南方广利回报债券型证券投资基金

2014 年度报告摘要

2014年12月31日

基金管理人:南方基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2015年3月26日

§1 重要提示

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年3月20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2014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	南方广利回报债券	
基金主代码	202105	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2010年11月3日	
基金管理人	南方基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,609,627,432.05份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	南方广利回报债券A/B	南方广利回报债券C
下属分级基金的交易代码:	202105	202107
下属分级基金的前端交易代码	202105	–
下属分级基金的后端交易代码	202106	–
报告期末下属分级基金的份额总额	952,745,477.37份	656,881,954.68份

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"南方广利"。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在保持资产流动性及有效控制风险的基础上,追求基金资产长期稳定增值。
投资策略	本基金管理人将以经济周期和宏观政策分析为前提,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债券、股票、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	中证全债指数
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		南方基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	蒋松云
	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	2014年		2013年		2012年	
	南方广利回报债券A/B	南方广利回报债券C	南方广利回报债券A/B	南方广利回报债券C	南方广利回报债券A/B	南方广利回报债券C
本期已实现收益	165,733,703.38	103,085,625.34	50,338,068.62	40,654,467.72	17,036,408.63	13,870,398.77
本期利润	384,867,957.04	217,882,770.14	24,450,274.90	16,865,971.76	85,161,957.74	79,995,599.79
加权平均基金份额本期利润	0.6681	0.6312	0.0401	0.0343	0.1091	0.1035
本期基金份额净值增长率	44.16%	43.85%	2.69%	2.33%	13.19%	12.71%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末		2013年末		2012年末	
期末可供分配基金份额利润	0.1906	0.1721	0.0448	0.0323	0.0105	0.0022
期末基金资产净值	1,374,640,126.98	933,304,129.22	402,963,165.96	287,834,908.78	654,795,026.58	648,344,756.63
期末基金份额净值	1.443	1.421	1.053	1.04	1.064	1.055

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

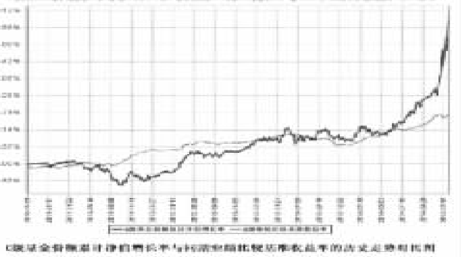
南方广利回报债券A/B

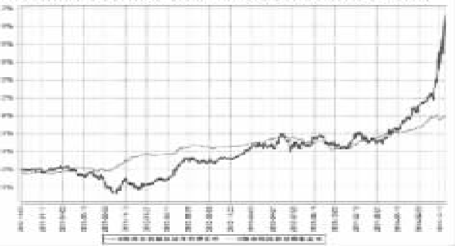
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	26.19%	1.20%	3.25%	0.15%	22.94%	1.05%
过去六个月	35.90%	0.90%	4.86%	0.11%	31.04%	0.79%
过去一年	44.16%	0.72%	10.82%	0.09%	33.34%	0.63%
过去三年	67.58%	0.52%	13.49%	0.09%	54.09%	0.43%
自基金合同生效起至今	57.52%	0.48%	18.90%	0.11%	38.62%	0.37%

南方广利回报债券C

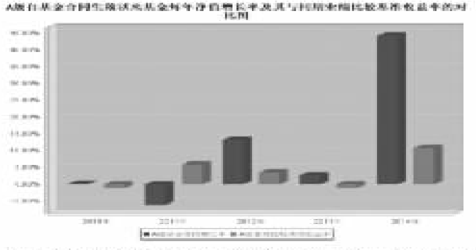
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	26.25%	1.20%	3.25%	0.15%	23.00%	1.05%
过去六个月	35.88%	0.90%	4.86%	0.11%	31.02%	0.79%
过去一年	43.85%	0.72%	10.82%	0.09%	33.03%	0.63%
过去三年	65.92%	0.52%	13.49%	0.09%	52.43%	0.43%
自基金合同生效起至今	55.30%	0.48%	18.90%	0.11%	36.40%	0.37%

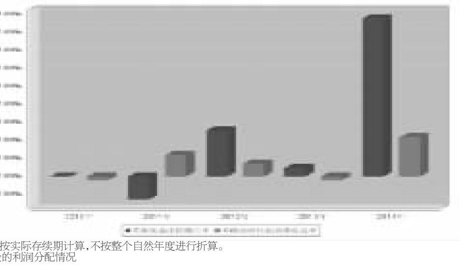
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





