基金管理人:易方达基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
送出日期:二〇一二年三月二十七日

科瑞证券投资基金

2011 年度 报告摘要

2011年12月31日

§1重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。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股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年3月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、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及其更新。

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。

本报告中财务资料已经审计,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。

本报告期自2011年1月1日起至12月31日止。

§2基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	易方达科瑞封闭
基金主代码	500056
交易代码	500056
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	2002年3月12日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,000,000,000份
基金合同存续期	2002年3月12日至2017年3月11日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2002年3月20日

2.2 基金产品说明

投资目标	主要投资于价值被市场他对或相对低估的股票。本基金的投资目标是在控制股票投资组合的风险的前提下,追求基金资产的长期稳定的增值。
投资策略	基金管理人在对宏观经济和市场发展趋势进行深入分析的基础上,进行资产在股票、债券和现金间的资产配置。当判断股票市场趋势向好时,基金管理人采取积极进取的投资方式,加大股票投资比例,降低债券投资、现金的比例,力求取得较好的资本增值收益;当预测股票市场走势趋淡时,则降低股票投资比例,加大债券投资和现金比例,避免股票市场大幅下挫时引起的资产损失。基金管理人主要选择公司价值被市场相对和绝对低估的股票构建投资组合。
业绩比较基准	无
风险收益特征	无

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张南	张咏东
	联系电话	020-38799008	021-32169999
	电子邮箱	csc@efunds.com.cn	zhangyd@bankcomm.com
客户服务电话		400 881 8088	95559
传真		020-38799488	021-62701216

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市体育西路189号城建大厦28楼

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2011年	2010年	2009年
本期已实现收益	-56,168,469.00	153,474,076.64	1,178,824,402.53
本期利润	-825,160,421.50	283,294,766.59	1,665,665,865.99
加权平均基金份额本期利润	-0.2751	0.0944	0.5552
本期基金份额净值增长率	-23.08%	8.55%	58.70%
3.1.2 期末数据和指标	2011年末	2010年末	2009年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0896	0.0518	0.3606
期末基金资产净值	2,731,105,035.96	3,706,265,457.46	4,502,970,690.87
期末基金份额净值	0.9104	1.2354	1.5010

注:1. 上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。

2. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

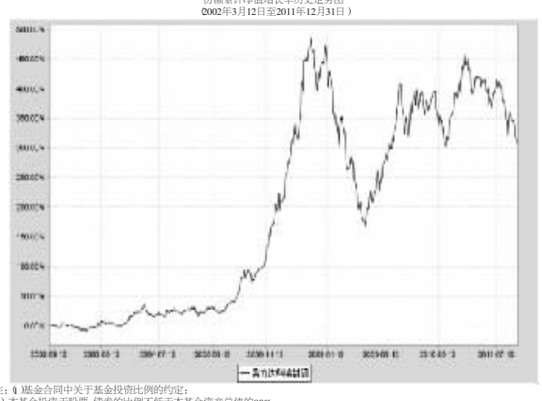
3.2 基金净值表现

3.2.1基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-8.14%	2.96%	-	-	-	-
过去六个月	-16.58%	2.41%	-	-	-	-
过去一年	-23.08%	2.30%	-	-	-	-
过去三年	32.52%	2.91%	-	-	-	-
过去五年	52.02%	3.40%	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	310.63%	2.87%	-	-	-	-

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

科瑞证券投资基金
份额累计净值增长率历史走势图
(2002年3月12日至2011年12月31日)



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%;

2)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%;

3)本基金投资于单个上市公司股票的比例不高于基金资产净值的10%;

4)本管理人所管理的全部基金持有一家公司发行的证券不得超过该证券的10%;

5)本基金投资不超过中国证监会规定的其他比例限制;

