科翔证券投资基金 2006年年度报告摘要

基金管理人:易方达基金管理有限公司　基金托管人:中国工商银行股份有限公司

重要提示

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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 3 月 6 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、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。

本报告财务资料已经审计。安永华明会计师事务所为本基金出具了标准无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

一、基金简介

(一)基金基本资料	
1、基金名称:	科翔证券投资基金
2、基金简称:	基金科翔
3、基金交易代码:	184713
4、基金运作方式:	契约型封闭式
5、基金合同生效日:	2001年5月25日
6、报告期末基金份额总额:	8亿份
7、基金合同存续期:	2001年5月25日至2008年12月13日
8、基金份额上市的证券交易所:	深圳证券交易所
9、上市日期:	2001年6月20日
(二)基金产品说明	
1、投资目标和策略:	科翔证券投资基金是积极成长型基金,主要投资目标是所处行业具有良好发展前景的新兴产业类上市公司。本基金将通过组合投资等措施减少和分散投资风险,努力确保基金资产的安全和长期资本增值。
2、业绩比较基准:	无
3、风险收益特征:	无
(三)基金管理人	
1、名称:	易方达基金管理有限公司
2、信息披露负责人:	张南
3、信息披露电话:	020－38799008
4、客户服务与投诉电话	400－881－8088(免长途话费)或(020)－83918088
5、传真:	020－38799488
6、电子邮箱:	csc@efunds.com.cn
(四)基金托管人	
1、名称:	中国工商银行股份有限公司
2、信息披露负责人:	蒋松云
3、联系电话:	010—66106912
4、传真:	010—66106904
5、电子邮箱:	custody@icbc.com.cn
(五)信息披露	
信息披露报纸名称:	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载年度报告正文的管理人互联网网址:	www.efunds.com.cn
基金年度报告置备地点:	广州市体育西路189号城建大厦28楼

二、主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况

(单位:人民币元)

重要提示:下述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字。

(一)主要财务指标

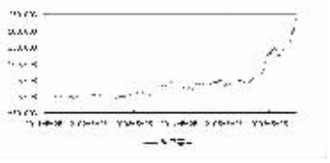
序号	项目	2006年度	2005年度	2004年度
1	基金本期净收益	357,908,810.21	74,782,172.38	111,028,388.15
2	基金份额本期净收益	0.4474	0.0935	0.1388
4	期末可供分配基金份额收益	0.4561	0.0987	0.1452
5	期末基金资产净值	2,116,356,553.66	989,230,459.55	1,000,454,362.40
6	期末基金份额净值	2.6454	1.2365	1.2506
8	本期基金份额净值增长率	127.20%	10.16%	8.51%

(二)基金净值表现

1、本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表:

阶段	净值增长率(1)	净值增长率标准差(2)	业绩比较基准收益率(3)	业绩比较基准收益率标准差(4)	(1)-(3)	(2)-(4)
过去三个月	31.37%	2.80%	-	-	-	-
过去六个月	34.85%	2.92%	-	-	-	-
过去一年	127.20%	3.34%	-	-	-	-
过去三年	171.58%	2.82%	-	-	-	-
过去五年	236.99%	2.51%	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	234.72%	2.38%	-	-	-	-

2、基金合同生效以来基金份额累计净值增长率的历史走势图



注:

1、基金合同中关于基金投资比例的约定:

(1)本基金投资于股票、债券的比例不低于本基金资产总值的 80%,本基金投资于国家债券的比例不低于本基金资产净值的 20%;

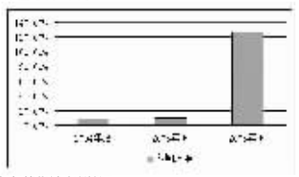
(2)本基金持有一家上市公司的股票,不得超过基金资产净值的 10%,本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和,不超过该证券的 10%;

(3)遵守中国证监会规定的其他比例限制;

