

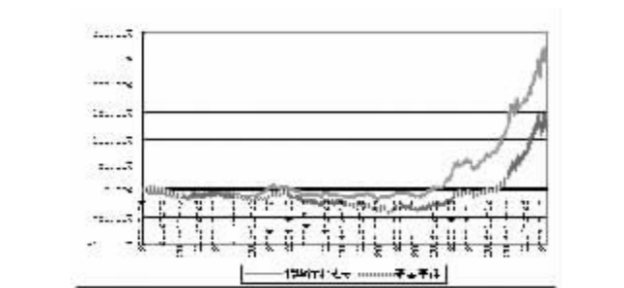
鹏华行业成长证券投资基金 2007年第二季度报告

一、重要提示

鹏华行业成长证券投资基金(以下简称本基金)基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2007年7月13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。
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。
基金的过往业绩并不预示其未来表现,投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告期中的财务资料未经审计。

二、基金产品概况

1.基金简称:鹏华行业成长基金
2.基金运作方式:契约开放式
3.基金合同生效日:2002年5月24日
4.报告期末基金份额总额:304,023,008.66份
5.投资目标:在控制风险的前提下谋求基金资产的长期稳定增值。
6.投资策略:
(1)一级资产配置:本公司的投资决策委员会在综合考虑宏观经济形势、政策变动以及市场走势等因素的前提下及时调整基金资产中股票、债券和现金的配置比例。
(2)股票投资:本基金一级资产配置中股票的投资比例确定之后,本基金通过两次优化配置完成投资组合的构建。
(3)债券投资:本基金可投资于国债、金融债和企业债(包括可转债)。本基金将在对利率走势和债券发行人基本面进行分析的基础上,综合考虑利率变化对不同债券品种的影响、收益率水平、信用风险的大小、流动性好坏等因素,建立由不同类型、不同期限债券品种构成的组合。
7.业绩比较基准:中信综合指数涨跌幅*90%+中信标普国债指数涨跌幅*10%。
8.风险收益特征:本基金为证券投资基金中的中高风险品种,本基金长期平均的风险和预期收益低于积极成长型股票基金,高于指数型基金、货币型基金、纯债型基金和国债。
9.基金管理人名称:鹏华基金管理有限公司
10.基金托管人名称:中国工商银行股份有限公司
三、主要财务指标和基金净值表现(未经审计)



四、管理人报告

1.基金经理简历
易贵海先生,硕士,12年证券从业经验,自2006年11月至今担任鹏华行业成长基金基金经理。曾在大鹏证券、兆富投资、长盛基金从事研究和投资工作,2004年2月加盟鹏华基金管理有限公司从事基金管理工作,从2004年8月至今,担任普丰基金基金经理。易贵海先生具备基金从业资格。
2.基金运作遵规守信情况说明
本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等相关法律法规的规定及基金合同、招募说明书等基金法律文件的约定,本着“诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于投资者”的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,忠实履行基金管理人职责。本报告期内,基金运作合法合规,无损害基金份额持有人利益的行为。
3.本报告期内基金业绩表现和投资策略
2007年2季度末,本基金份额净值3.0335元,比2007年1季度末增加0.6394元,涨幅为26.71%。同期上证指数和深圳综指分别上涨20.00%和30.53%。
2007年2季度本基金资产配置主要集中在IT、房地产、金融、化工等行业,整体配置相对均衡,我们在房地产、电力、化工等行业的超配取得了良好的超额收益。2季度市场配置行情进入了大幅震荡阶段,为了更好地保护基金份额持有人的利益,我们采取了相对谨慎的投资风格,在资产配置和个股选择上显得较为保守。
展望3季度,我们认为在国家继续收缩流动性的背景下,宏观经济政策成为影响股市运行的主要因素之一,加息可能性加大。同时,我们也面临着红筹股的回调,无风险收益率水平上升对估值体系的压制作用等方面的影响,我们认为3季度市场将进入调整期,我们的操作策略仍以稳健为主。在个股选择上,我们将继续寻找业绩优良的地产、机械、医药等行业,以及奥运、节能环保等主题投资,选择行业里面的成长股以及相对低估的股票。

