易方达科翔股票型证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6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:二〇一四年七月二十一日

§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2014年7月16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2014年4月1日起至6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	433,864,171.51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(2014年4月1日-2014年6月30日)
1.本期已实现收益	-1,645,138.49
2.本期利润	24,212,211.34
3.加权平均基金份额本期利润	0.0852
4.期末基金资产净值	536,802,053.78
5.期末基金份额净值	1.237

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.本基金已于2008年12月12日对原基金科翔退市时的基金份额进行了拆分,基金拆分比例为1:1.340278796。

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

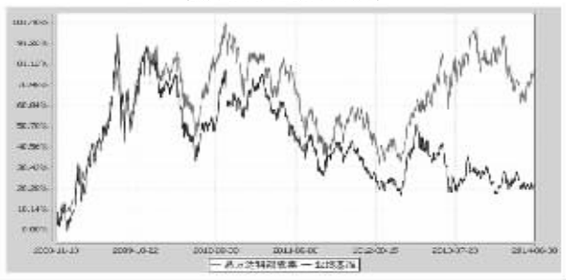
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.45%	0.88%	0.09%	0.76%	6.36%	0.12%

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2014年6月30日)



注:1.按基金合同和招募说明书的约定,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(第十一部分二、投资范围、四、投资策略和五、投资限制)的有关约定。

2.本基金由原基金科翔于2008年11月13日转型而来。

3.自基金转型至报告期末,基金份额净值增长率为78.93%,同期业绩比较基准收益率为22.52%。

§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	2011-01-01	2014-05-10	17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。
陈皓	本基金的基金经理、易方达平稳增长证券投资基金的基金经理	2014-05-10	-	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,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4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

2014年第二季度A股市场整体呈现震荡格局,各类指数有一定幅度分化,尤其体现在新兴成长与传统成长之间的分化,2季度沪深300指数上涨0.88%,上证指数上涨0.74%,中小盘指数上涨4.35%,但同时创业板指数上涨5.79%,而创业板综指上涨11.27%。

年初以来的大小盘风格分化进一步演化,创业板指数显著跑赢中小盘指数和沪深300指数。

分析原因:

(1)从宏观经济层面看,宏观经济较弱,人民币汇率出现波动,整体人民币计价的大类资产吸引力不大;

(2)从政策层面看,新政府反腐力度明显加大,对国产化的需求也明显上升,但改革过程将是一个艰难的系统工程,传统行业所面临的盈利不确定性加大。

(3)从微观行业以及企业层面看,传统监筹成长类行业盈利增速有一定程度放缓,例如传媒、电子、安防、消费品、医药等行业增速均出现不同程度低于预期。新兴行业中互联网、软件信息化、新能源汽车等行业趋势向好。

(4)创业板综指与创业板指数之间出现明显分化,小权重小市值创业板出现系统性机会,大幅超越权重成长股。

本基金在二季度基本保持较高仓位,进一步调整了成长股的配置结构,增加了医疗服务、互联网、智慧城市等新兴产业的投资品种占比,降低了电子、安防等行业占比,由于之前传统成长类资产配置比例较重,导致净值受到一定损失。

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1.0656元,本报告期份额净值增长率为0.85%。

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2014年3季度,宏观经济预计依然偏弱,同时考虑到资金成本正处于明显下降通道之中,同时股票类资产整体估值水平较低,预期市场较为活跃,存在结构性机会。市场依然存在与经济改革相关的主题性机会以及新兴成长的中期机会。

基于以上判断,本基金将保持仓位稳定,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。由于整体成长股更新换代趋势明显,本基金将加大对新兴成长股的配置比例。

§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	386,883,897.61	68.49
	其中:股票	386,883,897.61	68.49
2	固定收益投资	25,047,000.00	4.43
	其中:债券	25,047,000.00	4.43
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	118,014,459.01	20.89
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	33,864,529.90	5.99
7	其他资产	1,087,521.96	0.19
8	合计	564,897,408.48	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	2,853,514.95	0.53
B	采矿业	1,390,400.00	0.26
C	制造业	260,883,761.94	48.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,726,821.46	2.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	14,580,000.00	2.72
G	交通运输、仓储和邮政业	2,037,044.03	0.38
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	83,126,214.43	15.49
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	8,520,740.80	1.59
N	水利、环境和公共设施管理业	2,126,400.00	0.40
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	639,000.00	0.12
S	综合	-	-
	合计	386,883,897.61	72.07

