

南方绩优成长股票型证券投资基金2007 年年度报告摘要

(上接 173 页)
(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	600000	浦发银行	1,751,609,125.91	10.82%
2	600030	中信证券	1,691,827,050.68	10.45%
3	601919	中国远洋	1,654,069,659.10	10.22%
4	000002	万科 A	1,497,069,538.08	9.25%
5	600036	招商银行	1,492,771,306.99	9.22%
6	600016	民生银行	1,367,307,333.04	8.45%
7	000625	太钢不锈	1,336,763,639.99	8.29%
8	600005	宝钢股份	1,200,602,692.16	7.42%
9	601390	中国中铁	1,029,049,530.42	6.36%
10	000069	华侨城 A	992,870,291.69	6.13%
11	600309	烟台万华	962,469,412.96	5.88%
12	600048	保利地产	937,791,454.11	5.79%
13	600019	宝钢股份	912,968,436.71	5.64%
14	000629	攀钢钒钛	858,424,524.76	5.30%
15	000039	中集集团	823,688,523.22	5.09%
16	600015	华夏银行	781,066,318.42	4.83%
17	601988	中国银行	764,248,673.86	4.72%
18	000157	中联重科	724,108,505.11	4.47%
19	600083	海油工程	670,506,019.94	4.14%
20	000456	宝钛股份	641,790,289.96	3.96%
21	000671	安徽合力	543,803,685.06	3.36%
22	600631	百联股份	536,293,524.28	3.31%
23	000717	韶钢松山	513,219,487.80	3.17%
24	600320	振华港机	507,811,483.28	3.14%
25	000001	深发展 A	499,139,673.54	3.07%
26	601166	兴业银行	496,214,712.08	3.04%
27	600009	上海机场	468,019,286.34	2.89%
28	601006	大秦铁路	447,574,836.62	2.76%
29	600060	福耀玻璃	437,901,209.91	2.71%
30	600739	辽宁成大	418,210,739.71	2.58%
31	000026	中海发展	414,975,079.97	2.56%
32	600276	恒瑞医药	400,533,853.92	2.47%
33	000078	云南铝业	376,141,346.64	2.32%
34	000087	南京高科	362,101,254.63	2.24%
35	600008	马钢股份	342,212,765.68	2.11%

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	000625	太钢不锈	2,778,770,918.55	17.17%
2	000002	万科 A	2,724,591,517.46	16.83%
3	600030	中信证券	2,289,266,506.47	14.20%
4	600016	民生银行	2,163,773,889.62	13.37%
5	600036	招商银行	2,066,080,360.24	12.70%
6	601988	中国银行	1,752,680,224.50	10.83%
7	600028	中国石化	1,339,428,156.44	8.23%
8	600000	浦发银行	1,289,850,606.81	8.03%
9	600309	烟台万华	1,042,971,219.33	6.44%
10	000683	海油工程	1,016,426,750.22	6.28%
11	000039	中集集团	940,333,723.86	5.81%
12	600015	华夏银行	917,246,066.73	5.67%
13	600060	福耀玻璃	813,096,393.52	5.02%
14	000338	潍柴动力	620,690,492.72	3.83%
15	601166	兴业银行	607,883,865.62	3.76%
16	601006	大秦铁路	607,619,565.60	3.75%
17	600761	安徽合力	575,562,240.93	3.56%
18	600066	宇通客车	574,350,898.15	3.55%
19	000157	中联重科	566,568,406.37	3.50%
20	000717	韶钢松山	529,814,417.30	3.27%
21	600879	火药股份	516,724,061.06	3.19%
22	600019	宝钢股份	501,318,849.54	3.10%
23	600005	宝钢股份	476,814,973.26	2.95%
24	600048	保利地产	458,282,678.64	2.83%
25	601919	中国远洋	454,103,846.29	2.81%
26	000001	深发展 A	450,072,187.23	2.78%
27	600739	辽宁成大	435,374,908.34	2.69%
28	600616	第一食品	435,082,591.55	2.69%
29	600808	马钢股份	419,509,197.31	2.59%
30	600666	新安股份	412,797,793.54	2.55%
31	600150	中国船舶	399,158,397.05	2.47%
32	000402	金 融 街	397,906,685.84	2.46%
33	000768	西飞国际	382,918,427.25	2.37%

