易方达深证100交易型开放式指数基金更新的招募说明书摘要

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

二〇〇九年五月

重要提示

本基金根据2006年2月15日中国证券监督管理委员会《关于核准易方达深证100交易型开放式指数基金募集申请的批复》(证监基金字[2006]20号)的核准,进行募集。本基金的基金合同于2006年3月24日正式生效。

基金管理人保证本《招募说明书》的内容真实、准确、完整。本《招募说明书》经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险,投资者投资于本基金前应认真阅读本《招募说明书》。基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据本基金的基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务;基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅本基金的基金合同。

基金管理人承诺恪尽职守,依照诚实信用、勤勉尽责的原则,谨慎、有效地管理和运用本基金财产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

本招募说明书已经本基金托管人复核。除非另有说明,本招募说明书所载内容截止日为2009年3月24日,有关财务数据截止日为2009年3月31日,净值表现截止日为2008年12月31日。财务数据未经审计。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

基金管理人:易方达基金管理有限公司

注册地址:广东省珠海市香洲区情侣路428号九洲港大厦4001室

办公地址:广州市体育西路189号城建大厦19、25、27、28楼

设立日期:2001年4月17日

法定代表人:梁棠

联系电话:400 881 8088

联系人:吴薇

注册资本:12,000万元人民币

股权结构:

股东名称	出资比例
广东粤财信托有限公司	1/4
广发证券股份有限公司	1/4
广东盈峰投资控股集团有限公司	1/4
广东省广晟资产经营有限公司	1/6
广州市广永国有资产经营有限公司	1/12
总　计	100%

(二)主要人员情况

1. 董事、监事及高级管理人员

梁棠先生,董事长,硕士,1958年生。历任广东省财政学校副校长,广东粤财实业发展公司总经理,广东粤财信托投资有限公司副总经理、总经理,广东粤财投资控股有限公司总经理。现任广东粤财投资控股有限公司董事长、易方达基金管理有限公司董事长。2008年1月,当选为政协广东省第十届委员会常委。

叶俊英先生,副董事长、总裁,博士,1963年生。历任中国南海石油联合服务总公司条法部科员、副科长、科长,广发证券有限责任公司投资银行部总经理、公司董事、副总裁,易方达基金管理有限公司董事、总裁。现任易方达基金管理有限公司副董事长、总裁。

李建勇先生,董事,博士,1957年生。曾任广发证券股份有限公司成都营业部总经理、投资银行部总经理、公司总裁助理、公司副总裁,现任广发证券股份有限公司总裁。

谢亮先生,董事,大学本科毕业,1963年生。曾任53011、53061部队财务部门助理员,广州军区生产管理部财务部门助理员、处长,现任广东省广晟资产经营有限公司总经理助理、计划财务部部长。

刘鹰先生,董事,硕士,1970年生。曾任广西信托投资公司深圳证券营业部部门经理,青海证券有限责任公司营业部、交易部经理,美的技术投资有限公司总经理,现任广东盈峰投资控股集团有限公司副总裁。

张优造先生,董事、副总裁,硕士,1964年生。曾任南方证券交易中心业务发展部经理,广东证券公司发行上市部经理、深圳证券业务部总经理、基金部总经理。现任易方达基金管理有限公司董事、副总裁兼营运总监。

佟志广先生,独立董事,1933年生。历任中国驻印度、缅甸大使馆商务处秘书,中国常驻联合国代表团秘书,中国驻美国联络处商务秘书,中国粮油食品进出口总公司副总经理,香港华润集团有限公司常务董事、副董事长、总经理。1991年2月任对外经济贸易部副部长,在担任副部长期间曾任中国“复关”首席谈判代表,中美贸易谈判代表团团长。1994年4月任中国进出口银行董事长、党组书记。曾被选为中华人民共和国第八、第九届全国人民代表大会常务委员会委员、外事委员会委员,中国—欧洲议会友好小组副主席。

项兵先生,独立董事,博士,1962年生。历任加拿大CALGARY大学副教授,香港科技大学讲师,中欧国际工商学院核心教授,北京大学教授、博士生导师、EMBA及高级管理培训部主任,现任长江商学院院长。

