

易方达深证100交易型开放式指数基金

2010 第三季度报告

2010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:二〇一〇年十月二十八日

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。
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2010年10月21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。

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。

基金产品概况

Table with 2 columns: 基金简称, 基金代码, 交易代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人

主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2010年7月1日-2010年9月30日)
1.本期已实现收益 95,518,624.20
2.本期利润 4,604,045,485.70
3.加权平均基金份额本期利润 0.7272
4.期末基金资产净值 23,355,806,521.64
5.期末基金份额净值 3.746

注:1.本基金已于2006年4月14日进行了基金份额折算,折算比例为0.94948342。
2.所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。

3.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table with 6 columns: 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

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达深证100交易型开放式指数基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2006年3月24日至2010年9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%。
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至报告期末的基金份额净值增长率为266.51%,同期业绩比较基准收益率为268.47%。

基金管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期限(任职日期, 离任日期), 证券从业年限, 说明

注:1.此处的“任职日期”和“离任日期”分别为公告确定的聘任日期和解聘日期。
2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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、取信于社会投资者为宗旨,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。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
本基金管理人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。本基金管理人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,并重视交易执行环节的公平交易措施,以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则,对在同一交易系统中交易的投资组合,启用投资交易系统中的公平交易模块,以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内,公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较无。

4.3.3 异常交易行为的专项说明
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。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
2010年第三季度国内宏观经济整体平稳发展,消费增速保持稳步上升趋势,投资增速逐步回落并企稳,进出口增速较前期有明显的下降,第三季度GDP增速较一、二季度仍将继续回落的趋势。由于夏季洪涝灾害导致食品价格的上涨,消费价格指数(CPI)仍延续了前期持续的上升趋势,但工业品出厂价格指数(PPI)随着整体经济增速的回落,在第三季度呈现了逐步下降的趋势。在货币供应方面,M1和M2增速在上半年的逐步回落之后,于第三季度出现了逐步企稳的势头。在宏观经济紧缩政策放松的预期之下,A股市场在上半年大幅下跌之后于第三季度出现了一定程度的反弹,上证指数第三季度涨幅为10.73%,深证100价格指数涨幅为23.94%。作为被动型指数基金,深证100ETF的净值跟踪业绩比较基准出现了一定程度的上涨。

4.4.2 报告期内基金的投资表现
截至报告期末,本基金份额净值为3.746元,本报告期份额净值增长率为24.12%,同期业绩比较基准收益率为23.94%,日跟踪偏离度的均值为0.0130%,日跟踪误差为0.0192%,年化跟踪误差为0.2975%,各项指标均在合同约定的目标控制范围之内。

4.4.3 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
展望未来一段时期,宏观经济总体将继续保持平稳发展,宏观经济政策的重点仍是在保持经济总量平稳较快发展的前提下,着力完善体制机制来推动经济增长方式和经济结构的优化调整。近期海外经济复苏的过程中出现了一些结构上的分化,但海外经济的整体复苏和再平衡趋势仍未变,海外需求的逐步恢复对国内经济增长的拉动作用仍在延续。鉴于内外需结构的调整、优化以及国内经济的弹性,本基金对中国中长期经济前景持相对乐观的判断。目前上市公司整体的业绩增长仍较快,盈利增长预期较好,虽然A股市场估值在细分行业上差异较大,但整体估值水平合理并处于相对偏低区域。同时,深证100指数行业分布均衡合理,指数成分股成长性较高,深证100指数中长期的投资价值依然明显。

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度为投资目标,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。期望深证100ETF为投资者分享中国经济的未来长期成长提供良好的投资机会。

投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 5 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)
1 权益投资 22,330,283,841.42 99.82
其中:股票 22,330,283,841.42 99.82
2 固定收益投资 -- --
其中:债券 -- --
资产支持证券 -- --
3 金融衍生品投资 -- --
4 买入返售金融资产 -- --
其中:买断式回购的买入返售金融资产 -- --
5 银行存款和结算备付金合计 35,217,789.20 0.16
6 其他各项资产 4,764,753.40 0.02
7 合计 22,370,266,384.02 100.00

