易方达积极成长证券投资基金 2007 年年度报告摘要

(上接 211 版)

（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	26,737,189,539.17
卖出股票的收入总额	26,256,031,687.64

5、本报告期末按券种分类的债券投资组合

本报告期末未持有债券。

6、本报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

本报告期末未持有债券。

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	5,891,036.73
应收股利	0.00
应收利息	838,204.25
应收申购款	24,484,248.98
待摊费用	0.00
其他应收款	0.00
合计	31,213,489.96

（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）	期末市值（元）	市值占基金资产净值比例
580013	武钢 CWB1	12,820,560	101,295,244.56	0.56%

（7）报告期内获得的权证明细

权证代码	权证名称	数量（份）	成本总额（元）	投资类别
580013	武钢 CWB1	13,704,160	31,748,436.67	被动持有
031003	深发 SFC1	774,337	0.00	被动持有
031004	深发 SFC2	387,168	0.00	被动持有
合计		14,865,665	31,748,436.67	

（8）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。

（9）报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

八、基金份额持有人户数、持有人结构

1、报告期末基金份额持有人户数

报告期末基金份额持有人户数：	422,348 户
报告期末平均每户持有的基金份额：	24,898.14 份

2、报告期末基金份额持有人结构

项目	数量（份）	占总份额的比例
基金份额总额：	10,515,678,386.67	100.00%
其中：机构投资者持有的基金份额	668,704,750.04	6.36%
个人投资者持有的基金份额	9,846,973,636.63	93.64%

3 期末本基金管理公司从业人员持有本开放式基金的情况

	期末持有本开放式基金份额的总量（份）	占本基金总份额的比例
本基金管理公司所有从业人员持有本基金合计	115,584.95	0.0011%

九、开放式基金份额变动

本基金份额变动情况如下：

（单位：份）

基金合同生效日的基金份额总额	1,158,459,840.28
本报告期期初基金份额总额	1,054,908,662.04
加：本报告期期间总申购份额	26,577,342,939.03
基金拆分增加份额	2,006,827,695.10
年度内申购份额	24,570,515,243.93
减：本报告期期间总赎回份额	17,116,573,214.40
本报告期期末基金份额总额	10,515,678,386.67

注：根据《易方达积极成长证券投资基金招募说明书》和《易方达积极成长证券投资基金基金份额分拆与修改基金合同的公告》的有关规定，基金管理人易方达基金管理有限公司确定 2007 年 2 月 7 日为本基金的基金份额拆分日。基金份额折算比例为 2.521248538。易方达基金管理有限公司已根据上述拆分比例，对各基金份额持有人持有的基金份额进行了拆分，并于 2007 年 2 月 8 日进行了变更登记。

十、重大事件揭示

1、本报告期内未召开基金份额持有人大会。

2、本报告期内，本金管理人未发生重大人事变动，本基金托管人的托管业务部门原总经理秦立儒先生已于 2007 年 11 月 27 日调任其他岗位，目前由董杰先生任托管部门总经理。

3、本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

4、本报告期内本基金的投资策略、本基金管理人的内部决策程序未有重大变化。

5、本报告期内基金收益分配情况；

	分红公告日	权益登记日	每 10 份基金份额收益分配金额(元)	收益分配金额(元)
第 1 次分红	2007-4-27	2007-5-8	0.500	773,059,865.49
第 2 次分红	2007-9-6	2007-9-10	0.500	628,837,063.97
第 3 次分红	2007-12-19	2007-12-21	0.500	525,798,464.90
累计收益分配金额			1.500	1,927,695,394.36

6、普华永道中天会计师事务所连续 3 年为本基金提供审计服务。本报告年度的审计费为 170,000.00 元。

7、本报告期内基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何处罚。

8、本基金租用专用交易席位的情况

本基金根据中国证券监督管理委员会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字[1998]29 号）的有关规定要求及本基金管理人的《基金专用交易席位租用制度》，决定租用东方证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、长城证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、西部证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、泰阳证券有限责任公司、中原证券股份有限公司和广发证券股份有限公司各一个交易席位。本报告期内中国国际金融有限公司、平安证券有限责任公司、华安证券有限责任公司、华西证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司和天源经纪有限公司各新增一个席位。