3、本期买入股票的成本总额为 35,165,940,669.98 元; 卖出股票的收入总额为 39,988,956,

260.00 元。
(五)期末按券种分类的债券投资组合

债券类别	债券市值	市值占净值比例
金融债	197,000,000.00	0.68%
央行票据	2,465,600,000.00	8.41%
企业债	24,522,636.60	0.08%
可转债	10,819,196.20	0.04%
合计	2,687,941,833.80	9.21%

(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	07 央行 129	1,489,000,000.00	5.10%
2	07 央行票据 18	291,450,000.00	1.00%
3	07 央票 91	289,530,000.00	0.99%
4	06 央行 02 浮	197,000,000.00	0.67%
5	07 央票 66	193,540,000.00	0.66%

(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
存出保证金	11,797,224.64
应收利息	23,502,825.37
应收申购款	73,361,849.91
合计	108,661,899.92

4. 期末未持有的处于转股期的可转换债券

5. 权证投资情况
本基金报告期内未发生权证交易,可转换债券转股的数量情况如下:

权证代码	权证名称	派发数量	买入成本	卖出数量	卖出成本
010102	宝钢 GP1	13,456,424.27	17,098,379	13,456,424.27	—
800111	中化 CWB1	12,563,872.93	8,623,360	12,563,872.93	—
800116	上汽 CWB1	3,000,188	8,681,160.17	—	—

截至 2007 年 12 月 31 日,南方德成成长基金持有人情况如下:

1. 基金份额持有人户数、持有人结构

项 目	户 数	户 均 份 额	占 总 份 额 的 比 例
基金份额持有人户数	484,860	—	—
平均每户持有基金份额	19,944.43	—	—
机构投资者持有的基金份额	286,668,060.07	2.96%	—
个人投资者持有的基金份额	9,383,589.5121	97.04%	—

2. 期末基金管理人从业人员投资开放式基金的情况

项目	期末持有本基金基金份额的数量(股)	占本基金总份额的比例(%)
基金管理人持有本基金基金份额的从业人员	2,477,080.75	0.03

十、开放式基金业绩变动

(一)基金合同生效日基金资产净值: 12,477,494,128.02

(二)期末基金资产净值: 13,363,066,803.87

期末基金总资产: 11,344,994,757.50

期末基金总负债: 15,038,413,988.69

期末基金份额净值: 9,670,287,572.78

十一、重大事件提示

- 1. 本报告期内未召开基金份额持有人大会。
- 2. 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、基金托管人、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发生变更。
- 5. 本报告期内本基金基金经理变更情况:无。
- 6. 本报告期内本基金未更换会计师事务所,本报告期内支付给普华永中天会计师事务所有限公司审计费用 182,000.00 元,该审计机构已提供审计服务的连续年限为 1 年。
- 7. 在本报告期内,基金管理人、基金托管人、基金托管人、基金托管业务的诉讼事项:无。
- 8. 本基金投资于上市公司专用交易席位的具体情况

(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	占成交额比例	支付佣金	占佣金总额比例
国泰君安证券股份有限公司	1	3,220,566,022.20	4.6%	2,520,116.38	4.31%
华泰证券股份有限公司	1	9,145,974,777.63	12.6%	7,487,293.38	12.81%
兴业证券股份有限公司	1	4,566,954,422.95	6.3%	3,572,249.60	6.11%
中国银河证券股份有限公司	1	540,584,422.95	0.7%	440,203.11	0.76%
东方证券股份有限公司	1	8,546,444,706.19	11.8%	6,897,548.88	11.5%
安信证券股份有限公司	1	1,687,728,517.17	2.3%	991,934.07	1.6%
招商证券股份有限公司	1	1,420,506,019.51	1.9%	809,407.17	1.3%
中国银河证券股份有限公司	1	4,567,673,363.89	6.3%	3,680,531.90	6.2%
海通证券股份有限公司	1	2,800,791,288.67	3.8%	2,256,622.37	3.8%
德盛证券有限责任公司	1	399,596,083.26	0.5%	242,425.20	0.41%
中国建设银行股份有限公司	1	86,563,250.99	1.1%	60,046.00	1.1%
东吴证券股份有限公司	1	6,066,285,780.00	8.2%	4,966,147.02	8.4%
中国国际金融有限公司	1	16,727,844,196.23	23.1%	13,724,680.02	23.6%
北京高华证券有限责任公司	1	7,228,763,194.24	9.9%	5,927,033.83	10.1%
中信证券股份有限公司	1	3,94,085,312.06	5.3%	2,715,266.42	4.6%
南方证券股份有限公司	1	88,983,854.44	1.2%	694,076.16	1.1%
大新证券股份有限公司	1	612,673,881.01	0.8%	479,419.89	0.8%
安信证券股份有限公司	1	—	—	—	—
东吴证券股份有限公司	1	—	—	—	—
中银证券股份有限公司	1	—	—	—	—
合计	20	72,341,516,143.76	100.0%	58,509,091.88	100.0%

