南方稳健成长贰号证券投资基金 2009年半年度报告摘要

2009年6月30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:2009年08月25日

§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2009年8月21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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2009年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	南方稳健成长贰号混合
交易代码	202002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年07月25日
报告期末基金份额总额	9,612,432,715.17

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“南稳贰号”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为稳健成长型基金,在控制投资风险并保持基金投资组合良好的流动性的前提下,力求使该为投资者提供稳健和长期稳定的资本利得。
投资策略	在股票投资方面,本基金根据上市公司的获利能力和成长潜力,主要可以区分为价值型股票和成长型股票。本基金明确界定了价值型和成长型股票的特征,并依据该特征分别构造一个投资组合。本基金投资于这两个组合内股票的比例不低于股票投资部分的80%。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为上证综合指数×80%+上证国债指数×20%。
风险收益特征	本基金为混合基金,属证券投资基金中的风险收益适中的品种。

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

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

§3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2009年1月1日-2009年6月30日)
本期已实现收益	-480,813,291.49
本期利润	2,106,268,220.67
加权平均基金份额本期利润	0.2102
本期基金份额净值增长率	30.83%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2009年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.3106
期末基金资产净值	8,605,989,649.69
期末基金份额净值	0.8953

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

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
过去一个月	10.44%	0.82%	9.79%	0.91%	0.65%	-0.09%
过去三个月	14.74%	0.91%	19.51%	1.12%	-4.77%	-0.21%
过去六个月	30.83%	1.29%	47.98%	1.43%	-17.15%	-0.14%
过去一年	-2.45%	1.69%	9.16%	1.91%	-11.61%	-0.22%
自基金合同生效起至今	90.26%	1.69%	65.24%	1.84%	25.02%	-0.15%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

§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金字[1998]4号文批准,由南方证券股份有限公司、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。目前股权结构:华泰证券股份有限公司45%、深圳市机场(集团)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;16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证券投资基金和南方沪深300指数证券投资基金;以及多个企国社保、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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
冯皓	本基金的基金经理	2007年5月10日	-	5	注册金融分析师(CFA),工商管理硕士,具有基金从业资格。曾任职于中安成长基金公司,2003年加入南方基金,2007年5月至今,任南方稳健基金经理;2007年5月至今,任南稳贰号基金经理。
马北雁	本基金的基金经理	2008年4月11日	-	8	土壤学博士,具有基金从业资格。曾先后担任广东省科学院助理研究员、平安证券研究所农业和食品饮料行业研究员、平安证券综合研究所行业公司部副总经理等职务,2005年9月加入南方基金,2008年4月至今,任南方稳健基金经理;2008年4月至今,任南稳贰号基金经理。

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 管理人对投资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、《南方稳健成长贰号证券投资基金基金合同》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

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求,我司分析了两支投资风格相近的基金——南方稳健基金和南方稳健贰号基金的业绩表现差异。在本报告期内,上述两支基金业绩表现差异在5%之内。

基金名称	本年度净值增长率	差异
南方稳健	33.48%	2.65%
南稳贰号	30.83%	

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

2009年上半年,在国际国内宏观经济逐步复苏和通胀预期抬头双重推动下,上证指数上涨62%,沪深300上涨74%,市场风格也从一季度的中小市值股票和主题投资转向二季度以金融地产为代表的大盘蓝筹股行情。上半年,南方稳健成长贰号基金净值增长30.83%,落后指数表现的主要原因是组合偏防御。虽然基金组在2季度根据市场变化,逐步将防御性行业配置比例较高的组合过渡到相对均衡的组合,增加了金融地产、钢铁等与经济复苏和通胀受益相关的行业的配置比例,但调整仍然显得力度不够。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,目前中国宏观经济正处在由企稳回暖走向平稳较快发展的关键时期,国家宏观政策转向的概率不大。从拉动经济增长的三架马车看,投资仍然有望保持较高增长,我们认为投资于基础设施建设从长期而言有利于我国经济全要素生产率的提高,在我国基础设施水平达到发达国家水平之前不存在过剩的担忧,基础设施建设是我国重要的内需;从上半年房市和车市的回暖看,我们认为消费升级动力仍在,房地产是中国居民最大的内需,仍然是中期经济增长的重要引擎;从出口看,随着美国经济的见底回升,经济出现全球同步复苏的概率加大,下半年出口回暖值得期待。虽然中国经济面临的结构性问题仍然突出,未来复苏之路有坎坷,但长期而言我们坚信中国经济复苏是确定性很高的大概率事件。