序号	行业	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	A 农、林、牧、渔业	9,470,711.77	1.03
2	B 采矿业	0.00	0.00
3	C 制造业	236,649,279.96	25.55
其中:	C0 食品、饮料	82,514,108.44	8.96
C1 纺织、服装、皮毛		0.00	0.00
C2 木材、家具	20,774,620.30	2.25	
C3 造纸、印刷	3,674,709.70	0.42	
C4 石油、化学、塑胶、塑料	21,173,063.64	2.30	
C5 电子	0.00	0.00	
C6 金属、非金属	0.00	0.00	
C7 机械、设备、仪表	32,740,692.94	3.55	
C8 医药、生物制品	74,572,604.94	8.08	
C99 其他制造业	0.00	0.00	
4	D 电力、煤气及水的生产和供应业	0.00	0.00
5	E 建筑业	0.00	0.00
6	F 交通运输、仓储业	23,364,208.45	2.53
7	G 信息技术业	102,889,677.51	11.16
8	H 批发和零售贸易	36,677,975.45	3.98
9	I 金融、保险业	102,832,567.07	11.15
10	J 房地产业	41,757,775.58	4.53
11	K 社会服务业	90,989,718.40	9.86
12	L 传播与文化业	21,802,926.31	2.36
13	M 综合类	0.00	0.00
合计		685,435,230.40	72.15

序号	债券品种	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	国债	184,473,736.80	20.00
2	金融债	14,917,260.00	1.62
3	企业债	0.00	0.00
4	可转换债券	0.00	0.00
合计		199,390,996.80	21.62

(五)本报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	债券名称	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	02国债08	47,292,937.50	5.13
2	20国债03	38,070,636.50	4.13
3	21国债03	33,867,085.00	3.67
4	02国债04	30,083,570.00	3.26
5	16国债01	16,731,750.00	1.81

(六)投资组合报告附注
1. 报告期内本基金投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的股票。
2. 报告期内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。
3. 其他资产构成

项目	金额(元)
基本本期收益	248,477,210.00
加权平均基金份额本期净收益	0.7918
期末基金资产净值	922,266,981.97
期末基金份额净值	3.0335

提示:所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

二、基金净值表现

(1)本基金本报告期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较列表

期间	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	1-3	2-4
过去三个月	26.71%	1.91%	23.29%	2.14%	3.42%	-0.23%

注:业绩比较基准 = 中信综合指数涨跌幅*90% + 中信标普国债指数涨跌幅*10%。
(2)鹏华行业成长基金自基金合同生效以来基金资产净值的变动情况,并与同期业绩比较基准的变动进行比较的走势图

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	600036	招商银行	2,697,483	66,304,132.14	7.19
2	000063	中兴通讯	798,100	42,872,640.00	4.65
3	000068	阳光股份	2,111,111	41,757,775.58	4.53
4	601268	中国人寿	888,563	36,528,824.93	3.96
5	600060	中国联通	5,645,623	33,119,807.01	3.59
6	000897	津滨发展	2,200,000	32,912,000.00	3.57
7	000012	津 波 A	2,482,236	32,740,692.94	3.55
8	000069	华侨城 A	818,696	31,684,100.80	3.53
9	000869	张裕 A	519,968	31,968,739.28	3.47
10	600761	安徽合力	974,000	27,759,000.00	3.01