本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其席位作为本基金的专用交易席位。基金专用交易席位的选择标准如下：

a.经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

b.具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

c.具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

基金专用交易席位的选择程序如下：

a.本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构。

b.基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

本报告期本基金通过各机构的交易席位的成交及佣金情况见下表（单位：元）：

券商名称	股票成交金额	比例	债券成交金额	比例	债券回购成交金额	比例	权证成交金额	比例	佣金	比例
平安证券	8,774,337,197.71	16.68%	-	-	-	-	-	-	7,194,926.87	16.88%
中金公司	8,459,732,193.00	16.08%	-	-	-	-	-	-	6,619,792.18	15.53%
长城证券	6,287,326,560.88	11.95%	-	-	-	-	-	-	5,155,601.95	12.10%
中信证券	4,801,028,537.55	9.13%	113,626,839.30	92.49%	-	-	4,441,539.30	9.30%	3,936,823.50	9.24%
长江证券	3,987,437,263.66	7.58%	4,442,245.70	3.62%	-	-	-	-	3,269,676.21	7.67%
华西证券	3,948,354,378.26	7.50%	-	-	-	-	-	-	3,237,622.86	7.60%
银河证券	3,871,217,021.37	7.36%	-	-	-	-	43,312,343.60	90.70%	3,029,254.32	7.11%
广发证券	2,715,778,521.51	5.16%	-	-	-	-	-	-	2,226,920.19	5.22%
中信建投	2,351,617,846.06	4.47%	-	-	-	-	-	-	1,928,320.11	4.52%
中原证券	1,843,123,443.01	3.50%	-	-	-	-	-	-	1,511,354.87	3.55%
华泰证券	1,513,641,364.95	2.88%	-	-	-	-	-	-	1,241,182.99	2.91%
东方证券	1,445,498,867.12	2.75%	-	-	-	-	-	-	1,131,110.37	2.65%
华安证券	1,227,533,246.11	2.33%	-	-	-	-	-	-	1,006,572.36	2.36%
国泰君安	777,142,079.53	1.48%	-	-	-	-	-	-	637,250.36	1.50%
西部证券	603,476,883.17	1.15%	4,781,945.00	3.89%	-	-	-	-	494,847.87	1.16%
两地合计	52,607,245,403.89	100.00%	122,851,030.00	100.00%	-	-	47,753,882.90	100.00%	42,621,257.01	100.00%

9、本报告期基金披露过的其他重要事项：

公告事项	披露日期
关于进一步开通建行龙卡储蓄卡基金网上交易的公告	2007-1-31
关于易方达积极成长基金限量持续销售的公告	2007-2-2
易方达积极成长证券投资基金基金份额分拆与修改基金合同的公告	2007-2-2
增加万联证券 1 家代销机构	2007-2-3
增加华西证券 1 家代销机构	2007-2-3
增加中国建设银行 1 家代销机构	2007-2-3
关于参与易方达积极成长基金自分拆之日起限量持续销售活动首批销售机构的公告	2007-2-6
关于增加参与易方达积极成长基金自分拆之日起限量持续销售活动销售机构的公告	2007-2-7
关于易方达积极成长证券投资基金基金份额分拆比例公告	2007-2-8
关于提前结束限量持续销售活动暨暂停申购和转入业务的公告	2007-2-10
关于恢复易方达积极成长证券投资基金申购和转入业务的公告	2007-2-26
关于易方达积极成长证券投资基金暂停申购和转入业务的公告	2007-3-1
对市场上出现冒用我司名义进行非法证券活动的特别提示	2007-3-20
易方达基金管理有限公司关于旗下基金获配武钢分离型可转债的公告	2007-3-31
易方达基金管理有限公司关于公司股权转让的公告	2007-4-3
增加渤海证券和东海证券 2 家代销机构	2007-4-4
关于增加浦发银行为代销机构以及在浦发银行推出基金定期定额业务的公告	2007-4-13
关于在西部证券推出基金定期定额业务的公告	2007-4-13
易方达基金管理有限公司关于旗下基金获配浙江利欧股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	2007-4-18
易方达基金管理有限公司关于旗下基金获配河南恒星科技股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	2007-4-18
关于恢复易方达积极成长证券投资基金申购和转入业务的公告	2007-4-18
关于五一期间易方达基金管理公司网站和客户服务热线暂停使用的公告	2007-4-25
易方达积极成长证券投资基金分红公告	2007-4-27
易方达基金管理有限公司关于修改旗下基金基金合同的公告	2007-5-15
关于调整旗下基金申购费用及申购份额计算方法的公告	2007-5-15
易方达基金管理有限公司关于运用固有资金进行基金投资的公告	2007-5-22
增加中国工商银行 1 家代销机构	2007-6-8
易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购深圳顺络电子股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	2007-6-8
易方达基金管理有限公司关于基金对帐单邮寄服务规则调整的公告	2007-6-12
旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司网上银行申购费率优惠活动的公告	2007-6-20
易方达基金管理有限公司关于开通浦发银行卡网上交易的公告	2007-6-25
易方达基金管理有限公司关于开通广发银行理财通卡网上交易定期定额申购业务的公告	2007-7-4
易方达基金管理有限公司关于公司股权转让的公告	2007-7-21
增加开放式证券投资基金代销机构及在建设银行推出定期定额申购业务的公告	2007-7-31
易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海浦东发展银行推出柜面基金定期定额业务的公告	2007-8-15
易方达积极成长证券投资基金更正公告	2007-9-1
易方达积极成长证券投资基金分红公告	2007-9-6
易方达基金管理有限公司关于开通中信银行卡网上交易的公告	2007-9-17
易方达基金管理有限公司关于开通中国银行广东省分行银行卡网上交易的公告	2007-9-20
增加开放式证券投资基金代销机构的公告（民生银行）	2007-9-21
易方达基金管理有限公司关于开通招商银行卡网上交易的公告	2007-9-24
关于参与交通银行基金定投业务推广活动的公告	2007-9-29
易方达基金管理有限公司关于修改旗下基金基金合同和托管协议中资产估值部分的公告	2007-9-29
增加深圳平安银行为旗下开放式基金代销机构及推出定期定额申购业务的公告	2007-10-17
易方达基金管理有限公司关于公司股东更名的公告	2007-10-19
关于增加易方达旗下基金定期定额申购业务代销机构的公告	2007-11-1
关于旗下基金代销机构天同证券变更为齐鲁证券的公告	2007-11-1
易方达基金管理有限公司关于在中原证券股份有限公司推出易方达旗下开放式基金定期定额申购业务的公告	2007-11-29
增加中信证券为旗下开放式基金代销机构的公告	2007-12-19
易方达基金管理有限公司关于在长城证券推出易方达基金定期定额业务的公告	2007-12-19
易方达积极成长证券投资基金分红公告	2007-12-19
易方达基金管理有限公司增加中信万通证券为旗下部分开放式基金代销机构的公告	2007-12-21
易方达基金管理有限公司增加北京银行为旗下部分开放式基金代销机构的公告	2007-12-26
易方达基金管理有限公司关于调整基金经理的公告	2007-12-28
增加招商银行为旗下部分开放式基金代销机构及推出定期定额申购业务的公告	2007-12-28

