

易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接  
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

二〇一〇年七月

## 重要提示

本基金为易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“深证 100ETF”）的联接基金，将绝大部分基金财产投资于深证 100ETF，实现对业绩比较基准的紧密跟踪，追求跟踪偏离度及跟踪误差最小化，并采用开放式基金的运作方式。本基金根据 2009 年 9 月 16 日中国证券监督管理委员会《关于核准易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的批复》（证监许可[2009]947 号）和 2009 年 10 月 21 日《关于深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集时间安排的确认函》（基金部函[2009]677 号）的核准，进行募集。本基金的基金合同于 2009 年 12 月 1 日正式生效。

本摘要根据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，应详细查阅基金合同。

基金管理人保证《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。

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。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等等。投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

投资有风险，投资者投资本基金时应认真阅读招募说明书；基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本基金为深证 100ETF 的联接基金，二者既有联系也有区别：（1）在基金的投资方法方面，深证 100ETF 主要采取完全复制法，直接投资于标的指数的成份股；而本基金则采取间

接的方法，通过将绝大部分基金财产投资于深证 100ETF，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。

(2) 在交易方式方面，投资者既可以像股票一样在交易所市场买卖深证 100ETF，也可以按照最小申赎单位和申赎清单的要求，实物申赎深证 100ETF；而本基金则像普通的开放式基金一样，通过基金管理人及代销机构按未知价法进行基金的申购与赎回。

本基金与深证 100ETF 业绩表现可能出现差异。可能引发差异的因素主要包括：(1) 法规对投资比例的要求。深证 100ETF 作为一种特殊的基金品种，可将全部或接近全部的基金资产，用于跟踪标的指数的表现；而本基金作为普通的开放式基金，仍需将不低于基金资产净值 5% 的资产投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券。(2) 申购赎回的影响。深证 100ETF 采取实物申赎的方式，申购赎回对基金净值影响较小；而本基金申赎采取现金方式，大额申赎可能会对基金净值产生一定冲击。

本招募说明书中基金投资组合报告和基金业绩中的数据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 2010 年 6 月 1 日，有关财务数据截止日为 2010 年 3 月 31 日，净值表现截止日为 2010 年 3 月 31 日。(本报告中财务数据未经审计)

## 一、基金管理人

### (一) 基金管理人基本情况

1. 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、26、27、28 楼

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会，证监基金字[2001]4 号

法定代表人：梁棠

设立日期：2001 年 4 月 17 日

组织形式：有限责任公司

注册资本：12,000 万元人民币

存续期限：持续经营

联系人：吴薇

联系电话：400 881 8088

2. 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。

杨力先生，董事，学士，1975 年生。历任美的集团空调事业部技术主管、企划经理，佛山顺德百年科技有限公司行政总监，美的空调深圳营销中心区域经理，佛山顺德创佳电器有限公司董事、副总经理，长虹空调广州营销中心营销总监。现任广东盈峰投资控股集团有限公司战略总监、董事、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 10 月生，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，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成员，上海、广州、深圳、厦门、珠海、佛山、肇庆、惠州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

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，现任指数与量化投资部总经理助理、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）、易方达沪深300指数基金基金经理（自2009年8月26日起）和易方达深证100交易型开放式指数基金联接基金基金经理（自2009年12月1日起）。

## 3. 投资决策委员会成员

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

陈志民先生，1971年出生，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、基金投资部总经理，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、易方达积极成长基金基金经理。

吴欣荣先生，1975年出生，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。现任易方达基金管理有限公司研究部总经理、易方达价值精选股票型证券投资基金基金经理和易方达科汇灵活配置混合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、基金投资部副总经理，现任易方达基金管理有限公司基金投资部总经理、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。

### （三）基金管理人的职责

1. 依法募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回、转换和登记事宜；
2. 办理基金备案手续；
3. 对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；
4. 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
5. 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
6. 编制半年度和年度基金报告；
7. 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
8. 办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
9. 召集基金份额持有人大会；
10. 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
11. 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
12. 国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

### （四）基金管理人的承诺

1. 本基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会有关规定的行为发生。
2. 本基金管理人承诺严格遵守《证券法》、《基金法》及有关法律法规，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：
  - （1） 将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
  - （2） 不公平地对待其管理的不同基金财产；