(四)本报告期末按券种分类的债券投资组合

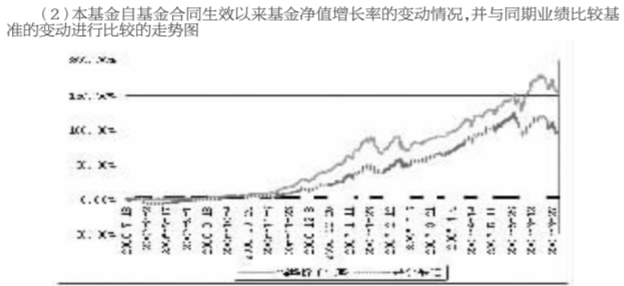
鹏华价值优势股票型证券投资基金(LOF) 2007年第二季度报告

一、重要提示

鹏华价值优势股票型证券投资基金(LOF)(以下简称本基金)基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2007年7月13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。
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。
基金的过往业绩并不预示其未来表现,投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告期中的财务资料未经审计。

二、基金产品概况

1.基金简称:鹏华价值基金
2.基金运作方式:上市契约开放式
3.基金合同生效日:2006年7月18日
4.报告期末基金份额总额:490,649,277.11份
5.投资目标:本基金依托严谨的研究流程和投资纪律,强调运用相对估值分析方法,发掘我国资本市场国际接轨趋势下具备相对价值优势的中国企业,谋求基金资产的长期稳定增值。
6.投资策略:
(1)股票投资:首先按照既有的研究流程和投资纪律进行行业配置和个股选择,再运用相对估值分析方法,进行多维估值比较,分析行业、个股的合理估值区间,深入发掘行业和个股中由于具备相对价值优势而存在的投资机会,以此作为基金经理的投资线索以及权重调整的重要依据。
(2)债券投资:以降低组合总体波动性而改善组合风险收益为目的,采取积极主动的投资策略,进而谋求超额收益。
7.业绩比较基准:中信综指*70%+中信标普国债指数*30%
8.风险收益特征:本基金属股票型证券投资基金,为证券投资基金中的中高风险品种。本基金长期平均的风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金、货币型基金,低于成长型股票基金。
9.基金管理人名称:鹏华基金管理有限公司
10.基金托管人名称:中国建设银行股份有限公司
三、主要财务指标和基金净值表现(未经审计)



四、管理人报告

1.基金经理简历
程世杰先生,硕士,10年金融证券从业经历,自2007年4月起至今担任鹏华价值优势股票型证券投资基金(LOF)基金经理。2001年5月加盟鹏华基金管理有限公司,历任行业研究员、鹏华中国50基金助理助理、鹏华证券投资基金基金经理。2007年5月担任原鹏华基金E及原鹏华基金封闭转开而成的基金——鹏华优质治理基金基金经理。程世杰先生具备基金从业资格。
2.基金运作遵规守信情况说明
本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等相关法律法规的规定及基金合同、招募说明书等基金法律文件的约定,本着“诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于投资者”的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,忠实履行基金管理人职责。本报告期内,基金运作合法合规,无损害基金份额持有人利益的行为。
3.本报告期内基金业绩表现和投资策略
二季度,国内证券市场继续呈现不断攀升的状况,但在5月开始出现了一次较大幅度的调整。上证指数和深圳综合指数分别上涨20.00%和30.53%,本基金季末基金份额净值为2.210元,较期初增长34.91%。
本季度初,市场延续了1季度的低估值、垃圾行情,概念炒作盛行,投机气氛浓厚,本基金严重落后大盘,但在5月份之后的调整行情中,本基金表现出了良好的抗跌性,基金净值一度创出新高。报告期内,本基金适度减持了一部分商业类进攻性个股,增持了房地产、医药、钢铁等个股,从效果看,二线城市地产股的介入时机尚晚,钢铁股的投资效果亦不太理想。
展望下一季度,我们认为牛市格局未变,但由于连续的升息和提高存款准备金率等宏观调控政策,资金成本不断推高,流动性过剩状况有所缓解,市场对可能出现的宏观调控的担忧,加之估值水位不再具有吸引力,将抑制垃圾股、概念股的估值水平,短期内市场可能仍存在一定的调整压力,但从长期看,这将有利于理性的投资者提供良好的人市机会。本基金将不断调整优化投资组合结构,力争为基金份额持有人获取良好的投资回报。

