

鹏华中国 50 开放式证券投资基金

更新的招募说明书摘要

基金管理人：鹏华基金管理有限公司 基金托管人：交通银行股份有限公司

本基金经中国证监会 2004 年 3 月 9 日证监基金字[2004]26 号文件《关于同意鹏华中国 50 开放式证券投资基金设立批复》批准发起设立。根据当时有效的法规，本基金基金合同已于 2004 年 5 月 12 日生效，基金管理人于该日起正式开始对基金财产进行运作管理。

重要提示

投资者过往业绩并不预示其未来表现。
本招募说明书所载内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。
本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2006 年 5 月 11 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2006 年 3 月 31 日。

一、基金管理人

(一) 基金管理人概况
1、名称：鹏华基金管理有限公司
2、住所：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 27 层
3、设立日期：1998 年 12 月 22 日
4、法定代表人：孙凤
5、办公地址：深圳市中心区益田路与福华三路交汇处深圳国际商会中心 43 层
6、电话：(0755)-82021233 传真：(0755)-82021155
7、联系人：徐丽萍
8、注册资本：人民币 1.5 亿元
9、股权结构情况

出资人名称	出资额(万元)	出资比例
国信证券有限责任公司	7,500	50%
深圳市北融信投资发展有限公司	2,502	16.68%
方正证券有限责任公司	2,499	16.66%
安徽国元证券有限责任公司	2,499	16.66%
合计	15,000	100%

(二) 主要人员情况

1、基金管理人董事会成员
孙凤先生，董事长，国际金融专业硕士，高级会计师，中国注册会计师。历任武汉市经济研究所室负责人、副所长，武汉市一轻局副局长，武汉友复复印机制造公司副经理，深圳市招商局金融处处长、办公室主任、党组成员，深圳市商业银行党委书记、董事长，深圳发展银行党委书记、董事长，现任鹏华基金管理有限公司党委书记、董事长。
胡继华先生，董事，博士研究生，高级经济师。历任中国人民银行武汉市分行办公室副科长、金融研究所副所长、所长，中国人民银行深圳分行办公室负责人，深圳证券交易所以总经理助理兼办公室主任、理事兼秘书长、策划总监、纪委书记、党委委员、副总经理，现任国信证券有限责任公司总裁，党委副书记。
钱海章先生，董事，国际金融博士，高级经济师。历任中国银行兴兴分行会计部、调研部负责人，深圳国投证券有限责任公司投资管理调研部副高级研究员，国信证券有限责任公司发展研究中心主任、投资管理部高级研究员、资产管理委员会督察员兼研究员、交易管理部投资业务督察员兼副总经理、风险管理部交易总监、投资管理委员会秘书长兼执行助理兼主任，现任国信证券有限责任公司总裁助理兼投资管理部总经理。
陈敏女士，董事，硕士。曾任方正证券有限责任公司经纪管理部副总经理，现任方正证券有限责任公司投资管理部副总经理。

过广洪先生，董事。历任安徽省政策研究室巡视员、安徽省委办公厅秘书，安徽省国际信托投资公司总经理助理、副总经理兼证券投资部总经理，现任安徽国元信托投资公司董事长。

黄俞先生，董事，大学学历。曾在中农信公司、正大财务公司工作，现任深圳市北融信投资发展有限公司董事长。

郝建江先生，独立董事，中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员，深圳市仲裁委员会委员、仲裁员。历任河南省高级人民法院经济审判庭庭长、审判员兼庭长，深圳市中级人民法院审判庭庭长、审判员兼庭长，深圳中院审判委员会、深圳市中级人民法院副院长、党组成员，深圳市法制局局长、党组书记，深圳市中级人民法院党组书记、深圳市中级人民法院法律事务部主任，现任北京大成律师事务所深圳分所所长。

方兆本先生，独立董事，美国匹兹堡大学统计学博士，中国科技大学教授、博士生导师，中国现场统计学会理事，中国现场统计学会理事，美国当代统计 CIS 通讯编辑，美国 ASA、IJMS 会员。曾任中国科技大学系主任，现任中国科技大学商学院院长、全国政协常委、安徽省政协副主席。

