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

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 2008 年 3 月 24 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2008 年 3 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

(二)　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 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%

(三)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、总经理，博士，1963 年生。曾任中国南海石油联合服务总公司企业管理部科长、广发证券有限责任公司投资银行部总经理、广发证券有限责任公司董事副总裁。现任易方达基金管理有限公司副董事长、总经理。

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（现改名为昆仑证券有限责任公司）营业部、交易部经理，现任美的技术投资有限公司总经理。

张优造先生，董事，副总经理，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、副总经理兼营运总监。

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，香港港口发展局委员以及多家公司董事长、董事。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，加拿大 ALBERTA 大学管理学博士，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。现任中山大学教授、法律学系国际法教研室主任，中山大学教师职务评审委员会法学学科评议组成员，曾兼任中国国际私法学会副会长，中国国际法学会理事，《中国国际私法与比较法年刊》编辑委员会委员、广东省律师高级专业资格评审委员会和广州市律师高级专业资格评审委员会委员，武汉大学法学院和西北政法学院兼职教授，以及中国国际经济贸易仲裁委员会等仲裁委员会仲裁员。

陈国祥先生，监事会主席，经济学硕士。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。

江作良先生，副总经理兼投资总监，硕士，1966 年生。曾任广发证券股份有限公司研发中心副总经理，投资自营部副总经理、总经理。2001 年 4 月至今，在易方达基金管理有限公司工作，曾任投资管理部总经理、科汇基金基金经理、易方达平稳增长证券投资基金基金经理，现任易方达基金管理有限公司副总经理兼投资总监。

刘晓艳女士，副总经理兼市场总监，博士，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经理兼市场总监。

张南女士，督察长，博士。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，现任易方达基金管理有限公司督察长兼监察部总经理。

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，自 2006 年 7 月 4 日起任易方达深证 100 交易型开放式指数基金基金经理，自 2007 年 2 月 10 日起任易方达 50 指数基金基金经理。

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 8 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：副总经理兼投资总监江作良先生、总裁助理兼基金投资部总经理陈志民先生以及研究部总经理吴欣荣先生。

江作良，同上

陈志民先生，法学硕士、公共管理硕士，1971 年出生。曾任职于厦门国际信托投资公司和南方基金管理有限公司，在南方基金管理有限公司工作期间曾任研究员、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筹建工作，公司开业后，曾任科翔、科瑞、科汇、易方达积极成长基金基金经理、易方达基金管理有限公司机构理财部总经理，期间公派美国哥伦比亚大学国际关系学院学习并曾在美国 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，兼基金投资部总经理。

吴欣荣，工学硕士，1975 年生。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、基金经理助理、科瑞基金基金经理、基金投资部副总经理，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。

4、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

名称：中国银行股份有限公司
办公及住所地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号
法定代表人：肖 钢
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
存续期间：持续经营
成立日期：1983 年 10 月 31 日
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号
托管部门总经理：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

（1）广发证券
注册地址：广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心 26 楼 2611 室
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
开放式基金咨询电话：（020）87555888
开放式基金业务传真：（020）87555305
网址：http://www.gf.com.cn

（2）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 29 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
开放式基金业务传真：021－38670666
客户服务热线：4008888666
网址：www.gtja.com

（3）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
联系电话：4008888888
网址：www.chinastock.com.cn

（4）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：4008888111、95565
网址：www.newone.com.cn

（5）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
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：林建闽
客户服务热线：800－810－8868
网址：www.guosen.com.cn

（6）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 171 号
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

（7）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：程伟
开放式基金咨询电话：安徽地区：96888；全国：400－8888－777
开放式基金业务传真：0551—2207935
网址：www.gyzq.com.cn

（8）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
法定代表人：王明权
联系人：刘晨
开放式基金咨询电话：021－68816000
开放式基金业务传真：021－68815009
客户服务电话：10108998
网址：www.ebscn.com