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	300238	冠昊生物	539,804	27,454,431.44	5.11
2	600967	北方创业	2,184,354	27,413,642.70	5.11
3	300170	汉得信息	1,977,918	25,515,142.20	4.75
4	600867	通化东宝	1,795,968	23,401,463.04	4.36
5	600887	伊利股份	600,000	19,872,000.00	3.70
6	600351	亚宝药业	1,603,171	14,749,173.20	2.75
7	000963	华东医药	270,000	14,580,000.00	2.72
8	300253	卫宁软件	319,250	14,021,460.00	2.61
9	300207	欣旺达	423,042	12,352,826.40	2.30
10	300003	乐普医疗	539,999	11,285,979.10	2.10

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	25,047,000.00	4.67
	其中:政策性金融债	25,047,000.00	4.67
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	25,047,000.00	4.67

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	140410	14农发10	150,000	15,045,000.00	2.80
2	130236	13国开36	100,000	10,002,000.00	1.86

5.6 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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	295,456.96
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	644,085.82
5	应收申购款	147,979.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,087,521.96

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 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	300253	卫宁软件	14,021,460.00	2.61	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	262,423,401.65
报告期基金总申购份额	186,411,986.70
减:报告期基金总赎回份额	14,971,216.84
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	433,864,171.51

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	47,973,806.65
报告期期间买入/申购总份额	181,667,217.18
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	229,641,023.83
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	52.93

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2014-06-17	181,667,217.18	219,999,000.00	-
合计			181,667,217.18	219,999,000.00	

注:按照基金合同及更新的招募说明书的有关规定,每笔申购费用为1000元。

§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
二〇一四年七月二十一日

易方达科讯股票型证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6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:二〇一四年七月二十一日

§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2014年7月16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2014年4月1日起至6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	6,850,554,704.63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、收益预期较高时,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(2014年4月1日-2014年6月30日)
1.本期已实现收益	-32,292,201.51
2.本期利润	230,884,679.41
3.加权平均基金份额本期利润	0.0341
4.期末基金资产净值	6,208,008,704.60
5.期末基金份额净值	0.9062

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.本基金已于2008年1月4日对原基金科讯退市时的基金份额进行了拆分,基金拆分比例为1:2.825206742。

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	3.84%	1.37%	1.22%	0.70%	2.62%	0.67%

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

易方达科讯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

(2007年12月18日至2014年6月30日)

注:1.按基金合同和招募说明书的约定,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(第十五部分(二)投资范围、(四)投资策略和(七)投资禁止行为与限制)的有关约定。

2.本基金由原基金科讯于2007年12月18日转型而来。

3.自基金转型至报告期末,基金份额净值增长率为4.78%,同期业绩比较基准收益率为-43.15%。

§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		
宋昆	本基金的基金经理、易方达新兴成长混合型证券投资基金的基金经理	2010-09-11	-	8年	硕士研究生,曾任易方达基金管理有限公司行业研究员、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,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4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

2014年第二季度,上证指数小幅上涨了0.74%。从结构上看,一季度表现良好、涨幅较大的计算机、软件、医疗、互联网等新兴产业板块个股在IPO开启等系列利空之下进行了大幅的调整。

本基金延续了一贯的投资思路,坚信在漫长的转型期,泛消费行业、战略新兴产业将是近年牛股的主要产地。2014年二季度本基金的操作,基本契合上述思路。

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0.9062元,本报告期份额净值增长率为3.84%,同期业绩比较基准收益率为1.22%。

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2014年第三季度,我们持相对谨慎的态度。

宏观经济层面,短期来看5.6两个月出口、政府投资略有回升,消费相对平稳。从中期来看结构调整带来的金融、地产等不确定性持续存在。从长期来看,改革和新技术有望提升中国经济的活力,但是经济增速中枢下滑依然不可避免。

资金面方面,二季度资金价格明显下滑,央行保持国内流动性相对宽松的意图有所显现。美国就业数据的良好表现使得QE退出预期增强,将给全球的流动性带来一定的压力。

政策层面,由于短期经济的下滑,政府将主要精力放在稳增长上,但是预计力度不会太大。同时稳增长将在调结构的指导思想下进行,政策刺激将更加符合经济转型的大方向。

基于上述判断,我们对整体市场走势持相对谨慎的态度。

随着全人类走进移动互联、云计算时代,机器人为代表的人工智能将在制造业中承担举足轻重的作用。从繁重的生产中解放出来的人类,对于自身的需求必将更加重视,娱乐、医疗、环保、教育产业必将迎来黄金发展时期。我们已经看到,在线教育、基因测序、干细胞治疗等板块已经成为整个资本市场的风向标,这些细分行业龙头公司的存在和发展,就是我们对市场相对乐观之处。寻找并买入、持有这些企业,也将是我们工作的重中之重。

