2008年年度报告摘要

基金管理人:鹏华基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
送出日期:2009年3月27日

1 重要提示

1.1 本年度报告摘要来自年度报告全文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告全文。

1.2 本基金管理人董事会、董事保证本年度报告摘要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、准确、完整承担个别和连带责任。

1.3 本基金托管人中国建设银行股份有限公司董事会、董事保证本年度报告摘要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、准确、完整承担个别和连带责任。

1.4 本基金年度报告摘要于2009年3月27日分别在中国证监会指定的报刊和网站上刊登。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华价值优势股票型证券投资基金(LOF)
基金简称	鹏华价值(LOF)
基金主代码	160607
交易代码	160607
基金运作方式	上市开放式
基金合同生效日	2006年07月18日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	16,305,297,163.15份
下属两类基金的交易代码	不适用
该两类基金的最低申购金额	不适用
该两类基金的最低持有量	不适用
该两类基金的基金简称	不适用

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制组合风险的前提下,通过对上市公司内在价值的深入研究,发现具有长期竞争优势的公司,并以合理的价格进行长期投资,在获取较高长期回报的同时,实现基金资产的稳定增值。
投资策略	1、资产配置策略;2、股票投资策略;3、债券投资策略;4、权证投资策略;5、股指期货投资策略;6、资产支持证券投资策略;7、中小企业私募债券投资策略;8、流通受限证券投资策略
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中信标普全债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为股票型证券投资基金,其风险收益特征一般高于债券型基金、混合型基金、保本型基金和货币市场基金,属于较高风险、较高预期收益的品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

		基金管理人	基金托管人
名称		鹏华基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶俊英	田青
	联系电话	0755-82021186	010-67595003
	电子邮箱	ph@mail.phfund.com.cn	yindong@ccb.cn
客户服务电话		4006788999	010-67595096
传真		0755-82021126	010-66275853

2.4 信息披露方式

信息披露方式	http://www.phfund.com.cn
信息披露年度报告摘要置备地点	深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦40层;北京市西城区金融大街25号中国建设银行大厦

3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要财务指标

3.1.1 报告期(2008年1月1日-2008年12月31日)	2008年	2007年	2006年07月18日(基金合同生效日)-2006年12月31日
本期利润	-3,209,445,733.16	1,438,716,070.49	209,275,529.52
本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	-9,710,730,614.55	2,169,686,224.90	724,193,774.90
期末可分配利润	-0.5842	0.3476	0.1469
期末可分配利润占期末基金份额净值比例(%)	-52.53%	131.64%	49.93%

3.1.2 期末数据和指标

3.1.2 报告期末数据和指标	2008年末	2007年末	2006年07月18日(基金合同生效日)-2006年12月31日
期末基金份额总额	16,305,297,163.15	16,305,297,163.15	16,305,297,163.15
期末可分配利润	0.1704	0.4918	0.0984
期末可分配利润占期末基金份额净值比例(%)	8.40%	14.53%	19.68%
期末基金资产净值	8,400,820,507.43	14,536,856,637.91	1,806,546,444.57
期末基金份额净值	0.515	1.085	1.441

注:(1)-(3)分别为本期利润、本期扣减本期公允价值变动损益后的净额、期末可分配利润的三个指标,其数值分别为报告期(2008年1月1日-2008年12月31日)、2007年1月1日-2007年12月31日、2006年07月18日(基金合同生效日)-2006年12月31日三个会计年度的相关数据。

(2)、(3)分别为期末可分配利润和期末可分配利润占期末基金份额净值比例两个指标,其数值分别为截至2008年12月31日、2007年12月31日、2006年12月31日三个时点的数据。

(4)2008年末,2007年末,2006年末的期末基金份额总额、期末可分配利润、期末可分配利润占期末基金份额净值比例、期末基金资产净值、期末基金份额净值数据,分别为截至2008年12月31日、2007年12月31日、2006年12月31日三个时点的数据。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现与同期比较基准

阶段	净值增长率①	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
2007年1月1日-2007年12月31日	131.64%	2.12%	48.78%	1.67%	82.86%	0.45%
2008年1月1日-2008年12月31日	-52.53%	2.41%	-47.68%	2.12%	-4.85%	0.29%
2006年07月18日(基金合同生效日)-2006年12月31日	49.93%	1.31%	19.68%	0.71%	30.25%	0.60%
自基金合同生效日起至报告期末	61.76%	2.16%	26.39%	1.19%	35.37%	0.97%