注：上述公告均披露于中国证券报、上海证券报、证券时报

十一、备查文件目录

1、 中国证监会批准易方达积极成长证券投资基金设立的文件；

2、 《易方达积极成长证券投资基金基金合同》；

3、 《易方达积极成长证券投资基金托管协议》；

4、 《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；

5、 基金管理人业务资格批件和营业执照；

6、 基金托管人业务资格批件和营业执照。

存放地点：基金管理人、基金托管人处

查阅方式：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司
2008 年 3 月 29 日

易方达货币市场基金 2007 年年度报告摘要

(上接 212 版)

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0452%
报告期内偏离度的最低值	-0.2084%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0912%

（六）投资组合报告附注

1、基金计价方法说明

本基金目前投资工具的估值方法如下：

（1）基金持有的债券（包括票据）购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，按实际利率计算其摊余成本及各期利息收入，每日计提收益；

（2）基金持有的回购以成本列示，按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息；合同利率与实际利率差异较小的，也可采用合同利率计算确定利息收入；

（3）基金持有的银行存款以本金列示，按实际协议利率逐日计提利息。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

如有新增事项，按国家最新规定估值。

2、本基金本报告期内不存在剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的 20％的情况。

3、本报告期内无需说明的证券投资程序。

4、报告期末其他资产的构成

序号	其他资产	金额（元）
1	交易保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	5,318,804.18
4	应收申购款	8,105,870.83
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
合 计		13,424,675.01

5、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。

6、报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

八、基金份额持有人情况

本报告期末本基金份额持有人户数和持有人结构如下：

份额级别	基金份额持有人户数(户)	平均每户持有的基金份额(份)	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额(份)	占总份额比例	持有份额(份)	占总份额比例
A级基金	28,675	51,901.95	56,362,232.76	2.31%	1,431,926,214.77	58.72%
B级基金	27	35,197,383.39	647,491,621.32	26.55%	302,837,730.14	12.42%
合计	28,702	84,963.34	703,853,854.08	28.86%	1,734,763,944.91	71.14%

九、开放式基金份额变动情况

(一)本基金份额变动情况如下：

单位：份

份额级别	基金合同生效日的基金份额总额	本报告期内基金份额的变动情况			
		期初基金份额总额	本期总申购份额	本期总赎回份额	期末基金份额总额
A级基金	3,622,219,215.04	1,180,724,072.18	18,141,856,704.53	17,834,292,329.18	1,488,288,447.53
B级基金	984,686,079.23	1,029,968,642.57	9,367,553,479.86	9,447,192,770.97	950,329,351.46
合计	4,606,905,294.27	2,210,692,714.75	27,509,410,184.39	27,281,485,100.15	2,438,617,798.99

（二）基金管理人从业人员持有本基金份额情况：

2007年	期末持有本开放式基金份额的总量（份）	占本基金总份额的比例（％）
A级基金	572,817.61	0.0385
B级基金	-	-

十、重大事件揭示

1、本报告期内未召开基金份额持有人大会。

2、本报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门原总经理秦立儒先生已于 2007 年 11 月 27 日调任其他岗位，目前由董杰先生任托管部门总经理。

