易方达50指数证券投资基金 2007年半年度报告摘要

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

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。本半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8月10日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告期间:2007年1月1日至2007年6月30日。本报告财务数据未经审计。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读登载于本基金管理人网站www.efunds.com.cn的半年度报告正文。

一、基金简介

(一)基金基本资料	
1、基金名称:	易方达50指数证券投资基金
2、基金简称:	易基50
3、基金交易代码:	110003
4、基金运作方式:	契约型开放式
5、基金合同生效日:	2004年3月22日
6、报告期末基金份额总额:	2,837,342,575.00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:	在严格控制与目标指数偏离风险的前提下,力争获得超越指数的投资收益,追求长期资本增值。
2、投资策略:	本基金为指数增强型基金,股票投资部分以上证50指数作为标的指数,资产配置上追求充分投资,不根据对市场时机的判断主动调整股票仓位,通过运用深入的基本面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。
3、业绩比较基准:	上证50指数
4、风险收益特征:	本基金为中等风险的证券投资基金,基金控制与基准的偏离风险,同时力争获得超越基准的收益。
(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、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	
信息披露报纸名称:	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载半年度报告正文的管理人互联网网址:	www.efunds.com.cn
基金半年度报告置备地点	广州市体育西路189号城建大厦28楼

二、主要财务指标和基金净值表现

(单位:人民币元)

重要提示:本报告所列示的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

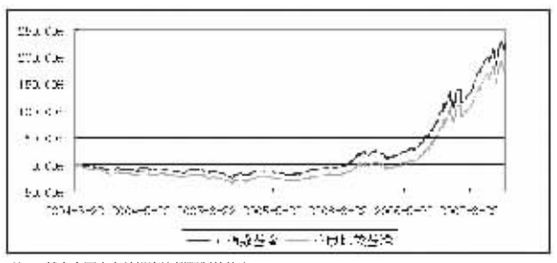
财务指标	2007年1月1日至2007年6月30日
1.基金本期净收益	1,343,483,248.19
2.基金份额本期净收益	0.9259
3.期末可供分配基金份额收益	0.1615
4.期末基金资产净值	3,418,037,036.47
5.期末基金份额净值	1.2047
6.本期基金份额净值增长率	57.73%

(二)基金净值表现

1、基金历史各时间段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1个月	2.33%	2.37%	-0.83%	2.60%	3.16%	-0.23%
过去3个月	30.35%	2.09%	27.43%	2.26%	2.92%	-0.17%
过去6个月	57.73%	2.29%	61.52%	2.43%	-3.79%	-0.14%
过去1年	149.47%	1.88%	164.43%	1.99%	-14.96%	-0.11%
过去3年	246.90%	1.44%	228.07%	1.54%	18.83%	-0.10%
自基金合同生效起至今	212.25%	1.40%	172.07%	1.50%	40.18%	-0.10%

2、基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:1、基金合同中有关投资比例限制的约定:

Ⅰ、由于《证券投资基金管理暂行办法》已经废止,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》和本基金合同、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定:

(1) 基金的业绩比较基准为:上证50指数。

(2) 基金的资产配置比例限制为:在目前的法律法规限制下,本基金应当保持不低于基金资产净值5%的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低于90%。

Ⅱ、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。法律法规另有规定时,从其规定。

2、本基金在本报告期间内遵守上述投资比例的规定进行证券投资。

3、本基金于2007年2月10日聘任林飞先生担任基金经理职务,但基金原有的投资目标、投资范围、投资策略和选股标准等没有发生变化。

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。截至2007年6月30日,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、广东省广晟资产经营有限公司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%,广东省广晟资产经营有限公司占出资额的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2007年6月30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、易方达深证100交易型开放式指数基金、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、易方达价值成长混合型基金十只开放式基金。

2、基金经理小组介绍

本报告期易方达50指数证券投资基金基金经理小组由马骏先生、梁天喜先生、林飞先生三位组成。

马骏先生,男,1966年3月生,理学学士,历任深圳众大投资有限公司投资主管,广发证券有限责任公司研究发展中心研究员。2001年4月至今,在易方达基金管理有限公司工作,曾任科讯基金基金经理,本报告期内任易方达50指数证券投资基金基金经理、易方达深证100交易型开放式指数基金基金经理。

