科讯证券投资基金 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:交通银行

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。

基金托管人交通银行根据本基金合同规定,于 2007 年 3 月 1 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:	科讯证券投资基金
2.基金简称:	基金科讯
3.基金交易代码:	500029
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1月11日
8.基金份额上市的证券交易所:	上海证券交易所
9.上市日期:	2001年6月20日
(二)基金产品说明	
1.投资目标与投资策略:	主要投资目标是企业基本面良好,业绩维持稳定增长,符合产业发展方向的上市公司。基金将通过创建投资组合等措施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:	40088-18088(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:	交通银行
2.信息披露负责人:	张咏东
3.联系电话:	021-68888917
4.传真:	021-58408836
5.电子邮箱:	zhangyd@bankcomm.com
(五)信息披露	
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	394,575,508.34	59,084,142.50	43,540,797.95
2	基金份额本期净收益	0.4932	0.0739	0.0544
3	期末可供分配基金份额收益	0.4997	0.0765	0.0377
4	期末基金资产净值	1,879,712,424.94	915,119,860.50	917,208,716.68
5	期末基金份额净值	2.3496	1.1439	1.1465
6	本期基金份额净值增长率	116.39%	2.68%	1.12%

(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列表:

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	39.02%	2.55%	-	-	-	-
过去六个月	32.22%	2.65%	-	-	-	-
过去一年	116.39%	2.99%	-	-	-	-
过去三年	124.69%	2.62%	-	-	-	-
过去五年	161.63%	2.41%	-	-	-	-
基金合同生效至今	157.00%	2.28%	-	-	-	-

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:

a. 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%;

b. 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%;

c. 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)本基金于 2006 年 1 月 1 日聘任侯清濯先生担任基金经理,免去马骏先生基金经理职务,但基金原有投资目标、投资范围、投资策略和选股标准等完全没有变化。

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	0.000	-
2005年	0.350	-
2006年	0.700	-
合计	1.050	-

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

侯清濯先生,生于 1975 年,清华大学工学硕士,曾任易方达基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理,本报告期内任基金科讯基金经理。

(二)基金运作合规性说明

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、 投资策略和业绩表现回顾

基金科讯在 2006 年坚定看好中国的宏观经济趋势,尽可能将主要资产配置在与国民经济紧密相关的行业板块中,并取得了较好的效果。基金科讯当期业绩超过封闭式基金平均水平。回顾 2006 年基金科讯的股票组合,钢铁、汽车和消费品板块配置比例明显超过封闭式基金平均配置水平,这些行业板块的超额收益对基金科讯业绩贡献最大;而零售、金融等板块的配置一直明显低于封闭式基金平均配置水平,基金科讯非常遗憾地错过了这些行业板块中的超额收益。未来基金科讯在坚持独立研究、投资的同时,也必须逐步开拓视野、虚心学习借鉴其他基金的投资经验,为持有人谋求最大的投资收益。

截至报告期末,本基金份额净值为 2.3496 元,本报告期份额净值增长率为 116.39%。

2、 宏观经济和市场展望

2006 年度市场强劲上涨,涨幅超过市场普遍预期,仅第四季度上证指数就上涨了 923 点。整个市场在震惊之余,纷纷从不同的角度出发思考 2007 年市场的走势,并采取相应的策略。基金科讯认为,当前市场最大的共识在于人民币持续升值的潜力。人民币持续升值的背后是中国活跃的对外贸易,但究其本质看,人民币升值只能算是中国宏观经济强劲上涨的一个外在现象,是中国成长为经济大国、强国这一不可逆转的巨潮中的浪花之一。在 2007 年或者今后相当长的时期内,以人民币升值和消费增长等为外在现象的中国宏观经济都将维持上涨趋势。预计 2007 中国股市有望与宏观经济保持同步上升趋势。消费服务、钢铁、航运等几个板块最有可能随着宏观经济的上涨而步入持续的上升景气周期,步入上升周期的企业大幅增长的业绩必将推动上市公司股价的进一步上涨。基金科讯有理由相信,2007 年中国 A 股市场仍然是充满机会的市场,并将积极调整策略,除了在传统的消费、制造等领域进一步深入发掘,保持相对配置优势外,还要不断开拓研究视野和投资范围,对于由新操作系统 Vista 和通讯 3G 系统引发的 IT 产业新的浪潮波及到的、并且未曾重点配置的板块,都将给予充分的重视。

