

易方达深证100交易型开放式指数基金 2009 第三季度报告

2009年9月30日

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
报告送出日期:二〇〇九年十月二十七日

重要提示
基金管理人、基金托管人及基金服务机构不存在虚假记载、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。

基金管理人、基金托管人及基金服务机构不存在虚假记载、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。

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2009年7月1日至2009年9月30日). Rows include 本期已实现收益, 本期利润, etc.

Table with 2 columns: 阶段, 净值增长率. Rows include 过去三个月, 过去六个月, etc.

基金管理人:泰达荷银基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2009年10月27日

重要提示
基金管理人、基金托管人及基金服务机构不存在虚假记载、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。

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2009年07月01日至2009年09月30日). Rows include 本期已实现收益, 本期利润, etc.

Table with 2 columns: 阶段, 净值增长率. Rows include 过去三个月, 过去六个月, etc.

基金管理人:泰达荷银基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2009年10月27日

重要提示
基金管理人、基金托管人及基金服务机构不存在虚假记载、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。

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2009年07月01日至2009年09月30日). Rows include 本期已实现收益, 本期利润, etc.

Table with 2 columns: 阶段, 净值增长率. Rows include 过去三个月, 过去六个月, etc.

基金管理人:泰达荷银基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2009年10月27日

重要提示
基金管理人、基金托管人及基金服务机构不存在虚假记载、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%

本基金的建仓期为三个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

2.本基金自基金合同生效之日起至本报告期末止,跟踪标的指数(深证100)的年化跟踪误差率为24.06%。

4.1 基金经理 魏基敏 基金经理小组简介

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期. Rows include 魏基敏, 基金经理.

4.2 基金经理对报告期内本基金遵守法律法规情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易专项说明的执行情况

4.3.2 公平交易专项说明的结论

4.3.3 公平交易专项说明的结论

4.3.4 公平交易专项说明的结论

4.3.5 公平交易专项说明的结论

4.3.6 公平交易专项说明的结论

4.3.7 公平交易专项说明的结论

4.3.8 公平交易专项说明的结论

4.3.9 公平交易专项说明的结论

4.3.10 公平交易专项说明的结论

4.3.11 公平交易专项说明的结论

4.3.12 公平交易专项说明的结论

4.3.13 公平交易专项说明的结论

4.3.14 公平交易专项说明的结论

4.3.15 公平交易专项说明的结论

4.3.16 公平交易专项说明的结论

4.3.17 公平交易专项说明的结论

4.3.18 公平交易专项说明的结论

4.3.19 公平交易专项说明的结论

4.3.20 公平交易专项说明的结论

4.3.21 公平交易专项说明的结论

4.3.22 公平交易专项说明的结论

4.3.23 公平交易专项说明的结论

4.3.24 公平交易专项说明的结论

4.3.25 公平交易专项说明的结论

4.3.26 公平交易专项说明的结论

4.3.27 公平交易专项说明的结论

4.3.28 公平交易专项说明的结论

4.3.29 公平交易专项说明的结论

4.3.30 公平交易专项说明的结论

4.3.31 公平交易专项说明的结论

4.3.32 公平交易专项说明的结论

4.3.33 公平交易专项说明的结论

4.3.34 公平交易专项说明的结论

4.3.35 公平交易专项说明的结论

4.3.36 公平交易专项说明的结论

4.3.37 公平交易专项说明的结论

4.3.38 公平交易专项说明的结论

4.3.39 公平交易专项说明的结论

4.3.40 公平交易专项说明的结论

4.3.41 公平交易专项说明的结论

4.3.42 公平交易专项说明的结论

4.3.43 公平交易专项说明的结论

4.3.44 公平交易专项说明的结论

4.3.45 公平交易专项说明的结论

4.3.46 公平交易专项说明的结论

4.3.47 公平交易专项说明的结论

4.3.48 公平交易专项说明的结论

4.3.49 公平交易专项说明的结论

4.3.50 公平交易专项说明的结论

4.3.51 公平交易专项说明的结论

4.3.52 公平交易专项说明的结论

4.3.53 公平交易专项说明的结论

4.3.54 公平交易专项说明的结论

4.3.55 公平交易专项说明的结论

4.3.56 公平交易专项说明的结论

4.3.57 公平交易专项说明的结论

4.3.58 公平交易专项说明的结论

4.3.59 公平交易专项说明的结论

4.3.60 公平交易专项说明的结论

4.3.61 公平交易专项说明的结论

4.3.62 公平交易专项说明的结论

4.3.63 公平交易专项说明的结论

4.3.64 公平交易专项说明的结论

4.3.65 公平交易专项说明的结论

4.3.66 公平交易专项说明的结论

4.3.67 公平交易专项说明的结论

4.3.68 公平交易专项说明的结论

4.3.69 公平交易专项说明的结论

4.3.70 公平交易专项说明的结论

4.3.71 公平交易专项说明的结论

4.3.72 公平交易专项说明的结论

4.3.73 公平交易专项说明的结论

4.3.74 公平交易专项说明的结论

4.3.75 公平交易专项说明的结论

4.3.76 公平交易专项说明的结论

4.3.77 公平交易专项说明的结论

4.3.78 公平交易专项说明的结论

4.3.79 公平交易专项说明的结论

4.3.80 公平交易专项说明的结论

注:上表中的股票投资项可退替代估值增值,而5.2的合计项不可退替代估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.4 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.5 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.6 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.7 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.8 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.9 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.10 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.11 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.12 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.13 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.14 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.15 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.16 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.17 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.18 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.19 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.20 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.21 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.22 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.23 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.24 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.25 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.26 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.27 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.28 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.29 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.30 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.31 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.32 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.33 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.34 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.35 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.36 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.37 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.38 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.39 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.40 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.41 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.42 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.43 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的积极投资与指数投资的前五名股票明细
5.3.1 积极投资与指数投资的前五名股票明细

Table with 6 columns: 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(%)

注:本报告期末本基金持有以上股票的投资。

5.3.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的积极投资与指数投资的前五名股票明细

Table with 6 columns: 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(%)

注:本报告期末本基金持有以上股票的投资。

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 6 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(元), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

注:本报告期末本基金持有以上债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

Table with 6 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

注:本报告期末本基金未持有权证。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券明细

Table with 6 columns: 序号, 资产支持证券代码, 资产支持证券名称, 数量(元), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

注:本报告期末本基金未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

Table with 6 columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(克), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

注:本报告期末本基金未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

Table with 6 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量(元), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

注:本报告期末本基金未持有股指期货。

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资明细

Table with 6 columns: 序号, 国债期货代码, 国债期货名称, 数量(元), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

注:本报告期末本基金未持有国债期货。

5.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他衍生品投资明细

Table with 6 columns: 序号, 其他衍生品代码, 其他衍生品名称, 数量(元), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

注:本报告期末本基金未持有其他衍生品。

5.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

Table with 6 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

注:本报告期末本基金未持有权证。

5.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

Table with 6 columns: 序号, 资产支持证券代码, 资产支持证券名称, 数量(元), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

注:本报告期末本基金未持有资产支持证券。

5.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

Table with 6 columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(克), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

注:本报告期末本基金未持有贵金属。

5.14 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

Table with 6 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量(元), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

注:本报告期末本基金未持有股指期货。

5.15 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资明细