6)法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定时从其规定。

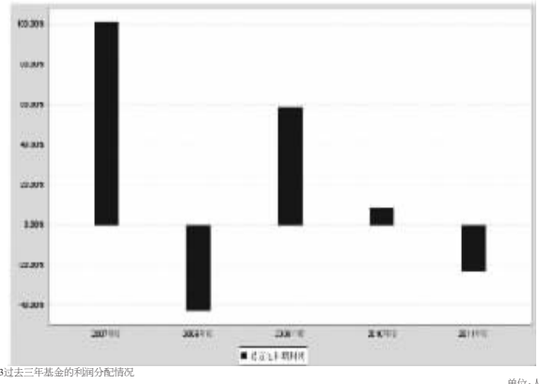
因基金规模或市场剧烈变化导致投资组合不符合上述规定时,基金管理人应在合理期限内进行调整,以符合上述规定。法律法规另有规定时,从其规定。

(2)本基金合同未规定业绩比较基准。

(3)本基自基金合同生效至报告期末的基金份额净值增长率为310.63%。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

科瑞证券投资基金
过去五年净值增长率图



3.3过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2011年	0.500	150,000,000.00	-	150,000,000.00	-
2010年	3.600	1,080,000,000.00	-	1,080,000,000.00	-
2009年	-	-	-	-	-
合计	4.100	1,230,000,000.00	-	1,230,000,000.00	-

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1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于2001年4月17日成立,注册资本1.2亿元,截至2011年12月31日,公司的股东为广东粤财信托有限公司、广发证券股份有限公司、盈峰投资控股集团有限公司、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,公司现有全国社保基金投资管理人、企业年金投资管理人、QDII和特定资产管理业务资格。

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,为投资者创造最优回报。

截至2011年12月31日,本公司旗下共管理30只开放式基金和1只封闭式基金,具体包括科瑞证券投资基金,易方达平稳增长证券投资基金,易方达策略成长证券投资基金,易方达50指数证券投资基金,易方达积极成长证券投资基金,易方达货币市场基金,易方达稳健收益债券型证券投资基金,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证券投资基金,易方达策略成长二号混合型证券投资基金,易方达价值成长混合型证券投资基金,易方达科讯股票型证券投资基金,易方达增强回报债券型证券投资基金,易方达中小盘股票型证券投资基金,易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金,易方达科翔股票型证券投资基金,易方达行业领先企业股票型证券投资基金,易方达沪深300指数证券投资基金,易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金,易方达亚洲精选股票型证券投资基金,易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金,易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金,易方达消费行业股票型证券投资基金,易方达岁丰添利债券型证券投资基金,易方达医疗保健行业股票型证券投资基金,易方达黄金主题证券投资基金(LOF),易方达安心回报债券型证券投资基金,易方达资源行业股票型证券投资基金,易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金,易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金,易方达双倍增强债券型证券投资基金。同时,公司还管理着多个全国社保基金、企业年金基金和特定客户资产管理投资组合。

4.1.2基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
付浩	本基金的基金经理、易方达科翔股票型证券投资基金的基金经理	2006-01-01	-	14年	硕士研究生,曾任广东粤财信托投资有限公司国际金融部职员,深圳和君创业研究咨询有限公司管理咨询项目经理,湖南证券投资银行总部项目经理,融通基金管理有限公司研究策划部研究员,易方达基金管理有限公司基金经理助理、易方达策略成长基金的基金经理。

注:1.此处的“任职日期”和“离任日期”分别为公告确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程,以及强化事后分析评估监督机制来确保公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等,并重视交易执行环节的公平交易措施,以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则,通过投资交易系统中的公平交易模块,以尽可能确保公平对待各投资组合。对于一级市场申购等场外交易,按照公平交易原则完善了相关分配机制。本报告期内,公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

无。

4.3.3异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2011年一季度,中央政府继续采取宏观紧缩政策,加息、提高存款准备金率等政策交替出台,持续的紧缩政策对于抑制经济过热起到了一定作用;对房地产行业,政府仍然采用高压姿态,一季度末期,房地产成交量开始出现明显下滑。

美国经济持续走好,特别是失业率这个重要指标有了一定的改善;欧洲方面情况也不断改善,加息已经提上日程;日本则遭受严重地震,加之核泄露事件,对其经济复苏影响较大。

一季度资本市场风格变化较大,从指数表现看,上证50指数上涨5.38%,战胜沪深300指数,较大幅度跑赢中小板和创业板指数,这是2009年来的第一次,代表市场风格在一季度的成功转换。一季度市场风格的转换来得比较突然,2010年表现较好的医药、消费和新兴经济股票持续下跌,制造业类的股票表现良好,银行、地产类股票也振荡上行。