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





注:合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

南方广利回报债券A/B					
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
2014	0.6000	37,234,491.54	7,132,665.53	44,367,157.07	
2013	0.4000	17,482,024.34	5,411,904.66	22,893,929.00	
2012	–	–	–	–	
合计	1.0000	54,716,515.88	12,544,570.19	67,261,086.07	

单位:人民币元

南方广利回报债券C					
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
2014	0.6000	21,159,179.68	5,826,304.28	26,985,483.96	
2013	0.4000	12,008,102.77	5,974,820.39	17,982,923.16	
2012	–	–	–	–	
合计	1.0000	33,167,282.45	11,801,124.67	44,968,407.12	

§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3,000亿元,旗下管理57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		
韩亚庆	本基金基金经理、固定收益部总监	2010年11月3日	–	14年	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,历任固定收益部副总监、执行总监,2014年12月至今,担任固定收益部总监;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;2013年4月至今,任南方永利基金经理。

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》等有关法律法规、中国证监会和《南方广利回报债券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,没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

公司每季度对旗下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的情况不存在,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7次,其中6次是由于指数型基金根据标的指数成份股调整而被动调仓所致,1次是由于指数型基金接受投资者申赎后被动增减仓位所致。

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

2014年国内宏观经济受房地产地产投资下滑、出口回落、财政支出下滑等的影响,经济增速逐步回落,增长压力逐步加大。央行在14年维持了货币市场的宽松,并主要通过定向调控、结构调控手段投放货币,在11月22日降息一次。由于2014年初的债券收益率很高,债券市场在2014年走出了较大规模的牛市,且一直持续到11月,在中登城投债质押受限制等影响下才出现调整。股票市场自7月下旬起,受沪港通开通、四中全会召开等影响,上证指数逐步自2000点开始向上,在降息前,市场在犹豫中上涨到接近2500点,降息后到年底市场出现了快速上涨,低估值权重股表现更为突出,年底上证指数突破3200点。从主要指数看,中债综合财富指数上涨10.34%,中债企债财富指数上涨11.66%。上证指数上涨约53%,中证转债指数上涨约57%,中小板和创业板指数分别上涨9.7%和12.8%。2014年股票和债券双涨,是很好的基金投资年份。

广利基金在2014年的投资中,债券部分主要以信用债持仓为主,获取了债市上涨收益,在年中开始看好权益市场,在下半年权益市场大幅上涨中,继续提高了仓位和低估值权重股的配置,基金在可转债和股票方面获取了较多收益。全年取得了较好的总回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,南方广利A/B年收益率为44.16%,南方广利C年收益率为43.85%。

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2015年的市场,我们认为债券市场总体的机会较为均衡,价差收益水平不及2014年,收益的来源将主要来自票息收益以及部分波段操作收益,对城投平台债务的梳理和认定对债市会有一定冲击,会形成信用债市场新的市场结构,经济复苏的节奏和强度则会决定利率的波动,预计上半年债市表现将好于下半年。我们将做好基金的流动性管理,尽可能把握债券类属和利率波动的机会。在权益市场方面,2014年市场上涨的幅度非常大,低估值权重股的上涨更为突出,2015年权益市场我们仍维持中性偏多的看法,但上涨的趋势和节奏可能并不明朗,在行业和风格上的表现上预计也会交替进行,我们计划以低估值权重股为配置重点,兼顾行业均衡和主题投资。可转债市场我们认为指数表现将弱于2014年,个券的选择能力和波段操作会更为重要。总体上在权益投资方面我们会认真观察市场并进行积极的布局和调整。广利基金将继续以经济、政策和市场三者关系为研究分析重点,将在最新市场环境下通过大类资产选择和配置,建立多策略和总回报投资思路,在控制基金下行风险的基础上,为基金积极创造正收益来源,为投资者累积正回报。

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。报告期内,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、权益投资总监、数量化投资部总监、风险管理部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。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:由于本基金A类/B类基金份额不收取销售服务费,而C类基金份额收取销售服务费,各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权;在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为12次,每次收益分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的10%;本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红。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;若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配;基金红利发放日距离收益分配基准日(即可供分配利润计算截止日)的时间不得超过15个工作日。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,本基金于2014年10月27日进行了收益分配(A类/B类、C类每10份基金份额均派发红利0.60元)。