梁天喜先生,男,1964年出生,工学硕士,曾在大鹏证券综合研究所从事行业和上市公司研究,先后任研究所市场部经理、投资研究部(行业与公司研究)经理、研究所副所长。2003年2月进入易方达基金管理有限公司,曾任投资管理部副总经理、科汇基金基金经理、易方达积极成长基金基金经理,本报告期内任易方达50指数基金基金经理。

林飞先生,男,1975年3月生,经济学博士。曾任融通基金管理有限公司基金经理助理。2006年3月进入易方达基金管理有限公司工作,曾任易方达深证100交易型开放式指数基金基金经理助理,本报告期内任易方达深证100交易型开放式指数基金基金经理,自2007年2月10日起兼任易方达50指数证券投资基金经理。

(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,无损害基金份额持有人利益的行为。本报告期内,基金经理根据上证50指数成分股调整方案,按预期权重买入托管人交通银行的股票,本基金管理人在合规监控中及时发现和纠正,并向监管部门进行了报告。

(三)基金经理报告

1、报告期内的业绩表现和投资策略

(1)行情回顾及运作分析

2007年上半年,宏观经济持续景气,人民币继续升值,流动性依然较为充裕,股权分置改革成效进一步显现,上市公司整体盈利增速保持在较高水平,为证券市场的持续稳定发展提供较为有利的外部环境。作为分享经济长期增长的投资工具之一,A股市场自去年以来积累了较大财富效应,市场相对吸引力进一步提高,这一效应在今年得到进一步延续和增强,增量资金带动指数进一步创出新高,上证指数半年涨幅42.8%。但天内份随着紧缩政策的逐步落实及市场扩容预期的增强,市场在高位出现较大幅度的振荡,同时伴随着和年初以来较为不同的结构分化,绩优蓝筹类个股在波动中逐渐启稳,而年初以来涨幅较高的题材低价类个股则出现较大幅度的调整。由于权重占比相对较大,金融股整体对50指数上半年走势产生较为明显的影响。50指数基金上半年在成份股投资权重匹配基础上,以同行业内优势企业为主要方向,对组合结构做了一定的优化,但未获得明显的增强效果,主要原因在于两个方面:首先,指数波动较大引起申购赎回规模增加,对基金仓位控制产生一定影响;其次,影响上半年市场结构分化的因素及其持续作用时间在一定程度上超过我们预期,部分成份股低于基准配置带来一定负贡献。由于累积了较多已实现收益,50指数基金在二季度进行了红利分配。

(2)本基金业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.2047元,本报告期份额净值增长率为57.73%,同期基准指数上证50指数增长率为61.52%,基金年化跟踪误差4.57%,受今年成分股更换增多和申购赎回影响,跟踪误差超出了4%的控制目标范围。

2、市场展望和投资策略

展望下半年证券市场,经济短期趋热背景下进一步紧缩政策的预期以及市场进一步扩容的预期,使得A股市场面临的短期不确定性在加大,短期资金流动引起更大幅波动的可能性在增加,但相信在工业化进程、全球产业转移、消费升级的推动下,中国宏观经济景气将在较长的周期内延续,支撑市场长期趋势的重要基础并未发生明显变化。在结构上,预期上市公司盈利增长的持续性和可提供的估值安全空间,将继续成为主导市场下一阶段结构分化的重要主线。作为增强型指数基金,50指数基金将继续在严格控制基金相对基准指数的跟踪误差等偏离风险的前提下,根据对市场结构性变化的判断,对投资组合做适度的优化和增强,力争获得超越指数的投资收益,追求长期资本增值。期望本基金为投资者进一步分享中国证券市场大盘蓝筹股未来长期稳定持续的增长提供更好的投资机会。

四、托管人报告

2007年上半年,托管人在易方达50指数证券投资基金的托管过程中,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、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

2007年上半年,易方达基金管理有限公司在易方达50指数证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。托管人根据证监会的有关规定,对基金购买交通银行股票的行为进行了提示,基金管理人根据规定进行了调整。