在新的一年中,预计对当前 A 股市场估值水平的分歧、宏观统计数据与微观企业经营状况背离等因素也会对市场产生负面影响,造成指数的波动。但基金科讯坚信,中国宏观经济向上发展的趋势不会改变,进入景气上升周期的企业业绩最终会推动指数进一步上涨,而基金科讯就是要在这一过程中,寻找优势企业并买入持有,为持有人谋求持续稳定的资本增值。

四、托管人报告

2006 年,交通银行在科讯基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、基金托管协议,依法安全保管了基金的资产,勤勉尽责地履行了基金托管人的义务,不存在损害基金持有人利益的行为。

2006 年,按照《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、基金托管协议,本托管人对基金管理人——易方达基金管理有限公司在科讯基金投资运作方面进行了监督,对基金资产净值、基金份额净值和费用计算上进行了认真复核,未发现基金管理人有损害基金持有人的利益行为。

2006 年,由科讯基金管理人——易方达基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关科讯基金的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真实、准确、完整。

交通银行

2007 年 3 月 1 日

五、审计报告

安永华明会计师事务所审计了科讯证券投资基金 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

科讯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		12,205,109.93	19,650,260.50
清算备付金		2,684,549.02	1,236,442.10
交易保证金		1,109,609.61	1,381,465.52
应收证券清算款		2,416,088.83	-
应收股利		-	-
应收利息		3,556,644.33	1,726,448.66
其他应收款		-	-
股票投资市值		1,469,792,603.65	714,096,786.13
其中:股票投资成本		808,875,419.81	661,693,843.48
债券投资市值		379,477,208.59	185,248,693.30
其中:债券投资成本		379,332,312.19	183,753,443.83
权证投资		25,108,899.65	-
其中:权证投资成本		6,255,731.67	-
买入返售证券		-	-
待摊费用		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,896,350,713.61	923,340,096.21
负债			
应付证券清算款		11,917,870.20	5,164,774.09
应付管理人报酬		2,198,274.72	1,122,381.13
应付托管费		366,379.11	187,063.51
应付佣金		1,105,629.71	795,882.05
应付利息		-	-
应付收益		-	-
未交税金		-	-
其他应付款		885,134.93	885,134.93
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		16,638,288.67	8,220,235.71
持有人权益			
实收基金		800,000,000.00	800,000,000.00
未实现利得		679,915,248.22	53,898,192.12
未分配收益		399,797,176.72	61,221,668.38
持有人权益合计		1,879,712,424.94	915,119,860.50
负债及持有人权益总计		1,896,350,713.61	923,340,096.21
基金份额净值		2.3496	1.1439

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

科讯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		418,799,706.50	75,689,225.01
股票差价收入		369,067,799.70	49,844,488.95
债券差价收入		195,985.87	2,539,378.90
权证差价收入		27,337,916.74	3,632,589.15
债券利息收入		7,500,023.42	6,527,877.40
存款利息收入		397,940.21	413,918.77
股利收入		14,280,040.56	12,702,643.71
买入返售证券收入		-	-
其他收入		20,000.00	28,328.13
费用		24,224,198.16	16,605,082.51
基金管理人报酬		19,066,583.61	13,709,807.79
基金托管费		3,177,763.82	2,284,967.95
卖出回购证券支出		1,348,507.85	34,723.55
利息支出		-	-
其他费用		631,342.88	575,583.22
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		394,575,508.34	59,084,142.50
加:未实现利得		626,017,056.10	-33,172,954.97
基金经营业绩		1,020,592,564.44	25,911,187.53

所附附注为本会计报表的组成部分

科讯证券投资基金

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		394,575,508.34	59,084,142.50
加:期初基金净收益		61,221,668.38	30,137,569.59
可供分配基金净收益		455,797,176.72	89,221,712.09
减:本期已分配基金净收益		56,000,000.00	28,000,043.71
期末基金净收益		399,797,176.72	61,221,668.38

所附附注为本会计报表的组成部分

3、基金净值变动表

科讯证券投资基金

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		915,119,860.50	917,208,716.68
二、本期经营活动:			
基金净收益		394,575,508.34	59,084,142.50
未实现利得		626,017,056.10	-33,172,954.97
经营活动产生的基金净值变动数		1,020,592,564.44	25,911,187.53
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		-56,000,000.00	-28,000,043.71
四、期末基金净值		1,879,712,424.94	915,119,860.50