本基金在本期间内遵守上述投资比例的规定进行证券投资。

2、本基金基金合同未规定业绩比较基准。

3、过往三年基金每年净值增长率图示



(三)过往三年基金每年的收益分配情况

单位:元

年度	每10份基金份额分红数	备注
2004年	0.800	-
2005年	1.400	-
2006年	0.900	-
合计	3.100	-

三、管理人报告

(一)基金管理人及基金经理介绍

1、基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2001]4 号文批准,易方达基金管理有限公司成立于 2001 年 4 月 17 日,注册资本 1.2 亿元。目前公司的股东为广东粤财信托、广发证券、广东美的电器股份公司、重庆国际信托和广州市广永国有资产经营有限公司,其中广东粤财信托、广发证券和广东美的电器股份公司分别占出资额的 25%,重庆国际信托占出资额的 16.67%,广州市广永国有资产经营有限公司占出资额的 8.33%。

公司下设基金投资部、研究部、集中交易室、市场部、注册登记部、核算部、信息技术部、监察部、人力资源部、综合管理部、机构理财部、固定收益部、投资发展部等部门。良好的治理结构和健全的内部控制保证了公司的合法规范经营,并逐步形成稳健、务实、规范、创新的经营风格。

自成立以来,易方达基金管理有限公司秉承“取信于市场,取信于社会”的宗旨,坚持“在诚信规范的前提下,通过专业化运作和团队合作实现持续稳健的增长”的经营理念,努力以规范的运作、良好的业绩和优质的服务,为投资者创造最佳的回报。

截至 2006 年 12 月 31 日,公司旗下有基金科汇、基金科翔、基金科讯、基金科瑞四只封闭式基金和易方达平稳增长基金、易方达策略成长基金、易方达 50 指数基金、易方达积极成长基金、易方达货币市场基金、易方达月月收益中短期债券投资基金、易方达价值精选股票型基金、易方达策略成长二号混合型基金等八只开放式基金和易方达深证 100 交易型开放式指数基金。

2、基金经理介绍

冉华,男,1976 年 1 月出生,经济学硕士。2001 年 4 月加入易方达基金管理有限公司,参与过公司筹建,曾任行业研究员、基金经理助理,本报告期内任机构理财部副总经理、科翔基金基金经理。

(二)对报告期内基金运作的遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定,以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内,基金运作合法合规,无损害基金份额持有人利益的行为。

(三)基金经理报告

1、报告期内基金投资策略和业绩表现的说明与解释

2006 年的牛市应该说是多种因素综合作用的结果。首先是监管层坚决推进的股改成为市场从熊转牛的关键性的一步。股改的完成和公司高管(员工)股权激励制度的逐步推进,在很大程度上解决了中国证券市场长期以来公司市值和管理层(或者大股东)利益两张皮的问题。当然由于各方面的原因,各公司解决的程度不同,但这是一个积极的趋势,并将长期影响上市公司的行为。其次是多年的经济体制改革的综合结果。虽然市场走过了 5 年的熊市,但是包括证券市场体制在内的市场经济体制改革没有停步,中国经济体制进一步市场化和国际化。稳定的政治环境、庞大的劳动力基础和中国人民勤劳的特质使得中国成为全球制造业的中心,并且正逐步从低成本的制造业中心向更高附加值的制造中心升级转型。同时,各行各业的企业在创新、提升管理水平、扩大全球视野等各方面不断进步,企业的内在竞争力不断增强。中国经济成为全球经济的少有亮点。由此带来的人民币升值和资产重估成为市场 06 年很重要的主线。

结合市场情况,本基金坚持以价值投资为导向,持续进行结构调整,力争做到攻守兼备。本基金在 2006 年仍然保持了高仓位,并持续进行结构调整。06 年上半年,本基金仍坚持个股适度重仓的策略,获得了较好的回报;06 年下半年,本基金战略性地选择了一些新的品种,扩大持股的覆盖面,使组合的弹性增加,并提前布局以迎接市场的进一步发展。

截至报告期末,本基金份额净值为 2.6454 元,本报告期份额净值增长率为 127.20%,同期上证指数增长率为 130.43%。

2、对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2007 年,上述因素依然存在并将持续发展,所以 2007 年的市场仍然可期。具体来看:1、一批大市值“蓝筹”公司估值依然偏低;2、全流通时代将创造更多新的投资机会,兼并收购、定向增发、资产重组等方兴未艾;3、在未来 3－5 年,有相当一批逐步具有国际竞争力的企业将持续成长。在中国经济改革多年以后,已经的的确确有相当一批具有远见卓识、专心主业的企业家成长起来,他们带领的企业将突破一些传统因素的波动影响,并将进入更大的市场发展空间。