基金科瑞去年组合比较多配置在医药消费等股票中,一季度也没有做大多的组合变化,所以净值表现一般。

进入2011年二季度,我国宏观经济仍然保持了较高的增长速度,但是,经济增速呈下降的趋势。此外,居高不下的通胀数据,也给投资者信心带来极大影响。

国际经济方面,在二季度有不少利空因素出现,欧盟部分成员国的债务危机、美国失业率重回高位等,在一定程度上打击了国际投资者的信心。

二季度资本市场受经济增速放缓和通胀压力较大等因素的影响,表现欠佳,沪深300指数下跌5.56%,而创业板股票则是市场下跌的重灾区,该板块指数下跌16%。

基金科瑞在二季度略微提高了组合的集中度,加大了地产、煤炭、化工等行业类股票的配置。令人遗憾的是在资产配置上操作并不成功,没有能够通过降低仓位来应对市场的下跌。

三季度,国内宏观经济增速呈持续下降的态势,通胀仍然是影响投资者的最重要因素。加上三季度经常出现的媒体报道部分中小企业资金紧张、某些地区高利贷等事件也使投资者对宏观经济的中期走势感到担心。

国际经济方面,三季度利空不断,欧元区债务危机不断发生,特别是标普下调美国主权信用评级,严重打击全球投资者信心,全球股市在三季度表现欠佳。

三季度受国际经济形势不好、内地通胀严重持续紧缩等因素的影响,内地股票市场受伤惨重,整个季度沪深300指数下跌15%。

基金科瑞在三季度降低了化工等部分周期行业类股票的配置,减持了部分基本面确定性较差的个股,但仍然没有较好回避市场系统性风险。

进入四季度,内地宏观经济仍然处于紧缩态势,通胀仍然是影响投资者决策的最重要因素,但投资者仍然担心物价的反弹,持续的通胀压力、较高的流通货币存量,使得政府在放松力度上较为谨慎。投资者越来越担心,内地宏观经济会像2008年那样,出现断崖式的下跌。

国际经济方面,四季度情况比较稳定,欧洲各国仍在为解决债务危机做不懈的努力,美国经济仍佛又重新进入复苏轨道。

四季度,内地股市仍然无法摆脱下跌的趋势,虽然通胀数据已经从高位回落,但投资者对长期经济增长缺乏信心,受上述因素影响,市场经历十月份的短暂反弹后,重新大幅下跌,整个季度沪深300指数下跌9.13%。

基金科瑞在四季度略微降低股票仓位,增持了少量银行股,但仍然没有较好回避市场系统性风险。

整个2011年,在债券操作方面,虽然在上半年债券市场在资金面推动下出现一波上涨行情,但是下半年受市场资金面收紧和加息预期升温的双重影响,债券市场出现了大幅下跌,年末收益率曲线较年初明显上移。报告期内,本基金根据市场的变化灵活调整组合久期,较好地回避了债券下跌的损失,在关注持有期收益的同时使得组合流动性保持在较高水平。

2011年的债券市场经历了先跌后涨的行情。受通胀预期持续升温和紧张的资金面的影响,债券收益率在前三个季度节节攀升。之后,随着资金面的缓解、通胀的回落和经济增速的下滑,市场在第四季度终于出现转机,收益率大幅下行。相对利率产品,信用产品的表现在下半年出现了分化。高评级品种受到市场青睐,低评级品种的信用利差则依然维持在历史高位。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为0.9104元,本报告期份额净值增长率为-23.08%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于2012年的宏观经济和股票市场,我们持相对谨慎的看法。

由于2011年基数较高的原因,今年我国通货膨胀问题的影响会小一些,增长问题会较长时间里受投资者关注。但是,过去几年,为了应对全球经济危机,央行释放了大量的流动性,过高的货币存量,对于整体物价水平都是潜在的威胁。即使会年的通货膨胀压力减轻,预计政府也不会有大的放松措施出台,还是会维持相对稳健的经济政策,特别是对于房地产的调控,暂时看不到有什么放松的迹象。

