鹏华价值优势股票型证券投资基金(LOF)2007年年度报告摘要

（上接133版）

1、累计买入价值超出期初基金资产净值2%或者前20名股票明细如下：

序号	股票代码	股票名称	累计买入金额(元)	占期初净值比例(%)
1	601398	工商银行	539,111,796.71	29.84
2	600879	火箭股份	520,997,562.68	28.84
3	000933	神火股份	407,697,110.86	22.57
4	000069	华侨城A	389,045,564.91	21.54
5	600569	安阳钢铁	380,155,836.66	21.04
6	600028	中国石化	377,264,000.13	20.88
7	600000	浦发银行	360,234,595.06	19.94
8	000006	深振业A	332,044,724.19	18.38
9	000001	深发展A	287,306,272.50	15.90
10	000488	晨鸣纸业	266,064,556.86	14.73
11	000910	大亚科技	245,275,140.31	13.58
12	600849	上海医药	244,280,330.08	13.52
13	600533	栖霞建设	241,406,107.54	13.36
14	000963	华东医药	227,871,834.24	12.61
15	600665	天地源	218,619,891.60	12.10
16	600309	烟台万华	218,095,603.54	12.07
17	002024	苏宁电器	216,040,402.28	11.96
18	600019	宝钢股份	196,290,921.92	10.87
19	600808	马钢股份	191,056,190.52	10.5
20	000063	中兴通讯	190,197,100.17	10.53
21	002021	中捷股份	180,543,160.65	9.99
22	000002	万科A	178,798,116.87	9.90
23	600001	邯郸钢铁	177,769,950.25	9.84
24	600016	民生银行	174,345,645.39	9.65
25	600276	恒瑞医药	165,729,009.00	9.7
26	600030	中信证券	164,853,345.67	9.13
27	000709	唐钢股份	163,537,406.58	9.05
28	600036	招商银行	160,524,775.75	8.89
29	601919	中国远洋	157,864,060.80	8.74
30	000926	福星股份	155,287,285.23	8.60
31	000012	南玻A	154,118,707.45	8.53
32	600102	莱钢股份	143,773,293.89	7.96
33	600150	中国船舶	143,473,323.00	7.94
34	600005	武钢股份	143,402,776.96	7.94
35	600812	华北制药	142,824,870.76	7.91
36	600628	新世界	139,598,153.84	7.73
37	000822	山东海化	137,219,930.61	7.60
38	600166	福田汽车	136,245,766.96	7.54
39	000848	承德露露	130,424,199.16	7.22
40	000538	云南白药	129,489,490.53	7.17
41	600069	银鸽投资	129,260,007.35	7.16
42	000061	农产品	128,728,371.06	7.13
43	601318	中国平安	127,466,785.96	7.06
44	002032	苏泊尔	127,147,776.93	7.04
45	600282	南钢股份	114,272,528.53	6.33
46	000539	粤电力A	113,985,692.05	6.31
47	000860	顺鑫农业	111,108,602.92	6.15
48	600535	天士力	104,256,848.60	5.77
49	600782	新钢股份	103,240,174.59	5.71
50	000698	沈阳化工	101,425,595.60	5.61
51	000088	盐田港	100,601,078.18	5.57
52	600963	岳阳纸业	98,750,060.76	5.47
53	600015	华夏银行	94,299,231.27	5.22
54	600835	上海机电	92,152,443.62	5.10
55	600489	中金黄金	91,537,479.73	5.07
56	600058	五矿发展	87,559,624.43	4.85
57	600697	欧亚集团	82,695,300.66	4.58
58	600246	万通地产	81,000,000.00	4.48
59	600089	特变电工	79,184,601.77	4.38
60	601006	大秦铁路	79,023,446.49	4.37
61	600547	山东黄金	77,156,980.57	4.27
62	600831	广电网络	73,029,993.59	4.04
63	600426	华鲁恒升	64,542,658.87	3.57
64	600439	瑞贝卡	61,935,839.94	3.43
65	000608	阳光股份	61,226,119.20	3.39
66	000598	蓝星清洗	60,897,415.18	3.37
67	000718	苏宁环球	59,370,695.69	3.29
68	600330	天通股份	58,092,607.67	3.22
69	600087	长航油运	57,753,250.52	3.20
70	600875	东方电气	53,150,312.05	2.94
71	601166	兴业银行	50,928,653.57	2.82
72	002098	浔兴股份	50,924,127.18	2.82
73	600888	新疆众和	48,093,639.60	2.66
74	000014	沙河股份	46,472,601.33	2.57
75	600067	冠城大通	45,483,133.91	2.52
76	600240	华业地产	42,796,599.76	2.37
77	600748	上实发展	41,570,439.28	2.30
78	600098	广州控股	39,022,967.57	2.16
79	600837	海通证券	38,679,269.92	2.14