注:(1)2007年1月1日-2007年12月31日、2008年1月1日-2008年12月31日两个会计年度的净值增长率、净值增长率标准差、业绩比较基准收益率、业绩比较基准收益率标准差分别为报告期(2008年1月1日-2008年12月31日)、2007年1月1日-2007年12月31日两个时点的数据。

(2)2006年07月18日(基金合同生效日)-2006年12月31日的净值增长率、净值增长率标准差、业绩比较基准收益率、业绩比较基准收益率标准差分别为截至2006年12月31日一个时点的数据。

(3)2006年07月18日(基金合同生效日)-2006年12月31日的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×80%+中信标普全债指数收益率×20%。

(4)自基金合同生效日起至报告期末的净值增长率、净值增长率标准差、业绩比较基准收益率、业绩比较基准收益率标准差分别为截至2008年12月31日一个时点的数据。

3.2.2 基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

鹏华价值优势股票型证券投资基金(LOF)
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2006年07月18日-2008年12月31日)

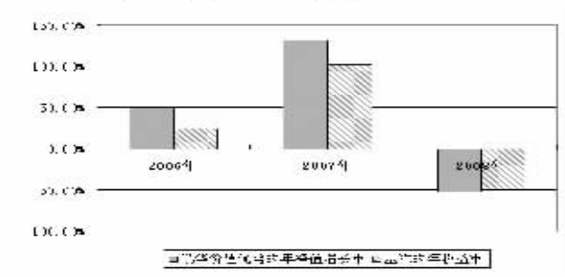
注:(1)2006年07月18日-2006年12月31日为本基金合同生效日至本年度末不足一个完整会计年度的期间。

(2)2006年07月18日-2006年12月31日的净值增长率、净值增长率标准差、业绩比较基准收益率、业绩比较基准收益率标准差分别为截至2006年12月31日一个时点的数据。

(3)2006年07月18日-2006年12月31日的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×80%+中信标普全债指数收益率×20%。

3.2.3 基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

鹏华价值优势股票型证券投资基金(LOF)
合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图



注:(1)2006年07月18日-2006年12月31日为本基金合同生效日至本年度末不足一个完整会计年度的期间。

(2)2006年07月18日-2006年12月31日的净值增长率、净值增长率标准差、业绩比较基准收益率、业绩比较基准收益率标准差分别为截至2006年12月31日一个时点的数据。

3.3 基金管理人管理费、托管费、销售服务费、申购费、赎回费、业绩报酬计提、支付的方法

费用种类	计提比例	计提方法	计提时间	支付方法
管理费	1.50%	前一日基金资产净值	每日	基金管理人与基金托管人核对后,由基金托管人按照与基金管理人约定的方式支付给基金管理人
托管费	0.25%	前一日基金资产净值	每日	基金管理人与基金托管人核对后,由基金托管人按照与基金管理人约定的方式支付给基金托管人
销售服务费	0%			
申购费(含转换费)	最高1.50%	申购金额	申购日	投资者向基金管理人或其代理人申购基金时,由投资者支付
赎回费	0.5%	赎回金额	赎回日	投资者赎回基金时,由赎回人支付
业绩报酬				

4 管理人报告

4.1 基金管理人对本报告期内基金运作遵守有关法律法规情况的说明

4.1.1 基金管理人对本报告期内基金运作遵守有关法律法规情况的说明

本报告期内,本基金管理人的运作基本符合有关法律法规的规定。

(1)本报告期内,本基金管理人的董事、监事、高级管理人员未发生重大变动。

(2)本报告期内,本基金管理人的重大诉讼事项:

①本报告期内,本基金管理人作为原告方的诉讼事项:

1)本基金管理人于2007年12月10日向上海证券交易所提交了对中国证券登记结算有限责任公司的诉讼材料,要求确认其对证券登记结算机构的结算参与人资格。2008年1月,上海证券交易所受理了本基金管理人的诉讼材料。2008年3月,本基金管理人收到上海证券交易所的通知,上海证券交易所决定不受理本基金管理人的诉讼。本基金管理人对上海证券交易所的决定不服,于2008年3月向中国证监会提交了复议申请。

②本报告期内,本基金管理人作为被告方的诉讼事项:

1)2008年1月,本基金管理人收到上海证券交易所的通知,上海证券交易所决定不受理本基金管理人的诉讼。本基金管理人对上海证券交易所的决定不服,于2008年3月向中国证监会提交了复议申请。