随着经济的复苏,上市公司业绩也将逐步改善。在目前宽松的货币环境下,市场的财富效应正将大家的预期从悲观转向乐观,市场主流预期已经从经济是否复苏到担心通胀的来临;估值已经回到历史平均水平,但断言泡沫还为时尚早。总体而言,从宏观经济、国家政策、市场流动性环境、上市公司业绩改善预期、当前估值水平和市场信心多角度分析,市场面临的内外部环境仍然处于比较好的阶段,我们对市场谨慎乐观,资产配置方面将保持积极态度。从通货膨胀的最新演变看,通货膨胀除了传统意义的物价通胀外,资产通胀是我们更加关注的领域。行业配置方面,我们将保持相对均衡的投资组合,在突出金融、地产、资源等领域的配置外,积极参与经济复苏过程中行业景气度回暖过程中的行业轮动机会。

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、风控策略总监、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

本基金合同约定,本基金的收益分配原则为: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,全年分配比例不得低于年度可供分配收益的90%,若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配;本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资人可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值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;基金投资当期出现净亏损,则不进行收益分配;基金当年收益应先弥补上一年度亏损后,才可进行当年收益分配;基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;每一基金份额享有同等分配权;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,本报告期内本基金无需收益分配。

§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

2009年上半年,本基金托管人在对南方稳健成长贰号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

2009年上半年,南方稳健成长贰号证券投资基金的管理人——南方基金管理有限公司在南方稳健成长贰号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,南方稳健成长贰号证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半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稳健成长贰号证券投资基金2009年半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。

中国工商银行股份有限公司资产托管部
2009年8月21日

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:南方稳健成长贰号证券投资基金

报告截止日:2009年06月30日

金额单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2009年6月30日	上年度末 2008年12月31日
资 产:			
银行存款		156,137,820.79	795,870,400.50
结算备付金		6,910,747.85	10,034,494.07
存出保证金		1,606,433.64	2,636,362.86
交易性金融资产		8,411,403,948.57	6,313,568,337.69
其中:股票投资		6,596,492,948.57	4,401,827,354.69
债券投资		1,814,911,000.00	1,911,740,983.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		16,883,235.15	-
应收利息		48,523,004.89	24,516,841.84
应收股利		1,220,794.68	-
应收申购款		2,622,437.66	934,088.78
其他资产		-	-
资产总计		8,645,308,423.23	7,147,560,525.74
负债和所有者权益	附注号	本期末 2009年6月30日	上年度末 2008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		-	99,688,481.35
应付赎回款		16,890,616.91	4,234,189.55
应付管理人报酬	6.4.4.2.1	10,272,148.83	9,358,847.79
应付托管费	6.4.4.2.2	1,712,024.77	1,559,807.96
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		8,894,741.73	4,169,639.39
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
其他负债		1,549,241.30	1,435,457.83
负债合计		39,318,773.54	120,446,423.87
所有者权益:			
实收基金		4,522,880,017.26	4,832,051,256.92
未分配利润		4,083,109,632.43	2,195,062,844.95
所有者权益合计		8,605,989,649.69	7,027,114,101.87
负债和所有者权益总计		8,645,308,423.23	7,147,560,525.74

