科瑞证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30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
报告送出日期:二〇一三年十月二十五日

§1 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。

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2013年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	3,000,000,000份
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
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	124,357,464.88
2.本期利润	420,934,767.77
3.加权平均基金份额本期利润	0.1403
4.期末基金资产净值	3,426,632,230.94
5.期末基金份额净值	1.1422

注:1.所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 本报告期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

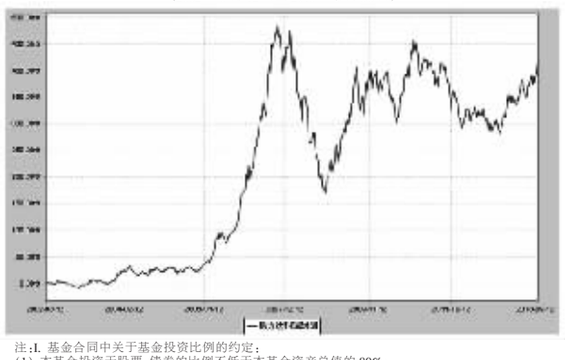
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	14.00%	2.11%	-	-	-	-

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

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

(2002年3月12日至2013年9月30日)



注:I. 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。

II. 本基金基金合同未规定业绩比较基准。

III.本基金自基金合同生效至报告期末的基金份额净值增长率为415.19%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
郑希	本基金的基金经理	2012-9-28	-	7年	硕士研究生,曾任易方达基金管理有限公司研究部行业研究员、基金经理助理兼行业研究员、基金投资部基金经理助理。

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 公平交易专项说明

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,以及强化事后监控分析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。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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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 公平交易专项说明

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,以及强化事后监控分析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。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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共有1次,为纯被动指数基金因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年第三季度,上证指数上涨了9.88%。市场结构继续出现分化,传媒、计算机、软件、互联网等行业涨幅居前,而地产、建材等传统周期行业继续走弱。

本基金近年的投资思路相对连贯:坚信在漫长的转型期,战略新兴产业、泛消费行业将是近年牛股的主要产地。2013年三季度本基金的操作,也基本服从于上述判断。

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1.1422元,本报告期份额净值增长率为14.00%。

4.4.3 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2013年4季度,经济数据大幅波动概率不高,同时通胀水平可控,考虑到市场中主流蓝筹价值股和成长股目前的估值水平,市场进一步大幅下跌的概率不大,但一线成长龙头再大幅上涨概率也不大,市场应在与经济改革相关的结构性机会。

基于以上判断,本基金将降低4季度收益率预期,立足中长期盈利成长性和稳定性的原则构建组合。维持以竞争优势明显、估值合理的蓝筹成长公司为核心持仓结构,保持组合的流动性和稳定性,并在中小市值股票中寻找能超越周期的个股。由于整体中小盘的估值溢价明显,精选真正成长股至关重要,将逐步增加对中小市值成长股的配置集中度。同时会考虑在流动性安全的前提下,适当参与有中长期预期的主题性投资机会。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,626,112,951.06	76.22
	其中:股票	2,626,112,951.06	76.22
2	固定收益投资	715,488,173.02	20.77
	其中:债券	715,488,173.02	20.77
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	48,000,192.00	1.39
	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	46,873,569.03	1.36
6	其他各项资产	9,013,744.53	0.26
7	合计	3,445,488,629.64	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	18,674,507.50	0.54
B	采矿业	11,100,000.00	0.32
C	制造业	1,735,622,367.66	50.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,735,188.56	0.08
E	建筑业	14,280,000.00	0.42
F	批发和零售业	94,359,136.01	2.75
G	交通运输、仓储和邮政业	5,175,570.40	0.15
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	207,590,035.80	6.06
J	金融业	85,287,900.00	2.49
K	房地产业	113,746,200.00	3.32
L	租赁和商务服务业	161,957,785.14	4.73
M	科学研究和技术服务业	3,696,000.00	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	34,733,000.00	1.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	12,784,783.45	0.37
R	文化、体育和娱乐业	124,370,476.54	3.63
S	综合	-	-
	合计	2,626,112,951.06	76.64

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600887	伊利股份	2,875,312	128,468,940.16	3.75
2	600587	新华医疗	1,750,000	106,015,000.00	3.09
3	002236	大华股份	2,045,926	93,253,307.08	2.72
4	002241	歌尔声学	2,032,920	85,951,857.60	2.51
5	002415	海康威视	3,150,289	83,167,629.60	2.43
6	600340	华夏幸福	2,490,000	80,875,200.00	2.36
7	000651	格力电器	2,912,270	77,349,891.20	2.26
8	300058	蓝色光标	1,188,000	74,778,000.00	2.18
9	000538	云南白药	631,940	73,974,896.40	2.16
10	300253	卫宁软件	1,050,000	61,498,500.00	1.79