柳广志先生，独立董事，美国马里亚大学法学院法学博士，美国律师协会会员，美国联邦法院认证律师。曾任美国芝加哥律师事务所合伙人律师，美国芝加哥斯库尔斯法学院法律部亚太地区法律顾问，兼大中国区首席法律顾问；德国戴姆勒克莱斯勒汽车全球投资兼并重组部高级法律顾问兼大中国区首席法律顾问；现任福特汽车(中国)有限公司副总裁、法律总监。

黄世忠先生，独立董事，加拿大达尔豪西(Dalhousie)大学工商管理专业工商管理硕士、厦门大学管理学院会计学博士。兼任全国会计硕士专业学位教育指导委员会委员、财政部会计准则委员会咨询专家、中国注册会计师协会会计准则委员会、中国注册会计师协会常务理事兼学术委员会、现任厦门大学会计系系主任、厦门大学会计学院首席客座教授、厦门大学管理学院副院长，现任厦门大学会计学院副院长、厦门大学管理学院会计学教授、博士生导师。

孙凤扬先生，董事、总裁，经济学博士，法学硕士。历任贵州省政府经济体制改革委员会主任科员，中共深圳市委政策研究室副处长、深圳证券结算公司常务副总经理、深圳证券交易所前任行政总监、香港深业(集团)有限公司助理总经理、香港深业控股有限公司(上市公司)助理总经理、现任鹏华基金管理有限公司董事长兼执行总裁，现任鹏华基金管理有限公司党委党总支书记、总裁。

殷克胜先生，董事、常务副总裁，经济学博士。历任中国综合开发研究院高级研究员，深圳证券管理办公室政策法规处处长、公司处副处长、公司处处长，现任鹏华基金管理有限公司常务副总裁兼资产管理部总经理。

2、基金管理人监事会成员
李耀庭先生，监事会召集人，硕士研究生，高级会计师，9 年证券从业经历。1994 年毕业于中南财经大学会计系，同年进入国信证券有限责任公司工作，历任审计部副总经理、证券二部副总经理、副总会计师、上海管理总部总经理，现任国信证券有限责任公司首席财务官兼资产管理部总经理。

朱天相先生，监事，经济学学士。历任江西省机械进出口公司财务处外贸单证管理员、会计员、主管会计，上海捷兴实业发展有限公司财务经理，上海华泰贸易发展有限公司财务经理，中国高科集团股份有限公司财务主管、财务部总经理助理、副总经理、总经理，方正证券有限责任公司稽核部总经理、稽核科科长。
徐剑先生，监事，本科学历，会计师。曾在黄河证券有限公司、民生证券有限公司工作，历任财务部副经理、营业部总经理、计划资金部总经理，现任深圳市北融信投资发展有限公司财务总监。

孙泳女士，监事。历任四川省什邡市税务局税收专员，曾在中国证券业协会从事财务出纳和信息管理工作，现任鹏华基金管理有限公司监察稽核部总监助理。

3、高级管理人员
孙凤先生，简历同上。
孙凤扬先生，简历同上。
殷克胜先生，简历同上。
于波先生，副总裁，工学硕士，经济学博士研究生，加拿大多伦多大学访问学者。历任中国机械进出口总公司国外大项目商务代表兼物流运输部总经理，深圳证券交易所北京代表处首席代表、创业板上市推广总监，现任鹏华基金管理有限公司副总裁兼运营部总经理。

刘昊先生，党委书记兼营销管理部总经理，管理学博士。历任广东发展银行深圳分行人事部部长、国家开发银行深圳分行人事处处长。

吴伟先生，督察长，法学博士。曾就职于中国建设银行深圳市分行。2001 年 3 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任公司法律顧問、社保基金独立稽核员、监察稽核部副总监，现任公司督察长兼监察稽核部副总监。

陈女士，总裁助理兼基金运营部办公室主任，西南财经大学心理学专业。曾任国信证券有限责任公司人力资源部高级经理、市场部综合管理部副经理。2003 年加盟鹏华基金管理有限公司，历任上市公司总经理、市场营销部副经理。

