

易方达 50 指数证券投资基金  
2009 年半年度报告摘要

2009 年 6 月 30 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 8 月 26 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2009 年 8 月 20 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。

本报告中财务资料未经审计。

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，应阅读半年度报告正文。

本报告期自 2009 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现 .....                             | 5  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 .....                               | 5  |
| § 4 管理人报告 .....                                     | 7  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 .....                              | 7  |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....                    | 8  |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....                       | 8  |
| 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 .....                   | 9  |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....                   | 9  |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....                      | 9  |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....                       | 10 |
| § 5 托管人报告 .....                                     | 10 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....                        | 10 |
| 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 .....       | 10 |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....           | 10 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） .....                           | 11 |
| 6.1 资产负债表 .....                                     | 11 |
| 6.2 利润表 .....                                       | 12 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....                            | 13 |
| 6.4 报表附注 .....                                      | 13 |
| § 7 投资组合报告 .....                                    | 18 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 .....                                | 18 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....                            | 19 |
| 7.3 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各前五名股票明细 ..... | 20 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....                           | 21 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                          | 22 |
| 7.6 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 .....            | 23 |
| 7.7 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 .....        | 23 |
| 7.8 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 .....            | 23 |

|  |           |
|--|-----------|
| 7.9 投资组合报告附注 .....                     | 23        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>             | <b>24</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....            | 24        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况 .....      | 24        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>             | <b>24</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>               | <b>24</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                 | 24        |
| 10.2 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 ..... | 24        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....      | 24        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                   | 24        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....            | 25        |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....    | 25        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....           | 25        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                     |
|------------|---------------------|
| 基金简称       | 易方达上证 50 指数         |
| 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 | 28,956,631,091.52 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 | <a href="mailto:csc@efunds.com.cn">csc@efunds.com.cn</a> | <a href="mailto:zhangyd@bankcomm.com">zhangyd@bankcomm.com</a> |
| 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

|                      |  |
|----------------------|--|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.efunds.com.cn">www.efunds.com.cn</a> |
| 基金半年度报告备置地点          | 广州市体育西路 189 号城建大厦 28 楼                                   |

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

|                      |                           |
|----------------------|---------------------------|
| <b>3.1.1 期间数据和指标</b> | 报告期（2009年1月1日-2009年6月30日） |
| 本期已实现收益              | -2,672,230,080.14         |
| 本期利润                 | 9,715,449,456.42          |
| 加权平均基金份额本期利润         | 0.3646                    |
| 本期基金份额净值增长率          | 68.64%                    |
| <b>3.1.2 期末数据和指标</b> | 报告期（2009年1月1日-2009年6月30日） |
| 期末可供分配基金份额利润         | -0.2540                   |
| 期末基金资产净值             | 25,798,746,900.06         |
| 期末基金份额净值             | 0.8909                    |

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    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月      | 18.13%   | 1.41%       | 19.57%     | 1.46%         | -1.44% | -0.05% |
| 过去三个月      | 30.10%   | 1.56%       | 30.08%     | 1.62%         | 0.02%  | -0.06% |
| 过去六个月      | 68.64%   | 1.93%       | 71.92%     | 1.98%         | -3.28% | -0.05% |
| 过去一年       | 9.18%    | 2.51%       | 9.44%      | 2.66%         | -0.26% | -0.15% |
| 过去三年       | 114.72%  | 2.27%       | 115.92%    | 2.45%         | -1.20% | -0.18% |
| 自基金合同生效起至今 | 168.75%  | 1.86%       | 122.16%    | 2.02%         | 46.59% | -0.16% |

#### 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2009年6月30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。

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 168.75%，同期业绩比较基准收益率为 122.16%。

## § 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 2009 年 6 月 30 日，公司的股东为广东粤财信托、广发证券、广东盈峰投资控股集团有限公司、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 2009 年 6 月 30 日，易方达基金管理有限公司共管理 1 只封闭式基金、16 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、易方达行业领先企业股票型基金。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 | 2007.02.10  | _____ | 6 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**