所附附注为本会计报表的组成部分

(二)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
交通银行	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

关联方名称	2006年度		2005年度	
(a) 股票买卖	年度成交金额	占全年交易金额比例	年度成交金额	占全年交易金额比例
广发证券	851,054,347.87	20.48%	370,886,404.28	15.92%
(b) 债券买卖	年度成交金额	占全年交易金额比例	年度成交金额	占全年交易金额比例
广发证券	200,506,108.90	36.49%	12,397,040.90	6.80%
(c) 债券回购	年度成交金额	占全年交易金额比例	年度成交金额	占全年交易金额比例
广发证券	-	-	-	-
(d) 权证买卖	年度成交金额	占全年交易金额比例	年度成交金额	占全年交易金额比例
广发证券	22,292,115.43	81.54%	2,103,600.00	57.90%
(e) 佣金	年度佣金金额	占全年佣金比例	年度佣金金额	占全年佣金比例
广发证券	694,956.80	20.79%	304,099.17	16.17%

说明:

基金交易佣金的计算方式如下:

沪市交易佣金＝股票买(卖)成交金额 *1－股票买(卖)经手费(买卖成交金额 *0.11)－股票买(卖)证管费(买卖成交金额 *0.04)－证券结算风险金(股票成交金额 *0.03+ 国债现货成交全价金额 *0.01+ 国债回购金额 * 相应费率)

深市交易佣金＝股票买(卖)成交金额 *1－股票买(卖)经手费(买卖成交金额 *0.1875)－证券结算风险金(股票成交金额 *0.03+ 国债现货成交全价金额 *0.01+ 国债回购金额 * 相应费率)

向关联方支付的交易佣金采用公允的交易佣金比率计算。关联方席位租用合同范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

(3)关联方报酬

A 基金管理人报酬

基金管理人报酬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 19,066,583.61 元(2005 年度:13,709,807.79 元),其中已支付基金管理人人民币 16,868,308.89 元,尚余人民币 2,198,274.72 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付给基金托管人。本基金于本期应支付基金托管人托管费共计人民币 3,177,763.82 元(2005 年度:2,284,967.95 元),其中已支付基金托管人人民币 2,811,384.71 元,尚余人民币 366,379.11 元未支付。

(4)与关联方进行的银行间同业市场债券(含回购)交易

本基金本报告期及 2005 年度均未发生与关联方进行的银行间同业市场债券(含回购)交易。

(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交通银行保管,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:

单位:元

	2006-12-31	2005-12-31
银行存款余额	12,205,109.93	19,650,260.50
	2006年度	2005年度
银行存款产生的利息收入	365,815.25	397,603.97

(6)关联方投资本基金的情况

A.基金管理人所持有的本基金份额

	2006年度	2005年度
年初持有基金份额	27,370,027	20,000,000
加:本年买入	2,250,000	7,370,027
减:本年卖出	-	-
年末持有基金份额	29,620,027	27,370,027
基金管理人持有份额占年末基金总份额的比例	3.70%	3.42%

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.基金管理人主要股东及其控制的机构所持有的本基金份额

	2006-12-31		2005-12-31	
	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
广发证券股份有限公司	2,000,000	0.25%	5,739,703	0.72%

附注 4.报告期末流通转让受到限制的基金资产

(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
000895	S双汇	3,250,000	43,711,900.56	31.02	100,815,000.00	2006-6-1	-	-
合 计	-	3,250,000	43,711,900.56	-	100,815,000.00	-	-	-

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)其他流通转让受限制的基金资产:

股票代码	股票名称	数量(股)	年末成本总额	年末估值总额	估值方法	流通受限原因	受限期限
002078	太阳纸业	252,465	4,216,165.50	4,817,032.20	按市价估值	网下公开发行未流通	2007-2-16
002084	海鸥卫浴	71,104	570,965.12	1,594,151.68	按市价估值	网下公开发行未流通	2007-2-24
002085	万丰奥威	94,666	535,809.56	691,061.80	按市价估值	网下公开发行未流通	2007-2-28
002086	东方海洋	19,316	144,676.84	225,224.56	按市价估值	网下公开发行未流通	2007-2-28
601333	广深铁路	1,831,700	6,887,192.00	13,133,289.00	按市价估值	网下公开发行未流通	2007-3-22
601398	工商银行	5,048,200	15,750,384.00	30,440,646.00	按市价估值	网下公开发行未流通	2007-1-29
601628	中国人寿	280,000	5,286,400.00	5,286,400.00	按成本估值	网上公开发行未上市	2007-1-9
合 计	-	7,597,451	33,391,593.02	56,187,805.24	-	-	-