4、本基金基金经理
胡建平先生，经济学硕士，8 年证券从业经历。先后在浙江证券、浙江天堂硅谷创业投资公司等机构从事证券研究及投资管理 work，历任研究员、行业研究小组组长、投资经理等职务。2004 年 9 月加盟鹏华基金管理有限公司，先后任行业研究员、策略研究员、鹏华行业成长基金和普润基金基金经理助理，现任鹏华中国 50 开放式基金基金经理。

5、投资决策委员会成员的姓名和职务
投资决策委员会成员组成：公司常务副总裁殷克胜先生、投资部副总经理郑毅先生、基金管理部总监黄奕良先生、基金管理部副总监杨建勋先生以及普华基金经理易秀华先生。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一) 基金托管人基本情况
1、名称：交通银行股份有限公司(简称：交通银行)
公司法定中文名称：交通银行股份有限公司(简称：交通银行)
公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS LTD
注册地址：上海市仙霞路 18 号 邮政编码：200336
注册时间：1987 年 3 月 30 日
注册资本：3807 亿元
法定代表人：蒋超良
办公地址：上海市银城中路 188 号 邮政编码：200120
基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[1998]25 号
电话：021-68888917

交通银行是中国第一家全国性国有股份制商业银行，自 1987 年重新组建以来，交通银行各项业务和机构均保持稳健发展。目前在我国境内大中城市均设有分支机构，员工达 5 万余人。截至 2006 年末，资产总额为 14234.39 亿元人民币，实现税后利润 92.49 亿元人民币。根据《银行家》杂志最新排名，交通银行投资资产总额排名世界 100 家大中银行中第 89 位。2006 年 6 月 23 日，交通银行成功在香港主板市场上市，成为首家在境外的内地商业银行。1998 年被评为“欧洲货币”评为中国最佳银行，1999 年被评为“环球金融”评为中国最佳银行，2006 年被评为“金融亚洲”评为中国最佳银行。

交通银行总行设在上海，下设 30 多个一级分行，现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具有基金从业资格，并有经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

三、相关服务机构

(一) 基金份额发售机构
1、直销机构
(1) 鹏华基金管理有限公司
住所：深圳市深南东路 5047 号发展银行大厦 27 层
法定代表人：孙凤
办公地址：深圳市中心区益田路与福华三路交汇处深圳国际商会中心 43 层
电话：(0755) 82021233 传真：(0755) 82021155
联系人：徐丽萍
网址：www.phfund.com.cn

(2) 鹏华基金管理有限公司北京分公司
办公地址：北京市海淀区三里河路 13 号中国建筑文化中心北塔楼 10 层
电话：(010) 88082426 传真：(010) 88082018
联系人：王乃力

(3) 鹏华基金管理有限公司上海分公司
办公地址：上海市陆家嘴环路 968 号华能联合大厦 3010 室
电话：(021) 58825962 传真：(021) 68866470
联系人：李洁怡

(1) 代销机构
(1) 交通银行
注册地址：上海市仙霞路 18 号
法定代表人：蒋超良
办公地址：上海市银城中路 188 号
电话：021-68872124

传真：021-68408842
联系人：曹杨
网址：www.bankcomm.com
热线电话：96599

(2) 深圳发展银行
住所：深圳市深南中路 5047 号
法定代表人：法兰克纽强(Frank N. Newman)
办公地址：深圳市深南中路 5047 号
电话：0755-82088888-8811
传真：0755-82081020
联系人：周勤
网址：www.sdb.com.cn
热线电话：96501

(3) 中国银河证券股份有限公司
住所：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座
法定代表人：宋林
办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座
联系电话：010-66568613
传真：010-66568536
联系人：赵荣春
网址：www.chinastock.com.cn

(4) 中信证券股份有限公司
住所：深圳市福田中心区福华路 103 号龙光大厦
法定代表人：王东明
办公地址：北京朝阳区新源南路 6 号京城大厦
电话：(010) 84964818-63266
传真：(010) 84965660
联系人：陈忠
网址：www.citics.com

(5) 海通证券股份有限公司
住所：上海市浦东大道 218 号
法定代表人：王开国
办公地址：上海市淮海中路 98 号
电话：(021) 53594566
传真：(021) 53595849
联系人：李芳
客户服务电话：021-962503
网址：www.htsec.com