注:上表中的股票投资项可替代权证估值增值,而5.2的合计项不含可替代权证估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 5 columns: 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 115,238,093.60 0.52
B 采掘业 1,529,937,536.95 6.84
C 制造业 12,744,617,408.61 57.01
D 食品、饮料 2,420,248,328.26 10.83
E 纺织服装、皮毛 69,475,867.20 0.31
F 木材、家具 -- --
G 造纸、印刷 187,331,672.97 0.84
H 石油、化学、塑胶、塑料 1,018,229,659.29 4.55
I 电子 275,401,398.90 1.23
J 金属、非金属 2,873,653,174.63 12.85
K 机械、设备、仪表 3,961,250,645.57 17.72
L 医药、生物制品 1,739,260,452.41 7.78
M 其他制造业 199,766,209.38 0.89
N 电力、煤气及水的生产和供应业 329,297,096.84 1.47
O 建筑业 -- --
P 交通运输、仓储业 181,112,933.75 0.81
Q 信息技术业 894,932,559.65 4.00
R 批发和零售贸易 1,471,345,541.15 6.58
S 金融、保险业 1,583,718,379.35 7.08
T 房地产业 2,253,909,584.78 10.08
U 社会服务业 306,721,728.81 1.37
V 传播与文化产业 221,406,307.60 0.99
W 综合类 697,982,186.33 3.12
合计 22,330,219,357.42 99.89

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前十名股票投资明细

Table with 5 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(%)
1 000002 万科A 150,556,325 1,264,673,130.00 5.66
2 002024 苏宁电器 70,589,681 1,127,317,205.57 5.04
3 000858 五粮液 31,201,540 1,071,148,868.20 4.79
4 000001 深发展A 44,516,862 722,063,501.64 3.23
5 000063 中兴通讯 25,248,779 622,382,402.35 2.78
6 000983 西山煤电 26,909,047 559,708,177.60 2.50
7 000651 格力电器 35,706,301 506,315,348.18 2.26
8 000527 美的电器 31,641,916 484,121,314.80 2.17
9 000423 东阿阿胶 9,412,655 463,855,638.40 2.07
10 000792 盐湖钾肥 7,313,398 447,579,957.60 2.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注
5.8.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现过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。
5.8.2 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。
5.8.3 其他各项资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)
1 存出保证金 2,078,297.45
2 应收证券清算款 2,675,415.51
3 应收股利 --
4 应收利息 11,040.44
5 应收申购款 --
6 其他应收款 --
7 待摊费用 --
8 其他 --
9 合计 4,764,753.40

5.8.4 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。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 项目, 单位:份
本报告期初基金份额总额 6,278,166,634
本报告期基金总申购份额 5,613,000,000
减:本报告期基金总赎回份额 5,924,000,000
本报告期基金净申购份额 --
本报告期末基金份额总额 5,967,166,634

备查文件目录

- 7.1 备查文件目录
1. 中国证监会批准易方达深证100交易型开放式指数基金募集的文件;
2. 《易方达深证100交易型开放式指数基金基金合同》;
3. 《易方达深证100交易型开放式指数基金托管协议》;
4. 基金管理人业务资格批件和营业执照;
5. 基金托管人业务资格批件和营业执照。
7.2 存放地点
基金管理人、基金托管人处。
7.3 查阅方式
投资者可在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司
二〇一〇年十月二十八日

易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2010 第三季度报告

2010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:二〇一〇年十月二十八日

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。
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2010年10月21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。
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。

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。

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。

基金产品概况

Table with 2 columns: 基金简称, 基金代码, 交易代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人

主要财务指标和基金净值表现

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2010年7月1日-2010年9月30日)
1.本期已实现收益 -60,257,723.54
2.本期利润 3,059,347,644.61
3.加权平均基金份额本期利润 0.1713
4.期末基金资产净值 15,789,754,719.76
5.期末基金份额净值 0.917

