易方达策略成长证券投资基金 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:中国银行股份有限公司

重要提示

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2007年3月13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。

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。

一、基金简介

(一)基金基本资料	
1.基金名称:	易方达策略成长证券投资基金
2.基金简称:	易基策略
3.基金交易代码:	110002
4.基金运作方式:	契约型开放式
5.基金合同生效日:	2003年12月09日
6.报告期末基金份额总额:	1,567,236,048.90份
7.基金合同存续期:	不定期
8.基金份额上市的证券交易所:	无
9.上市日期:	无
(二)基金产品说明	
1.投资目标:	本基金通过投资兼具较高内在价值和良好成长性的股票,积极把握股票市场波动所带来的获利机会,努力为基金持有人追求较高的中长期资本增值。
2.投资策略:	本基金为主动型股票基金,投资的总体原则是在价值区域内把握波动,在波动中实现研究的"溢价"。基金采取相对稳定的资产配置策略,避免因过于主动的仓位调整带来额外的风险。同时,以雄厚的研究力量为依托,通过以价值成长比率(PEG)为核心的系统方法筛选出兼具较高内在价值及良好成长性的股票,并通过对相关行业和上市公司成长率变化的动态预测,积极把握行业/板块、个股的市场波动所带来的获利机会,为基金持有人追求较高的当期收益及长期资本增值。
3.业绩比较基准:	上证A指收益率×75%+上证国债指数收益率×25%
4.风险收益特征:	本基金为中等风险水平的证券投资基金,基金力争通过主动投资获取较高的资本增值和一定的当期收益。
(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.传真:	020-38799488
5.电子信箱:	csc@efunds.com.cn
(四)基金托管人	
1.名称:	中国银行股份有限公司
2.信息披露负责人:	宁敏
3.联系电话:	010-66594977
4.传真:	010-66594942
5.电子信箱:	tgxxpl@bank-of-china.com
(五)信息披露	
登载年度报告正文的管理人互联网网址:	http://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

重要提示:下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,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	1,310,851,121.60元	66,550,036.98元	136,047,734.32元
2	基金份额本期净收益	0.6723元	0.0376元	0.0717元
3	期末可供分配基金份额收益	0.5310元	-0.0014元	0.0106元
4	期末基金资产净值	3,868,755,969.43元	2,524,632,781.54元	1,429,307,028.86元
5	期末基金份额净值	2.469元	1.125元	1.046元
6	本期基金份额净值增长率	151.60%	13.41%	6.12%

(二)基金净值表现

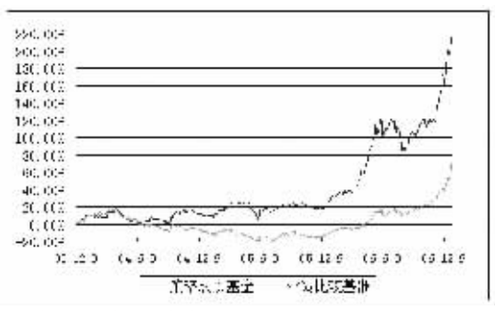
1、本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表:

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3个月	45.58%	1.62%	39.81%	1.03%	5.77%	0.59%
过去6个月	44.28%	1.53%	45.49%	0.99%	-1.21%	0.54%
过去1年	151.60%	1.56%	98.46%	1.01%	53.14%	0.55%
过去3年	180.71%	1.24%	62.57%	1.02%	118.14%	0.22%
基金合同生效至今	215.52%	1.23%	68.80%	1.02%	146.72%	0.21%

2、自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况,并与同期业绩比较基准的变动比较

易方达策略成长基金累计份额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

(2003年12月9日至2006年12月31日)



注:(1)基金合同中关于基金投资比例的约定:

1) 基金持有一家上市公司的股票,不超过基金资产净值的10%;

2) 基金与由基金管理人管理的其它基金持有任何一家公司发行的证券的总和,不超过该证券的10%;

3) 基金投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的80%;

4) 基金股票投资比例最高可达95%;