序号	行业	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	A 农、林、牧、渔业	37,573,155.00	2.36
2	B 采矿业	86,796,963.23	5.44
3	C 制造业	724,488,542.00	45.40
其中:	C0 食品、饮料	64,997,428.00	4.07
C1 纺织、服装、皮毛		0.00	0.00
C2 木材、家具		0.00	0.00
C3 造纸、印刷		0.00	0.00
C4 石油、化学、塑胶、塑料	137,714,925.97	8.63	
C5 电子	35,557,063.20	2.23	
C6 金属、非金属	259,065,518.62	16.24	
C7 机械、设备、仪表	174,607,417.97	10.94	
C8 医药、生物制品	52,546,188.24	3.29	
C99 其他制造业	0.00	0.00	
4	D 电力、煤气及水的生产和供应业	70,992,924.50	4.45
5	E 建筑业	4,872,000.00	0.00
6	F 交通运输、仓储业	62,854,600.00	3.94
G 信息技术业	47,872,000.00	3.00	
H 批发和零售贸易	69,188,646.00	4.34	
I 金融、保险业	232,131,605.58	14.55	
J 房地产业	124,437,028.39	7.80	
K 社会服务业	0.00	0.00	
L 传播与文化业	19,603,155.00	1.23	
M 综合类	0.00	0.00	
合计		1,475,938,664.70	92.50

(三)本报告期末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	债券品种	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	06央行14	40,000,800.00	2.51
2	02国债08	22,056,000.00	1.38

注:上述债券明细为本基金截止本报告期末投资的全部债券。
(六)投资组合报告附注
1. 报告期内本基金投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的股票。
2. 报告期内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。
3. 其他资产构成

项目	金额(元)
基本本期净收益	453,547,647.54
加权平均基金份额本期净收益	0.7220
期末基金资产净值	1,595,657,641.76
期末基金份额净值	2.310

提示:所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

二、基金净值表现

(1)本基金本报告期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较列表

期间	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	1-3	2-4
过去三个月	34.91%	2.14%	20.01%	1.87%	14.90%	0.27%

注:业绩比较基准 = 中信综合指数*70% + 中信标普国债指数*30%。

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	股票		1,475,938,664.70	90.83	
2	股票		62,065,800.00	3.82	
3	权证		0.00	0.00	
4	银行存款及清算备付金		31,394,696.36	1.93	
5	其他资产		55,569,770.98	3.42	
合计			1,624,948,902.04	100.00	

(二)本报告期末按券种分类的债券投资组合

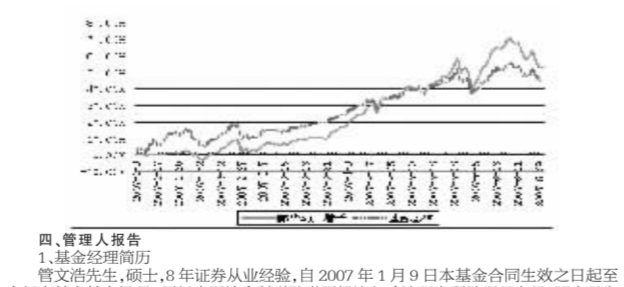
鹏华动力增长混合型证券投资基金(LOF) 2007年第二季度报告

一、重要提示

鹏华动力增长混合型证券投资基金(LOF)(以下简称本基金)基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2007年7月16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。
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。
基金的过往业绩并不预示其未来表现,投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告期中的财务资料未经审计。