2、累计卖出价值超出期初基金资产净值2%或者前20名股票明细如下：

序号	股票代码	股票名称	累计卖出金额（元）	占期初净值比例(%)
1	600028	中国石化	355,145,812.18	19.66
2	002032	苏泊尔	222,921,738.68	12.34
3	000822	山东海化	128,316,925.49	7.10
4	600005	武钢股份	111,841,500.15	6.19
5	600009	上海机场	99,221,221.46	5.49
6	600016	民生银行	96,376,158.30	5.33
7	600150	中国船舶	94,239,949.53	5.22
8	600000	浦发银行	93,159,261.94	5.16
9	600900	长江电力	85,699,235.56	4.74
10	601398	工商银行	85,072,500.73	4.71
11	601006	大秦铁路	84,027,768.61	4.65
12	000825	太钢不锈	83,359,018.94	4.61
13	600812	华北制药	79,722,508.25	4.41
14	600019	宝钢股份	71,683,807.00	3.97
15	000002	万科A	67,587,908.38	3.74
16	600694	大商股份	66,536,426.15	3.68
17	000951	中国重汽	66,353,721.73	3.67
18	000935	四川双马	62,462,404.49	3.46
19	600309	烟台万华	61,399,969.09	3.40
20	600383	金地集团	59,107,562.23	3.27
21	600036	招商银行	58,677,766.60	3.25
22	600547	山东黄金	54,441,055.31	3.01
23	600837	海通证券	49,481,296.49	2.74
24	600686	金龙汽车	49,400,688.33	2.73
25	600748	上实发展	49,387,845.96	2.73
26	600690	青岛海尔	49,023,617.83	2.71
27	002024	苏宁电器	48,413,826.18	2.68
28	600350	山东高速	47,882,235.14	2.65
29	000709	唐钢股份	46,937,633.24	2.60
30	000792	盐湖钾肥	46,685,617.82	2.58
31	600143	金发科技	45,243,584.91	2.50
32	600880	博瑞传播	44,797,798.42	2.48
33	600015	华夏银行	44,777,351.00	2.48
34	000898	鞍钢股份	42,892,682.86	2.37
35	600835	上海机电	42,568,614.28	2.36
36	600808	马钢股份	40,294,489.80	2.23
37	600276	恒瑞医药	39,879,198.07	2.21
38	600386	*ST北巴	39,605,280.66	2.19
39	601001	大同煤业	38,508,693.25	2.13
40	600307	酒钢宏兴	36,797,894.28	2.04

3、报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

	2007年
买入股票的成本总额	13,174,878,009.61
卖出股票的收入总额	4,529,663,962.26

注：卖出股票的收入总额已扣除交易费用。

序号	债券品种	期末市值(元)	市值占净值比例(%)
1	国债	0.00	0.00
2	金融债	482,550,000.00	3.32
3	企业债	0.00	0.00
4	可转换债券	13,813,573.75	0.09
合计		496,363,573.75	3.41

（五）本报告期末按券种分类的债券投资组合

（六）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	市值(元)	市值占净值比例(%)
1	07央票91	482,550,000.00	3.32
2	唐钢转债	7,603,604.05	0.05
3	大荒转债	6,209,969.70	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。

