6,960,116,800.00 | 209,135.16 |

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<br>2010年1月1日至2010年12月31日 | | |
|---|---|---|---|
| | 南方现金增利货币A | 南方现金增利货币B | 合计 |
| 基金合同生效日(2004年3月5日)持有的基金份额 | - | - | - |
| 期初持有的基金份额 | 8,132,856.94 | - | 8,132,856.94 |
| 期间申购/买入总份额 | 58,660.27 | - | 58,660.27 |
| 期间因拆分变动份额 | - | - | - |
| 减:期间赎回/卖出总份额 | 8,191,517.21 | - | 8,191,517.21 |
| 期末持有的基金份额 | - | - | - |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | - | - | - |

| 项目 | 上年度可比期间<br>2009年1月1日至2009年12月31日 | | |
|---|---|---|---|
| | 南方现金增利货币A | 南方现金增利货币B | 合计 |
| 基金合同生效日(2004年3月5日)持有的基金份额 | - | - | - |
| 期初持有的基金份额 | 9,860,819.65 | - | 9,860,819.65 |
| 期间申购/买入总份额 | 174,573.29 | - | 174,573.29 |
| 期间因拆分变动份额 | - | - | - |
| 减:期间赎回/卖出总份额 | 1,902,536.00 | - | 1,902,536.00 |
| 期末持有的基金份额 | 8,132,856.94 | - | 8,132,856.94 |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.21% | - | 0.13% |

注:1. 期间申购总份额含红利再投、转换入份额,期间赎回总份额含转换出份额。

2. 基金管理人南方基金公司于本年度赎回本基金份额适用的手续费率为零。

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-活期存款 | 6,919,176.39 | 468,609.06 | 4,830,111.95 | 2,842,993.85 |
| 中国工商银行-定期存款 | - | - | - | 10,435,000.00 |

注:本基金的银行活期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。本基金的部分银行定期存款由基金托管人中国工商银行保管,按协议利率计息。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位:人民币元

| 本期<br>2010年1月1日至2010年12月31日 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 关联方名称 | 证券代码 | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入 | |
| | | | | 数量(单位:张) | 总金额 |
| 华泰证券 | 1081440 | 10营口港CP02 | 分销 | 500,000 | 50,000,000.00 |
| 上年度可比期间<br>2009年1月1日至2009年12月31日 | | | | | |
| 关联方名称 | 证券代码 | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入 | |
| | | | | 数量(单位:份) | 总金额 |
| - | - | - | - | - | - |

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

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

注:无。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:无。

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

7.4.6 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)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。

(b)以公允价值计量的金融工具

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值,公允价值层级可分为:

第一层级:相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级:直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级:以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

于2010年12月31日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第二层级的余额为5,918,918,273.28元,无属于第一层级和第三层级的余额(2009年12月31日:第二层级的余额为4,054,868,856.94元,无属于第一层级和第三层级的余额)。本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

(2)除公允价值外,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 | 固定收益投资 | 5,918,918,273.28 | 55.87 |
| | 其中:债券 | 5,858,918,273.28 | 55.30 |
| | 资产支持证券 | 60,000,000.00 | 0.57 |
| 2 | 买入返售金融资产 | 2,489,425,694.13 | 23.50 |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 3 | 银行存款和结算备付金合计 | 2,109,933,267.30 | 19.92 |
| 4 | 其他各项资产 | 75,599,852.40 | 0.71 |
| 5 | 合计 | 10,593,877,087.11 | 100.00 |

8.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

| 序号 | 项目 | 占基金资产净值的比例(%) | |
|---|---|---|---|
| 1 | 报告期内债券回购融资余额 | | 3.95 |
| | 其中:买断式回购融资 | | - |
| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金资产净值的比例(%) |
| 2 | 报告期末债券回购融资余额 | - | - |
| | 其中:买断式回购融资 | - | - |

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注:在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目 | 天数 |
|---|---|
| 报告期末投资组合平均剩余期限 | 87 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 154 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 87 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

注:本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过180天。

8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限 | 各期限资产占基金资产净值的比例(%) | 各期限负债占基金资产净值的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 30天以内 | 45.91 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | 4.30 | - |
| 2 | 30天(含)—60天 | 11.69 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | 7.61 | - |
| 3 | 60天(含)—90天 | 12.87 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | 2.74 | - |
| 4 | 90天(含)—180天 | 11.54 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | 1.07 | - |
| 5 | 180天(含)—397天(含) | 17.46 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | 0.94 | - |
| 合计 | | 99.47 | - |