谢石松先生,独立董事,法学博士,1963年生。现任中山大学法学院教授、国际法研究所所长,兼任中国国际私法学会副会长,中国国际法学会、中国国际经济法学会理事,广东省律师高级专业资格评审委员会委员,武汉大学法学院、西北政法大学兼职教授,中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员及专家咨询委员会委员,以及上海、广州、深圳、厦门等仲裁委员会仲裁员。

陈国祥先生,监事会主席,硕士,1963年生。曾任交通银行广州分行江南西营业部经理,广东粤财信托投资公司证券部副总经理、基金部总经理,易方达基金管理有限公司总裁助理兼市场拓展部总经理、市场总监。现任易方达基金管理有限公司监事会主席。

刘少波先生,监事,1960年生,曾任暨南大学金融系系主任,现任暨南大学经济学院教授、博士生导师。

廖智先生,监事,硕士,1971年生。曾任广东证券股份有限公司基金部主管、易方达基金管理有限公司综合管理部副总经理、易方达基金管理有限公司人力资源部副总经理,现任易方达基金管理有限公司市场部总经理。

刘晓艳女士,副总裁兼市场总监,博士,1969年生。曾任广发证券有限责任公司投资理财部副经理、基金经理,基金投资理财部副总经理、基金资产管理部总经理,易方达基金管理有限公司督察员兼监察部总经理、总经理助理兼市场部总经理。现任易方达基金管理有限公司副总裁兼市场总监。

张南女士,督察长,博士,1970年生。曾任广东省经济贸易委员会主任科员、副处长,2001年10月加入易方达基金管理有限公司,曾任市场拓展部副总经理、督察长兼监察部总经理,现任易方达基金管理有限公司督察长。

2.基金经理小组介绍

林飞先生,男,1975年3月生,经济学博士。曾任融通基金管理有限公司基金经理助理。2006年3月进入易方达基金管理有限公司工作,曾任易方达深证100交易型开放式指数基金基金经理助理,现任易方达深证100交易型开放式指数基金基金经理(自2006年7月4日起)、易方达50指数基金基金经理(自2007年2月10日起)。

本基金历任基金经理情况:王守章先生,任职时间为2006年3月24日至2006年4月7日;马骏先生,任职时间为2006年3月24日至2007年12月31日。

3.投资决策委员会成员

投资决策委员会成员包括:总裁助理、基金投资总监兼基金投资部总经理陈志民先生、研究部总经理吴欣荣先生以及基金投资部副总经理潘峰先生。

陈志民先生,1971年生,法学硕士、公共管理硕士。曾任职于厦门国际信托投资公司、南方基金管理有限公司,在南方基金管理有限公司曾任研究员、基金经理助理、投资部副总经理(主管研究)。2000年12月开始参与易方达基金管理有限公司的筹建工作,公司成立后,曾任基金投资部副总经理、机构理财部总经理、基金科翔基金经理、基金科瑞基金经理、基金科汇基金经理、机构理财部投资经理,曾公派美国哥伦比亚大学国际关系学院学习,获公共管理硕士学位,并曾在美国Evergreen Investments基金管理公司国际股票投资部工作。现任易方达基金管理有限公司总裁助理、基金投资总监、基金投资部总经理、易方达积极成长基金基金经理。

吴欣荣先生,1975年生,工学硕士。2001年4月至今,在易方达基金管理有限公司工作,参与过公司筹建,曾任易方达基金管理有限公司研究员、科瑞基金基金经理、基金投资部副总经理、研究部副总经理。现任研究部总经理、易方达价值精选股票型证券投资基金基金经理。

潘峰先生,1974年生,理学博士。曾任易方达基金管理有限公司行业研究员、机构理财部投资经理、易方达平稳增长证券投资基金基金经理助理,现任基金投资部副总经理、易方达价值成长混合型证券投资基金基金经理。

4.上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

本基金之基金托管人为中国银行股份有限公司(简称“中国银行”),基本情况如下:

名称:中国银行股份有限公司(简称“中国银行”)

住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期:1983年10月31日

变更注册登记日期:2004年8月26日

注册资本:人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元

法定代表人:肖　钢

基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【1998】24号

托管及投资者服务部总经理:董杰

托管部门联系人:宁敏

电话:(010)66594977

传真:(010)66594942

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1.申购、赎回代办证券公司(以下排序不分先后)

