

# 易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基 金联接基金

## 2011 年半年度报告

### 2011 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇一一年八月二十六日

## 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 8 月 22 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。

本报告期自 2011 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.....	6
2.4	信息披露方式.....	7
2.5	其他相关资料.....	7
3	主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1	主要会计数据和财务指标.....	7
3.2	基金净值表现.....	7
4	管理人报告.....	9
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
5	托管人报告.....	13
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
6	半年度财务会计报告（未经审计）.....	14
6.1	资产负债表.....	14
6.2	利润表.....	15
6.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4	报表附注.....	17
7	投资组合报告.....	33
7.1	期末基金资产组合情况.....	33
7.2	期末投资目标基金明细.....	34
7.3	期末按行业分类的股票投资组合.....	34
7.4	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	35
7.5	报告期内股票投资组合的重大变动.....	37
7.6	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
7.7	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.....	39
7.8	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	39

7.9	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 .....	40
7.10	投资组合报告附注 .....	40
8	基金份额持有人信息 .....	40
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	40
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 .....	41
9	开放式基金份额变动 .....	41
10	重大事件揭示 .....	41
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	41
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 .....	41
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	41
10.4	基金投资策略的改变 .....	41
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	42
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 .....	42
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	42
10.8	其他重大事件 .....	43
11	备查文件目录 .....	45
11.1	备查文件目录 .....	45
11.2	存放地点 .....	45
11.3	查阅方式 .....	45

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金
基金简称	易方达上证中盘ETF联接
基金主代码	110021
交易代码	110021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年3月31日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,181,741,966.04份
基金合同存续期	不定期

#### 2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510130
基金运作方式	交易型开放式 (ETF)
基金合同生效日	2010年3月29日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2010年6月23日
基金管理人名称	易方达基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司

### 2.2 基金产品说明

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。力争将日均跟踪偏离度控制在0.35%以内，年化跟踪误差控制在4%以内。
投资策略	本基金为上证中盘ETF的联接基金。上证中盘ETF是采用完全复制法实现对上证中盘指数紧密跟踪的全被动指数基金，本基金主要通过投资于上证中盘ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争将日均跟踪偏离度控制在0.35%以内，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上证中盘ETF的买卖。

业绩比较基准	上证中盘指数收益率X95%+活期存款利率(税后)X5%。
风险收益特征	<p>本基金是指数型股票基金，属于证券投资基金中的高风险高收益品种，理论上其风险收益水平高于混合型基金、债券基金和货币市场基金。</p> <p>本基金为上证中盘ETF 的联接基金，主要通过投资于上证中盘ETF 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上证中盘指数的表现密切相关。</p>

### 2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金采取完全复制法进行投资，即按照上证中盘指数的成份股组成及权重构建股票投资组合。但是当指数编制方法变更、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股派发现金股息、配股及增发、股票长期停牌、市场流动性不足等情况发生，基金管理人无法按照指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。
业绩比较基准	上证中盘指数
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

### 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张南	赵会军
	联系电话	020-38799008	010-66105799
	电子邮箱	csc@efunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95588
传真		020-38799488	010-66105798
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	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		广州市体育西路189号城建大厦25、26、27、28楼	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		510620	100140
法定代表人		梁棠	姜建清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	广州市体育西路 189 号城建大厦 25 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

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	25,154,010.86
本期利润	-73,805,862.18
加权平均基金份额本期利润	-0.0615
本期加权平均净值利润率	-5.68%
本期基金份额净值增长率	-4.98%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	43,390,792.98
期末可供分配基金份额利润	0.0367
期末基金资产净值	1,225,132,759.02
期末基金份额净值	1.0367
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2011 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	3.67%

注：1. 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。

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. 期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 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	2.97%	1.18%	3.08%	1.22%	-0.11%	-0.04%
过去三个月	-6.77%	1.15%	-7.14%	1.19%	0.37%	-0.04%
过去六个月	-4.98%	1.27%	-5.11%	1.30%	0.13%	-0.03%
过去一年	18.48%	1.34%	25.51%	1.46%	-7.03%	-0.12%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	3.67%	1.26%	-4.67%	1.57%	8.34%	-0.31%

### 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

易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2010年3月31日至2011年6月30日)



注：1. 基金合同中关于基金投资比例的约定：

- (1) 基金资产中投资于上证中盘 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；
- (2) 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%；
- (3) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；
- (4) 本基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不得超过本基金的总资产，

所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(5) 本基金不得违反《基金合同》关于投资范围和投资比例的约定；