5) 法律法规规定的其他限制。

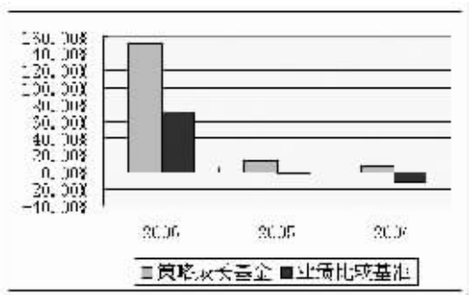
因基金规模或市场剧烈变化导致投资组合不符合上述规定时,基金管理人应在合理期限内进行调整,以符合上述规定。法律法规另有规定时,从其规定。

本报告期遵守法律、法规和基金合同的比例限制进行证券投资。

(2)策略成长基金于2005年12月30日公告减聘基金经理,自2006年1月1日起免去付浩先生策略成长证券投资基金基金经理职务,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、本基金过往三年每年的净值增长率,及与同期业绩比较基准的收益率比较

易方达策略成长基金净值增长率与业绩比较基准收益率对比图



(三)过往三年每年的基金收益分配情况

年度	每10份基金份额分红数(元)	备注
2004年	0.600	-
2005年	0.600	-
2006年	2.100	-
合计	3.300	-

三、管理人报告

(一)基金管理人及基金经理情况

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、 基金经理简介

肖坚,男,1969年11月出生,经济学硕士,曾任香港安财投资有限公司财务部经理,粤信(香港)投资有限公司业务部副经理、广东粤财信托投资公司基金部经理。2001年4月加入易方达基金管理有限公司,曾任投资管理部总经理助理、投资管理部常务副总经理、科翔基金基金经理,本报告期内任总经理助理、基金投资部总经理兼研究部总经理,易方达策略成长基金基金经理。

(二)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)报告期内基金基金投资策略和业绩表现的说明与解释

2006年,在世界经济增速回落、高油价、人民币升值、宏观调控等一系列因素的影响下,国民经济依然呈现快速稳定高效的运行格局,GDP大约增长10.7%, 比上年加快0.3个百分点。经济运行三驾马车中,全社会固定资产投资比上年增长24.0%,增幅回落2个百分点;进出口总额比上年增长23.8%,加快0.6个百分点。年末国家外汇储备10663亿美元,比上年末增加2473亿美元;全年社会消费品零售总额比上年增长13.7%,加快0.8个百分点。

2006年的证券市场是带给广大投资者惊喜的一年,中国证券市场发生了翻天覆地的变化。股改的成功堪称中国证券史上一次伟大的革命,它使困扰市场多年的痼疾得以根治。制度变革所释放的强大动能推动上证指数从年初的1163.88点成功站上2675.47点的历史新高,市场又恢复了融资功能。随着一只又一只的大盘股登陆A股市场,指数迭创新高,市场参与者获得了丰厚的投资回报,证券市场呈现久违的繁荣景象。2006年,证券投资基金为持有人创造了丰厚的回报并且成为市场中的阳光力量,基金公司管理资产规模已经超过8500亿元,使市场的格局发生了深刻的变化。

策略成长基金从成立伊始,就一直坚持价值投资理念和"策略应对市场"的组合管理思想,坚持"以确定的企业价值应对不确定的市场风险,用灵活的配置策略来追求持续的超额回报"的投资思路。

整个2006年,我们依然坚持以研究为先导,不断深入挖掘具有投资价值的个股,通过积极地操作来优化组合。在一季度,我们抓住了有色、金融、地产等行业机会;二季度把握了工程机械、装备制造等板块机会;四季度则顺应市场,积极参与了大盘蓝筹个股,全年取得了不错的业绩。