(6) 国泰君安证券股份有限公司
住所：上海市浦东新区商城路 618 号
法定代表人：顾冰
办公地址：上海市银平路 125 号
客户服务电话：(021) 962588、800-820-6888
传真：(021) 62584349
联系人：芮筱婷
联系电话：021-62508818-213
网址：www.gtja.com

(7) 中信建投证券股份有限公司(原华夏证券股份有限公司)
住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼
法定代表人：陈东晓
办公地址：北京市朝阳区东直门北大街 188 号
联系电话：(010)63168000
传真：(010)65182621
联系人：王健
客户服务电话：400-888-1008-100(免收长途费)
网址：中信建投证券网 www.csc108.com

(8) 国信证券股份有限公司
住所：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层
法定代表人：胡继华
办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 21 层
联系电话：(0755) 82133066
传真：(0755) 82133000
联系人：林建国
客户服务电话：800-810-8888
网址：www.guosen.com.cn

(9) 兴业证券股份有限公司
住所：福州市湖东路 99 号标力大厦
法定代表人：兰荣
办公地址：上海浦东新区陆家嘴东路 166 号中保大厦 19 楼
电话：(021) 68419125
传真：(021) 68419067
联系人：廖白
客户服务电话：021-68419125
网址：www.xyzq.com.cn

(10) 华泰证券股份有限公司
住所：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦
法定代表人：吴万善
办公地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦
电话：(025) 4467777-882、721
联系人：张雪梅、袁红彬
网址：www.htsec.com

(11) 中信证券股份有限公司
住所：青岛市东海东路 28 号
法定代表人：齐向东
办公地址：青岛市山东路 28 号
联系电话：0532-5023457
联系人：陈向华
网址：www.citic.com

(12) 招商证券股份有限公司
住所：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 39-45 层
法定代表人：宫少林
办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 40 层
电话：0755-82943111
传真：0755-82943377
联系人：黄辉
客户服务电话：4008888111、0755-26951111
网址：www.newone.com

(13) 东吴证券股份有限公司
住所：江苏省苏州市十梓街 298 号
法定代表人：吴永敏
办公地址：苏州市石路爱河桥 26 号
电话：0512-65581136
传真：0512-65588021
联系人：方晓丹
客户服务电话：0512-96288
网址：www.dwj.com.cn

(14) 长江证券股份有限公司
住所：湖北省武汉市新华路 28 号
法定代表人：吕志波
办公地址：上海市汉口路 130 号长江证券总汇 5F
电话：(021) 63291352
传真：(021) 33130730
联系人：甘霖
客户服务电话：(021) 63291352
联系：021-4008-888-318、027-65799833
网址：www.c318.com.cn

(15) 湘财证券有限责任公司
住所：湖南省长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼
法定代表人：陈学荣
办公地址：上海市浦东银城东路 139 号华能联合大厦 5 楼
电话：021-68893418
传真：021-68895938
联系人：陈伟
开放式基金热线电话：021-68865020
网址：www.xcsc.com

(16) 国元证券股份有限公司
住所：合肥市寿春路 1 7 9 号国元大厦 11 楼
法定代表人：吴志忠
办公地址：合肥市寿春路 1 7 9 号国元大厦 11 楼
联系电话：0651-2634400
传真：0651-2634400-1171
联系人：李赛
客户服务电话：0651-96888
网址：www.gyzq.com.cn

(17) 大同证券有限责任公司
住所：山西省太原市迎泽大街 282 号
法定代表人：吴晋安
办公地址：山西省太原市迎泽大街 282 号
联系电话：0351-8686766、0351-8686708
联系人：邹连星、刘文康
网址：www.dtjz.com.cn

(18) 广发证券股份有限公司
住所：广东省珠海市吉大海滨路广太国际贸易中心 26 楼 2611 室
法定代表人：王志伟
办公地址：广州市天河区珠江 183 号大会展广场 36、38、41、42 楼
电话：(020) 87576888
传真：(020) 87576985
联系人：肖梅
网址：www.gf.com.cn

(19) 申银万国证券股份有限公司
住所：上海市常熟路 171 号
法定代表人：王明权
办公地址：上海市常熟路 171 号
联系电话：021-54040044
联系人：胡洁瑜
公司网址：www.swhl.com.cn