年初以来，在积极财政政策和适度宽松货币政策的共同作用下，国内经济在较短时间内走出了增长的低谷，二季度稳步复苏的宏观经济数据进一步验证了中国经济增长的潜力和扩大内需扩大投资政策的效果，投资增速和信贷增长均创出多年以来的新高，A股市场在经济转好预期和流动性充裕相互强化的过程中，呈现出明显的资金净流入。与此同时，围绕经济复苏预期和超跌反弹两条主线，市场也表现出较为明显的板块轮涨和结构分化的特征。上证指数上半年累计上涨62.53%，上证50指数涨幅71.92%，作为增强型指数基金，本基金净值上半年跟随指数出现较大幅度的上涨。

截至报告期末，本基金份额净值为0.8909元，本报告期份额净值增长率为68.64%，同期基准指数收益率为71.92%，年化跟踪误差2.97%，在合同规定的控制范围之内。

#### **4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望**

展望下一阶段市场，经济复苏正处于一个较为关键的阶段：随着资产价格及通胀预期的变化，宏观政策可以灵活运用空间在进一步减少；全球需求萎缩和产能过剩仍将在较长时间内成为影响国内经济进一步复苏的负面因素；微观企业盈利复苏依然存在一定不确定性；由投资带动的经济循环仍无法确认。尽管如此，本基金对国内经济中长期的前景仍维持相对乐观的判断，经过这轮反弹之后，A股市场整体估值虽然已有一定幅度的提升，但考虑到经济复苏后上市公司未来盈利可能的增长，市场中长期的投资价值依然明显。

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**

本基金管理人按照新会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所

持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所根据中国证监会规定对估值调整的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。

本基金管理人设有估值委员会，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。基金经理可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。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。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**

本基金本报告期内未实施利润分配。

## **§ 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**

2009 年上半年度，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**

2009 年上半年度，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。

本报告期内本基金未进行收益分配。

### **5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见**

2009 年上半年度，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半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 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：2009 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产             | 本期末<br>2009 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2008 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------------------|--------------------------|
| <b>资 产：</b>     |                        |                          |
| 银行存款            | 1,514,864,354.90       | 857,847,738.36           |
| 结算备付金           | 11,385,306.54          | 7,832,486.46             |
| 存出保证金           | 353,913.63             | 351,282.05               |
| 交易性金融资产         | 24,239,417,744.67      | 13,394,540,624.93        |
| 其中：股票投资         | 24,239,417,744.67      | 13,394,540,624.93        |
| 债券投资            | -                      | -                        |
| 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         | -                      | 45,466,548.01            |
| 应收利息            | 256,695.20             | 201,240.01               |
| 应收股利            | 9,306,900.88           | -                        |
| 应收申购款           | 220,330,443.46         | 27,703,924.23            |
| 其他资产            | -                      | -                        |
| 资产总计            | 25,995,915,359.28      | 14,333,943,844.05        |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末</b>             | <b>上年度末</b>              |
|                 | <b>2009 年 6 月 30 日</b> | <b>2008 年 12 月 31 日</b>  |
| <b>负 债：</b>     |                        |                          |
| 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         | 86,750,403.01          | 979,404.65               |
| 应付赎回款           | 73,402,027.47          | 16,427,611.41            |
| 应付管理人报酬         | 22,761,636.51          | 15,654,692.41            |
| 应付托管费           | 3,793,606.06           | 2,609,115.39             |
| 应付交易费用          | 6,870,637.10           | 4,026,203.04             |
| 应交税费            | -                      | -                        |
| 应付利息            | -                      | -                        |
| 应付利润            | -                      | -                        |
| 其他负债            | 3,590,149.07           | 2,484,799.04             |
| 负债合计            | 197,168,459.22         | 42,181,825.94            |

|               |                   |                    |
|---------------|-------------------|--------------------|
| <b>所有者权益：</b> |                   |                    |
| 实收基金          | 28,956,631,091.52 | 27,053,275,309.49  |
| 未分配利润         | -3,157,884,191.46 | -12,761,513,291.38 |
| 所有者权益合计       | 25,798,746,900.06 | 14,291,762,018.11  |
| 负债和所有者权益总计    | 25,995,915,359.28 | 14,333,943,844.05  |