策略成长基金于2006年5月17日投资了非公开发行证券华联综超290万股, 占期末基金资产净值的1.73%,将于2007年5月17日上市流通。

2006年,策略成长基金份额净值为2.469元,净值增长率为151.6%,远远超越同期上证A指收益率。策略成长基金至成立以来的累计净值达到了2.799元。

(四)宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

就宏观经济而言,展望2007年,尽管仍有美国经济回落、地区局部冲突、油价波动等不确定性因素存在,但是我们对宏观经济依然持乐观态度。中国经济经历了多年高速增长之后,经济体自身的弹性及抗冲击能力已大大提高,政府及央行对经济运行的判断和调控能力也将有效防范宏观经济出现过"冷"或过"热"的局面。政府在保持国民经济高速稳定增长的同时,将更加重视增长的质量,改变以前主要依靠固定资产投资和粗放式出口拉动经济增长的模式,通过鼓励发展自主创新能力、提高能源使用效率、促进产业升级及企业竞争力的提升等手段来进一步改变经济增长方式。另外,创建和谐社会,促进居民消费水平,提高生活质量等政策导向也将在各方面影响经济的发展。但是,在经济良性运转的背后,我们也要看到流动性过剩所带来的隐忧,资金的过分充裕将导致经济生活中各种资产价格的膨胀,甚至产生泡沫。

就证券市场而言,股改的胜利结束,标志着中国证券市场的新生。大盘蓝筹的陆续回归,代表着中国证券市场正在发生着质的改变。整个市场将真正成为资源优化配置、财富创造的场所。我们欣喜地看到,随着多层次市场的形成、各种金融衍生产品的推出、居民储蓄通过基金进入证券市场、阳光资金力量的壮大及市场地位的确立等等,市场将更加有序、活跃,中国将迎来投资的黄金年代。

2007年,我们认为市场仍将处于牛市之中。但是,在经历了06年的大幅上涨之后,不少行业个股的估值已不再便宜,市场将出现结构性分化,板块中个股也将出现分化,因此,对个股的发掘将尤为重要。预计07年市场的震荡将加剧,行情的演变将更加复杂。2007年,我们将更加关注企业整体上市、企业并购、人民币升值、资产重估、金融创新、股权激励等事件带来的投资机会,以及金融、商业、钢铁、IT、医药等行业和板块的投资机会。对于我们来说,最重要的仍是去不断挖掘能带来较大超额回报的行业优势企业。我们相信,波动产生机会,研究创造价值,策略实现收益。我们将进一步提高组合的配置效率,加强对市场、行业、个股的前瞻性研究,用实事求是、与时俱进的态度应对市场的变化,不断学习提升投资管理水平,希望2007年仍能给我们的持有人交上满意的答卷。

四、托管人报告

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对易方达策略成长证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管合同的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管合同的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核, 未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本年度报告中的财务指标、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真实、准确和完整。

五、审计报告

安永华明会计师事务所审计了策略成长证券投资基金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

易方达策略成长证券投资基金

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	243,567,518.15	279,318,189.94
清算备付金	3,399,895.59	866,461.88
交易保证金	1,888,549.10	1,122,896.97
应收证券清算款	5,086,830.23	1,811,926.74
应收股利	-	-
应收利息	105,200.86	1,653,223.12
应收申购款	71,897,659.25	8,269,386.18
其他应收款	-	-
股票投资市值	3,536,578,894.20	2,123,946,767.75
其中:股票投资成本	2,023,178,113.52	1,863,572,699.98
债券投资市值	13,602,303.00	160,297,002.50
其中:债券投资成本	7,605,000.00	156,930,562.33
权证投资	71,006,363.94	-
其中:权证投资成本	648,305.83	-
买入返售证券	-	-
待摊费用	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,947,133,214.32	2,577,285,855.08
负债		
应付证券清算款	18,500,169.95	2,819,876.85
应付赎回款	50,039,825.08	44,357,303.62
应付赎回费	799,053.36	65,159.02
应付管理人报酬	4,080,849.74	3,008,201.20
应付托管费	680,141.62	501,366.84
应付佣金	2,981,685.34	1,205,646.21
应付利息	-	-
应付收益	-	-
未交税金	-	-
其他应付款	1,090,519.80	590,519.80
卖出回购证券款	-	-
短期借款	-	-
预提费用	205,000.00	105,000.00
其他负债	-	-
负债合计	78,377,244.89	52,653,073.54
持有人权益		
实收基金	1,567,236,048.90	2,244,452,091.20
未实现利得	1,469,387,480.67	283,408,152.65
未分配收益	832,132,439.86	-3,227,462.31
持有人权益合计	3,868,755,969.43	2,524,632,781.54
负债及持有人权益总计	3,947,133,214.32	2,577,285,855.08
基金份额净值	2.469	1.125

