

易方达 50 指数证券投资基金 2008 年年度报告摘要

2008 年 12 月 31 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2009 年 03 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2009 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告财务资料已经审计。安永华明会计师事务所为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2008 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 审计报告	12
§ 7 年度财务报表	12
7.1 资产负债表	12
7.2 利润表	13
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	14
7.4 报表附注	15
§ 8 投资组合报告	21
8.1 期末基金资产组合情况	21
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	21
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名股票投资明细	23
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	23
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	25

8.6 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	25
8.7 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	25
8.8 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	25
8.9 投资组合报告附注	25
§ 9 基金份额持有人信息	26
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	26
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	26
§ 10 开放式基金份额变动	26
§ 11 重大事件揭示	27
11.1 基金份额持有人大会决议	27
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	27
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	27
11.4 基金投资策略的改变	27
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	27
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	27
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	27

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	易基 50
交易代码	110003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004 年 3 月 22 日
报告期末基金份额总额	27,053,275,309.49 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制与目标指数偏离风险的前提下，力争获得超越指数的投资收益，追求长期资本增值。
投资策略	本基金为指数增强型基金，股票投资部分以上证 50 指数作为标的指数，资产配置上追求充分投资，不根据对市场时机的判断主动调整股票仓位，通过运用深入的基本面研究及先进的数量化投资技术，控制与目标指数的偏离风险，追求超越基准的收益水平。
业绩比较基准	上证 50 指数
风险收益特征	本基金为中等风险的证券投资基金，基金控制与基准的偏离风险，同时力争获得超越基准的收益。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张南	张咏东
	联系电话	020-38799008	021-68888917
	电子邮箱	csc@efunds.com.cn	zhangyd@bankcomm.com
客户服务电话		40088-18088（免长途话费）	95559
传真		020-38799488	021-58408842

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.efunds.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市体育西路 189 号城建大厦 28 楼

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2008年	2007年	2006年
本期已实现收益	-4,857,366,909.03	2,197,279,712.26	955,347,239.99
本期利润	-22,115,552,505.53	4,606,876,692.91	1,848,551,140.44
加权平均基金份额本期利润	-0.9050	0.5331	0.8512
本期基金份额净值增长率	-63.94%	123.25%	126.72%
3.1.2 期末数据和指标	2008年	2007年	2006年
期末可供分配基金份额利润	-0.4717	0.0323	0.2972
期末基金资产净值	14,291,762,018.11	32,999,660,123.55	2,054,249,001.03
期末基金份额净值	0.5283	1.4651	1.7895

注：1. 上述基金业绩指标不包括持有人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。

2. 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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

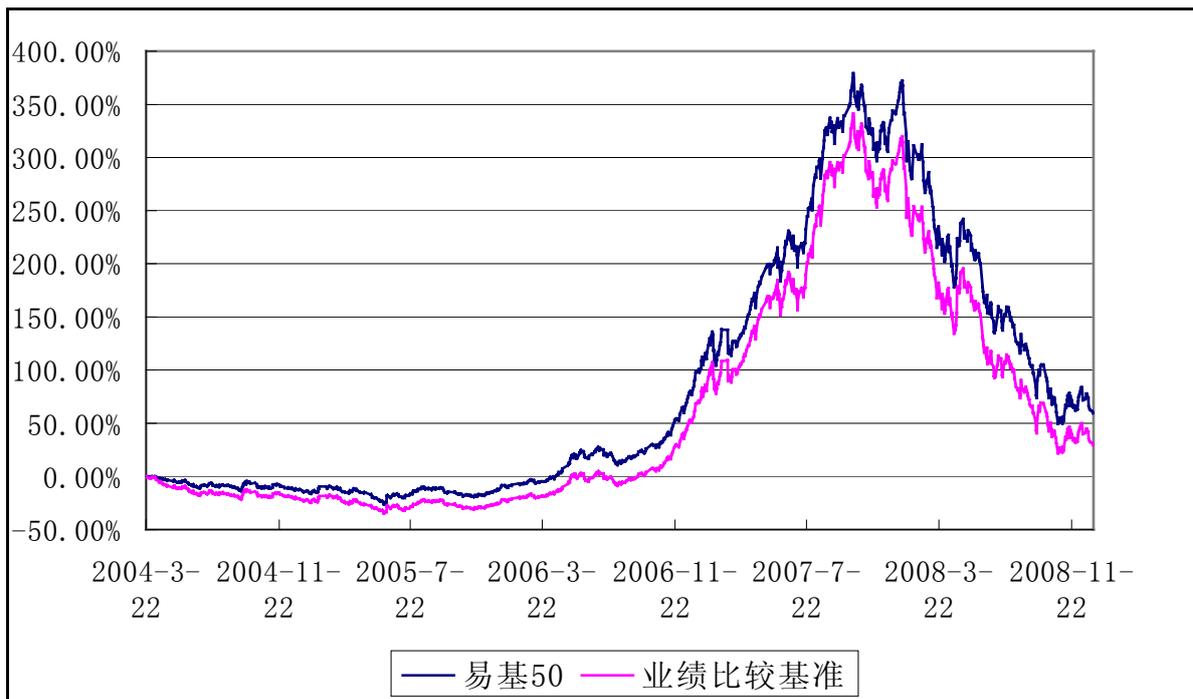
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-22.31%	3.05%	-23.54%	3.17%	1.23%	-0.12%
过去六个月	-35.26%	2.90%	-36.34%	3.12%	1.08%	-0.22%
过去一年	-63.94%	2.83%	-67.23%	3.08%	3.29%	-0.25%
过去三年	82.49%	2.19%	73.90%	2.38%	8.59%	-0.19%
自基金合同生效起至今	59.37%	1.85%	29.22%	2.02%	30.15%	-0.17%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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 50 指数证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2004年3月22日至2008年12月31日)