4.1.2 基金管理人对本报告期内基金运作遵守有关法律法规情况的说明

本报告期内,本基金管理人的运作基本符合有关法律法规的规定。

4.2 基金管理人对本报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.2.1 本报告期内,本基金管理人的投资策略和业绩表现的说明

本报告期内,本基金管理人的投资策略和业绩表现的说明

4.2.2 本报告期内,本基金管理人的投资策略和业绩表现的说明

本报告期内,本基金管理人的投资策略和业绩表现的说明

4.3 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内,本基金管理人对本报告期内基金利润分配情况的说明

4.4 管理人对报告期内基金投资组合的说明

本报告期内,本基金管理人对本报告期内基金投资组合的说明

4.5 管理人对报告期内基金投资组合的说明

本报告期内,本基金管理人对本报告期内基金投资组合的说明

4.6 管理人对报告期内基金投资组合的说明

本报告期内,本基金管理人对本报告期内基金投资组合的说明

4.7 管理人对报告期内基金投资组合的说明

本报告期内,本基金管理人对本报告期内基金投资组合的说明

4.8 管理人对报告期内基金投资组合的说明

本报告期内,本基金管理人对本报告期内基金投资组合的说明

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵守有关法律法规情况的说明

本报告期内,本基金托管人遵守有关法律法规情况的说明

5.2 报告期内本基金托管人对本报告期内基金投资组合的说明

本报告期内,本基金托管人对本报告期内基金投资组合的说明

5.3 报告期内本基金托管人对本报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内,本基金托管人对本报告期内基金利润分配情况的说明

6 审计报告

本报告期内,本基金管理人的董事、监事、高级管理人员未发生重大变动。

7 年度财务报表

7.1 资产负债表

本报告期内,本基金管理人的董事、监事、高级管理人员未发生重大变动。

7.2 利润表

本报告期内,本基金管理人的董事、监事、高级管理人员未发生重大变动。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

本报告期内,本基金管理人的董事、监事、高级管理人员未发生重大变动。

7.4 投资组合报告

7.4.1 报告期末按证券品种分类的投资组合

序号	证券代码	证券名称	市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000933	神火股份	734,958,063.16	5.06
2	600036	招商银行	686,513,187.91	4.72
3	600009	上海机场	660,424,264.83	4.54
4	000069	华侨城A	616,224,069.68	4.24
5	600016	民生银行	567,672,528.82	3.91
6	601318	中国平安	542,923,649.00	3.73
7	600000	浦发银行	502,762,465.82	3.46
8	601398	工商银行	345,999,298.82	2.38
9	600569	安阳钢铁	286,941,694.19	1.97
10	601328	交通银行	264,985,814.21	1.82
11	000002	万科A	260,537,179.73	1.79
12	600808	马钢股份	252,744,572.45	1.74
13	600309	烟台万华	247,538,770.03	1.70
14	601628	中国人寿	237,925,257.24	1.64
15	601006	大秦铁路	232,833,319.93	1.60
16	002024	苏宁电器	221,250,862.74	1.52
17	000063	中兴通讯	219,356,204.01	1.51
18	600150	沪东重机	209,296,537.70	1.44
19	000012	南玻A	208,240,475.11	1.43
20	600963	岳阳林纸	207,610,805.53	1.43

7.4.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	金属非金属	2,555,000,000.00	17.57
2	金融保险	1,811,000,000.00	12.46
3	交通运输仓储	1,260,000,000.00	8.67
4	综合类	1,000,000,000.00	6.88
5	电子	800,000,000.00	5.50
6	房地产	700,000,000.00	4.81
7	医药生物	600,000,000.00	4.13
8	信息技术业	500,000,000.00	3.44
9	社会服务业	400,000,000.00	2.75
10	石油化学塑胶塑料	300,000,000.00	2.06

7.4.3 报告期末按市场类别分类的股票投资组合

序号	市场类别	市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	主板	14,500,000,000.00	99.72
2	中小板	40,000,000.00	0.28
3	创业板		

7.4.4 报告期末按流通受限情况分类的股票投资组合

序号	流通受限情况	市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	流通受限	14,540,000,000.00	100.00
2	非流通受限		