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

易方达策略成长证券投资基金

经营业绩表

2006年度

单位:人民币元

	2006年度	2005年度
收入	1,366,219,778.71	100,462,682.52
股票差价收入	1,256,155,531.25	64,726,893.63
债券差价收入	598,322.47	1,961,580.07
权证差价收入	71,238,157.35	3,742,396.18
债券利息收入	177,849.24	3,902,569.07
存款利息收入	1,896,300.96	2,824,326.93
股利收入	32,376,892.97	22,663,069.40
买入返售证券收入	-	-
其他收入	3,776,724.47	641,857.24
费用	55,368,657.11	33,912,645.54
基金管理人报酬	47,094,441.97	28,674,769.19
基金托管费	7,849,073.62	4,779,128.17
卖出回购证券支出	-	-
其他费用	425,141.52	458,748.18
其中:信息披露费	300,000.00	332,100.15
审计费用	105,000.00	105,000.00
基金净收益	1,310,851,121.60	66,550,036.98
加:未实现利得	1,326,015,633.85	148,691,583.11
基金经营业绩	2,636,866,755.45	215,241,620.09

所附附注为本会计报表的组成部分

易方达策略成长证券投资基金

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	1,310,851,121.60	66,550,036.98
加:期初基金净收益	-3,227,462.31	14,532,299.50
加:本期损益平准金	-82,051,597.83	14,537,736.74
可供分配基金净收益	1,225,572,061.46	95,620,073.22
减:本期已分配基金净收益	393,439,621.60	98,847,535.53
期末基金净收益	832,132,439.86	-3,227,462.31

所附附注为本会计报表的组成部分

3、基金净值变动表

易方达策略成长证券投资基金

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	2,524,632,781.54	1,429,307,028.86
二、本期经营活动:		
基金净收益	1,310,851,121.60	66,550,036.98
未实现利得	1,326,015,633.85	148,691,583.11
经营活动产生的基金净值变动数	2,636,866,755.45	215,241,620.09
三、本期基金份额交易:		
基金申购款	6,400,306,842.32	2,845,672,360.57
基金赎回款	-7,299,610,788.28	-1,866,740,692.45
基金份额交易产生的基金净值变动数	-899,303,945.96	978,931,668.12
四、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	-393,439,621.60	-98,847,535.53
五、期末基金净值	3,868,755,969.43	2,524,632,781.54

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.主要会计政策和会计估计及其变更与上年度会计报表相一致

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
中国银行股份有限公司(简称"中国银行")	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

2006年度及2005年度均无通过主要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47,094,441.97元(2005年:人民币28,674,769.19元),其中已支付基金管理人人民币43,013,592.23元,尚余人民币4,080,849.74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7,849,073.62元(2005年:人民币4,779,128.17元),其中已支付基金托管人人民币7,168,932.00元,尚余人民币680,141.62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

关联方名称	中国银行	
	2006年度	2005年度
买入债券成交金额	-	33,232,767.12
卖出债券成交金额	-	-
买入返售证券成交金额	-	-
买入返售证券利息收入	-	-
卖出回购证券成交金额	-	-
卖出回购证券利息支出	-	-

(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	243,567,518.15	279,318,189.94
	2006年度	2005年度
银行存款产生的利息收入	1,819,399.11	2,774,870.21

(6)关联方投资本基金的情况

A 基金管理人持有基金份额情况

2006年度及2005年度基金管理人未持有本基金份额。

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年末及2005年末基金管理人主要股东及其控制的机构均未持有本基金份额。

附注4.流通转让受到限制的基金资产

股票代码	股票名称	数量(股)	年末成本总额(元)	年末估值总额(元)	占基金净值比例	受限期限(上市流通日)	流通受限原因	估值方法
002024	苏宁电器	2,000,000	48,000,000.00	90,800,000.00	2.26%	2007-6-25(预计)	非公开发行未流通	按市价估值
600361	华联综超	2,900,000	37,468,000.00	66,961,000.00	1.73%	2007-5-17	非公开发行未流通	按市价估值
	合计	4,900,000	85,468,000.00	157,761,000.00	4.08%			