2007年上半年,由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易方达50指数证券投资基金的半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8月10日

五、财务会计报告

(一)基金会计报表

1、资产负债表

易方达50指数证券投资基金
资产负债表
二零零七年六月三十日

单位:人民币元

	2007-6-30	2006-12-31
资产:		
银行存款	196,780,087.63	112,838,205.05
清算备付金	15,848,183.98	1,977,740.62
交易保证金	452,873.94	359,609.61
应收证券清算款	7,854,958.66	0.00
应收股利	2,705,501.44	0.00
应收利息	61,703.09	25,547.48
应收申购款	77,534,254.06	65,615,027.13
其他应收款	0.00	0.00
股票投资市值	3,204,316,816.21	1,920,349,887.70
其中:股票投资成本	2,619,279,109.06	1,037,831,495.11
债券投资市值	0.00	903,952.00
其中:债券投资成本	0.00	875,527.24
权证投资市值	8,150,181.69	481,320.00
其中:权证投资成本	3,114,222.56	244,472.76
买入返售证券	0.00	0.00
待摊费用	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00
资产总计:	3,513,704,560.70	2,102,551,289.59
负债及持有人权益		
负债:		
应付证券清算款	33,947,826.01	33,117,614.72
应付赎回款	52,157,495.54	11,490,938.00
应付赎回费	1,663,113.66	259,510.30
应付管理人报酬	3,084,034.19	1,806,497.56
应付托管费	514,005.68	301,082.92
应付佣金	3,850,215.17	871,645.06
应付利息	0.00	0.00
应付收益	0.00	0.00
未交税金	0.00	0.00
其他应付款	250,000.00	250,000.00
卖出回购证券款	0.00	0.00
短期借款	0.00	0.00
预提费用	200,833.98	205,000.00
其他负债	0.00	0.00
负债总计	95,667,524.23	48,302,288.56
持有人权益:		
实收基金	2,837,342,575.00	1,147,923,485.96
未实现利得	122,399,541.21	565,144,461.10
未分配收益	458,294,920.26	341,181,053.97
持有人权益合计	3,418,037,036.47	2,054,249,001.03
负债与持有人权益总计	3,513,704,560.70	2,102,551,289.59
基金单位净值	1.2047	1.7895

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50指数证券投资基金
经营业绩表
自二零零七年一月一日至二零零七年六月三十日止期间

单位:人民币元

	2007年1月1日-2007年6月30日	2006年1月1日-2006年6月30日
收入	1,360,904,935.25	746,835,607.13
股票差价收入	1,337,803,565.84	610,769,926.37
债券差价收入	462,772.85	0.00
权证差价收入	4,787,555.32	100,383,689.95
债券利息收入	10,730.72	0.00
存款利息收入	878,155.69	995,085.22
股利收入	14,465,809.59	31,997,895.53
买入返售证券收入	0.00	0.00
其他收入	2,496,345.24	2,689,010.06
费用	17,421,687.06	22,620,746.47
基金管理人报酬	14,741,005.04	19,175,179.16
基金托管费	2,456,834.13	3,195,863.24
卖出回购证券支出	0.00	0.00
利息支出	0.00	0.00
其他费用	223,847.89	249,704.07
信息披露费	148,765.71	168,603.31
审计费用	52,068.27	52,068.27
基金净收益	1,343,483,248.19	724,214,860.66
加:未实现利得	-292,709,998.31	373,547,175.04
基金经营业绩	1,050,773,249.88	1,097,762,035.70

所附附注为本会计报表的组成部分

易方达50指数证券投资基金
收益分配表
自二零零七年一月一日至二零零七年六月三十日止期间

单位:人民币元

	2007年1月1日-2007年6月30日	2006年1月1日-2006年6月30日
本期基金净收益	1,343,483,248.19	724,214,860.66
加:期初基金净收益	341,181,053.97	-572,199,088.42
加:本期损益平准金	-37,506,156.63	169,303,863.69
可供分配基金净收益	1,647,158,145.53	321,319,635.93
减:本期已分配基金净收益	1,188,863,225.27	83,766,525.26
期末基金净收益	458,294,920.26	237,553,110.67

