

南方多利增强债券型证券投资基金 2007 年年度报告摘要

(上接 182 版)

(二)期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量	期末市值	市值占净值比例
1	601300	中国平安	2,924,968	33,677,850.34	1.9%
2	601939	建设银行	2,876,663	27,635,751.00	1.63%
3	601857	中国石化	836,600	25,901,130.00	1.53%
4	601088	中国神华	223,000	14,631,030.00	0.86%
5	601808	中海油服	216,648	7,439,662.32	0.44%
6	601918	信达地产	445,632	7,094,461.44	0.42%
7	002194	武汉光谷	33,001	1,713,061.99	0.10%
8	002186	全聚德	19,259	1,077,829.77	0.06%
9	002187	广信股份	19,763	849,429.41	0.05%
10	002105	华天科技	33,697	722,463.68	0.04%

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登录于本基金管理人网站 <http://www.nfndfund.com> 上的年度报告正文。

(四)本期股票投资组合的重大变动

1.本期累计买入价值超出期初基金资产净值 2% 的股票明细 (至少前 20 名)

序号	股票代码	股票名称	累计买入价值	占期初基金资产净值比例
1	601857	中国石化	20,434,120.00	1.22%
2	601939	建设银行	18,006,507.00	1.06%
3	601088	中国神华	17,406,270.00	1.06%
4	601300	中国平安	16,175,308.00	0.97%
5	601918	信达地产	8,000,000.00	0.38%
6	601169	北京银行	4,412,500.00	0.28%
7	601866	中海油服	4,389,000.00	0.26%
8	601808	中海油服	2,920,415.04	0.17%
9	601918	信达地产	2,620,316.16	0.16%
10	002194	武汉光谷	1,213,271.10	0.07%
11	002185	华天科技	560,673.36	0.03%
12	002183	普华永道	522,490.00	0.03%
13	002194	武汉光谷	391,340.80	0.02%
14	002187	广信股份	365,163.12	0.02%
15	002186	全聚德	327,565.01	0.02%
16	002190	成飞集成	290,920.23	0.01%
17	002188	新嘉坡	198,177.69	0.01%
18	002180	万力达	180,440.00	0.01%
19	002189	郑达光电	169,371.00	0.01%
20	002179	中航光电	137,615.04	0.01%

2.本期累计卖出价值超出期初基金资产净值 2% 的股票明细 (至少前 20 名)

序号	股票代码	股票名称	累计卖出价值	占期初基金资产净值比例
1	601088	中国神华	19,389,638.80	1.16%
2	601857	中国石化	12,107,319.37	0.72%
3	601801	中国铝业	10,971,801.24	0.61%
4	601866	中海油服	7,110,141.66	0.42%
5	601169	北京银行	6,327,036.69	0.41%
6	601300	中国平安	3,963,442.10	0.23%
7	002183	普华永道	1,151,318.43	0.07%
8	002194	武汉光谷	1,075,087.79	0.06%
9	002187	广信股份	455,607.06	0.03%
10	002180	万力达	434,111.08	0.03%
11	002186	全聚德	414,120.88	0.02%
12	002179	中航光电	402,882.16	0.02%
13	002185	华天科技	398,973.49	0.02%
14	002184	海得控制	288,373.80	0.02%

序号	股票代码	股票名称	数量	期末市值	市值占净值比例
15	002177	御银股份	260,288.34	0.01%	
16	002188	新嘉坡	147,445.52	0.01%	
17	002190	成飞集成	128,106.70	0.01%	
18	002181	粤传媒	105,163.72	0.01%	
19	002189	郑达光电	90,400.92	0.01%	
20	002166	莱茵生物	81,127.57	0.00%	

3.本期买入股票的成本总额为 97,253,717.62 元;卖出股票的收入总额为 65,349,315.22 元;本基金持有的股票全部为通过一级市场申购获得。

(五)期末按券种分类的债券投资组合

债券类别	金额	占基金净值比例
国债	14,703,297.40	0.87%
金融债	646,301,000.00	38.11%
央行票据	582,349,000.00	33.98%
可转债	73,127,930.00	4.31%
资产支持证券	111,963,592.83	6.61%
合计	1,388,044,800.23	82.48%

(六) 基金投资的前十名债券明细	序号	债券名称	金额	占基金净值比例
1	07央票 117	297,810,000.00	17.57%	
2	06央行 2	199,040,000.00	11.74%	
3	07进出 13	99,840,000.00	5.89%	
4	07央票 141	99,170,000.00	5.85%	
5	06央行 02 存	86,500,000.00	5.81%	