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,本基金托管人在对南方广利回报债券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

本报告期内,南方广利回报债券型证券投资基金的管理人——南方基金管理有限公司在南方广利回报债券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,南方广利回报债券型证券投资基金对基金份额持有人进行了1次利润分配,分配金额为71,352,641.03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广利回报债券型证券投资基金2014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2014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(2015)第20363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:南方广利回报债券型证券投资基金

报告截止日:2014年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
资产:		
银行存款	157,116,093.40	30,379,340.67
结算备付金	46,157,720.81	18,692,134.63
存出保证金	673,316.23	414,904.13
交易性金融资产	3,674,268,080.81	960,108,517.09
其中:股票投资	454,930,412.54	46,275,843.38
基金投资	–	–
债券投资	3,219,337,668.27	913,832,673.71
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	32,856,593.70	17,577,228.01
应收股利	–	–
应收申购款	53,971,521.50	233,193.28
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	3,965,043,326.45	1,027,405,317.81
负债和所有者权益	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013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	1,443,824,134.16	305,129,144.80
应付证券清算款	148,687,525.65	26,148,707.29
应付赎回款	60,701,020.63	4,075,825.65
应付管理人报酬	1,219,637.69	403,085.79
应付托管费	375,273.12	124,026.40
应付销售服务费	279,492.83	104,066.73
应付交易费用	1,625,010.01	324,701.25
应交税费	–	–
应付利息	60,167.51	113,706.45
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	326,808.65	183,978.71
负债合计	1,657,099,070.25	336,607,243.07
所有者权益:		
实收基金	1,609,627,432.05	659,598,912.16
未分配利润	698,316,824.15	31,199,162.58
所有者权益合计	2,307,944,256.20	690,798,074.74
负债和所有者权益总计	3,965,043,326.45	1,027,405,317.81

注:报告截止日2014年12月31日,基金份额总额1,609,627,432.05份,其中A/B类基金份额的份额总额为952,745,477.37份,份额净值1.443元;C类基金份额的份额总额为656,881,954.68份,份额净值1.421元。

7.2 利润表

会计主体:南方广利回报债券型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
一、收入	641,510,411.90	81,221,878.76
1.利息收入	64,268,288.95	76,864,130.71
其中:存款利息收入	874,279.19	794,195.16
债券利息收入	63,394,009.76	76,069,935.55
资产支持证券利息收入	–	–
买入返售金融资产收入	–	–
其他利息收入	–	–
2.投资收益(损失以"-"填列)	241,563,636.19	53,230,493.58
其中:股票投资收益	43,307,344.85	32,355,849.91
基金投资收益	–	–
债券投资收益	196,089,970.13	18,787,379.69
资产支持证券投资收益	–	–
贵金属投资收益	–	–
衍生工具收益	–	–
股利收益	2,166,321.21	2,087,263.98
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	333,931,398.46	-49,676,289.68
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	–	–
5.其他收入(损失以"-"号填列)	1,747,088.30	803,544.15
减:二、费用	38,759,684.72	39,905,632.10
1.管理人报酬	6,859,332.49	7,803,372.19
2.托管费	2,110,563.81	2,401,037.62
3.销售服务费	1,577,372.50	2,139,350.48
4.交易费用	3,301,160.29	3,834,185.15
5.利息支出	24,477,732.08	23,284,650.90
其中:卖出回购金融资产支出	24,477,732.08	23,284,650.90
6.其他费用	433,523.55	443,035.76
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	602,750,727.18	41,316,246.66
减:所得税费用	–	–
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	602,750,727.18	41,316,246.66

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:南方广利回报债券型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014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)	659,598,912.16	31,199,162.58	690,798,074.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	602,750,727.18	602,750,727.18
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)	950,028,519.89	135,719,575.42	1,085,748,095.31
其中:1.基金申购款	3,143,022,171.93	624,368,357.10	3,767,390,529.03
2.基金赎回款	-2,192,993,652.04	-488,648,781.68	-2,681,642,433.72
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)	–	-71,352,641.03	-71,352,641.03
五、期末所有者权益(基金净值)	1,609,627,432.05	698,316,824.15	2,307,944,256.20
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013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)	1,229,641,289.81	73,498,493.40	1,303,139,783.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	41,316,246.66	41,316,246.66
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)	-570,042,377.65	-42,738,725.32	-612,781,102.97
其中:1.基金申购款	1,313,572,414.40	109,902,690.35	1,423,475,104.75
2.基金赎回款	-1,883,614,792.05	-152,641,415.67	-2,036,256,207.72
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)	–	-40,876,852.16	-40,876,852.16
五、期末所有者权益(基金净值)	659,598,912.16	31,199,162.58	690,798,074.74