- (3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人谋取利益;
  - (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;
  - (5) 法律法规或中国证监会禁止的其他行为。
3. 本基金管理人承诺加强人员管理, 强化职业操守, 督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范, 诚实信用、勤勉尽责, 不从事以下活动:
- (1) 越权或违规经营;
  - (2) 违反基金合同或托管协议;
  - (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益;
  - (4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假;
  - (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管;
  - (6) 玩忽职守、滥用职权;
  - (7) 违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定, 泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密, 尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息;
  - (8) 违反证券交易场所业务规则, 利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格, 扰乱市场秩序;
  - (9) 贬损同行, 以抬高自己;
  - (10) 以不正当手段谋求业务发展;
  - (11) 有悖社会公德, 损害证券投资基金人员形象;
  - (12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分;
  - (13) 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

#### 4. 基金经理承诺

- (1) 依照有关法律、法规和基金合同的规定, 本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益;
- (2) 不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益;
- (3) 不违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定, 泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息;
- (4) 不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。



## （五）基金管理人的内部控制制度

为保证公司规范化运作，有效地防范和化解经营风险，促进公司诚信、合法、有效经营，保障基金份额持有人利益，维护公司及公司股东的合法权益，本基金管理人建立了科学、严密、高效的内部控制体系。

### 1. 公司内部控制的总体目标

- （1）保证公司经营管理活动的合法合规性；
- （2）保证基金份额持有人的合法权益不受侵犯；
- （3）实现公司稳健、持续发展，维护股东权益；
- （4）促进公司全体员工恪守职业操守，正直诚信，廉洁自律，勤勉尽责；
- （5）保护公司最重要的资本：公司声誉。

### 2. 公司内部控制遵循的原则

- （1）全面性原则：内部控制必须覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节，并普遍适用于公司每一位职员；
- （2）审慎性原则：内部控制的核心是有效防范各种风险，公司组织体系的构成、内部管理制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点；
- （3）相互制约原则：公司设置的各部门、各岗位权责分明、相互制衡。
- （4）独立性原则：公司根据业务的需要设立相对独立的机构、部门和岗位；公司内部部门和岗位的设置必须权责分明；
- （5）有效性原则：各种内部管理制度具有高度的权威性，应是所有员工严格遵守的行动指南；执行内部管理制度不能有任何例外，任何人不得拥有超越制度或违反规章的权力；
- （6）适时性原则：内部控制应具有前瞻性，并且必须随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修改和完善；
- （7）成本效益原则：公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，力争以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

### 3. 内部控制的制度体系

公司制定了合理、完备、有效并易于执行的制度体系。公司制度体系由不同层面的制度构成。按照其效力大小分为四个层面：第一个层面是公司章程；第二个层面是公司内部控制大纲，它是公司制定各项规章制度的基础和依据；第三个层面是公司基本管理制度；第四个层面是公司各机构、部门根据业务需要制定的各种制度及实施细则等。它们的制订、修改、实施、废止应该遵循相应的程序，每一层面的内容不得与其以上层面的内容相违背。公司重视对制度的持续检验，结合业务的发展、法规及监管环境的变化以及公司风险控制的要求，不断检讨和增强公司制度的完备性、有效性。

### 4. 关于授权、研究、投资、交易等方面的控制点

#### (1) 授权制度

公司的授权制度贯穿于整个公司活动。股东会、董事会、监事会和管理层必须充分履行各自的职权，健全公司逐级授权制度，确保公司各项规章制度的贯彻执行；各项经济经营业务和管理程序必须遵从管理层制定的操作规程，经办人员的每一项工作必须是在业务授权范围内进行。公司重大业务的授权必须采取书面形式，授权书应当明确授权内容和时效。公司授权要适当，对已获授权的部门和人员应建立有效的评价和反馈机制，对已不适用的授权应及时修改或取消授权。

#### (2) 公司研究业务

研究工作应保持独立、客观，不受任何部门及个人的不正当影响；建立严密的研究工作业务流程，形成科学、有效的研究方法；建立投资产品备选库制度，研究部门根据投资产品的特征，在充分研究的基础上建立和维护备选库。建立研究与投资的业务交流制度，保持畅通的交流渠道；建立研究报告质量评价体系，不断提高研究水平。

#### (3) 基金投资业务

基金投资应确立科学的投资理念，根据决策的风险防范原则和效率性原则制定合理的决策程序；在进行投资时应有明确的投资授权制度，并应建立与所授权限相应的约束制度和考核制度。建立严格的投资禁止和投资限制制度，保证基金投资的合法合规性。建立投资风险评估与管理制，将重点投资限制在规定的风险权限额度内；对于投资结果建立科学的投资管理业绩评价体系。

#### (4) 交易业务

建立集中交易室和集中交易制度，投资指令通过集中交易室完成；应建立交易监测系统、

预警系统和交易反馈系统，完善相关的安全设施；集中交易室应对交易指令进行审核，建立公平的交易分配制度，确保各基金利益的公平；交易记录应完善，并及时进行反馈、核对和存档保管；同时应建立科学的投资交易绩效评价体系。