(1)广发证券

注册地址:广州市天河北路183号大都会广场43楼

办公地址:广东广州天河北路大都会广场18、19、36、38、41和42楼

法定代表人:王志伟

联系人:肖中梅

开放式基金业务传真:(020)87555305

客户服务电话:95575

网址:www.gf.com.cn

(2)银河证券

注册地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人:肖时庆

联系人:李洋

客户服务电话:4008888888

网址:www.chinastock.com.cn

(3)国泰君安证券

注册地址:上海市浦东新区商城路618号

办公地址:上海市银城中路168号上海银行大厦15楼

法定代表人:祝幼一

联系人:芮敏祺

开放式基金咨询电话:021-38676161

传真:021-38670666

客户服务电话:4008888666

网址:www.gtja.com

(4)国信证券

注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

法人代表人:何如

开放式基金咨询电话:0755-82130833

开放式基金业务传真:0755-82133302

联系人:齐晓燕

客户服务电话:95536

网址:www.guosen.com.cn

(5)申银万国证券

注册地址:上海市常熟路171号

办公地址:上海市常熟路239号2楼

法定代表人:丁国荣

联系人:曹晔

电话:021-54033888

传真:021-54038844

客服电话:021-962505

网址:www.sw2000.com.cn

(6)招商证券

注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层

法定代表人:宫少林

电话:0755-82943666

传真:0755-82943636

联系人:黄健

客户服务热线:95565、4008888111

网址:www.newone.com.cn

(7)中信建投证券

注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址:北京市朝阳门内大街188号

法定代表人:张佑君

开放式基金咨询电话:4008888108

开放式基金业务传真:(010)65182261

网址:www.csc108.com

(8)华泰证券

注册地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

法定代表人:吴万善

开放式基金咨询电话:95597

开放式基金业务传真:025-84579763

联系人:张小波

网址:www.htsc.com.cn

(9)中信证券

注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦A层

办公地址:北京市朝阳区新源南路6号京城大厦3层

法定代表人:王东明

电话:010-84588888

传真:010-84865560

联系人:陈忠

网址:www.ecitic.com

(10)联合证券

注册地址:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦10、24、25层

办公地址:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦10、24、25层

法定代表人:马昭明

联系人:盛宗凌

电话:0755-82492000

开放式基金咨询电话:400-8888-555,0755-25125666

开放式基金业务传真:0755-82492962

网址:www.lhzq.com

(11)光大证券

注册地址:上海市静安区新闸路1508号

办公地址:上海市静安区新闸路1508号3楼

法定代表人:徐浩明

联系人:刘晨、李芳芳

电话:021-22169999

传真:021-22169134

客户服务电话:4008888788、10108998

网址:www.ebscn.com

(12)长江证券

住所:武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人:胡运钊

客户服务电话:4008-888-999或027-85808318

联系人:李良

电话:021-63219781

传真:021-51062920

网址:www.95579.com

(13)东方证券

注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层-29层

法定代表人:王益民

联系人:吴宇

电话:021-63325888

传真:021-63326173

客户服务电话:021-95503或40088-88506

网址:www.dfzq.com.cn

(14)国联证券

法定代表人:雷建辉

注册地址:无锡市县前东街168号

办公地址:无锡市县前东街168号

联系人:袁丽萍

开放式基金咨询电话:0510-82588168

开放式基金业务传真:0510-82830162

网址:www.gjsc.com.cn

(15)平安证券

注册地址:深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦

办公地址:深圳市八卦岭八卦三路平安大厦三楼(518029)

法定代表人:陈敬达

联系人:袁月、毛娟梅

客户服务电话:95511

开放式基金业务传真:0755-82433794

联系电话:0755-82450826

网址:www.pa18.com

(16)国元证券

注册地址:合肥市寿春路179号

办公地址:合肥市寿春路179号

法定代表人:凤良志

联系人:程维

开放式基金咨询电话:95578和400-8888-777

开放式基金业务传真:0551—2207935

网址:www.gyzq.com.cn

(17)中原证券

注册地址:许昌市南关大街38号

办公地址:郑州市经三路15号广汇国贸11楼

法定代表人:石保上

开放式基金咨询电话:0371-967218

开放式基金业务传真:0371-65585665

联系人:陈利民　程月艳

联系电话:0371-65585670

网址:www.ccnew.com或www.zyzq.cn

(18)南京证券

注册地址:江苏省南京市大钟亭8号

法人代表:张华东

联系电话:025-83367888-4101

联系人:胥春阳

传真:025-83320066

网址:www.njzq.com.cn

(19)中信万通证券

注册地址:青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层(1507-1510室)

