易方达深证100交易型开放式指数基金

2010 第四季度报告

2010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：中国银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一一年一月二十二日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2011年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2010年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达深证100ETF
基金主代码	159901
交易代码	159901
基金运作方式	交易型开放式（ETF）
基金合同生效日	2006年3月24日
报告期末基金份额总额	23,191,833,170份
投资目标	紧密跟踪目标指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将采用优化方法计算最优化投资组合的个股权重比例，以此构建本基金实际的投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。
业绩比较基准	深证100价格指数
风险收益特征	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，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2010年10月1日-2010年12月31日）
1.本期已实现收益	3,305,832,985.07
2.本期利润	2,328,098,197.26
3.加权平均基金份额本期利润	0.1594
4.期末基金资产净值	18,941,495,188.67
5.期末基金份额净值	0.817

注：1.本基金已于2006年4月14日进行了基金份额折算，折算比例为0.94948342。
2.本基金已于2010年11月19日进行了基金份额拆分，拆分比例为5:1，即每一份基金份额拆成5份。
3.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。
4.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 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	9.05%	1.96%	8.77%	1.96%	0.28%	0.00%

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

易方达深证100交易型开放式指数基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
（2006年3月24日至2010年12月31日）

注：1.基金合同中关于基金投资比例的约定：
本基金将把全部或接近全部的基金资产用于跟踪标的指数的表现，正常情况下，本基金的指数化投资比例不低于基金资产净值的95%。
本基金的建仓期为三个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。
2. 本基金自基金合同生效至报告期末的基金份额净值增长率为299.68%，同期业绩比较基准收益率为300.79%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）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50指数基金的基金经理，易方达沪深300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，指数与量化投资部总经理助理	2006-7-4	-	7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基金经理助理，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助理。
王建军	本基金的基金经理，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基金经理助理，易方达50指数基金基金经理助理、易方达沪深300指数基金基金经理助理、易方达深证100交易型开放式指数基金联接基金基金经理助理、指数与量化投资部量化研究员。	2010-9-27	-	3年	经济学博士，历任武汉利辉国际游轮有限公司职员，依莱克斯（中国）汽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研究部数量研究员、易方达深证100交易型开放式指数基金基金经理助理、易方达50指数基金基金经理助理、易方达沪深300指数基金基金经理助理、易方达深证100交易型开放式指数基金联接基金基金经理助理、指数与量化投资部量化研究员。

注：1.此处的“任职日期”和“离任日期”分别为公告确定的聘任日期和解聘日期。
2.证券从业的含义遵从行业协会《证券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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程来确保公平对待不同投资组合，进出口增速则较前期仍有一定程度的下降，第四季度GDP增速在连续两个季度下降之后企稳。由于通胀预期的升温，消费价格指数（CPI）在第四季度创出了年内的新高，工业品出厂价格指数（PPI）在第四季度也出现了反弹。在货币供应方面，第四季度M1和M2增速与第三季度基本持平。在通胀水平持续上升的情况下，央行在第四季度连续动用了上调存款准备金率和加息等调控手段，因而A股市场在第四季度出现了冲高回落、震荡的走势，上证指数第四季度涨幅为5.74%，深证100价格指数涨幅为8.77%。作为被动型指数基金，深证100ETF的单位净值（根据2010年11月19日基金拆分比例进行调整计算）跟随业绩比较基准出现了一定程度的上涨。

本基金于2010年11月19日进行了份额拆分，拆分比例为1拆5。根据拆分之后一个多月的运行情况分析，拆分对深证100ETF基金二级市场流动性起到了一定的改善作用。

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0.817元，本报告期份额净值增长率为9.05%，同期业绩比较基准收益率为8.77%，日跟踪偏离度的均值为0.0302%，日跟踪误差为0.0446%，年化跟踪误差为0.6903%，各项指标均在合同规定的目标控制范围之内。

4.4.3 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段市场，宏观经济总体将继续保持平稳发展，宏观经济政策短期的重点将是保持经济总量平稳发展的前提下严格控制通胀水平，中长期的重点仍是着力完善体制机制来推动经济增长方式和经济结构的优化调整。近期海外经济复苏的过程中出现了一些结构上的分化，欧洲经济出现了一些负面的波动，但美国经济的持续复苏则成为市场的一致预期。鉴于内外需结构的调整，优化以及国内经济的弹性和潜在的内生增长力，本基金对中国经济中长期的前景持相对乐观的判断。目前上市公司整体的业绩增长仍较快，盈利增长预期也较好，虽然A股市场估值在细分行业上差异较大，但整体估值水平合理并处于相对偏低区域。同时，深证100指数行业分布均衡合理，指数成分股成长性较高，深证100指数中长期的投资价值依然明显。

