# 易方达深证100交易型开放式指数基金 2008年半年度报告摘要

**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　送出日期:2008年8月28日**

**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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2008年8月11日复核了本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、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。

本报告期间:2008年1月1日至2008年6月30日。本报告财务数据未经审计。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读登载于本基金管理人网站www.efunds.com.cn的半年度报告正文。

**一、基金简介**

| | |
|---|---|
| (一)基金基本资料 | |
| 1.基金名称 | 易方达深证100交易型开放式指数基金 |
| 2.基金简称: | 深100ETF |
| 3.基金交易代码: | 159901 |
| 4.基金运作方式: | 交易型开放式 |
| 5.基金合同生效日: | 2006年3月24日 |
| 6.报告期末基金份额总额: | 1,327,166,634份 |
| 7.基金合同存续期: | 不定期 |
| 8.基金份额上市的证券交易所: | 深圳证券交易所 |
| 9.上市日期: | 2006年4月24日 |
| (二)基金产品说明 | |
| 1.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 |
| 2.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。 |
| 3.业绩比较基准: | 深证100价格指数 |
| 4.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。 |
| (三)基金管理人 | |
| 1.名称: | 易方达基金管理有限公司 |
| 2.信息披露负责人: | 张南 |
| 3.信息披露电话: | 020-38799008 |
| 4.客户服务与投诉电话 | 400 881 8088 |
| 5.传真: | 020-38799488 |
| 6.电子邮箱: | csc@efunds.com.cn |
| (四)基金托管人 | |
| 1.名称: | 中国银行股份有限公司 |
| 2.信息披露负责人: | 宁敏 |
| 3.联系电话: | 010-66594977 |
| 4.传真: | 010-66594942 |
| 5.电子邮箱: | tgxxpl@bank-of-china.com |
| (五)信息披露 | |
| 信息披露报纸名称: | 中国证券报、上海证券报、证券时报 |
| 登载半年度报告正文的管理人互联网网址: | http://www.efunds.com.cn |
| 基金半年度报告置备地点: | 广州市体育西路189号城建大厦28楼 |

**二、主要财务指标和基金净值表现**

(单位:人民币元)

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。

(一)主要会计数据和财务指标

| 序号 | 主要会计数据和财务指标 | |
|---|---|---|
| 1 | 本期利润 | -3,296,741,238.04 |
| 2 | 本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额 | -159,236,583.19 |
| 3 | 加权平均份额本期利润 | 2.4888 |
| 4 | 期末可供分配份额利润 | 1.8625 |
| 5 | 期末基金资产净值 | 3,869,570,722.79 |
| 6 | 期末基金份额净值 | 2.916 |
| 7 | 本期份额净值增长率 | -46.11% |

(二)基金净值表现

1、本基金历史各时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较列表:

| 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1个月 | -22.94% | 3.53% | -23.25% | 3.53% | 0.31% | 0.00% |
| 过去3个月 | -29.26% | 3.42% | -29.57% | 3.42% | 0.31% | 0.00% |
| 过去6个月 | -46.11% | 3.18% | -46.29% | 3.18% | 0.18% | 0.00% |
| 过去1年 | -25.55% | 2.72% | -25.69% | 2.72% | 0.14% | 0.00% |
| 基金合同生效至今 | 185.30% | 2.37% | 189.20% | 2.38% | -3.90% | -0.01% |

2、自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况,并与同期业绩比较基准的变动比较

深100ETF累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2006年3月24日至2008年6月30日)

注:1、基金合同中关于基金投资比例的约定:

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,本基金的指数化投资比例不低于基金资产净值的95%。

2、本基金本报告期遵守法律、法规和基金合同的比例限制进行证券投资。

3、本基金自基金合同生效至报告期末的基金份额净值增长率为185.30%,同期业绩比较基准收益率为189.20%。

4、本基金于2008年1月1日免去马骏先生基金经理职务,但基金原有投资目标、投资范围、投资策略和选股标准等完全没有发生变化。

**三、管理人报告**

(一)基金管理人及基金经理介绍

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,注册资本1.2亿元。截至2008年6月30日,公司的股东为广东粤财信托、广发证券、广东盈峰集团有限公司、广东省广晟资产经营有限公司和广州市广永国有资产经营有限公司,其中广东粤财信托、广发证券和广东盈峰集团有限公司分别占出资额的25%,广东省广晟资产经营有限公司占出资额的16.67%,广州市广永国有资产经营有限公司占出资额的8.33%。