注:1.本基金合同于2009年12月1日生效,截至报告日本基金合同生效未满一年。
(1)本基金资产投资于深证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%。
(2)本基金参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过基金总资产,本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;
(3)本基金可不投资于《证券投资基金运作管理办法》第三十一条的下列限制:①一只基金持有一家上市公司股票,其市值不超过基金资产净值的10%;②同一基金管理人管理的全部基金持有一家上市公司发行的证券,不超过该证券的10%;
(4)法律法规和基金合同规定的其他限制。

若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更,致使本款前述约定的投资禁止行为和限制不再适用,本基金管理人将在依法履行相应程序后,本基金可相应调整禁止行为和限制,但须提前公告。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例的,基金管理人应当在十个交易日内进行调整,以确保符合有关规定,从其规定。

3.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。

4.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-8.30%,同期业绩比较基准收益率为-10.00%。

基金管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期限(任职日期, 离任日期), 证券从业年限, 说明

注:1.此处的“任职日期”和“离任日期”分别为公告确定的聘任日期,林飞的“任职日期”为基金合同生效之日,王建军为“任职日期”为公告确定的聘任日期。
2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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、取信于社会投资者为宗旨,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。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
本基金管理人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。本基金管理人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,并重视交易执行环节的公平交易措施,以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则,对在不同交易系统中的交易指令,启用投资交易系统中的公平交易模块,以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内,公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较无。

4.3.3 异常交易行为的专项说明
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。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
2010年第三季度国内宏观经济整体平稳发展,消费增速保持稳步上升趋势,投资增速逐步回落并企稳,进出口增速较前期有明显的下降,第三季度GDP增速较一、二季度仍将继续回落的趋势。由于夏季洪涝灾害导致食品价格的上涨,消费价格指数(CPI)仍延续了前期持续的上升趋势,但工业品出厂价格指数(PPI)随着整体经济增速的回落,在第三季度呈现了逐步下降的趋势。在货币供应方面,

M1和M2增速在上半年的逐步回落之后,于第三季度出现了逐步企稳的势头。在宏观经济紧缩政策放松的预期之下,A股市场在上半年大幅下跌之后于第三季度出现了一定程度的反弹,上证指数第三季度涨幅为10.73%,深证100价格指数涨幅为23.94%。作为被动型指数基金,深证100ETF联接基金的净值跟踪业绩比较基准出现了一定程度的上涨。

4.4.2 报告期内基金的投资表现
截至报告期末,本基金份额净值为0.917元,本报告期份额净值增长率为22.76%,同期业绩比较基准收益率为22.66%,年化跟踪误差为0.8291%,各项指标均在合同约定的目标控制范围之内。

4.4.3 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
展望未来一段时期,宏观经济总体将继续保持平稳发展,宏观经济政策的重点仍是在保持经济总量平稳较快发展的前提下,着力完善体制机制来推动经济增长方式和经济结构的优化调整。近期海外经济复苏的过程中出现了一些结构上的分化,但海外经济的整体复苏和再平衡趋势仍未变,海外需求的逐步恢复对国内经济增长的拉动作用仍在延续。鉴于内外需结构的调整、优化以及国内经济的弹性,本基金对中国中长期经济前景持相对乐观的判断。目前上市公司整体的业绩增长仍较快,盈利增长预期较好,虽然A股市场估值在细分行业上差异较大,但整体估值水平合理并处于相对偏低区域。同时,深证100指数行业分布均衡合理,指数成分股成长性较高,深证100指数中长期的投资价值依然明显。

作为被动投资的基金,深证100ETF联接基金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度为投资目标,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。期望深证100ETF联接基金为投资者分享中国经济的未来长期成长提供良好的投资机会。

投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 5 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)
1 权益投资 163,015,189.16 1.03
其中:股票 163,015,189.16 1.03
2 固定收益投资 14,699,892,369.24 92.85
其中:债券 553,389,000.00 3.50
资产支持证券 -- --
3 金融衍生品投资 -- --
4 买入返售金融资产 -- --
其中:买断式回购的买入返售金融资产 -- --
5 银行存款和结算备付金合计 319,824,835.85 2.02
6 其他各项资产 95,459,422.99 0.60
7 合计 15,831,580,812.74 100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 5 columns: 序号, 基金名称, 基金类型, 运作方式, 管理人, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)
1 易方达深证100交易型指数基金 股票型 交易型开放式(ETF) 易方达基金管理 14,699,892,369.24 93.10