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	1,469,792,603.65	77.51%
债券	379,477,208.59	20.01%
权证	25,108,899.65	1.32%
银行存款和清算备付金合计	14,889,658.95	0.78%
应收证券清算款	2,416,088.83	0.13%
其他资产	4,666,253.94	0.25%
总计	1,896,350,713.61	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	225,224.56	0.01%
B 采掘业	9,130,000.00	0.49%
C 制造业	1,141,893,534.57	60.75%
C0 食品、饮料	291,346,400.00	15.50%
C1 纺织、服装、皮毛	30,138,620.79	1.60%
C2 木材、家具	46,034,800.00	2.45%
C3 造纸、印刷	4,817,032.20	0.26%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	41,811,420.04	2.22%
C5 电子	0.00	0.00%
C6 金属、非金属	332,471,013.86	17.69%
C7 机械、设备、仪表	377,683,025.92	20.09%
C8 医药、生物制品	17,591,221.76	0.94%
C99 其他制造业	0.00	0.00%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	28,000,000.00	1.49%
E 建筑业	0.00	0.00%
F 交通运输、仓储业	93,046,646.90	4.95%
G 信息技术业	20,545,000.00	1.09%
H 批发和零售贸易	54,450,000.00	2.90%
I 金融、保险业	65,877,046.00	3.50%
J 房地产业	18,508,297.08	0.98%
K 社会服务业	22,330,000.00	1.19%
L 传播与文化产业	15,786,854.54	0.84%
M 综合类	0.00	0.00%
合计	1,469,792,603.65	78.19%

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	2,033,000	178,497,400.00	9.50%
2	600686	金龙汽车	8,736,915	145,382,265.60	7.73%
3	000951	中国重汽	5,418,256	134,156,018.56	7.14%
4	600019	宝钢股份	12,080,000	102,921,600.00	5.48%
5	000895	S双汇	3,250,000	100,815,000.00	5.36%
6	600005	武钢股份	10,000,000	63,700,000.00	3.39%
7	601398	工商银行	10,048,200	60,590,646.00	3.22%
8	600739	辽宁成大	3,000,000	54,450,000.00	2.90%
9	000629	新钢钒	11,000,000	46,750,000.00	2.49%
10	600337	美克股份	4,010,000	46,034,800.00	2.45%

4、本报告期内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%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	601398	工商银行	101,872,976.71	11.13%
2	600686	金龙汽车	99,419,982.01	10.86%
3	600019	宝钢股份	95,662,621.69	10.45%
4	000060	中金岭南	70,670,079.74	7.72%
5	600005	武钢股份	64,390,093.10	7.04%
6	000625	长安汽车	51,920,673.17	5.67%
7	000717	韶钢松山	50,211,370.69	5.49%
8	000002	万科A	45,171,891.93	4.94%
9	000951	中国重汽	44,780,988.10	4.89%
10	600028	中国石化	43,000,338.82	4.70%
11	600030	中信证券	42,005,822.60	4.59%
12	000629	新钢钒	39,702,013.80	4.34%
13	600296	S兰铝	37,936,433.00	4.15%
14	600104	上海汽车	36,274,994.36	3.96%
15	600315	上海家化	35,633,410.97	3.89%
16	000539	粤电力A	33,004,895.87	3.61%
17	000858	五粮液	31,052,402.52	3.39%
18	600026	中海发展	28,528,586.95	3.12%
19	000039	中集集团	27,657,250.61	3.02%
20	000970	中科三环	27,555,149.06	3.01%
21	600428	中远航运	27,043,604.88	2.96%
22	000807	云铝股份	25,815,405.72	2.82%
23	000927	一汽夏利	25,445,472.22	2.78%
24	600900	长江电力	25,311,329.06	2.77%
25	601111	中国国航	24,614,158.16	2.69%
26	600337	美克股份	23,621,853.82	2.58%
27	000581	威孚高科	23,422,439.95	2.56%
28	000729	燕京啤酒	23,188,192.00	2.53%
29	600717	天津港	23,109,913.06	2.53%
30	000917	电广传媒	22,971,727.15	2.51%
31	600808	马钢股份	22,426,452.14	2.45%
32	600309	烟台万华	21,719,518.87	2.37%
33	000839	中信国安	21,302,193.74	2.33%
34	600739	辽宁成大	20,704,704.90	2.26%
35	000157	中联重科	20,421,921.13	2.23%
36	600269	赣粤高速	19,841,208.16	2.17%
37	000088	盐田港	19,657,704.78	2.15%
38	600177	雅戈尔	19,518,417.19	2.13%
39	600456	宝钛股份	19,364,728.84	2.12%
40	600289	亿阳信通	19,292,590.17	2.11%
41	000825	太钢不锈	18,822,192.11	2.06%
42	002029	七匹狼	18,415,802.87	2.01%

