

科瑞证券投资基金

【2015】第二季度报告

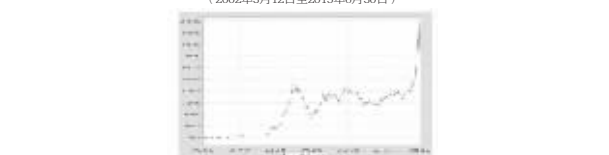
基金管理人:易方达基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年七月二十日

§1 重要提示
基金管理人、基金托管人及基金销售机构在本报告中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2015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预示其未来表现,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。
本报告自2015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
基金代码	509056
交易代码	509056
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低估或相对低估的股票,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	基金管理人将对宏观经济和产业发展趋势进行深入的分析和研究,进行资产配置,在股票、债券和现金资产的配置,当期股票趋势向好时,基金管理人采取积极进攻的投资方式,加大股票投资比例,降低债券投资,现金比例,力求取得较好的资本增值收益;当期股票市场走势趋好时,则降低股票投资比例,加大债券投资和现金比例,避免股票仓位大幅下移对净值引起的资产损失。 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	本基金属于股票型基金,风险收益特征较高。
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	
单位:人民币元	
主要财务指标	报告期(2015年4月1日-2015年6月30日)
1.本期已实现收益	1,243,371,299.80
2.本期利润	691,920,874.28
3.加权平均基金份额本期利润	0.2306
4.期末基金资产净值	5,293,512,117.77
5.期末基金份额净值	1.7645

注:1.本基金基金业绩指标不包括持有人认购或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,本期利润为本基金已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3.2.1本报告期末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
3.2.2自基金合同生效以来本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2015年6月30日)



注:1.本基金基金合同未约定业绩比较基准。
2.自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为746.00%。

§4 管理人报告	
4.1 基金管理人(或基金经小组)简介	
姓名	职务
周希	本基金的基金经理,易方达科瑞证券投资基金的基金经理
任本基金的基金经理期限	2012-09-28
离任日期	-
证券从业年限	9年
说明	硕士研究生,曾任易方达基金管理有限公司研究员,基金助理助理,基金研究员,基金经理助理,基金经理,基金投资,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.基金从业年限指从事证券行业(证券投资基金行业)资格管理办法)的相关规定。
4.2 管理人对报告期内基金运作遵信情况的说明
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,取信于社会公众及为宗旨,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的利益的行为。
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。本基金管理人制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,并建立及时执行公平交易措施,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超过该证券当日成交量的5%的交易共有2次,其中1次为指数组合投资股票需和其他组合发生的反向交易;1次为不同基金管理人管理的非指数组合投资股票发生的反向交易,有关基金投资组合均履行了审批程序。
本报告期内,未发生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报告期内基金的投资策略和运作分析
截至报告期末,本基金资产净值为5,293,512,117.77元,本报告期间净值增长率为15.02%。
4.4.2报告期内,本基金投资策略执行情况
本基金管理人主要遵循纪律、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。本基金管理人制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,并建立及时执行公平交易措施,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。
4.4.3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超过该证券当日成交量的5%的交易共有2次,其中1次为指数组合投资股票需和其他组合发生的反向交易;1次为不同基金管理人管理的非指数组合投资股票发生的反向交易,有关基金投资组合均履行了审批程序。
本报告期内,未发生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报告期内基金的投资策略和运作分析
截至报告期末,本基金资产净值为5,293,512,117.77元,本报告期间净值增长率为15.02%。
4.4.2报告期内,本基金投资策略执行情况
本基金管理人主要遵循纪律、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。本基金管理人制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,并建立及时执行公平交易措施,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。
4.4.3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超过该证券当日成交量的5%的交易共有2次,其中1次为指数组合投资股票需和其他组合发生的反向交易;1次为不同基金管理人管理的非指数组合投资股票发生的反向交易,有关基金投资组合均履行了审批程序。
本报告期内,未发生本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

§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
1	权益投资
2	固定收益投资
3	金融衍生品投资
4	买入返售金融资产
5	其他资产
6	合计

注:1.本基金基金合同未约定业绩比较基准。
2.自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为746.00%。

§6 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	
序号	项目
1	权益投资
2	固定收益投资
3	金融衍生品投资
4	买入返售金融资产
5	其他资产
6	合计

注:1.本基金基金合同未约定业绩比较基准。
2.自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为746.00%。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	
序号	项目
1	权益投资
2	固定收益投资
3	金融衍生品投资
4	买入返售金融资产
5	其他资产
6	合计

注:1.本基金基金合同未约定业绩比较基准。
2.自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为746.00%。

§8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	
序号	项目
1	权益投资
2	固定收益投资
3	金融衍生品投资
4	买入返售金融资产
5	其他资产
6	合计

注:1.本基金基金合同未约定业绩比较基准。
2.自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为746.00%。

§9 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	
序号	项目
1	权益投资
2	固定收益投资
3	金融衍生品投资
4	买入返售金融资产
5	其他资产
6	合计

注:1.本基金基金合同未约定业绩比较基准。
2.自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为746.00%。

§10 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	
序号	项目
1	权益投资
2	固定收益投资
3	金融衍生品投资
4	买入返售金融资产
5	其他资产
6	合计

注:1.本基金基金合同未约定业绩比较基准。
2.自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为746.00%。

§11 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	
序号	项目
1	权益投资
2	固定收益投资
3	金融衍生品投资
4	买入返售金融资产
5	其他资产
6	合计