8.4 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 | 摊余成本 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | 348,266,371.04 | 3.29 |
| 3 | 金融债券 | 1,346,961,556.03 | 12.74 |
| | 其中:政策性金融债 | 1,146,893,757.08 | 10.85 |
| 4 | 企业债券 | 682,659,853.97 | 6.46 |
| 5 | 企业短期融资券 | 3,481,030,492.24 | 32.92 |
| 6 | 其他 | - | - |
| 7 | 合计 | 5,858,918,273.28 | 55.41 |
| 8 | 剩余存续期超过397天的浮动利率债券 | 1,761,850,051.68 | 16.66 |

8.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 债券数量(张) | 摊余成本 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 068007 | 06首都机场债 | 2,700,000 | 264,929,316.23 | 2.51 |
| 2 | 100233 | 10国开33 | 2,200,000 | 217,753,083.93 | 2.06 |
| 3 | 071304 | 07华夏02浮 | 2,000,000 | 200,067,798.95 | 1.89 |
| 4 | 100236 | 10国开36 | 1,800,000 | 179,728,160.05 | 1.70 |
| 5 | 100230 | 10国开30 | 1,400,000 | 140,499,801.12 | 1.33 |
| 6 | 090306 | 09进出06 | 1,300,000 | 130,128,640.75 | 1.23 |
| 7 | 1081025 | 10鞍钢CP01 | 1,300,000 | 130,002,831.73 | 1.23 |
| 8 | 100209 | 10国开09 | 1,300,000 | 129,623,244.50 | 1.23 |
| 9 | 0980147 | 09中航工债浮 | 1,200,000 | 120,640,691.06 | 1.14 |
| 10 | 090213 | 09国开13 | 1,200,000 | 119,518,975.15 | 1.13 |

8.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

| 项目 | 偏离情况 |
|---|---|
| 报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数 | 192 |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.4763% |
| 报告期内偏离度的最低值 | 0.0548% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.3147% |

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

金额单位:人民币元

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量(份) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 119004 | 澜 电 03 | 600,000 | 60,000,000.00 | 0.57 |

8.8 投资组合报告附注

8.8.1 本基金采用“摊余成本法”计价,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内平均摊销,每日计提收益。

8.8.2 本报告期内本基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券,但不存在该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

8.8.3 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。

8.8.4 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 | 250,000.00 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | 75,024,739.19 |
| 4 | 应收申购款 | 295,113.21 |
| 5 | 其他应收款 | 30,000.00 |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 75,599,852.40 |

## §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

| 份额级别 | 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 |
| 南方现金增利货币A | 130,448 | 40,017.44 | 852,874,946.20 | 16.34% | 4,367,320,263.64 | 83.66% |
| 南方现金增利货币B | 124 | 43,180,753.05 | 4,944,329,047.49 | 92.34% | 410,084,330.24 | 7.66% |
| 合计 | 130,572 | 80,986.80 | 5,797,203,993.69 | 54.82% | 4,777,404,593.88 | 45.18% |

注:机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中,对下属分级基金,比例的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

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 | 份额级别 | 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 | 南方现金增利货币A | 2,857,855.12 | 0.05% |
| | 南方现金增利货币B | - | - |
| | 合计 | 2,857,855.12 | 0.03% |

注:分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中,对下属分级基金,比例的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

## §10 开放式基金份额变动

单位:份

| | 南方现金增利货币A | 南方现金增利货币B |
|---|---|---|
| 基金合同生效日(2004年3月5日)基金份额总额 | 8,049,850,114.32 | - |
| 本报告期期初基金份额总额 | 3,877,973,366.08 | 2,507,751,726.44 |
| 本报告期基金总申购份额 | 29,573,381,722.27 | 15,325,927,877.98 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 28,231,159,878.51 | 12,479,266,226.69 |
| 本报告期期末基金份额总额 | 5,220,195,209.84 | 5,354,413,377.73 |

## §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

经证监会审批,晏秋生任资产托管部副总经理;本基金管理人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

本基金本报告期内未更换会计师事务所,本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所有限公司审计费用103,000.00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、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 | |
| 银河证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | 1 | - | - | - | - | - |

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 |
| 银河证券 | - | - | 16,696,000,000.00 | 100.00% | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | - | - | - | - | - | - |

注:1、本期租用证券公司交易单元的变更情况 本报告期内中止2家证券公司的2个交易单元:浙商证券有限责任公司(上海),光大证券股份有限公司(上海)。

2、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

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。

11.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

注:无。