作为被动投资的基金，深证100ETF将继续坚持既定的指数化投资策略，以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为投资目标，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。期望深证100ETF为投资者分享中国经济的未来长期成长提供良好的投资机会。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	18,890,726,530.80	99.63
	其中：股票	18,890,726,530.80	99.63
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	52,094,844.96	0.27
6	其他各项资产	17,808,280.35	0.09
7	合计	18,960,629,656.11	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而5.2的合计项不含可退替代款估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	83,715,188.00	0.44
B	采掘业	1,626,472,464.33	8.59
C	制造业	11,342,211,707.93	59.88
C0	食品、饮料	2,042,109,003.74	10.78
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	135,929,438.22	0.72
C4	石油、化学、塑胶、塑料	764,789,272.09	4.04
C5	电子	587,681,215.22	3.10
C6	金属、非金属	2,448,661,543.50	12.93
C7	机械、设备、仪表	3,854,559,457.73	20.35
C8	医药、生物制品	1,339,873,285.39	7.07
C99	其他制造业	168,608,492.04	0.89
D	电力、煤气及水的生产和供应业	236,488,200.70	1.25
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	142,087,761.90	0.75
G	信息技术业	705,174,075.25	3.72
H	批发和零售贸易	908,512,009.71	4.80
I	金融、保险业	1,222,920,294.07	6.46
J	房地产业	1,604,701,364.50	8.47
K	社会服务业	226,608,422.85	1.20
L	传播与文化产业	176,508,232.72	0.93
M	综合类	614,940,079.73	3.25
	合计	18,890,339,801.69	99.73

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000002	万科A	112,282,473	922,961,928.06	4.87
2	000858	五粮液	24,264,465	840,278,422.95	4.44
3	002024	苏宁电器	53,542,458	701,406,199.80	3.70
4	000983	西山煤电	20,850,550	556,501,179.50	2.94
5	000001	深发展A	34,344,170	542,294,444.30	2.86
6	000063	中兴通讯	19,542,503	533,510,331.90	2.82
7	000338	潍柴动力	10,020,865	524,792,700.05	2.77
8	000651	格力电器	27,666,063	501,585,722.19	2.65
9	000157	中联重科	30,141,241	426,197,147.74	2.25
10	000527	美的电器	24,024,989	418,034,808.60	2.21

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细
本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.8.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,373,445.43
2	应收证券清算款	16,419,369.36
3	应收股利	-
4	应收利息	15,465.56
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,808,280.35

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	5,967,166,634
本报告期基金总申购份额	24,665,000,000
减：本报告期基金总赎回份额	27,233,000,000
本报告期基金拆分变动份额	19,792,666,536
本报告期期末基金份额总额	23,191,833,170

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录
1. 中国证监会批准易方达深证100交易型开放式指数基金募集的文件；
2. 《易方达深证100交易型开放式指数基金基金合同》；
3. 《易方达深证100交易型开放式指数基金托管协议》；
4. 基金管理人业务资格批件和营业执照；
5. 基金托管人业务资格批件和营业执照。

7.2 存放地点
基金管理人、基金托管人处。

7.3 查阅方式
投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司
二〇一一年一月二十二日

易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2010 第四季度报告

2010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：中国银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一一年一月二十二日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2011年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2010年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	1,154,664,626.61份
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，待指数衍生金融产品推出以后，基金管理人在履行适当程序后，本基金可以适度运用衍生金融产品进一步降低跟踪误差。
业绩比较基准	上证中盘指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	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。 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。
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

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基金
基金交易代码	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

2.1.2 目标基金产品概况

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、成份股权重由于日由流通量发生变化、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。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2010年10月1日-2010年12月31日）
1.本期已实现收益	169,374,676.61
2.本期利润	208,304,923.87
3.加权平均基金份额本期利润	0.1560
4.期末基金资产净值	1,259,831,044.21
5.期末基金份额净值	1.091

注：1.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；
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	10.09%	1.71%	10.23%	1.77%	-0.14%	-0.06%

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

易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
（2010年3月31日至2010年12月31日）

注：1.本基金合同于2010年3月31日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。
2.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。
3.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。
4.本基金自基金合同生效至报告期末的基金份额净值增长率为9.10%，同期业绩比较基准收益率为0.46%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）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		
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基金经理	2010-3-31	-	5年	硕士研究生，历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，易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理，研究部行业研究员。

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统中的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