3、本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

4、本报告期内本基金的投资策略、本基金管理人的内部决策程序未有重大变化。

5、本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并全部分配，每月以红利再投资方式集中支付累计收益，即按份额面值 1.00 元转为基金份额。本基金本报告期累计分配收益 62,369,913.64 元。

6、本基金自基金合同生效以来连续 3 年聘请安永华明会计师事务所提供审计服务，本报告年度的审计费为 105,000.00 元。

7、本报告期内基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何处罚。

8、本基金租用专用交易席位的情况

本基金根据中国证券监督管理委员会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字[1998]29 号）的有关规定要求及本基金管理人的《基金专用交易席位租用制度》，决定租用国泰君安证券股份有限公司一个交易席位。本期无新增或减少席位。

本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其席位作为本基金的专用交易席位。基金专用交易席位的选择标准如下：

a.经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

b.具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

c.具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

基金专用交易席位的选择程序如下：

a.本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构。

b.基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

本报告期内，本基金通过证券经营机构的交易席位成交及佣金情况见下表：

单位：元

券商名称	债券成交金额	比例	债券回购成交金额	比例	佣金	比例
国泰君安证券	-	-	11,486,500,000.00	100.00%	80,000.00	100.00%
合计	-	-	11,486,500,000.00	100.00%	80,000.00	100.00%

9、本报告期基金披露过的其他重要事项：

公告事项	披露日期
关于进一步开通建行龙卡储蓄卡基金网上交易的公告	2007-1-31
增加华西证券 1 家代销机构	2007-2-3
增加万联证券 1 家代销机构	2007-2-3
易方达货币市场基金春节前（2 月 15 日）暂停申购的公告	2007-2-12
对市场上出现冒用我司名义进行非法证券活动的特别提示	2007-3-20
易方达基金管理有限公司关于公司股权转让的公告	2007-4-3
增加渤海证券和东海证券 2 家代销机构	2007-4-4
关于在西部证券股份有限公司推出基金定期定额业务的公告	2007-4-13
易方达货币市场基金五一前两个工作日暂停申购的公告	2007-4-23
关于五一期间易方达基金管理公司网站和客户服务热线暂停使用的公告	2007-4-25
增加上海银行 1 家代销机构	2007-5-21
易方达基金管理有限公司关于运用固有资金进行基金投资的公告	2007-5-22
关于在上海银行推出易方达 50 指数基金和易方达货币市场基金 A 级基金份额的定期定额申购业务的公告	2007-5-22
易方达基金管理有限公司关于基金对帐单邮寄服务规则调整的公告	2007-6-12
易方达基金管理有限公司关于开通浦发银行卡网上交易的公告	2007-6-25
易方达基金管理有限公司关于开通广发银行理财通卡网上交易定期定额申购业务的公告	2007-7-4
易方达基金管理有限公司关于公司股权转让的公告	2007-7-21
关于易方达价值成长混合型基金开放与我司旗下货币市场基金和月月收益中短期债券基金之间的转换业务的公告	2007-8-18
易方达基金管理有限公司关于开通中信银行卡网上交易的公告	2007-9-17
易方达基金管理有限公司关于开通中国银行广东省分行银行卡网上交易的公告	2007-9-20
关于易方达货币市场基金十一前两个工作日暂停申购的公告	2007-9-21
易方达基金管理有限公司关于开通招商银行网上交易的公告	2007-9-24
易方达基金管理有限公司关于修改旗下基金合同和托管协议中资产估值部分的公告	2007-9-29
易方达基金管理有限公司增加深圳平安银行为旗下开放式基金代销机构及推出定期定额申购业务的公告	2007-10-17
易方达基金管理有限公司关于公司股东更名的公告	2007-10-19
易方达基金管理有限公司关于旗下基金代销机构天同证券变更为齐鲁证券及增加基金代销机构的公告	2007-11-01
易方达基金管理有限公司关于在中原证券股份有限公司推出易方达旗下开放式基金定期定额申购业务的公告	2007-11-29
易方达基金管理有限公司关于在招商银行推出易方达旗下部分开放式基金定期定额业务的公告	2007-12-07
易方达基金管理有限公司关于在长城证券推出易方达旗下部分开放式基金定期定额业务的公告	2007-12-19
易方达基金管理有限公司增加中信万通证券为旗下部分开放式基金代销机构的公告	2007-12-21
关于易方达货币市场基金元旦前两个工作日暂停申购和转换转入的公告	2007-12-25
易方达基金管理有限公司增加北京银行为旗下部分开放式基金代销机构的公告	2007-12-26
易方达基金管理有限公司增加中国工商银行股份有限公司为易方达货币市场基金代销机构的公告	2007-12-28