（9）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：025－84579897
开放式基金业务传真：010－84579763
联系人：张小波
网址：www.htsc.com.cn

（10）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
开放式基金清算传真：（010）65183880
公司总机：（010）85130588
网址：www.csc108.com

（11）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：0755－82492062
网址：www.lhzq.com

（12）长江证券
注册地址：武汉市新华路特 8 号
法定代表人：胡运钊
开放式基金咨询电话：021－63219781
开放式基金业务传真：021－51062920
联系人：李良
客户服务热线：4008－888－999
网址：www.95579.com

（13）国联证券
法定代表人：范炎
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.glsc.com.cn

（14）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：http://www.njzq.com.cn

（15）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
客户服务热线：021－95503 或 4008888506
联系人：吴宇
电话：021－63325888
传真：021－63326173
网址：www.dfzq.com.cn

（16）中信证券
注册地址：深圳市湖贝路 1030 号海龙王大厦
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

（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：0371－65585670
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）上海证券
注册地址：上海市九江路 111 号
法定代表人：蒋元真
联系电话：021－65076608*557
咨询电话：021－962518
传真：021－65081069
联系人：刘永、方凌云
网址：http://www.962518.com

（19）平安证券
办公地址：深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦三楼
法定代表人：陈敬达
开放式基金咨询电话：95511
开放式基金业务传真：0755－82433794
联系人：袁月、毛娟梅
联系电话：0755－82450826
网址：www.pa18.com

（20）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
咨询电话：0532－96577
联系人：丁韶燕
联系电话：0532－85022026
传真：0532－85022026
网址：www.zxwt.com.cn

（21）东海证券
注册地址：常州延陵西路 59 号常信大厦 18、19 楼
办公地址：上海市浦东新区东方路 989 号中达广场 17 楼
法定代表人：朱科敏
客户服务热线：400－888－8588
联系人：邵一明
电话：021－50586660－8837
网址：www.longone.com.cn

（22）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：赵晖
电话：010－68055776
客户服务电话：0755－25832583
网址：www.firstcapital.com.cn

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、薛竞
联系人：陈兆欣

四、基金的名称

本基金名称：易方达深证 100ETF 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，或用作杠杆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

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 2008 年 4 月 15 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。

本投资组合报告有关数据的期间为 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 3 月 31 日。

1、本报告期末基金资产组合情况

项目名称	金额（元）	占基金资产总值比例
股票	5,420,466,705.42	99.79%
债券	–	–
权证	–	–
资产支持证券	–	–
银行存款和清算备付金合计	7,646,354.04	0.14%
应收证券清算款	2,118,229.25	0.04%
其他资产	1,560,675.01	0.03%
总计	5,431,791,963.72	100.00%

2、本报告期末按行业分类的股票投资组合

行业类别	市值(元)	占基金资产净值比例
A 农、林、牧、渔业	–	–
B 采掘业	230,253,353.92	4.24%
C 制造业	2,906,316,499.59	53.57%
C0 食品、饮料	422,240,809.89	7.78%
C1 纺织、服装、皮毛	65,899,628.79	1.21%
C2 木材、家具	–	–
C3 造纸、印刷	53,513,778.88	0.99%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	331,908,203.97	6.12%
C5 电子	66,128,292.25	1.22%
C6 金属、非金属	1,012,430,134.72	18.66%
C7 机械、设备、仪表	719,603,932.78	13.26%
C8 医药、生物制品	206,911,575.83	3.81%
C99 其他制造业	27,680,142.48	0.51%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	141,240,290.98	2.60%
E 建筑业	36,269,515.80	0.67%
F 交通运输、仓储业	142,153,963.48	2.62%
G 信息技术业	216,344,005.91	3.99%
H 批发和零售贸易	266,380,476.20	4.91%
I 金融、保险业	283,208,872.22	5.22%
J 房地产业	913,504,933.83	16.84%
K 社会服务业	160,835,906.31	2.96%
L 传播与文化产业	23,910,600.60	0.44%
M 综合类	100,048,286.58	1.84%
合计	5,420,466,705.42	99.91%

