

一、重要提示  
普华证券投资基金(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。  
基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2007年10月23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。  
本报告中的财务资料未经审计。

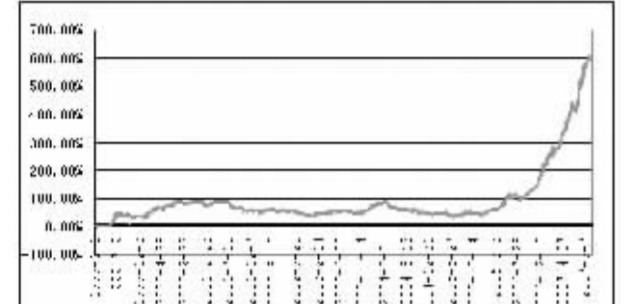
二、基金产品概况  
1. 基金简称:基金普华  
2. 基金运作方式:契约型封闭式  
3. 基金合同生效日:1999年1月6日  
4. 报告期末基金份额总额:20亿份  
5. 投资目标:为投资者减少和分散投资风险,确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定的投资收益。  
6. 投资策略:本基金采取自上而下与自下而上相结合的资产配置,以宏观经济、政策研究和行业研究作为投资方向的指导,以市场、技术、管理、机制等为主体内容的核心竞争力作为成长性个股的选择标准,同时兼顾具有超市场低估值优势的优质和绩优个股。本基金在投资组合构建中引入投资组合优化模型和辅助工具,根据市场变化灵活调整各类资产的投资比例,注重基金资产的流动性,以优化投资组合的风险和收益特征。  
7. 基金管理人名称:鹏华基金管理有限公司  
8. 基金托管人名称:交通银行股份有限公司  
三、主要财务指标和基金净值表现(未经审计)  
1. 主要财务指标

|                        | 单位:人民币元          |
|------------------------|------------------|
| 1 本期利润                 | 2,134,389,130.25 |
| 2 本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额 | 1,129,662,717.30 |
| 3 基金份额本期利润             | 1.0672           |
| 4 期末基金资产净值             | 8,036,089,833.58 |
| 5 期末基金份额净值             | 4.0180           |

提示:1.2007年7月1日基金实施新会计准则后,原“基金本期净收益”名称调整为“本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额”,原“基金本期净收益”为第2项/(第1项/第3项)  
2.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,封闭式基金交易佣金等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2. 基金净值表现  
(1) 本基金本报告期基金份额净值增长率  
过去三个月 36.17% 净值增长率标准差 3.65%

注:基金合同中未规定业绩比较基准。  
(2) 本基金自基金合同生效以来基金基金份额净值的变动情况走势图



一、重要提示  
普华证券投资基金(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。  
基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2007年10月24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。  
本报告中的财务资料未经审计。

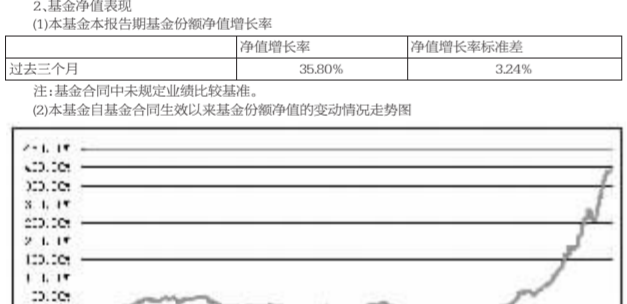
二、基金产品概况  
1. 基金简称:基金普华  
2. 基金运作方式:契约型封闭式  
3. 基金合同生效日:1999年7月14日  
4. 报告期末基金份额总额:30亿份  
5. 投资目标:导入指数化投资概念,增加投资广度,分散投资风险,同时兼顾增值、成长的选股策略,通过指数化投资和优化组合投资两种模式的积极结合,实现风险与收益的更有效平衡,力争使基金取得超过市场平均收益率以上的投资收益,实现基金资产的长期稳定增值。  
6. 投资策略:本基金将指数化投资与优化组合投资有机结合,在进一步分散风险的同时,积极投资增值个股和成长股,将基金资产按一定比例分为指数化投资部分、债券投资部分和优化组合投资部分,力争在降低风险的同时,实现基金资产增值。  
7. 基金管理人名称:鹏华基金管理有限公司  
8. 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)  
1. 主要财务指标