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 5 columns: 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 676,460.00 0.00
B 采掘业 10,179,980.54 0.06
C 制造业 79,713,851.62 0.50
D 食品、饮料 15,778,487.19 0.10
E 纺织服装、皮毛 379,300.80 0.00
F 木材、家具 -- --
G 造纸、印刷 1,609,941.73 0.01
H 石油、化学、塑胶、塑料 5,841,558.30 0.04
I 电子 2,220,089.10 0.01
J 金属、非金属 15,528,322.76 0.10
K 机械、设备、仪表 26,372,196.22 0.17
L 医药、生物制品 10,734,269.21 0.07
M 其他制造业 1,789,676.31 0.01
N 电力、煤气及水的生产和供应业 2,039,577.17 0.01
O 建筑业 -- --
P 交通运输、仓储业 1,193,854.20 0.01
Q 信息技术业 11,273,780.13 0.07
R 批发和零售贸易 8,246,233.91 0.05
S 金融、保险业 12,917,910.76 0.08
T 房地产业 29,909,837.64 0.19
U 社会服务业 1,729,520.10 0.01
V 传播与文化产业 1,227,571.48 0.01
W 综合类 3,906,631.01 0.02
合计 163,015,189.16 1.03

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十名股票投资明细

Table with 5 columns: 代码, 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 2,849,398 23,939,479.20 0.15
2 000063 中兴通讯 395,499 9,749,050.35 0.06
3 000001 深发展A 473,245 7,676,033.90 0.05
4 000051 格力电器 519,650 7,308,637.00 0.05
5 002024 苏宁电器 398,553 6,364,891.41 0.04
6 000858 五粮液 175,017 6,008,333.61 0.04
7 000423 东阿阿胶 72,752 3,585,218.56 0.02
8 000895 双汇发展 60,193 3,491,795.93 0.02
9 000983 西山煤电 149,580 3,111,264.00 0.02
10 000792 盐湖钾肥 41,384 2,532,700.80 0.02

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 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 -- --
3 金融债券 553,389,000.00 3.50
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 553,389,000.00 3.50

5.6 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

Table with 5 columns: 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 1000119 10央行票据19 4,300,000 421,615,000.00 2.67
2 0801047 08央行票据47 8,000,000 81,104,000.00 0.51
3 0801044 08央行票据44 500,000 50,670,000.00 0.32
4 -- -- -- -- --
5 -- -- -- -- --

注:本基金本报告期末持有以上债券。

5.7 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。

5.8 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

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 投资组合报告附注
5.9.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现过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。
5.9.2 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。
5.9.3 其他各项资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)
1 存出保证金 4,250,000.00
2 应收证券清算款 74,221,700.88
3 应收股利 --
4 应收利息 7,097,528.18
5 应收申购款 9,890,193.93
6 其他应收款 --
7 待摊费用 --
8 其他 --
9 合计 95,459,422.99

5.9.4 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。

5.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

Table with 5 columns: 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(%)
1 000895 双汇发展 3,491,795.93 0.02

开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 项目, 单位:份
本报告期初基金份额总额 18,092,960,851.67
本报告期基金总申购份额 831,584,458.67
减:本报告期基金总赎回份额 1,704,177,738.03
本报告期基金净申购份额 --
本报告期末基金份额总额 17,220,367,572.31

备查文件目录

- 7.1 备查文件目录
1. 中国证监会核准易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金募集的文件;
2. 《易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;
3. 《易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;
4. 基金管理人业务资格批件、营业执照;
5. 基金托管人业务资格批件、营业执照;
6. 基金托管人业务资格批件和营业执照。
7.2 存放地点
基金管理人、基金托管人处。
7.3 查阅方式
投资者可在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司
二〇一〇年十月二十八日