(20) 联合证券有限责任公司
住所：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 10.24.25 层
法定代表人：马国强
办公地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 10.24.25 层
联系电话：(0755) 82483661
传真：(0755) 82492187
联系人：盛宗波
公司网址：www.lhzq.com

(21) 山西证券股份有限公司
住所：山西省太原市迎泽大街 282 号
法定代表人：吴晋安
办公地址：山西省太原市迎泽大街 282 号
联系电话：0351-8686766、0351-8686708
联系人：邹连星、刘文康
网址：www.sxjz.com.cn

(22) 长城证券有限责任公司
住所：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14.16.17 层
法定代表人：魏庆华
办公地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14.16.17 层
联系电话：0755-82288968
联系人：高峰
网址：www.cc168.com.cn

(23) 齐鲁证券有限公司
住所：山东省济南市经十路 128 号
法定代表人：李玮
办公地址：山东省济南市经十路 128 号
电话：(0631) 82024184
传真：(0631) 82024197
联系人：傅咏梅
客户服务电话：(0631) 82024184
网址：http://www.lzq.com.cn

(24) 国都证券有限责任公司
住所：北京市东城区安外大街 2 号安外大厦 3 层
法定代表人：王少华
办公地址：北京市东城区安外大街 2 号安外大厦 3 层
联系电话：010-64482828-390
联系人：马泽承
全国服务热线：900-810-8900
开放式基金业务传真：010-64482000
网址：http://www.guodu.com

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其它符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

(二) 注册登记机构
名称：中国证券登记结算有限责任公司
住所：北京市西城区金融大街 27 号投资广场 23 层
法定代表人：陈雁飞
办公地址：北京市西城区金融大街 27 号投资广场 23 层
电话：0755-25383065
传真：0755-25387538
联系人：任瑞新
网址：www.cdic.com

(三) 律师事务所与经办律师
律师事务所：北京市德恒律师事务所
住所：北京市西城区金融大街 8 号富凯大厦 B 座 12 层
办公地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 12 层
负责人：王丽
电话：(010) 66557588
传真：(010) 65232181
联系人：苏文蓓
经办律师：陈静韵、高国富

(四) 会计师事务所及经办注册会计师
会计师事务所：普华永道中天会计师事务所有限公司
住所：上海市浦东新区东川路 325 号
法定代表人：Kont Watson
办公地址：上海市淮海中路 333 号瑞安广场 12 楼
电话：(021) 63863388
传真：(021) 63863300
联系人：陈欣欣
经办注册会计师：汪隹、高峰

四、基金的名称

五、基金的类型

本基金类型：混合型

六、基金的投资目标

以价值投资为主，通过集中投资于基本面和流动性良好同时收益价值或成长价值相对被低估的股票，长期持有结合适度波段操作，以求在充分控制风险的前提下分享中国经济成长成果实现基金财产的长期稳定增值。

七、基金的投资方向

本基金以股票、中央银行票据、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具为主要投资对象。

八、基金的投资策略

1、债券投资策略
本基金债券投资以降低组合总体波动率而改善组合风险结构为目的，采取积极主动的投资策略，采取超配策略。如投资有流动性则可在严格控制风险的前提下通过回购参与有价的新发行债券。

2、股票投资策略
本基金股票投资中，精选个股，长期持有结合适度波段操作，注重长期收益。将指数的选股方式与积极的权重配置相结合，从而在保持了收益空间的前提下一定程度上降低了投资风险。股票价值分析兼顾收益性和成长性。

具体流程是：首先选择全市场基本面流动性较好、流通市值较大的 100 只股票；由行业研究员对 100 只股票再根据目标行业的情况，动态分析其价值低估程度。选择收益价值或成长价值相对被低估的 50 只左右的股票长期投资；为避免行业投资过于集中，由金融工程部门对投资组合进行行业比例调整，如果个别行业的投资比例过高，则进行适当之调整。