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

序号	股票代码	股票名称	数量	市值(元)	占基金资产净值比例
1	000002	万科 A	26,102,399	668,221,414.40	12.32%
2	002024	苏宁电器	4,332,280	239,098,533.20	4.41%
3	000001	深发展 A	7,776,786	219,305,365.20	4.04%
4	000858	五粮液	6,375,690	154,291,698.00	2.84%
5	000792	盐湖钾肥	1,733,199	148,361,834.40	2.73%
6	000063	中兴通讯	2,370,835	139,594,764.80	2.57%
7	000527	美的电器	4,052,171	128,413,298.99	2.37%
8	000568	泸州老窖	1,979,870	122,751,940.00	2.26%
9	000069	华侨城 A	2,813,190	114,750,020.10	2.12%
10	000898	鞍钢股份	5,673,929	110,074,222.60	2.03%

4、本报告期末按券种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券。

5、本报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

本报告期末本基金未持有债券。

6、报告附注

（1）本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查的情况，报告编制日前一年内未受到公开谴责或处罚。

（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。

（3）其他资产：

名称	金额（元）
存出保证金	1,557,826.56
应收股利	–
应收利息	2,848.45
待摊费用	–
其他应收款	–
合计	1,560,675.01

（4）报告期末基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有可转换债券。

（5）报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有权证明细

本报告期末本基金未持有权证。

（6）报告期内获得的权证明细

本报告期内本基金未获得权证。

（7）报告期末持有资产支持证券的情况

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

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 2007 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%
基金合同生效至 2007 年 12 月 31 日	429.41%	2.06%	438.47%	2.08%	–9.06%	–0.02%

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》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对 2007 年 11 月 16 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，增加了第一创业证券 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，以 2008 年 3 月 24 日的数据更新了"申购、赎回清单的格式"；
5.在"十、基金的投资"部分，补充了本基金最近一期投资组合报告的内容。
6.在"十一、基金的业绩"部分，补充说明基金合同生效以来的投资业绩。
7.在"二十二、对基金份额持有人的服务"部分，进行了更新。
8.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
2008 年 5 月 21 日

股票代码：002083　股票简称：孚日股份　公告编号：临 2008-031

孚日集团股份有限公司关于为四川地震灾区人民捐赠的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

2008年 5 月 12 日，四川省汶川县发生了 8.0 级大地震，给灾区人民的生产、生活带来了极大的困难。地震发生后，为帮助灾区人民重建家园，共度难关，公司发扬"一方有难、八方支援"的救助精神，经公司管理层研究决定，起制了价值 105 万元的灾区急需的春秋被和毛巾被等物品，该批物资已于 5 月 17 日由公司车队亲自送达本次地震重灾区青州县和阿坝自治州。

在将捐赠物资送往灾区的同时，公司发动全体干部员工再献爱心，捐款 40 多万元，为灾区人民战胜困难、重建家园奉献一片爱心。同时公司管理层决定再从孚日教育奖励基金中捐赠 100 万元，用于地震灾区的校园重建，该笔善款已由当地慈善总会接收。

截至目前本公司及全体员工已向四川地震灾区捐款捐物共计 245 万元。

特此公告。

孚日集团股份有限公司董事会
2008年 5 月 21 日

证券代码：600571　证券简称：信雅达　编号：临 2008-010

信雅达系统工程股份有限公司
关于向吴泉明先生实施股权激励计划的补充公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整，对公告的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏负连带责任。