#### (5) 基金会计核算

公司根据法律法规及业务的要求建立会计制度，并根据风险控制点建立严密的会计系统，对于不同基金、不同客户独立建账，独立核算；公司通过复核制度、凭证制度、合理的估值方法和估值程序等会计措施真实、完整、及时地记载每一笔业务并正确进行会计核算和业务核算。同时还建立会计档案保管制度，确保档案真实完整。

#### (6) 信息披露

公司建立了完善的信息披露制度，保证公开披露的信息真实、准确、完整。公司设立了信息披露负责人，并建立了相应的程序进行信息的收集、组织、审核和发布工作，以此加强对信息的审查核对，使所公布的信息符合法律法规的规定，同时加强对信息披露的检查和评价，对存在的问题及时提出改进办法。

#### (7) 监察稽核

公司设立督察长，经董事会聘任，报中国证监会核准。根据公司监察稽核工作的需要和董事会授权，督察长可以列席公司相关会议，调阅公司相关档案，就内部控制制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能。督察长定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况，董事会对督察长的报告进行审议。

公司设立监察部开展监察稽核工作，并保证监察部的独立性和权威性。公司明确了监察部及内部各岗位的具体职责，严格制订了专业任职条件、操作程序和组织纪律。

监察部强化内部检查制度，通过定期或不定期检查内部控制制度的执行情况，促使公司各项经营管理活动的规范运行。

公司董事会和管理层充分重视和支持监察稽核工作，对违反法律、法规和公司内部控制制度的，追究有关部门和人员的责任。

### 5. 基金管理人关于内部控制制度声明书

- (1) 本公司承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；
- (2) 本公司承诺根据市场变化和公司业务发展不断完善内部控制制度。

## 二、基金托管人

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：唐州徽

电话：(010) 66594855

传真：(010) 66594942

## 三、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1. 直销机构

##### （1）易方达基金管理有限公司

办公地址：广州市体育西路 189 号城建大厦 25、26、27、28 楼

法定代表人：梁棠

电话：020-38797023

传真：400 881 8099

联系人：熊桃红

网址：www.efunds.com.cn

##### （2）易方达基金管理有限公司北京分公司

办公地址：北京市金融大街 19 号富凯大厦 B1007 室

电话：010-66574378

传真：400 881 8099

联系人：魏巍

##### （3）易方达基金管理有限公司上海分公司

办公地址：上海市世纪大道 88 号金贸大厦 2307 室

电话：021-50472350

传真：400 881 8099

联系人：王璟

## 2. 代销机构

### (1) 中国银行

住所：北京市复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市复兴门内大街 1 号

法定代表人：肖钢

客户服务电话：95566

传真：(010) 66594946

网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

### (2) 中国工商银行

地址：北京西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

客户服务电话：95588

网址：[www.icbc.com.cn](http://www.icbc.com.cn)

### (3) 中国建设银行

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：郭树清

客户服务电话：95533

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

### (4) 中国农业银行

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：项俊波

客户服务电话：95599

网址：[www.abchina.com](http://www.abchina.com)

### (5) 交通银行

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：胡怀邦

联系人：曹榕

电话：(021) 58781234

传真：(021) 58408483

客户服务电话：95559

网址：www.bankcomm.com

(6) 招商银行

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：秦晓

联系人：丰靖

客户服务电话：95555

网址：www.cmbchina.com

(7) 中信银行

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人：孔丹

客户服务电话：95558

联系人：郭伟

电话：010-65557048

传真：010-65550827

网址：<http://bank.ecitic.com>

(8) 深圳发展银行

注册地址：广东省深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

办公地址：广东省深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

法定代表人：法兰克纽曼 (Frank N. Newman)

联系人：张青

联系电话：0755-82088888

客户服务电话：95501

网址：[www.sdb.com.cn](http://www.sdb.com.cn)

(9) 民生银行

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：董文标

联系人：董云巍 吴海鹏

电话：010-58351666

传真：010-83914283

客户服务电话：95568

网址：www.cmbc.com.cn

(10) 浦发银行

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市北京东路 689 号东银大厦

法定代表人：吉晓辉

联系人：倪苏云

电话：(021) 61618888

传真：(021) 63604199

客户服务电话：95528

网址：www.spdb.com.cn

(11) 上海银行

注册地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

法定代表人：宁黎明

联系人：张萍

联系电话：021-68475888

开放式基金咨询电话：021-962888

开放式基金业务传真：021-68476111

网址：www.bankofshanghai.com

(12) 北京银行

地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层

法定代表人：闫冰竹

联系人：王曦

联系电话：010-66223584

客户服务电话：010-96169（北京） 022-96269（天津） 021-53599688（上海）



029-85766888（西安） 0755-23957088（深圳）

网址：[www.bankofbeijing.com.cn](http://www.bankofbeijing.com.cn)

