

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	-	-
B	矿业	2,736,040,356.81	5.65
C	制造业	5,756,554,585.14	12.62
D	电力、热力、燃气及生产和供应业	-	-
E	建筑业	355,442,596.34	2.60
F	批发和零售业	0.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	239,080,474.49	1.75
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	328,711,777.13	2.40
J	金融业	6,881,383,281.26	50.24
K	房地产业	363,660,124.22	2.66
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-
S	综合	123,333,950.64	0.90
合计		11,001,472,046.03	84.71

Q 鹏华投资行业分类的股票投资组合

鹏华投资行业分类的股票投资组合

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	26,300,051	1,097,501,128.23	8.01
2	600036	招商银行	88,806,266	967,100,256.74	7.06
3	000016	民生银行	117,681,301	938,499,643.72	6.63
4	600519	贵州茅台	6,965,386	894,216,254.68	6.53
5	601166	兴业银行	37,377,773	784,610,618.22	5.76
6	600000	浦发银行	63,374,190	597,617,291.50	4.33
7	600837	海通证券	45,260,069	512,343,867.88	3.74
8	600030	中信证券	38,974,271	496,921,955.25	3.64
9	600887	伊泰股份	8,899,324	347,785,912.92	2.54
10	601601	中国太保	16,550,114	306,673,612.42	2.24

Q 鹏华投资行业分类的股票投资组合

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600000	浦发银行	6,235,836	305,244,172.20	2.23
2	200895	首创期货	5,713,235	268,979,303.80	1.96
3	000033	中航集团	2,416,172	120,806,000.00	0.88
4	600232	中孚实业	7,060,914	96,310,866.96	0.70
5	600276	恒顺股份	699,724	26,575,517.52	0.19

4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	-	-	-
2	央行票据	-	-	-
3	金融债券	670,835,000.00	670,835,000.00	4.90
其中:政策性金融债	670,835,000.00	670,835,000.00	4.90	
4	企业债券	-	-	-
5	企业短期融资券	-	-	-
6	中期票据	-	-	-
7	可转债	388,873,821.90	388,873,821.90	2.84
8	其他	-	-	-
9	合计	-	1,059,708,821.90	7.74

5.报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130423	13国债(4)	2,500,000	248,250,000.00	1.81
2	130427	13国债(7)	1,450,000	143,811,000.00	1.05
3	113005	平安转债	1,318,370	141,395,182.50	1.03
4	110023	民生转债	1,315,830	127,017,069.90	0.93
5	110002	万科转债	1,128,590	120,461,569.50	0.88

6.报告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.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名股指期货投资明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

9.报告期末本基金投资的期权投资情况说明

本基金本报告期末未持有期权。

10.投资组合报告附注

1) 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有发生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。

2) 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票列表。

3) 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,395,230.12
2	应收证券清算款	44,303,190.24
3	应收股利	-
4	应收利息	11,419,561.59
5	其他应收款	-
6	其他流动资产	-
7	其他	-
8	合计	60,460,656.57

4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110023	民生转债	127,017,069.90	0.93
2	110002	万科转债	120,461,569.50	0.88

6. 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

7. 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

8. 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

9. 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指期货投资明细

10. 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名期权投资明细

11. 投资组合报告附注

1) 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有发生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。

2) 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票列表。

3) 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,395,230.12
2	应收证券清算款	44,303,190.24
3	应收股利	-
4	应收利息	11,419,561.59
5	其他应收款	-
6	其他流动资产	-
7	其他	-
8	合计	60,460,656.57

4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Q 鹏华投资行业分类的股票投资组合

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	26,300,051	1,097,501,128.23	8.01
2	600036	招商银行	88,806,266	967,100,256.74	7.06
3	000016	民生银行	117,681,301	938,499,643.72	6.63
4	600519	贵州茅台	6,965,386	894,216,254.68	6.53
5	601166	兴业银行	37,377,773	784,610,618.22	5.76
6	600000	浦发银行	63,374,190	597,617,291.50	4.33
7	600837	海通证券	45,260,069	512,343,867.88	3.74
8	600030	中信证券	38,974,271	496,921,955.25	3.64
9	600887	伊泰股份	8,899,324	347,785,912.92	2.54
10	601601	中国太保	16,550,114	306,673,612.42	2.24

Q 鹏华投资行业分类的股票投资组合

3.期末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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600000	浦发银行	6,235,836	305,244,172.20	2.23
2	200895	首创期货	5,713,235	268,979,303.80	1.96
3	000033	中航集团	2,416,172	120,806,000.00	0.88
4	600232	中孚实业	7,060,914	96,310,866.96	0.70
5	600276	恒顺股份	699,724	26,575,517.52	0.19

4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	-	-	-
2	央行票据	-	-	-
3	金融债券	670,835,000.00	670,835,000.00	4.90
其中:政策性金融债	670,835,000.00	670,835,000.00	4.90	
4	企业债券	-	-	-
5	企业短期融资券	-	-	-
6	中期票据	-	-	-
7	可转债	388,873,821.90	388,873,821.90	2.84
8	其他	-	-	-
9	合计	-	1,059,708,821.90	7.74

