（上接B274版）

本基金 2013年2月18日(基金合同生效日)至2013年6月30日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2013年6月30日的财务状况以及 2013年2月18日(基金合同生效日)至2013年6月30日止期间 的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2013年2月18日(基金合同生效日)至2013年6月30日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括和各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购、赎回以及配对转换引起的实收基金变动分别于基金申购确认日、基金赎回确认日及基金配对转换确认日认列。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润 /(累计亏损)。

6.4.4.9 收入 /(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到1%以上时，基金管理人可进行收益分配。本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会基金部通知[2006]37号《关于进一步加强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(2)在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行 < 企业会计准则 > 估值业务及份额净值计价有关事项的通知》 采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时代扣代缴个人所得税，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 本报告期各关联方

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”)	基金管理人、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
兴业证券股份有限公司(“兴业证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
厦门国际信托有限公司(“厦门信托”)	基金管理人的股东
深圳市投资控股有限公司	基金管理人的股东
南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金(南方300联接)	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

无。

6.4.8.1.2 权证交易

无。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年2月18日至2013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	-	-	25,311.71	1.84%

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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013年2月18日至2013年6月30日
当期应支付的管理费	4,137,194.48
其中：支付销售机构的客户维护费	-

注：支付基金管理人南方基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.5%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 0.5% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013年2月18日至2013年6月30日
当期应支付的托管费	827,438.91

注：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0.1%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 0.1% / 当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2013年2月18日至2013年6月30日
基金合同生效日(2013年2月18日)持有的基金份额	50,686,168.00
期间申购 / 买入总份额	-
期间因拆分增加的份额	-6,248,272.00
期间赎回 / 卖出总份额	-
期末持有的基金份额	44,437,896.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.92%

6.4.8.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2013年6月30日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华泰证券	41,756,295.00	1.81%
南方300联接	864,409,669.00	37.37%

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年2月18日至2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
活期存款	15,642,188.69	565,212.99

注：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。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发 / 增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.9.2 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	备注
000999	华润三九	2013年6月3日	重大事项未公告	29.60	2013年8月19日	26.51	152,701.00	4,415,513.37	4,519,949.60	-
600598	北大荒	2013年5月27日	重大事项未公告	8.35	2013年7月19日	8.35	315,671.00	2,819,113.42	2,635,852.85	-
601918	国投新集	2013年5月16日	重大事项未公告	7.55	2013年8月23日	5.05	234,260.00	2,027,547.66	1,768,663.00	-
601989	中国重工	2013年5月17日	重大事项未公告	4.52	未知	未知	1,900,718.00	9,213,170.06	8,591,245.36	-

注：本基金截至2013年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

§7 投资组合报告(转型前)

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	1,393,067,624.43	72.18
	其中：股票	1,393,067,624.43	72.18
2	固定收益投资	88,052,000.00	4.56
	其中：债券	88,052,000.00	4.56
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	350,000,000.00	18.14
	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	95,697,152.16	4.96
6	其他资产	3,074,998.69	0.16
7	合计	1,929,891,775.28	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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	8,095,405.80	0.44
B	采矿业	144,161,838.57	7.78
C	制造业	474,094,603.64	25.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	34,984,758.88	1.89
E	建筑业	50,955,859.44	2.75
F	批发和零售业	33,808,802.92	1.82
G	交通运输、仓储和邮政业	32,462,961.73	1.75
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,383,269.71	1.26
J	金融业	488,049,616.08	26.33
K	房地产业	73,598,535.20	3.97
L	租赁和商务服务业	8,132,404.72	0.44
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	6,287,280.50	0.34
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,451,748.11	0.08
S	综合	13,600,539.13	0.73
	合计	1,393,067,624.43	75.14