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	128,671,000.00	3.76
2	央行票据	100,080,000.00	2.92
3	金融债券	484,990,000.00	14.15
	其中:政策性金融债	484,990,000.00	14.15
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,747,173.02	0.05
8	其他	-	-
9	合计	715,488,173.02	20.88

5.5 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130218	13国开18	2,900,000	288,057,000.00	8.41
2	1101032	11央行票据32	1,000,000	100,080,000.00	2.92
3	130017	13附息国债17	900,000	89,955,000.00	2.63
4	130308	13进出08	500,000	49,630,000.00	1.45
5	120414	12农发14	500,000	48,900,000.00	1.43

5.6 报告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。

5.7 报告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。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	541,134.21
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,472,610.32
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,013,744.53

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110022	同仁转债	574,695.00	0.02

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300058	蓝色光标	8,582,000.00	0.25	非公开发行流通受限

§6 基金管理人运用固有资金投资本封闭式基金情况

单位:份

报告期期初管理人持有的封闭式基金份额	219,110,562
报告期期间买入总份额	-
报告期期间卖出总份额	-
报告期期末管理人持有的封闭式基金份额	219,110,562
报告期期末持有的封闭式基金份额占基金总份额比例(%)	7.30

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金买卖本基金份额。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1.中国证券监督管理委员会《关于同意科瑞证券投资基金设立的批复》(证监基金字[2001]50号文);

2.《科瑞证券投资基金基金合同》;

3.《科瑞证券投资基金托管协议》;

4.基金管理人业务资格批件和营业执照;

5.基金托管人业务资格批件和营业执照。

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

8.3 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
二〇一三年十月二十五日

易方达科翔股票型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30日

基金管理人:易方达基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年十月二十五日

§1 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达科翔股票
基金主代码	110013
交易代码	110013
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年11月13日
报告期末基金份额总额	254,967,993.85份
投资目标	本基金主要投资于红利股,追求在有效控制风险的前提下,实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金基于定量与定性相结合的宏观及市场分析,确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例,追求更高收益,回避市场风险。
业绩比较基准	80%×中证红利指数收益率+中债总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为股票型基金,理论上其风险收益水平高于混合型基金、债券基金和货币市场基金。
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	11,831,562.66
2.本期利润	54,273,881.91
3.加权平均基金份额本期利润	0.2109
4.期末基金资产净值	360,601,814.98
5.期末基金份额净值	1.414

注:1.所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 本报告期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

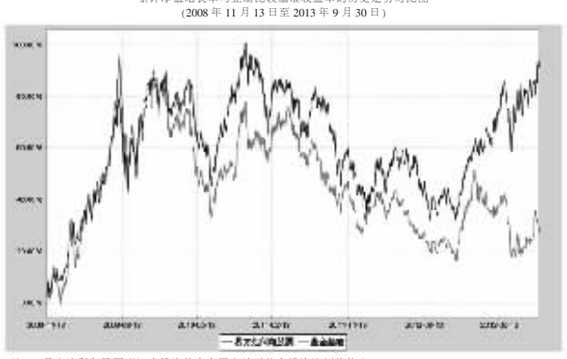
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	17.44%	1.39%	6.26%	1.24%	11.18%	0.15%

3.2.2 自基金转型以来基金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

易方达科翔股票型证券投资基金

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

(2008年11月13日至2013年9月30日)



注:1. 易方达科翔股票型证券投资基金合同中关于基金投资比例的约定:

(1)股票资产占基金资产的60%--95%;基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%;本基金投资红利股的资产不低于股票资产的80%;

(2)本基金持有一家上市公司的股票,其市值不得超过基金资产净值的10%;

(3)本基金与由基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券,不得超过该证券的10%;

(4)本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;

(5)本基金在任何交易日买入权证的总金额,不超过上一交易日基金资产净值的0.5%,基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%,基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%,法律法规或中国证监会另有规定的,遵从其规定;

(6)基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不得超过本基金的总资产,所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

(7)相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

如法律法规或监管部门取消上述限制性规定,履行适当程序后,本基金不受上述规定的限制。

由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内,但基金管理人应在10个交易日内进行调整,以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

2.本基金的建仓期为三个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.本基金自基金转型后至报告期末的基金份额净值增长率为95.34%,同期业绩比较基准收益率为28.64%。

4.本基金由原基金科翔于2008年11月13日转型而来。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	2011-1-1	-	16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、易方达策略成长证券投资基金的基金经理、科瑞证券投资基金的基金经理。

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 公平交易专项说明

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,以及强化事后监控分析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。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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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 公平交易专项说明

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,以及强化事后监控分析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。本报告期内,公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共有1次,为纯被动指数基金因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

进入2013年第三季度,内地经济触底回升迹象明显,经济内生增长动力在起主要作用。

三季度,发电量数据增速回升,社会融资总量稳定增长、货物运输量增速也有所回升,季度末,PPI环比开始转正、同比跌幅收窄,CPI增速控制在3%以内。从这些情况看起来,宏观经济进入让投资者比较舒服的局面。

