(上接C10版)

报告期末按行业分类的股票投资组合

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	采掘业	206,239,194.52	7.92
C	制造业	1,019,821,878.46	39.16
C0	食品、饮料	271,635,870.34	10.43
C1	纺织、服装、皮毛	52,599,614.78	2.02
C2	木材、家具		
C3	造纸、印刷		
C4	石油、化学、塑胶、塑料	24,795,851.96	0.95
C5	电子	47,049,746.94	1.81
C6	金属、非金属	141,822,184.32	5.45
C7	机械、设备、仪表	328,278,963.85	12.60
C8	医药、生物制品	153,639,645.77	5.90
C99	其他制造业		
D	电力、煤气及水的生产和供应业		
E	建筑业		
F	交通运输、仓储业	201,961,392.57	7.75
G	信息技术业	82,088,571.37	3.15
H	批发和零售贸易	364,797,601.38	14.01
I	金融、保险业		
J	房地产业	444,349,342.62	17.06
K	社会服务业	116,078,126.46	4.46
L	传播与文化产业		
M	综合类		
	合计	2,435,336,107.38	93.50

报告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

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	600406	国电南瑞	10,805,853	201,961,392.57	7.75
2	600519	贵州茅台	605,730	144,860,329.50	5.56
3	600240	华业地产	13,465,844	120,923,279.12	4.64
4	000581	威孚高科	3,056,825	83,757,005.00	3.22
5	600216	浙江医药	3,131,465	78,756,344.75	3.02
6	000651	格力电器	3,650,827	76,119,742.95	2.92
7	600030	中信证券	5,892,585	74,423,348.55	2.86
8	000009	中国宝安	12,929,809	73,829,209.39	2.83
9	600318	中国中	1,539,908	70,435,391.92	2.70
10		苏宁环球	8,265,254	66,948,557.40	2.57

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	136,965,000.00	5.26
3	金融债券		
	其中：政策性金融债		
4	企业债券		
5	企业短期融资券		
6	中期票据		
7	可转债		
8	其他		
9	合计	136,965,000.00	5.26

报告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

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	1101094	11央行票据94	700,000	67,872,000.00	2.61
2	1001037	10央行票据37	400,000	40,020,000.00	1.54
3	1101088	11央行票据88	300,000	29,073,000.00	1.12

基金投资组合

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,435,336,107.38	93.23
	其中：股票	2,435,336,107.38	93.23
2	固定收益投资	136,965,000.00	5.24
	其中：债券	136,965,000.00	5.24
	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：买入返售金融资产		

（续表）

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,080,924.79
2	应收证券清算款	19,812,729.69
3	应收股利	
4	应收利息	2,131,219.60
5	应收申购款	555,035.34
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	24,579,909.42

申购费率表

申购金额(M)	申购费率
M<100万	1.5%
100万≤M<500万	0.9%
500万≤M<1000万	0.6%
M≥1000万	每笔1000元

持有期限(N)	赎回费率
N<1年	1.8%
1年≤N<2年	1.5%
2年≤N<3年	1.2%
3年≤N<4年	0.9%
4年≤N<5年	0.3%
N≥5年	0

南方基金管理有限公司
二〇一二年十月三十一日