所附附注为本会计报表的组成部分

3、净值变动表

易方达50指数证券投资基金
基金净值变动表
自二零零七年一月一日至二零零七年六月三十日止期间

单位:人民币元

	2007年1月1日-2007年6月30日	2006年1月1日-2006年6月30日
一、期初基金净值	2,054,249,001.03	4,651,552,479.76
二、本期经营活动:		
基金净收益	1,343,483,248.19	724,214,860.66
未实现利得	-292,709,998.31	373,547,175.04
经营活动产生的基金净值变动数	1,050,773,249.88	1,097,762,035.70
三、本期基金单位交易:		
基金申购款	6,494,094,486.15	1,053,282,432.90
基金赎回款	-4,992,216,475.32	-5,044,300,222.05
基金单位交易产生的基金净值变动数	1,501,878,010.83	-3,991,017,789.15
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	1,188,863,225.27	-83,766,525.26
五、期末基金净值	3,418,037,036.47	1,674,530,201.05

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.　本基金半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2007年半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")	基金管理人的股东
广东粤财信托投资有限公司	基金管理人的股东
广东美的电器股份有限公司	基金管理人的股东
广州市广永国有资产经营有限公司	基金管理人的股东
广东省广晟资产经营有限公司	基金管理人的股东
重庆国际信托投资有限公司	基金管理人的股东(自2007年4月3日起不再是本基金管理人的股东)

本报告期内经易方达基金管理有限公司(以下简称"本公司")2007年第一次临时股东会审议通过,并报经中国证监会证监基金字[2007]75号文批准,重庆国际信托投资有限公司将其持有的本公司股权(占本公司总股本16.67%)全部转让给广东省广晟资产经营有限公司。此次出资转让的工商变更登记手续已办理完毕。

本次股权转让后,广东粤财信托投资有限公司、广发证券股份有限公司、广东美的电器股份有限公司、广东省广晟资产经营有限公司、广州市广永国有资产经营有限公司对本公司的出资比例分别为25%、25%、25%、16.67%、8.33%

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	2007年1月1日至2007年6月30日		2006年1月1日至2006年6月30日	
(a) 股票买卖	本期成交金额	占本期交易金额比例	本期成交金额	占本期交易金额比例
广发证券	846,934,640.29	11.82%	1,341,985,398.14	20.32%
(b) 债券买卖	本期成交金额	占本期交易金额比例	本期成交金额	占本期交易 金额比例
广发证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%
(c)权证买卖	本期成交金额	占本期交易金额比例	本期成交金额	占本期交易金额比例
广发证券	3,864,087.00	10.80%	0.00	0.00%
(d) 债券回购	本期成交金额	占本期交易金额比例	本期成交金额	占本期交易金额比例
广发证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%
(e) 佣金	本期佣金金额	占本期佣金比例	本期佣金金额	占本期佣金比例
广发证券	679,228.55	11.59%	1,078,284.99	20.00%

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‰+国债现货成交金价金额*0.01‰+国债回购成交金额*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‰+国债现货成交金价金额*0.01‰+国债回购成交金额*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

基金管理费按前一日的基金资产净值的1.2%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.2%/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14,741,005.04元(2006年同期:19,175,179.16元),其中已支付基金管理人11,656,970.85人民币元,尚余人民币3,084,034.19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0.20%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.20%/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2,456,834.13元(2006年同期:3,195,863.24元),其中已支付基金托管人人民币1,942,828.45元,尚余人民币514,005.68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

本基金于2007年上半年以及2006年同期均无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

(5)由关联方保管的银行存款情况

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

	2007-6-30	2006-6-30
银行存款余额	196,780,087.63	90,720,077.03
	2007年1月1日至2007年6月30日	2006年1月1日至2006年6月30日
银行存款产生的利息收入	643,466.05	965,534.46