|                        | 单位:人民币元          |
|------------------------|------------------|
| 1 本期利润                 | 2,631,863,473.58 |
| 2 本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额 | 792,350,191.46   |
| 3 基金份额本期利润             | 0.8773           |
| 4 期末基金资产净值             | 9,984,256,101.24 |
| 5 期末基金份额净值             | 3.3281           |

提示:1.2007年7月1日基金实施新会计准则后,原“基金本期净收益”名称调整为“本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额”,原“基金本期净收益”为第2项/(第1项/第3项)  
2.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,开放式基金的交易佣金等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2. 基金净值表现  
(1) 本基金本报告期基金份额净值增长率  
过去三个月 36.80% 净值增长率标准差 3.24%

注:基金合同中未规定业绩比较基准。  
(2) 本基金自基金合同生效以来基金基金份额净值的变动情况走势图



四、管理人报告  
1. 报告期内基金基金经理变更情况及其简历  
本报告期内本基金基金经理由易贵海先生变更为高晓琴女士。  
高晓琴女士,硕士,7年证券从业经验,2007年8月至担任鹏华基金普华基金经理,曾在长城证券有限

一、重要提示  
鹏华优质治理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。  
基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2007年10月23日复核了本报告中的财务指标、基金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,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。  
本报告中的财务资料未经审计。

二、基金产品概况  
1. 基金简称:鹏华治理基金  
2. 基金运作方式:上市契约型开放式  
3. 基金合同生效日:2007年4月25日  
4. 报告期末基金份额总额:15,812,723,640.60份  
5. 投资目标:投资于具有相对完善的公司治理结构和良好成长性的优质上市公司,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) 股票投资策略:本基金采取“自上而下”的资产配置和“自下而上”的选股策略相结合的主动投资管理策略,整体资产和行业配置主要根据宏观经济、政策环境和行业发展不同阶段、不同特点等因素确定股票投资比例和行业配置比例,个股方面,主要投资于具有相对完善的公司治理结构和良好成长性的优质上市公司,同时关注那些过去基本面较差但在发生转折的上市公司,采用多种价值评估方法,多视角地进行分析,努力选择具有投资价值个股进行投资。  
(2) 债券投资策略:本基金的债券投资采用久期控制下的主动投资策略,本基金权益匹配策略,兼顾流动性风险的确定债券各类资产的配置比例,在个股选择上,本基金综合运用利率预期、收益曲线估值、信用评级分析、流动性评估等方法来评估个股的投资价值。  
(3) 信用投资策略:本基金将债券看作风险辅助性投资工具,其投资原则为有利于基金资产增值,有利于加强基金风险控制。  
7. 业绩比较基准:沪深300指数×75%+新华富时中国综合债券指数×25%。  
8. 风险收益特征:本基金属于股票型基金,其预期的风险收益高于货币型基金、债券基金、混合型基金,为证券投资基金中具有较高风险、较高收益的品种。  
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)  
1. 主要财务指标

|                        | 单位:人民币元           |
|------------------------|-------------------|
| 1 本期利润                 | 7,259,114,249.48  |
| 2 本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额 | 830,510,900.37    |
| 3 加权平均基金份额本期利润         | 0.4546            |
| 4 期末基金资产净值             | 23,362,622,063.41 |
| 5 期末基金份额净值             | 1.514             |

提示:1.2007年7月1日基金实施新会计准则后,原“基金本期净收益”名称调整为“本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额”,原“加权平均基金份额本期净收益”为第2项/(第1项/第3项)  
2.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。

