南方积极配置证券投资基金2007年年度报告摘要

(上接176版)

序号	股票代码	股票名称	数量	期末市值	市值占基金净值
1	600030	中信证券	4,500,000	401,715,000.00	5.54%
2	600036	招商银行	10,000,000	396,300,000.00	5.47%
3	600519	贵州茅台	1,500,000	345,000,000.00	4.76%
4	601628	中国人寿	5,477,821	317,384,948.74	4.38%
5	601006	大秦铁路	11,659,200	298,708,704.00	4.12%
6	600900	长江电力	15,000,000	292,350,000.00	4.03%
7	000002	万 科 A	10,000,000	288,400,000.00	3.98%
8	600660	福耀玻璃	7,200,000	258,192,000.00	3.56%
9	600028	中国石化	10,000,000	234,300,000.00	3.23%
10	000651	格力电器	4,410,083	217,637,596.05	3.00%

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站http://www.nffund.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	600030	中信证券	808,300,096.80	22.58%
2	601628	中国人寿	403,537,929.61	11.27%
3	600028	中国石化	392,247,121.64	10.96%
4	600016	民生银行	371,062,155.65	10.36%
5	000039	中集集团	364,845,915.40	10.19%
6	000063	中兴通讯	354,864,990.18	9.91%
7	000002	万 科 A	350,665,654.35	9.79%
8	000651	格力电器	328,882,282.39	9.19%
9	600900	长江电力	323,404,882.24	9.03%
10	000898	鞍钢股份	270,816,581.81	7.56%
11	600036	招商银行	257,142,054.95	7.18%
12	600519	贵州茅台	246,088,904.35	6.87%
13	601111	中国国航	243,976,956.34	6.81%
14	601006	大秦铁路	239,457,666.16	6.69%
15	000402	金 融 街	229,445,884.92	6.41%
16	600019	宝钢股份	206,071,914.05	5.76%
17	600660	福耀玻璃	195,712,782.27	5.47%
18	000031	中粮地产	194,078,424.21	5.42%
19	600585	海螺水泥	183,420,625.07	5.12%
20	600761	安徽合力	180,259,876.52	5.04%
21	600631	百联股份	179,789,275.41	5.02%
22	600858	银座股份	178,394,588.40	4.98%
23	600887	伊利股份	173,975,909.81	4.86%
24	600583	海油工程	173,701,329.65	4.85%
25	000768	西飞国际	168,429,551.94	4.70%
26	000869	张 裕 A	167,354,956.72	4.67%
27	601088	中国神华	165,298,017.12	4.62%
28	600005	武钢股份	147,789,700.22	4.13%
29	600511	国药股份	143,468,684.50	4.01%
30	600875	东方电气	142,914,357.39	3.99%
31	000951	中国重汽	141,882,141.64	3.96%
32	002032	苏 泊 尔	139,755,216.02	3.90%
33	000410	沈阳机床	139,696,568.34	3.90%
34	000987	广州友谊	137,220,549.26	3.83%
35	000046	泛海建设	133,828,350.81	3.74%
36	600859	王府井	133,727,181.78	3.74%
37	600011	华能国际	132,905,858.00	3.71%
38	000825	太钢不锈	121,936,666.47	3.41%
39	600048	保利地产	120,410,861.10	3.36%
40	600456	宝钛股份	112,521,244.08	3.14%
41	601318	中国平安	110,464,274.01	3.09%
42	600000	浦发银行	110,335,785.14	3.08%
43	600795	国电电力	108,957,463.45	3.04%
44	600276	恒瑞医药	95,436,412.11	2.67%
45	000538	云南白药	92,527,328.36	2.58%
46	600015	华夏银行	90,352,067.01	2.52%
47	600332	广州药业	86,694,057.79	2.42%
48	000069	华侨城 A	86,039,791.53	2.40%
49	000562	宏源证券	84,630,855.80	2.36%
50	000629	攀钢钒钛	82,285,086.70	2.30%
51	600685	广船国际	78,226,366.10	2.19%
52	000717	韶钢松山	77,682,984.08	2.17%
53	600628	新世界	74,803,646.41	2.09%
54	000927	一汽夏利	71,683,900.53	2.00%