注：上述公告均披露于中国证券报、上海证券报、证券时报。

易方达基金管理有限公司
2008 年 3 月 29 日

易方达 50 指数证券投资基金 2007 年年度报告摘要

(上接 213 版)

（1）指数投资部分

序号	证券代码	证券名称	数量（股）	市值（元）	市值占基金资产净值比例
1	600028	中国石化	130,790,203	3,064,414,456.29	9.29%
2	600030	中信证券	28,888,155	2,578,845,596.85	7.81%
3	600000	浦发银行	47,978,006	2,533,238,716.80	7.68%
4	600005	武钢股份	122,397,295	2,411,226,711.50	7.31%
5	600016	民生银行	132,540,802	1,964,254,685.64	5.95%

（2）积极投资部分

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	601939	建设银行	35,229,826	347,013,786.10	1.05%
2	600497	驰宏锌锗	1,200,000	95,664,000.00	0.29%
3	601168	西部矿业	1,499,987	62,564,457.77	0.19%
4	000338	潍柴动力	468,865	40,603,709.00	0.12%
5	000903	云内动力	2,065,773	38,774,559.21	0.12%

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	600028	中国石化	2,926,530,841.37	142.46%
2	600030	中信证券	2,419,503,931.32	117.78%
3	600016	民生银行	2,312,623,755.96	112.58%
4	600000	浦发银行	2,268,493,980.90	110.43%
5	600005	武钢股份	2,125,326,495.88	103.46%
6	600036	招商银行	1,691,377,062.45	82.34%
7	600019	宝钢股份	1,688,090,252.05	82.18%
8	600900	长江电力	1,371,200,080.42	66.75%
9	601398	工商银行	1,141,242,883.34	55.56%
10	601088	中国神华	837,900,938.04	40.79%
11	600050	中国联通	784,705,596.52	38.20%
12	600048	保利地产	702,507,199.36	34.20%
13	601318	中国平安	698,767,549.72	34.02%
14	601006	大秦铁路	682,785,798.15	33.24%
15	600519	贵州茅台	619,342,288.96	30.15%
16	601988	中国银行	546,601,873.10	26.61%
17	600009	上海机场	531,784,278.57	25.89%
18	600011	华能国际	510,207,240.27	24.84%
19	600331	宏达股份	497,176,374.33	24.20%
20	601166	兴业银行	457,948,290.55	22.29%
21	600177	雅戈尔	451,949,446.64	22.00%
22	600320	振华港机	426,447,651.20	20.76%
23	600309	烟台万华	418,284,265.73	20.36%
24	600018	上港集团	417,905,598.03	20.34%
25	600104	上海汽车	417,060,569.58	20.30%
26	601628	中国人寿	406,523,629.52	19.79%
27	600015	华夏银行	384,186,024.46	18.70%
28	601939	建设银行	343,133,992.16	16.70%
29	600717	天津港	289,398,640.76	14.09%
30	600001	邯郸钢铁	288,979,025.71	14.07%
31	600795	国电电力	286,846,233.92	13.96%
32	601600	中国铝业	276,394,579.77	13.45%
33	600642	申能股份	223,442,897.50	10.88%
34	600583	海油工程	214,906,154.19	10.46%
35	600037	歌华有线	208,396,011.30	10.14%
36	600832	东方明珠	193,664,818.61	9.43%
37	601998	中信银行	193,443,742.76	9.42%
38	601333	广深铁路	187,409,013.59	9.12%
39	600887	伊利股份	174,915,147.48	8.51%
40	600879	火箭股份	172,041,634.77	8.37%
41	600026	中海发展	149,318,136.20	7.27%
42	600269	赣粤高速	141,077,201.35	6.87%
43	601111	中国国航	136,901,697.16	6.66%
44	601872	招商轮船	108,450,696.23	5.28%
45	600497	驰宏锌锗	95,361,462.24	4.64%
46	600811	东方集团	86,992,957.04	4.23%
47	600362	江西铜业	74,555,627.23	3.63%
48	600649	原水股份	64,297,574.11	3.13%
49	600895	张江高科	61,907,709.14	3.01%
50	601168	西部矿业	61,571,732.28	3.00%
51	600660	福耀玻璃	43,294,024.34	2.11%
52	600317	营口港	42,726,776.74	2.08%