7.4.5 报告期末按市值排序的前十名股票投资组合

序号	证券代码	证券名称	市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000933	神火股份	734,958,063.16	5.06
2	600036	招商银行	686,513,187.91	4.72
3	600009	上海机场	660,424,264.83	4.54
4	000069	华侨城A	616,224,069.68	4.24
5	600016	民生银行	567,672,528.82	3.91
6	601318	中国平安	542,923,649.00	3.73
7	600000	浦发银行	502,762,465.82	3.46
8	601398	工商银行	345,999,298.82	2.38
9	600569	安阳钢铁	286,941,694.19	1.97
10	601328	交通银行	264,985,814.21	1.82
11	000002	万科A	260,537,179.73	1.79
12	600808	马钢股份	252,744,572.45	1.74
13	600309	烟台万华	247,538,770.03	1.70
14	601628	中国人寿	237,925,257.24	1.64
15	601006	大秦铁路	232,833,319.93	1.60
16	002024	苏宁电器	221,250,862.74	1.52
17	000063	中兴通讯	219,356,204.01	1.51
18	600150	沪东重机	209,296,537.70	1.44
19	000012	南玻A	208,240,475.11	1.43
20	600963	岳阳林纸	207,610,805.53	1.43

7.4.6 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债		
2	金融债券		
3	企业债券		
4	可转换债券		
5	其他		

7.4.7 报告期末按市值排序的前五名债券投资组合

序号	债券代码	债券名称	市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1				
2				
3				
4				
5				

7.4.8 报告期末按流通受限情况分类的债券投资组合

序号	流通受限情况	市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	流通受限		
2	非流通受限		

7.4.9 报告期末按市值排序的前十名股票投资组合

序号	证券代码	证券名称	市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000933	神火股份	734,958,063.16	5.06
2	600036	招商银行	686,513,187.91	4.72
3	600009	上海机场	660,424,264.83	4.54
4	000069	华侨城A	616,224,069.68	4.24
5	600016	民生银行	567,672,528.82	3.91
6	601318	中国平安	542,923,649.00	3.73
7	600000	浦发银行	502,762,465.82	3.46
8	601398	工商银行	345,999,298.82	2.38
9	600569	安阳钢铁	286,941,694.19	1.97
10	601328	交通银行	264,985,814.21	1.82
11	000002	万科A	260,537,179.73	1.79
12	600808	马钢股份	252,744,572.45	1.74
13	600309	烟台万华	247,538,770.03	1.70
14	601628	中国人寿	237,925,257.24	1.64
15	601006	大秦铁路	232,833,319.93	1.60
16	002024	苏宁电器	221,250,862.74	1.52
17	000063	中兴通讯	219,356,204.01	1.51
18	600150	沪东重机	209,296,537.70	1.44
19	000012	南玻A	208,240,475.11	1.43
20	600963	岳阳林纸	207,610,805.53	1.43

7.4.10 报告期末按市值排序的前五名债券投资组合

序号	债券代码	债券名称	市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1				
2				
3				
4				
5				

7.4.11 报告期末按流通受限情况分类的债券投资组合

序号	流通受限情况	市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	流通受限		
2	非流通受限		

7.4.12 报告期末按市值排序的前十名股票投资组合

序号	证券代码	证券名称	市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000933	神火股份	734,958,063.16	5.06
2	600036	招商银行	686,513,187.91	4.72
3	600009	上海机场	660,424,264.83	4.54
4	000069	华侨城A	616,224,069.68	4.24
5	600016	民生银行	567,672,528.82	3.91
6	601318	中国平安	542,923,649.00	3.73
7	600000	浦发银行	502,762,465.82	3.46
8	601398	工商银行	345,999,298.82	2.38
9	600569	安阳钢铁	286,941,694.19	1.97
10	601328	交通银行	264,985,814.21	1.82
11	000002	万科A	260,537,179.73	1.79
12	600808	马钢股份	252,744,572.45	1.74
13	600309	烟台万华	247,538,770.03	1.70
14	601628	中国人寿	237,925,257.24	1.64
15	601006	大秦铁路	232,833,319.93	1.60
16	002024	苏宁电器	221,250,862.74	1.52
17	000063	中兴通讯	219,356,204.01	1.51
18	600150	沪东重机	209,296,537.70	1.44
19	000012	南玻A	208,240,475.11	1.43
20	600963	岳阳林纸	207,610,805.53	1.43

7.4.13 报告期末按市场类别分类的股票投资组合

序号	市场类别	市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	主板	14,500,000,000.00	99.72
2	中小板	40,000,000.00	0.28
3	创业板		

7.4.14 报告期末按流通受限情况分类的股票投资组合

序号	流通受限情况	市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	流通受限	14,540,000,000.00	100.00
2	非流通受限		