(6)本基金参与关联方主承销证券的情况

①参与关联方主承销的公开发行证券情况

本报告期及2006年同期本基金未参与关联方主承销的公开发行证券。

②参与关联方主承销的非公开发行证券情况

本报告期及2006年同期本基金未参与关联方主承销的非公开发行证券。

(7)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

本报告期及2006年同期基金管理人均未持有本基金份额。

B 基金管理人主要股东及其控制的机构持有基金份额情况

本报告期末及2006年6月30日基金管理人的主要股东及其控制的机构均未持有本基金份额。

附注4.报告期末流通转让受到限制的基金资产

无

六、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	3,204,316,816.21	91.20%
债券	0.00	0.00%
权证	8,150,181.69	0.23%
银行存款和清算备付金合计	212,628,271.61	6.05%
应收证券清算款	7,854,958.66	0.22%
其他资产	80,754,332.53	2.30%
总计	3,513,704,560.70	100.00%

2、本报告期末按行业分类的股票投资组合

(1)指数投资部分

行业类别	市值(元)	占基金资产净值比例
A 农、林、牧、渔业	0.00	0.00%
B 采掘业	157,480,754.86	4.61%
C 制造业	689,009,132.00	20.16%
C0 食品、饮料	139,267,729.64	4.07%
C1 纺织、服装、皮毛	56,546,037.12	1.65%
C2 木材、家具	0.00	0.00%
C3 造纸、印刷	0.00	0.00%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	100,623,010.43	2.94%
C5 电子	0.00	0.00%
C6 金属、非金属	256,851,326.42	7.51%
C7 机械、设备、仪表	135,721,028.39	3.97%
C8 医药、生物制品	0.00	0.00%
C99 其他制造业	0.00	0.00%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	291,490,579.85	8.53%
E 建筑业	0.00	0.00%
F 交通运输、仓储业	284,134,150.73	8.31%
G 信息技术业	40,517,000.00	1.19%
H 批发和零售贸易	0.00	0.00%
I 金融、保险业	1,471,596,548.92	43.05%
J 房地产业	18,394,965.00	0.54%
K 社会服务业	0.00	0.00%
L 传播与文化产业	31,412,779.86	0.92%
M 综合类	35,366,544.89	1.03%
合计	3,019,402,456.11	88.34%

(2)积极投资部分

行业类别	市值(元)	占基金资产净值比例
A 农、林、牧、渔业	0.00	0.00%
B 采掘业	64,868,254.20	1.90%
C 制造业	50,495,669.77	1.48%
C0 食品、饮料	0.00	0.00%
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	0.00	0.00%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	0.00	0.00%
C5 电子	0.00	0.00%
C6 金属、非金属	13,689,767.27	0.40%
C7 机械、设备、仪表	36,805,902.50	1.08%
C8 医药、生物制品	0.00	0.00%
C99 其他制造业	0.00	0.00%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	0.00	0.00%
E 建筑业	0.00	0.00%
F 交通运输、仓储业	51,033,136.13	1.49%
G 信息技术业	0.00	0.00%
H 批发和零售贸易	18,517,300.00	0.54%
I 金融、保险业	0.00	0.00%
J 房地产业	0.00	0.00%
K 社会服务业	0.00	0.00%
L 传播与文化产业	0.00	0.00%
M 综合类	0.00	0.00%
合计	184,914,360.10	5.41%

3、本报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票明细

(1)指数投资部分

序号	股票代码	股票名称	数量	市值(元)	占基金资产净值比例
1	600030	中信证券	4,913,150	260,249,555.50	7.61%
2	600000	浦发银行	7,059,950	258,323,570.50	7.56%
3	600036	招商银行	9,524,464	234,111,325.12	6.85%
4	600900	长江电力	13,340,710	201,711,535.20	5.90%
5	600016	民生银行	17,132,000	195,818,760.00	5.73%

(2)积极投资部分

序号	股票代码	股票名称	数量	市值(元)	占基金资产净值比例
1	000338	潍柴动力	468,865	36,805,902.50	1.08%
2	000983	西山煤电	1,275,000	35,993,250.00	1.05%
3	600188	兖州煤业	2,033,451	28,875,004.20	0.84%
4	601111	中国国航	2,499,933	24,474,344.07	0.72%
5	600153	建发股份	970,000	18,517,300.00	0.54%