(13) 平安银行

注册地址：深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦

办公地址：深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦

法定代表人：孙建一

联系人：霍兆龙

联系电话：0755-25859591

开放式基金业务传真：0755-25879453

客户服务电话：40066-99999（免长途费）或 0755-961202

网址：[www.pingan.com](http://www.pingan.com)

(14) 中国光大银行

注册地址：北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦

法定代表人：唐双宁

联系人：薛军丽

电话：010-68098777

传真：010-68560661

客户服务电话：95595（全国）

网址：[www.cebbank.com](http://www.cebbank.com)

(15) 广发银行

注册地址：广东省广州市农林下路 83 号

办公地址：广东省广州市农林下路 83 号

法定代表人：董建岳

客户服务电话：800-830-8003；400-830-8003

网址：[www.gdb.com.cn](http://www.gdb.com.cn)

(16) 东莞银行

注册地址：东莞市运河东一路 193 号

办公地址：东莞市运河东一路 193 号

法定代表人：廖玉林

客户服务电话：0769-96228

网址: [www.dongguanbank.cn](http://www.dongguanbank.cn)

(17) 上海农村商业银行

注册地址: 中国上海市浦东新区浦东大道 981 号

办公地址: 上海市银城中路 8 号中融碧玉蓝天大厦 16 层

法定代表人: 胡平西

联系人: 吴海平

联系电话: 021-38576977

开放式基金咨询电话: 021-962999

开放式基金业务传真: 021-50105124

网址: [www.srcb.com](http://www.srcb.com)

(18) 兴业银行

注册地址: 福州市湖东路 154 号中山大厦

法定代表人: 高建平

联系人: 曾鸣

电话: (021) 52629999

客户服务电话: 95561, 或拨打当地咨询电话

网址: [www.cib.com.cn](http://www.cib.com.cn)

(19) 江苏银行

注册地址: 南京市洪武北路 55 号

法定代表人: 黄志伟

客户服务电话: 96098, 40086-96098

联系人: 田春慧, 法晓宁

电话: 025-58588167, 025-58588071

传真: 025-58588164

网址: [www.jsbchina.cn](http://www.jsbchina.cn)

(20) 杭州银行

注册地址: 杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦

办公地址: 杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦

法定代表人: 马时雍

联系人: 严峻

联系电话：0571-85108195

传真：0571-85106576

客户服务电话：4008888508 或 0571-96523

网址：www.hzbank.com.cn

(21) 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：黄岚

开放式基金业务传真：(020) 87555305

客户服务电话：95575

网址：www.gf.com.cn

(22) 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：顾伟国

联系人：李洋

客户服务电话：400-888-8888

网址：www.chinastock.com.cn

(23) 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

(24) 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

法定代表人：何如

联系人：齐晓燕

电话：0755-82130833

传真：0755-82133302

客户服务电话：95536

网址：[www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

(25) 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

客户服务电话：021-962505

网址：[www.sywg.com](http://www.sywg.com)

(26) 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

联系人：黄健

电话：0755-82943666

传真：0755-82943636

客户服务电话：95565、4008881111

网址：[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

(27) 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：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：张佑君