3、决策委员会
投资决策委员会：确定本基金总体资产配置和投资策略。投资决策委员会定期召开会议，如投资环境发生重大变化时，主动提议，可临时召开投资决策委员会会议。

金融工程研究员及行业研究员：对于宏观经济的业绩比较基准主要是基于如下四因素：可投资股票品种的建立与完善、投资风险控制与基金绩效评估等与投资决策有关的内容进行全面的分析，作为投资决策的依据。

基金经理小组：构造和调整投资组合。设计和调整投资组合需要考虑的基本因素包括：投资组合管理委员会、每日基金申购和赎回净现金流量；基金合同所设定的投资限制和比例限制；研究员的投资建议；基金交易的独立判断；绩效与风险评估小组的建议等。

绩效与风险评估小组：负责投资组合进行绩效评价，对各种投资风险指标进行测量并向基金经理小组提出预警和调整建议。

九、基金的风险收益特征
本基金属平衡型证券投资基金，为证券投资基金中的中低风险品种。长期平均的风险和预期收益低于成长型基金、高于价值型基金、指数型基金、纯债券基金、国债基金。

十一、基金的投资组合报告(未经审计)

本基金的资产及基金财产的投资组合情况不存在虚假记载、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责任。

本基金的托管人交通银行根据本基金合同规定，已于 2006 年 6 月 1 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

截至 2006 年 3 月 31 日基金资产组合情况

序号 资产品种 金额(元) 金额占基金总资产比例(%)

1 股票 579,840,783.89 87.75

2 债券 52,264,088.25 7.91

3 权证 0.00 0.00

4 银行存款及清算备付金 11,716,488.66 1.77

5 其他资产 16,901,090.04 2.57

合计 660,812,366.84 100

2.截至 2006 年 3 月 31 日按行业分类的股票投资组合

序号 行业 期末市值(元) 市值占基金净值比例(%)

1 A 农、林、牧、渔业 0.00 0.00

2 B 采掘业 53,515,150.62 8.48

3 C 制造业 314,442,233.97 49.83

C1 纺织、服装、皮毛 27,469,508.15 4.36

C2 木材、家具 0.00 0.00

C3 造纸、印刷 5,316,638.22 0.84

C4 石油、化学、塑胶、塑料 38,976,061.41 13.31

C5 电子 6,322,219.06 1.00

C6 金属、非金属 75,029,177.90 11.89

C7 机械、设备、仪表 104,730,000.32 16.60

C8 医药、生物制品 9,796,300.11 1.55

C9 其他制造业 1,771,251.30 0.28

D 电力、煤气及水的生产和供应业 0.00 0.00

E 建筑业 0.00 0.00

F 交通运输、仓储业 47,130,011.58 7.48

G 信息技术业 47,089,365.36 7.46

H 批发和零售贸易 26,900,245.04 4.26

I 金融、保险业 42,101,520.76 6.67

J 房地产业 17,260,442.10 2.74

K 社会服务业 31,332,190.00 4.97

L 传播与文化业 0.00 0.00

M 其他类 0.00 0.00

合计 679,840,783.89 91.90

3.截至 2006 年 3 月 31 日按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

序号 股票代码 股票名称 数量(股) 期末市值(元) 市值占基金资产净值比例(%)

1 600649 乐视网 1,563,008 30,678,294.08 5.08

2 600009 烟台万华 1,752,045 30,678,307.56 4.86

3 600036 招商银行 3,833,569 24,649,948.67 3.91

4 600289 圣阳电源 2,501,324 23,037,194.04 3.66

5 600236 桂冠电力 3,876,900 19,772,190.00 3.13

6 002024 苏宁电器 640,000 19,116,800.00 3.03

7 600020 中国石化 1,450,000 17,411,500.00 2.93

8 600888 上海石化 3,044,728 17,401,424.40 2.79

9 000051 格力电器 1,642,785 17,381,192.40 2.76

10 000002 万科 A 2,636,182 17,280,442.10 2.74

4.截至 2006 年 3 月 31 日按券种分类的债券投资组合

序号 债券类别 期末市值(元) 市值占基金资产净值比例(%)

1 国债 39,521,200.00 6.26

2 金融债 0.00 0.00

3 企业债 0.00 0.00

4 可转债 12,742,888.25 2.02

合计 39,521,200.00 6.26

注：上述债券明细为截至