需要注意的是,2006 年很多公司由于估值水平的提升,上涨幅度远超出了想象。如果同时考虑盈利预测上调,两个正向因素叠加,上涨幅度将更加惊人。此外,2006 年市场如此强劲的一个重要因素还在于赚钱效应吸引了新增资金源源不断涌入市场。但是,一旦盈利水平达不到预期,其估值水平又会相应降低,两个负向因素叠加,股价的下跌恐怕也会是惊人的。所以 2007 年市场特别是个股的波动可能加大。

总的来看,由于中国巨大的人口基数的存在,老百姓消费习惯或者储蓄行为的轻微改变都会给很多行业带来巨大的机会。市场会有波动,但是必将有相当一批企业会有耀眼表现。我们将努力发掘这些具有核心竞争力的“亮点”企业,争取为持有人带来长期稳定的回报。

(四)基金内部监察报告

本报告期内,监察工作继续完善内控体系,加强风险管理,督促各项业务的合规运作。监察部根据独立、客观、公正的原则,认真履行职责,通过材料审阅、实时监控、调查核实、人员询问和重点抽查等多种方法开展工作,发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告,定期向公司董事会和监管部门出具监察报告。

本报告期内,为进一步强化投资的规范运作和风险管理,监察部主要做了以 下工作:

(1)进一步健全公司内控体系,保持了良好的内控环境、全面合理的风险评估机制、充分有效的控制活动、顺畅及时的信息沟通、以及对制度和内控体系的持续检验。

(2)按照最新颁布的《证券投资基金管理公司治理准则(试行)》等法规规定,着力从理论基础、思路框架、方法流程、技术规范等方面协助和指导业务部门的制度建设工作,积极推进公司制度体系的全面检讨修订工作。

(3)进一步健全了投资的事前、事中和事后风险监控和防范机制。

(4)坚持对投资、交易、核算、注册登记、信息技术、直销、客服等业务的运作进行日常合规性监察检查,同时还有计划、有针对性地对公司有关业务部门进行了多次全面或专项的监察检查,并根据证监会的《监察稽核报告内容与格式指引》以及《监察稽核项目表》,每季度组织各业务部门进行全面或专项的监察检查。

(5)按照法规的要求,认真做好旗下各只基金的信息披露工作,确保有关信息披露的真实、完整、准确、及时。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性,努力防范和控制各种风险,充分保障基金份额持有人的合法权益。

四、托管人报告

2006 年度,本基金托管人在对科翔证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

2006 年度,科翔证券投资基金的管理人——易方达基金管理有限公司在科翔证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本托管人依法对易方达基金管理有限公司在 2006 年度所编制和披露的科翔证券投资基金年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行股份有限公司资产托管部

2007 年 3 月 6 日

五、审计报告

安永华明会计师事务所审计了科翔证券投资基金 2006 年 12 月 31 日的资产负债表和 2006 年度的经营业绩表、基金净值变动表及基金收益分配表,并出具了标准无保留意见的审计报告。

