

易方达深证 100 交易型开放式指数基金

2006 年年度报告摘要

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

重要提示: 基金管理人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...

基金管理人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定,于 2007 年 3 月 19 日复核了本报告中的...

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。

Table with 2 columns: Item, Value. Section: 一、基金简介. Includes: 1. 基金名称: 易方达深证 100 交易型开放式指数基金.

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。本基金主要采取完全复制法,即以完全按照标的指数的成份股及其权重构建基金股票投资组合...

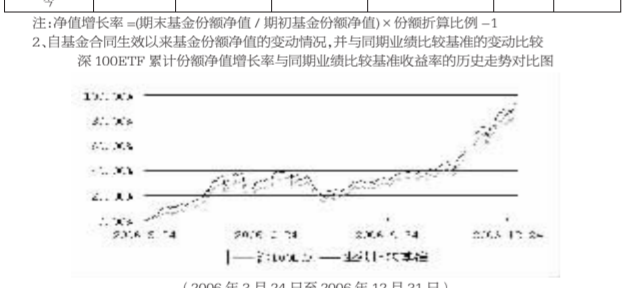
Table with 2 columns: Item, Value. Section: 三、基金管理人. Lists: 1. 名称: 易方达基金管理有限公司.

Table with 2 columns: Item, Value. Section: 二、主要财务指标和基金净值表现及收益分配情况. Includes: 1. 基金份额净值: 1.0696.

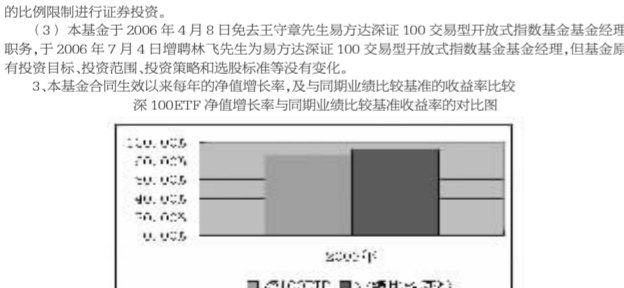
重要提示: 下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

Table with 2 columns: Item, Value. Section: (一) 主要会计数据和财务指标. Includes: 1. 本期净利润: 190,000.00.

Table with 2 columns: Item, Value. Section: (二) 基金净值表现. Includes: 1. 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率对比表.



注: (1) 本基金合同于 2006 年 3 月 24 日生效,2006 年 4 月 24 日在深圳证券交易所上市并开放申购赎回业务...



注: 本基金合同生效日为 2006 年 3 月 24 日,2006 年度的相关数据根据当年的实际存续期间计算。

(三) 以往一年的基金收益分配情况: 无。

三、管理人报告

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成立于 2001 年 4 月 17 日...

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,努力以规范运作、良好的业绩和优质的服务,为投资者创造回报。

截至 2006 年 12 月 31 日,公司旗下有基金合计: 基金共 11 只,其中封闭式基金和开放式基金合计 11 只,资产规模 126.72 亿元。

2. 本基金基金经理简介: 基金管理人易方达深证 100 交易型开放式指数基金基金经理小组由马骏先生、林飞先生(自 2006 年 7 月 4 日起)等组成。

3. 基金投资组合报告: 本基金本报告期末持有股票 2,030,000 股,公允价值 14,406,962.94 元,占基金资产净值的 13.82%。

4. 基金业绩比较基准: 本基金业绩比较基准为: 深证 100 指数收益率 x 95% + 银行活期存款利率 x 5%。

5. 基金业绩表现: 截至 2006 年 12 月 31 日,本基金自成立以来,累计净值增长率为 15.61%,同期业绩比较基准收益率为 15.61%。

(四) 宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望: 随着 07 年证券市场的进一步繁荣政策预期,市场扩容以及周边市场的调整使得 A 股市场短期面临的不确定性增加...

素并未发生任何变化,初步判断明年的蓝筹类产品的相对吸引力依然有进一步增加的趋势...

本基金管理人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规,基金合同和托管合同的有关规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督...

普华永道中天会计师事务所审计了 2006 年 12 月 31 日的资产负债表和 2006 年 3 月 24 日(基金合同生效日)至 2006 年 12 月 31 日止期间的经营业绩表...

Table with 2 columns: Item, Value. Section: 六、财务会计报告. Includes: 1. 资产负债表: 资产总计 3,181,219,146.73.

Table with 2 columns: Item, Value. Section: 2. 利润表: 本期净利润 190,000.00.

Table with 2 columns: Item, Value. Section: 3. 所有者权益变动表: 所有者权益合计 32,304,566.68.

持有权益类证券: 1,696,894,161.34. 其他资产: 3,181,219,146.73.