（七）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

其他资产明细	金额（元）
应收交易保证金	3,877,913.67
应收利息	5,953,982.51
应收证券清算款	92,368,996.33
应收申购款	85,936,248.27
合计	188,137,140.78

4、基金持有的处于转股期的可转换债券

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、分离交易可转债。

5、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	本报告期买入权证金额（元）	本报告期获配权证数量（股）	本报告期获配权证成本(元)	本报告期获配权证市值（元）	报告期末持有权证市值（元）	报告期末权证市值占基金资产净值比例（%）
武汉钢铁认购权证	0.00	423,696	981,820.44	1,040,385.53	0.00	0.00
烟台万华认购权证	14,358,665.84	0	0.00	0.00	0.00	0.00
五粮液认购权证	4,305,420.82	0	0.00	0.00	0.00	0.00
华侨城认购权证	140,557,492.63	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
合计	159,221,579.29	423,696	981,820.44	1,040,385.53	0.00	0.00

本基金投资、持有权证的金额、比例等符合相关法律法规及中国证监会的相关规定。

八、基金份额持有人结构

（一）本报告期末基金份额持有人信息

基金份额持有人户数（户）	平均每户持有基金份额（份）	机构投资者持有基金份额（份）	占总份额比例（%）	个人投资者持有基金份额（份）	占总份额比例（%）
766,500	17,475.57	111,639,004.57	0.83	13,283,385,027.68	99.17

（二）本报告期末基金份额场内前十名份额持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占总份额比例（%）
1	王荣	8,526,921.00	0.06
2	马俊	5,664,800.00	0.04
3	徐慧均	4,349,200.00	0.03
4	赵辉	4,347,844.00	0.03
5	解淑贤	4,000,000.00	0.03
6	王健	3,900,000.00	0.03
7	陈静	3,106,879.00	0.02
8	刘瑄	3,000,000.00	0.02
9	胡俊明	2,510,520.00	0.02
10	南宁德瑞科实业发展有限公司	2,479,542.00	0.02

（三）本报告期末本基金管理公司从业人员投资、持有本基金的情况

项目	期末持有本开放式基金份额的总量（份）	占本基金总份额的比例（%）
基金管理公司持有本基金的所有从业人员	22,671.05	0.0002

注：截止本报告期末，本基金管理人从业人员投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

九、开放式基金份额变动

项目	份额(份)
基金合同生效日基金份额总额	1,876,753,992.72
本报告期期初基金份额总额	1,253,706,287.37
本报告期期末基金份额总额	13,395,024,032.25
本报告期间基金总申购份额	10,721,837,343.12
本报告期间基金份额拆分调整份额	6,523,586,568.50
本报告期间基金总赎回份额	5,104,106,166.74

注：基金合同生效日为2006年7月18日，红利再投资和基金转换转入作为本期申购资金的来源，统一计入本报告期间基金总申购份额，基金转换转出作为本期赎回资金的支付，统一计入本报告期间基金总赎回份额，不单独列示。

十、重大事项揭示

(一) 本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

(二) 本基金管理人（以下简称“本公司”），托管人的重大人事变动：

1、本基金管理人的重大人事变动情况

（1）因本公司职工监事孙泽女士离职，按照公司章程规定，需由公司职工民主选举另产生一名职工代表担任监事。根据2007年5月15日职工代表大会选举结果，现由张兴和先生担任职工监事，孙泽女士不再担任职工监事。

（2）根据股东欧利盛金融集团（Eurizon Financial Group）推荐，经本公司2007年第三次临时股东会会议审议，股东会同意Francis Candylaftis先生和Ciro Beffi先生担任鹏华基金管理有限公司非独立董事；同意过仕刚先生、陈锐女士辞去本公司董事职务，不再担任本公司董事。上述变更事项已报告中国证券监督管理委员会深圳监管局并于2007年8月14日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》公告。