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	600030	中信证券	1,297,084,552.17	36.23%
2	000002	万 科 A	968,448,687.14	27.05%
3	600036	招商银行	735,807,156.89	20.55%
4	000039	中集集团	692,353,656.66	19.34%
5	600016	民生银行	659,262,802.79	18.41%
6	000063	中兴通讯	541,849,901.83	15.13%
7	000651	格力电器	524,096,277.72	14.64%
8	600519	贵州茅台	289,131,116.52	8.08%
9	600859	王府井	286,310,727.42	8.00%
10	600631	百联股份	285,909,291.31	7.99%
11	600583	海油工程	280,969,674.36	7.85%
12	000031	中粮地产	263,753,447.95	7.37%
13	000410	沈阳机床	258,594,802.09	7.22%
14	600000	浦发银行	258,547,011.05	7.22%
15	600028	中国石化	251,571,674.35	7.03%
16	000869	张 裕 A	250,530,396.58	7.00%
17	000898	鞍钢股份	247,306,964.31	6.91%
18	000987	广州友谊	239,476,602.65	6.69%
19	600685	广船国际	237,416,094.70	6.63%
20	000538	云南白药	236,181,821.24	6.60%
21	000768	西飞国际	227,485,698.11	6.35%
22	600011	华能国际	206,037,556.31	5.76%
23	600761	安徽合力	204,110,215.88	5.70%
24	600276	恒瑞医药	185,065,815.51	5.17%
25	600005	武钢股份	183,607,874.07	5.13%
26	000069	华侨城 A	175,798,806.66	4.91%
27	000825	太钢不锈	175,474,345.03	4.90%
28	000878	云南铜业	147,386,269.70	4.12%
29	600795	国电电力	146,417,195.26	4.09%
30	600887	伊利股份	145,224,498.87	4.06%
31	601111	中国国航	143,982,203.32	4.02%
32	600858	银座股份	143,105,681.67	4.00%
33	000338	潍柴动力	142,624,319.82	3.98%
34	600628	新世界	137,813,696.43	3.85%
35	000629	攀钢钒钛	131,409,358.06	3.67%
36	002032	苏 泊 尔	128,165,470.43	3.58%
37	600048	保利地产	125,197,550.70	3.50%
38	000951	中国重汽	124,332,568.64	3.47%
39	601318	中国平安	120,121,850.20	3.36%
40	000896	双汇发展	118,311,784.62	3.30%
41	000402	金 融 街	117,632,615.71	3.29%
42	600019	宝钢股份	114,859,880.73	3.21%
43	600015	华夏银行	106,363,623.36	2.97%
44	600511	国药股份	105,675,138.51	2.95%
45	000562	宏源证券	102,431,112.92	2.86%
46	600660	福耀玻璃	101,634,514.57	2.84%
47	601857	中国石油	94,422,518.98	2.64%
48	600361	华联综超	94,180,523.47	2.63%
49	000550	江铃汽车	93,699,738.06	2.62%
50	601003	柳钢股份	92,353,592.63	2.58%
51	600332	广州药业	90,124,187.03	2.52%
52	600616	第一食品	89,878,987.41	2.51%
53	600900	长江电力	89,040,654.75	2.49%
54	000060	中金岭南	87,630,001.38	2.45%
55	600827	友谊股份	84,532,501.50	2.36%
56	000157	中联重科	81,442,764.18	2.27%
57	000927	一汽夏利	80,919,948.55	2.26%
58	600585	海螺水泥	76,674,137.89	2.14%
59	000717	韶钢松山	76,574,480.38	2.14%
60	000778	新兴铸管	72,118,246.03	2.01%

3、本期买入股票的成本总额为11,678,307,775.26元；卖出股票的收入总额为14,627,039,575.14元。

（五）期末按券种分类的债券投资组合

债券类别	市 值	市值占净值比例
国家债券	124,872,000.00	1.72%
企业债券	19,948,194.00	0.28%
央行票据	744,515,000.00	10.27%
债券投资合计	889,335,194.00	12.27%

（五）期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	债券名称	市 值	市值占净值比例
1	07央票112	198,580,000.00	2.74%
2	07央票117	198,540,000.00	2.74%
3	07央票123	198,460,000.00	2.74%
4	07央票109	148,935,000.00	2.06%
5	20国债(4)	124,872,000.00	1.72%