公司下设基金投资部、研究部、集中交易室、市场部、电子商务部、注册登记部、核算部、信息技术部、监察部、人力资源部、综合管理部、机构理财部、固定收益部、投资发展部等部门。良好的治理结构和健全的内部控制保证了公司的合法规范经营,并逐步形成稳健、务实、规范、创新的经营风格。

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,努力以规范的运作、良好的业绩和优质的服务,为投资者创造最佳的回报。

截至2008年6月30日,公司旗下有基金科汇、基金科翔、基金科瑞三只封闭式基金和易方达科讯股票型基金、易方达平稳增长基金、易方达策略成长基金、易方达50指数基金、易方达积极成长基金、易方达货币市场基金、易方达稳健收益债券型基金、易方达深证100交易型开放式指数基金、易方达价值精选股票型基金、易方达策略成长二号混合型基金、易方达价值成长混合型基金、易方达增强回报债券型基金、易方达中小盘股票型基金十三只开放式基金。

2、基金经理简介

林飞先生,1975年生,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,本报告期内任易方达深证100交易型开放式指数基金基金经理和易方达50指数证券投资基金基金经理。

(二)报告期内基金运作的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。

(三)公平交易专项说明

1、公平交易制度的执行情况

公司主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程来确保公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。

公司树立了研究导向的投资文化,强调投资应以研究作为依据,不断建立完善系统、科学的研究方法和流程,并认真地推行实施。

公司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,基金经理只能在既定的权限范围内、根据投资决策委员会的决议或指导意见进行投资操作,超出其权限范围的投资须报投资总监或投资决策委员会审批;同时,基金经理只能投资公司股票备选库中的股票,金额比例超出一定范围的还须是核心备选库中的股票,而股票备选库及核心备选库的建立维护主要由研究部负责,并需要经过投资研究联席会的集体讨论和表决通过,这样就可对基金经理形成相对的制约;此外,所有的投资指令必须通过集中交易室下达,集中交易室与投资部门相隔离,交易员要对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核,审核认为无效的可以拒绝执行,如发现任何异常交易还应及时反馈报告,由此形成对投资合规有效性的又一重把关;在交易过程中,按照"时间优先、价格优先"的原则,通过投资交易系统中的公平交易模块,公平对待各投资组合;在此基础上,监察部还将通过对投资组合各项合规性指标的日常检查提示,以及对投资、研究、交易等全流程的独立的监察稽核,督促落实上述制度措施,促进投资运作的规范性。

本报告期内,上述公平交易制度总体执行情况良好。

2、本基金与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

无

3、关于异常交易情况的说明

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。

(四)报告期内基金投资策略和业绩表现的说明与解释

1、行情回顾及运作分析

虽然近几年的证券市场,无论是市场容量、市场参与者还是制度环境都已经发生了质的变化,但08年的市场还是再次完整地验证了其作为一个新兴市场的基本特征:预期容易走向极端状态并自我强化,当滑向另一个极端的时候,会象杠杆一样的撬动指数的起落,从而带动市场风险溢价水平的大幅波动。次债危机也好、"大小非"也好、能源冲击也好,事后总可以发现诸多可能的解释因素。但我认为,对于规模已经接近经济总量的股票市场而言,只有对经济现状及未来预期已经发生了根本的转变,才可能以这种方式去修正06年以来的上涨,未来同样也将由相同的因素来决定这种修正是否超过其应有的幅度。虽然下跌的顺序不尽相同,但08年上半年市场最终呈现典型的系统性风险特征,上证综合指数下跌48%,是证券市场成立以来的最大的半年度跌幅。本基金是以指数化为投资策略的纯被动基金,通过控制股票投资权重与深证100指数成份股自然权重偏离,力求实现对深证100指数的精确跟踪。上半年基金偏离指标始终控制在基金合同规定的范围之内,作为以被动复制基准指数为主的深证100ETF基金,上半年基金净值不可避免地跟随市场出现了较大幅度的下跌。

2、本基金业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为2.916元,本报告期份额净值增长率为-46.11%,同期基准指数收益率为-46.29%,日跟踪偏离度的均值为0.02%,日跟踪误差为0.02%,年化跟踪误差0.34%,在基金合同规定的控制目标范围之内。