六、财务会计报告

(一)基金会计报表

1、资产负债表

科翔证券投资基金
资产负债表
2006 年 12 月 31 日
单位:人民币元

	2006-12-31	2005-12-31
资产		
银行存款	8,085,411.86	41,537,323.39
清算备付金	2,598,571.90	153,125.28
交易保证金	848,780.49	1,098,780.49
应收证券清算款	2,054,141.01	16,376,634.15
应收股利	-	-
应收利息	3,341,949.47	3,193,860.95
其他应收款	-	-
股票投资市值	1,607,305,341.45	729,611,386.54
其中:股票投资成本	675,311,409.64	620,354,505.52
债券投资市值	480,385,216.34	200,791,156.20
其中:债券投资成本	481,511,274.77	200,119,679.04
权证投资	20,612,537.25	334,768.55
其中:权证投资成本	-	-
买入返售证券	-	-
待摊费用	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,125,231,949.77	993,097,035.55
负债		
应付证券清算款	3,333,729.79	-
应付管理人报酬	2,521,186.87	1,210,163.41
应付托管费	420,197.82	201,693.89
应付佣金	438,219.27	392,656.34
应付利息	-	-
应付收益	-	-
未交税金	-	-
其他应付款	1,997,062.36	1,997,062.36
卖出回购证券款	-	-
短期借款	-	-
预提费用	165,000.00	65,000.00
其他负债	-	-
负债合计	8,875,396.11	3,866,576.00
持有人权益		
实收基金	800,000,000.00	800,000,000.00
未实现利得	951,480,410.63	110,263,126.73
未分配收益	364,876,143.03	78,967,332.82
持有人权益合计	2,116,356,553.66	989,230,459.55
负债及持有人权益总计	2,125,231,949.77	993,097,035.55
基金份额净值	2.6454	1.2365

所附附注为本会计报表的组成部分

2、经营业绩表及收益分配表

科翔证券投资基金
经营业绩表
2006 年度
单位:人民币元

	2006年度	2005年度
收入	385,140,249.66	92,816,796.61
股票差价收入	343,112,485.93	67,084,075.44
债券差价收入	-1,678,265.70	4,246,414.74
权证差价收入	20,355,324.31	1,121,995.57
债券利息收入	8,515,668.97	6,379,274.72
存款利息收入	412,634.28	363,518.60
股利收入	14,402,401.87	13,612,521.20
买入返售证券收入	-	-
其他收入	20,000.00	8,996.34
费用	27,231,439.45	18,034,624.23
基金管理人报酬	21,464,213.80	14,720,921.07
基金托管费	3,577,368.92	2,453,486.91
卖出回购证券支出	1,501,280.23	36,045.21
利息支出	-	-
其他费用	688,576.50	824,171.04
其中:上市年费	60,000.00	60,000.00
信息披露费	300,000.00	340,000.00
审计费用	65,000.00	65,000.00
基金净收益	357,908,810.21	74,782,172.38
加:未实现利得	841,217,283.90	25,993,924.77
基金经营业绩	1,199,126,094.11	100,776,097.15

所附附注为本会计报表的组成部分

科翔证券投资基金
收益分配表
2006 年度
单位:人民币元

	2006年度	2005年度
本期基金净收益	357,908,810.21	74,782,172.38
加:期初基金净收益	78,967,332.82	116,185,160.44
可供分配基金净收益	436,876,143.03	190,967,332.82
减:本期已分配基金净收益	72,000,000.00	112,000,000.00
期末基金净收益	364,876,143.03	78,967,332.82

所附附注为本会计报表的组成部分

3、基金净值变动表

科翔证券投资基金
基金净值变动表
2006 年度
单位:人民币元

	2006年度	2005年度
一、期初基金净值	989,230,459.55	1,000,454,362.40
二、本期经营活动:		
基金净收益	357,908,810.21	74,782,172.38
未实现利得	841,217,283.90	25,993,924.77
经营活动产生的基金净值变动数	1,199,126,094.11	100,776,097.15
三、本期向持有人分配收益		
向基金持有人分配收益产生的基金净值变动数	-72,000,000.00	-112,000,000.00
四、期末基金净值	2,116,356,553.66	989,230,459.55

所附附注为本会计报表的组成部分

(二)年度会计报表附注

附注 1.　本基金年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表一致。

附注 2.　重大会计差错的内容和更正金额。

本基金 2006 年度并无重大会计差错。

附注 3.　关联方关系及关联方交易

(1)主要关联方关系

企业名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人
中国工商银行股份有限公司	基金托管人
广发证券股份有限公司(简称“广发证券”)	基金发起人、基金管理人股东
广东粤财信托投资有限公司	基金发起人、基金管理人股东
广东美的电器股份有限公司	基金管理人股东
重庆国际信托投资有限公司	基金管理人股东
广州市广永国有资产经营有限公司	基金管理人股东