二、基金产品概况

1.基金简称:鹏华动力
2.基金运作方式:上市契约开放式
3.基金合同生效日:2007年1月9日
4.报告期末基金份额总额:7,315,552,929.19份
5.投资目标:精选具有成长性和持续盈利增长潜力的上市公司中价值相对低估的股票,进行积极主动的投资管理,在有效控制投资风险的前提下,为基金份额持有人谋求长期、稳定的资本增值。
6.投资策略:
(1)股票投资:本基金股票投资采取“自上而下”和“自下而上”相结合的主动投资管理策略,策略分为战略性资产配置、动态资产配置和个股选择三个层次,重点投资具有成长性和持续盈利增长潜力的上市公司中价值相对低估的股票。
(2)债券投资:本基金债券投资的主要目的是规避投资组合的系统性风险,在投资过程中综合运用久期、收益率曲线、流动性、相对价值控制、套利等策略。
7.业绩比较基准:新华富时600成长指数*70%+新华富时中国综合债券指数*30%
8.风险收益特征:本基金属于混合型(偏股型)基金,其预期风险和收益高于货币型基金、债券型基金,混合型基金中的偏债型基金,为证券投资基金中的中高风险品种。
9.基金管理人名称:鹏华基金管理有限公司
10.基金托管人名称:中国工商银行股份有限公司
三、主要财务指标和基金净值表现(未经审计)



四、管理人报告

1.基金经理简历
管文浩先生,硕士,8年证券从业经历,自2007年1月9日本基金合同生效之日起至今任本基金基金经理。历任中国社会科学院世界经济与政治研究所助理研究员,国泰君安证券研究所研究员、国债投资研究中心研究员、泰信基金管理有限公司投资总监兼先行策略基金经理。2006年9月起至今担任鹏华动力增长混合型证券投资基金基金经理。管文浩先生具备基金从业资格。
2.基金运作遵规守信情况说明
本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等相关法律法规的规定及基金合同、招募说明书等基金法律文件的约定,本着“诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于投资者”的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,忠实履行基金管理人职责。本报告期内,基金运作合法合规,无损害基金份额持有人利益的行为。
3.本报告期内基金业绩表现和投资策略
2007年第二季度本基金的投资收益率为39.22%,同期上证指数和深圳综合指数分别上涨20%和30.53%。本基金净值在良好的宏观经济环境和充裕的资金面支持下,在4.5月份走出了加速上涨的行情。本基金由于重点投资了有色、白色家电、工程机械、医药、证券、地产等行业中的优秀公司,因而组合收益率在这段时期内涨幅较大。
进入6月份,各项针对宏观经济和股市的调控政策相继出台,同时资金面出现收紧,市场开始进入剧烈调整期。本基金净值在6月中旬的反弹中创出新高后,由于未及时减仓,净值在本月下旬随市场的下跌而回落。
回顾本季度的操作,本组合在行业配置和选股上做的较为成功。我们抓住了在宏观经济向好的背景下企业盈利上升最快的行业,如证券、有色、地产;根据行业国际竞争力的比较优势,我们抓住了工程机械、白色家电这类我们认为中国具有国际竞争力的产业;我们也适度重视了由于整体上市、资产重组、企业治理改善等带来的投资机会,找到了相应的个股重点投资,取得了较好的收益。
但本季度的操作也存在很多值得检讨的地方。最主要的是我们对牛市过程中可能出现的市场回调估计不足,致使组合收益率在6月末的市场大跌中损失较大;同时我们在某些行业中的内部轮动转换上把握不够,比如迟滞介入二线城市地产。
展望下一季度或下半年的市场,首先我们还是坚持认为牛市并未结束。我们原来判断当前市场中的所有基石仍然存在,宏观经济仍将继续发展,中国企业的竞争力在不断提升,只要经济面不出现问题,我们相信市场向上格局不会改变。在估值方面,在本轮调整前市场的结构性牛市较为严重,主要是垃圾股和题材股的泡沫被吹破。但在3500点附近,我们仍重点投资和跟踪的优质公司的07年市盈率基本都在30倍以下,08年市盈率在20倍左右。我们认为这一估值水平是完全可以接受的,所以并不必对市场调整过度的恐慌。我们会继续耐心持有估值合理的优秀公司,同时还将继续关注如产品供需失衡带来的上游工业、资源类、节能环保等领域的投资机会。