(6) 相关法律法规以及监管部门规定的其他投资限制。

如法律法规或监管部门取消上述限制性规定，履行适当程序后，本基金不受上述规定的限制。

由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

2. 本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

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为 3.67%，同期业绩比较基准收益率为-4.67%。

## 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 2011 年 6 月 30 日，公司的股东为广东粤财信托有限公司、广发证券股份有限公司、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 2011 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、26 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、易方达沪深 300 指数基金、易方达深证 100 交易型开放式指数基金联接基金、易方达亚洲精选股票型基金、易方达上证中盘交易型开放式指数基金、易方达上证中盘交易型开放式指数基金联接基金、易方达消费行业股票型基金、易方达岁丰添利债券型基金、易方达医疗保健行业股票型基金、易方达黄金主题基金（LOF）、易方达安心回

报债券型基金。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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张胜记	本基金的基金经理、易方达上证中盘交易型开放式指数基金的基金经理、易方达沪深 300 指数基金的基金经理	2010-03-31	-	6 年	硕士研究生，曾任易方达基金管理有限公司机构理财部研究员、机构理财部投资经理助理、基金经理助理、研究部行业研究员。
王建军	本基金的基金经理助理、易方达深证 100 交易型开放式指数基金的基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数基金联接基金的基金经理、易方达上证中盘交易型开放式指数基金的基金经理助理	2010-03-31	-	4 年	博士研究生，曾任武汉利辉国际游轮有限公司职员，依莱克斯（中国）营销有限公司区域零售经理，汇添富基金管理有限公司数量分析师，易方达基金管理有限公司量化研究员、基金经理助理。

注：1. 此处的“任职日期”为基金合同生效之日，“离任日期”为公告确定的解聘日期。  
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合规守信情况的说明

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**

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，通过投资交易系统内的公平交易模块，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**

##### **4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析**

2011 年上半年中国 GDP 增长 9.6%，规模以上工业增加值同比增长 14.3%，经济运行总体良好。同期经济也呈现出一些过热特点，主要是通胀形势日益严峻，CPI 一路攀升，6 月份达到 6.4% 创近三年来新高，这使得中央调控政策不断收紧。上半年央行先后 6 次提高存款准备金率，大型金融机构人民币存款准备金率调至 21.5% 的历史新高，先后 2 次上调存贷款基准利率。在持续收紧的调控政策下，资本市场流动性压力不断增大，上证指数下跌 1.64%，市场分化比较明显。估值较高的创业板指数跌幅达 25.6%，中小板指数下跌 14.8%；大盘股指数表现相对稳定，上证 50 指数上涨 0.6%。从行业来看，信息技术、医药生物、餐饮旅游等板块跌幅较大；水泥建材、白色家电等板块在良好基本面的支撑下，表现较好。

本基金是易方达上证中盘 ETF 的联接基金，主要投资于上证中盘 ETF。报告期内，本基金依据申购赎回的情况进行日常操作，控制跟踪误差和跟踪偏离度在较低水平上。

##### **4.4.2 报告期内基金的业绩表现**

截至报告期末，本基金份额净值为 1.0367 元，本报告期份额净值增长率为-4.98%，同期业绩比较基准收益率为-5.11%，年化跟踪误差 0.97%，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

股市涨跌是对宏观经济周期波动的反映，中国经济增长的波动幅度较大是决定 A 股市场大幅波动的根源。展望 2011 年下半年，在持续高通胀的压力下，货币政策前景仍不容乐观。调控政策的滞后效应将逐步显现，经济增速、企业盈利增长的减缓将难以避免，股市的中期趋势仍难言乐观。流动性压力下，规模庞大的地方政府融资平台负债、银行信托理财产品的质量问題将成为市场关注的焦点。对于前者，由于地方政府的负债大多是投资性的而非消耗性的，导致政府净负债占比远低于总负债占 GDP 的比例，在国际比较中也处于较好水平，没必要过于悲观。对于后者，银行信托理财产品的规模日益庞大，是流动性稀缺背景下存款资金价格提高的市场化表现，预计会持续较长的时间，从而对银行业的盈利增长较为不利。另一方面，A 股整体市盈率水平处于历史低位，应密切关注前期跌幅较大、业绩成长性好的股票品种，预计下半年会有较明显的超跌反弹机会。

长期来看，我国处于快速的城市化、工业化进程中，经济将在较长时期内保持高增速，本基金对市场的长期走势保持乐观。作为被动投资的基金，下阶段本基金将继续采取紧密跟踪比较基准的投资策略，审慎管理基金资产，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化，期望为投资者分享中国经济的未来成长提供良好的投资机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、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。

本基金管理人设有估值委员会，公司营运总监担任估值委员会主席，研究部、投资风险管理部、监察部和核算部指定人员担任委员。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，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作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。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

#### **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**

2011 年上半年，本基金托管人在对易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### **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**

2011 年上半年，易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金的管理人——易方达基金管理有限公司在易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金未进行利润分配。