（六）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
存出保证金	2,621,713.17
应收证券清算款	39,251,950.33
应收利息	6,781,033.94
应收申购款	2,977,177.67
合 计	51,631,875.11

4、权证投资情况

本报告期内本基金无主动投资权证情况，因申购分离交易可转债获得权证情况如下：

序号	代码	名称	数 量	成本
1	580016	上汽CWB1	1,000,188	8,681,160.17

九、基金份额持有人情况

1、 基金份额持有人户数、持有人结构

项 目	户/份额	占总份额的比例
基金份额持有人户数	191,776	
平均每户持有基金份额	18,435.17	
机构投资者持有的基金份额	213,071,535.83	6.03%
个人投资者持有的基金份额	3,322,351,189.24	93.97%

2.报告期末本基金前十名持有人明细（上市交易部分）

序号	持有人名称	持有份额	占总份额的比例
1	南方基金管理有限公司	57,015,420.00	1.61%
2	中国人寿保险股份有限公司－传统账户	10,000,000.00	0.28%
3	刘影	3,326,479.00	0.09%
4	无锡电缆实业总公司	2,208,139.00	0.06%
5	曹刚建	1,499,007.00	0.04%
6	中国人寿保险股份有限公司	1,210,646.00	0.03%
7	潘顺坤	1,000,000.00	0.03%
8	郭子栋	999,931.00	0.03%
9	薛长福	989,452.00	0.03%
10	汤龙祥	798,000.00	0.02%

3、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	2,563,336.39	0.07%

十、开放式基金份额变动

（一）基金合同生效日基金份额总额：3,535,576,439.25

（一） 本期基金份额的变动情况

期初基金份额总额	3,185,857,622.44
期间基金总申购份额	9,285,007,159.58
期间基金总赎回份额	8,935,442,056.95
期末基金份额总额	3,535,422,725.07

十一、重要事项揭示

1、本报告期内未召开持有人大会。

2、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。

3、本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项

4、本报告期内本基金投资策略未改变。

5、本基金于2007年3月9日进行了本年度第一次收益分配，基金分红方案为每份基金单位0.17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133,000.00元，该审计机构已提供审计服务的连续年限为2年。

7、基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚的任何情形。

8、本基金租用证券公司专用交易席位的有关情况

（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	占佣金总量比例
华泰证券股份有限公司	1	4,946,958,875.40	19.08%	4,056,054.81	19.45%
联合证券有限责任公司	2	5,025,819,402.78	19.39%	4,042,420.20	19.38%
国泰君安证券股份有限公司	1	939,296,026.91	3.62%	735,003.39	3.52%
广发证券股份有限公司	2	3,707,678,091.59	14.30%	3,017,347.33	14.47%
国元证券有限责任公司	1	–	–	–	–
浙商证券有限责任公司	1	–	–	–	–
湘财证券有限责任公司	1	1,996,366,747.23	7.70%	1,562,169.50	7.49%
中信证券股份有限公司	1	5,046,772,083.07	19.47%	3,949,127.03	18.94%
国都证券有限责任公司	1	–	–	–	–
山西证券有限责任公司	1	1,487,215,209.40	5.74%	1,219,515.24	5.85%
中国银河证券股份有限公司	1	528,074,416.03	2.04%	433,019.29	2.08%
中信建投有限公司	1	593,246,554.41	2.29%	486,463.79	2.33%
中原证券股份有限公司	1	1,106,944,773.59	4.27%	907,687.55	4.35%
华安证券有限责任公司	1	226,288,425.35	0.87%	185,557.10	0.89%
华西证券有限责任公司	1	318,927,969.09	1.23%	261,520.08	1.25%
合 计	17	25,923,588,574.85	100.00%	20,855,885.31	100.00%

（2）债券交易情况

券商名称	债券成交金额	占成交总额比例
华泰证券股份有限公司	41,799,200.00	33.49%
联合证券有限责任公司	83,000,000.00	66.51%
国泰君安证券股份有限公司	–	–
广发证券股份有限公司	–	–
国元证券有限责任公司	–	–
浙商证券有限责任公司	–	–
湘财证券有限责任公司	–	–
中信证券股份有限公司	–	–
国都证券有限责任公司	–	–
山西证券有限责任公司	–	–
中国银河证券有限责任公司	–	–
中信建投证券有限责任公司	–	–
中原证券股份有限公司	–	–
华安证券有限责任公司		
华西证券有限责任公司		
合 计	124,799,200.00	100.00%