开放式基金咨询电话：400888108

开放式基金业务传真：(010) 65182261

网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

(28) 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

联系人：舒萌菲

开放式基金咨询电话：95597

开放式基金业务传真：025-84579763

网址：www.htsc.com.cn

(29) 海通证券

注册地址：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：王开国

联系人：金芸、李笑鸣

电话：021-23219000

传真：021-23219100

客户服务电话：95553、400-8888-001

网址：www.htsec.com

(30) 华泰联合证券

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

传真：0755-82492962

开放式基金咨询电话：95513，400-8888-555

开放式基金业务传真：0755-82492962

网址：www.lhzq.com

(31) 长江证券

注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

联系人：李良

电话：021-63219781

传真：021-51062920

客户服务电话：4008-888-999 或 027-85808318

网址：www.95579.com

(32) 长城证券

注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人：黄耀华

联系人：匡婷

电话：0755-83516289

传真：0755-83516199

客户服务电话：0755-82288968

网址：www.cc168.com.cn

(33) 国联证券

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

法定代表人：雷建辉

联系人：袁丽萍

开放式基金咨询电话：400-888-5288, 0510-82588168

开放式基金业务传真：0510-82830162

网址：www.glsc.com.cn

(34) 平安证券

注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼（518048）

法定代表人：杨宇翔

联系人：周璐

客户服务电话：4008816168

开放式基金业务传真：0755-82400862

网址：www.pingan.com

(35) 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：陈琳琳

开放式基金咨询电话：95578 和 400-8888-777

开放式基金业务传真：0551-2272100

网址：www.gyzq.com.cn

(36) 国都证券

注册地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法定代表人：王少华

联系人：黄静

联系电话：010-84183333

客户服务电话：400-818-8118

开放式基金业务传真：010-84183311-3389

网址：www.guodu.com

(37) 世纪证券

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 41/42 楼

法定代表人：卢长才

联系人：章磊

联系电话：0755-83199511

开放式基金咨询电话：0755-83199511

开放式基金业务传真：0755-83199545

网址：www.csco.com.cn

(38) 山西证券

办公地址：山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

注册地址：山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

法定代表人：侯巍

联系人：张治国

联系电话：0351-8686703

传真：0351-8686619

客户服务电话：400-666-1618



网址: [www.i618.com.cn](http://www.i618.com.cn)

(39) 东吴证券

注册地址: 苏州市工业园区翠园路 181 号商旅大厦 18-21 层

办公地址: 苏州市工业园区翠园路 181 号商旅大厦 18-21 层

法定代表人: 吴永敏

联系人: 方晓丹

电话: 0512-65581136

传真: 0512- 65588021

客户服务电话: 0512- 33396288

网址: [www.dwzq.com.cn](http://www.dwzq.com.cn)

(40) 安信证券

注册地址: 深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址: 深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

法定代表人: 牛冠兴

联系人: 陈剑虹

联系电话: 0755-82558305

开放式基金咨询电话: 4008001001

开放式基金业务传真: 0755-82558355

网址: [www.essence.com.cn](http://www.essence.com.cn)

(41) 万联证券

注册地址: 广州市中山二路 18 号广东电信广场 36-37 层

办公地址: 广州市中山二路 18 号广东电信广场 36-37 层

法定代表人: 张建军

联系人: 罗创斌

联系电话: 020-37865070

开放式基金业务传真: 020-22373718-1013

客户服务电话: 400-8888-133

网址: [www.wlzq.com.cn](http://www.wlzq.com.cn)