#### **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**

本托管人依法对易方达基金管理有限公司编制和披露的易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2011 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## 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：易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	15,425,949.97	14,517,310.40
结算备付金		19,910.10	798,250.15
存出保证金		166,666.66	166,666.66
交易性金融资产	6.4.7.2	1,205,279,396.36	1,238,873,533.13
其中：股票投资		11,517,989.20	19,824,802.65
基金投资		1,138,383,161.96	1,155,931,912.08
债券投资		55,378,245.20	63,116,818.40
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,371,053.02	19,626.99
应收利息	6.4.7.5	662,429.22	1,904,796.76
应收股利		1,077.44	-
应收申购款		3,235,702.27	5,430,474.09
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,226,162,185.04	1,261,710,658.18
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		772,194.46	1,501,861.13
应付管理人报酬		42,308.98	43,282.96
应付托管费		8,461.79	8,656.58
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	16,018.39	30,008.68

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	190,442.40	295,804.62
负债合计		1,029,426.02	1,879,613.97
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,181,741,966.04	1,154,664,626.61
未分配利润	6.4.7.10	43,390,792.98	105,166,417.60
所有者权益合计		1,225,132,759.02	1,259,831,044.21
负债和所有者权益总计		1,226,162,185.04	1,261,710,658.18

注：报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0367 元，基金份额总额 1,181,741,966.04 份。

## 6.2 利润表

会计主体：易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010 年 3 月 31 日（基金 合同生效日）至 2010 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>-72,918,320.33</b>	<b>-250,444,400.77</b>
1.利息收入		1,065,989.67	3,452,631.22
其中：存款利息收入	6.4.7.11	116,401.81	1,338,428.05
债券利息收入		949,587.86	1,069,813.21
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	1,044,389.96
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		24,364,993.75	-162,403,805.13
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-1,843,217.34	-166,581,252.54
基金投资收益	6.4.7.13	26,341,475.77	-
债券投资收益	6.4.7.14	-275,186.64	-709,770.00
资产支持证券投资收 益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	141,921.96	4,887,217.41
3.公允价值变动收益（损失以	6.4.7.17	-98,959,873.04	-91,756,947.89

“-”号填列)			
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	6.4.7.18	610,569.29	263,721.03
<b>减: 二、费用</b>		<b>887,541.85</b>	<b>4,648,557.84</b>
1. 管理人报酬		295,154.21	2,410,820.84
2. 托管费		59,030.81	482,164.12
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	312,077.08	1,636,028.93
5. 利息支出		17,485.89	-
其中: 卖出回购金融资产支出		17,485.89	-
6. 其他费用	6.4.7.20	203,793.86	119,543.95
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		<b>-73,805,862.18</b>	<b>-255,092,958.61</b>
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		<b>-73,805,862.18</b>	<b>-255,092,958.61</b>

注: 本基金合同生效日为 2010 年 3 月 31 日, 上年度可比期间为 2010 年 3 月 31 日至 2010 年 6 月 30 日。

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期: 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 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)	1,154,664,626.61	105,166,417.60	1,259,831,044.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-73,805,862.18	-73,805,862.18
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)	27,077,339.43	12,030,237.56	39,107,576.99
其中: 1. 基金申购款	505,411,038.33	57,730,037.39	563,141,075.72
2. 基金赎回款	-478,333,698.90	-45,699,799.83	-524,033,498.73
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）	1,181,741,966.04	43,390,792.98	1,225,132,759.02
项目	上年度可比期间 2010年3月31日（基金合同生效日）至2010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）	2,088,942,454.37	-	2,088,942,454.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-255,092,958.61	-255,092,958.61
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）	-144,693,767.50	12,086,786.79	-132,606,980.71
其中：1. 基金申购款	12,533,504.81	-1,043,439.43	11,490,065.38
2. 基金赎回款	-157,227,272.31	13,130,226.22	-144,097,046.09
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）	1,944,248,686.87	-243,006,171.82	1,701,242,515.05

注：本基金合同生效日为2010年3月31日，上年度可比期间为2010年3月31日至2010年6月30日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：梁棠，主管会计工作负责人：张优造，会计机构负责人：陈荣

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2009]第1498号《关于核准易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》核准，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》于2010年3月31日正式生效，基金合

同生效日的基金份额总额为 2,088,942,454.37 份基金份额，其中认购资金利息折合 462,872.89 份基金份额。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

#### **6.4.2 会计报表的编制基础**

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会 2010 年 2 月 8 日颁布的《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>》、《易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》和中国证监会允许的基金行业实务操作的规定编制。

#### **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 2011 年 6 月 30 日的财务状况以及 2011 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 差错更正的说明**

本基金本报告期无会计差错。

#### **6.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50%计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20%代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
活期存款	15,425,949.97
定期存款	-
其他存款	-
合计	15,425,949.97