2. 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

|       | 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 | 43.24% | 1.81%    | 34.96%    | 1.60%        | 8.28% | 0.21% |

注:业绩比较基准=沪深300指数×75%+新华富时中国综合债券指数×25%  
(2) 本基金自基金合同生效以来基金基金份额净值的变动情况,并与同期业绩比较基准的变动进行比较的走势

## 普华证券投资基金 2007年第三季度报告

四、管理人报告  
1. 基金基金经理  
黄晓东先生,硕士,7年证券从业经验,自2006年11月至今担任鹏华基金普华基金经理,曾在南方证券有限公司研究所任研究员,先后从事市场分析、债券研究、化工行业分析及投资组合设计等工作;2006年2月加盟鹏华基金管理有限公司从事行业研究工作,2006年8月开始先后担任鹏华行业成长基金、普华基金基金经理助理,鹏华中国50基金基金经理,黄晓东先生具备基金从业资格。  
2. 基金运作遵规守信情况说明  
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。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  
报告期内,本基金净值增长率36.17%,尽管我们对市场走势保持了相当的警惕,但由于在优质上市公司业绩未来增长预期仍保持期待,因此,我们在仓位上还是采取了积极策略;行业配置上出于对人民币升值主线的坚持,继续对地产、金融、食品饮料作了重点配置。  
三季度A股市场走势继续保持强势,但行业和个股的表现差异巨大。首先中报业绩超出市场预期,公司股价出现波动,显示市场的有效性;其次,面对不断上涨的股价,因此公司未来的业绩能否提供更大的成长空间,尚难以从现有资产的生产式增长是难以达到市场预期,因此市场对外延式增长的追捧就成为了必然;第三,牛市格局下,业绩的确定性反而成为了获得高估值理由,这一点在周期性行业本季度的大幅上探中体现的尤为明显。绩优股、亏损股以及各种题材个股都受到了市场的追捧。  
市场整体经过了量能信息之后,对宏观经济前景和效应可能逐步显现,而国内物价指数的企稳,央行年内可能继续上调利率,对资本市场的压力也会进一步加大,四季度将出现回调下行的可能性增加,而且较高的持仓估值水平也为调整打下了伏笔。

投资策略上,我们将对市场保持适度警惕,提高操作的灵活性。行业适度由均衡转向偏重,而个股则保持分散。行业选择上,我们认为地产行业尽管在政策面保持高压态势下出现了持续回调,但未来2年的业绩仍将保持高速增长态势,且确定性较强,而且,从政策的力度看,对优势地产公司的未来发展也提供了更大的空间,因此,我们将保持对地产行业的较高配置。对一些未来业绩在各种乐观预期下可能出现高速增长的中期行业,尽管市场给予了较高估值,但由于这些行业的业绩增长确定性大,且持续性强,我们在适度参与的同时仍将给一份冷静。在经过了2、3季度的行业业绩增长后,消费品行业随着传统消费旺季的到来,四季度应该会良好表现。

其他投资主题上,资产注入和整体上市仍将演绎大量个股行情,而奥运和股指期货也可能在四季度成为阶段性行情热点。  
一份付出,一份收获,我们将努力工作,不断为持有人带来良好回报。

五、投资组合报告(未经审计)  
(一) 本报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 资产品种       | 金额(元)            | 金额占基金总资产比例(%) |
|----|------------|------------------|---------------|
| 1  | 股票         | 6,206,830,259.25 | 66.84         |
| 2  | 债券         | 1,625,664,425.50 | 17.61         |
| 3  | 权证         | 200,656,000.00   | 2.16          |
| 4  | 银行存款及清算备付金 | 1,220,731,779.67 | 13.14         |
| 5  | 其他资产       | 32,500,925.30    | 0.35          |
| 合计 |            | 9,296,391,407.72 | 100.00        |

