

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:二〇一一年七月二十一日

§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7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预示其未来表现。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。  
本报告自2011年4月1日起共6个月止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达深证100ETF联接
基金代码	110109
交易代码	110109
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年12月1日
报告期末基金份额总额	10,717,934,663.82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。
投资策略	本基金为深证100ETF的联接基金。深证100ETF是主要采用完全复制法实现对深证100价格指数跟踪的被动型指数基金。本基金主要通过投资于深证100ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪,力争最终将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,决定采用实物申购的方式或申购二级市场交易的方式进行深证100ETF的交易,待取得基金份额产品推出以后,本基金可以适时采用衍生品金融产品进一步降低跟踪误差。
业绩比较基准	深证100价格指数收益率X95%+活期存款利率(税后)X5%
风险收益特征	本基金为深证100ETF的联接基金,主要通过投资于深证100ETF实现业绩比较基准的紧密跟踪。因此,本基金的风险收益特征与深证100价格指数表现密切相关。理论上,本基金预期风险与收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。
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

2.1 目标基金基本情况

基金名称	易方达深证100交易型开放式指数基金
基金代码	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
证券上市证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2006年4月24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	中国银行股份有限公司

2.2 目标基金产品概况

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,即按标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数的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股票组合,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。

§3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元	
主要财务指标	报告期(2011年4月1日-2011年6月30日)
1.本期已实现收益	40,187,525.20
2.本期利润	-535,519,580.83
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0499
4.期末基金资产净值	10,197,762,582.63
5.期末基金份额净值	0.9515

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。

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	-5.23%	1.12%	-5.47%	1.14%	0.24%	-0.02%

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



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:二〇一一年七月二十一日

§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7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预示其未来表现。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。  
本报告自2011年4月1日起共6个月止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达丰添利债券
基金代码	161115
交易代码	161115
基金运作方式	契约型,本基金合同生效后三年内(含三年)封闭运作,在深圳证券交易所上市交易。封闭期结束后,本基金转为上市开放式基金(LOF)。
基金合同生效日	2010年11月9日
报告期末基金份额总额	2,679,114,943.70份
投资目标	本基金通过主要投资于债券品种,力争为基金份额持有人提供持续稳定的高于业绩比较基准的收益,实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金基于对以下因素的判断,进行基金资产在非信用类固定收益品种(国债、央行票据等)、信用等级固定收益品种(含可转换债券)、新股(含增发)申购之前配置:1)基于对利率走势、利率期限结构等因素的分析,预测固定收益品种的收益和风险;2)基于对宏观经济、行业前景及公司财务状况的分析,考量其对固定收益市场信用利差的影响;3)基于对债券发行公司的基本面、盈利利率水平、票息率及流动性、信用风险等固定收益因素,以及期权定价模型,对可转债债券进行定价分析并制定相关投资策略;4)基于对股(含增发)发行利率、中签率、上市后的平均涨幅等的分析,预测新股(含增发)申购的收益以及风险。
业绩比较基准	三年期银行定期存款收益率+1.2%
风险收益特征	本基金为债券型基金,属证券投资基金中的低风险品种,理论上其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金,高于货币市场基金。
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

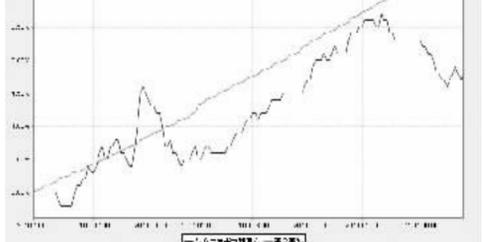
3.1 主要财务指标

单位:人民币元	
主要财务指标	报告期(2011年4月1日-2011年6月30日)
1.本期已实现收益	23,652,294.68
2.本期利润	9,222,506.56
3.加权平均基金份额本期利润	0.0034
4.期末基金资产净值	2,687,043,520.64
5.期末基金份额净值	1.003

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。

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	0.29%	0.09%	1.48%	0.02%	-1.19%	0.07%