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2011年6月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		12,904,888.16	11,517,989.20	-1,386,898.96
债券	交易所市场	5,093,720.87	5,378,245.20	284,524.33
	银行间市场	50,052,500.00	50,000,000.00	-52,500.00
	合计	55,146,220.87	55,378,245.20	232,024.33
资产支持证券		-	-	-
基金		1,068,432,000.13	1,138,383,161.96	69,951,161.83
其他		-	-	-
合计		1,136,483,109.16	1,205,279,396.36	68,796,287.20

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.4 买入返售金融资产

###### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

###### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

##### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应收活期存款利息	1,985.56
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	8.10
应收债券利息	660,435.56
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	662,429.22

**6.4.7.6 其他资产**

本基金本报告期末无其他资产。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
交易所市场应付交易费用	16,018.39
银行间市场应付交易费用	-
合计	16,018.39

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,003.30
预提费用	188,439.10
合计	190,442.40

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,154,664,626.61	1,154,664,626.61
本期申购	505,411,038.33	505,411,038.33
本期赎回（以“-”号填列）	-478,333,698.90	-478,333,698.90
本期末	1,181,741,966.04	1,181,741,966.04

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	41,367,147.64	63,799,269.96	105,166,417.60
本期利润	25,154,010.86	-98,959,873.04	-73,805,862.18
本期基金份额交易产生的变动数	1,916,694.46	10,113,543.10	12,030,237.56
其中：基金申购款	25,714,106.97	32,015,930.42	57,730,037.39
基金赎回款	-23,797,412.51	-21,902,387.32	-45,699,799.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	68,437,852.96	-25,047,059.98	43,390,792.98

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
活期存款利息收入	99,749.95
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	3,490.13
其他	13,161.73
合计	116,401.81

## 6.4.7.12 股票投资收益

## 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-2,394,057.31
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	550,839.97
合计	-1,843,217.34

## 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
卖出股票成交总额	23,105,085.84
减：卖出股票成本总额	25,499,143.15
买卖股票差价收入	-2,394,057.31

## 6.4.7.12.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
申购基金份额总额	222,920,000.00
减：现金支付申购款总额	7,624,011.47
减：申购股票成本总额	214,745,148.56
申购差价收入	550,839.97

**6.4.7.13 基金投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	194,026,064.63
减：卖出/赎回基金成本总额	167,684,588.86
基金投资收益	26,341,475.77

**6.4.7.14 债券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	59,491,418.50
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	57,484,480.14
减：应收利息总额	2,282,125.00
债券投资收益	-275,186.64

**6.4.7.15 衍生工具收益**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
股票投资产生的股利收益	141,921.96
基金投资产生的股利收益	-
合计	141,921.96

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
1. 交易性金融资产	-98,959,873.04
——股票投资	985,494.32
——债券投资	-352,593.06
——资产支持证券投资	-

——基金投资	-99,592,774.30
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-98,959,873.04

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
基金赎回费收入	610,569.29
合计	610,569.29

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
交易所市场交易费用	311,802.08
银行间市场交易费用	275.00
合计	312,077.08

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	148,767.52
银行汇划费用	6,354.76
账户维护费	9,000.00
合计	203,793.86

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至本会计报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

**6.4.9 关联方关系****6.4.9.1 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**

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

注：根据 2011 年 4 月 9 日《易方达基金管理有限公司关于公司股东更名的公告》，基金管理人股东广东盈峰投资控股集团有限公司已更名为“盈峰投资控股集团有限公司”，基

金管理人已完成股东更名事项的工商变更登记。

#### 6.4.9.2 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、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)	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
易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金	本基金是该基金的联接基金

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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年3月31日（基金合同生效日） 至2010年6月30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	15,964,655.96	6.28%	910,805,309.46	66.04%

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年3月31日（基金合同生效日） 至2010年6月30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	5,309,748.10	73.63%	-	-

##### 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年3月31日（基金合同生效日） 至2010年6月30日

	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
广发证券	-	-	1,398,700,000.00	56.60%

**6.4.10.1.5 基金交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年3月31日（基金合同生效日） 至2010年6月30日	
	成交金额	占当期基金成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
广发证券	42,786,775.26	19.40%	-	-

**6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30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	13,570.91	6.28%	13,570.91	84.72%
关联方名称	上年度可比期间 2010年3月31日（基金合同生效日）至2010年6月30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	774,182.01	66.04%	774,182.01	66.04%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以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基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月 30日	上年度可比期间 2010年3月31日（基金合同生效日） 至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	295,154.21	2,410,820.84
其中：支付销售机构的客户	662,887.26	615,938.87

## 维护费

注：1. 基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

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 - 前一日本基金持有的上证中盘 ETF 公允价值，金额为负时以零计。

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 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