注：（1）基金合同中有关投资比例限制的约定：

1) 由于《证券投资基金管理暂行办法》已经废止，根据《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》和本基金合同、招募说明书有关条款的规定，自 2004 年 11 月 5 日起本基金的业绩比较基准和资产配置比例适用如下规定：

① 基金的业绩比较基准为：上证 50 指数

② 基金的资产配置比例限制为：在目前的法律法规限制下，本基金应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，正常情况下股票投资占基金净资产的比例不低于 90%

2) 遵守中国证监会规定的其他比例限制。

因基金规模或市场剧烈变化导致投资组合不符合上述规定时，基金管理人应在合理期限内进行调整，以符合上述规定。法律法规另有规定时，从其规定。

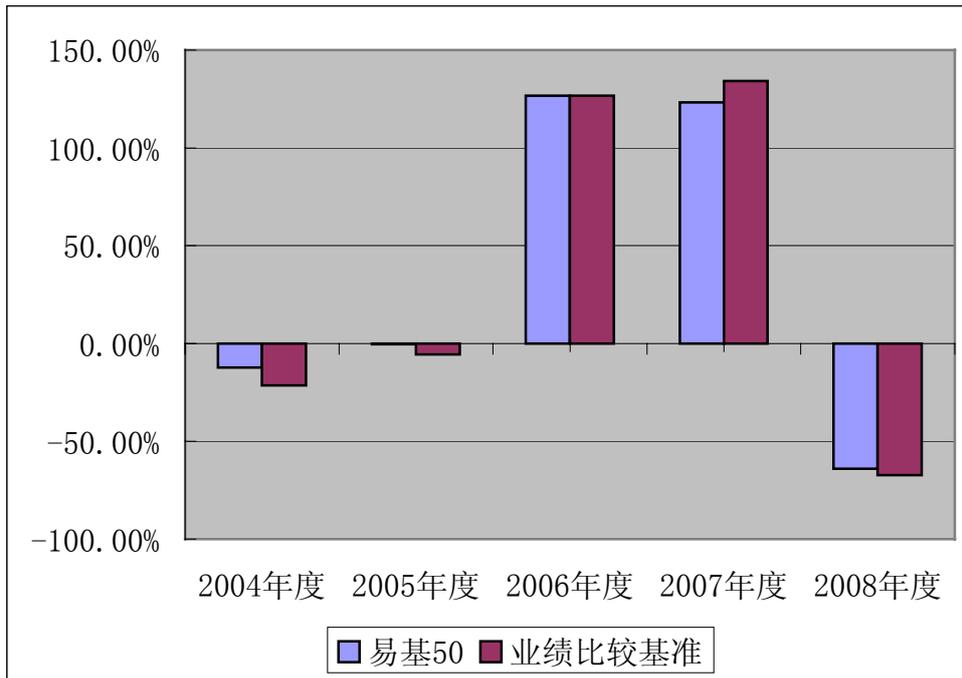
本基金本报告期遵守法律、法规和基金合同的比例限制进行证券投资。

（2）本基金于 2008 年 1 月 1 日免去马骏先生和梁天喜先生基金经理职务，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。