无。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2010年第四季度，严厉房地产限购令降温楼市的效果尚未显现，通胀逐步显露出全面化趋向，物价形势日益严峻。11月份CPI达5.1%，创年度新高。中央紧缩货币的信心逐步坚定，央行将大型商业银行存款准备金率加至18.5%的历史最高位，并先后两次上调存贷款基准利率。经济基本面和调控政策的共同作用下，A股市场经历了前高后低的大幅波动，上证指数报告期内涨幅5.74%，期间最高收盘涨幅达19.0%。市场风格的变换更为剧烈，第四季度伊始，前期严重落后市场的大盘股、周期股全面上涨；消费、医药、新兴技术等板块则大幅下跌。然而，这种风格变换仅持续了一个月，又完全转换回去，第四季度成为2010年最为考验投资者心态的一个时期。

上证中盘ETF联接基金属于完全跟踪指数的证券投资基金，报告期内，本基金跟随上证中盘指数成分股调整进行日常操作，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1.091元，本报告期份额净值增长率为10.09%，同期业绩比较基准收益率为10.23%，年化跟踪误差1.66%，在合同规定的控制范围之内。

4.4.3 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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。在四季度经济增速回落过程中出现的高通胀，使得中国经济潜在增速下降的隐忧显现。展望2011上半年，在紧缩性经济政策的作用下，中国经济仍将继续回落，通胀亦将得以控制。下半年目前仍看不清楚，重新上行的概率较大。在一季度经济下行、流动性紧缩的预期下，A股市场的短期走势难以乐观。然而，目前沪深股市的2011年整体动态市盈率在15倍左右，处于历史较低水平，下跌空间也比较有限，短期市场的最大机会可能来自于风格演变。长期来看，我国仍处于快速的城市化、工业化进程中，经济仍将在较长时期内保持高增速。本基金对市场长期走势看好，短期需更加关注流动性紧缩的力度以及房地产市场的变化。

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。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	19,824,802.65	1.57
	其中：股票	19,824,802.65	1.57
2	基金投资	1,155,931,912.08	91.62
3	固定收益投资	63,116,818.40	5.00
	其中：债券	63,116,818.40	5.00
	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	15,315,560.55	1.21
7	其他各项资产	7,521,564.50	0.60
8	合计	1,261,710,658.18	100.00

5.2 期末投资目标基金明细

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基金	股票型	交易型开放式	易方达基金管理有限公司	1,155,931,912.08	91.75

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	17,815.00	0.00
B	采掘业	109,427.80	0.01
C	制造业	10,080,929.08	0.80
C0	食品、饮料	12,460.70	0.00
C1	纺织、服装、皮毛	11,870.04	0.00
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	44,188.33	0.00
C5	电子	11,027.00	0.00
C6	金属、非金属	84,805.04	0.01
C7	机械、设备、仪表	9,846,680.34	0.78
C8	医药、生物制品	69,897.63	0.01
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	11,467.89	0.00
E	建筑业	34,661.41	0.00
F	交通运输、仓储业	72,891.74	0.01
G	信息技术业	51,604.76	0.00
H	批发和零售贸易	27,384.75	0.00
I	金融、保险业	3,036,246.74	0.24
J	房地产业	6,286,977.93	0.50
K	社会服务业	20,765.47	0.00
L	传播与文化产业	7,275.00	0.00
M	综合类	67,355.08	0.01
	合计	19,824,802.65	1.57

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600690	青岛海尔	344,275	9,711,997.75	0.77
2	600675	中华企业	893,869	6,185,573.48	0.49
3	600816	安信信托	219,505	2,985,268.00	0.24
4	600256	广汇股份	714	29,938.02	0.00
5	600585	海螺水泥	992	29,442.56	0.00
6	600068	葛洲坝	2,021	23,443.60	0.00
7	601989	中国重工	1,900	22,401.00	0.00
8	601299	中国北车	3,100	21,979.00	0.00
9	600415	小商品城	600	21,024.00	0.00
10	601009	南京银行	2,010	19,979.40	0.00

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	50,105,000.00	3.98
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	13,011,818.40	1.03
7	其他	-	-
8	合计	63,116,818.40	5.01

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	0801026	08央行票据26	500,000	50,105,000.00	3.98
2	113001	中行转债	118,440	13,011,818.40	1.03

注：本基金本报告期末仅持有以上债券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.9.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.9.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	166,666.66
2	应收证券清算款	19,626.99
3	应收股利	-
4	应收利息	1,904,796.76
5	应收申购款	5,430,474.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,521,564.50

5.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113001	中行转债	13,011,818.40	1.03

5.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600816	安信信托	2,985,268.00	0.24	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	1,967,318,784.61
本报告期基金总申购份额	500,128,078.44
减：本报告期基金总赎回份额	1,312,782,236.44
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,154,664,626.61

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录
1.中国证监会核准易方达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。

7.2 存放地点
基金管理人、基金托管人处。

7.3 查阅方式
投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司
二〇一一年一月二十二日