2. 客户维护费按日提，按季支付，具体公式如下：

$$H = E \times R / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的客户维护费

E 为前一日代销机构保有该基金份额的基金资产净值

R 为代销机构的客户维护费率

对于非工作日，则按照前一工作日的保有资产市值计算当日客户维护费。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月 30日	上年度可比期间 2010年3月31日（基金合同生效日） 至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托 管费	59,030.81	482,164.12

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% / \text{当年天数}$$

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 - 前一日本基金持有的上证中盘 ETF 公允价值，金额为负时以零计。

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 3 个工作日内从基金资产中一次性支取。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.4.2 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

无。

#### 6.4.10.5 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 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年3月31日（基金合同生效日）至

			2010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
中国工商银行	15,425,949.97	99,749.95	620,297,675.21	1,317,270.19

#### 6.4.10.6 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未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

于本报告期末及上年度末，本基金分别持有 380,870,274 份和 365,801,238 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例分别为 67.74%和 57.64%。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

#### 6.4.12 期末（2011年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 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的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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	备注
600216	浙江医药	2011-06-27	重大事项	31.39	2011-07-04	32.60	2,100	78,127.53	65,919.00	-
600369	西南证券	2011-03-01	重大事项	11.87	2011-8-16	12.49	5,154	59,652.94	61,177.98	-

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2011 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。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2011 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。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。

从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察部、集中交易室、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

本基金属股票基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，采取间接的方法，通过将绝大部分基金财产投资于上证中盘 ETF，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此本基金具有与标的指数相似的风险收益特征。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。

于 2011 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.44% (2010 年 12 月 31 日：1.04%)。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	50,657,845.30	51,978,972.60
合计	50,657,845.30	51,978,972.60

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

##### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
AAA	5,380,835.46	13,039,465.22
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00

合计	5,380,835.46	13,039,465.22
----	--------------	---------------

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因金融资产的流动性不足，无法在合理价格变现资产。本基金的流动性风险主要来自于投资品种流动性不足，导致金融资产不能在合理价格变现。本基金采用分散投资、监控流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时基金管理人通过分析持有人结构、申购赎回行为分析、变现比例、压力测试等方法评估组合的流动性风险。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在证券交易所上市，期末除 6.4.12 列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。投资管理人通过久期、凸度、VAR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2011年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	15,425,949.97	-	-	-	15,425,949.97
结算备付金	19,910.10	-	-	-	19,910.10
存出保证金	-	-	-	166,666.66	166,666.66
交易性金融资产	50,000,000.00	5,378,245.20	-	1,149,901,151.16	1,205,279,396.36
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	1,371,053.02	1,371,053.02
应收利息	-	-	-	662,429.22	662,429.22

应收股利	-	-	-	1,077.44	1,077.44
应收申购款	2,141,533.37	-	-	1,094,168.90	3,235,702.27
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	67,587,393.44	5,378,245.20	-	1,153,196,546.40	1,226,162,185.04
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	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	772,194.46	772,194.46
应付管理人报酬	-	-	-	42,308.98	42,308.98
应付托管费	-	-	-	8,461.79	8,461.79
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	16,018.39	16,018.39
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	190,442.40	190,442.40
负债总计	-	-	-	1,029,426.02	1,029,426.02
利率敏感度缺口	67,587,393.44	5,378,245.20	-	1,152,167,120.38	1,225,132,759.02
上年度末2010年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	14,517,310.40	-	-	-	14,517,310.40
结算备付金	798,250.15	-	-	-	798,250.15
存出保证金	-	-	-	166,666.66	166,666.66
交易性金融资产	50,105,000.00	-	13,011,818.40	1,175,756,714.73	1,238,873,533.13
衍生金融资产	-	-	-	-	-

买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	19,626.99	19,626.99
应收利息	-	-	-	1,904,796.76	1,904,796.76
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	3,848,881.88	-	-	1,581,592.21	5,430,474.09
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	69,269,442.43	-	13,011,818.40	1,179,429,397.35	1,261,710,658.18
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	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	1,501,861.13	1,501,861.13
应付管理人报酬	-	-	-	43,282.96	43,282.96
应付托管费	-	-	-	8,656.58	8,656.58
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	30,008.68	30,008.68
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	295,804.62	295,804.62
负债总计	-	-	-	1,879,613.97	1,879,613.97
利率敏感度缺口	69,269,442.43	-	13,011,818.40	1,177,549,783.38	1,259,831,044.21

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变
----	--------------------

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
	1. 市场利率下降25个基点	11,952.06	22,527.04
2. 市场利率上升25个基点	-11,946.35	-22,506.80	

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VAR 等指标，监控投资组合面临的市场价格波动风险。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日		上年度末 2010年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	11,517,989.20	0.94	19,824,802.65	1.57
交易性金融资产-基金投资	1,138,383,161.96	92.92	1,155,931,912.08	91.75
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,149,901,151.16	93.86	1,175,756,714.73	93.33