（3）债券回购、权证交易情况

本报告期内本基金没有债券回购交易、权证交易。

（4）本期租用证券公司席位的变更情况

本报告期内新增华西证券有限责任公司席位1个（上海）、华安证券有限责任公司席位1个（上海）

（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

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。

9、已在临时报告中披露过的本报告期内发生的其他重要事项(信息披露报纸为：中国证券报、上海证券报、证券时报)

序号	其他重要事项	披露日期
1	南方基金关于延长农行金穗卡网上交易优惠费率的公告	2007-12-29
2	南方基金关于股东名称变更、住所变更及章程修改的公告	2007-12-29
3	关于旗下基金参与中国工商银行基金定投优惠活动的公告	2007-12-27
4	南方基金关于旗下基金在中国邮政储蓄银行推出基金定投业务的公告	2007-12-20
5	南方基金关于旗下基金在中国光大银行开通基金定投业务的公告	2007-12-18
6	南方基金关于增加天相投资顾问有限公司为旗下基金代销机构的公告	2007-12-14
7	南方基金关于增加农行代销南方稳健等5只基金并开办旗下基金定投业务的公告	2007-12-10
8	南方基金管理有限公司增加开放式证券投资基金代销机构的公告	2007-11-27
9	南方基金关于网上交易系统开通东莞农信社网上支付的公告	2007-11-20
10	南方基金关于南方e站网上交易系统优惠费率调整的公告	2007-11-17
11	南方基金关于在广州证券推出基金定期定额投资业务的公告	2007-11-07
12	南方基金关于网上交易系统开通中国银行广东省分行网上支付的公告	2007-10-12
13	南方基金关于旗下基金在工行开展个人网银基金申购费率优惠活动的公告	2007-9-28
14	南方基金关于调整旗下基金基金合同和托管协议中资产估值部分的公告	2007-9-28
15	南方基金关于网上交易系统开通南京银行网上支付的公告	2007-9-28
16	南方基金关于在中国建设银行推出基金定投业务的公告	2007-8-28
17	南方基金关于在中国工商银行增加旗下基金定投业务的公告	2007-8-25
18	南方基金关于网上交易系统开通昆明市商业银行网上支付的公告	2007-8-22
19	南方基金关于旗下基金在上海浦东发展银行推出基金定投业务的公告	2007-8-15
20	南方基金关于网上交易系统开通中信银行、浦发银行网上支付的公告	2007-8-09
21	南方基金关于网上交易系统开通中国农业银行网上支付的公告	2007-8-09
22	南方基金关于旗下基金在招商银行开通基金定投业务的公告	2007-8-08
23	南方基金关于通过中国光大银行网上银行申购旗下基金实行费率优惠的公告	2007-8-08
24	南方基金关于增加中国光大银行为代销机构的公告	2007-8-08
25	南方基金关于增加中信银行代销南方稳健基金等7只基金的公告	2007-7-31
26	南方基金关于增加华林证券有限责任公司为代销机构的公告	2007-7-10
27	南方基金管理有限公司关于执行新企业会计准则的公告	2007-7-02
28	关于增加交通银行代销南方稳健成长等8只基金并开办旗下基金定期定额申购业务的公告	2007-06-20
29	关于旗下基金在中国工商银行开展个人网上银行基金申购费率优惠活动的公告	2007-06-20
30	关于修改南方积极配置基金申购费用及申购份额计算方法的公告	2007-06-04
31	关于增加华林证券为代销机构的公告	2007-04-12
32	关于旗下基金投资宜华水（600978）非公开发行股票的公告	207-04-05
33	关于在上海浦东发展银行推出定期定额投资业务的公告	2007-03-15
34	关于增加中国邮政储蓄为代销机构的公告	2007-03-12
35	关于增加江南证券为代销机构的公告	2007-03-12
36	关于增加新时代证券为代销机构的公告	2007-03-08
37	关于增加大同证券为代销机构的公告	2007-03-08
38	关于进行网上交易优惠促销活动的公告	2007-03-06

投资者对本报告书若有疑问，可咨询本基金管理人。

咨询电话：400-889-8899

公司网站：http://www.nffund.com

南方基金管理有限公司

二零零八年三月二十九日

南方成份精选股票型证券投资基金2007年年度报告摘要

(上接178版)