以上暂时停牌的股票,其年末估值单价是根据最近一个交易日的收盘价确定。

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	3,536,578,894.20	89.60%
债券	13,602,303.00	0.34%
权证	71,006,363.94	1.80%
银行存款和清算备付金合计	246,967,413.74	6.26%
应收证券清算款	5,086,830.23	0.13%
资产支持证券	-	-
其他资产	73,891,409.21	1.87%
总计	3,947,133,214.32	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	13,437,319.52	0.26%
B 采掘业	117,146,745.97	3.03%
C 制造业	1,549,281,971.77	40.03%
C0 食品,饮料	357,426,014.37	9.22%
C1 纺织,服装,皮毛	42,053,090.27	1.09%
C2 木材,家具	3,263,619.20	0.08%
C3 造纸,印刷	1,118,000.00	0.03%
C4 石油,化学,塑胶,塑料	131,033,054.20	3.39%
C5 电子	239,829,596.82	6.20%
C6 金属,非金属	429,291,837.70	11.09%
C7 机械,设备,仪表	273,413,061.11	7.07%
C8 医药,生物制品	61,781,674.70	1.60%
C99 其他制造业	10,072,023.40	0.26%
D 电力,煤气及水的生产和供应业	4,885,000.00	0.13%
E 建筑业	0.00	0.00%
F 交通运输,仓储业	0.00	0.00%
G 信息技术业	193,505,408.42	5.00%
H 批发和零售贸易	627,780,132.98	16.23%
I 金融,保险业	329,664,328.96	8.52%
J 房地产业	222,074,155.05	5.74%
K 社会服务业	199,892,459.81	5.17%
L 传播与文化产业	198,822,871.72	5.14%
M 综合类	80,088,500.00	2.07%
合计	3,536,578,894.20	91.41%

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	002024	苏宁电器	7,998,676	363,139,890.40	9.39%
2	600519	贵州茅台	3,306,477	290,407,874.91	7.51%
3	600005	武钢股份	44,279,140	281,615,330.40	7.28%
4	600037	歌华有线	7,997,702	198,822,871.72	5.14%
5	600089	特变电工	12,300,000	183,885,000.00	4.75%
6	000069	华侨城A	8,200,000	180,482,000.00	4.67%
7	600030	中信证券	6,588,912	180,404,410.56	4.66%
8	002008	大族激光	8,620,167	178,265,053.56	4.61%
9	600036	招商银行	8,500,000	139,060,000.00	3.59%
10	000839	中信国安	5,915,882	134,941,268.42	3.49%

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	600030	中信证券	360,847,674.08	14.29%
2	600036	招商银行	316,302,058.28	12.53%
3	600331	宏达股份	233,903,597.07	9.26%
4	000002	万科A	222,760,642.87	8.82%
5	600005	武钢股份	173,463,807.51	6.87%
6	600028	中国石化	168,385,671.98	6.67%
7	000839	中信国安	161,598,171.11	6.40%
8	600089	特变电工	139,176,581.35	5.51%
9	000983	西山煤电	122,822,857.09	4.86%
10	000039	中集集团	121,856,356.47	4.83%
11	600900	长江电力	109,374,617.16	4.33%
12	002008	大族激光	106,981,444.96	4.24%
13	000970	中科三环	104,585,438.67	4.14%
14	000157	中联重科	100,095,603.06	3.96%
15	600309	烟台万华	91,606,389.08	3.63%
16	600019	宝钢股份	90,307,783.87	3.58%
17	000917	电广传媒	90,208,919.11	3.57%
18	600050	中国联通	89,571,602.76	3.55%
19	600205	S山东铝	87,229,394.25	3.46%
20	002024	苏宁电器	85,223,625.33	3.38%
21	000858	五粮液	83,964,187.80	3.33%
22	600549	厦门钨业	74,333,717.57	2.94%
23	000063	中兴通讯	70,806,147.62	2.80%
24	000061	农产品	69,823,652.00	2.77%
25	000069	华侨城A	68,876,428.19	2.73%
26	000060	中金岭南	68,490,326.81	2.71%
27	600315	上海家化	65,678,118.97	2.60%
28	600037	歌华有线	65,044,642.95	2.58%
29	600325	华发股份	64,092,810.64	2.54%
30	600289	亿阳信通	63,620,256.72	2.52%
31	600009	上海机场	63,196,583.92	2.50%
32	600361	华联综超	62,916,378.75	2.49%
33	000089	深圳机场	56,732,098.94	2.25%
34	000623	吉林敖东	55,752,468.57	2.21%
35	600296	S兰铝	54,971,794.84	2.18%
36	600475	华光股份	54,800,450.04	2.17%