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
1. 业绩比较基准上升5%	53,443,292.52	61,101,805.64
2. 业绩比较基准下降5%	-53,443,292.52	-61,101,805.64

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

##### (b) 以公允价值计量的金融工具

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

于 2011 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 1,155,152,299.38 元，第二层级的余额为 50,127,096.98 元，无属于第三层级的余额(2010 年 12 月 31 日：第一层级的余额为 1,185,768,459.21 元，第二层级的余额为 53,105,073.92 元，无属于第三层级的余额)。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## 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	11,517,989.20	0.94
	其中：股票	11,517,989.20	0.94
2	基金投资	1,138,383,161.96	92.84
3	固定收益投资	55,378,245.20	4.52
	其中：债券	55,378,245.20	4.52
	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	15,445,860.07	1.26
7	其他各项资产	5,436,928.61	0.44
8	合计	1,226,162,185.04	100.00

## 7.2 期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

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	易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式 (ETF)	易方达基金管理有限公司	1,138,383,161.96	92.92

## 7.3 期末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	158,847.00	0.01
B	采掘业	3,551,882.50	0.29
C	制造业	3,375,413.67	0.28
C0	食品、饮料	400,364.20	0.03
C1	纺织、服装、皮毛	215,745.81	0.02
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	383,437.54	0.03
C5	电子	101,841.50	0.01
C6	金属、非金属	490,558.97	0.04
C7	机械、设备、仪表	1,195,312.09	0.10
C8	医药、生物制品	588,153.56	0.05
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	981,489.69	0.08
E	建筑业	478,541.34	0.04

F	交通运输、仓储业	429,648.00	0.04
G	信息技术业	289,437.64	0.02
H	批发和零售贸易	379,805.00	0.03
I	金融、保险业	481,512.68	0.04
J	房地产业	697,181.75	0.06
K	社会服务业	89,313.00	0.01
L	传播与文化产业	60,956.58	0.00
M	综合类	543,960.35	0.04
	合计	11,517,989.20	0.94

#### 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	601666	平煤股份	52,153	730,663.53	0.06
2	600642	申能股份	127,205	644,929.35	0.05
3	600123	兰花科创	14,938	624,109.64	0.05
4	601001	大同煤业	29,908	508,436.00	0.04
5	600997	开滦股份	25,150	401,394.00	0.03
6	600395	盘江股份	12,000	398,280.00	0.03
7	600508	上海能源	15,049	366,744.13	0.03
8	601101	昊华能源	4,900	309,239.00	0.03
9	600068	葛洲坝	18,221	218,469.79	0.02
10	600674	川投能源	14,601	209,378.34	0.02
11	600887	伊利股份	12,428	206,926.20	0.02
12	600739	辽宁成大	7,179	199,576.20	0.02
13	601299	中国北车	29,200	195,640.00	0.02
14	600309	烟台万华	9,174	171,645.54	0.01
15	600518	康美药业	12,900	169,764.00	0.01
16	601009	南京银行	18,210	163,343.70	0.01
17	600132	重庆啤酒	2,640	151,536.00	0.01
18	600875	东方电气	5,928	151,164.00	0.01
19	600029	南方航空	19,000	148,960.00	0.01
20	601186	中国铁建	24,300	147,015.00	0.01
21	600415	小商品城	11,830	145,390.70	0.01
22	600150	中国船舶	1,863	137,843.37	0.01
23	600058	五矿发展	3,992	136,845.76	0.01
24	600100	同方股份	12,200	127,612.00	0.01
25	600660	福耀玻璃	12,052	124,858.72	0.01