7.4.15 报告期末按市值排序的前十名股票投资组合

序号	证券代码	证券名称	市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000933	神火股份	734,958,063.16	5.06
2	600036	招商银行	686,513,187.91	4.72
3	600009	上海机场	660,424,264.83	4.54
4	000069	华侨城A	616,224,069.68	4.24
5	600016	民生银行	567,672,528.82	3.91
6	601318	中国平安	542,923,649.00	3.73
7	600000	浦发银行	502,762,465.82	3.46
8	601398	工商银行	345,999,298.82	2.38
9	600569	安阳钢铁	286,941,694.19	1.97
10	601328	交通银行	264,985,814.21	1.82
11	000002	万科A	260,537,179.73	1.79
12	600808	马钢股份	252,744,572.45	1.74
13	600309	烟台万华	247,538,770.03	1.70
14	601628	中国人寿	237,925,257.24	1.64
15	601006	大秦铁路	232,833,319.93	1.60
16	002024	苏宁电器	221,250,862.74	1.52
17	000063	中兴通讯	219,356,204.01	1.51
18	600150	沪东重机	209,296,537.70	1.44
19	000012	南玻A	208,240,475.11	1.43
20	600963	岳阳林纸	207,610,805.53	1.43

7.4.16 报告期末按市值排序的前五名债券投资组合

序号	债券代码	债券名称	市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1				
2				
3				
4				
5				

7.4.17 报告期末按流通受限情况分类的债券投资组合

序号	流通受限情况	市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	流通受限		
2	非流通受限		

7.4.18 报告期末按市值排序的前十名股票投资组合

序号	证券代码	证券名称	市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000933	神火股份	734,958,063.16	5.06
2	600036	招商银行	686,513,187.91	4.72
3	600009	上海机场	660,424,264.83	4.54
4	000069	华侨城A	616,224,069.68	4.24
5	600016	民生银行	567,672,528.82	3.91
6	601318	中国平安	542,923,649.00	3.73
7	600000	浦发银行	502,762,465.82	3.46
8	601398	工商银行	345,999,298.82	2.38
9	600569	安阳钢铁	286,941,694.19	1.97
10	601328	交通银行	264,985,814.21	1.82
11	000002	万科A	260,537,179.73	1.79
12	600808	马钢股份	252,744,572.45	1.74
13	600309	烟台万华	247,538,770.03	1.70
14	601628	中国人寿	237,925,257.24	1.64
15	601006	大秦铁路	232,833,319.93	1.60
16	002024	苏宁电器	221,250,862.74	1.52
17	000063	中兴通讯	219,356,204.01	1.51
18	600150	沪东重机	209,296,537.70	1.44
19	000012	南玻A	208,240,475.11	1.43
20	600963	岳阳林纸	207,610,805.53	1.43

7.4.19 报告期末按市场类别分类的股票投资组合

序号	市场类别	市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	主板	14,500,000,000.00	99.72
2	中小板	40,000,000.00	0.28
3	创业板		

7.4.20 报告期末按流通受限情况分类的股票投资组合

序号	流通受限情况	市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	流通受限	14,540,000,000.00	100.00
2	非流通受限		

7.4.21 报告期末按市值排序的前十名股票投资组合

序号	证券代码	证券名称	市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000933	神火股份	734,958,063.16	5.06
2	600036	招商银行	686,513,187.91	4.72
3	600009	上海机场	660,424,264.83	4.54
4	000069	华侨城A	616,224,069.68	4.24
5	600016	民生银行	567,672,528.82	3.91
6	601318	中国平安	542,923,649.00	3.73
7	600000	浦发银行	502,762,465.82	3.46
8	601398	工商银行	345,999,298.82	2.38
9	600569	安阳钢铁	286,941,694.19	1.97
10	601328	交通银行	264,985,814.21	1.82
11	000002	万科A	260,537,179.73	1.79
12	600808	马钢股份	252,744,572.45	1.74
13	600309	烟台万华	247,538,770.03	1.70
14	601628	中国人寿	237,925,257.24	1.64
15	601006	大秦铁路	232,833,319.93	1.60
16	002024	苏宁电器	221,250,862.74	1.52
17	000063	中兴通讯	219,356,204.01	1.51
18	600150	沪东重机	209,296,537.70	1.44
19	000012	南玻A	208,240,475.11	1.43
20	600963	岳阳林纸	207,610,805.53	1.43

7.4.22 报告期末按市值排序的前五名债券投资组合

序号	债券代码	债券名称	市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1				
2				
3				
4				
5				