(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	600036	招商银行	423,239,570.05	16.76%
2	600030	中信证券	276,709,188.91	10.96%
3	600331	宏达股份	268,453,100.78	10.63%
4	000002	万科A	252,186,864.90	9.99%
5	600009	上海机场	250,113,357.73	9.91%
6	002024	苏宁电器	239,382,569.53	9.48%
7	000983	西山煤电	236,073,510.87	9.35%
8	600900	长江电力	217,091,354.22	8.60%
9	000069	华侨城A	206,276,765.14	8.17%
10	600694	大商股份	196,969,221.75	7.80%
11	600879	火箭股份	172,571,975.89	6.84%
12	000063	中兴通讯	166,255,134.66	6.59%
13	600519	贵州茅台	166,147,627.19	6.58%
14	000157	中联重科	148,422,775.10	5.88%
15	600549	厦门钨业	142,143,615.62	5.63%
16	000970	中科三环	141,566,938.72	5.61%
17	000039	中集集团	138,601,423.30	5.49%
18	600361	华联综超	106,787,389.44	4.23%
19	000917	电广传媒	106,451,474.01	4.22%
20	600016	民生银行	105,119,368.81	4.16%
21	000402	金融街	100,279,272.86	3.97%
22	600205	S山东铝	90,433,835.60	3.58%
23	600050	中国联通	87,707,450.90	3.47%
24	600309	烟台万华	80,627,202.89	3.19%
25	600269	赣粤高速	76,954,066.97	3.05%
26	600460	士兰微	75,354,886.09	2.98%
27	600028	中国石化	75,136,498.82	2.98%
28	600125	铁龙物流	72,130,876.90	2.86%
29	000061	农产品	67,677,443.30	2.68%
30	000528	柳工	65,683,960.20	2.60%
31	600089	特变电工	62,963,292.08	2.49%
32	000897	新大陆	61,679,456.23	2.44%
33	000858	五粮液	61,465,017.21	2.43%
34	000001	S深发展A	59,193,235.69	2.34%
35	600761	安徽合力	57,246,071.33	2.27%
36	600406	国电南瑞	57,206,277.71	2.27%
37	000089	深圳机场	56,989,072.88	2.26%
38	600475	华光股份	56,598,129.48	2.24%
39	600031	三一重工	55,649,187.56	2.20%
40	000759	武汉中百	55,149,894.25	2.18%
41	000060	中金岭南	54,290,239.87	2.15%
42	600420	现代制药	53,310,929.75	2.11%
43	000839	中信国安	52,895,580.31	2.10%

(3)本报告期买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

买入股票的成本总额	6,069,239,082.41
卖出股票的收入总额	7,161,361,157.64

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	0.00	0.00%
2	金融债	0.00	0.00%
3	央行票据	0.00	0.00%
4	企业债	0.00	0.00%
5	可转债	13,602,303.00	0.35%
	合　计	13,602,303.00	0.35%

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	债券代码	债券名称	市值(元)	占基金资产净值比例
1	110325	华发转债	13,602,303.00	0.35%

本报告期末本基金仅持有以上一只债券。

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, 应阅读刊登于基金管理人网站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	1,888,549.10
应收股利	-
应收利息	105,200.86
应收申购款	71,897,659.25
待摊费用	-
其他应收款	-
合计	73,891,409.21

(5)本报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

(6)本报告期内投资资产支持证券的情况

本报告期内本基金未投资资产支持证券。

(7)本报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有权证明细

| 序号 | 权证代码 | 权证名称 | 数量(份) | 市值 | 市值占基金资产净值比例 |
|---|---|---|---|---