（3）经本公司2007年第四次临时股东会会议审议通过，股东会同意钱海章先生、黄俞先生、殷克胜先生辞去董事职务，同意朱天相先生辞去监事职务。上述变更事项已报中国证券监督管理委员会深圳监管局备案。

（4）经本公司第三届董事会第二十六次会议审议通过，同意孙煜扬先生辞去本公司总裁职务，同意由邓召明先生担任本公司总裁。上述变更事项已经中国证券监督管理委员会证监许可[2008]122号文核准并于2008年2月1日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》公告。

（5）因工作变动，经本公司第三届董事会临时会议审议通过，公司决定由程世杰先生担任鹏华价值优势股票型证券投资基金（LOF）基金经理，胡建平先生不再担任该基金基金经理。上述变更事项已报中国证监会和深圳证监局备案并于2007年4月20日在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》公告。

2、本基金托管人 --- 中国建设银行股份有限公司的基金托管部门本报告期内没有发生重大变动。

(三) 本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

(四) 本报告期内本基金投资策略未改变。

(五) 本基金在本报告期进行了1次收益分配，向基金份额持有人按每10份基金份额派发红利1.200元，分红预案公告分别刊登于2007年4月20日的《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》

(六) 经本公司董事会批准、并经基金托管人同意，本公司决定将为本基金审计的会计师事务所由德勤华永会计师事务所有限公司更换为普华永道中天会计师事务所有限公司。上述变更已报中国证监会备案并于2007年1月20日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》公告。本年度审计费用100,000.00元。

(七) 本基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员在报告期内未受到任何处罚。

(八)基金租用证券公司专用席位的有关情况：

1、交易席位选择的标准和程序

基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其席位作为基金的专用交易席位，选择的标准是：

（1）实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于3亿元人民币；

（2）财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

（3）经营行为规范，最近二年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚；

（4）内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

（5）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；

（6）研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

选择席位的程序：

我公司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用席位的对象。我公司投研部门定期对所选定证券公司的服务进行综合评比，评比内容包括：提供研究报告质量、数量、及时性及提供研究服务主动性和质量等情况，并依据评比结果确定席位交易的具体情况。我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，分别向中银国际证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、北京高华证券有限责任公司、方正证券有限责任公司、兴业证券股份有限公司作为基金专用交易席位，并从2006年7月开始陆续使用。2007年新增安信证券股份有限公司、中国国际金融有限公司席位作为基金专用席位。本报告期内上述其他席位未发生变化。

2、鹏华价值优势股票型证券投资基金（LOF）2007年度通过各证券经营机构的席位买卖证券的交易量及支付的佣金如下：

（1）2007年1-12月份各券商股票交易量及佣金情况如下：

券商名称	租用席位数量	股票交易量（元）	占股票交易量比例（%）	累计佣金（元）	占各券商累计佣金比例（%）
中银国际	1	2,262,071,748.64	13.07	1,655,938.12	11.96
高华证券	1	2,540,983,153.64	14.68	2,082,559.22	15.05
兴业证券	1	3,674,215,082.15	21.22	3,011,467.60	21.76
方正证券	1	4,108,383,313.87	23.73	3,214,831.15	23.23
中信证券	1	1,517,915,839.76	8.77	1,244,334.24	8.99
安信证券	1	1,622,233,418.60	9.37	1,330,227.99	9.61
中金证券	1	1,586,341,972.30	9.16	1,300,804.05	9.40
合计	7	17,312,144,528.96	100.00	13,840,162.37	100.00

（2） 2007年1-12月份各券商债券及债券回购交易量情况如下：

券商名称	租用席位数量	债券交易量（元）	占债券交易量比例（%）	债券回购交易量（元）	占债券回购交易量比例（%）
中银国际	1	0.00	0.00	0.00	0.00
高华证券	1	59,782,161.70	42.52	88,000,000.00	31.65
兴业证券	1	79,681,940.40	56.68	120,000,000.00	43.17
方正证券	1	0.00	0.00	0.00	0.00
中信证券	1	0.00	0.00	70,000,000.00	25.18
安信证券	1	1,123,272.00	0.80	0.00	0.00
中金证券	1	0.00	0.00	0.00	0.00
合计	7	140,587,374.10	100.00	278,000,000.00	100.00