公司于 2008 年 4 月 25 日召开三届董事会第十三次会议，审议通过《关于向吴泉明先生实施股权激励计划的议案》，为履行杭州信雅达电子有限公司在本公司股权分置改革中的承诺事项，董事会同意向吴泉明先生实施股权激励计划，杭州信雅达电子有限公司以协议转让方式向吴泉明先生按约定价格和约定考核办法转让本公司股票，股票转让的价格为 1 元／股，数量按考核办法确定后，公司将另行公告。

现按约定考核办法确定，向吴泉明先生实施股权激励计划的股票数量为 637,529 股。

特此公告！

信雅达系统工程股份有限公司
董事会
2008 年 5 月 20 日

长信基金管理有限责任公司关于直销专户银行账号变更的公告

因招商银行股份有限公司（以下简称＂招商银行＂）上海分行计算机系统升级，长信基金管理有限责任公司（以下简称＂我公司＂）在招商银行上海分行开立的直销账户信息变更如下：

开户银行：招商银行上海分行营业部
银行户名：长信基金管理有限责任公司
银行账号：216089229110001

敬请投资者注意以上直销银行账号变更信息，避免因收款帐号不正确、认、申购款项不能及时到账而导致交易申请延误或无效。

我公司和招商银行亦将对上述直销银行账号变更初期的认、申购资金进账情况加以关注，减少因上述变化给投资者带来的不便。

我公司在其他银行的直销专户银行账户信息不变。

特此公告。

长信基金管理有限责任公司
2008 年 5 月 21 日

证券简称：天威保变　证券代码：600550　编号：临 2008-027

保定天威保变电气股份有限公司
关于河北宝硕股份有限公司重组事宜进展情况公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容真实、准确和完整，并对公告中的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏承担责任。

近日，本公司接到河北宝硕股份有限公司（以下简称"* ST 宝硕"）的股东让渡的普通股股票 641,856 股，以 * ST 宝硕 2007 年 12 月 28 日（因重大事项连续停牌前的最后一个交易日） 股票收盘的价格 6.63 元 \ 股计算，市值 4,255,505.28 元人民币。本公司此次接到 * ST 宝硕的股东让渡的股票是根据 * ST 宝硕的重整计划，按照债权比例获得的股份。

有关本公司与 * ST 宝硕有关债权债务关系的形成详见 2006 年 12 月 1 日和 2006 年 12 月 6 日刊登于上海证券交易所网站 http://www.sse.com.cn、《中国证券报》和《上海证券报》上的《董事会决议公告》和《保定天威保变电气股份有限公司重要事项公告》。

本公司将持续披露 * ST 宝硕重组进展情况，敬请广大投资者注意投资风险。

特此公告。

保定天威保变电气股份有限公司
二 00 八年五月二十日

证券代码：000002、200002　证券简称：万科 A、万科 B　公告编号：〈万〉2008-023

万科

万科企业股份有限公司关于参与四川地震灾区灾后安置及恢复重建工作的董事会决议公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

关于参与四川地震灾区灾后安置及恢复重建工作的议案于 2008 年 5 月 19 日以电子邮件方式送达各位董事，各位董事对议案进行了审议，并以通讯方式进行了表决，整个程序符合有关法规和《公司章程》的规定。董事会以 11 票赞成、0 票反对、0 票弃权通过了有关议案。详情如下：

2008 年 5 月 12 日，四川汶川地区发生里氏 8 级地震，灾情及救灾抗震工作牵动举国人心。自地震发生以来，公司一直密切关注各方面信息，寻找对灾区最有价值的努力方向，尤其是寻求能发挥万科专业优势的具体项目。为此多名公司管理人员、技术骨干及外聘专家先后赴救灾现场了解情况。

综合现场和其他渠道收集到的信息，公司认为灾后恢复重建的工作，将是一个长期的持续过程，需要社会各方力量的支持和援助，而万科参与该项工作能够发挥自身特长。作为一家专业房地产开发公司，万科本身具备较强的区域规划、建筑设计及组织实施的能力；万科在全国拥有多家分支机构，在动员、组织能力上具有一定优势，且万科在成都设有子公司，也能为实施援助提供便利。