注:1.报告截止日2009年6月30日,基金份额净值0.8953元,基金份额总额9,612,432,715.17份。

2.后附6.4报表附注为本财务报表的组成部分。

6.2 利润表

会计主体:南方稳健成长贰号证券投资基金

本报告期:2009年01月01日至2009年06月30日

金额单位:人民币元

项 目	附注号	本期金额 2009年1月1日至2009年6月30日	上年度可比期间金额 2008年1月1日至2008年6月30日
一、收入		2,198,313,529.32	-6,322,535,330.50
1.利息收入		33,189,522.06	61,639,210.21
其中:存款利息收入		2,184,847.68	7,143,520.33
债券利息收入		31,004,674.38	54,495,689.88
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)		-422,711,397.62	-295,227,076.14
其中:股票投资收益		-462,013,682.52	-365,607,560.52
债券投资收益		-323,567.94	2,292,549.10
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	8,576,982.63
股利收益		39,625,852.84	59,510,952.65
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		2,587,081,512.16	-6,093,974,665.67
4.其他收入(损失以“-”号填列)		753,892.72	5,027,201.10
二、费用		-92,045,308.65	-231,198,990.94
1.管理人报酬	6.4.4.2.1	-57,682,007.51	-110,963,859.31
2.托管费	6.4.4.2.2	-9,613,667.89	-18,493,976.53
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		-24,504,249.31	-87,138,587.45
5.利息支出		-	-14,349,400.86
其中:卖出回购金融资产支出		-	-14,349,400.86
6.其他费用		-245,383.94	-253,166.79
三、利润总额		2,106,268,220.67	-6,553,734,321.44
四、净利润		2,106,268,220.67	-6,553,734,321.44

后附6.4报表附注为本财务报表的组成部分。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:南方稳健成长贰号证券投资基金

本报告期:2009年01月01日至2009年06月30日

金额单位:人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年6月30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)	4,832,051,256.92	2,195,062,844.95	7,027,114,101.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,106,268,220.67	2,106,268,220.67
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)	-309,171,239.66	-218,221,433.19	-527,392,672.85
其中:1.基金申购款	45,603,655.09	30,082,389.51	75,686,044.60
2.基金赎回款(以“-”号填列)	-354,774,894.75	-248,303,822.70	-603,078,717.45
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	4,522,880,017.26	4,083,109,632.43	8,605,989,649.69
项目	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30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)	6,581,847,125.73	13,780,082,890.70	20,361,930,016.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-6,553,734,321.44	-6,553,734,321.44
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)	-1,405,534,984.20	-2,305,599,078.43	-3,711,134,062.63
其中:1.基金申购款	111,135,100.82	199,325,542.67	310,460,643.49
2.基金赎回款(以“-”号填列)	-1,516,670,085.02	-2,504,924,621.10	-4,021,594,706.12
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	5,176,312,141.53	4,920,749,490.83	10,097,061,632.36

后附6.4报表附注为本财务报表的组成部分。

6.4 报表附注

6.4.1 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。

6.4.2 差错更正的说明

本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日至2009年6月30日		上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30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	447,767,893.47	2.80%	2,073,700,218.25	8.07%

6.4.4.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日至2009年6月30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	363,814.20	2.71%	363,814.20	4.09%
关联方名称	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30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	1,684,893.86	7.83%	714,545.73	7.40%

注:1、上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券风险结算基金后的净额列示。

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。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

金额单位:人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年6月30日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日
当期应支付的管理费	57,682,007.51	110,963,859.31
其中:当期已支付	47,409,858.68	97,544,388.24
期末未支付	10,272,148.83	13,419,471.07

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1.5%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 1.5%/当年天数。

6.4.4.2.2 基金托管费

金额单位:人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年6月30日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日
当期应支付的托管费	9,613,667.89	18,493,976.53
其中:当期已支付	7,901,643.12	16,257,397.98
期末未支付	1,712,024.77	2,236,578.55

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0.25%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 0.25%/当年天数。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

金额单位:人民币元

	本期 2009年1月1日至2009年6月30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	-	-	-	-	-	-
	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30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	96,091,900.00	-	-	-	1,000,000,000.00	1,139,726.03

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无

6.4.4.4.2 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

6.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日至2009年6月30日		上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30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	156,137,820.79	2,111,504.28	27,586,355.80	6,964,809.84

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。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无

6.4.5 期末(2009年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 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

6.4.5.1.1 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
600122	宏图高科	2009年01月14日	2010年01月14日	非公开发行流通受限	7.14	9.66	2,250,000.00	16,065,000.00	21,735,000.00

6.4.5.1.2 受限证券类别:债券

无

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌股票

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
000792	盐湖钾肥	2009年06月26日	资产重组	55.14	2009年07月27日	60.65	552,592.00	50,340,297.49	30,469,922.88
000400	许继电气	2009年06月05日	资产重组	18.28	2009年07月06日	20.11	1,063,764.00	13,050,771.51	19,445,605.92
000776	S延边路	2006年10月20日	股权分置	10.55	未知	未知	2,457,200.00	26,049,262.50	25,923,460.00

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

无

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

无

§7 投资组合报告

7.1 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	6,596,492,948.57	76.30
	其中:股票	6,596,492,948.57	76.30
2	固定收益投资	1,814,911,000.00	20.99
	其中:债券	1,814,911,000.00	20.99
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	163,048,568.64	1.89
6	其他资产	70,855,906.02	0.82
7	合计	8,645,308,423.23	100.00