(七)投资组合报告附注

1.本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

2.本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3.期末其他资产构成

项目	金额
应收利息	260,000.00
应收申购款	33,646,832.49
应收股利	13,618,656.37
其他应收款	94,761.61
证券清算款	27,829,487.77
合计	76,439,737.24

(八) 报告期末持有的资产支持证券明细	序号	代码	名称	数量	金额	占净值比例
1	119002	浦发 01	660,000	65,799,188.38	3.88%	
2	119003	浦发 02	330,000	32,950,672.53	1.95%	
3	119005	浦发收益	200,000	13,170,732.00	0.78%	

9. 投资投资组合附注

本报告期内本基金因申购/赎回/转换/转股获得权证情况如下:

权证	名称	数量	成本	
1	580014	招商 CWB1	291,448	932,494.20
2	580015	招商 CWB1	336,669	708,293.26
3	580016	招商 CWB1	727,416	6,313,627.68

九、基金份额持有人户数、持有人结构		
项目	户/份额	占份额的比例
基金份额持有人户数	35,254	
平均每户持有基金份额	44,154.03	
机构投资者持有的基金份额	300,171,715.66	19.28%
个人投资者持有的基金份额	1,266,434,519.15	80.72%

2.期末基金管理公司从业人员投资开放式基金的情况

项目	期末持有本开放式基金基金份额的总量(份)	占本基金总份额的比例(%)
基金管理公司持有本基金的所有从业人员	45,073.24	0.00

十、开放式基金份额变动

(一) 基金合同生效日基金份额总额:4,902,664,980.80

(二) 本年基金份额的变动情况

期初基金份额总额	737,243,256.89
期间基金总申购份额	3,569,294,462.45
期间基金总赎回份额	2,016,109,066.58
期末基金份额总额	2,320,428,652.73

十一、重大事件提示

1. 本年内未召开持有人大会。

2. 本基金托管人的专门基金托管部门在本报告期内无重大人事变动;

3. 基金管理人及高级管理人员、基金经理均未发生变动;基金经理于 2007 年 5 月 11 日发布关于增聘基金经理的公告,增聘师帅为南方宝元债券型基金的基金经理。基金管理人于 2008 年 1 月 12 日发布关于调整基金经理的公告,聘任高峰、蒋峰为南方宝元债券型基金的基金经理,王翠娟不再担任宝元债券型基金的基金经理。

4. 本报告期内无涉及及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

5. 本报告期内本基金收益分配情况:本基金于 2007 年 6 月 12 日(权益登记日)对基金持有人分配红利,每 10 份基金份额 9.50 元。

6. 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 80,000.00 元,该审计机构已提供审计服务的连续年限为 6 年。

7. 本报告期内无涉及及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

8. 基金管理人、托管人及其高级管理人员、基金经理均未发生变动;

9. 本基金租用证券公司专用交易席位的情况

证券公司名称及席位数量、股票交易及支付佣金情况(1) 证券公司名称及席位数量、股票交易及支付佣金情况

券商名称	席位数量	股票成交金额	占成交总额比例	支付佣金	占佣金总额比例
海通证券股份有限公司	1				
华泰证券股份有限公司	2	683,912,212.51	25.19%	536,852.87	24.15%
民族证券有限责任公司	1				
招商证券股份有限公司	1	1,528,338,917.83	56.30%	1,253,236.33	57.46%
国泰君安证券股份有限公司	1	455,213,475.27	16.77%	364,532.22	16.71%
安信证券股份有限公司	1				
上海证券有限责任公司	1	47,130,199.88	1.74%	36,885.83	1.69%
合计	8	2,714,602,805.58	100.00%	2,181,498.27	100.00%

十二、重要事项提示

1. 本报告期内未召开持有人大会。

(5) 专用席位的选择标准和程序

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席位的选择标准和程序:

A: 选择标准

(a) 公司经营行为规范,财务状况及经营状况良好;

(b) 公司具有较较强的研究能力,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,能满足基金操作保密的要求;

(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

1. 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;

2. 基金管理人、托管人及其高级管理人员、基金经理均未发生变动;

3. 本基金租用证券公司专用交易席位的情况

项目	期末持有本开放式基金基金份额的总量(份)	占本基金总份额的比例(%)
基金管理公司持有本基金的所有从业人员	--	--

十三、开放式基金份额变动

(一) 基金合同生效日基金份额总额:5,191,610,489.92

(二) 本期基金份额的变动情况

期初基金份额总额	3,902,106,212.99
期间基金总申购份额	--
期间基金总赎回份额	1,569,124,830.24
期末基金份额总额	2,332,981,382.75