(五)宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

快速上涨的大宗商品价格、贸易摩擦、人民币升值过程中出口企业竞争力的变化,都让我们重新审视中国在国际分工中的真实处境,依赖外需和房地产需求膨胀而带动的经济超常规增长面临减速的过程,过去以高能耗、环境福利下降为代价换来的经济高速成长正逐渐面临新的瓶颈,处于转型过程中的中国经济仍将在较长时间内面临诸多的不确定性因素。然而,我对国内经济的未来仍持乐观态度,这一判断主要是基于看好中国内需扩张带来的经济增长、城镇化进程的进一步推动、人力资源潜能更深层次的释放、基础设施改善之后效率的提升、宏观调控多年经验的积累以及中国对迈向富足社会的专注和执着。如果判断成立,未来中国经济稳定增长的动力依然存在,而资本市场作为经济的晴雨表,终将反映这种趋势,相信以各行业内优势企业为主要投资对象的指数基金也将逐渐受益于这样一个过程。作为被动投资的基金,深证100ETF将继续坚持既定的指数化投资策略,以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为投资目标,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。期望深证100ETF为投资者进一步分享中国经济的未来长期成长提供更好的投资机会。

**四、托管人报告**

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对易方达深证100交易型开放式指数基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本半年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。(注:财务会计报告中的"金融工具风险管理"部分未在托管人复核范围内。)

中国银行股份有限公司

2008年8月20日

**五、财务会计报告(未经审计)**

(一)基金会计报表

1、资产负债表

易方达深证100交易型开放式指数基金

资产负债表

2008年6月30日

单位:人民币元

| | 2008-6-30 | 2007-12-31 |
|---|---|---|
| 资 产: | | |
| 银行存款 | 9,258,465.53 | 5,195,970.58 |
| 结算备付金 | 5,175,447.61 | 3,403,464.06 |
| 存出保证金 | 1,000,000.00 | 1,335,371.00 |
| 交易性金融资产 | 3,859,034,721.83 | 6,246,571,719.79 |
| 其中:股票投资 | 3,857,600,066.87 | 6,246,571,719.79 |
| 债券投资 | 1,434,654.96 | - |
| 资产支持证券投资 | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - |
| 应收证券清算款 | 543,848.46 | 6,036,536.12 |
| 应收利息 | 7,282.45 | 2,906.18 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 3,875,019,765.88 | 6,262,545,967.73 |
| | | |
| 负债和所有者权益 | | |
| 负 债: | | |
| 短期借款 | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - |
| 衍生金融负债 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - |
| 应付证券清算款 | - | - |
| 应付赎回款 | - | - |
| 应付管理人报酬 | 1,817,001.45 | 2,407,644.57 |
| 应付托管费 | 363,400.30 | 481,528.90 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 875,716.85 | 737,507.46 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 其他负债 | 2,392,924.49 | 2,534,253.40 |
| 负债合计 | 5,449,043.09 | 6,160,934.33 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 1,397,782,988.39 | 1,217,684,359.51 |
| 未分配利润 | 2,471,787,734.40 | 5,038,700,673.89 |
| 所有者权益合计 | 3,869,570,722.79 | 6,256,385,033.40 |
| 负债及所有者权益总计 | 3,875,019,765.88 | 6,262,545,967.73 |

附注:2008年6月30日基金份额净值2.916元,基金份额总额1,327,166,634份。

所附附注为本会计报表的组成部分

2、利润表

易方达深证100交易型开放式指数基金

利润表

2008年1月1日-2008年6月30日

单位:人民币元

| | 2008年1月1日-2008年6月30日 | 2007年1月1日-2007年6月30日 |
|---|---|---|
| 一.收入 | -3,275,368,970.86 | 2,967,382,542.78 |
| 1.利息收入 | 82,278.62 | 68,055.68 |
| 其中:存款利息收入 | 80,092.92 | 60,935.56 |
| 债券利息收入 | 2,185.70 | 7,120.12 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | - | - |
| 2.投资收益(损失以"-"填列) | -134,664,566.95 | 2,958,857,141.92 |
| 其中:股票投资收益 | -164,848,296.01 | 2,932,289,792.73 |
| 债券投资收益 | - | 3,880,062.95 |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |
| 衍生工具收益 | - | - |
| 股利收益 | 30,183,729.06 | 22,687,286.24 |
| 3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列) | -3,137,504,654.85 | 8,826,165.84 |
| 4.其他收入(损失以"-"号填列) | -3,282,027.68 | -368,820.66 |
| 二.费用 | 21,372,267.18 | 16,144,527.04 |
| 1. 管理人报酬 | 14,263,849.59 | 10,004,146.37 |
| 2. 托管费 | 2,852,769.92 | 2,000,829.26 |
| 3. 销售服务费 | - | - |
| 4. 交易费用 | 4,033,381.45 | 3,911,158.99 |
| 5. 利息支出 | - | - |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | - | - |
| 6. 其他费用 | 222,266.22 | 228,392.42 |
| 三.利润总额 | -3,296,741,238.04 | 2,951,238,015.74 |