注：报告截止日 2009 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8909 元，基金份额总额 28,956,631,091.52 份。

## 6.2 利润表

会计主体：易方达 50 指数证券投资基金

本报告期：2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                        | 本期<br>2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2008 年 1 月 1 日至 2008<br>年 6 月 30 日 |
|----------------------------|--|---|
| <b>一、收入</b>                | 9,861,410,389.62                         | -14,581,397,490.20                            |
| 1. 利息收入                    | 4,456,051.22                             | 9,899,040.76                                  |
| 其中：存款利息收入                  | 4,456,051.22                             | 9,871,483.57                                  |
| 债券利息收入                     | -  | 27,557.19                                     |
| 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）          | -2,539,603,771.70                        | -429,852,396.48                               |
| 其中：股票投资收益                  | -2,712,690,251.61                        | -638,519,540.01                               |
| 债券投资收益                     | -  | 3,510,929.42                                  |
| 资产支持证券投资收益                 | -  | -   |
| 衍生工具收益                     | -  | 8,593,273.60                                  |
| 股利收益                       | 173,086,479.91                           | 196,562,940.51                                |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | 12,387,679,536.56                        | -14,170,195,491.39                            |
| 4. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 8,878,573.54                             | 8,751,356.91                                  |
| <b>二、费用（以“-”号填列）</b>       | -145,960,933.20                          | -213,881,984.35                               |
| 1. 管理人报酬                   | -109,007,733.23                          | -155,896,759.35                               |
| 2. 托管费                     | -18,167,955.51                           | -25,982,793.23                                |
| 3. 交易费用                    | -18,552,648.02                           | -31,766,387.49                                |
| 4. 利息支出                    | -  | -   |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | -  | -   |
| 5. 其他费用                    | -232,596.44                              | -236,044.28                                   |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | 9,715,449,456.42                         | -14,795,279,474.55                            |

### 6.3 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：2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2009 年 1 月 1 日至 2009 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）                        | 27,053,275,309.49                          | -12,761,513,291.38 | 14,291,762,018.11  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | 9,715,449,456.42   | 9,715,449,456.42   |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数<br>（净值减少以“-”号填列）  | 1,903,355,782.03                           | -111,820,356.50    | 1,791,535,425.53   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 13,280,743,491.53                          | -3,546,026,337.53  | 9,734,717,154.00   |
| 2. 基金赎回款（以“-”号填列）                      | -11,377,387,709.50                         | 3,434,205,981.03   | -7,943,181,728.47  |
| 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）                        | 28,956,631,091.52                          | -3,157,884,191.46  | 25,798,746,900.06  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2008 年 1 月 1 日至 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）                        | 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）               | -  | -14,795,279,474.55 | -14,795,279,474.55 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数<br>（净值减少以“-”号填列）  | 1,555,884,336.32                           | -110,799,923.70    | 1,445,084,412.62   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 8,860,201,081.18                           | 1,430,212,516.33   | 10,290,413,597.51  |
| 2. 基金赎回款（以“-”号填列）                      | -7,304,316,744.86                          | -1,541,012,440.03  | -8,845,329,184.89  |
| 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）                        | 24,079,409,697.47                          | -4,429,944,635.85  | 19,649,465,061.62  |

### 6.4 报表附注

#### 6.4.1 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。

#### **6.4.2 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》、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。

#### **6.4.3 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2009年6月30日的财务状况以及2009年半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **6.4.4 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**

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。

#### **6.4.5 税项**

##### **6.4.5.1 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。

##### **6.4.5.2 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。

#### 6.4.5.3 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。

### 6.4.6 关联方关系

#### 6.4.6.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

根据易方达基金管理有限公司于2009年5月7日发布的公告，公司原股东“广东盈峰集团有限公司”已更名为“广东盈峰投资控股集团有限公司”，股东更名事项已经完成工商变更登记。