(42) 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

联系人：徐翔

联系电话：025-83367888-4201

传真：025-83320066

客户服务电话：400-828-5888

网址：www.njzq.com.cn

(43) 财富证券

注册地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼（410005）

办公地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼（410005）

法定代表人：周晖

联系人：郭磊

联系电话：0731-84403360 或 0731-84403319

业务投诉电话：0731-84403350

开放式基金业务传真：0731-84403439

网址：www.cfzq.com

(44) 东莞证券

注册地址：东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼

办公地址：东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼

法定代表人：游锦辉

联系人：张建平 0769-22119423

开放式基金咨询电话：0769-961130

开放式基金业务传真：0769-22119423

网站：www.dgzq.com.cn

(45) 金元证券

注册地址：海南省海口市南宝路 36 号证券大厦 4 层

办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 17 层

法定代表人：陆涛

联系人：金春

电话：0755-83025695

传真：0755-83025625

客户服务电话：400-8888-228

网址：www.jyzq.com.cn

(46) 国海证券

注册地址：广西南宁市滨湖路 46 号

办公地址：深圳市福田区竹子林四路光大银行大厦 30 楼

法定代表人：张雅锋

联系人：武斌

联系电话：0755-83707413

传真：0755-83700205

客户服务电话：4008888100（全国）、96100（广西）

网址：www.ghzq.com.cn

(47) 广州证券

注册地址：广州市先烈中路 69 号东山广场主楼五楼

办公地址：广州市先烈中路 69 号东山广场主楼五楼

法定代表人：吴志明

联系人：林洁茹

电话：020-87322668

传真：020-87325036

客户服务电话：020-961303

网址：www.gzs.com.cn

(48) 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

(49) 渤海证券

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址：天津市南开区宾水西道 8 号

法定代表人：王春峰

联系人：王兆权

电话：022-28451861

传真：022-28451892

客户服务电话：4006515988

网址：www.bhzq.com

(50) 方正证券

注册地址：湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦 22—24 层

办公地址：湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦 22—24 层

法定代表人：雷杰

联系人：邵艳霞

电话：0731—85832343

传真：0731—85832214

客户服务电话：95571

网址：www.foundersc.com

(51) 中投证券

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层至 20 层

办公地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层至 20 层

法定代表人：杨明辉

联系人：刘权

电话：(0755) 82026521

传真：(0755) 82026539

客户服务电话：400-600-8008

网址：www.cjis.cn

(52) 江南证券

注册地址：南昌市抚河北路 291 号

办公地址：南昌市抚河北路 291 号五楼

法定代表人：姚江涛

联系人：余雅娜

电话：0791-6768763

传真：0791-6789414

客户服务电话：0791-6781119

网址：www.scstock.com

(53) 日信证券

注册地址：内蒙古呼和浩特市锡林南路 18 号

法定代表人：洪明

联系人：张利军

联系电话：0471-6292465， 010-88086830-652

咨询电话：010-88086830

传真：010-88086637

网址：www.rxzq.com.cn

(54) 天源证券

注册地址：青海省西宁市长江路 53 号汇通大厦 6 楼

法定代表人：裴东平

联系人：张斌

电话：0755-33331188-8803

传真：0755-33329815

客户服务电话：4006543218

网址：www.tyzq.com.cn

(55) 广发华福证券

注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8、10 层

法定代表人：黄金琳

联系人：张腾

客户服务电话：96326（福建省外请加拨 0591）

网址：www.gfhfzq.com.cn

(56) 信达证券

注册地址：北京市西城区三里河东路 5 号中商大厦 10 层

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼信达金融中心

法定代表人：张志刚

联系人：唐静

联系电话：010-63081000

传真：010-63080978

客户服务电话：400-800-8899

网址：www.cindasc.com

(57) 东兴证券

注册地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层

法定代表人：崔海涛

联系人：黄英

联系电话：010-66555835

传真：010-66555246

客户服务电话：400-8888-993

网址：www.dxzq.net

(58) 华龙证券

注册地址：甘肃省兰州市静宁路 308 号

办公地址：甘肃省兰州市静宁路 308 号

法定代表人：李晓安

联系人：李昕田

联系电话：0931-4890100

传真：0931-4890118

客户服务电话：0931-4890100、4890619、4890618

网址：www.hlzqgs.com

(59) 瑞银证券

注册地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层，100140

办公地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层，100140

法定代表人：刘弘

联系人：谢亚凡、田文健

联系电话：010-58328752

客户服务电话：400-887-8827

网址： [www.ubssecurities.com](http://www.ubssecurities.com)

## （二）基金注册登记机构

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、26、27、28 楼

法定代表人：梁棠

电话： 400 881 8088

传真：020-38799249

联系人：余贤高

## （三）律师事务所和经办律师

名称：北京市天元律师事务所

住所：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 11 层

负责人：王立华

联系电话：(010) 88092188

传真：(010) 88092150

联系人：杨科

经办律师：陈华、杨科

## （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：上海市浦东新区陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 1604-1608 室

法定代表人：杨绍信

联系电话：021-23238888

传真电话：021-23238800

经办注册会计师：汪棣、金毅

联系人：金毅

## 四、基金的名称

本基金名称：易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金



## 五、基金的类型

本基金类型：契约型开放式

## 六、基金的投资目标

紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。

## 七、基金的投资方向

本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括深证 100ETF、深证 100 价格指数成份股及备选成份股、新股(一级市场初次发行和增发)、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

正常情况下，本基金资产中投资于深证 100ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。如果法律法规允许，本基金指数化投资（指对深证 100ETF、深证 100 价格指数成份股及备选成份股的投资）的比例可以提高到基金资产净值的 100%，同时业绩比较基准进行相应变更，该事项无须经基金份额持有人大会同意。

## 八、基金的投资策略

本基金为深证 100ETF 的联接基金。深证 100ETF 是主要采用完全复制法实现对深证 100 价格指数紧密跟踪的全被动指数基金，本基金主要通过投资于深证 100ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争最终将年化跟踪误差控制在 4% 以内。

在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用实物申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行深证 100ETF 的买卖。

待指数衍生金融产品推出以后，本基金可以适度运用衍生金融产品进一步降低跟踪误差。

## 九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：深证 100 价格指数收益率 X95%+活期存款利率(税后) X5%。

如果深证 100ETF 变更业绩比较基准、或深证 100 价格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、或深证 100 价格指数编制方法发生重大变更导致该指数不宜继续作为业绩比较基准的组成部分,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,履行必要手续后,调整业绩比较基准并及时公告。

## 十、基金的风险收益特征

本基金为深证 100ETF 的联接基金,主要通过投资于深证 100ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此,本基金的业绩表现与深证 100 价格指数的表现密切相关。理论上本基金预期风险与收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