(二) 本报告期末按行业分类的股票投资组合

| 序号  | 行业               | 期末市值(元)          | 市值占基金资产净值比例(%) |
|-----|------------------|------------------|----------------|
| 1   | A 农、林、牧、渔业       | 0.00             | 0.00           |
| 2   | B 采掘业            | 44,086,222.92    | 0.44           |
| 3   | C 制造业            | 1,462,883,977.54 | 14.65          |
| 其中: | C0 食品、饮料         | 0.00             | 0.00           |
|     | 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         | 216,598,611.33   | 2.17           |
|     | C4 石油、化学、塑胶、塑料   | 878,151.06       | 0.01           |
|     | C5 电子            | 73,350,000.00    | 0.73           |
|     | C6 金属、非金属        | 767,532,960.40   | 7.69           |
|     | C7 机械、设备、仪表      | 414,278,964.15   | 4.15           |
|     | C8 医药、生物制品       | 245,390.60       | 0.00           |
|     | C9 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           |

(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 | 股票代码   | 股票名称  | 数量(股)      | 市值(元)          | 市值占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|-------|------------|----------------|----------------|
| 1  | 600150 | 中国船舶  | 2,420,000  | 663,056,800.00 | 8.25           |
| 2  | 000002 | 万科 A  | 15,515,125 | 449,791,775.00 | 5.60           |
| 3  | 000024 | 招商银行  | 5,198,017  | 409,696,343.00 | 5.10           |
| 4  | 000069 | 华侨城 A | 5,400,000  | 330,966,000.00 | 4.12           |
| 5  | 600036 | 招商银行  | 8,300,000  | 317,641,000.00 | 3.96           |
| 6  | 600080 | 青岛海尔  | 12,000,000 | 301,690,000.00 | 3.75           |
| 7  | 002024 | 苏宁电器  | 4,361,522  | 299,287,639.64 | 3.72           |
| 8  | 601919 | 中国远洋  | 6,142,321  | 276,772,984.26 | 3.44           |
| 9  | 000668 | 泸州老窖  | 4,400,000  | 250,400,000.00 | 3.12           |
| 10 | 600100 | 同力股份  | 6,450,000  | 227,040,000.00 | 2.83           |

(四) 本报告期末按券种分类的债券投资组合

| 序号    | 股票代码       | 股票名称             | 数量(股) | 市值(元) | 市值占基金资产净值比例(%) |
|-------|------------|------------------|-------|-------|----------------|
| 6     | E 建筑业      | 0.00             | 0.00  | 0.00  |                |
| 7     | F 交通运输、仓储业 | 621,572,579.85   | 6.22  |       |                |
| 8     | G 信息技术业    | 589,388.60       | 0.01  |       |                |
| 9     | H 批发和零售业   | 0.00             | 0.00  |       |                |
| 10    | I 金融、保险业   | 294,939,430.04   | 2.96  |       |                |
| 11    | J 房地产业     | 520,219,357.66   | 5.21  |       |                |
| 12    | K 社会服务业    | 130,390,785.42   | 1.34  |       |                |
| 13    | L 传播与文化业   | 129,161,400.00   | 1.29  |       |                |
| M 综合类 | 0.00       | 0.00             | 0.00  |       |                |
| 合计    |            | 3,107,037,145.03 | 31.12 |       |                |