26	601607	上海医药	7,106	119,380.80	0.01
27	600177	雅戈尔	11,887	117,324.69	0.01
28	601727	上海电气	15,969	110,505.48	0.01
29	600583	海油工程	17,120	109,910.40	0.01
30	600999	招商证券	5,971	109,746.98	0.01
31	600832	东方明珠	14,137	109,561.75	0.01
32	600320	振华重工	16,354	108,754.10	0.01
33	600166	福田汽车	12,000	104,160.00	0.01
34	600009	上海机场	8,100	103,680.00	0.01
35	600497	驰宏锌锗	4,676	103,105.80	0.01
36	600271	航天信息	3,921	101,318.64	0.01
37	601106	中国一重	20,700	100,395.00	0.01
38	600115	东方航空	19,200	99,840.00	0.01
39	600550	天威保变	5,310	95,633.10	0.01
40	600208	新湖中宝	14,298	89,076.54	0.01
41	600196	复星医药	8,053	87,616.64	0.01
42	600219	南山铝业	9,300	87,513.00	0.01
43	600352	浙江龙盛	9,100	87,178.00	0.01
44	600598	北大荒	6,100	85,400.00	0.01
45	600649	城投控股	10,105	82,052.60	0.01
46	600812	华北制药	7,056	81,285.12	0.01
47	600376	首开股份	6,098	80,554.58	0.01
48	600418	江淮汽车	7,000	77,770.00	0.01
49	601866	中海集运	21,200	77,168.00	0.01
50	600549	厦门钨业	1,800	74,574.00	0.01
51	600643	爱建股份	7,100	74,550.00	0.01
52	600108	亚盛集团	12,100	73,447.00	0.01
53	600879	航天电子	6,000	72,960.00	0.01
54	600595	中孚实业	7,080	71,083.20	0.01
55	601179	中国西电	11,100	67,710.00	0.01
56	600325	华发股份	5,971	66,994.62	0.01
57	600331	宏达股份	4,999	66,536.69	0.01
58	600432	吉恩镍业	2,962	65,993.36	0.01
59	600895	张江高科	6,990	65,985.60	0.01
60	600216	浙江医药	2,100	65,919.00	0.01
61	600703	三安光电	3,960	64,944.00	0.01
62	600085	同仁堂	1,800	64,188.00	0.01
63	600239	云南城投	4,901	63,026.86	0.01
64	600369	西南证券	5,154	61,177.98	0.00
65	600037	歌华有线	5,982	60,956.58	0.00
66	600118	中国卫星	2,700	60,507.00	0.00

67	600096	云天化	3,000	59,670.00	0.00
68	600266	北京城建	3,961	59,613.05	0.00
69	601158	重庆水务	7,200	59,472.00	0.00
70	600747	大连控股	7,000	56,630.00	0.00
71	600663	陆家嘴	3,981	55,654.38	0.00
72	600528	中铁二局	6,150	53,443.50	0.00
73	601588	北辰实业	14,073	51,507.18	0.00
74	600220	江苏阳光	9,900	49,896.00	0.00
75	601888	中国国旅	2,100	49,623.00	0.00
76	600884	杉杉股份	2,656	48,525.12	0.00
77	600872	中炬高新	7,100	47,712.00	0.00
78	600183	生益科技	4,925	45,211.50	0.00
79	600109	国金证券	3,050	44,377.50	0.00
80	600823	世茂股份	2,998	43,860.74	0.00
81	600240	华业地产	4,000	42,600.00	0.00
82	600773	西藏城投	1,800	42,480.00	0.00
83	600737	中粮屯河	4,088	41,902.00	0.00
84	600064	南京高科	3,013	41,730.05	0.00
85	600638	新黄浦	4,012	39,919.40	0.00
86	600158	中体产业	6,300	39,690.00	0.00
87	600641	万业企业	3,970	36,127.00	0.00
88	600622	嘉宝集团	4,000	33,240.00	0.00
89	600635	大众公用	5,298	31,258.20	0.00
90	601268	二重重装	2,700	29,268.00	0.00
91	600175	美都控股	6,930	28,759.50	0.00
92	600748	上实发展	3,960	28,670.40	0.00
93	601099	太平洋	3,006	28,316.52	0.00
94	600246	万通地产	5,060	25,300.00	0.00
95	600173	卧龙地产	3,000	16,230.00	0.00
96	600759	正和股份	3,000	15,930.00	0.00
97	600741	华域汽车	1,008	11,219.04	0.00
98	600655	豫园商城	83	903.04	0.00

## 7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.5.1 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	600585	海螺水泥	7,765,107.80	0.62

2	600795	国电电力	5,386,844.16	0.43
3	601766	中国南车	4,860,259.00	0.39
4	600887	伊利股份	4,630,128.21	0.37
5	600739	辽宁成大	4,470,337.42	0.35
6	600068	葛洲坝	4,335,502.93	0.34
7	601299	中国北车	4,203,433.08	0.33
8	600690	青岛海尔	3,690,872.41	0.29
9	600518	康美药业	3,621,572.81	0.29
10	601666	平煤股份	3,590,597.08	0.29
11	600415	小商品城	3,528,077.56	0.28
12	601009	南京银行	3,492,573.16	0.28
13	601186	中国铁建	3,481,168.06	0.28
14	600875	东方电气	3,418,279.68	0.27
15	600188	兖州煤业	3,409,515.01	0.27
16	600132	重庆啤酒	3,333,192.47	0.26
17	600309	烟台万华	3,097,629.30	0.25
18	600256	广汇股份	3,057,568.46	0.24
19	600100	同方股份	2,968,809.08	0.24
20	600150	中国船舶	2,894,048.45	0.23