（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 59.37%，同期业绩比较基准收益率 29.22%。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的

比较



注：本基金合同生效日为2004年3月22日，2004年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2008年	-	-	-	-	-
2007年	17.300	670,609,280.88	1,490,881,998.68	2,161,491,279.56	-
2006年	1.200	88,191,308.80	64,652,201.33	152,843,510.13	-
合计	18.500	758,800,589.68	1,555,534,200.01	2,314,334,789.69	-

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 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12月31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。公司现有全国社保基金投资管理人、企业年金投资管理人、QDII和特定资产管理业务资格。

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 12 月 31 日，易方达基金管理有限公司共管理 1 只封闭式基金、15 只开放式基金，具体包括基金科瑞和易方达科讯股票型基金、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。同时，公司还管理着多个全国社保基金、企业年金基金和特定客户资产管理投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
林飞	本基金的基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数基金的基金经理	2007-2-10	-	5 年	博士研究生，历任融通基金管理有限公司基金经理助理，易方达基金管理有限公司易方达深证 100 交易型开放式指数基金基金经理助理。

注：1. 此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日。

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。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 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，对在同一个交易系统中交易的组合，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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

继 06、07 年的单边上涨行情之后，在国际金融危机蔓延及国内经济下行压力的交叉影响下，已经累计较高估值的 A 股市场在 08 年四个季度中一路延续了惯性下跌的趋势，最终以巨幅下跌再次完整地呈现了其作为新兴市场的主要特征。经济数据的快速回落迫使经济和货币政策在第四季度出现较为明显转向，刺激经济政策的时间和力度均超过市场预期，与此同时，反周期经济政策及预期逐渐成为影响 A 股市场后续结构分化的另一条主线。连续三年极端的市場变化，引发了投资者对市场、对投资策略甚至对投资理念的重新思考，仓位、波段被提到了前所未有的高度。值得一提的是，即使在年度跌幅创出历史新高的 08 年，仍有 40% 以上的交易日是上涨的，熊市中靠维持极端空头策略去回避市场系统性风险所需要的前瞻性以及承受力，是要远远超过牛市中做多的情形，显然 08 年大多数投资者（包括专业或机构投资者）都未能在短时间做好适应这种变化的准备。上证综合指数最终年度跌幅 65.39%，上证 50 指数年度跌幅 67.23%，作为增强型指数基金，50 指数基金在 2008 年跟随指数出现较大幅度的下跌。但本基金在成份股投资权重匹配基础上，以同行业内优势企业为主要方向，对组合结构做了一定的优化，获得了一定的超额收益。

截至报告期末，本基金份额净值为 0.5283 元，本报告期份额净值增长率为-63.94%，同期业绩比较基准收益率为-67.23%，年化跟踪误差 6.37%，受今年指数编制方法修改、基金估值方法修改和基金申购赎回增加等因素影响，本基金跟踪误差超出了 4% 的目标控制范围。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2009 年，国际金融危机对实体经济的影响正在逐步显现，主要经济体在去杠杆化的过程中正在寻找新的平衡点，外围经济环境仍存在着较大的不确定性。对国内而言，由于政策效应的滞后，国内经济仍将在一段时间处于下行通道中，市场对政策见效之后经济增长的可持续性仍然存在一定分歧。对此本基金持相对乐观判断。本基金认为，微观经济实体的基本面和应变能力，及时有力的调控政策以及后续可释放的内需空间，都使得中国在这轮全球性经济调整中具备较多的回旋余地，中国经济稳定持续增长的动力并不会因为这轮调整发生明显变化。而市场经过 2008 年大幅调整之后，估值已经进入历史较低水平，中长期的投资价值更加明显。50 指数基金将继续在努力控制基金相对基准指数的跟踪误差的前提下，根据对市场未来结构性变化的判断，对投资组合做适度的优化和增强，力争获得超越指数的投资收益，追求长期资本增值。期望本基金为投资者进一步分享中国证券市场大盘蓝筹股未来长期稳定的增长提供更好的投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，基金管理人根据相关法律法规的要求和业务发展需要，进一步完善了旗下证券投资基金的估值政策和程序，确保基金估值的公平、合理。