序号	股票代码	股票名称	累计买入价值	占期末基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	1,931,545,412.83	6.36%
2	600000	浦发银行	1,820,987,033.93	6.00%
3	600030	中信证券	1,564,888,594.29	5.15%
4	000002	万 科 A	1,380,792,963.35	4.55%
5	601006	大秦铁路	1,183,732,253.60	3.90%
6	600016	民生银行	1,102,344,946.84	3.63%
7	600900	长江电力	926,163,703.43	3.05%
8	601390	中国中铁	902,369,706.08	2.97%
9	600383	金地集团	848,152,522.75	2.79%
10	600005	武钢股份	734,393,585.60	2.42%
11	000825	太钢不锈	692,620,022.13	2.28%
12	600309	烟台万华	672,155,442.13	2.21%
13	601088	中国神华	612,961,846.11	2.02%
14	601939	建设银行	609,858,621.13	2.01%
15	600015	华夏银行	574,331,009.41	1.89%
16	600050	中国联通	570,693,016.73	1.88%
17	000858	五 粮 液	568,886,969.71	1.87%
18	000568	泸州老窖	557,936,305.17	1.84%
19	000039	中集集团	519,381,552.51	1.71%
20	600028	中国石化	518,858,031.85	1.71%

2、本期累计卖出价值超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600030	中信证券	1,586,219,559.01	5.22%
2	000002	万 科 A	1,556,475,054.82	5.13%
3	600036	招商银行	1,306,476,267.27	4.30%
4	600016	民生银行	1,293,217,646.39	4.26%
5	601919	中国远洋	801,970,592.19	2.64%
6	000825	太钢不锈	619,457,310.95	2.04%
7	600028	中国石化	607,102,872.33	2.00%
8	600000	浦发银行	601,521,397.44	1.98%
9	000039	中集集团	583,190,527.48	1.92%
10	000568	泸州老窖	556,840,469.92	1.83%
11	000027	深圳能源	527,354,343.45	1.74%
12	600900	长江电力	509,243,879.47	1.68%
13	000338	潍柴动力	496,696,500.16	1.64%
14	600320	振华港机	481,846,890.71	1.59%
15	601166	兴业银行	459,398,291.15	1.51%
16	600739	辽宁成大	447,178,031.50	1.47%
17	601006	大秦铁路	431,489,412.51	1.42%
18	600383	金地集团	407,438,460.72	1.34%
19	600005	武钢股份	384,779,261.20	1.27%
20	600309	烟台万华	318,730,046.70	1.05%

3、本期买入股票的成本总额为35,598,334,208.11元；卖出股票的收入总额为22,260,355,344.14元。

（五）期末按券种分类的债券投资组合

债券类别	市 值	市值占净值比例
国家债券投资	–	
央行票据投资	793,760,000.00	2.61%
企业债券投资	26,437,478.00	0.09%
金融债券投资	299,460,000.00	0.99%
可转换债投资	44,023,058.90	0.15%
国家政策金融债券	–	
债券投资合计	1,163,680,536.90	3.83%

（六）期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	债券名称	市 值	市值占净值比例
1	05央行票据34	499,850,000.00	1.65%
2	04建行03浮	299,460,000.00	0.99%
3	07央行票据28	194,000,000.00	0.64%
4	05央行票据40	99,910,000.00	0.33%
5	中海转债	44,023,058.90	0.15%

（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
交易保证金	7,433,400.38
应收利息	22,109,832.72
应收申购款	35,979,984.55
证券清算款	14,435,904.08
买入返售金融资产	3,000,001,120.00
合 计	3,079,960,241.73

4、期末持有处于转股期的可转换债券

债券代码	债券名称	市 值	市值占净值比
110026	中海转债	44,023,058.90	0.15%

5、权证投资情况：本期内没有主动投资持有的权证，因投资分离交易可转债获得派发的认股权证情况如下。

权证代码	权证名称	增加数量	调增成本	卖出数量	卖出成本
580016	上汽CWB1	1,325,556	11,277,983.25		
031005	国安GAC1	244,342	1,332,910.99	244,342	1,332,910.99
580013	武钢CWB1			604,601	1,401,041.90
580012	云化CWB1			210,654	1,247,303.40