所附附注为本会计报表的组成部分

3、所有者权益(基金净值)变动表

易方达深证100交易型开放式指数基金

所有者权益(基金净值)变动表

2008年1月1日-2008年6月30日

单位:人民币元

| 项 目 | 2008年1月1日-2008年6月30日 | | |
|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 1,217,684,359.51 | 5,038,700,673.89 | 6,256,385,033.40 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润) | - | -3,296,741,238.04 | -3,296,741,238.04 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(减少以"-"号填列) | 180,098,628.88 | 729,828,298.55 | 909,926,927.43 |
| 其中:1.基金申购款 | 1,203,817,150.61 | 3,645,560,344.61 | 4,849,377,495.22 |
| 2.基金赎回款 | -1,023,718,521.73 | -2,915,732,046.06 | -3,939,450,567.79 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数 | - | - | - |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 1,397,782,988.39 | 2,471,787,734.40 | 3,869,570,722.79 |
| | 2007年1月1日-2007年6月30日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 1,696,894,161.34 | 1,452,020,428.71 | 3,148,914,590.05 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润) | - | 2,951,238,015.74 | 2,951,238,015.74 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(减少以"-"号填列) | -741,458,682.38 | -1,697,458,366.03 | -2,438,917,048.41 |
| 其中:1.基金申购款 | 701,436,765.01 | 1,566,806,373.24 | 2,268,243,138.25 |
| 2.基金赎回款 | -1,442,895,447.39 | -3,264,264,739.27 | -4,707,160,186.66 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数 | - | - | - |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 955,435,478.96 | 2,705,800,078.42 | 3,661,235,557.38 |

所附附注为本会计报表的组成部分

(二)易方达深证100交易型开放式指数基金会计报表附注

附注1. 本基金半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表一致。

附注2. 重大会计差错的内容和更正金额

本报告期无重大会计差错。

附注3. 关联方关系及关联方交易

(1)主要关联方关系

| 企业名称 | 与本基金的关系 |
|---|---|
| 易方达基金管理有限公司 | 基金管理人 |
| 中国银行股份有限公司(以下简称"中国银行") | 基金托管人 |
| 广发证券股份有限公司(以下简称"广发证券") | 基金管理人股东 |
| 广东粤财信托有限公司 | 基金管理人股东 |
| 广东盈峰集团有限公司 | 基金管理人股东 |
| 广东省广晟资产经营有限公司 | 基金管理人股东 |
| 广州市广永国有资产经营有限公司 | 基金管理人股东 |

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(2)通过主要关联方席位进行的交易

2008年1月1日至2008年6月30日交易情况如下:

| 券商名称 | 股票成交金额 | 比例% | 债券成交金额 | 比例% | 债券回购成交金额 | 比例% | 权证成交金额 | 比例% | 佣金 | 比例% |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 广发证券 | 369,304,890.69 | 25.19 | - | - | - | - | - | - | 300,063.96 | 25.19 |

2007年1月1日至2007年6月30日交易情况如下:

| 券商名称 | 股票成交金额 | 比例% | 债券成交金额 | 比例% | 债券回购成交金额 | 比例% | 权证成交金额 | 比例% | 佣金 | 比例% |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 广发证券 | 108,133,145.59 | 7.67 | 7,888,819.22 | 66.15 | - | - | - | - | 84,615.00 | 7.67 |

说明:

上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

向关联方支付的交易佣金采用公允的交易佣金比率计算。关联方席位租用合同范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

(3)关联方报酬

A 基金管理人报酬

支付基金管理人易方达基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日基金管理人报酬=前一日基金资产净值 × 0.5%/当年天数。

本基金于本期应支付基金管理人管理费共计人民币14,263,849.59元(2007年1月1日至2007年6月30日:10,004,146.37元),其中已支付基金管理人人民币12,446,848.14元,尚余人民币1,817,001.45元未支付。