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(2)通过主要关联方席位进行的交易

本基金 2006 及 2005 年度均未发生通过关联方席位进行的交易

(3)关联方报酬

A　基金管理人报酬

基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.5%/当年天数

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付;由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。本基金于本期应支付基金管理人管理费共计人民币 21,464,213.80(2005 年:14,720,921.07 元),其中已支付基金管理人人民币 18,943,026.93 元,尚余人民币 2,521,186.87 元未支付。

B　基金托管人报酬

基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%/当年天数

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付;由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。本基金于本期应支付基金托管人托管费共计人民币 3,577,368.92 元(2005 年:2,453,486.91 元),其中已支付基金托管人人民币 3,157,171.10 元,尚余人民币 420,197.82 元未支付。

(4)　与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易

项目	中国工商银行	
	2006年度	2005年度
买入债券成交金额	0.00	0.00
卖出债券成交金额	0.00	0.00
买入返售证券成交金额	0.00	0.00
买入返售证券利息收入	0.00	0.00
卖出回购证券成交金额	196,240,000.00	0.00
卖出回购证券利息支出	99,732.93	0.00

(5)　由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管,并按银行间同业存款利率计息,由基金托管人保管的银行存款余额及产生的利息收入情况如下:

	2006-12-31	2005-12-31
银行存款余额	8,085,411.86	41,537,323.39

	2006年度	2005年度
银行存款产生的利息收入	383,260.11	348,489.30

(6)关联方投资本基金的情况

A　基金管理公司持有基金份额情况

	2006年度	2005年度
年初持有基金份额	39,360,853	19,999,000
加:本年买入	2,213,102	19,361,853
减:本年卖出	-	-
年末持有基金份额	41,573,955	39,360,853
基金管理人持有份额占年末基金总份额的比例	5.20%	4.92%

基金管理人 2006 年度及 2005 年度持有本基金基金份额变动相关的交易费用按交易所公布的基金交易费率计算并支付。

B　基金管理公司主要股东及其控制的机构持有基金份额情况

关联方名称	2006年 12 月 31 日		2005年 12 月 31 日	
	持有基金份额	占基金总份额比例	持有基金份额	占基金总份额比例
广东粤财信托投资有限公司	1,330,000	0.17%	1,330,000	0.17%
广发证券股份有限公司	1,330,000	0.17%	1,330,000	0.17%

附注 4.　报告期末流通转让受到限制的基金资产

本基金截至 2006 年 12 月 31 日止流通转让受限制的资产情况如下:

(1)本基金截至 2006 年 12 月 31 日止因股权分置改革暂时停牌而流通转让受限制的资产情况如下:

股票代码	股票名称	数量(股)	年末成本总额	年末估值单价	年末估值总额	停牌日期	复牌日期	复牌开盘单价
000423	S阿胶	1,361,830	8,911,523.87	13.72	18,684,307.60	2006-12-4	未知	未知
000895	S双汇	120,550	1,559,541.90	31.02	3,739,461.00	2006-6-1	未知	未知
600582	S天地	715,006	17,197,730.64	25.34	18,118,252.04	2006-12-14	2007-1-15	30.00
合计			27,668,796.41		40,542,020.64			

以上因股权分置改革而暂时停牌的股票,其年末估值单价是根据最近一个交易日的市场平均价确定。

(2)网下申购未流通新股:

名称	数量	期末成本总额	期末估值总额	占基金净值比例	估值方法	转让受限原因	受限期限(上市流通日)
青岛软控	22,360	581,360.00	1,057,180.80	0.0500%	按市价估值	网下公开发行未流通	2007-01-18
东源电器	42,423	334,293.24	596,043.15	0.0282%	按市价估值	网下公开发行未流通	2007-01-18
鲁阳股份	38,917	428,087.00	1,048,813.15	0.0496%	按市价估值	网下公开发行未流通	2007-02-28
青岛金王	55,377	425,849.13	658,986.30	0.0311%	按市价估值	网下公开发行未流通	2007-03-15
网盛科技	17,772	250,407.48	992,388.48	0.0469%	按市价估值	网下公开发行未流通	2007-03-15
广深铁路	958,120	3,602,531.20	6,869,720.40	0.3246%	按市价估值	网下公开发行未流通	2007-03-22
北辰实业	582,414	1,397,793.60	3,925,470.36	0.1855%	按市价估值	网下公开发行未流通	2007-1-16
中国人寿	174,195	3,288,801.60	3,288,801.60	0.1554%	按成本估值	网下公开发行未上市	2007-4-9
大唐发电	120,000	801,600.00	1,236,000.00	0.0584%	按市价估值	网下公开发行未流通	2007-03-21
合计	2,011,578	11,110,723.25	19,673,404.24				