#### 6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 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 |

### 6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

### 6.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2009年1月1日至2009年6月30日 |                  | 上年度可比期间<br>2008年1月1日至2008年6月30日 |                  |
|-------|----------------------------|------------------|---------------------------------|------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期股票<br>成交总额的比例 | 成交金额                            | 占当期股票成交总<br>额的比例 |
| 广发证券  | 1,208,579,060.24           | 9.79%            | 185,252,034.66                  | 2.00%            |

### 6.4.7.1.2 权证交易

本报告期及上年度可比期间本基金未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

### 6.4.7.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2009年1月1日至2009年6月30日 |                |              |                  |
|-------|----------------------------|----------------|--------------|------------------|
|       | 当期佣金                       | 占当期佣金<br>总量的比例 | 期末应付佣金<br>余额 | 占期末应付佣金总额的比<br>例 |
| 广发证券  | 1,018,528.00               | 9.71%          | 897,514.98   | 13.06%           |
| 关联方名称 | 本期<br>2008年1月1日至2008年6月30日 |                |              |                  |
|       | 当期<br>佣金                   | 占当期佣金<br>总量的比例 | 期末应付佣金<br>余额 | 占期末应付佣金总额的比<br>例 |
| 广发证券  | 150,518.15                 | 1.92%          | 57,525.35    | 1.74%            |

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。

### 6.4.7.2 关联方报酬

#### 6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2009年1月1日至2009年6<br>月30日 | 上年度可比期间<br>2008年1月1日至2008年6<br>月30日 |
|-----------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期应支付的管理费 | 109,007,733.23                 | 155,896,759.35                      |
| 其中：当期已支付  | 86,246,096.72                  | 134,324,718.19                      |
| 期末未支付     | 22,761,636.51                  | 21,572,041.16                       |

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。

#### 6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2009年1月1日至2009年6月30日 | 上年度可比期间<br>2008年1月1日至2008年6月30日 |
|-----------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期应支付的托管费 | 18,167,955.51              | 25,982,793.23                   |
| 其中：当期已支付  | 14,374,349.45              | 22,387,453.04                   |
| 期末未支付     | 3,793,606.06               | 3,595,340.19                    |

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。

#### 6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期及上年度可比期间本基金未与关联方进行银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

#### 6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目                    | 本期<br>2009年1月1日至2009年6月30日 | 上年度可比期间<br>2008年1月1日至2008年6月30日 |
|-----------------------|----------------------------|---------------------------------|
| 期初持有的基金份额             | -                          | -                               |
| 期间认购总份额               | -                          | -                               |
| 期间申购/买入总份额            | 365,428,663.88             | -                               |
| 期间因拆分增加的份额            | -                          | -                               |
| 期间赎回/卖出总份额            | -                          | -                               |
| 期末持有的基金份额             | 365,428,663.88             | -                               |
| 期末持有的基金份额<br>占基金总份额比例 | 1.26%                      | -                               |

注：基金管理人本报告期及上年度可比期间持有本基金基金份额变动相关的交易费用按交易所公布的基金交易费率计算并支付。

#### 6.4.7.4.2 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

本报告期末及上年度末基金管理人主要股东及其控制的机构均未持有本基金份额。

#### 6.4.7.5 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                   |              | 上年度可比期间              |              |
|-------|----------------------|--------------|----------------------|--------------|
|       | 2009年1月1日至2009年6月30日 |              | 2008年1月1日至2008年6月30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  | 1,514,864,354.9      | 4,000,635.35 | 1,911,037,874.58     | 9,415,903.94 |

#### 6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.8 期末（2009年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有流通受限证券。

##### 6.4.8.2 期末持有的暂时停牌股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌股票。

##### 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2009年6月30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。

###### 6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2009年6月30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。