但是,从另一个角度看,从去年开始的紧缩和调控政策,对于中长期的经济发展是有利的,它会使得经济增速放缓,通胀压力减轻,更利于中国经济结构的转型。

注:根据2011年4月9日《易方达基金管理有限公司关于公司股东更名的公告》,基金管理人股东“广东盈峰投资控股集团有限公司”,基金管理人已完成股东更名事项的工商变更登记。

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	533,669,104.19	9.18%	1,735,109,722.38	9.00%

7.4.8.1.2权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.8.1.3应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	453,618.81	9.38%	21,826.75	3.63%
关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	1,474,837.68	9.19%	-	-

注:上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

该类佣金协议的服务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等。

7.4.8.2关联方报酬

7.4.8.2.1基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	49,127,201.34	54,184,041.16
其中:支付销售机构的客户维护费	-	-

注: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。

7.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	8,187,866.94	9,030,673.47

注: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。

7.4.8.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

本期 2011年1月1日至2011年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
交通银行	101,385,818.62	145,941,709.04	-	-	-	-
上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
交通银行	10,382,409.04	329,383,097.36	-	-	947,600,000.00	375,252.45

7.4.8.4各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
期初持有的基金份额	219,110,562.00	219,110,562.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	219,110,562.00	219,110,562.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	7.30%	7.30%

7.4.8.4.2报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位:份

关联方名称	本期末 2011年12月31日		上年度末 2010年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
粤财信托	7,500,000.00	0.25%	7,500,000.00	0.25%
广发证券	9,396,142.00	0.31%	-	-

7.4.8.5由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	175,547,872.28	613,035.44	71,476,183.14	1,317,392.41

7.4.8.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位:人民币元

本期 2011年1月1日至2011年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
广发证券	600518	康美药业	配股发行	60,000	412,800.00
上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
广发证券	601126	四方股份	公开发行	59,361	1,365,303.00
广发证券	300110	华仁药业	公开发行	500	6,995.00
广发证券	002398	建研集团	公开发行	500	14,000.00

7.4.8.7其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9期末(2011年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1银行间市场债券正回购

截至本报告期末2011年12月31日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0,无抵押债券。

7.4.9.3.2交易所市场债券正回购

截至本报告期末2011年12月31日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0,无抵押债券。

7.4.10有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(b)以公允价值计量的金融工具

(i)金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值,公允价值层级可分为:

第一层级:相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级:直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级:以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii)各层次金融工具公允价值

于2011年12月31日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为1,996,796,856.61元,第二层级的余额为553,272,000.00元,无属于第三层级的余额(2010年12月31日:第一层级的余额为2,750,177,111.13元,第二层级的余额为872,323,002.45元,无属于第三层级的余额)。

(iii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌等交易不活跃情况,或属于非公开发行等情况,本基金于上述事项影响期间不将相关股票的公允价值列入第一层级;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票公允价值应属第二层级或第三层级。

(iv)第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金本报告期初未持有公允价值归属于第三层级的金融工具(2010年期初:同);本基金本期净转入/(转出)第三层级0.00元(2010年度:无)。

(v)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,996,796,856.61	72.93
	其中:股票	1,996,796,856.61	72.93
2	固定收益投资	553,272,000.00	20.21
	其中:债券	553,272,000.00	20.21
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	176,859,454.22	6.46
6	其他各项资产	11,221,631.87	0.41
7	合计	2,738,149,942.70	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	76,326,707.73	2.79
B	采掘业	158,758,871.04	5.81
C	制造业	1,120,847,428.89	41.04
C0	食品、饮料	384,546,399.00	14.08
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	97,730,209.75	3.58
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	253,102,081.53	9.27
C8	医药、生物制品	385,468,738.61	14.11
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	24,989,549.52	0.91
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	167,776,893.91	6.14
H	批发和零售贸易	88,201,293.50	3.23
I	金融、保险业	106,525,879.57	3.90
J	房地产业	199,069,776.00	7.29
K	社会服务业	54,300,456.45	1.99
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	1,996,796,856.61	73.11