公允价值变动资产: 29,152,698.08. 应付托管费: 259,238.94.

应付利息: 288,006.65. 其他应付款: 1,118,437.36.

持有权益类证券公允价值变动: 1,696,894,161.34. 其他应付款: 1,118,437.36.

Table with 2 columns: Item, Value. Section: 附注 2 关联方关系及关联交易. Includes: 1. 关联方名称: 易方达深证 100 交易型开放式指数基金.

收入: 868,033,568.06. 债券利息收入: 752,404,701.98.

其他收入: 14,814,274.20. 基金管理人报酬: 11,996,310.86.

费用: 11,996,310.86. 基金管理人报酬: 11,996,310.86.

本期基金净值: 1,696,894,161.34. 期末基金净值: 1,696,894,161.34.

本期基金净值: 1,696,894,161.34. 期末基金净值: 1,696,894,161.34.

本期基金净值: 1,696,894,161.34. 期末基金净值: 1,696,894,161.34.

本期基金净值: 1,696,894,161.34. 期末基金净值: 1,696,894,161.34.

本期基金净值: 1,696,894,161.34. 期末基金净值: 1,696,894,161.34.

本期基金净值: 1,696,894,161.34. 期末基金净值: 1,696,894,161.34.

本期基金净值: 1,696,894,161.34. 期末基金净值: 1,696,894,161.34.

本期基金净值: 1,696,894,161.34. 期末基金净值: 1,696,894,161.34.

本期基金净值: 1,696,894,161.34. 期末基金净值: 1,696,894,161.34.

本期基金净值: 1,696,894,161.34. 期末基金净值: 1,696,894,161.34.

本期基金净值: 1,696,894,161.34. 期末基金净值: 1,696,894,161.34.

程中由非流通股股东支付的现金对价,于股权过户方案实施后随减持减持股票投资成本。

卖出债券投资收益及债券利息收入(指买入基金当期赎回申请中包含的组合股票于赎回申请日确认赎回差价收入(损失)),并按移动加权平均法于成交日,赎回申请日结转成本。

● 债券投资: 买入证券交易所上市的债券于成交日确认为债券投资,债券投资按成交日支付的全部价款入账,其中所含债券利息收入(或扣除日至赎回日止的利息,作为应收利息单独核算,不构成债券投资成本。

● 权证投资: 买入证券交易所上市的权证于成交日确认为权证投资,权证投资按成交日支付的全部价款入账,其中所含权证利息收入(或扣除日至赎回日止的利息,作为应收利息单独核算,不构成权证投资成本。

● 买入返售证券: 买入返售证券于成交日确认为买入返售证券,买入返售证券按成交日支付的全部价款入账,其中所含返售证券利息收入(或扣除日至赎回日止的利息,作为应收利息单独核算,不构成买入返售证券投资成本。

● 其他金融资产: 买入其他金融资产于成交日确认为其他金融资产,其他金融资产按成交日支付的全部价款入账,其中所含其他金融资产利息收入(或扣除日至赎回日止的利息,作为应收利息单独核算,不构成其他金融资产投资成本。

● 公允价值变动损益: 公允价值变动损益是指基金持有的金融资产公允价值变动而产生的公允价值变动损益(或损失),在基金资产负债表中以公允价值变动损益(或损失)列示。