注：累计买入金额＝∑（买入数量＊买入成交单价）

（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	本期累计卖出金额(元)	占期初基金资产净值的比例
1	601318	中国平安	888,091,531.14	43.23%
2	600030	中信证券	522,868,647.03	25.45%
3	601600	中国铝业	501,150,255.31	24.40%
4	600900	长江电力	489,441,876.22	23.83%
5	600016	民生银行	462,264,736.68	22.50%
6	600036	招商银行	452,871,136.94	22.05%
7	601628	中国人寿	413,941,013.72	20.15%
8	600050	中国联通	298,823,768.98	14.55%
9	601988	中国银行	297,548,381.78	14.48%
10	600026	中海发展	231,990,477.03	11.29%
11	600037	歌华有线	222,486,648.62	10.83%
12	600005	武钢股份	211,620,169.08	10.30%
13	600000	浦发银行	190,389,508.56	9.27%
14	601111	中国国航	180,298,388.97	8.78%
15	600879	火箭股份	173,526,049.90	8.45%
16	600269	赣粤高速	166,756,370.50	8.12%
17	600018	上港集团	164,433,200.65	8.00%
18	601398	工商银行	160,075,163.08	7.79%
19	600028	中国石化	157,649,129.80	7.67%
20	600019	宝钢股份	141,399,084.78	6.88%
21	601006	大秦铁路	139,468,593.77	6.79%
22	600177	雅戈尔	130,439,792.15	6.35%
23	600009	上海机场	127,720,207.27	6.22%
24	600320	振华港机	118,745,235.65	5.78%
25	600832	东方明珠	102,154,855.45	4.97%
26	600717	天津港	98,927,248.86	4.82%
27	600015	华夏银行	91,377,470.15	4.45%
28	600895	张江高科	88,681,987.76	4.32%
29	600642	申能股份	83,330,422.08	4.06%
30	600660	福耀玻璃	82,598,080.70	4.02%
31	600011	华能国际	79,916,153.97	3.89%
32	000839	中信国安	78,532,836.54	3.82%
33	600519	贵州茅台	74,535,270.57	3.63%
34	000983	西山煤电	66,710,254.90	3.25%
35	600309	烟台万华	66,520,424.48	3.24%
36	600795	国电电力	64,839,085.83	3.16%
37	000903	云内动力	63,638,278.43	3.10%
38	600104	上海汽车	62,084,656.37	3.02%
39	600188	兖州煤业	55,699,877.68	2.71%
40	600649	原水股份	55,300,944.98	2.69%
41	600317	营口港	46,980,733.95	2.29%
42	600887	伊利股份	44,325,717.53	2.16%
43	002024	苏宁电器	43,920,906.99	2.14%
44	600809	山西汾酒	43,665,259.10	2.13%
45	601166	兴业银行	41,801,029.80	2.03%

注：累计卖出金额＝∑（卖出数量＊卖出成交单价）

（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）
买入股票成本总额	32,542,619,248.44
卖出股票收入总额	8,920,900,330.49

注：本表统计口径同上表（1）、（2）。

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	12,967,798.00	0.04%
5	可 转 债	0.00	0.00%
	合 计	12,967,798.00	0.04%

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	07上汽债	12,967,798.00	0.04%
合计		12,967,798.00	0.04%

注：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	351,282.05
应收股利	0.00
应收利息	808,978.82
应收申购款	128,063,269.59
待摊费用	0.00
其他应收款	0.00
合计	129,223,530.46

（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）	占基金资产净值比例
580013	武钢 CWB1	1,344,249	10,620,911.35	0.03%
580016	上汽 CWB1	650,196	5,907,485.80	0.02%
	合计	1,994,445	16,528,397.15	0.05%

（7）报告期内获得的权证明细

权证代码	权证名称	数量（份）	成本总额	投资类别
580005	万华 HXB1	879,860	30,534,253.55	主动投资
580013	武钢 CWB1	1,437,249	3,329,675.72	被动持有
580016	上汽 CWB1	650,196.00	5,189,336.33	被动持有
580989	南航 JTP1	1,680,000	-	被动持有
031005	国安 GAC1	77,548	423,030.32	被动持有
合计：		4,724,853	39,476,295.92	

（8）报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

（9）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。

八、基金份额持有人情况

（一）报告期末基金份额持有人户数

报告期末基金份额持有人户数：	1,329,216 户
报告期末平均每户持有的基金份额：	16,944.97 份

（二）报告期末基金份额持有人结构：

项目	数量	占总份额的比例
基金份额总额：	22,523,525,361.15	100%
其中：机构投资者持有的基金份额	318,813,868.49	1.42%
个人投资者持有的基金份额	22,204,711,492.66	98.58%

(三) 报告期末本基金管理公司从业人员持有本基金份额情况

项 目	期末持有本开放式基金份额的总量（份）	占本基金总份额的比例（％）
基金管理公司持有本基金的所有从业人员	250,075.97	0.0011%

九、开放式基金份额变动

本基金份额变动情况如下：

单位：份

基金合同生效日的基金份额总额	5,048,902,330.26
本报告期期初基金份额总额	1,147,923,485.96
加：本报告期期间总申购份额	34,278,163,452.72
减：本报告期期间总赎回份额	12,902,561,577.53
本报告期期末基金份额总额	22,523,525,361.15