办公地址:青岛市东海西路28号

法定代表人:史洁民

客户服务电话:0532-96577

联系人:丁韶燕

联系电话:0532-85022026

传真:0532-85022026

网址:www.zxwt.com.cn

(20)第一创业证券

注册地址:广东省深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层

办公地址:广东省深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层

法定代表人:刘学民

联系人:徐菁

电话:0755-25832848

客户服务电话:0755-25832583

网址:www.firstcapital.com.cn

(21)东海证券

注册地址:常州延陵西路59号常信大厦18楼

办公地址:上海市浦东区东方路989号中达广场17楼

法定代表人:朱科敏

联系人:程学军

电话:021-50586660-8853

传真:021-50586660-8881

网址:www.longone.com.cn

客户服务电话:021-52574550　0519-88166222　0379-64902266

免费服务热线:400-888-8588

(22)齐鲁证券

通讯地址:山东省济南市经十路128号

法定代表人:李玮

联系人:傅咏梅

联系电话:0531-81283938

传真电话:0531-81283735

客户服务电话:95538

邮政编码:250001

网址:www.qlzq.com.cn

(23)兴业证券

注册地址:福州市湖东路99号标力大厦

办公地址:浦东新区民生路1199弄证大·五道口广场1号楼21层

法定代表人:兰荣

业务联系人:谢高得

业务联系电话:021-38565785

客户服务电话:4008888123

网站:www.xyzq.com.cn

(24)上海证券

注册地址:上海市西藏中路336号

办公地址:上海市临平北路19号

法定代表人:蒋元真

联系电话:021 - 53519888

客户服务电话:021-962518

传真:021-65081069

联系人:刘永、方凌云

网址:www.962518.com

2.二级市场交易代办证券公司

投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金二级市场交易。

(二)登记结算机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司

地址:深圳市深南中路1093号中信大厦18楼

法定代表人:陈耀先

联系人:严峰

电话:(0755)25946013

传真:(0755)25987122

(三)律师事务所和经办律师

律师事务所:北京金杜律师事务所

地址:北京市朝阳区东三环中路39号建外SOHO A座31层

负责人:王玲

电话:0755-82125533

传真:0755-82125580/5590

经办律师:靳庆军、宋萍萍

联系人:宋萍萍

(四)会计师事务所和经办注册会计师

会计师事务所:普华永道中天会计师事务所有限公司

住所:上海市浦东新区东昌路568号

办公地址:上海湖滨路202号普华永道中心11楼

法定代表人:杨绍信

联系电话:021-61238888

传真电话:021-61238800

经办注册会计师:汪棣、薛竟

联系人:陈兆欣

四、基金的名称

本基金名称:易方达深证100交易型开放式指数基金

五、基金的类型

本基金类型:交易型开放式指数基金

六、基金的投资目标

紧密跟踪目标指数,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。

七、基金的投资方向

本基金投资范围主要为目标指数成份股及备选成份股。此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股、参与新股市值配售、以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金将把全部或接近全部的基金资产用于跟踪标的指数的表现,正常情况下指数化投资比例不低于基金资产净值的95%。

八、基金的投资策略

本基金主要采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将采用优化方法计算最优化投资组合的个股权重比例,以此构建本基金实际的投资组合,追求尽可能贴近目标指数的表现。

在法律法规许可时,基金管理人可运用股票期货、期权等相关金融衍生工具,以提高投资效率,更好达到本基金的投资目标。

基金管理人运用上述金融衍生工具必须是出于追求基金充分投资、减少交易费用、降低跟踪误差的目的,不得将之应用于投机目的,或用作杆杠工具放大基金的投资。

本基金投资于股票期货、期权等相关金融衍生工具必须经过投资决策委员会的批准。

1.决策依据

有关法律、法规、基金合同和标的指数的相关规定是基金管理人运用基金财产的决策依据。

2.投资管理体制

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理团队制。投资决策委员会负责决定有关指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策;基金经理决定日常指数跟踪维护过程中的组合构建、调整决策以及每日申购赎回清单的编制决策。