#### 6.4.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## §7 投资组合报告

### 7.1 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              | 24,239,417,744.67 | 93.24  |
|   | 其中：股票             | 24,239,417,744.67 | 93.24  |
| 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      | 1,526,249,661.44  | 5.87   |
| 6 | 其他资产              | 230,247,953.17    | 0.89   |
| 7 | 合计                | 25,995,915,359.28 | 100.00 |

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 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           | 占基金资产净值比例 (%) |
|-----|----------------|----------------|---------------|
| A   | 农、林、牧、渔业       | -              | -             |
| B   | 采掘业            | 208,557,530.85 | 0.81          |
| C   | 制造业            | 608,001,641.72 | 2.36          |
| 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    | 48,978,567.78  | 0.19          |
| C5  | 电子             | -              | -             |
| C6  | 金属、非金属         | -              | -             |
| C7  | 机械、设备、仪表       | 559,023,073.94 | 2.17          |
| 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            | -              | -             |
| F   | 交通运输、仓储业       | -              | -             |
| G   | 信息技术业          | -              | -             |
| H   | 批发和零售贸易        | -              | -             |

|   |         |                |      |
|---|---------|----------------|------|
| 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      | 816,559,172.57 | 3.17 |

### 7.2.2 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              | 占基金资产净值比例（%） |
|-----|----------------|-------------------|--------------|
| A   | 农、林、牧、渔业       | -                 | -            |
| B   | 采掘业            | 2,910,959,370.38  | 11.28        |
| C   | 制造业            | 1,979,130,041.75  | 7.67         |
| C0  | 食品、饮料          | 568,238,659.91    | 2.20         |
| C1  | 纺织、服装、皮毛       | 225,546,288.94    | 0.87         |
| 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         | 1,025,181,910.50  | 3.97         |
| C7  | 机械、设备、仪表       | 160,163,182.40    | 0.62         |
| 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 | 920,293,321.03    | 3.57         |
| E   | 建筑业            | 613,351,468.24    | 2.38         |
| F   | 交通运输、仓储业       | 882,379,812.39    | 3.42         |
| G   | 信息技术业          | 482,044,372.74    | 1.87         |
| H   | 批发和零售贸易        | 531,555,598.08    | 2.06         |
| I   | 金融、保险业         | 14,824,202,389.92 | 57.46        |
| J   | 房地产业           | 278,942,197.57    | 1.08         |
| K   | 社会服务业          | -                 | -            |
| L   | 传播与文化产业        | -                 | -            |
| M   | 综合类            | -                 | -            |
|     | 合计             | 23,422,858,572.10 | 90.79        |

## 7.3 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各前五名股票明细

### 7.3.1 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 | 16,761,356 | 302,374,862.24 | 1.17         |
| 2  | 601958 | 金钼股份 | 12,913,779 | 208,557,530.85 | 0.81         |
| 3  | 000651 | 格力电器 | 7,127,625  | 148,967,362.50 | 0.58         |
| 4  | 600582 | 天地科技 | 5,239,944  | 107,680,849.20 | 0.42         |
| 5  | 600596 | 新安股份 | 1,324,461  | 48,978,567.78  | 0.19         |

### 7.3.2 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  | 600000 | 浦发银行 | 99,919,859  | 2,300,155,154.18 | 8.92          |
| 2  | 600016 | 民生银行 | 257,304,659 | 2,037,852,899.28 | 7.90          |
| 3  | 600036 | 招商银行 | 90,447,423  | 2,026,926,749.43 | 7.86          |
| 4  | 601318 | 中国平安 | 39,250,000  | 1,941,305,000.00 | 7.52          |
| 5  | 601166 | 兴业银行 | 47,126,056  | 1,748,847,938.16 | 6.78          |