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000024	招商地产	11,059,432	199,069,776.00	7.29
2	000568	泸州老窖	4,084,420	152,348,866.00	5.58
3	600535	天士力	3,187,917	133,701,238.98	4.90
4	002038	双鹭药业	3,881,099	127,494,102.15	4.67
5	600559	老白干酒	5,019,356	104,553,185.48	3.83
6	600406	国电南瑞	3,332,582	103,976,558.40	3.81
7	000581	威孚高科	2,747,377	98,603,360.53	3.61
8	600251	冠农股份	5,199,191	97,068,895.97	3.55
9	000937	冀中能源	5,500,000	92,730,000.00	3.40
10	600587	新华医疗	2,591,367	81,109,787.10	2.97

注: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www.efunds.com.cn网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000024	招商地产	204,177,284.52	5.51
2	000568	泸州老窖	178,883,132.65	4.83
3	000061	农产品	147,553,975.73	3.98
4	600251	冠农股份	145,653,844.31	3.93
5	000937	冀中能源	95,558,602.24	2.58
6	600587	新华医疗	86,616,643.10	2.34
7	600585	海螺水泥	71,128,106.22	1.92
8	000630	铜陵有色	68,773,369.58	1.86
9	600518	康美药业	66,673,627.11	1.80
10	600348	阳泉煤业	53,526,069.93	1.44
11	000059	辽通化工	53,199,353.89	1.44
12	600688	S上石化	51,721,982.27	1.40
13	000661	长春高新	48,484,793.49	1.31
14	600015	华夏银行	46,046,805.28	1.24
15	600497	驰宏锌锗	45,166,218.46	1.22
16	300216	千山药机	45,007,807.72	1.21
17	002073	软控股份	44,278,179.62	1.19
18	600485	中创信测	44,152,734.54	1.19
19	600409	三友化工	43,589,331.34	1.18
20	002535	林州重机	41,079,615.04	1.11

注:买入金额按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.2累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000061	农产品	154,313,604.18	4.16
2	000063	中兴通讯	133,090,171.78	3.59
3	600535	天士力	88,159,864.45	2.38
4	600348	阳泉煤业	86,957,018.57	2.35
5	600085	同仁堂	81,666,584.73	2.20
6	600585	海螺水泥	77,613,415.31	2.09
7	600306	商业城	76,324,355.64	2.06
8	600289	亿阳信通	64,624,547.83	1.74
9	002106	莱宝高科	61,556,271.92	1.66
10	600497	驰宏锌锗	54,676,936.32	1.48
11	600496	精工钢构	52,906,833.41	1.43
12	000630	铜陵有色	51,358,392.09	1.39
13	000039	中集集团	50,665,822.21	1.37
14	600991	广汽长丰	49,256,185.04	1.33
15	600858	银座股份	48,360,576.46	1.30
16	600409	三友化工	47,508,331.66	1.28
17	002344	海宁皮城	45,717,790.70	1.23
18	600688	S上石化	44,880,311.49	1.21
19	000059	辽通化工	44,783,990.11	1.21
20	600887	伊利股份	44,281,594.67	1.19

注:卖出金额按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.3买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	2,879,716,389.52
卖出股票收入(成交)总额	2,942,673,091.39

注:“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	50,205,000.00	1.84
2	央行票据	129,693,000.00	4.75
3	金融债券	373,374,000.00	13.67
	其中:政策性金融债	373,374,000.00	13.67
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	553,272,000.00	20.26

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110414	11农发14	1,800,000	180,558,000.00	6.61
2	070419	07农发19	1,400,000	142,226,000.00	5.21
3	1101032	11央行票据32	1,000,000	100,710,000.00	3.69
4	070211	07国开11	500,000	50,590,000.00	1.85
5	110018	11附息国债18	500,000	50,205,000.00	1.84

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.2 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。

8.9.3期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,353,913.63
2	应收证券清算款	2,286,880.89
3	应收股利	-
4	应收利息	7,580,837.35
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,221,631.87

8.9.4期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.9.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

| 持有人户数(户) | 户均持有的基