（3） 2007年1-12月份各券商权证交易量情况如下：

券商名称	租用席位数量	权证交易量（元）	占权证交易量比例(%)
中银国际	1	72,063,611.45	33.05
高华证券	1	24,971,508.23	11.45
兴业证券	1	4,288,144.74	1.97
方正证券	1	86,455,889.81	39.65
中信证券	1	30,250,860.03	13.87
安信证券	1	0.00	0.00
中金证券	1	0.00	0.00
合计	7	218,030,014.26	100.00

(九) 本报告期内其他重大事项：

1、本基金管理人于2007年3月29日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《关于谨防不法人员冒用我司名义进行非法证券活动的特别提示》，具体内容详见公告。

2、本基金管理人于2007年4月20日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《鹏华基金管理有限公司关于开通鹏华价值优势股票型证券投资基金（LOF）转换业务的公告》。

3、本基金管理人于2007年5月17日在本公司网站刊登《鹏华关于基金网上交易费率的补充公告》，对基金网上交易的大额申（认）购费率做如下补充说明：从本公告发布之日起，投资者通过本公司基金网上交易进行单笔大额申（认）购，其所购买基金招募说明书或相关业务公告中规定的最新适用的普通申（认）购费率低于基金网上交易优惠费率（0.6%）的，则该笔申（认）购按二者费率中的较低费率计收申（认）购费。具体内容详见公告。

4、根据中国证监会下发的《关于基金管理公司及证券投资基金执行（企业会计准则）的通知》规定，鹏华基金管理有限公司管理的所有基金于2007年7月1日实施新会计准则，实施新会计准则后，基金将全面采用公允价值进行会计计量，请投资者关注相关法规的规定以及相关基金定期信息披露报告。实施新会计准则后，基金估值方法及个别会计政策方面的变更不会对投资者利益造成实质性影响。上述事项已于2007年7月2日在本公司网站公告。

5、本基金管理人于2007年7月25日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登《鹏华基金管理有限公司在建设银行开通旗下开放式基金定期定额投资业务的公告》，自2007年7月25日起正式在中国建设银行股份有限公司开通本基金的定期定额投资业务。具体内容详见公告。

6、本基金管理人于2007年8月9日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《鹏华价值优势股票型证券投资基金（LOF）实施基金份额拆分和限量持续销售活动及修改基金合同的公告》，8月11日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《鹏华价值优势股票型证券投资基金（LOF）暂停基金转换业务的公告》，8月14日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《关于提前结束鹏华价值优势股票型证券投资基金（LOF）持续销售活动并暂停基金申购业务的公告》，9月12、13日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《鹏华价值优势股票型证券投资基金（LOF）拆分后恢复申购及转换转入业务公告》。具体内容详见公告。

7、本基金管理人于2007年8月29日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登《关于调整鹏华基金管理有限公司旗下开放式基金有关业务规则的公告》，于2007年9月3日起对本基金的有关业务规则作如下调整：（1）上述基金单个账户最低持有份额由原50份或100份调整为30份；（2）上述基金的定期定额投资业务每次最低扣款金额由原300元调整为200元。具体内容详见公告。

8、本基金托管人于2007年9月25日在上海证券交易所上市及开始交易，股票代码为601939。

9、经本公司股东会审议通过并经中国证监会证监基金字[2007]178号文批准和中国商务部商外资资审字[2007]0259号批准，深圳市北融信投资发展有限公司、方正证券有限责任公司、安徽国元信托投资有限责任公司将其持有的占本公司总股本49%的股权转让给意大利欧利盛金融集团（Eurizon Financial Group），上述三家股东分别转让本公司股权的15.68%、16.66%、16.66%。本次股权转让后，本公司将依法变更设立为外商投资企业，国信证券有限责任公司、Eurizon Financial Group、深圳市北融信投资发展有限公司三家股东的出资比例分别为50%、49%、1%。本公司已办理完毕上述变更事项的工商变更登记手续，并于2007年9月29日在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》公告。