B 基金托管人报酬

支付基金托管人中国银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日基金托管费=前一日基金资产净值 × 0.10%/当年天数。

本基金于本期应支付基金托管人托管费共计人民币2,852,769.92元(2007年1月1日至2007年6月30日:2,000,829.26元),其中已支付基金托管人人民币2,489,369.62元,尚余人民币363,400.30元未支付。

(4)与关联方进行的银行间同业市场债券(含回购)交易

本报告期和2007年1月1日至2007年6月30日期间均无通过关联方进行的银行间同业市场债券(含回购)交易。

(5)由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管,并按同业存款利率计息。由基金托管人保管的银行存款余额及产生的利息收入情况如下:

单位:元

| | 2008-6-30 | 2007-6-30 |
|---|---|---|
| 银行存款余额 | 9,258,465.53 | 10,457,362.82 |
| | 2008年1月1日至2008年6月30日 | 2007年1月1日至2007年6月30日 |
| 银行存款产生的利息收入 | 52,539.20 | 43,214.58 |

(6)本基金参与关联方主承销证券的情况

A 参与关联方主承销的公开发行证券情况

本报告期和2007年1月1日至2007年6月30日期间均无参与关联方主承销的公开发行证券的情况。

B 参与关联方主承销的非公开发行证券情况

本报告期和2007年1月1日至2007年6月30日期间均无参与关联方主承销的非公开发行证券情况。

(7)关联方投资本基金的情况

A 基金管理人所持有的本基金份额

本报告期和2007年1月1日至2007年6月30日期间易方达基金管理有限公司均未持有本基金份额。

B 基金管理人主要股东及其控制的机构所持有的本基金份额

| 关联方名称 | 2008年06月30日 | | 2007年06月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 持有基金份额(份) | 占基金总份额比例 | 持有基金份额(份) | 占基金总份额比例 |
| 广发证券 | - | - | 6,910,600 | 0.76% |

附注4. 报告期末流通转让受到限制的基金资产

截至2008年6月30日,本基金股票投资部分持有以下因将公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,这些股票将在重要信息披露完成后或所公布事项的重大影响消除后并经交易所批准后复牌。

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量 | 期末成本总额 | 期末估值总额 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 000024 | 招商地产 | 2008-6-30 | 公告重大事项 | 14.94 | 2008-7-1 | 14.50 | 2,014,515 | 59,992,920.73 | 30,096,854.10 |
| 000089 | 深圳机场 | 2008-6-30 | 公告重大事项 | 6.13 | 2008-7-1 | 6.21 | 2,738,062 | 25,517,220.48 | 16,784,320.06 |
| 000792 | 盐湖钾肥 | 2008-6-26 | 公告重大事项 | 88.12 | 未知 | 未知 | 1,631,883 | 111,884,309.75 | 143,801,529.96 |
| 合 计 | | | | | | | | 197,394,450.96 | 190,682,704.12 |

截至2008年6月30日止,基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款。

本基金无因认购新发或增发证券而于期末持有的流通受限证券。

附注5. 期末买断式逆回购中取得的债券

无。

附注6. 按新会计准则调整对比数据说明

按原会计准则和制度列报的2007年6月30日的所有者权益,以及按原会计准则和制度列报的2007年1月1日至2007年6月30日止期间的净损益调整为按企业会计准则列报的所有者权益及净损益的调节过程列示如下:

| 项目 | 2007年年初所有者权益 | 2007年1月1日至2007年6月30日止期间净损益 | 2007年6月30日所有者权益 |
|---|---|---|---|
| 按原会计准则列报的金额 | 3,148,914,590.05 | 2,942,411,849.90 | 3,661,235,557.38 |
| 金融资产公允价值变动的调整数 | - | 8,826,165.84 | - |
| 按新会计准则列报的金额 | 3,148,914,590.05 | 2,951,238,015.74 | 3,661,235,557.38 |

根据上述追溯调整,按原会计准则和制度直接记入所有者权益下"未实现利得/(损失)"科目的投资估值增值/(减值)净变动现按企业会计准则在利润表中的"公允价值变动收益/(损失)"科目中核算,相应的未实现损益平准金现按企业会计准则直接记入"未分配利润/(累计亏损)"科目。于会计期末,按原会计准则和制度列示于所有者权益下"未实现利得/(损失)"科目中的全部余额,现按企业会计准则包含于"未分配利润/(累计亏损)"科目中。