3.投资程序

研究、决策、组合构建、交易、评估、组合维护的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行,避免重大风险的发生。

(1)研究:研究部依托公司整体研究平台,整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果开展指数跟踪、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作,撰写研究报告,作为基金投资决策的重要依据。

(2)投资决策:投资决策委员会依据研究部提供的研究报告,定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议,决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议,每日进行基金投资管理的日常决策。

(3)组合构建:根据标的指数,结合研究报告,基金经理主要以完全复制指数成份股权重方法构建组合。在追求跟踪误差和偏离度最小化的前提下,基金经理将采取适当的方法,以降低买入成本、控制投资风险。

(4)交易执行:集中交易室负责具体的交易执行,同时履行一线监控的职责。

(5)投资绩效评估:基金绩效与风险评估小组定期和不定期对基金进行投资绩效评估,并提供相关报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来源及投资策略成功与否,基金经理可以据此检讨投资策略,进而调整投资组合。

(6)组合监控与调整:基金经理将跟踪标的指数变动,结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果,对投资组合进行监控和调整,密切跟踪标的指数。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整,并在基金招募说明书及其更新中公告。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为深证100价格指数。

如果指数编制单位变更或停止深证100价格指数的编制及发布、或深证100价格指数由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致深证100价格指数不宜继续作为标的指数,或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,变更本基金的标的指数。

十、基金的风险收益特征

本基金属股票基金,预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

十一、基金的投资组合报告(未经审计)

本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。

本基金的托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同的规定,已于2009年4月30日复核了本报告的内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告有关数据的期间为2009年1月1日至2009年3月31日。

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	3,428,664,343.15	98.65
	其中:股票	3,428,664,343.15	98.65
2	固定收益投资	1,835,970.24	0.05
	其中:债券	1,835,970.24	0.05
	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	11,370,509.71	0.33
6	其他资产	33,846,122.43	0.97
7	合计	3,475,716,945.53	100.00

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	采掘业	144,025,287.68	4.16
C	制造业	1,846,123,414.84	53.28
C0	食品、饮料	276,611,106.19	7.98
C1	纺织、服装、皮毛	15,612,120.80	0.45
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	24,712,978.59	0.71
C4	石油、化学、塑胶、塑料	193,409,288.23	5.58
C5	电子	48,858,600.98	1.41
C6	金属、非金属	569,648,942.40	16.44
C7	机械、设备、仪表	523,472,852.19	15.11
C8	医药、生物制品	175,071,190.74	5.05
C99	其他制造业	18,726,334.72	0.54
D	电力、煤气及水的生产和供应业	82,345,387.80	2.38
E	建筑业	17,522,945.84	0.51
F	交通运输、仓储业	73,871,023.84	2.13
G	信息技术业	140,560,114.90	4.06
H	批发和零售贸易	119,361,324.24	3.45
I	金融、保险业	336,788,254.95	9.72
J	房地产业	496,530,324.28	14.33
K	社会服务业	93,632,274.47	2.70
L	传播与文化产业	20,633,943.72	0.60
M	综合类	57,270,046.59	1.65
	合计	3,428,664,343.15	98.96

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	000002	万科A	33,108,526	274,138,595.28	7.91
2	000001	深发展A	10,592,523	168,844,816.62	4.87
3	000858	五粮液	6,810,979	108,430,785.68	3.13
4	002024	苏宁电器	5,689,116	102,688,543.80	2.96
5	000063	中兴通讯	2,629,075	92,911,510.50	2.68
6	000792	盐湖钾肥	1,598,637	92,385,232.23	2.67
7	000651	格力电器	3,323,234	86,437,316.34	2.49
8	000629	攀钢钒钛	8,148,701	77,901,581.56	2.25
9	002202	金风科技	1,795,707	72,097,636.05	2.08
10	000069	华侨城A	5,231,641	68,953,028.38	1.99

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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	1,835,970.24	0.05
7	其他	-	-
8	合计	1,835,970.24	0.05

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	125528	柳工转债	13,476	1,835,970.24	0.05
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

注:本报告期末本基金仅持有以上债券。

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

本基金本报告期未未持有资产支持证券。

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。

8.投资组合报告附注

(1)本基金投资的前十名证券的发行主体本期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:

根据中兴通讯股份有限公司董事会2008年10月7日发布的《中兴通讯股份有限公司关于财政部驻深圳市财政监察专员办事处2007年度会计信息质量检查结论和处理决定的公告》,中兴通讯在财政检查中受到16万元的行政罚款并被要求补缴企业所得税380万元。

根据青海盐湖钾肥股份有限公司2009年2月27日发布的《青海盐湖钾肥股份有限公司受到有关部门相关处罚的提示性公告》,盐湖钾肥因未及时严格履行监管部门制订的氯化钾销售临时指导价格,受到500万元的经济处罚。

本基金是纯被动指数基金,对中兴通讯、盐湖钾肥维持了标准配置比例。

(2)基金投资的前十名股票都在基金合同规定备选股票库之内。

(3)其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,000,000.00
2	应收证券清算款	32,830,779.77
3	应收股利	-
4	应收利息	15,342.66
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	33,846,122.43

(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	125528	柳工转债	1,835,970.24	0.05

(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情况。

十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。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。

本基金合同生效日为2006年3月24日,基金合同生效以来(截至2008年12月31日)的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示:

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
基金合同生效至2006年12月31日	85.53%	1.56%	92.96%	1.59%	-7.43%	-0.03%
2007年1月1日至2007年12月31日	185.35%	2.38%	179.05%	2.40%	6.30%	-0.02%
2008年1月1日至2008年12月31日	-63.43%	3.04%	-63.57%	3.04%	0.14%	0.00%
基金合同生效至2008年12月31日	93.63%	2.48%	96.19%	2.49%	-2.56%	-0.01%

十三、费用概览

(一)与基金运作有关的费用

1.基金费用的种类

(1)基金管理人的管理费;

(2)基金托管人的托管费;

(3)基金合同生效后的信息披露费用;

(4)基金上市费及年费;

(5)基金份额持有人大会费用;

(6)基金合同生效后的与基金相关的会计师费和律师费;

(7)证券交易费用;

(8)基金收益分配中发生的费用;

(9)按照法律法规和基金合同规定可以列入的其他费用。

法律法规另有规定时从其规定。

2. 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

(1)基金管理人的管理费

基金管理费按基金前一日的资产净值乘以0.5%的管理费年费率来计算,具体计算方法如下:

每日应计提的基金管理费=前一日该基金资产净值×年管理费率÷当年天数

基金管理费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人复核后于次月的前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

(2)基金托管人的托管费

本基金的托管费按该基金前一日资产净值乘以0.1%的托管费年费率来计算。计算方法如下:

每日应计提的基金托管费=前一日该基金资产净值×年托管费率÷当年天数

基金托管费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月的前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

(3)上述1.基金费用的种类中(3)至(9)项费用由基金托管人根据有关法规及相应协议的规定,按费用实际支出金额支付,列入当期基金费用。

3.不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

4.基金费用的调整

基金管理人和基金托管人可磋商酌情调低基金管理费和托管费,经中国证监会核准后公告。此项调整不需要召开基金份额持有人大会。

(二)与基金销售有关的费用

1.申购、赎回费用

投资者在申购或赎回基金份额时,需按照本招募说明书第八章第(六)条的规定,交纳一定的申购、赎回佣金。

本基金申购、赎回均以份额申请,费用计算公式为:

申购/赎回佣金=申购/赎回份额×佣金比率

本基金申购、赎回佣金由代办证券公司在投资者申购、赎回确认时收取,用于市场推广费用、销售服务费用、证券交易所和登记结算机构收取的相关费用等。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及《易方达深证100交易型开放式指数基金基金合同》,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对2008年11月20日刊登的本基金更新的招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