(3)非公开发行未流通股票:

名称	数量	期末成本总额	期末估值总额	占基金净值比例	估值方法	转让受限原因	受限期限(上市流通日)
中金岭南	800,000	9,624,000.00	10,152,000.00	0.4797%	按证监会规定的计算方法	非公开发行未流通	2007-11-21
中信国安	2,300,000	27,600,000.00	53,130,000.00	2.5104%	按市价估值	非公开发行未流通	2007-8-23
沪东重机	1,300,000	18,850,000.00	41,262,000.00	1.9497%	按市价估值	非公开发行未流通	2007-08-30
瑞贝卡	2,000,000	19,800,000.00	20,680,000.00	0.9772%	按证监会规定的计算方法	非公开发行未流通	2007-12-06
合计	6,400,000	75,874,000.00	125,224,000.00				

七、投资组合报告

1、本报告期末基金资产组合情况

项目名称	金额(元)	占基金资产总值比例
股票	1,607,305,341.45	75.63%
债券	480,385,216.34	22.60%
权证	20,612,537.25	0.97%
资产支持证券	-	-
银行存款和清算备付金合计	10,683,983.76	0.50%
应收证券清算款	2,054,141.01	0.10%
其他资产	4,190,729.96	0.20%
总计	2,125,231,949.77	100.00%

2、本报告期末按行业分类的股票投资组合

行业类别	市值(元)	占基金资产净值比例
A 农、林、牧、渔业	4,406,260.48	0.21%
B 采掘业	4,144,606.14	0.20%
C 制造业	852,158,498.69	40.26%
C0 食品、饮料	300,974,481.40	14.22%
C1 纺织、服装、皮毛	33,119,226.16	1.56%
C2 木材、家具	0.00	0.00%
C3 造纸、印刷	8,270,801.09	0.39%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	22,933,003.50	1.08%
C5 电子	3,392,228.25	0.16%
C6 金属、非金属	155,719,533.08	7.36%
C7 机械、设备、仪表	236,165,398.31	11.16%
C8 医药、生物制品	90,924,840.60	4.30%
C99 其他制造业	658,986.30	0.03%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	1,272,319.86	0.06%
E 建筑业	10,988,317.62	0.52%
F 交通运输、仓储业	43,393,766.84	2.05%
G 信息技术业	81,971,549.32	3.87%
H 批发和零售贸易	284,432,843.74	13.44%
I 金融、保险业	130,215,385.65	6.15%
J 房地产业	45,029,466.08	2.13%
K 社会服务业	82,469,474.43	3.90%
L 传播与文化产业	0.00	0.00%
M 综合类	66,822,852.60	3.16%
合计	1,607,305,341.45	75.95%

3、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)	占基金资产净值比例
1	600519	贵州茅台	2,256,515	198,122,017.00	9.36%
2	002024	苏宁电器	4,353,700	193,652,576.00	9.15%
3	600089	特变电工	8,097,355	122,108,113.40	5.77%
4	600036	招商银行	5,800,000	94,134,000.00	4.45%
5	000069	华侨城 A	3,641,371	81,311,814.43	3.84%
6	000869	张裕 A	1,441,763	73,284,813.29	3.46%
7	000839	中信国安	3,003,507	69,381,011.70	3.28%
8	600415	小商品城	872,361	66,822,852.60	3.16%
9	600150	沪东重机	1,325,000	42,055,500.00	1.99%
10	600439	瑞贝卡	2,751,161	33,119,226.16	1.56%