债券投资方面,由于通胀处于低位,尚不会成为压制债市的力量,债券市场将有一定的收益机会,将继续采取稳健的投资思路。

最后,衷心感谢持有人对本基金的信任和支持,我们将努力工作,力争回报大家的信任。

§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	5,674,254,808.25	90.46
	其中:股票	5,674,254,808.25	90.46
2	固定收益投资	318,620,087.60	5.08
	其中:债券	318,620,087.60	5.08
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	249,136,431.89	3.97
7	其他资产	30,608,067.31	0.49
8	合计	6,272,619,395.05	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	13,811,228.16	0.22
B	采矿业	427,884,000.00	6.89
C	制造业	2,886,490,709.58	46.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,990,000.00	0.03
E	建筑业	4,308,115.20	0.07
F	批发和零售业	5,799,500.00	0.09
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	1,580,305,612.65	25.46
J	金融业	3,413,329.92	0.05
K	房地产业	5,750,373.43	0.09
L	租赁和商务服务业	610,691,600.00	9.84
M	科学研究和技术服务业	27,871,600.00	0.45
N	水利、环境和公共设施管理业	17,930,606.40	0.29
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	86,110,132.91	1.39
R	文化、体育和娱乐业	1,196,000.00	0.02
S	综合	702,000.00	0.01
	合计	5,674,254,808.25	91.40

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	002400	省广股份	22,770,000	559,686,600.00	9.02
2	300017	网宿科技	8,006,171	510,793,709.80	8.23
3	300315	掌趣科技	26,730,000	456,916,900.00	7.36
4	600583	海油工程	58,800,000	427,884,000.00	6.89
5	000049	德赛电池	9,843,000	395,393,310.00	6.37
6	300228	富瑞特装	6,399,300	327,388,188.00	5.27
7	002065	东华软件	13,730,000	276,247,600.00	4.45
8	002456	欧菲光	11,600,000	248,588,000.00	4.00
9	601012	隆基股份	16,000,000	248,000,000.00	3.99
10	300273	和佳股份	7,569,723	232,390,496.10	3.74

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	280,393,000.00	4.52
	其中:政策性金融债	280,393,000.00	4.52
4	企业债券	36,852,240.00	0.59
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,374,847.60	0.02
8	其他	-	-
9	合计	318,620,087.60	5.13

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	130243	13国开43	1,800,000	180,198,000.00	2.90
2	140429	14农发29	500,000	50,185,000.00	0.81
3	130236	13国开36	500,000	50,010,000.00	0.81
4	112118	12金控01	379,920	36,852,240.00	0.59
5	110022	同仁转债	12,020	1,374,847.60	0.02

5.6 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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,278,524.82
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,051,794.94
5	应收申购款	20,277,747.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,608,067.31

5.11.4 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	1,374,847.60	0.02

5.11.5 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	601012	隆基股份	248,000,000.00	3.99	重大事项停牌
2	600583	海油工程	162,564,000.00	2.62	非公开发行流通受限
3	300315	掌趣科技	63,996,900.00	1.03	非公开发行流通受限

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	7,011,134,850.48
报告期基金总申购份额	448,808,837.11
减:报告期基金总赎回份额	609,388,982.96
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	6,850,554,704.63

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	72,448,816.90
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	72,448,816.90
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.06

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1.中国证监会《关于核准科讯证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》(证监基金字[2007]330号);

2.《易方达科讯股票型证券投资基金基金合同》;

3.《易方达科讯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
二〇一四年七月二十一日

科瑞证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6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:二〇一四年七月二十一日

§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2014年7月16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2014年4月1日起至6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	3,000,000,000.00份
投资目标	主要投资于价值被市场绝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(2014年4月1日-2014年6月30日)
1.本期已实现收益	-68,028,479.85
2.本期利润	26,975,193.50
3.加权平均基金份额本期利润	0.0090
4.期末基金资产净值	3,196,652,800.41
5.期末基金份额净值	1.0656

注:1.所述基金业绩指标不包括持有人交