● 其他业务收入: 其他业务收入是指基金在运作过程中产生的除主营业务收入以外的其他业务收入,包括基金管理人从事其他业务取得的收入。

● 其他费用: 其他费用是指基金在运作过程中发生的除主营业务成本以外的其他费用,包括基金管理人从事其他业务发生的费用。

● 其他应收款: 其他应收款是指基金在运作过程中产生的除主营业务收入以外的其他应收款,包括基金管理人从事其他业务产生的应收款。

● 其他应付款: 其他应付款是指基金在运作过程中产生的除主营业务收入以外的其他应付款,包括基金管理人从事其他业务产生的应付款。

● 其他流动资产: 其他流动资产是指基金在运作过程中持有的除金融资产以外的其他流动资产,包括基金管理人从事其他业务持有的流动资产。

● 其他非流动资产: 其他非流动资产是指基金在运作过程中持有的除金融资产以外的其他非流动资产,包括基金管理人从事其他业务持有的非流动资产。

● 其他负债: 其他负债是指基金在运作过程中产生的除主营业务收入以外的其他负债,包括基金管理人从事其他业务产生的负债。

● 其他非流动负债: 其他非流动负债是指基金在运作过程中产生的除主营业务收入以外的其他非流动负债,包括基金管理人从事其他业务产生的非流动负债。

● 其他所有者权益: 其他所有者权益是指基金在运作过程中产生的除主营业务收入以外的其他所有者权益,包括基金管理人从事其他业务产生的所有者权益。

● 其他所有者权益变动: 其他所有者权益变动是指基金在运作过程中产生的除主营业务收入以外的其他所有者权益变动,包括基金管理人从事其他业务产生的所有者权益变动。

● 其他所有者权益变动: 其他所有者权益变动是指基金在运作过程中产生的除主营业务收入以外的其他所有者权益变动,包括基金管理人从事其他业务产生的所有者权益变动。

● 其他所有者权益变动: 其他所有者权益变动是指基金在运作过程中产生的除主营业务收入以外的其他所有者权益变动,包括基金管理人从事其他业务产生的所有者权益变动。

● 其他所有者权益变动: 其他所有者权益变动是指基金在运作过程中产生的除主营业务收入以外的其他所有者权益变动,包括基金管理人从事其他业务产生的所有者权益变动。

● 其他所有者权益变动: 其他所有者权益变动是指基金在运作过程中产生的除主营业务收入以外的其他所有者权益变动,包括基金管理人从事其他业务产生的所有者权益变动。

● 其他所有者权益变动: 其他所有者权益变动是指基金在运作过程中产生的除主营业务收入以外的其他所有者权益变动,包括基金管理人从事其他业务产生的所有者权益变动。

● 其他所有者权益变动: 其他所有者权益变动是指基金在运作过程中产生的除主营业务收入以外的其他所有者权益变动,包括基金管理人从事其他业务产生的所有者权益变动。

● 其他所有者权益变动: 其他所有者权益变动是指基金在运作过程中产生的除主营业务收入以外的其他所有者权益变动,包括基金管理人从事其他业务产生的所有者权益变动。

● 其他所有者权益变动: 其他所有者权益变动是指基金在运作过程中产生的除主营业务收入以外的其他所有者权益变动,包括基金管理人从事其他业务产生的所有者权益变动。

● 其他所有者权益变动: 其他所有者权益变动是指基金在运作过程中产生的除主营业务收入以外的其他所有者权益变动,包括基金管理人从事其他业务产生的所有者权益变动。

● 其他所有者权益变动: 其他所有者权益变动是指基金在运作过程中产生的除主营业务收入以外的其他所有者权益变动,包括基金管理人从事其他业务产生的所有者权益变动。

● 其他所有者权益变动: 其他所有者权益变动是指基金在运作过程中产生的除主营业务收入以外的其他所有者权益变动,包括基金管理人从事其他业务产生的所有者权益变动。

3. 本报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细:

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量, 市值(元). Includes: 1. 股票代码: 000002, 股票名称: 万科 A, 数量: 23,028,366.

4. 本报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券明细:

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 债券名称, 数量, 市值(元). Includes: 1. 股票代码: 000002, 债券名称: 万科 A, 数量: 23,028,366.

5. 本报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证明细:

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 权证名称, 数量, 市值(元). Includes: 1. 股票代码: 000002, 权证名称: 万科 A, 数量: 23,028,366.

6. 本报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股指期货明细:

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 期货名称, 数量, 市值(元). Includes: 1. 股票代码: 000002, 期货名称: 万科 A, 数量: 23,028,366.

7. 本报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名货币市场工具明细:

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 货币市场工具名称, 数量, 市值(元). Includes: 1. 股票代码: 000002, 货币市场工具名称: 万科 A, 数量: 23,028,366.

8. 本报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他金融资产明细:

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 其他金融资产名称, 数量, 市值(元). Includes: 1. 股票代码: 000002, 其他金融资产名称: 万科 A, 数量: 23,028,366.

9. 本报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他非流动资产明细:

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 其他非流动资产名称, 数量, 市值(元). Includes: 1. 股票代码: 000002, 其他非流动资产名称: 万科 A, 数量: 23,028,366.

10. 本报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他非流动负债明细:

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 其他非流动负债名称, 数量, 市值(元). Includes: 1. 股票代码: 000002, 其他非流动负债名称: 万科 A, 数量: 23,028,366.

11. 本报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他所有者权益明细:

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 其他所有者权益名称, 数量, 市值(元). Includes: 1. 股票代码: 000002, 其他所有者权益名称: 万科 A, 数量: 23,028,366.

12. 本报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他所有者权益变动明细:

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 其他所有者权益变动名称, 数量, 市值(元). Includes: 1. 股票代码: 000002, 其他所有者权益变动名称: 万科 A, 数量: 23,028,366.

13. 本报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他所有者权益变动明细:

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 其他所有者权益变动名称, 数量, 市值(元). Includes: 1. 股票代码: 000002, 其他所有者权益变动名称: 万科 A, 数量: 23,028,366.

注: 上述公允价值均来源于中国证券报、上海证券报、证券时报。易方达基金管理有限公司 2007 年 3 月 31 日