10、本基金管理人于2007年9月29日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登《关于修改鹏华基金管理有限公司旗下基金基金合同中有关基金估值方法等内容的公告》，根据中国证监会下发的《关于基金实施＜企业会计准则＞后修改原有基金合同相关条款的通知》要求，依照2007年7月1日起生效执行的《企业会计准则》的规定，经与基金托管人协商一致，对本基金基金合同中有关基金估值方法和会计政策等内容进行了修改，具体内容详见公告。

11、本基金管理人于2007年10月22日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登《鹏华基金管理有限公司旗下基金关于在农行开通基金定投业务的公告》。自2007年10月22日起正式开通本基金在中国农业银行办理定期定额投资计划，并参加农行于2007年7月2日至12月31日举办的“金钥匙·基金宝”基金定期定投业务推广活动。具体内容详见公告。

12、本基金管理人于2007年12月26日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《鹏华基金管理有限公司关于旗下基金参与控股股东担任财务顾问的SEB国际股份有限公司部分要约收购苏泊尔股票的公告》，本基金参与了SEB国际股份有限公司部分要约收购苏泊尔股票。本公司的控股股东国信证券有限责任公司担任本次SEB国际股份有限公司部分要约收购浙江苏泊尔股份有限公司股票的财务顾问，具体内容详见公告。

13、本基金最近一次更新的招募说明书摘要于2008年3月3日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》。

十一、备查文件目录

（一）《鹏华价值优势股票型证券投资基金(LOF)基金合同》；

（二）《鹏华价值优势股票型证券投资基金(LOF)托管协议》；

（三）鹏华价值优势股票型证券投资基金(LOF)二00七年年度报告（原文）。

存放地点：深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心43层鹏华基金管理有限公司。

北京市西城区闹市口大街1号院1号楼中国建设银行股份有限公司

查阅方式：投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站（http://www.phfund.com.cn）查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司，本公司已开通客户服务系统，咨询电话：4006788999

鹏华基金管理有限公司
2008年3月29日

鹏华动力增长混合型证券投资基金(LOF)2007年年度报告摘要

（上接135版）

根据上述追溯调整，按原会计准则和制度直接记入所有者权益下“未实现利得/(损失)”科目的投资估值增值/(减值)净变动现按企业会计准则在利润表中的“公允价值变动收益/(损失)”科目中核算，相应的未实现损益平准金现按企业会计准则直接记入“未分配利润/(累计亏损)”科目。于会计期末，按原会计准则和制度列示于所有者权益下“未实现利得/(损失)”科目中的全部余额，现按企业会计准则包含于“未分配利润/(累计亏损)”科目中。

七、基金投资组合报告

(一) 本报告期末基金资产组合情况

资产品种	金额(元)	金额占基金总资产比例(%)
股票	13,644,315,762.17	86.32
债券	484,866,402.00	3.07
权证	23,801,500.00	0.15
银行存款及清算备付金	1,271,745,709.16	8.05
其他资产	381,081,793.40	2.41
合计	15,805,811,166.73	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)	市值占净值比例(%)
1	A 农、林、牧、渔业	0.00	0.00
2	B 采掘业	2,576,957,956.66	16.57
3	C 制造业	6,088,615,661.08	39.14
其中:	C0 食品、饮料	642,162,326.22	4.13
	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	708,000.00	0.00
	C4 石油、化学、塑胶、塑料	1,848,536,081.57	11.88
	C5 电子	132,300.00	0.00
	C6 金属、非金属	1,635,711,382.33	10.52
	C7 机械、设备、仪表	991,641,321.92	6.38
	C8 医药、生物制品	969,724,249.04	6.23
	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	414,452,219.35	2.66
5	E 建筑业	644,929,207.86	4.15
6	F 交通运输、仓储业	223,516,853.15	1.44
7	G 信息技术业	424,635,000.00	2.73
8	H 批发和零售贸易	388,178,000.00	2.50
9	I 金融、保险业	307,376,783.67	1.98
10	J 房地产业	1,819,293,926.56	11.70
11	K 社会服务业	729,676,962.96	4.69
12	L 传播与文化产业	26,683,190.88	0.17
13	M 综合类	0.00	0.00
	合计	13,644,315,762.17	87.72