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	本期累计买入金额(元)	占期初基金资产净值的比例
1	600030	中信证券	221,705,908.95	10.79%
2	600900	长江电力	198,134,737.75	9.65%
3	600016	民生银行	196,419,000.75	9.56%
4	601398	工商银行	191,166,752.70	9.31%
5	600036	招商银行	185,795,056.79	9.04%
6	600000	浦发银行	168,859,208.86	8.22%
7	601318	中国平安	165,953,673.19	8.08%
8	600009	上海机场	144,894,711.71	7.05%
9	600028	中国石化	125,263,240.59	6.10%
10	600019	宝钢股份	117,815,075.68	5.74%
11	601988	中国银行	105,517,980.50	5.14%
12	600320	振华港机	100,784,541.77	4.91%
13	600519	贵州茅台	92,638,570.19	4.51%
14	600050	中国联通	92,212,042.11	4.49%
15	601628	中国人寿	84,085,375.86	4.09%
16	600018	上港集团	73,763,198.78	3.59%
17	601166	兴业银行	68,665,526.24	3.34%
18	600005	武钢股份	65,135,740.47	3.17%
19	601006	大秦铁路	62,532,085.85	3.04%
20	600309	烟台万华	60,014,825.25	2.92%
21	600104	上海汽车	57,827,080.79	2.81%
22	600895	张江高科	50,421,901.43	2.45%
23	600832	东方明珠	48,397,550.94	2.36%
24	600001	邯郸钢铁	46,593,342.48	2.27%
25	600649	原水股份	45,958,723.95	2.24%
26	600795	国电电力	45,034,029.58	2.19%
27	600015	华夏银行	44,058,448.70	2.14%
28	600660	福耀玻璃	43,381,702.35	2.11%
29	600317	营口港	42,813,580.66	2.08%
30	600037	歌华有线	41,529,600.33	2.02%

(1)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	本期累计卖出金额(元)	占期初基金资产净值的比例
1	600016	民生银行	219,665,501.20	10.69%
2	600036	招商银行	213,434,405.71	10.39%
3	600030	中信证券	167,186,653.34	8.14%
4	601398	工商银行	159,875,672.20	7.78%
5	600050	中国联通	152,337,946.42	7.42%
6	600019	宝钢股份	141,229,723.16	6.88%
7	600005	武钢股份	124,766,571.33	6.07%
8	600320	振华港机	118,567,624.21	5.77%
9	600028	中国石化	118,285,143.23	5.76%
10	600900	长江电力	113,974,190.91	5.55%
11	601988	中国银行	105,152,652.65	5.12%
12	600009	上海机场	89,454,012.46	4.35%
13	600000	浦发银行	88,510,819.00	4.31%
14	600660	福耀玻璃	82,387,268.97	4.01%
15	600018	上港集团	77,704,035.52	3.78%
16	600519	贵州茅台	74,423,921.68	3.62%
17	600309	烟台万华	66,443,010.31	3.23%
18	000903	云内动力	63,562,706.29	3.09%
19	600104	上海汽车	62,011,058.24	3.02%
20	600895	张江高科	61,631,558.39	3.00%
21	600832	东方明珠	60,512,880.58	2.95%
22	000839	中信国安	59,708,042.87	2.91%
23	600795	国电电力	53,143,205.28	2.59%
24	600642	申能股份	45,169,790.81	2.20%
25	601006	大秦铁路	45,112,504.87	2.20%
26	601318	中国平安	44,710,222.45	2.18%
27	002024	苏宁电器	43,845,902.65	2.13%
28	600809	山西汾酒	43,614,479.06	2.12%
29	600177	雅戈尔	42,864,825.55	2.09%

(3)本报告期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	3,725,312,045.53
卖出股票的收入总额	3,484,624,974.52

5、本报告期末按券种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券。

6、本报告期末前五名债券投资明细

本报告期末本基金未持有债券。

7、投资组合报告附注注:

(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的半年度报告正文。

(2)本基金投资的前十名证券的发行主体本期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	452,873.94
应收股利	2,705,501.44
应收利息	61,703.09
应收申购款	77,534,254.06
配股权证	0.00
待摊费用	0.00
合计	80,754,332.53

(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)本报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有权证明细

权证代码	权证名称	数量(份)	市值(元)	占净值比例
580013	武钢CWB1	1,344,249	8,150