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。

#### 7.5.2 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	600690	青岛海尔	9,010,478.20	0.72
2	600675	中华企业	6,380,854.98	0.51
3	600816	安信信托	4,194,965.05	0.33
4	600795	国电电力	1,166,886.00	0.09
5	600188	兖州煤业	832,622.80	0.07
6	600585	海螺水泥	444,603.40	0.04
7	601766	中国南车	226,416.00	0.02
8	601333	广深铁路	102,372.90	0.01
9	600631	百联股份	79,002.00	0.01
10	600839	四川长虹	75,072.00	0.01
11	600808	马钢股份	73,776.00	0.01
12	600601	方正科技	72,768.00	0.01
13	600008	首创股份	60,836.34	0.00
14	600026	中海发展	51,166.08	0.00
15	600269	赣粤高速	50,626.70	0.00
16	600481	双良节能	49,022.00	0.00

17	600198	大唐电信	41,580.00	0.00
18	600300	维维股份	38,274.39	0.00
19	601107	四川成渝	34,560.00	0.00
20	600161	天坛生物	34,088.70	0.00

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。

### 7.5.3 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	230,951,983.94
卖出股票收入（成交）总额	23,105,085.84

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。

### 7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,000,000.00	4.08
	其中：政策性金融债	50,000,000.00	4.08
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	5,378,245.20	0.44
8	其他	-	-
9	合计	55,378,245.20	4.52

### 7.7 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	080413	08 农发 13	500,000	50,000,000.00	4.08
2	113001	中行转债	50,940	5,378,245.20	0.44

注：本基金本报告期末仅持有以上债券。

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

## 7.9 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。

## 7.10 投资组合报告附注

7.10.1 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。

7.10.2 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。

### 7.10.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	166,666.66
2	应收证券清算款	1,371,053.02
3	应收股利	1,077.44
4	应收利息	662,429.22
5	应收申购款	3,235,702.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,436,928.61

### 7.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113001	中行转债	5,378,245.20	0.44

### 7.10.5 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。

## 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

32,984	35,827.73	381,434,157.90	32.28%	800,307,808.14	67.72%
--------	-----------	----------------	--------	----------------	--------

## 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	50,334.38	0.0043%

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年3月31日）基金份额总额	2,088,942,454.37
本报告期期初基金份额总额	1,154,664,626.61
本报告期基金总申购份额	505,411,038.33
减：本报告期基金总赎回份额	478,333,698.90
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,181,741,966.04

## 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

本报告期内本基金管理人、基金托管人的专门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。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国海证券	1	238,081,424.82	93.72%	202,369.14	93.72%	-
广发证券	1	15,964,655.96	6.28%	13,570.91	6.28%	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无新增和减少交易单元。

b) 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。

c) 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。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国海证券	1,901,670.40	26.37%	-	-	-	-	145,774,031.68	66.11%
广发证券	5,309,748.10	73.63%	-	-	-	-	42,786,775.26	19.40%
申银万国	-	-	-	-	-	-	31,937,744.51	14.49%
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-01-25
2	易方达基金管理有限公司关于旗下基金持有的哈药股份（证券代码：600664）采用收盘价估值的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-02-17
3	易方达基金管理有限公司关于调整中国工商银行借记卡基金网上直销优惠申购费率的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-02-28
4	易方达基金管理有限公司关于运用公司自有资金申购旗下开放式基金的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-03-01
5	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加浦发银行基金定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-03-01
6	易方达基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-03-09

	件的公告		
7	易方达基金管理有限公司关于扩展网上交易定期定额业务申购周期的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-03-28
8	易方达基金管理有限公司关于增加民族证券、瑞银证券、中信万通证券为易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-03-29
9	易方达基金管理有限公司关于基金对账单服务形式调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-03-31
10	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行个人电子银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-04-01
11	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加东莞银行网上银行申购和定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-04-01
12	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加华夏银行为代销机构、在华夏银行推出定期定额申购业务及参加华夏银行网上银行与定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-04-07
13	易方达基金管理有限公司关于公司股东更名的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-04-09
14	关于易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金基金份额净值计算位数变更及基金合同、托管协议修改的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-04-16
15	易方达基金管理有限公司关于开通中国工商银行借记卡网上直销定期定额申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-04-26
16	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加江苏银行网上银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-04-29
17	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在中信证券推出定期定额申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-04-29
18	关于暂停中国银行广东省分行银行卡基金网上直销业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-05-24
19	易方达基金管理有限公司关于开通基金手机交易和查询业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-06-07
20	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在中国工商银行推出定期定额申购业务及参加中国工商银行定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-06-17
21	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开	中国证券报、上海	2011-06-30

	放式基金参加交通银行网上银行、手机银行 申购费率优惠活动的公告	证券报、证券时报	
--	------------------------------------	----------	--

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

1. 中国证监会核准易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的文件；
2. 《易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；
3. 《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
4. 《易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；
5. 基金管理人业务资格批件和营业执照；
6. 基金托管人业务资格批件和营业执照。

### 11.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

### 11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司  
二〇一一年八月二十六日