注：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 [www.efunds.com.cn](http://www.efunds.com.cn) 网站的半年度报告正文。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 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  | 600016 | 民生银行 | 893,527,625.95 | 6.25           |
| 2  | 601398 | 工商银行 | 617,045,102.00 | 4.32           |
| 3  | 600036 | 招商银行 | 564,879,893.94 | 3.95           |
| 4  | 600005 | 武钢股份 | 479,657,195.22 | 3.36           |
| 5  | 600837 | 海通证券 | 414,413,532.17 | 2.90           |
| 6  | 600030 | 中信证券 | 400,439,207.82 | 2.80           |
| 7  | 600050 | 中国联通 | 360,836,914.19 | 2.52           |
| 8  | 601166 | 兴业银行 | 353,885,509.66 | 2.48           |
| 9  | 601899 | 紫金矿业 | 314,902,113.57 | 2.20           |
| 10 | 601169 | 北京银行 | 227,256,161.88 | 1.59           |
| 11 | 601168 | 西部矿业 | 212,689,794.36 | 1.49           |
| 12 | 600177 | 雅戈尔  | 197,714,960.65 | 1.38           |
| 13 | 601958 | 金钼股份 | 190,192,763.27 | 1.33           |
| 14 | 600739 | 辽宁成大 | 179,347,257.81 | 1.25           |
| 15 | 601186 | 中国铁建 | 153,884,253.87 | 1.08           |
| 16 | 601088 | 中国神华 | 149,920,916.88 | 1.05           |

|    |        |      |                |      |
|----|--------|------|----------------|------|
| 17 | 601988 | 中国银行 | 141,795,796.16 | 0.99 |
| 18 | 601898 | 中煤能源 | 135,551,678.31 | 0.95 |
| 19 | 601318 | 中国平安 | 126,723,864.92 | 0.89 |
| 20 | 601601 | 中国太保 | 115,705,681.70 | 0.81 |

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 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  | 600036 | 招商银行 | 721,901,228.20 | 5.05           |
| 2  | 600030 | 中信证券 | 558,746,914.82 | 3.91           |
| 3  | 600000 | 浦发银行 | 460,433,255.33 | 3.22           |
| 4  | 600048 | 保利地产 | 400,692,074.78 | 2.80           |
| 5  | 601988 | 中国银行 | 285,939,707.78 | 2.00           |
| 6  | 600005 | 武钢股份 | 261,303,234.74 | 1.83           |
| 7  | 601857 | 中国石油 | 256,091,471.20 | 1.79           |
| 8  | 600050 | 中国联通 | 250,858,498.25 | 1.76           |
| 9  | 601318 | 中国平安 | 225,339,480.56 | 1.58           |
| 10 | 600019 | 宝钢股份 | 222,379,123.18 | 1.56           |
| 11 | 600028 | 中国石化 | 205,818,087.76 | 1.44           |
| 12 | 601398 | 工商银行 | 163,237,470.60 | 1.14           |
| 13 | 600837 | 海通证券 | 148,548,672.17 | 1.04           |
| 14 | 600177 | 雅戈尔  | 122,475,964.17 | 0.86           |
| 15 | 601333 | 广深铁路 | 118,851,690.28 | 0.83           |
| 16 | 600642 | 申能股份 | 117,432,733.49 | 0.82           |
| 17 | 000651 | 格力电器 | 112,334,453.30 | 0.79           |
| 18 | 601166 | 兴业银行 | 88,597,509.94  | 0.62           |
| 19 | 000063 | 中兴通讯 | 82,803,526.36  | 0.58           |
| 20 | 600582 | 天地科技 | 78,256,320.30  | 0.55           |

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 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 | 6,759,148,121.67 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 5,589,260,286.88 |

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 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。

#### 7.6 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。

#### 7.7 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。

#### 7.8 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。

#### 7.9 投资组合报告附注

7.9.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体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。

7.9.2 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。

#### 7.9.3 其他资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额             |
|----|---------|----------------|
| 1  | 存出保证金   | 353,913.63     |
| 2  | 应收证券清算款 | -              |
| 3  | 应收股利    | 9,306,900.88   |
| 4  | 应收利息    | 256,695.20     |
| 5  | 应收申购款   | 220,330,443.46 |
| 6  | 其他应收款   | -              |
| 7  | 待摊费用    | -              |
| 8  | 其他      | -              |
| 9  | 合计      | 230,247,953.17 |