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  
易方达丰添利债券型证券投资基金  
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11月9日至2011年6月30日



注:1.本基金合同于2010年11月9日生效,截至报告期末本基金合同生效未满一年。  
2.本基金投资于国债的比例不低于基金资产的80%,其中,信用债券的投资比例不低于固定收益类资产的40%;

易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2011 第二季度 报告

2011年6月30日



注:1.本基金合同中关于基金投资比例的规定:  
① 本基金资产中投资于深证100ETF的比例不低于基金资产净值的90%;现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。  
② 本基金参与股票资产申购,本基金所申报的金额不超过基金总资产,本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;  
③ 本基金不受《证券投资基金运作管理办法》第三十一条的下列限制:①一只基金持有一家上市公司股票,其市值不超过基金资产净值的10%;②同一基金管理人管理的全部基金持有一家上市公司证券,不超过该证券的10%。  
④ 法律法规和基金合同规定的其他限制。

若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更,致使本款前述约定的投资禁止行为和限制措施被修改或取消,基金管理人可在依法履行相应程序后,本基金可相应调整禁止行为和限制规定。  
因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人以外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的,基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规另有规定的,从其规定。  
2.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。  
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-4.85%,同期业绩比较基准收益率为-6.84%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理 钱基金小组 简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限 任职日期 离任日期	证券从业年限	说明
林飞	本基金的基金经理、易方达50指数的基金经理、易方达深证100交易型开放式指数基金的基金经理、指数与量化投资部副经理	2009-12-1 -	8年	博士研究生,曾任融通基金管理有限公司研究员,基金经理助理,华泰证券(中国)投资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,易方达上证中盘交易型开放式指数基金的基金经理助理
王建华	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、易方达上证中盘交易型开放式指数基金的基金经理	2010-9-27 -	4年	博士研究生,曾任武汉利群国际证券有限公司职员,华泰证券(中国)投资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,易方达上证中盘交易型开放式指数基金的基金经理助理

注:1.此处的“离任日期”为公告确定的解聘日期,林飞的“任职日期”为基金合同生效之日,王建华的“任职日期”为公告确定的聘任日期。  
2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。  
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明  
本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定,以取信于市场、取信于社会投资者为宗旨,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内,基金运作合法合规,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明  
4.3.1 公平交易制度的执行情况  
本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程来确保公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等,并重视交易执行环节的公平交易措施,以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则,通过投资交易系统中的公平交易模块,以确保能够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  
2011年二季度国内宏观经济整体平稳发展,投资增速总体保持在高位运行,消费增速较

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	105,770,981.50	1.04
	其中:股票	105,770,981.50	1.04
2	固定收益投资	9,455,448,141.76	92.59
	其中:债券	439,175,000.00	4.30
	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	189,595,253.42	1.86
7	其他各项资产	22,568,494.45	0.22
8	合计	10,212,557,871.13	100.00

序号	基金名称	基金类型	运作方式	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	易方达深证100交易型开放式指数基金	股票型	交易型开放式(ETF)	9,455,448,141.76	92.72

代码	行业类别	股票名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔		342,630.00	0.00
B	采掘业		8,556,421.59	0.08
C	制造业		62,255,405.83	0.61
C0	食品、饮料		16,466,597.76	0.16
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		6,709,546.77	0.07
C5	电子		1,842,674.28	0.02
C6	金属、非金属		10,986,908.57	0.11
C7	机械、设备、仪表		19,925,274.62	0.20
C8	医药、生物制品		5,445,495.24	0.05
C99	其他制造业		878,908.59	0.01
D	电力、煤气及水的生产和供应业		1,097,658.32	0.01
E	建筑业		-	-
F	交通运输、仓储业		-	-
G	信息技术业		3,058,762.12	0.03
H	批发和零售贸易		4,545,929.98	0.04
I	金融、保险业		6,505,329.27	0.06
J	房地产业		8,045,758.59	0.08
K	社会服务业		1,332,850.82	0.01
L	传播与文化产业		5,187,304.28	0.05
M	综合类		4,842,930.70	0.05
	合计		105,770,981.50	1.04