7.4.23 报告期末按流通受限情况分类的债券投资组合

序号	流通受限情况	市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	流通受限		
2	非流通受限		

7.4.24 报告期末按市值排序的前十名股票投资组合

序号	证券代码	证券名称	市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000933	神火股份	734,958,063.16	5.06
2	600036	招商银行	686,513,187.91	4.72
3	600009	上海机场	660,424,264.83	4.54
4	000069	华侨城A	616,224,069.68	4.24
5	600016	民生银行	567,672,528.82	3.91
6	601318	中国平安	542,923,649.00	3.73
7	600000	浦发银行	502,762,465.82	3.46
8	601398	工商银行	345,999,298.82	2.38
9	600569	安阳钢铁	286,941,694.19	1.97
10	601328	交通银行	264,985,814.21	1.82
11	000002	万科A	260,537,179.73	1.79
12	600808	马钢股份	252,744,572.45	1.74
13	600309	烟台万华	247,538,770.03	1.70
14	601628	中国人寿	237,925,257.24	1.64
15	601006	大秦铁路	232,833,319.93	1.60
16	002024	苏宁电器	221,250,862.74	1.52
17	000063	中兴通讯	219,356,204.01	1.51
18	600150	沪东重机	209,296,537.70	1.44
19	000012	南玻A	208,240,475.11	1.43
20	600963	岳阳林纸	207,610,805.53	1.43

7.4.25 报告期末按市场类别分类的股票投资组合

序号	市场类别	市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	主板	14,500,000,000.00	99.72
2	中小板	40,000,000.00	0.28
3	创业板		

7.4.26 报告期末按流通受限情况分类的股票投资组合

序号	流通受限情况	市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	流通受限	14,540,000,000.00	100.00
2	非流通受限		

7.4.27 报告期末按市值排序的前十名股票投资组合

序号	证券代码	证券名称	市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000933	神火股份	734,958,063.16	5.06
2	600036	招商银行	686,513,187.91	4.72
3	600009	上海机场	660,424,264.83	4.54
4	000069	华侨城A	616,224,069.68	4.24
5	600016	民生银行	567,672,528.82	3.91
6	601318	中国平安	542,923,649.00	3.73
7	600000	浦发银行	502,762,465.82	3.46
8	601398	工商银行	345,999,298.82	2.38
9	600569	安阳钢铁	286,941,694.19	1.97
10	601328	交通银行	264,985,814.21	1.82
11	000002	万科A	260,537,179.73	1.79
12	600808	马钢股份	252,744,572.45	1.74
13	600309	烟台万华	247,538,770.03	1.70
14	601628	中国人寿	237,925,257.24	1.64
15	601006	大秦铁路	232,833,319.93	1.60
16	002024	苏宁电器	221,250,862.74	1.52
17	000063	中兴通讯	219,356,204.01	1.51
18	600150	沪东重机	209,296,537.70	1.44
19	000012	南玻A	208,240,475.11	1.43
20	600963	岳阳林纸	207,610,805.53	1.43

7.4.28 报告期末按市场类别分类的债券投资组合

序号	市场类别	市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债		
2	金融债券		
3	企业债券		
4	可转换债券		
5	其他		

7.4.29 报告期末按流通受限情况分类的债券投资组合

序号	流通受限情况	市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	流通受限		
2	非流通受限		

7.4.30 报告期末按市值排序的前五名债券投资组合

序号	债券代码	债券名称	市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1				
2				
3				
4				
5				

7.4.31 报告期末按流通受限情况分类的债券投资组合

序号	流通受限情况	市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	流通受限		
2	非流通受限		

7.4.32 报告期末按市值排序的前十名股票投资组合

序号	证券代码	证券名称	市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000933	神火股份	734,958,063.16	5.06
2	600036	招商银行	686,513,187.91	4.72
3	600009	上海机场	660,424,264.83	4.54
4	000069	华侨城A	616,224,069.68	4.24
5	600016	民生银行	567,672,528.82	3.91
6	601318	中国平安	542,923,649.00	3.73
7	600000	浦发银行	502,762,465.82	3.46
8	601398	工商银行	345,999,298.82	2.38
9	600569	安阳钢铁	286,941,694.19	1.97
10	601328	交通银行	264,985,814.21	1.82
11	000002	万科A	260,537,179.73	1.79
12	600808	马钢股份	252,744,572.45	1.74
13	600309	烟台万华	247,538,770.03	1.70
14	601628	中国人寿	237,925,257.24	1.64
15	601006	大秦铁路	232,833,319.93	1.60
16	002024	苏宁电器	221,250,862.74	1.52
17	000063	中兴通