(1) 参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

基金管理人成立估值委员会，分管运营的公司副总裁担任估值委员会主席，核算部、研究部、投资发展部和监察部的部门负责人或其指定人员担任委员。估值委员会负责对各类投资品种的估值方法、估值模型等进行研究和验证，组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。

估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等方面的专业胜任能力。

(2) 基金经理参与或决定估值的程度

基金经理参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

(3) 参与估值流程各方之间是否存在任何重大利益冲突

基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

(4) 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

基金管理人未签署与估值相关的任何定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期出现亏损，无需实施利润分配。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2008 年度，基金托管人在易方达 50 指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2008 年度，易方达基金管理有限公司在易方达 50 指数证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2008 年度，由易方达基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关易方达 50 指数证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

安永华明会计师事务所审计了 2008 年 12 月 31 日的资产负债表、2008 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注，并出具了标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：易方达 50 指数证券投资基金

报告截止日：2008 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2008 年 12 月 31 日	上年度末 2007 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	857,847,738.36	2,735,084,883.42
结算备付金	7,832,486.46	16,951,774.82
存出保证金	351,282.05	351,282.05
交易性金融资产	13,394,540,624.93	30,417,449,909.41
其中：股票投资	13,394,540,624.93	30,404,482,111.41
债券投资	-	12,967,798.00
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	16,528,397.15
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	45,466,548.01	8,880,880.61
应收利息	201,240.01	808,978.82
应收股利	-	-
应收申购款	27,703,924.23	128,063,269.59
其他资产	-	-
资产总计	14,333,943,844.05	33,324,119,375.87
负债和所有者权益	本期末	上年度末

	2008年12月31日	2007年12月31日
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	979,404.65	16,030,383.31
应付赎回款	16,427,611.41	255,222,828.26
应付管理人报酬	15,654,692.41	31,920,156.56
应付托管费	2,609,115.39	5,320,026.08
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	4,026,203.04	10,923,953.12
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
其他负债	2,484,799.04	5,041,904.99
负债合计	42,181,825.94	324,459,252.32
所有者权益：		
实收基金	27,053,275,309.49	22,523,525,361.15
未分配利润	-12,761,513,291.38	10,476,134,762.40
所有者权益合计	14,291,762,018.11	32,999,660,123.55
负债和所有者权益总计	14,333,943,844.05	33,324,119,375.87

注：报告截止日2008年12月31日，基金份额净值0.5283元，基金份额总额27,053,275,309.49份。

7.2 利润表

会计主体：易方达50指数证券投资基金

本报告期：2008年1月1日至2008年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期	上年度可比期间
	2008年1月1日至2008年12月31日	2007年1月1日至2007年12月31日
一、收入	-21,765,254,418.98	4,932,418,993.56
1. 利息收入	17,728,454.73	11,871,910.14
其中：存款利息收入	17,697,469.00	11,853,006.09
债券利息收入	30,985.73	18,904.05
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-4,540,834,215.95	2,493,449,122.25
其中：股票投资收益	-4,819,596,937.39	2,460,872,025.70

债券投资收益	4,695,485.37	1,027,785.23
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	8,448,907.93	5,359,081.24
股利收益	265,618,328.14	26,190,230.08
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-17,258,185,596.50	2,409,596,980.65
4. 其他收入（损失以“-”号填列）	16,036,938.74	17,500,980.52
二、费用（以“-”号填列）	-350,298,086.55	-325,542,300.65
1. 管理人报酬	-258,602,086.01	-146,634,627.09
2. 托管费	-43,100,347.61	-24,439,104.44
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	-48,121,882.47	-154,024,205.25
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	-473,770.46	-444,363.87
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-22,115,552,505.53	4,606,876,692.91

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达 50 指数证券投资基金

本报告期：2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 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）	22,523,525,361.15	10,476,134,762.40	32,999,660,123.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-22,115,552,505.53	-22,115,552,505.53
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 （净值减少以“-”号填列）	4,529,749,948.34	-1,122,095,548.25	3,407,654,400.09
其中：1. 基金申购款	21,420,012,508.31	-3,115,730,819.74	18,304,281,688.57
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-16,890,262,559.97	1,993,635,271.49	-14,896,627,288.48
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	27,053,275,309.49	-12,761,513,291.38	14,291,762,018.11