2. 指数股票投资组合

| 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       | 21,051,361.37    | 0.21           |
| 2   | B 采掘业            | 329,389,363.63   | 3.30           |
| 3   | C 制造业            | 1,740,560,799.66 | 17.43          |
| 其中: | C0 食品、饮料         | 196,228,654.08   | 1.97           |
|     | C1 纺织、服装、皮毛      | 55,792,985.23    | 0.56           |
|     | C2 木材、家具         | 19,245,877.69    | 0.19           |
|     | C3 造纸、印刷         | 154,745,306.96   | 1.55           |
|     | C4 石油、化学、塑胶、塑料   | 48,184,998.61    | 0.48           |
|     | C5 电子            | 724,078,231.60   | 7.25           |
|     | C6 金属、非金属        | 345,227,400.00   | 3.46           |
|     | C7 机械、设备、仪表      | 428,740,023.30   | 4.29           |
|     | C8 医药、生物制品       | 67,534,585.33    | 0.68           |
|     | C9 其他制造业         | 25,988,068.77    | 0.26           |
| 4   | D 电力、煤气及水的生产和供应业 | 227,501,281.45   | 2.29           |
| 5   | E 建筑业            | 56,166,971.19    | 0.56           |
| 6   | F 交通运输、仓储业       | 435,001,678.69   | 4.36           |
| 7   | G 信息技术业          | 187,158,679.87   | 1.87           |
| 8   | H 批发和零售业         | 185,594,739.81   | 1.86           |
| 9   | I 金融、保险业         | 312,339,331.65   | 3.14           |
| 10  | J 房地产业           | 961,374,929.68   | 9.62           |
| 11  | K 社会服务业          | 93,976,877.61    | 0.94           |
| 12  | L 传播与文化业         | 30,099,219.49    | 0.30           |
| 13  | M 综合类            | 163,662,864.50   | 1.64           |
| 合计  |                  | 4,743,888,078.31 | 47.51          |

(三) 本报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的积极投资与指数投资的各前五名股票明细

| 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   | A 农、林、牧、渔业       | 0.00             | 0.00  | 0.00    |                |
| 2   | B 采掘业            | 329,389,363.63   | 3.30  |         |                |
| 3   | C 制造业            | 1,740,560,799.66 | 17.43 |         |                |
| 其中: | C0 食品、饮料         | 196,228,654.08   | 1.97  |         |                |
|     | C1 纺织、服装、皮毛      | 55,792,985.23    | 0.56  |         |                |
|     | C2 木材、家具         | 19,245,877.69    | 0.19  |         |                |
|     | C3 造纸、印刷         | 154,745,306.96   | 1.55  |         |                |
|     | C4 石油、化学、塑胶、塑料   | 48,184,998.61    | 0.48  |         |                |
|     | C5 电子            | 724,078,231.60   | 7.25  |         |                |
|     | C6 金属、非金属        | 345,227,400.00   | 3.46  |         |                |
|     | C7 机械、设备、仪表      | 428,740,023.30   | 4.29  |         |                |
|     | C8 医药、生物制品       | 67,534,585.33    | 0.68  |         |                |
|     | C9 其他制造业         | 25,988,068.77    | 0.26  |         |                |
| 4   | D 电力、煤气及水的生产和供应业 | 227,501,281.45   | 2.29  |         |                |
| 5   | E 建筑业            | 56,166,971.19    | 0.56  |         |                |
| 6   | F 交通运输、仓储业       | 435,001,678.69   | 4.36  |         |                |
| 7   | G 信息技术业          | 187,158,679.87   | 1.87  |         |                |
| 8   | H 批发和零售业         | 185,594,739.81   | 1.86  |         |                |
| 9   | I 金融、保险业         | 312,339,331.65   | 3.14  |         |                |
| 10  | J 房地产业           | 961,374,929.68   | 9.62  |         |                |
| 11  | K 社会服务业          | 93,976,877.61    | 0.94  |         |                |
| 12  | L 传播与文化业         | 30,099,219.49    | 0.30  |         |                |
| 13  | M 综合类            | 163,662,864.50   | 1.64  |         |                |
| 合计  |                  | 4,743,888,078.31 | 47.51 |         |                |