二季度末的钱荒事件让货币主管当局和金融机构都吸取了教训,三季度的月末和季度末,没有再出现钱荒情况。

三季度宏观经济的表现,让投资者一定程度上恢复了市场信心,整个季度沪深300指数上涨9%,而创业板指数大涨35%。创业板股票累计涨幅巨大、估值过高,未来走势不确定性增强。

国际经济方面,各国经济运行平稳,没有大的经济事件发生,美国政府又面临提高债务上限的问题,但资本市场没有受到大的影响。

基金科翔在三季度降低了地产产业链股票的配置,加大了医药、消费和新兴行业的配置,取得了较好的效果。

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1.414元,本报告期份额净值增长率为17.44%,同期业绩比较基准收益率为6.26%。

4.4.3 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2013年四季度,我们对市场看法略微谨慎。一是因为四季度宏观经济的走势较难把握;二是担心投资者对政策的预期过高;三是很多中小市值股票的估值较高、涨幅较大,存在回调压力;四是渐行渐近的IPO重启会给市场带来压力。但是,市场结构性的机会总是存在,这对于信奉基本面投资的机构来说是有利的。本基金也将加大研究力度,争取更多地捕捉结构分化的机会,在遵守基金契约的前提下,尽量提高持有人的收益水平。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	317,867,342.61	87.10
	其中:股票	317,867,342.61	87.10
2	固定收益投资	24,935,500.00	6.83
	其中:债券	24,935,500.00	6.83
	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	18,911,421.48	5.18
6	其他各项资产	3,227,855.19	0.88
7	合计	364,942,119.28	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	266,958,615.94	74.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	9,289,240.00	2.58
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,687,180.92	1.30
J	金融业	-	-
K	房地产业	9,744,000.00	2.70
L	租赁和商务服务业	20,441,647.00	5.67
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	6,746,658.75	1.87
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	317,867,342.61	88.15

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000538	云南白药	250,000	29,265,000.00	8.12
2	600887	伊利股份	654,669	29,250,610.92	8.11
3	002236	大华股份	619,940	28,256,865.20	7.84
4	002415	海康威视	1,038,786	27,423,950.40	7.61
5	002241	歌尔声学	392,984	16,615,363.52	4.61
6	300228	富瑞特装	189,659	14,715,641.81	4.08
7	300058	蓝色光标	191,741	12,846,647.00	3.56
8	000895	双汇发展	249,881	11,606,972.45	3.22
9	600600	青岛啤酒	242,418	10,387,611.30	2.88
10	600340	华夏幸福	300,000	9,744,000.00	2.70

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	14,947,500.00	4.15
	其中:政策性金融债	14,947,500.00	4.15
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	9,988,000.00	2.77
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	24,935,500.00	6.91

5.5 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	041356003	13铁道CP001	100,000	9,988,000.00	2.77
2	120419	12农发19	100,000	9,981,000.00	2.77
3	130218	13国开18	50,000	4,966,500.00	1.38

注:本基金本报告期末仅持有以上债券。

5.6 报告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。

5.7 报告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。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	268,322.48
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	512,153.07
5	应收申购款	2,447,379.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,227,855.19

5.10.4 报告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。

5.10.5 报告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的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	261,263,832.52
本报告期基金总申购份额	17,305,799.41
减:本报告期基金总赎回份额	23,601,638.08
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	254,967,993.85

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回本基金份额。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1. 中国证监会《关于核准科翔证券投资基金基金份额持有人大会有关转换基金运作方式决议的批复》(证监许可[2008]1221号);

2.《易方达科翔股票型证券投资基金基金合同》;

3.《易方达科翔股票型证券投资基金托管协议》;

4. 中国证监会《关于同意科汇、科讯、科翔证券投资基金上市、扩募和续期的批复》(证监基金字[2001]11号文);

5.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》;

6.基金管理人业务资格批件和营业执照;

7.基金托管人业务资格批件和营业执照。

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

8.3 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
二〇一三年十月二十五日

易方达科讯股票型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30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
报告送出日期:二〇一三年十月二十五日

§1 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。

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2013年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达科讯股票
基金主代码	110029
交易代码	110029
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年12月18日
报告期末基金份额总额	7,038,489,209.04份
投资目标	根据市场环境变化,综合运用多种投资策略,追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金综合运用多种投资策略,把握多种投资机会,股票投资策略方面,一般情况下以优势企业策略和成长策略为主,辅以行业周期策略、绝对价值策略、突发事件/收购兼并策略以及新兴技术策略。在特定的市场情况下,后四种策略中一种或多种的资金容量较大、不确定性较小、收益期较高时,也可成为主策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中债总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是主动股票型基金,理论上其风险收益水平高于混合型基金和债券基金。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	406,915,633.90
2.本期利润	1,136,926,345.23
3.加权平均基金份额本期利润	0.1613
4.期末基金资产净值	6,481,612,484.91
5.期末基金份额净值	0.9209

注:1.所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