#### 7.9.4 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。

#### 7.9.5 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 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<br>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 |
| 1,435,486 | 20,172.01     | 4,339,409,971.65 | 14.99% | 24,617,221,119.87 | 85.01% |

### 8.2 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 | 1,475,427.77 | 0.0051%  |

## § 9 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               | 27,053,275,309.49 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 13,280,743,491.53 |
| 报告期期间基金总赎回份额              | 11,377,387,709.50 |
| 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               | 28,956,631,091.52 |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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和基金托管人的基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 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。

### 10.4 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。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

### 10.6 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基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 10.7 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 |              |
|------|--------|-------------------|--------------|------|--------------|
|      |        | 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 |
| 海通证券 | 1      | 267,904,219.30    | 2.17%        | -    | -            |
| 中信建投 | 1      | -                 | -            | -    | -            |
| 广发证券 | 2      | 1,208,579,060.24  | 9.79%        | -    | -            |
| 光大证券 | 1      | 100,178,760.64    | 0.81%        | -    | -            |
| 金通证券 | 1      | 1,364,645,026.48  | 11.05%       | -    | -            |
| 中银国际 | 1      | 255,234,738.19    | 2.07%        | -    | -            |
| 国泰君安 | 1      | 13,992,863.29     | 0.11%        | -    | -            |
| 万联证券 | 1      | -                 | -            | -    | -            |
| 银河证券 | 1      | 103,962,296.35    | 0.84%        | -    | -            |
| 财通证券 | 1      | 380,703,712.75    | 3.08%        | -    | -            |
| 国信证券 | 1      | 2,615,743,817.41  | 21.18%       | -    | -            |
| 齐鲁证券 | 1      | 733,113,964.00    | 5.94%        | -    | -            |
| 国都证券 | 1      | 304,895,626.64    | 2.47%        | -    | -            |
| 渤海证券 | 1      | 2,796,024,388.95  | 22.64%       | -    | -            |
| 安信证券 | 1      | 2,203,429,934.31  | 17.84%       | -    | -            |
| 合计   | 16     | 12,348,408,408.55 | 100.00%      | -    | -            |

| 券商名称 | 交易 | 权证交易 | 应支付该券商的佣金 |
|------|----|------|-----------|
|------|----|------|-----------|

|      | 单元数量 | 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    | -    | -            | 227,716.92    | 2.17%      |
| 中信建投 | 1    | -    | -            | -             | -          |
| 广发证券 | 2    | -    | -            | 1,018,528.00  | 9.71%      |
| 光大证券 | 1    | -    | -            | 85,151.68     | 0.81%      |
| 金通证券 | 1    | -    | -            | 1,159,951.03  | 11.06%     |
| 中银国际 | 1    | -    | -            | 216,950.18    | 2.07%      |
| 国泰君安 | 1    | -    | -            | 11,893.00     | 0.11%      |
| 万联证券 | 1    | -    | -            | -             | -          |
| 银河证券 | 1    | -    | -            | 88,368.67     | 0.84%      |
| 财通证券 | 1    | -    | -            | 323,601.03    | 3.09%      |
| 国信证券 | 1    | -    | -            | 2,223,374.94  | 21.20%     |
| 齐鲁证券 | 1    | -    | -            | 623,148.79    | 5.94%      |
| 国都证券 | 1    | -    | -            | 259,160.71    | 2.47%      |
| 渤海证券 | 1    | -    | -            | 2,376,613.69  | 22.66%     |
| 安信证券 | 1    | -    | -            | 1,872,916.34  | 17.86%     |
| 合计   | 16   | -    | -            | 10,487,374.98 | 100.00%    |

注：1. 本报告期内本基金未发生交易单元变更。

2. 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- 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服务；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. 基金交易单元的选择程序如下：

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

易方达基金管理有限公司  
2009年8月26日