

易方达 50 指数证券投资基金 2006 年第四季度报告

2006年第4号

重要提示
本基金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。
四、基金管理人报告

本基金的托管人交通银行根据基金合同的规定，已于 2007 年 1 月 15 日核对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代表其未来表现。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。

本基金公告期为 2006 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。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：易基 50
2. 基金运作方式：契约型开放式
3. 基金合同生效日：2004 年 3 月 22 日
4. 报告期基金份额总额：1,750,563,056 份
5. 投资目标：通过长期稳健的资产增值，力争获得超越指数的投资收益，追求长期资本增值。
6. 投资策略：本基金主要投资于股票型基金，股票投资部分以上证 50 指数为目标的指数，资产配置以充分考虑充分的市场时机的判断主动调整仓位，通过运用深入的基本研究及先进的数量化投资技术，控制与目标指数的偏离风险，追求超越基准的收益水平。
7. 业绩比较基准：上证 50 指数
8. 风险收益特征：本基金属于股票型基金，风险控制与基准的偏离风险，同时力求风险收益特征。
9. 基金管理人：易方达基金管理有限公司
10. 基金托管人：交通银行股份有限公司

三、主要财务指标和基金净值表现

1. 主要财务指标(单位：元)

基金份额的收益	124,801,130.20
份额平均基金份额本期净收益	0.0170
期末基金份额净值	2,064,249,001.03
期末基金份额净值	1.7895

本基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

2. 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

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准	业绩比较基准收益率	①-③	②-④
过去3个月	66.95%	1.51%	61.81%	1.59%	-4.86%	-0.08%

3. 基金合同生效以来基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注：基金合同中有关投资比例限制的规定：

1、由于《证券投资基金管理办法》已废止，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》以及本基金管理人的有关规定，招募说明书有关条款的规定，自 2004 年 11 月 5 日起本基金的业绩比较基准和资产配置比例适用如下规则：

(1) 基金的业绩比较基准：上证 50 指数

(2) 基金的资产配置比例：本基金投资于股票的比例不低于基金净资产的 5%，现金或者到期日在一年以内的政府债券、正常情况下股票投资占基金净资产的比例不高于 90%。

4、遵守中国证监会规定的其他比例限制。

因基金规模或市场剧烈变化导致投资组合不符合上述规定时，基金管理人应在合理期限内进行调

整，以符合上述规定。法律法规另有规定的，从其规定。

5. 本基金在报告期间内未发生上述投资比例限制规定的情形。

6. 本报告期未按行业分类的股票投资组合

(1) 指数投资部分

7. 报告期内行业配置分析

2006 年第四季度，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明等有关基金运作的规定，以诚信于市场，诚信于社会公众为宗旨，本着诚信信用、勤勉尽责的原则管理基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋取最大利益。在本报告期，本基金管理人根据公司内部研究部门、基金经理、研究员、风控部门、监察稽核部、合规部、法律部门、客户服务部等部门的建议，结合宏观经济形势、政策导向、市场环境、资金面、估值水平、流动性等因素，综合评估后，适时调整大类资产配置比例，适当降低股票仓位，具体操作上在上涨趋势下，大盘蓝筹股被优先配置以为更好的成长性价值型股票，但实际上，市盈率股票成长性并不差，甚至好于许多中小股票，且这种成长预期持续并可持续。

8. 本报告期未按行业分类的股票投资组合

9. 报告期内行业配置分析

10. 本报告期未按行业分类的股票投资组合

11. 其他重要事项

12. 备查文件目录

13. 其他

14. 其他

15. 其他

16. 其他

17. 其他

18. 其他

19. 其他

20. 其他

21. 其他

22. 其他

23. 其他

24. 其他

25. 其他

26. 其他

27. 其他

28. 其他

29. 其他

30. 其他

31. 其他

32. 其他

33. 其他

34. 其他

35. 其他

36. 其他

37. 其他

38. 其他

39. 其他

40. 其他

41. 其他

42. 其他

43. 其他

44. 其他

45. 其他

46. 其他

47. 其他

48. 其他

49. 其他

50. 其他

51. 其他

52. 其他

53. 其他

54. 其他

55. 其他

56. 其他

57. 其他

58. 其他

59. 其他

60. 其他

61. 其他

62. 其他

63. 其他

64. 其他

65. 其他

66. 其他

67. 其他

68. 其他

69. 其他

70. 其他

71. 其他

72. 其他

73. 其他

74. 其他

75. 其他

76. 其他

77. 其他

78. 其他

79. 其他

80. 其他

81. 其他

82. 其他

83. 其他

84. 其他

85. 其他

86. 其他

87. 其他

88. 其他

89. 其他

90. 其他

91. 其他

92. 其他

93. 其他

94. 其他

95. 其他

96. 其他

97. 其他

98. 其他

99. 其他

100. 其他

101. 其他

102. 其他

103. 其他

104. 其他

105. 其他

106. 其他

107. 其他

108. 其他

109. 其他

110. 其他

111. 其他

112. 其他

113. 其他

114. 其他

115. 其他

116. 其他

117. 其他

118. 其他

119. 其他

120. 其他

121. 其他

122. 其他

123. 其他

124. 其他

125. 其他

126. 其他

127. 其他

128. 其他

129. 其他

130. 其他

131. 其他

132. 其他

133. 其他

134. 其他

135. 其他

136. 其他

137. 其他

138. 其他

139. 其他

140. 其他

141. 其他

142. 其他