1.在“三、基金管理人”部分,更新了基金管理人基本情况、部分主要人员情况。

2.在“四、基金托管人”部分,根据最新资料进行了更新。

3.在“五、相关服务机构”部分,根据相关公告的内容,增加了兴业证券1个申购赎回代办证券公司,并根据最新资料更新了基金份额发售机构信息。

4.在“八、基金份额的申购、赎回”部分,更新了“申购赎回清单的格式”。

5.在“十、基金的投资”部分,补充了本基金2009年第1季度投资组合报告的内容。

6.在“十一、基金的业绩”部分,补充了基金合同生效以来的投资业绩。

7.在“二十三、其他应披露事项”部分,根据相关公告的内容进行了更新。

易方达基金管理有限公司

2009年5月19日

中银基金关于旗下基金持有的长期停牌股票估值方法变更的提示性公告

根据中国证监会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》([2008]38号文)的相关规定,自2008年9月16日起,中银基金管理有限公司(以下简称本公司)已对旗下证券投资基金持有的长期停牌股票等没有市价的投资品种的估值方法按照“指数收益法”进行估值,并对相关的基金资产净值进行了调整(详见本公司2008年9月18日的有关公告)。

2009年5月18日,根据本公司旗下中银中国混合、中银策略股票基金所持有的长江电力(股票代码600900)复牌后的市场交易情况,经本公司与基金托管人协商一致,自2009年5月18日起对旗下中银中国混合、中银策略股票基金所持有的长江电力采用交易当天收盘价进行估值。

投资者可登陆中银基金管理有限公司网站:http://www.bocim.com,或拨打中银基金管理有限公司客户服务电话:021-3883-4788、400-888-5566咨询有关信息。

特此公告

中银基金管理有限公司

2009年5月19日

中银基金管理有限公司关于旗下基金新增华宝证券经纪有限责任公司为代销机构的公告

根据中银基金管理有限公司(以下简称“本公司”)与华宝证券经纪有限责任公司(以下简称“华宝证券”)签署的销售代理协议,自2009年5月21日起,本公司新增华宝证券为旗下中银中国精选混合型开放式证券投资基金(基金代码:163801)、中银货币市场证券投资基金(基金代码:163802)、中银持续增长股票型证券投资基金(基金代码:163803)、中银收益混合型证券投资基金(基金代码:163804)、中银动态策略股票型证券投资基金(基金代码:163805)、中银稳健增利债券型证券投资基金(基金代码:163806)、中银行业优选灵活配置混合型证券投资基金(基金代码:163807)的代销机构。

华宝证券目前在以下6个城市的营业网点办理基金代销业务:上海、北京、深圳、舟山、杭州、福州。投资者欲了解我司旗下基金的详细情况,请仔细阅读各基金的基金合同、招募说明书等相关文件,也可通过以下途径了解或咨询相关详情:

1、中银基金管理有限公司

客户服务热线:021-38834788;400-888-5566

公司网站:http://www.bocim.com

2、华宝证券经纪有限责任公司

客户服务电话:4008209898;021-38929908

公司网站:www.cnhbstock.com

特此公告。

风险提示:本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则,在做出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行负担。投资者投资基金前应认真阅读基金合同、最新的招募说明书等法律文件。

中银基金管理有限公司

二〇〇九年五月十九日

证券简称:南京高科　证券代码:600064　编号:临2009-015号

南京新港高科技股份有限公司对外投资公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

重要提示:

1、投资标的名称:南京瑞科新型显示技术有限公司(暂定名);

2、投资金额和比例:首期投资额3,000万元。

风险提示:

1、由于AMOLED技术尚在研发阶段,能否顺利产业化存在一定的不确定性。

一、对外投资概述

公司控股子公司南京高科新创投资有限公司(以下简称“新创投资”)于2009年5月18日与江苏省有机电子与信息显示重点实验室(以下简称“重点实验室”)、南京瑞福达微电子技术有限公司(以下简称“瑞福达”)签署合作协议,共同成立南京瑞科新型显示技术有限公司(暂定名)(以下简称“南京瑞科”)暨南京TFT-OLED工程技术研究中心,主要开展TFT-OLED技术研究,开发TFT-OLED工程技术,并推动TFT-OLED工程技术的产业化。南京瑞科首期投资额3,000万元人民币。新创投资负责提供首期注册资金;瑞福达、重点实验室负责提供技术开发与工程研究所需的人力资源与技术资源。该合作事项产生的技术专利将归南京瑞科所有,收益由三方共享。由于该技术尚在研发阶段,能否顺利产业化存在一定的不确定性。该事项不构成关联交易。

二、投资协议主体的基本情况

1、新创投资系公司全资子公司,成立于2008年4月24日,注册资本5亿元人民币;注册地址:南京经济技术开发区内;经营范围:实业投资、创业投资、证券投资;投资管理及咨