7.2 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	28,200,000.00	0.33
B	采掘业	761,489,483.38	8.85
C	制造业	2,283,331,496.06	26.53
C0	食品、饮料	875,709,576.54	10.18
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	16,170,000.00	0.19
C4	石油、化学、塑胶、塑料	119,849,240.50	1.39
C5	电子	14,449,100.00	0.17
C6	金属、非金属	644,716,576.41	7.49
C7	机械、设备、仪表	468,245,748.95	5.44
C8	医药、生物制品	144,191,253.66	1.68
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	27,889,449.01	0.32
E	建筑业	181,350,024.16	2.11
F	交通运输、仓储业	375,689,681.62	4.37
G	信息技术业	355,071,509.01	4.13
H	批发和零售贸易	171,648,734.45	1.99
I	金融、保险业	1,617,517,984.27	18.80
J	房地产业	486,529,960.57	5.65
K	社会服务业	70,702,369.10	0.82
L	传播与文化产业	237,072,256.94	2.75
M	综合类	-	-
	合计	6,596,492,948.57	76.65

7.3 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	600519	贵州茅台	3,237,162.00	479,132,347.62	5.57
2	600036	招商银行	17,662,045.00	395,806,428.45	4.60
3	000895	双汇发展	8,854,192.00	318,750,912.00	3.70
4	600000	浦发银行	12,532,873.00	288,506,736.46	3.35
5	601318	中国平安	4,981,404.00	246,380,241.84	2.86
6	000002	万 科A	18,009,946.00	229,626,811.50	2.67
7	600016	民生银行	27,660,170.00	219,068,546.40	2.55
8	600028	中国石化	20,055,463.00	213,791,235.58	2.48
9	000898	鞍钢股份	13,615,106.00	179,583,248.14	2.09
10	600392	太工天成	7,804,638.00	177,789,653.64	2.07

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网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内权益投资组合的重大变动

7.4.1 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	730,294,462.02	10.39
2	600837	海通证券	556,903,423.87	7.93
3	600036	招商银行	315,703,196.62	4.49
4	600000	浦发银行	279,675,119.22	3.98
5	601939	建设银行	249,169,243.61	3.55
6	601318	中国平安	245,244,584.45	3.49
7	600016	民生银行	218,527,501.14	3.11
8	000002	万 科A	200,991,766.71	2.86
9	600028	中国石化	195,366,819.46	2.78
10	600392	太工天成	184,256,967.22	2.62
11	600031	三一重工	182,837,818.65	2.60
12	601866	中海集运	156,479,920.32	2.23
13	600018	上港集团	145,218,546.01	2.07
14	601601	中国太保	133,440,521.66	1.90
15	000898	鞍钢股份	131,421,770.11	1.87
16	601088	中国神华	126,979,321.77	1.81
17	601628	中国人寿	118,729,594.11	1.69
18	600050	中国联通	113,046,757.21	1.61
19	600739	辽宁成大	107,810,843.87	1.53
20	600089	特变电工	105,513,277.87	1.50

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。

7.4.2 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	686,452,609.21	9.77
2	600837	海通证券	543,065,252.67	7.73
3	000623	吉林敖东	515,268,206.83	7.33
4	000792	盐湖钾肥	487,236,819.95	6.93
5	600739	辽宁成大	396,208,069.39	5.64
6	601939	建设银行	271,831,716.84	3.87
7	000858	五粮液	264,602,718.33	3.77
8	600325	华发股份	206,455,476.08	2.94
9	000999	三九医药	186,912,948.20	2.66
10	600048	保利地产	181,673,257.12	2.59
11	000685	中山公用	165,508,639.59	2.36
12	600383	金地集团	164,593,854.00	2.34
13	600031	三一重工	156,720,604.11	2.23
14	600050	中国联通	145,440,312.19	2.07
15	000629	攀钢钢钒	142,952,583.93	2.03
16	601866	中海集运	122,078,825.98	1.74
17	600598	北大荒	112,807,555.89	1.61
18	601601	中国太保	109,225,834.55	1.55
19	600816	安信信托	107,167,788.07	1.53
20	600089	特变电工	104,468,393.24	1.49

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。

7.4.3 买入股票的成