5.报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130423	13国债(4)	2,500,000	248,250,000.00	1.81
2	130427	13国债(7)	1,450,000	143,811,000.00	1.05
3	113005	平安转债	1,318,370	141,395,182.50	1.03
4	110023	民生转债	1,315,830	127,017,069.90	0.93
5	110002	万科转债	1,128,590	120,461,569.50	0.88

6.报告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.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名股指期货投资明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

9.报告期末本基金投资的期权投资情况说明

本基金本报告期末未持有期权。

10.投资组合报告附注

1) 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有发生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。

2) 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票列表。

3) 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,395,230.12
2	应收证券清算款	44,303,190.24
3	应收股利	-
4	应收利息	11,419,561.59
5	其他应收款	-
6	其他流动资产	-
7	其他	-
8	合计	60,460,656.57

4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Q 鹏华投资行业分类的股票投资组合

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	26,300,051	1,097,501,128.23	8.01
2	600036	招商银行	88,806,266	967,100,256.74	7.06
3	000016	民生银行	117,681,301	938,499,643.72	6.63
4	600519	贵州茅台	6,965,386	894,216,254.68	6.53
5	601166	兴业银行	37,377,773	784,610,618.22	5.76
6	600000	浦发银行	63,374,190	597,617,291.50	4.33
7	600837	海通证券	45,260,069	512,343,867.88	3.74
8	600030	中信证券	38,974,271	496,921,955.25	3.64
9	600887	伊泰股份	8,899,324	347,785,912.92	2.54
10	601601	中国太保	16,550,114	306,673,612.42	2.24

Q 鹏华投资行业分类的股票投资组合

3.期末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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600000	浦发银行	6,235,836	305,244,172.20	2.23
2	200895	首创期货	5,713,235	268,979,303.80	1.96
3	000033	中航集团	2,416,172	120,806,000.00	0.88
4	600232	中孚实业	7,060,914	96,310,866.96	0.70
5	600276	恒顺股份	699,724	26,575,517.52	0.19

4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	-	-	-
2	央行票据	-	-	-
3	金融债券	670,835,000.00	670,835,000.00	4.90
其中:政策性金融债	670,835,000.00	670,835,000.00	4.90	
4	企业债券	-	-	-
5	企业短期融资券	-	-	-
6	中期票据	-	-	-
7	可转债	388,873,821.90	388,873,821.90	2.84
8	其他	-	-	-
9	合计	-	1,059,708,821.90	7.74

5.报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130423	13国债(4)	2,500,000	248,250,000.00	1.81
2	130427	13国债(7)	1,450,000	143,811,000.00	1.05
3	113005	平安转债	1,318,370	141,395,182.50	1.03
4	110023	民生转债	1,315,830	127,017,069.90	0.93
5	110002	万科转债	1,128,590	120,461,569.50	0.88

6.报告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.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名股指期货投资明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

9.报告期末本基金投资的期权投资情况说明

本基金本报告期末未持有期权。

10.投资组合报告附注

1) 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有发生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。

2) 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票列表。

3) 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,395,230.12
2	应收证券清算款	44,303,190.24
3	应收股利	-
4	应收利息	11,419,561.59
5	其他应收款	-
6	其他流动资产	-
7	其他	-
8	合计	60,460,656.57

4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Q 鹏华投资行业分类的股票投资组合

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	26,300,051	1,097,501,128.23	8.01
2	600036	招商银行	88,806,266	967,100,256.74	7.06
3	000016	民生银行	117,681,301	938,499,643.72	6.63
4	600519	贵州茅台	6,965,386	894,216,254.68	6.53
5	601166	兴业银行	37,377,773	784,610,618.22	5.76
6	600000	浦发银行	63,374,190	597,617,291.50	4.33
7	600837	海通证券	45,260,069	512,343,867.88	3.74
8	600030	中信证券	38,974,271	496,921,955.25	3.64
9	600887	伊泰股份	8,899,324	347,785,912.92	2.54
10	601601	中国太保	16,550,114	306,673,612.42	2.24

Q 鹏华投资行业分类的股票投资组合

3.期末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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600000	浦发银行	6,235,836	305,244,172.20	2.23
2	200895	首创期货	5,713,235	268,979,303.80	1.96
3	000033	中航集团	2,416,172	120,806,000.00	0.88
4	600232	中孚实业	7,060,914	96,310,866.96	0.70
5	600276	恒顺股份	699,724	26,575,517.52	0.19

4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	-	-	-
2	央行票据	-	-	-
3	金融债券	670,835,000.00	670,835,000.00	4.90
其中:政策性金融债	670,835,000.00	670,835,000.00	4.90	
4	企业债券	-	-	-
5	企业短期融资券	-	-	-
6	中期票据	-	-	-
7	可转债	388,873,821.90	388,873,821.90	2.84
8	其他	-	-	-
9	合计	-	1,059,708,821.90	7.74

5.报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	-------	---------	--------------