## 十一、基金投资组合报告(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 2010 年 6 月 11 日复核了本投资组合报告。

本投资组合报告有关数据的期间为 2010 年 1 月 1 日至 2010 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	185,907,557.00	1.01
	其中:股票	185,907,557.00	1.01
2	基金投资	17,084,185,484.54	93.16
3	固定收益投资	791,000,000.00	4.31
	其中:债券	791,000,000.00	4.31
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	233,337,934.70	1.27
7	其他各项资产	44,051,036.78	0.24
8	合计	18,338,482,013.02	100.00

2. 期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	易方达深证100交易型开放式指数基金	股票型	交易型开放式 (ETF)	易方达基金管理有限公司	17,084,185,484.54	93.80

3. 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	12,537,808.42	0.07
C	制造业	99,289,961.17	0.55
C0	食品、饮料	16,825,048.62	0.09
C1	纺织、服装、皮毛	724,236.50	0.00
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	2,209,054.04	0.01
C4	石油、化学、塑胶、塑料	7,698,195.89	0.04
C5	电子	2,333,502.22	0.01
C6	金属、非金属	24,169,617.16	0.13
C7	机械、设备、仪表	32,032,878.40	0.18
C8	医药、生物制品	11,970,324.74	0.07
C99	其他制造业	1,327,103.60	0.01
D	电力、煤气及水的生产和供应业	4,007,793.52	0.02
E	建筑业	1,050,111.78	0.01
F	交通运输、仓储业	3,724,018.22	0.02
G	信息技术业	10,048,548.90	0.06
H	批发和零售贸易	7,817,749.08	0.04
I	金融、保险业	18,230,765.74	0.10

J	房地产业	21,947,512.14	0.12
K	社会服务业	3,005,841.30	0.02
L	传播与文化产业	959,846.40	0.01
M	综合类	3,287,600.33	0.02
	合计	185,907,557.00	1.02

4. 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	1,160,338	11,023,211.00	0.06
2	000651	格力电器	311,700	8,789,940.00	0.05
3	000001	深发展A	373,245	8,659,284.00	0.05
4	000063	中兴通讯	174,126	7,400,355.00	0.04
5	002024	苏宁电器	363,102	6,822,686.58	0.04
6	000858	五粮液	240,721	6,781,110.57	0.04
7	000983	西山煤电	159,600	5,633,880.00	0.03
8	000623	吉林敖东	70,682	3,230,874.22	0.02
9	002202	金风科技	88,817	3,065,962.84	0.02
10	000895	双汇发展	60,193	3,038,542.64	0.02

5. 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	791,000,000.00	4.34
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	-	-
7	其他	-	-
8	合计	791,000,000.00	4.34

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	1001020	10央行票据20	4,000,000	398,600,000.00	2.19
2	1001019	10央行票据19	4,000,000	392,400,000.00	2.15

注：本基金本报告期末仅持有以上2只债券。

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十名资产支持证券投资明细  
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8. 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  
本报告期末本基金未持有权证。

9. 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没有出现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。

(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) 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	17,501,976.94
2	应收证券清算款	2,765,792.82
3	应收股利	-
4	应收利息	550,882.37
5	应收申购款	23,232,384.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	44,051,036.78

(4) 报告期末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。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000895	双汇发展	3,038,542.64	0.02	重大事项停牌

## 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 2009 年 12 月 1 日，基金合同生效以来（截至 2010 年 3 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 2010 年 3 月 31 日	-3.30%	0.96%	-4.48%	1.35%	1.18%	-0.39%

## 十三、 基金的费用与税收

### (一) 与基金运作相关的费用

#### 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) 因基金的证券交易或结算而产生的费用；
- (4) 基金合同生效以后的信息披露费用；
- (5) 基金份额持有人大会费用；
- (6) 基金合同生效以后的会计师费和律师费；
- (7) 基金的资金汇划费用；
- (8) 基金的指数使用费；
- (9) 按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

#### 2. 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

由于本基金管理人和托管人同时为深证 100ETF 的管理人与托管人，为避免重复收费，本基金管理人、托管人不对本基金财产中的 ETF 部分计提管理费、托管费。本基金制定了以下的收费标准。

##### (1) 基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按调整后的前一日基金资产净值的 0.5% 年费率计提，管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的管理费

E 为调整后的前一日基金资产净值。调整后的前一日基金资产净值 = 前一日基金资产净值 - 本基金持有的深证 100ETF 前一日公允价值，金额为负时以零计。

基金管理费每日计提，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首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

##### (2) 基金托管人的托管费

在通常情况下，本基金的托管费按调整后的前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为调整后的前一日基金资产净值。调整后的前一日基金资产净值=前一日基金资产净值一本基金持有的深证 100ETF 前一日公允价值，金额为负时以零计。