(2)本报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值 2%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	600519	贵州茅台	114,165,396.58	12.48%
2	600009	上海机场	83,540,276.20	9.13%
3	600030	中信证券	76,991,910.72	8.41%
4	600269	赣粤高速	69,735,605.67	7.62%
5	600036	招商银行	67,457,259.49	7.37%
6	600019	宝钢股份	66,479,381.93	7.26%
7	601398	工商银行	63,883,921.41	6.98%
8	000002	万科A	56,665,840.70	6.19%
9	000717	韶钢松山	48,641,768.91	5.32%
10	600296	S兰铝	47,962,589.02	5.24%
11	600795	国电电力	46,177,457.94	5.05%
12	000060	中金岭南	45,457,359.03	4.97%
13	600327	大厦股份	45,231,177.59	4.94%
14	000869	张裕A	42,535,110.75	4.65%
15	000069	华侨城A	40,269,531.52	4.40%
16	600104	上海汽车	36,702,581.36	4.01%
17	000157	中联重科	36,671,493.90	4.01%
18	000858	五粮液	36,614,762.45	4.00%
19	600028	中国石化	34,293,934.03	3.75%
20	000625	长安汽车	33,418,898.13	3.65%
21	600597	光明乳业	32,023,791.63	3.50%
22	600026	中海发展	31,784,634.90	3.47%
23	600005	武钢股份	29,975,867.50	3.28%
24	000680	山推股份	29,903,553.59	3.27%
25	000970	中科三环	29,898,760.75	3.27%
26	600418	江淮汽车	29,697,525.13	3.25%
27	600031	三一重工	28,652,705.57	3.13%
28	600879	火箭股份	27,475,117.85	3.00%
29	600420	现代制药	27,176,460.31	2.97%
30	000983	西山煤电	26,587,308.11	2.91%
31	600900	长江电力	26,428,529.14	2.89%
32	600600	青岛啤酒	25,950,738.38	2.84%
33	000729	燕京啤酒	25,745,341.24	2.81%
34	000825	太钢不锈	25,352,806.76	2.77%
35	600717	天津港	24,647,770.66	2.69%
36	000039	中集集团	24,474,792.36	2.67%
37	000629	新钢钒	23,881,702.79	2.61%
38	000839	中信国安	23,868,161.75	2.61%
39	600309	烟台万华	23,444,646.38	2.56%
40	000528	柳工	23,376,056.23	2.55%
41	000927	一汽夏利	22,170,333.46	2.42%
42	000917	电广传媒	20,894,811.31	2.28%
43	600636	三爱富	20,724,077.10	2.26%
44	000581	威孚高科	20,659,334.92	2.26%
45	600686	金龙汽车	19,772,873.24	2.16%
46	002024	苏宁电器	19,504,203.57	2.13%
47	600415	小商品城	19,121,955.68	2.09%

(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

项目	金额(元)
买入股票的成本总额	1,989,127,022.34
卖出股票的收入总额	2,208,404,673.78

5、本报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券类别	市值(元)	占基金资产净值比例
1	国　债	83,668,841.80	4.45%
2	金融债	294,679,666.79	15.68%
3	央行票据	0.00	0.00%
4	企业债	0.00	0.00%
5	可转债	1,128,700.00	0.06%
	合　计	379,477,208.59	20.19%

6、本报告期末按市值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券名称	市值(元)	占基金资产净值比例
1	06进出04	69,075,278.79	3.67%
2	05国开17	65,573,880.00	3.49%
3	05农发11