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

杨小松	徐超	徐超
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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

财政部于2014年颁布《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第40号——合营安排》、《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第2号——长期股权投资》、《企业会计准则第9号——职工薪酬》、《企业会计准则第30号——财务报表列报》、《企业会计准则第33号——合并财务报表》以及《企业会计准则第37号——金融工具列报》,要求除《企业会计准则第37号——金融工具列报》自2014年度财务报表起施行外,其他准则自2014年7月1日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

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[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(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,股权的股息、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,暂减按25%计入应纳税所得额。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
中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")	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("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 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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	240,634,971.20	10.64%	440,300,419.52	18.07%

7.4.4.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014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	209,244.30	10.46%	91,568.19	5.67%
关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013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	388,951.51	17.87%	–	–

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。权证交易不计佣金。

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 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	6,859,332.49	7,803,372.19
其中:支付销售机构的客户维护费	1,517,153.30	2,038,051.70

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0.65%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 0.65% / 当年天数。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,110,563.81	2,401,037.62

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。

7.4.4.2.3 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 2014年1月1日至2014年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方广利回报债券A/B	南方广利回报债券C	合计
南方基金	–	642,037.68	642,037.68
中国工商银行	–	429,347.16	429,347.16
华泰证券	–	12,162.35	12,162.35
兴业证券	–	1,349.40	1,349.40
合计	–	1,084,896.59	1,084,896.59
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方广利回报债券A/B	南方广利回报债券C	合计
南方基金	–	600,426.60	600,426.60
中国工商银行	–	736,385.18	736,385.18
华泰证券	–	17,499.78	17,499.78
兴业证券	–	3,328.08	3,328.08
合计	–	1,357,639.64	1,357,639.64

注:支付销售机构的C类基金份额销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.4%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给南方基金,再由南方基金计算并支付给各基金销售机构。A/B类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为:

日销售服务费=前一日C类基金份额基金资产净值 X 0.4% / 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 2014年1月1日至2014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	–	–	–	–	–	–
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013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	10,004,142.47	–	–	–	–	–

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

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

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 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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	157,116,093.40	232,634.76	30,379,340.67	146,499.40

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

金额单位:人民币元

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
本期 2014年1月1日至2014年12月31日					
兴业证券	110025	国金转债	新债承销	22,670	2,267,000
上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日					
兴业证券	112156	12中顺债	新债分销	140,000	14,000,000.00
兴业证券	1380088	13三明城投债	新债分销	100,000	10,000,000.00

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.5 期末(2014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
600703	三安光电	2014年1月30日	2015年1月27日	非公开发行	21.80	14.22	164,000	3,575,200.00	2,332,080.00	–
600703	三安光电	2014年7月4日	2015年1月27日	非公开发行-转增	–	14.22	82,000	–	1,166,040.00	–

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
110030	格力转债	2014年12月30日	2015年1月13日	新债认购	100.00	100.00	22,210	2,221,000.00	2,221,000.00	–

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/新债申购。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/新债,从新股/新债获配日至新股/新债上市日之间不能自由转让。此外,基金还可作为特定投资者,认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票,所认购的股票自发行结束之日起12个月内不得转让。

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
600240	华业地产	2014年10月16日	重大资产重组	9.99	2015年1月22日	7.91	317,458	1,772,580.10	3,171,405.42	–
300252	金信诺	2014年11月11日	重大事项	43.40	2015年1月28日	46.99	49,962	2,185,750.20	2,168,350.80	–
300248	新开普	2014年11月17日	重大资产重组	33.24	2015年2月16日	34.91	41,900	1,362,740.00	1,392,756.00	–
600584	长电科技	2014年11月3日	重大资产重组	11.13	2015年1月14日	12.24	102,000	1,065,579.29	1,135,260.00	–