为此董事会决议召集股东大会，提请股东大会批准公司参与四川地震灾区灾后安置、修复和重建工作。具体情况如下：

（1）批准公司参与四川地震灾区的临时安置、灾后恢复与重建工作，并以绵竹市遵道镇为重点；该项工作为纯公益性质，不涉及任何商业性（包括微利项目）的开发；

（2）批准公司在净支出额度人民币一亿元以内参与上述工作；

（3）上述费用将在未来 3 到 5 年内，根据实际需要逐年支出。公司将在每年的年度报告中披露具体的支出情况。

特此公告。

万科企业股份有限公司
董事会
二〇〇八年五月二十一日

证券代码：000002、200002　证券简称：万科 A、万科 B　公告编号：〈万〉2008-024

万科

万科企业股份有限公司
2008 年第一次临时股东大会通知

本公司及董事会全体成员保证公告内容真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

一、召开会议的基本情况
1、召集人：万科企业股份有限公司第十五届董事会
2、会议地点：深圳市福田区梅林路 63 号万科建筑研究中心一楼
3、表决方式：现场表决
4、会议时间：2008 年 6 月 5 日（周四）上午 9:30 起

二、会议议程
1、审议《关于参与四川地震灾区灾后安置及恢复重建工作的议案》

上述议程的详细情况，请见 2008 年 5 月 21 日刊登在《中国证券报》、《证券时报》和《上海证券报》上的关于参与四川地震灾区灾后安置及恢复重建工作的董事会决议公告。

三、出席对象：

（1）公司董事、监事及高级管理人员；

（2）中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司登记在册 2008 年 5 月 29 日收市时，持有本公司股票的股东，均有权亲自或委托代理人出席本届股东大会，行使表决权。股东委托的代理人不必是公司的股东。

四、会议登记办法

1.法人股东登记。法人股东的法定代表人须持有股东账户卡、加盖公司公章的营业执照复印件、法人代表证明书和本人身份证办理登记手续；委托代理人出席的，还须持法人授权委托书和出席人身份证；

2.个人股东登记。个人股东须持本人身份证、股东账户卡及持股凭证办理登记手续；受委托出席的股东代理人还须持有出席人身份证和授权委托书；

3.登记时间：2007 年 5 月 30 日至 6 月 4 日之间每个工作日上午 9:00—下午 17:30；以及 6 月 5 日 9:00–9:30（异地股东可用信函或传真方式登记）；

4.登记地点：深圳市福田区梅林路 63 号万科建筑研究中心董事会办公室；

5.注意事项：出席会议的股东及股东代理人请携带相关证件原件到场。

五、股东大会联系方式

联系地址：深圳市福田区梅林路 63 号万科建筑研究中心万科企业股份有限公司董事会办公室，邮编：518049

联系电话：0755-25606666 转董事会办公室

联系传真：0755-25531696（传真请注明：转董事会办公室）

六、其他事项

本次股东大会会期半天，与会人员食宿及交通费自理。

特此公告。

万科企业股份有限公司董事会
二〇〇八年五月二十一日

附件一

授权委托书

兹委托　先生／女士代表本人（本公司）出席万科企业股份有限公司 2008 年第一次临时股东大会并代为行使表决权。

委托人股票帐号：　　　　持股数：　　　　股
委托人身份证号码（法人股东营业执照号码）：
被委托人（签名）：　　　　被委托人身份证号码：
委托人对下述议案表决如下（请在相应的表决意见项下划"√"）：

议案序号	议案内容	表决意见		
		同意	反对	弃权
1	关于参与四川地震灾区灾后安置及恢复重建工作的议案			

如果委托人未对上述议案作出具体表决指示，被委托人可否按自己决定表决：
可以　　　不可以
委托人签名（法人股东加盖公章）：
委托日期：二〇〇八年　月　日