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应查阅登载于本基金管理人网站 <http://www.nfund.com.cn> 的年度报告正文。

(四)报告期内股票投资组合的重大变动

1. 报告期内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	数量(股)	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	601390	中国中铁	57,000,000	654,330,000.00	4.71%
2	600019	宝钢股份	35,000,000	610,400,000.00	4.31%
3	600150	中国铝业	2,400,000	699,376,000.00	4.93%
4	600036	招商银行	5,000,000	594,450,000.00	4.23%
4	600099	招商证券	15,700,000	563,002,000.00	4.04%
6	601006	大秦铁路	21,000,000	529,020,000.00	3.74%
7	000002	万科 A	18,160,400	534,096,304.64	3.74%
8	600000	浦发银行	10,100,400	523,400,720.00	3.71%
9	000878	云南铜业	10,000,000	474,100,000.00	3.34%
10	600030	中信证券	4,000,000	387,080,000.00	2.82%

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应查阅登载于本基金管理人网站 <http://www.nfund.com.cn> 的年度报告正文。

(四)报告期内股票投资组合的重大变动

1. 报告期内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	累计买入金额(元)	占期初基金资产净值的比例
1	600019	宝钢股份	961,331,488.62	6.52%
2	600000	浦发银行	726,472,629.90	4.95%
3	601919	中国远洋	664,109,510.82	4.55%
4	601390	中国中铁	641,393,597.83	4.40%
5	000625	太钢不锈	608,001,181.47	4.17%
6	600016	民生银行	539,622,028.48	3.70%
7	000002	万科 A	487,829,313.40	3.34%
8	600015	华夏银行	452,156,190.14	3.10%
9	601390	中国中铁	450,622,117.95	3.09%
10	600030	中信证券	429,670,083.50	2.95%
11	600016	民生银行	406,173,569.33	2.78%
12	600005	宝钢股份	364,920,461.23	2.50%
13	600036	招商银行	348,227,652.16	2.39%
14	600066	新安股份	309,646,173.80	2.12%
15	000623	吉林敖东	300,032,667.72	2.06%
16	600039	烟台万华	293,094,430.97	2.01%
17	600519	贵州茅台	273,929,016.69	1.88%
18	000682	泰达股份	267,795,889.29	1.77%
19	600000	浦发银行	262,502,285.10	1.73%
20	600050	中国联通	242,766,400.04	1.66%

1. 报告期内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	累计买入金额(元)	占期初基金资产净值的比例
1	600030	中信证券	2,380,620,250.20	15.77%
2	601390	中国中铁	1,761,542,091.58	11.68%
3	600036	招商银行	1,541,476,217.28	10.07%
4	000002	万科 A	1,537,709,630.67	10.04%
5	600016	民生银行	1,233,397,862.83	8.06%
6	600039	烟台万华	1,185,554,940.62	7.81%
7	000625	太钢不锈	971,734,991.64	6.46%
8	000039	烟台万华	739,879,833.63	4.97%
9	600150	中国铝业	689,227,022.57	4.56%
10	000888	五粮液	671,771,561.74	4.32%
11	000402	金融街	626,376,088.03	3.99%
12	000338	潍柴动力	498,450,240.61	3.40%
13	600019	宝钢股份	469,629,843.55	3.08%
14	600028	中国石化	481,298,170.12	3.20%
15	600683	海油工程	471,641,088.38	3.13%
16	600000	浦发银行	424,423,288.43	2.81%
17	600066	宇通客车	414,789,201.18	2.74%
18	000623	吉林敖东	402,091,380.14	2.70%
19	601919	中国远洋	398,039,288.40	2.71%
20	600519	贵州茅台	382,000,838.00	2.52%
21	600011	华能国际	389,360,537.67	2.54%
22	601166	兴业银行	342,052,684	