基金托管费每日计提，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首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

本条第 1 节“基金费用的种类”的第(3)至第(8)项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，从基金财产中支付。

### 3. 不列入基金费用的项目

本条第 1 款约定以外的其他费用，以及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等不列入基金费用。

### 4. 基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

#### (二) 与基金销售有关的费用

##### 1. 申购费

(1) 申购费率为：

申购金额 M (元) (含申购费)	申购费率
M < 100 万	1.2%
100 万 ≤ M < 500 万	0.5%
500 万 ≤ M < 1000 万	0.1%
M ≥ 1000 万	1000 元/笔

(2) 申购费的收取方式和用途

在申购费按金额分档的情况下，如果投资者多次申购，申购费适用单笔申购金额所对应的费率。

申购费用由申购基金份额的基金投资人承担，不列入基金财产，用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

(3) 申购份额的计算方式

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额，其中：

净申购金额=申购金额/（1+申购费率）

申购费用=申购金额-净申购金额



申购份额=净申购金额/申购当日基金份额净值

对于 1000 万元（含）以上的申购，净申购金额=申购金额-绝对数额的申购费金额

申购费用以人民币元为单位，四舍五入，保留至小数点后二位；申购份数采取四舍五入的方法保留小数点后二位，由此产生的误差计入基金财产。

## 2. 赎回费

(1) 赎回费率为：

持有时间（天）	赎回费率
0-90	0.5%
91-729	0.25%
730 及以上	0%

(2) 赎回费的收取和用途

本基金的赎回费由赎回人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取，所收赎回费总额的 25% 归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

(3) 基金赎回金额的计算方式

本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用，其中：

赎回总额=赎回数量×T 日基金份额净值

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额-赎回费用

赎回金额、赎回费用以人民币元为单位，四舍五入，保留小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产。

## 3. 转换费率

目前，基金管理人已开通了本基金与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、易方达科讯股票型基金、易方达增强回报债券型基金、易方达中小盘股票型基金、易方达科汇灵活配置混合型基金、易方达科翔股票型基金、易方达行业领先企业股票型基金、易方达沪深 300 指数基金和易方达上证中盘 ETF 联接基金之间的转换业务。基金转换费用由投资者承担，基金转换费用由转出基金赎回费用和基金申购补差费用构成，其中转出基金赎回费用 25% 的部分归入基金财产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费，具体实施办法和转换费率详见相关公告。转换费用以人民币元为单位，计算结果按照四舍五入方法，保留小数点后两位。代销机构可对每笔转换申请向投资者收取不高于 10 元的业务代理费，具体收费

标准以各代销机构的规定为准。

4. 投资者通过本公司网上交易系统（www.efunds.com.cn）进行申购、赎回和转换的交易费率，请具体参照我公司网站上的相关说明。

5. 基金管理人可以在基金合同规定的范围内调整上述费率。上述费率如发生变更，基金管理人应按照《证券投资基金信息披露管理办法》或其他相关规定于新的费率实施前在至少一种指定媒体公告。

6. 基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对特定地域范围、特定交易方式（如网上交易、电话交易等）或特定时间段等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以对促销活动范围内的投资者调低基金申购、赎回和转换费率。

## 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 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对 2009 年 10 月 22 日刊登的本基金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、主要人员情况部分。
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，根据相关公告和最新资料补充并更新了基金份额发售机构信息。
4. 将“六、基金的募集安排”改为“六、基金的募集”，更新了部分内容，概述了基金的募集情况。
5. 更新了“七、基金合同的生效”部分的内容，概述了基金合同生效的情况。
6. 将“八、基金份额的申购、赎回和转换”改为“八、基金份额的申购、赎回”，将其中的“(十二)基金转换”改为“九、基金转换”并相应调整其他部分的序号。更新了“八、基金份额的申购、赎回”的部分表述。
7. 在“九、基金转换”部分，根据《易方达基金管理有限公司关于开通易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金转换业务的公告》和《易方达基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金转换业务规则与“E 之道”网上交易费率的公

告》，更新了部分表述，并更新了基金转换后转入基金份额持有期限计算规则的相关内容。

8. 在“十一、基金的投资”部分，补充了本基金 2010 年第 1 季度投资组合报告的内容。
9. 增加了“十二、基金的业绩”部分，补充了基金合同生效以来的投资业绩数据，并相应调整其他部分的序号。
10. 在“十四、基金的费用与税收”部分，更新了部分内容。
11. 在“二十二、其他应披露事项”部分，根据相关公告的内容进行了补充。

易方达基金管理有限公司

2010 年 7 月 16 日