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	600016	民生银行	5,556,403	58,453,359.56	3.15
2	600036	招商银行	3,476,550	48,810,762.00	2.63
3	601318	中国平安	824,158	42,765,558.62	2.31
4	601166	兴业银行	1,874,724	36,744,590.40	1.98
5	600000	浦发银行	2,753,167	31,220,913.78	1.68
6	601328	交通银行	5,499,509	29,037,407.52	1.57
7	600837	海通证券	1,990,625	26,415,593.75	1.42
8	600030	中信证券	1,694,159	26,259,464.50	1.42
9	000002	万科A	2,147,900	25,839,237.00	1.39
10	601088	中国神华	811,287	20,152,369.08	1.09

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 的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	47,236,039.79	2.70
2	600016	民生银行	45,591,228.06	2.61
3	601318	中国平安	38,127,318.37	2.18
4	601166	兴业银行	32,075,001.34	1.83
5	600000	浦发银行	27,993,510.21	1.60
6	601328	交通银行	27,594,392.80	1.58
7	000002	万科A	25,617,427.60	1.46
8	600030	中信证券	22,315,525.15	1.28
9	600519	贵州茅台	21,255,036.20	1.22
10	601088	中国神华	20,252,511.67	1.16
11	600837	海通证券	20,115,776.04	1.15
12	601288	农业银行	17,663,980.36	1.01
13	601601	中国太保	17,204,952.68	0.98
14	601939	建设银行	15,459,022.75	0.88
15	000651	格力电器	15,418,847.18	0.88
16	600048	保利地产	14,595,059.36	0.83
17	601668	中国建筑	14,221,491.89	0.81
18	600104	上汽集团	13,870,751.30	0.79
19	601988	中国银行	13,621,357.19	0.78
20	600111	包钢稀土	13,113,807.67	0.75

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601989	中国重工	127,865,113.06	7.31
2	601766	中国南车	120,722,978.99	6.90
3	600598	北大荒	106,632,710.45	6.10
4	600547	山东黄金	101,786,380.90	5.82
5	601919	中国远洋	93,432,979.72	5.34
6	600489	中金黄金	84,511,716.11	4.83
7	600150	中国船舶	78,784,897.20	4.50
8	601299	中国北车	77,065,273.71	4.41
9	600583	海油工程	74,526,652.48	4.26
10	600863	内蒙华电	69,825,017.44	3.99
11	600739	辽宁成大	68,170,042.65	3.90
12	601899	紫金矿业	56,697,142.40	3.24
13	600072	中船股份	39,065,726.45	2.23
14	601808	中海油服	37,644,319.22	2.15
15	000983	西山煤电	23,216,115.61	1.33
16	000630	铜陵有色	18,729,018.94	1.07
17	600362	江西铜业	14,774,332.04	0.84
18	600058	五矿发展	13,722,645.74	0.78
19	600808	马钢股份	13,713,923.20	0.78
20	002155	辰州矿业	8,467,987.80	0.48

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 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本(成交)总额	1,182,248,990.22
卖出股票收入(成交)总额	1,235,171,223.01

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：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	28,046,000.00	1.51
2	央行票据	-	-
3	金融债券	60,006,000.00	3.24
	其中：政策性金融债	60,006,000.00	3.24
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	88,052,000.00	4.75

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：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	030201	03国开01	400,000	40,004,000.00	2.16
2	060001	06国债01	200,000	20,006,000.00	1.08
3	070228	07国开28	200,000	20,002,000.00	1.08
4	010308	03国债(8)	80,000	8,040,000.00	0.43

注：除以上债券外，本基金本报告期末未持有其他债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.10.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.10.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	290,579.90
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,784,418.79
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,074,998.69

7.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

§7 投资组合报告(转型后)