十一、金元证券投资基金投资组合报告(2007年1月1日至2007年5月13日)

（一）期末基金资产组合情况

项 目	金 额	占基金总资产的比例
股 票	1,191,640,742.22	76.92%
债 券	317,999,559.10	20.53%
权 证	6,703,318.31	0.43%
银行存款及清算备付金合计	27,924,021.07	1.80%
其他资产	4,939,935.61	0.32%
资产总值	1,549,207,576.31	100.00%

（二）期末按行业分类的股票投资组合

行业分类	市值	占基金资产净值比例
A 农、林、牧、渔业	--	
B 采掘业	12,560.00	0.00%
C 制造业	577,415,206.78	37.34%
C0 食品、饮料	36,758,612.00	2.38%
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	83,940,000.00	5.43%
C5 电子	--	
C6 金属、非金属	326,341,032.95	21.10%
C7 机械、设备、仪表	92,829,624.39	6.00%
C8 医药、生物制品	37,545,937.44	2.43%
C99 其他制造业	--	
D 电力、煤气及水的生产和供应业	30,416,000.00	1.97%
E 建筑业	--	
F 交通运输、仓储业	34,831,063.44	2.25%
G 信息技术业	37,000,000.00	2.39%
H 批发和零售贸易	23,003,200.00	1.49%
I 金融、保险业	290,188,560.00	18.77%
J 房地产业	147,438,400.00	9.53%
K 社会服务业	23,626,312.00	1.53%
L 传播与文化产业	27,709,440.00	1.79%
M 综合类	--	
合计	1,191,640,742.22	77.06%

（三）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	市值占基金净值
1	000002	万 科 A	6,880,000	147,438,400.00	9.53%
2	600036	招商银行	6,280,000	133,198,800.00	8.61%
3	000825	太钢不锈	4,680,000	121,446,000.00	7.85%
4	600030	中信证券	2,038,000	113,700,020.00	7.35%
5	600660	福耀玻璃	3,955,000	89,501,650.00	5.79%
6	000338	潍柴动力	1,245,753	75,280,853.79	4.87%
7	600005	武钢股份	3,842,765	46,228,462.95	2.99%
8	600596	新安股份	1,230,000	42,262,800.00	2.73%
9	600309	烟台万华	1,080,000	41,677,200.00	2.70%
10	000538	云南白药	1,172,944	37,545,937.44	2.43%

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站http://www.nffund.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	600519	贵州茅台	53,317,690.57	4.63%
2	000039	中集集团	41,306,886.36	3.59%
3	600005	武钢股份	33,006,941.67	2.87%
4	600269	赣粤高速	32,014,043.11	2.78%
5	600030	中信证券	23,803,856.88	2.07%
6	600000	浦发银行	20,975,048.26	1.82%
7	000569	*ST长钢	20,420,710.60	1.77%
8	000999	中信海直	20,206,189.38	1.75%
9	600642	申能股份	19,982,068.09	1.73%
10	600737	中粮屯河	19,931,377.43	1.73%
11	600236	桂冠电力	19,780,383.66	1.72%
12	000060	中金岭南	19,635,693.65	1.70%
13	002106	莱宝高科	18,808,431.94	1.63%
14	601318	中国平安	18,440,850.19	1.60%
15	600810	神马实业	18,171,381.67	1.58%
16	601003	柳钢股份	18,160,560.19	1.58%
17	600350	山东高速	18,056,600.95	1.57%
18	600150	沪东重机	17,904,615.29	1.55%
19	000063	中兴通讯	17,092,864.33	1.48%
20	600015	华夏银行	16,368,467.77	1.42%

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	000825	太钢不锈	107,269,249.19	9.31%
2	600030	中信证券	69,713,583.55	6.05%
3	000039	中集集团	66,119,515.63	5.74%
4	600887	伊利股份	54,612,178.37	4.74%
5	600028	中国石化	53,502,715.18	4.65%
6	600519	贵州茅台	49,769,642.04	4.32%
7	600011	华能国际	43,976,410.78	3.82%
8	600016	民生银行	32,440,799.92	2.82%
9	000569	*ST长钢	25,262,371.32	2.19%
10	000999	中信海直	24,768,911.51	2.15%
11	601628	中国人寿	24,553,837.52	2.13%
12	600810	神马实业	22,261,697.42	1.93%
13	002106	莱宝高科