十、重大事件揭示

1、本报告期内未召开基金份额持有人大会。

2、本报告期内基金管理人未发生重大人事变动。

基金托管人交通银行于 2007 年 10 月 19 日公布了《交通银行股份有限公司关于基金托管行业高管人员变动的公告》，交通银行资产托管部原总经理阮红同志不再担任资产托管部总经理职务。目前暂由资产托管部谷娜莎副总经理主持资产托管部工作。

具体内容请参阅在 2007 年 10 月 19 日《中国证券报》上发布的《交通银行股份有限公司关于基金托管行业高管人员变动的公告》。

2007 年 12 月 21 日，交通银行股份有限公司在《证券时报》上刊登了《交通银行股份有限公司关于谷娜莎基金托管行业高管任职资格的公告》，谷娜莎同志担任交通银行资产托管部总经理，主持资产托管部工作。

具体内容请参阅在 2007 年 12 月 21 日《证券时报》上发布的《交通银行股份有限公司关于谷娜莎基金托管行业高管任职资格的公告》。

3、本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

4、本报告期内本基金的投资策略、本基金管理人的内部决策程序未有重大变化。

5、本报告期内本基金收益分配事项：

	分红公告日	权益登记日	每 10 份基金份额收益分配金额(元)	收益分配金额(元)
本期第 1 次分红	2007-5-16	2007-5-18	15.500	1,188,863,225.27
本期第 2 次分红	2007-7-2	2007-7-4	1.500	449,391,622.90
本期第 3 次分红	2007-9-14	2007-9-18	0.300	523,236,431.39
累计收益分配金额			17.300	2,161,491,279.56

6、本基金自基金合同生效以来连续 4 年聘请安永华明会计师事务所提供审计服务，本报告年度的审计费为 105,000.00 元。

7、本报告期内本基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何处罚。

8、本基金租用专用交易席位的情况

本基金根据中国证券监督管理委员会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字[1998]29 号）的有关规定要求及本基金管理人的《基金专用交易席位租用制度》，决定租用海通证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、金通证券股份有限公司、万联证券有限责任公司、中银国际证券有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、财通证券有限责任公司、国信证券有限责任公司各一个交易席位，租用广发证券股份有限公司两个交易席位。本报告期内减少联合证券有限责任公司一个交易席位，新增国信证券有限责任公司一个交易席位。原天和证券更名为财通证券。

本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其席位作为本基金的专用交易席位。基金专用交易席位的选择标准如下：

(1)经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

(2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

(3)具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

基金专用交易席位的选择程序如下：

(1)本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构。

(2)基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

本报告期，本基金通过各机构的交易席位的成交及佣金情况见下表：

券商名称	股票成交金额	比例	债券成交金额	比例	权证成交金额	比例	佣金	比例
海通证券	2,382,962,689.58	5.79%	-	-	-	-	1,954,022.90	5.79%
中信建投	7,366,249,873.41	17.90%	-	-	-	-	6,040,298.27	17.91%
广发证券	2,578,180,019.40	6.26%	945,380.94	5.97%	4,855,870.04	13.21%	2,090,663.60	6.20%
光大证券	2,977,366,708.50	7.23%	-	-	30,531,887.10	83.03%	2,441,433.43	7.24%
金通证券	3,797,806,555.32	9.23%	-	-	-		3,114,186.47	9.23%
中银国际	2,576,576,266.82	6.26%	-	-	-		2,112,785.59	6.26%
国泰君安	2,246,867,456.74	5.46%	-	-	-		1,842,423.95	5.46%
万联证券	4,186,253,564.76	10.17%	12,838,366.80	81.06%	1,383,800.99	3.76%	3,432,719.49	10.18%
银河证券	8,817,115,786.62	21.42%	2,054,415.60	12.97%	-	-	7,230,014.69	21.44%
财通证券	1,982,468,363.35	4.82%	-	-	-	-	1,625,615.50	4.82%
国信证券	2,250,964,416.14	5.46%	-	-	-	-	1,845,775.46	5.47%
合计	41,162,811,700.64	100.00%	15,838,163.34	100.00%	36,771,558.13	100.00%	33,729,939.35	100.00%