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	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600795 国电电力	10,000,000	29,600,000.00	1.10
2	300217 东方热电	460,000	13,330,800.00	0.50
3	601208 东材科技	104,918	2,267,277.98	0.08
4	002205 国电股份	24,078	626,028.00	0.02

注:本基金本报告期末持有以上股票。

5.4 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	313,836,000.00	11.68
3	金融债券	195,934,000.00	7.29
	其中:政策性金融债	195,934,000.00	7.29
4	企业债券	1,149,593,866.67	42.78
5	企业短期融资券	1,340,026,000.00	49.87
6	可转债	-	-
7	中期票据	256,880,385.20	9.56
8	其他	-	-
9	合计	3,256,270,231.87	121.18

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	1001069	10央行票据69	2,200,000	214,346,000.00	7.98
2	110013	国电转债	1,310,010	156,323,493.30	5.82
3	1181283	11大唐集CP1	1,000,000	99,880,000.00	3.72
4	1101032	11央行票据32	1,000,000	99,490,000.00	3.70
5	122688	11国债01	800,000	79,992,000.00	2.98

5.6 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序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 报告期内前十名证券的发行主体本期没有出现在监管部门立案调查,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	159,381.70
2	应收证券清算款	22,980,616.74
3	应收股利	-
4	应收利息	44,089,718.53
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	67,229,716.97

5.8.4 报告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

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	300217	东方热电	13,330,800.00	0.50	新股流通受限
2	601208	东材科技	2,267,277.98	0.08	新股流通受限
3	002205	国电股份	626,028.00	0.02	非公开发行股票受限

§6 基金管理人运用固有资金投资本基金情况  
本基金管理人自基金合同生效日至本报告期末未运用固有资金投资本基金封闭式基金。

§7 备查文件目录

- 1.中国证监会核准易方达丰添利债券型证券投资基金募集的文件;
2. 易方达丰添利债券型证券投资基金合同;
3. 易方达丰添利债券型证券投资基金托管协议;
- 4.基金管理人业务资格批件、营业执照;
- 5.基金托管人业务资格批件、营业执照。

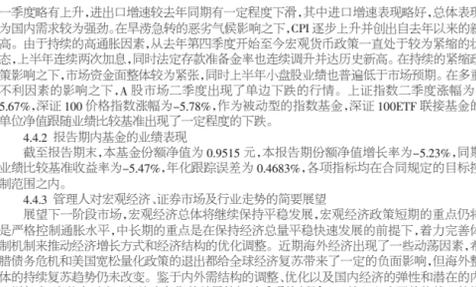
基金管理人、基金托管人处。  
7.3 查阅方式  
投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司  
二〇一一年七月二十一日

易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2011 第二季度 报告

2011年6月30日



注:1.本基金合同中关于基金投资比例的规定:  
① 本基金资产中投资于深证100ETF的比例不低于基金资产净值的90%;现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。  
② 本基金参与股票资产申购,本基金所申报的金额不超过基金总资产,本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;  
③ 本基金不受《证券投资基金运作管理办法》第三十一条的下列限制:①一只基金持有一家上市公司股票,其市值不超过基金资产净值的10%;②同一基金管理人管理的全部基金持有一家上市公司证券,不超过该证券的10%。  
④ 法律法规和基金合同规定的其他限制。

若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更,致使本款前述约定的投资禁止行为和限制措施被修改或取消,基金管理人可在依法履行相应程序后,本基金可相应调整禁止行为和限制规定。  
因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人以外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的,基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规另有规定的,从其规定。  
2.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。  
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-5.47%,同期业绩比较基准收益率为-6.84%。

§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	105,770,981.50	1.04
	其中:股票	105,770,981.50	1.04
2	固定收益投资	9,455,448,141.76	92.59
	其中:债券	439,175,000.00	4.30
	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	189,595,253.42	1.86
7	其他各项资产	22,568,494.45	0.22
8	合计	10,212,557,871.13	100.00

序号	基金名称	基金类型	运作方式	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	易方达深证100交易型开放式				