**六、投资组合报告**

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 | 3,857,600,066.87 | 99.55% |
| 债券 | 1,434,654.96 | 0.04% |
| 权证 | - | - |
| 资产支持证券 | - | - |
| 银行存款和结算备付金合计 | 14,433,913.14 | 0.37% |
| 其他资产 | 1,551,130.91 | 0.04% |
| 总计 | 3,875,019,765.88 | 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 | 250,711,596.17 | 6.48% |
| C 制造业 | 2,057,921,731.18 | 53.18% |
| C0 食品、饮料 | 372,544,419.82 | 9.63% |
| C1 纺织、服装、皮毛 | 29,005,925.58 | 0.75% |
| C2 木材、家具 | - | - |
| C3 造纸、印刷 | 35,528,448.80 | 0.92% |
| C4 石油、化学、塑胶、塑料 | 267,396,512.95 | 6.91% |
| C5 电子 | 71,726,269.91 | 1.85% |
| C6 金属、非金属 | 656,819,576.30 | 16.97% |
| C7 机械、设备、仪表 | 415,685,680.56 | 10.74% |
| C8 医药、生物制品 | 190,313,965.10 | 4.92% |
| C99 其他制造业 | 18,900,932.16 | 0.49% |
| D 电力、煤气及水的生产和供应业 | 109,492,291.93 | 2.83% |
| E 建筑业 | 21,871,676.44 | 0.57% |
| F 交通运输、仓储业 | 83,853,374.16 | 2.17% |
| G 信息技术业 | 200,647,701.66 | 5.19% |
| H 批发和零售贸易 | 199,628,465.34 | 5.16% |
| I 金融、保险业 | 234,189,098.03 | 6.05% |
| J 房地产业 | 538,214,949.36 | 13.91% |
| K 社会服务业 | 82,142,746.11 | 2.12% |
| L 传播与文化产业 | 21,702,687.04 | 0.56% |
| M 综合类 | 57,223,749.45 | 1.48% |
| 合计 | 3,857,600,066.87 | 99.69% |

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 | 40,096,726 | 361,271,501.26 | 9.34% |
| 2 | 002024 | 苏宁电器 | 4,283,379 | 176,903,552.70 | 4.57% |
| 3 | 000001 | 深发展A | 8,454,286 | 163,421,348.38 | 4.22% |
| 4 | 000858 | 五粮液 | 8,588,467 | 156,481,868.74 | 4.04% |
| 5 | 000792 | 盐湖钾肥 | 1,631,883 | 143,801,529.96 | 3.72% |
| 6 | 000063 | 中兴通讯 | 2,272,035 | 142,229,391.00 | 3.68% |
| 7 | 000983 | 西山煤电 | 2,397,124 | 119,856,200.00 | 3.10% |
| 8 | 000568 | 泸州老窖 | 3,024,072 | 90,994,326.48 | 2.35% |
| 9 | 000651 | 格力电器 | 2,522,416 | 78,951,620.80 | 2.04% |
| 10 | 000629 | 攀钢钒钛 | 7,970,701 | 73,250,742.19 | 1.89% |

4、本报告期股票投资组合的重大变动

(1)本期累计买入、累计卖出价值占期初基金资产净值比例前二十名的股票明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额(元) | 占期初基金资产净值的比例 |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 000100 | TCL集团 | 69,546,207.40 | 1.11% |
| 2 | 000858 | 五粮液 | 61,700,789.51 | 0.99% |
| 3 | 000690 | 宝新能源 | 53,162,810.53 | 0.85% |
| 4 | 000001 | 深发展A | 51,361,730.38 | 0.82% |
| 5 | 000878 | 云南铜业 | 44,951,810.26 | 0.72% |
| 6 | 000402 | 金融街 | 40,208,411.08 | 0.64% |
| 7 | 002092 | 中泰化学 | 35,431,754.91 | 0.57% |
| 8 | 000667 | 名流置业 | 34,819,602.16 | 0.56% |
| 9 | 000800 | 一汽轿车 | 31,193,498.99 | 0.50% |
| 10 | 002142 | 宁波银行 | 30,793,126.51 | 0.49% |
| 11 | 000511 | 银基发展 | 29,439,760.21 | 0.47% |
| 12 | 002097 | 山河智能 | 28,222,959.57 | 0.45% |
| 13 | 000046 | 泛海建设 | 26,947,184.60 | 0.43% |
| 14 | 000831 | 关铝股份 | 24,458,385.81 | 0.39% |
| 15 | 000532 | 力合股份 | 22,547,967.37 | 0.36% |
| 16 | 000825 | 太钢不锈 | 16,277,120.09 | 0.26% |
| 17 | 000527 | 美的电器 | 15,640,644.00 | 0.25% |
| 18 | 000063 | 中兴通讯 | 15,092,245.46 | 0.24% |
| 19 | 000651 | 格力电器 | 14,512,180.38 | 0.23% |
| 20 | 002024 | 苏宁电器 | 12,665,506.58 | 0.20% |