注：本基金于 2007 年度无债券回购交易。

9、本报告期基金披露过的其他重要事项：

公告事项	披露日期
易方达基金管理有限公司关于进一步开通建行龙卡储蓄卡基金网上交易的公告	2007-01-31
增加万联证券一家代销机构	2007-02-03
增加华西证券一家代销机构	2007-02-03
易方达基金管理有限公司关于增聘基金经理的公告	2007-02-10
对市场上出现冒用我司名义进行非法证券活动的特别提示	2007-03-20
易方达基金管理有限公司关于旗下基金获配武钢分离型可转债的公告	2007-03-31
易方达基金管理有限公司关于公司股权转让的公告	2007-04-03
增加渤海证券和东海证券两家代销机构	2007-04-04
易方达基金管理有限公司关于增加浦发银行为代销机构以及在浦发银行推出基金定期定额业务的公告	2007-04-13
易方达基金管理有限公司关于在西部证券股份有限公司推出基金定期定额业务的公告	2007-04-13
关于五一期间易方达基金管理有限公司网站和客户服务热线暂停使用的公告	2007-04-25
易方达基金管理有限公司关于修改旗下基金基金合同的公告	2007-05-15
易方达基金管理有限公司关于调整旗下基金申购费用及申购份额计算方法的公告	2007-05-15
易方达 50 指数证券投资基金分红公告	2007-05-16
关于易方达 50 指数证券投资基金暂停申购和转入业务的公告	2007-05-16
易方达基金管理有限公司关于增加开放式基金代销机构的公告（上海银行）	2007-05-21
易方达基金管理有限公司关于运用固有资金进行基金投资的公告	2007-05-22
易方达基金管理有限公司关于在上海银行推出易方达 50 指数基金和易方达货币市场基金 A 级基金份额的定期定额申购业务的公告	2007-05-22
易方达基金管理有限公司关于基金对帐单邮寄服务规则调整的公告	2007-06-12
易方达基金管理有限公司关于开通浦发银行卡网上交易的公告	2007-06-25
易方达基金管理有限公司增加中国工商银行股份有限公司为易方达 50 指数证券投资基金代销机构的公告	2007-06-29
易方达 50 指数证券投资基金分红公告	2007-07-02
易方达基金管理有限公司关于开通广发银行理财通卡网上交易定期定额申购业务的公告	2007-07-04
易方达基金管理有限公司关于公司股权转让的公告	2007-07-21
易方达基金管理有限公司增加中国银行股份有限公司为易方达 50 指数证券投资基金代销机构及推出定期定额申购业务的公告	2007-07-24
易方达基金管理有限公司增加开放式证券投资基金代销机构及在建设银行推出定期定额申购业务的公告	2007-07-31
易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海浦东发展银行推出柜面基金定期定额业务的公告	2007-08-15
易方达 50 指数基金和易方达策略成长基金在中国工商银行股份有限公司推出定期定额申购业务的公告	2007-08-24
易方达 50 指数证券投资基金分红公告	2007-09-14
易方达基金管理有限公司关于开通中信银行卡网上交易的公告	2007-09-17
易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行基金定投申购费率优惠活动的公告	2007-09-17
易方达基金管理有限公司关于开通中国银行广东省分行银行卡网上交易的公告	2007-09-20
易方达基金管理有限公司增加开放式证券投资基金代销机构的公告	2007-09-21
易方达基金管理有限公司关于开通招商银行卡网上交易的公告	2007-09-24
易方达基金管理有限公司关于修改旗下基金基金合同和托管协议中资产估值部分的公告	2007-09-29
易方达基金管理有限公司关于参与交通银行基金定投业务推广活动的公告	2007-09-29
易方达基金管理有限公司增加深圳平安银行为旗下开放式基金代销机构及推出定期定额申购业务的公告	2007-10-17
易方达基金管理有限公司关于公司股东更名的公告	2007-10-19
易方达基金管理有限公司关于增加易方达旗下基金定期定额申购业务代销机构的公告	2007-11-01
易方达基金管理有限公司关于旗下基金代销机构天同证券变更为齐鲁证券及增加基金代销机构的公告	2007-11-01
易方达基金管理有限公司关于在中原证券股份有限公司推出易方达旗下开放式基金定期定额申购业务的公告	2007-11-29
易方达基金管理有限公司关于在招商银行推出易方达旗下部分开放式基金定期定额业务的公告	2007-12-07
易方达基金管理有限公司增加中信证券为旗下部分开放式基金代销机构的公告	2007-12-19
易方达基金管理有限公司增加中国邮政储蓄银行为旗下部分开放式基金代销机构、推出定期定额申购业务及参加邮储银行定期定额投资优惠活动的公告	2007-12-19
易方达基金管理有限公司关于在长城证券推出易方达旗下部分开放式基金定期定额业务的公告	2007-12-19
易方达基金管理有限公司增加中国农业银行为旗下部分开放式基金代销机构的公告	2007-12-20
易方达基金管理有限公司增加中信万通证券为旗下部分开放式基金代销机构的公告	2007-12-21
易方达基金管理有限公司增加北京银行为旗下部分开放式基金代销机构的公告	2007-12-26
易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加“工行——2008 倾心回馈”基金定投优惠活动及工行个人网上银行基金申购费率优惠变更的公告	2007-12-27
易方达基金管理有限公司关于调整基金经理的公告	2007-12-28

注：上述公告均披露于中国证券报、上海证券报、证券时报

易方达基金管理有限公司
2008年 3 月 29 日