(四) 本报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的积极投资与指数投资的各前五名股票明细

| 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   | A 农、林、牧、渔业       | 0.00             | 0.00  | 0.00    |                |
| 2   | B 采掘业            | 44,086,222.92    | 0.44  |         |                |
| 3   | C 制造业            | 1,462,883,977.54 | 14.65 |         |                |
| 其中: | C0 食品、饮料         | 0.00             | 0.00  |         |                |
|     | 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         | 216,598,611.33   | 2.17  |         |                |
|     | C4 石油、化学、塑胶、塑料   | 878,151.06       | 0.01  |         |                |
|     | C5 电子            | 73,350,000.00    | 0.73  |         |                |
|     | C6 金属、非金属        | 767,532,960.40   | 7.69  |         |                |
|     | C7 机械、设备、仪表      | 414,278,964.15   | 4.15  |         |                |
|     | C8 医药、生物制品       | 245,390.60       | 0.00  |         |                |
|     | C9 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  |         |                |

(五) 投资组合报告(未经审计)  
(一) 本报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 资产品种       | 金额(元)             | 金额占基金总资产比例(%) |
|----|------------|-------------------|---------------|
| 1  | 股票         | 21,996,713,303.87 | 83.10         |
| 2  | 债券         | 1,050,043,241.80  | 3.82          |
| 3  | 权证         | 212,623,450.06    | 0.85          |
| 4  | 银行存款及清算备付金 | 1,861,639,862.03  | 6.35          |
| 5  | 其他资产       | 122,945,503.39    | 0.49          |
| 合计 |            | 24,966,965,462.94 | 100           |

(二) 本报告期末按行业分类的股票投资组合

| 序号  | 行业               | 期末市值(元)           | 市值占基金资产净值比例(%) |
|-----|------------------|-------------------|----------------|
| 1   | A 农、林、牧、渔业       | 211,347,972.43    | 0.88           |
| 2   | B 采掘业            | 2,342,347,879.49  | 9.79           |
| 3   | C 制造业            | 9,098,360,726.70  | 38.01          |
| 其中: | C0 食品、饮料         | 750,350,333.58    | 3.13           |
|     | C1 纺织、服装、皮毛      | 1,659,443.28      | 0.01           |
|     | C2 木材、家具         | 0.00              | 0.00           |
|     | C3 造纸、印刷         | 392,451,912.81    | 1.64           |
|     | C4 石油、化学、塑胶、塑料   | 732,768,788.77    | 3.06           |
|     | C5 电子            | 158,627,733.80    | 0.66           |
|     | C6 金属、非金属        | 3,961,943,290.45  | 16.51          |
|     | C7 机械、设备、仪表      | 2,331,553,473.88  | 9.74           |
|     | C8 医药、生物制品       | 779,017,670.13    | 3.25           |
|     | C9 其他制造业         | 0.00              | 0.00           |
| 4   | D 电力、煤气及水的生产和供应业 | 322,009,530.94    | 1.35           |
| 5   | E 建筑业            | 71,882,416.00     | 0.30           |
| 6   | F 交通运输、仓储业       | 1,121,847,399.00  | 4.69           |
| 7   | G 信息技术业          | 491,993,024.90    | 2.06           |
| 8   | H 批发和零售业         | 782,054,751.62    | 3.27           |
| 9   | I 金融、保险业         | 4,582,021,090.17  | 19.14          |
| 10  | J 房地产业           | 2,316,206,620.05  | 9.68           |
| 11  | K 社会服务业          | 301,627,709.18    | 1.26           |
| 12  | L 传播与文化业         | 354,009,212.40    | 1.48           |
| 13  | M 综合类            | 0.00              | 0.00           |
| 合计  |                  | 21,996,713,303.87 | 91.90          |

(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 | 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 | 35,341,417 | 1,362,516,028.59 | 5.65           |
| 2  | 000933 | 神火股份 | 14,440,576 | 960,334,306.56   | 3.97           |
| 3  | 600016 | 民生银行 | 54,998,231 | 869,532,032.11   | 3.63           |
| 4  | 600069 | 安钢转债 | 57,189,470 | 738,316,067.70   | 3.08           |
| 5  | 600030 |      |            |                  |                |