项目	上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31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）	1,147,923,485.96	906,325,515.07	2,054,249,001.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,606,876,692.91	4,606,876,692.91
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 （净值减少以“-”号填列）	21,375,601,875.19	7,124,423,833.98	28,500,025,709.17
其中：1. 基金申购款	34,278,163,452.72	13,681,708,028.11	47,959,871,480.83
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-12,902,561,577.53	-6,557,284,194.13	-19,459,845,771.66
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-2,161,491,279.56	-2,161,491,279.56
五、期末所有者权益（基金净值）	22,523,525,361.15	10,476,134,762.40	32,999,660,123.55

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

易方达 50 指数证券投资基金（简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（简称“中国证监会”）证监基金字[2004]13 号文《关于同意易方达 50 指数证券投资基金设立的批复》的批准，由易方达基金管理有限公司作为基金发起人，向社会公开发行募集并于 2004 年 3 月 22 日正式成立，首次设立募集规模为 5,048,902,330.26 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定，基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释（统称“企业会计准则”），中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、关于发布《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉（试行）》等问题的通知及其他中国证监会颁布的相关规定而编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2008年12月31日的财务状况以及2008年度会计期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

根据中国证券监督管理委员会证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的要求，本基金自2008年9月16日起，采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对长期停牌股票进行估值，上述指数收益法的关键假设包括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动，停牌股票的发行者的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。

除上述变更外，本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

上述 7.4.4 会计估计变更对变更当天的资产净值及损益的影响数为-350,071,243.78 元，对 2008 年的年度损益及 2008 年末的资产净值影响数为-371,416,577.00 元。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期未发生会计差错。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

根据财政部、国家税务总局财税字[2007]84号文《关于调整证券（股票）交易印花税率的通知》的规定，自2007年5月30日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的1%调整为3%；

经国务院批准，财政部、国家税务总局决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3%调整为1%；

经国务院批准，财政部、国家税务总局决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

7.4.6.2 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

7.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自2005年6月13日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税[2005]102号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按50%计算应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)	基金托管人、基金销售机构
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、基金销售机构
广东粤财信托有限公司(以下简称“粤财信托”)	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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年12月31日		上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总 额的比例
广发证券	1,581,154,655.90	8.05%	2,578,180,019.40	6.26%

7.4.8.1.2 权证交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年12月31日		上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日	
	成交金额	占当期权证 成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总 额的比例
广发证券	3,171,384.89	6.94%	4,855,870.04	13.21%

7.4.8.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年12月31日		上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
广发证券	-	-	945,380.94	5.97%

7.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及2007年度未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金 余额	占期末应付佣金总额的比 例
广发证券	1,329,511.93	7.97%	608,941.47	15.12%
关联方名称	上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金 余额	占期末应付佣金总额的比 例
广发证券	2,090,663.60	6.20%	112,978.04	1.03%

注：上述佣金按市场佣金率计算，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

适用期间内由券商承担的证券结算风险金后的净额列示，管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2008年1月1日至2008年12 月31日	上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12 月31日
当期应支付的管理费	258,602,086.01	146,634,627.09
其中：当期已支付	242,947,393.60	114,714,470.53
期末未支付	15,654,692.41	31,920,156.56

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.2%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.2\% / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2008年1月1日至2008年12 月31日	上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12 月31日
当期应支付的托管费	43,100,347.61	24,439,104.44
其中：当期已支付	40,491,232.22	19,119,078.36
期末未支付	2,609,115.39	5,320,026.08

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期及2007年本基金未与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期和 2007 年度期间基金管理人未持有本基金份额。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末和 2007 年末基金管理人主要股东及其控制的机构未持有本基金份额。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	857,847,738.36	16,974,486.29	2,735,084,883.42	10,386,667.76

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：）	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：手）	总金额
广发证券	126005	武钢分离型可转债	公开发售	14,817	14,817,000.00

7.4.9 期末（2008 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌股票

金额单位：人民币元

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（股）	期末成本总额	期末估值总额
600900	长江电力	2008-5-8	资产重组	7.35	未知	未知	53,059,511	974,758,726.89	389,987,405.85