十四、重要事项提示

1. 本报告期内未召开持有人大会。

(5) 专用席位的选择标准和程序

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席位的选择标准和程序:

A: 选择标准

(a) 公司经营行为规范,财务状况及经营状况良好;

(b) 公司具有较较强的研究能力,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,能满足基金操作保密的要求;

(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

1. 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;

2. 基金管理人、托管人及其高级管理人员、基金经理均未发生变动;

3. 本基金租用证券公司专用交易席位的情况

券商名称	席位数量	股票成交金额	占成交总额比例	支付佣金	占佣金总额比例
河北财达证券经纪有限责任公司		837,400,000.00	2.91%	--	--
广发证券股份有限公司		--	--	--	--
上海证券有限责任公司		--	--	--	--
东吴证券有限责任公司		--	--	--	--
海通证券股份有限公司		7,008,100,000.00	24.34%	16,328,372.50	92.79%
中国银河证券有限责任公司		--	--	--	--
国泰君安证券股份有限公司		--	--	--	--
中信万通证券有限责任公司		7,003,800,000.00	24.33%	1,269,626.40	72.1%
东海证券有限责任公司		13,942,700,000.00	48.43%	--	--
长江证券股份有限公司		--	--	--	--
中信建投证券有限责任公司		--	--	--	--
合计		28,792,000,000.00	100.00%	17,597,995.90	100.00%

十五、重要事项提示

1. 本报告期内未召开持有人大会。

(5) 专用席位的选择标准和程序

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席位的选择标准和程序:

A: 选择标准

(a) 公司经营行为规范,财务状况及经营状况良好;

(b) 公司具有较较强的研究能力,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,能满足基金操作保密的要求;

(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

1. 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;

2. 基金管理人、托管人及其高级管理人员、基金经理均未发生变动;

3. 本基金租用证券公司专用交易席位的情况

项目	期末持有本开放式基金基金份额的总量(份)	占本基金总份额的比例(%)
基金管理公司持有本基金的所有从业人员	--	--

十六、开放式基金份额变动

(一) 基金合同生效日基金份额总额:5,191,610,489.92

(二) 本期基金份额的变动情况

期初基金份额总额	3,902,106,212.99
期间基金总申购份额	--
期间基金总赎回份额	1,569,124,830.24
期末基金份额总额	2,332,981,382.75

十七、重要事项提示

1. 本报告期内未召开持有人大会。

(5) 专用席位的选择标准和程序

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席位的选择标准和程序:

A: 选择标准

(a) 公司经营行为规范,财务状况及经营状况良好;

(b) 公司具有较较强的研究能力,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,能满足基金操作保密的要求;

(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

1. 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;

2. 基金管理人、托管人及其高级管理人员、基金经理均未发生变动;

3. 本基金租用证券公司专用交易席位的情况

券商名称	席位数量	股票成交金额	占成交总额比例	支付佣金	占佣金总额比例
河北财达证券经纪有限责任公司		837,400,000.00	2.91%	--	--
广发证券股份有限公司		--	--	--	--
上海证券有限责任公司		--	--	--	--
东吴证券有限责任公司		--	--	--	--
海通证券股份有限公司		7,008,100,000.00	24.34%	16,328,372.50	92.79%
中国银河证券有限责任公司		--	--	--	--
国泰君安证券股份有限公司		--	--	--	--
中信万通证券有限责任公司		7,003,800,000.00	24.33%	1,269,626.40	72.1%
东海证券有限责任公司		13,942,700,000.00	48.43%	--	--
长江证券股份有限公司		--	--	--	--
中信建投证券有限责任公司		--	--	--	--
合计		28,792,000,000.00	100.00%	17,597,995.90	100.00%

十八、重要事项提示

1. 本报告期内未召开持有人大会。

(5) 专用席位的选择标准和程序

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席位的选择标准和程序:

A: 选择标准

(a) 公司经营行为规范,财务状况及经营状况良好;

(b) 公司具有较较强的研究能力,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,能满足基金操作保密的要求;

(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

1. 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;

2. 基金管理人、托管人及其高级管理人员、基金经理均未发生变动;

3. 本基金租用证券公司专用交易席位的情况

项目	期末持有本开放式基金基金份额的总量(份)	占本基金总份额的比例(%)
基金管理公司持有本基金的所有从业人员	2,941,490.70	0.13%

十四、开放式基金份额变动

(一) 基金合同生效日基金份额总额:8,977,113,995.62

(二) 本期基金份额的变动情况

期初基金份额总额	1,663,147,642.98</
----------	--------------------