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额(元) | 占期初基金资产净值的比例 |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 000002 | 万科A | 47,540,967.33 | 0.76% |
| 2 | 000800 | 一汽轿车 | 33,931,402.96 | 0.54% |
| 3 | 002028 | 思源电气 | 22,589,413.96 | 0.36% |
| 4 | 002024 | 苏宁电器 | 22,211,486.38 | 0.36% |
| 5 | 002122 | 天马股份 | 21,736,932.45 | 0.35% |
| 6 | 000550 | 江铃汽车 | 20,209,856.15 | 0.32% |
| 7 | 000659 | 珠海中富 | 19,672,424.37 | 0.31% |
| 8 | 000939 | 凯迪电力 | 18,775,677.70 | 0.30% |
| 9 | 000601 | 韶能股份 | 17,790,768.90 | 0.28% |
| 10 | 000970 | 中科三环 | 17,226,000.46 | 0.28% |
| 11 | 000726 | 鲁泰A | 15,468,357.62 | 0.25% |
| 12 | 000001 | 深发展A | 14,685,489.79 | 0.23% |
| 13 | 000792 | 盐湖钾肥 | 14,092,856.16 | 0.23% |
| 14 | 002056 | 横店东磁 | 13,232,240.75 | 0.21% |
| 15 | 000927 | 一汽夏利 | 12,439,457.89 | 0.20% |
| 16 | 000898 | 鞍钢股份 | 12,220,100.60 | 0.20% |
| 17 | 000063 | 中兴通讯 | 11,663,110.59 | 0.19% |
| 18 | 000069 | 华侨城A | 11,384,916.58 | 0.18% |
| 19 | 000568 | 泸州老窖 | 11,003,831.60 | 0.18% |
| 20 | 000527 | 美的电器 | 10,640,016.13 | 0.17% |

(2)本报告期买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

| 项目 | 金额(元) |
|---|---|
| 买入股票的成本总额 | 851,420,697.94 |
| 卖出股票的收入总额 | 637,885,084.01 |

5、 报告期末按券种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 市值(元) | 占基金资产净值比例 |
|---|---|---|---|
| 1 | 国 债 | - | - |
| 2 | 金融债 | - | - |
| 3 | 央行票据 | - | - |
| 4 | 企业债 | - | - |
| 5 | 可转债 | 1,434,654.96 | 0.04% |
| | 合 计 | 1,434,654.96 | 0.04% |

6、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

| 序号 | 债券名称 | 市值(元) | 占基金资产净值比例 |
|---|---|---|---|
| 1 | 柳工转债 | 1,434,654.96 | 0.04% |

7、投资组合报告附注

(1)投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于基金管理人网站www.funds.com.cn的半年度报告正文。

(2)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。

(3)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。

(4)其他资产:

| 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 | 543,848.46 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 7,282.45 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| | 合计 | 1,551,130.91 |

(5)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处于转股期的可转换债券。

(6)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。

(7)报告期内获得的权证明细

本报告期内本基金未获得权证。

(8)报告期内持有资产支持证券的情况

本报告期内本基金未持有资产支持证券。

(9)报告期内基金管理人持有本基金的情况

本报告期内基金管理人未持有本基金。

**七、基金份额持有人户数、持有人结构**

1、报告期末基金份额持有人户数

| | |
|---|---|
| 报告期末基金份额持有人户数 | 75,093户 |
| 报告期末平均每户持有基金份额 | 17,673.64份 |

2、报告期末基金份额持有人结构

| 项目 | 数量(份) | 占总份额的比例 |
|---|---|---|
| 基金份额总额: | 1,327,166,634 | 100% |
| 其中:机构投资者持有的基金份额 | 549,584,016 | 41.41% |
| 个人投资者持有的基金份额 | 777,582,618 | 58.59% |