4、本报告期股票投资组合的重大变动

(1)本报告期内累计买入价值超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	累计买入金额(元)	占期初基金资产净值的比例
1	000039	中集集团	59,857,657.82	6.05%
2	000839	中信国安	47,443,517.02	4.80%
3	000002	万科 A	44,794,961.66	4.53%
4	600089	特变电工	44,496,151.18	4.50%
5	000970	中科三环	34,570,171.01	3.49%
6	600026	中海发展	33,021,015.40	3.34%
7	600439	瑞贝卡	31,771,536.86	3.21%
8	600549	厦门钨业	30,313,299.05	3.06%
9	600036	招商银行	27,074,287.20	2.74%
10	600423	柳化股份	23,886,839.39	2.41%
11	600325	华发股份	23,071,036.60	2.33%
12	601006	大秦铁路	22,778,933.38	2.30%
13	000869	张裕 A	22,543,583.73	2.28%
14	600331	宏达股份	22,411,687.94	2.27%
15	000837	秦川发展	21,828,430.43	2.21%
16	600863	内蒙华电	21,436,657.35	2.17%
17	600030	中信证券	19,947,358.34	2.02%
18	600161	天坛生物	19,888,997.04	2.01%
19	600795	国电电力	19,373,967.56	1.96%
20	000157	中联重科	19,307,836.69	1.95%

(2)本报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	累计卖出金额(元)	占期初基金资产净值的比例
1	600009	上海机场	87,711,064.52	8.87%
2	600519	贵州茅台	62,599,577.11	6.33%
3	000039	中集集团	61,568,920.38	6.22%
4	000002	万科 A	51,679,678.07	5.22%
5	600460	士兰微	43,797,381.00	4.43%
6	600863	内蒙华电	39,421,531.56	3.99%
7	000157	中联重科	38,698,645.15	3.91%
8	000869	张裕 A	36,137,451.70	3.65%
9	600125	铁龙物流	34,771,712.64	3.52%
10	000970	中科三环	34,309,751.83	3.47%
11	600795	国电电力	33,174,334.70	3.35%
12	600739	辽宁成大	29,000,914.31	2.93%
13	000069	华侨城 A	28,593,981.16	2.89%
14	600879	火箭股份	27,937,277.61	2.82%
15	000423	S阿胶	26,368,400.25	2.67%
16	600030	中信证券	25,712,765.02	2.60%
17	601006	大秦铁路	25,531,142.94	2.58%
18	600900	长江电力	25,475,845.99	2.58%
19	000983	西山煤电	24,496,377.73	2.48%
20	600036	招商银行	24,001,872.08	2.43%
21	000837	秦川发展	23,306,067.36	2.36%
22	600423	柳化股份	23,299,639.30	2.36%
23	600887	伊利股份	23,107,241.23	2.34%
24	600269	赣粤高速	22,601,836.21	2.28%
25	600138	中青旅	22,266,881.58	2.25%
26	000800	一汽轿车	22,258,655.12	2.25%
27	600549	厦门钨业	20,315,240.87	2.05%
28	000900	现代投资	20,043,914.20	2.03%

(3)本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:元

买入股票成本总额	1,215,852,745.01
卖出股票收入总额	1,500,278,883.85

5、本报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券品种	市值(元)	占基金资产净值比例
1	国　债	128,076,474.20	6.05%
2	金融债	298,722,283.79	14.12%
3	央行票据	-	-
4	企业债	53,586,458.35	2.53%
5	可转债	-	-
	合　计	480,385,216.34	22.70%

6、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)	占基金资产净值比例
1	02国债(4)	75,337,638.20	3.56%
2	01国开14	66,113,460.00	3.12%
3	05国开17	65,573,880.00	3.10%
4	钢钒债1	53,586,458.35	2.53%
5	06进出06	49,326,312.77	2.33%

7、投资组合报告附注

(1)投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于基金管理人网站 www.efunds.com.cn 的年度报告正文。

(2)报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查的情况,报告编制日前一年内未受到公开谴责或处罚。

(3)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。

(4)其他资产:

名称	金额(元)
交易保证金	848,780.49
应收股利	-
应收利息	3,341,949.47
待摊费用	-
其他应收款	-
合计	4,190,729.96