注:1.本基金基金合同未约定业绩比较基准。
2.自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为746.00%。

§12 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	
序号	项目
1	权益投资
2	固定收益投资
3	金融衍生品投资
4	买入返售金融资产
5	其他资产
6	合计

注:1.本基金基金合同未约定业绩比较基准。
2.自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为746.00%。

§13 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	
序号	项目
1	权益投资
2	固定收益投资
3	金融衍生品投资
4	买入返售金融资产
5	其他资产
6	合计

注:1.本基金基金合同未约定业绩比较基准。
2.自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为746.00%。

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	1,914,532,533.48	36.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,423,200.00	0.25
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	125,671,771.34	2.37
G	交通运输、仓储和邮政业	2,790,317.71	0.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,486,025,730.06	28.07
J	金融业	79,520,000.00	1.50
K	房地产业	45,784,712.64	0.86
L	租赁和商务服务业	36,782,000.00	0.69
M	科学研究和技术服务业	90,560,600.00	1.71
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	41,970,000.00	0.79
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		3,837,060,866.13	72.49

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	300199	顺丰药业	11,200,000	362,096,000.00	6.84
2	300253	卫宁软件	2,800,000	145,600,000.00	2.75
3	600651	飞乐音响	6,370,000	131,030,000.00	2.48
4	300075	数字政通	3,363,357	126,764,925.33	2.39
5	600446	金证股份	1,021,600	126,120,736.00	2.38
6	002260	伊立浦	2,982,796	121,369,969.24	2.29
7	600571	信维达	1,092,100	115,598,785.00	2.18
8	600570	恒生电子	984,900	110,338,045.00	2.08
9	300168	万达信息	2,201,700	108,147,594.00	2.04
10	000222	科华生物	2,300,000	98,118,000.00	1.85

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	2,220,712.00	0.04
2	央行票据	—	—
3	金融债券	1,415,809,649.80	26.75
	其中:政策性金融债	1,415,809,649.80	26.75
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	1,418,030,361.80	26.79

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	150207	15国开07	3,100.00	315,084,000.00	5.95
2	140208	14国开08	1,600.00	164,624,000.00	3.11
3	140201	14国开01	1,100.00	113,696,000.00	2.15
4	150202	15国开02	1,100.00	110,594,000.00	2.09
5	140311	14进汇11	1,000.00	101,380,000.00	1.92

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过被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到严重、公开的谴责。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	
序号	项目
1	权益投资
2	固定收益投资
3	金融衍生品投资
4	买入返售金融资产
5	其他资产
6	合计

§8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	
序号	项目
1	权益投资
2	固定收益投资
3	金融衍生品投资
4	买入返售金融资产
5	其他资产
6	合计

§9 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	
序号	项目
1	权益投资
2	固定收益投资
3	金融衍生品投资
4	买入返售金融资产
5	其他资产
6	合计

§10 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	
序号	项目
1	权益投资
2	固定收益投资
3	金融衍生品投资
4	买入返售金融资产
5	其他资产
6	合计

§11 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	
序号	项目
1	权益投资
2	固定收益投资
3	金融衍生品投资
4	买入返售金融资产
5	其他资产
6	合计

§12 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	
序号	项目
1	权益投资
2	固定收益投资
3	金融衍生品投资
4	买入返售金融资产
5	其他资产
6	合计

§13 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	
序号	项目
1	权益投资
2	固定收益投资
3	金融衍生品投资
4	买入返售金融资产
5	其他资产
6	合计

§14 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	
序号	项目
1	权益投资
2	固定收益投资
3	金融衍生品投资
4	买入返售金融资产
5	其他资产
6	合计

§15 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	
序号	项目
1	权益投资
2	固定收益投资
3	金融衍生品投资
4	买入返售金融资产
5	其他资产
6	合计

§16 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	
序号	项目
1	权益投资
2	固定收益投资
3	金融衍生品投资
4	买入返售金融资产
5	其他资产
6	合计

§17 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	
序号	项目
1	权益投资
2	固定收益投资
3	金融衍生品投资
4	买入返售金融资产
5	其他资产
6	合计

§18 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	
序号	项目
1	权益投资
2	固定收益投资
3	金融衍生品投资
4	买入返售金融资产
5	其他资产
6	合计

注:1.本基金基金合同未约定业绩比较基准。
2.自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为746.00%。

易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金(LOF)

【2015】第二季度报告

基金管理人:易方达基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年七月二十日

§1 重要提示
基金管理人、基金托管人及基金销售机构在本报告中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2015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预示其未来表现,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。
本报告自2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况	
基金简称	易方达中债新综合发起式(LOF)
场内简称	161119
基金代码	161119
基金运作方式	契约型,上市开放式(LOF),发起式
基金合同生效日	2012年11月8日
报告期末基金份额总额	77,567,154.34份
投资目标	本基金通过指数化投资,争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相近的投资回报,追求跟踪精度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为被动管理型指数基金,主要采用完全复制法和动态优化的方法,构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合,以实现对标的指数的有效跟踪。
业绩比较基准	中债-新综合指数
风险收益特征	本基金为债券指数基金,其预期风险和预期收益低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金。
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	易方达中债新综合发起式(LOF)A 易方达中债新综合发起式(LOF)C
下属分级基金的交易代码	161119 161120
报告期末下属分级基金的份额总额	39,774,204.72份 37,792,949.62份

3.1 主要财务指标