(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)	市值占净值比例(%)
1	000069	华侨城A	14,470,335	727,134,333.75	4.67
2	600547	山东黄金	4,150,000	701,308,500.00	4.51
3	600489	中金黄金	5,800,000	662,070,000.00	4.26
4	600432	吉恩镍业	3,999,000	406,658,310.00	2.61
5	000024	招商地产	6,799,777	402,546,798.40	2.59
6	000758	中色股份	10,000,000	386,100,000.00	2.48
7	600383	金地集团	9,820,000	364,396,000.00	2.34
8	002001	新和成	11,200,000	364,000,000.00	2.34
9	000655	金岭矿业	10,176,972	361,587,815.16	2.32
10	000792	盐湖钾肥	4,500,000	350,460,000.00	2.25

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于鹏华基金管理有限公司网站http://www.phfund.com.cn的年度报告正文。

(四) 报告期内股票投资组合的重大变动（按新准则追溯调整后数据）

1.累计买入价值超出期末基金资产净值2%或前20名股票明细如下：

序号	股票代码	股票名称	累计买入金额(元)	占期末净值比例(%)
1	600489	中金黄金	1,183,357,960.95	7.61
2	600547	山东黄金	1,020,106,776.08	6.56
3	000069	华侨城A	756,844,412.46	4.87
4	600497	驰宏锌锗	736,156,540.29	4.73
5	600030	中信证券	622,005,264.43	4.00
6	000960	锡业股份	604,280,176.40	3.89
7	000655	金岭矿业	592,443,746.32	3.81
8	600036	招商银行	591,613,811.94	3.80
9	600432	吉恩镍业	560,416,502.05	3.60
10	000758	中色股份	528,300,338.80	3.40
11	600000	浦发银行	526,443,714.90	3.38
12	000792	盐湖钾肥	486,337,996.91	3.13
13	000060	中金岭南	453,676,383.18	2.92
14	600016	民生银行	437,649,957.09	2.81
15	000024	招商地产	424,994,081.03	2.73
16	000002	万科A	421,657,239.23	2.71
17	601628	中国人寿	418,243,243.45	2.69
18	000898	鞍钢股份	403,225,696.84	2.59
19	600050	中国联通	377,680,339.52	2.43
20	600123	兰花科创	363,440,260.26	2.34
21	600019	宝钢股份	361,287,405.26	2.32
22	600162	香江控股	359,646,641.21	2.31
23	600299	星新材料	358,786,090.99	2.31
24	000623	吉林敖东	336,375,873.04	2.16
25	600456	宝钛股份	328,285,767.57	2.11
26	000983	西山煤电	324,200,244.37	2.08
27	600058	五矿发展	322,960,981.37	2.08
28	000063	中兴通讯	321,598,802.33	2.07
29	600005	武钢股份	318,570,129.59	2.05

2.累计卖出价值超出期末基金资产净值2%或前20名股票明细如下：

序号	股票代码	股票名称	累计卖出金额(元)	占期末净值比例(%)
1	600030	中信证券	1,100,442,425.11	7.07
2	000002	万科A	791,915,127.43	5.09
3	600489	中金黄金	785,514,622.77	5.05
4	600000	浦发银行	774,626,371.22	4.98
5	000960	锡业股份	730,342,277.81	4.70
6	600036	招商银行	652,150,088.48	4.19
7	600547	山东黄金	640,031,119.47	4.11
8	600016	民生银行	625,101,361.41	4.02
9	000060	中金岭南	516,713,856.68	3.32
10	601628	中国人寿	467,961,906.41	3.01
11	000898	鞍钢股份	443,896,588.02	2.85
12	600497	驰宏锌锗	421,302,362.51	2.71