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2008 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2008 年 12 月 31 日止, 本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0, 无抵押债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	13,394,540,624.93	93.45
	其中：股票	13,394,540,624.93	93.45
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	865,680,224.82	6.04
6	其他资产	73,722,994.30	0.51
7	合计	14,333,943,844.05	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产的净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	568,467,286.24	3.98
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-

C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	10,758,920.00	0.08
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	557,708,366.24	3.90
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	153,867,477.84	1.08
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	76,682,811.20	0.54
H	批发和零售贸易	25,002,360.00	0.17
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	824,019,935.28	5.77

8.2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产的净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	1,696,393,040.81	11.87
C	制造业	1,213,876,228.42	8.49
C0	食品、饮料	395,580,061.70	2.77
C1	纺织、服装、皮毛	42,428,665.37	0.30
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	658,644,780.34	4.61
C7	机械、设备、仪表	117,222,721.01	0.82
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-

D	电力、煤气及水的生产和供应业	653,631,727.37	4.57
E	建筑业	334,960,010.80	2.34
F	交通运输、仓储业	594,598,614.18	4.16
G	信息技术业	237,762,667.60	1.66
H	批发和零售贸易	109,434,917.12	0.77
I	金融、保险业	7,360,826,288.15	51.50
J	房地产业	369,037,195.20	2.58
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	12,570,520,689.65	87.96

8.3 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票投资明细

8.3.1 积极投资部分

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600089	特变电工	11,174,237	266,840,779.56	1.87
2	000651	格力电器	9,184,566	178,547,963.04	1.25
3	601186	中国铁建	15,325,446	153,867,477.84	1.08
4	600582	天地科技	7,698,573	105,316,478.64	0.74
5	000063	中兴通讯	2,819,221	76,682,811.20	0.54

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.efunds.com.cn 的年度报告正文。

8.3.2 指数投资部分

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产的净值比例（%）
1	600036	招商银行	104,099,946	1,265,855,343.36	8.86
2	600000	浦发银行	94,206,558	1,248,236,893.50	8.73
3	601318	中国平安	41,992,535	1,116,581,505.65	7.81
4	601398	工商银行	236,074,397	835,703,365.38	5.85
5	600030	中信证券	44,269,095	795,515,637.15	5.57

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.efunds.com.cn 的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
----	------	------	----------	----------------

1	601088	中国神华	1,706,266,521.81	5.17
2	600036	招商银行	1,541,233,728.14	4.67
3	601318	中国平安	1,209,593,572.76	3.67
4	601857	中国石油	815,331,901.57	2.47
5	601166	兴业银行	797,227,165.22	2.42
6	601939	建设银行	681,917,079.82	2.07
7	601398	工商银行	671,423,115.77	2.03
8	600000	浦发银行	568,031,159.99	1.72
9	601628	中国人寿	481,840,624.89	1.46
10	600030	中信证券	476,710,110.18	1.44
11	601919	中国远洋	377,062,499.51	1.14
12	601390	中国中铁	345,567,401.11	1.05
13	600739	辽宁成大	287,472,116.01	0.87
14	601006	大秦铁路	254,409,040.49	0.77
15	600089	特变电工	246,731,514.92	0.75
16	601988	中国银行	217,362,497.19	0.66
17	000651	格力电器	204,350,239.32	0.62
18	600058	五矿发展	203,202,503.57	0.62
19	601186	中国铁建	153,517,490.03	0.47
20	600048	保利地产	149,494,885.04	0.45

注：累计买入金额=Σ（买入数量*买入成交单价）

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600028	中国石化	869,174,759.17	2.63
2	600030	中信证券	803,606,534.34	2.44
3	600019	宝钢股份	497,672,410.18	1.51
4	600016	民生银行	495,750,067.01	1.50
5	600331	宏达股份	319,227,519.54	0.97
6	600011	华能国际	270,826,126.99	0.82
7	600583	海油工程	256,580,576.72	0.78
8	600309	烟台万华	226,011,897.64	0.68
9	601628	中国人寿	223,470,986.14	0.68
10	600519	贵州茅台	205,769,276.20	0.62
11	600001	邯郸钢铁	203,020,561.59	0.62
12	601998	中信银行	201,003,405.97	0.61
13	601988	中国银行	198,962,729.80	0.60
14	600036	招商银行	189,939,097.48	0.58
15	600018	上港集团	177,397,062.27	0.54