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	1,944,788,220.95	98.63
	其中：股票	1,944,788,220.95	98.63
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	15,961,909.85	0.81
6	其他资产	10,966,771.14	0.56
7	合计	1,971,716,901.94	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	11,595,827.67	0.59
B	采矿业	145,508,254.46	7.41
C	制造业	691,048,994.79	35.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	62,647,802.49	3.19
E	建筑业	78,514,300.86	4.00
F	批发和零售业	51,162,363.81	2.60
G	交通运输、仓储和邮政业	41,689,499.76	2.12
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	40,587,462.14	2.07
J	金融业	656,931,714.75	33.44
K	房地产业	110,611,326.06	5.63
L	租赁和商务服务业	12,342,658.18	0.63
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	11,624,536.90	0.59
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	5,254,266.14	0.27
S	综合	25,269,212.94	1.29
	合计	1,944,788,220.95	99.00

7.2.2 积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细(转型后)

7.3.1 期末指数投资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	600016	民生银行	9,522,080	81,604,225.60	4.15
2	600036	招商银行	5,957,853	69,111,094.80	3.52
3	601318	中国平安	1,412,461	49,097,144.36	2.50
4	601166	兴业银行	3,212,697	47,451,534.69	2.42
5	000002	万科A	4,080,771	40,195,594.35	2.05
6	600000	浦发银行	4,718,105	39,065,909.40	1.99
7	600519	贵州茅台	175,106	33,685,141.22	1.71
8	600837	海通证券	3,411,340	31,998,369.20	1.63
9	600030	中信证券	2,903,322	29,410,651.86	1.50
10	601328	交通银行	6,618,609	26,937,738.63	1.37

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 的半年度报告正文。

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	600157	永泰能源	201,641,656.90	10.27
2	600266	北京城建	190,875,056.27	9.72
3	002106	莱宝高科	149,704,582.09	7.62
4	600016	民生银行	113,469,433.10	5.78
5	601318	中国平安	104,652,597.54	5.33
6	601179	中国西电	98,043,222.81	4.99
7	601106	中国一重	96,719,078.54	4.92
8	600036	招商银行	90,464,005.53	4.61
9	601166	兴业银行	69,816,744.21	3.55
10	600125	铁龙物流	59,446,726.29	3.03
11	600000	浦发银行	58,364,271.66	2.97
12	601398	工商银行	57,153,438.90	2.91
13	000002	万科A	55,638,108.78	2.83
14	002344	海宁皮城	53,309,197.54	2.71
15	600519	贵州茅台	44,855,693.36	2.28
16	600030	中信证券	44,296,510.69	2.26
17	601328	交通银行	43,503,521.16	2.21
18	600837	海通证券	43,483,553.22	2.21
19	600352	浙江龙盛	36,249,443.22	1.85
20	601088	中国神华	35,788,767.82	1.82

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末基金资产净值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	600266	北京城建	171,891,567.99	8.75
2	600157	永泰能源	148,209,291.41	7.54
3	002106	莱宝高科	144,484,223.34	7.36
4	601179	中国西电	91,085,330.66	4.64
5	601106	中国一重	88,572,575.76	4.51
6	600125	铁龙物流	49,492,378.57	2.52
7	002344	海宁皮城	49,277,579.67	2.51
8	601318	中国平安	37,541,504.39	1.91
9	600352	浙江龙盛	33,979,743.98	1.73
10	601333	广深铁路	26,011,754.36	1.32
11	601669	中国水电	16,994,640.44	0.87
12	601216	内蒙君正	12,235,493.82	0.62
13	601988	中国银行	10,060,400.66	0.51
14	000581	威孚高科	9,432,315.08	0.48
15	002236	大华股份	8,394,186.24	0.43
16	601328	交通银行	8,324,861.24	0.42
17	000970	中科三环	6,861,597.07	0.35
18	600489	中金黄金	5,566,128.22	0.28
19	601939	建设银行	5,180,391.05	0.26
20	000783	长江证券	4,700,959.90	0.24

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 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本(成交)总额	2,552,217,946.82
卖出股票收入(成交)总额	1,121,815,060.57

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.10.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.10.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,092,057.36
2	应收证券清算款	4,302,466.26
3	应收股利	5,569,430.78
4	应收利息	2,816.74
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,966,771.14

7.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.10.5 末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

§8 基金份额持有人信息(转型前)

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比