注:本基金截至2014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

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2014年12月31日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额177,224,134.16元,是以如下债券作为抵押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
1080162	10东城发债	2015年1月7日	101.09	300,000	30,327,000.00
1080009	10泰州债	2015年1月7日	102.46	243,000	24,897,780.00
1480227	14克投债	2015年1月5日	104.80	200,000	20,960,000.00
980177	09九城投债	2015年1月5日	102.09	200,000	20,418,000.00
1080169	10湖州城投债	2015年1月5日	102.07	200,000	20,414,000.00
1282541	12湘建工MTN1	2015年1月6日	98.41	107,000	10,529,870.00
1480363	14冀顺德债	2015年1月6日	103.27	100,000	10,327,000.00
1280233	12龙岩城投债	2015年1月6日	102.56	100,000	10,256,000.00
1080122	10徐州债	2015年1月5日	100.10	100,000	10,010,000.00
1282411	12三花MTN2	2015年1月6日	99.86	100,000	9,986,000.00
1282481	12嘉公路MTN1	2015年1月6日	99.77	100,000	9,977,000.00
1382250	13甘建投MTN1	2015年1月5日	99.64	73,000	7,273,720.00
合计	–	–	–	1,823,000	185,376,370.00

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2014年12月31日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额1,266,600,000.00元,于2015年1月5日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

§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	454,930,412.54	11.47
	其中:股票	454,930,412.54	11.47
2	固定收益投资	3,219,337,668.27	81.19
	其中:债券	3,219,337,668.27	81.19
	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	203,273,814.21	5.13
7	其他各项资产	87,501,431.43	2.21
8	合计	3,965,043,326.45	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	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	75,268,736.05	3.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	26,943,379.40	1.17
F	批发和零售业	10,723,250.52	0.46
G	交通运输、仓储和邮政业	52,640,743.80	2.28
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,145,389.23	0.09
J	金融业	168,527,347.64	7.30
K	房地产业	115,425,970.12	5.00
L	租赁和商务服务业	3,190,536.80	0.14
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	65,058.98	0.00
S	综合	–	–
	合计	454,930,412.54	19.71

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 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	000024	招商地产	1,170,000	30,876,300.00	1.34
2	600048	保利地产	2,732,110	29,561,430.20	1.28
3	600030	中信证券	863,366	29,268,107.40	1.27
4	000031	中粮地产	2,553,400	21,601,764.00	0.94
5	600837	海通证券	836,664	20,130,135.84	0.87
6	600999	招商证券	648,087	18,321,419.49	0.79
7	600663	陆家嘴	452,381	16,964,287.50	0.74
8	601555	东吴证券	676,740	15,172,510.80	0.66
9	601668	中国建筑	2,063,000	15,018,640.00	0.65
10	600855	航天长峰	486,600	13,508,016.00	0.59

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	600030	中信证券	43,933,842.06	6.36
2	600855	航天长峰	27,805,436.97	4.03
3	600048	保利地产	26,628,957.29	3.85
4	601555	东吴证券	26,606,199.40	3.85
5	000024	招商地产	22,125,558.31	3.20
6	600837	海通证券	21,675,447.70	3.14
7	000031	中粮地产	21,635,657.64	3.13
8	002185	华天科技	19,093,835.21	2.76
9	600240	华业地产	18,055,477.65	2.61
10	600999	招商证券	17,493,987.12	2.53
11	600676	交运股份	16,345,254.10	2.37
12	600663	陆家嘴	15,894,677.67	2.30
13	600655	豫园商城	15,212,314.37	2.20
14	002432	九安医疗	15,171,561.61	2.20
15	600115	东方航空	15,091,959.50	2.18
16	601998	中信银行	15,085,383.87	2.18
17	600650	锦江投资	14,942,571.88	2.16
18	002030	达安基因	14,306,582.70	2.07
19	002023	海特高新	14,156,760.62	2.05
20	600118	中国卫星	13,680,506.33	1.98

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	600030	中信证券	41,869,093.92	6.06
2	601555	东吴证券	27,567,558.49	3.99
3	600240	华业地产	20,772,283.16	3.01
4	002185	华天科技	18,600,386.66	2.69
5	600855	航天长峰	18,589,344.53	2.69
6	002432	九安医疗	15,492,607.87	2.24
7	002023	海特高新	14,407,388.99	2.09
8	002030	达安基因	14,052,060.92	2.03
9	600879	航天电子	13,790,979.89	2.00
10	000558	莱茵置业	13,426,188.96	1.94
11	600212	江泉实业	12,936,493.26	1.87
12	002285	世联行	12,604,917.96	1.82
13	600115	东方航空	12,558,320.63	1.82
14	300059	东方财富	12,397,331.28	1.79
15	600662	强生控股	12,009,158.43	1.74
16	002673	西部证券	11,163,611.58	1.62
17	300226	上海钢联	10,438,532.08	1.51
18	000728	国元证券	10,239,106.48	1.48
19	600343	航天动力	10,109,521.34	1.46
20	600366	宁波韵升	10,072,984.76	1.46

注:卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票,卖出金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	1,291,976,428.86
卖出股票收入(成交)总额	1,008,701,143.05

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	1,229,142,511.43	53.26
5	企业短期融资券	10,085,000.00	0.44
6	中期票据	180,306,000.00	7.81
7	可转债	1,799,804,156.84	77.98
8	其他	–	–
9	合计	3,219,337,668.27	139.49

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	113001	中行转债	1,286,420	201,440,507.80	8.73
2	110023	民生转债	1,386,970	191,776,341.90	8.31
3	110015	石化转债	1,375,770	185,618,888.40	8.04
4	110020	南山转债	1,014,250	141,599,442.50	6.14
5	110029	浙能转债	990,210	138,589,791.60	6.00

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。

8.9 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	673,316.23
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	32,856,593.70
5	应收申购款	53,971,521.50
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	87,501,431.43

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	201,440,507.80	8.73
2	110023	民生转债	191,776,341.90	8.31
3	110015	石化转债	185,618,888.40	8.04
4	110020	南山转债	141,599,442.50	6.14
5	127002	徐工转债	115,511,536.90	5.00
6	113005	平安转债	105,848,805.60	4.59
7	110011	歌华转债	75,120,407.40	3.25
8	110017	中海转债	67,859,539.20	2.94
9	110012	海运转债	54,932,458.00	2.38
10	125089	深机转债	52,505,410.94	2.27
11	110022	同仁转债	47,677,943.40	2.07
12	113006	深燃转债	22,786,045.20	0.99
13	128005	齐翔转债	18,128,390.56	0.79
13	128002	东华转债	16,252,389.90	0.70
14	128006	长青转债	12,487,835.59	0.54

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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

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
南方广利回报债券A/B	15,778	60,384.43	260,730,215.01	27.37%	692,015,262.36	72.63%
南方广利回报债券C	8,782	74,798.67	362,099,113.82	55.12%	294,782,840.86	44.88%
合计	24,560	135,183.10	622,829,328.83	38.69%	986,798,103.22	61.31%

注:分级基金机构/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)。户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	南方广利回报债券A/B	129,620.54	0.0136%
	南方广利回报债券C	780.48	0.0001%
	合计	130,401.02	0.0081%

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)。

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	份额级别	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	南方广利回报债券A/B	–
	南方广利回报债券C	–
	合计	–
本基金基金经理持有本开放式基金	南方广利回报债券A/B	0~10
	南方广利回报债券C	–
	合计	0~10

§10 开放式基金份额变动

单位:份

项目	南方广利回报债券A/B	南方广利回报债券C
基金合同生效日(2010年11月3日)基金份额总额	1,615,049,459.34	2,950,578,156.77
本报告期期初基金份额总额	382,862,774.82	276,736,137.34
本报告期基金总申购份额	2,294,978,616.64	848,043,555.29
减:本报告期基金总赎回份额	1,725,095,914.09	467,897,737.95
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	952,745,477.37	656,881,954.68

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

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

本报告期内,因中国工商银行股份有限公司(以下简称"本行")工作需要,周月秋同志不再担任本行资产托管部总经理。在新任资产托管部总经理李勇同志完成证券投资基金行业高级管理人员任职资格备案手续前,由副总经理王立波同志代为行使本行资产托管部总经理部分业务授权职责。

本报告期内,本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

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74,000.00元,该审计机构已提供审计服务的连续年限为4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	
东北证券	1	985,013,266.34	43.55%	852,384.78	42.62%	–
海通证券	1	775,631,501.02	34.29%	702,376.28	35.12%	–
国金证券	1	260,518,819.10	11.52%	235,985.01	11.80%	–
华泰证券	2	240,634,947.29	10.64%	209,244.30	10.46%	–

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
东北证券	510,558,257.23	9.12%	1,210,600,000.00	1.14%	–	–
海通证券	3,804,907,607.03	67.98%	82,248,300,000.00	77.54%	–	–
国金证券	1,189,660,944.17	21.25%	22,231,500,000.00	20.96%	–	–
华泰证券	92,367,318.75	1.65%	377,000,000.00	0.36%	–	–

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。