16	600050	中国联通	171,851,450.45	0.52
17	601398	工商银行	149,040,065.69	0.45
18	600005	武钢股份	146,234,994.21	0.44
19	600717	天津港	111,144,787.53	0.34
20	600104	上海汽车	107,077,051.69	0.32

注：累计卖出金额=Σ（卖出数量*卖出成交单价）

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	12,365,333,793.00
卖出股票收入（成交）总额	7,305,813,718.18

注：本表统计口径同 8.4.1 和 8.4.2。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期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：

根据中兴通讯股份有限公司董事会 2008 年 10 月 7 日《中兴通讯股份有限公司关于财政部驻深圳市财政监察专员办事处 2007 年度会计信息质量检查结论和处理决定的公告》，中兴通讯在财政检查中受到 16 万元的行政罚款并被要求补缴企业所得税 380 万元。

本基金认为，该处罚不会对中兴通讯投资价值构成实质性负面影响。

8.9.2 本基金投资的前十名股票都在基金合同规定备选股票库之内。

8.9.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	351,282.05
2	应收证券清算款	45,466,548.01
3	应收股利	-
4	应收利息	201,240.01
5	应收申购款	27,703,924.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	73,722,994.30

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.9.5 期末指数投资或积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金指数投资或积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,363,008	19,848.21	3,082,860,866.16	11.40%	23,970,414,443.33	88.60%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	138,524.16	0.0005%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2004年3月22日)基金份额总额	5,048,902,330.26
报告期期初基金份额总额	22,523,525,361.15
报告期期间基金总申购份额	21,420,012,508.31

报告期期间基金总赎回份额	16,890,262,559.97
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期期末基金份额总额	27,053,275,309.49

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金管理人于2008年6月21日发布了《易方达基金管理有限公司高管人员变更公告》，江作良先生不再担任易方达基金管理有限公司副总经理职务；本报告期基金托管人的基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来连续5年聘请安永华明会计师事务所提供审计服务，本报告年度的审计费用为130,000.00元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		权证交易		应支付该券商的佣金	
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例
海通证券	1	2,942,316,758.79	14.98%	-	-	-	-	2,500,958.87	14.99%
中信建投	1	952,981,142.01	4.85%	-	-	-	-	810,042.55	4.85%
广发证券	2	1,581,154,655.90	8.05%	-	-	3,171,384.89	6.94%	1,329,511.93	7.97%

光大证券	1	1,532,398,985.47	7.80%	-	-	-	-	1,302,536.30	7.81%
金通证券	1	1,011,472,563.81	5.15%	18,319,381.60	19.34%	10,852,485.19	23.74%	859,750.35	5.15%
中银国际	1	631,333,384.54	3.21%	-	-	3,950,009.84	8.64%	536,631.67	3.22%
国泰君安	1	1,082,190,453.22	5.51%	-	-	-	-	919,858.57	5.51%
万联证券	1	1,309,175,462.94	6.66%	6,307,456.50	6.66%	2,911,999.99	6.37%	1,112,772.93	6.67%
银河证券	1	1,075,385,152.72	5.47%	-	-	12,989,252.60	28.42%	914,074.15	5.48%
财通证券	1	841,196,541.50	4.28%	-	-	-	-	715,015.27	4.29%
国信证券	1	3,606,027,737.30	18.35%	70,104,121.20	74.00%	11,830,626.70	25.88%	3,065,103.90	18.37%
齐鲁证券	1	1,496,075,047.56	7.61%	-	-	-	-	1,271,661.75	7.62%
国都证券	1	852,267,468.81	4.34%	-	-	-	-	724,431.34	4.34%
渤海证券	1	733,710,015.77	3.74%	-	-	-	-	623,661.53	3.74%
安信证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-
合计	16	19,647,685,370.34	100.00%	94,730,959.30	100.00%	45,705,759.21	100.00%	16,686,011.11	100.00%

注：1. 本期新增齐鲁证券有限公司、安信证券股份有限公司、国都证券有限责任公司、渤海证券有限责任公司各一个交易席位。

2. 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其席位作为本基金的专用交易席位。基金专用交易席位的选择标准如下：

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

3. 基金专用交易席位的选择程序如下：

- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构。
- 2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

易方达基金管理有限公司

2009年3月28日