序号	资产品种	金额(元)	金额占基金总资产比例(%)
1	股票	10,491,326,627.83	92.90
2	债券	210,256,815.00	1.85
3	权证	0.00	0.00
4	银行存款及清算备付金	454,424,832.43	4.02
5	其他资产	137,710,962.41	1.22
合计		11,293,728,237.67	100.00

(二)本报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	债券品种	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	国债	22,056,000.00	1.38
2	金融债	40,000,800.00	2.51
3	企业债	0.00	0.00
4	可转换债券	0.00	0.00
合计		62,056,800.00	3.89

(五)本报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	债券名称	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	02国债08	206,237,815.00	1.83
2	21国债09	5,019,000.00	0.04

注:上述债券明细为本基金截止本报告期末投资的全部债券。
(六)投资组合报告附注
1. 报告期内本基金投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的股票。
2. 报告期内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。
3. 其他资产构成

项目	金额(元)
基本本期净收益	2,100,479,157.54
加权平均基金份额本期净收益	0.2856
期末基金资产净值	11,193,094,707.83
期末基金份额净值	1.530

提示:所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

二、基金净值表现

(1)本基金本报告期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较列表

期间	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	1-3	2-4
过去三个月	39.22%	2.33%	20.90%	1.63%	18.32%	0.70%

提示:业绩比较基准 = 新华富时600成长指数*70% + 新华富时中国综合债券指数*30%。
(2)本基金自基金合同生效以来基金资产净值的变动情况,并与同期业绩比较基准的变动进行比较的走势图

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	600030	中信证券	7,800,000.00	413,166,000.00	3.69
2	000002	万科 A	19,000,000.00	363,280,000.00	3.25
3	600788	中信股份	12,061,888.00	306,671,680.00	2.73
4	601318	中国平安	4,077,875.00	291,608,841.25	2.61
5	600000	浦发银行	7,800,000.00	285,402,000.00	2.55
6	600489	中金黄金	5,979,545.00	281,218,001.35	2.51
7	601288	中国人寿	6,500,000.00	267,215,000.00	2.39
8	600016	民生银行	22,330,000.00	255,231,000.00	2.28
9	000069	华侨城 A	6,410,200.00	245,125,960.00	2.21
10	600067	冠城大通	11,468,012.00	247,335,658.60	2.22

(四)本报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券品种	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	国债	210,256,815.00	1.88
2	金融债	0.00	0.00
3	企业债	0.00	0.00
4	可转换债券	0.00	0.00
合计		210,256,815.00	1.88

(五)本报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票明细

序号	股票名称	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	02国债08	206,237,815.00	1.83
2	21国债09	5,019,000.00	0.04

注:上述债券明细为本基金截止本报告期末投资的全部债券。
(六)投资组合报告附注
1. 报告期内本基金投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的股票。
2. 报告期内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。
3. 其他资产构成

项目	金额(元)
交易保证金	9,291,439.08
应收证券清算款	51,419,296.22
应收股利	171,429.98
应收利息	3,923,827.73
应收申购款	72,294,974.52
合计	137,710,962.41

4. 本报告期末本基金没有持有处于转股期的可转换债券,也没有投资资产支持证券。
(七)本基金权证投资情况及本报告期末本基金持有权证情况

权证名称	本报告期买入权证市值(元)	本报告期卖出权证市值(元)	报告期末持有权证市值(元)	报告期末持有权证市值占基金资产净值比例(%)
武钢 CWB1	0.00	1,040,385.63	0.00	0.00
万华 HXB1	0.00	0.00	17,024,266.66	0.00
合计	0.00	1,040,385.63	17,024,266.66	0.00

六、开放式基金份额变动

项目	份额(份)
本报告期初基金份额总额	725,628,616.877
本报告期末基金份额总额	690,648,2