

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

重要提示
基金管理人及基金托管人承诺不存在虚假记载、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法律责任。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2011年8月22日复核了本报告中的财务数据、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合比例等内容,保证数据真实、准确。

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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,投资者自行承担投资风险,投资者作出投资决策后应自行承担基金的投资风险及基金资产的波动。

本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,请阅读半年度报告正文。
本报告自2011年1月1日起至6月30日止。

2.1 基金基本情况
基金名称:易方达上证中盘ETF
基金代码:110021
交易场所:深圳证券交易所

2.2 基金产品说明
基金的投资目标:紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,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。
基金的投资策略:本基金为上证中盘ETF的跟踪基金,本基金主要投资于上证中盘ETF,实现对上证中盘指数的紧密跟踪,力争使跟踪误差控制在0.35%以内,年化跟踪误差控制在4%以内。

2.3 基金管理人及基金托管人
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

2.4 信息披露方式
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:广州市城西西路189号城建大厦28楼

3 主要会计数据和财务指标
3.1 主要会计数据和财务指标
3.1.1 期间数据和指标
3.1.2 年度数据和指标

3.2 本基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:上证中盘指数收益率*95%+上证国债指数收益率*5%

3.3 基金投资组合报告
3.3.1 基金资产组合情况
3.3.2 基金资产组合情况

3.3.3 基金资产组合情况
3.3.4 基金资产组合情况

3.3.5 基金资产组合情况
3.3.6 基金资产组合情况

3.3.7 基金资产组合情况
3.3.8 基金资产组合情况

3.3.9 基金资产组合情况
3.3.10 基金资产组合情况

3.3.11 基金资产组合情况
3.3.12 基金资产组合情况

3.3.13 基金资产组合情况
3.3.14 基金资产组合情况

3.3.15 基金资产组合情况
3.3.16 基金资产组合情况

3.3.17 基金资产组合情况
3.3.18 基金资产组合情况

3.3.19 基金资产组合情况
3.3.20 基金资产组合情况

3.3.21 基金资产组合情况
3.3.22 基金资产组合情况

3.3.23 基金资产组合情况
3.3.24 基金资产组合情况

3.3.25 基金资产组合情况
3.3.26 基金资产组合情况

3.3.27 基金资产组合情况
3.3.28 基金资产组合情况

3.3.29 基金资产组合情况
3.3.30 基金资产组合情况

3.3.31 基金资产组合情况
3.3.32 基金资产组合情况

3.3.33 基金资产组合情况
3.3.34 基金资产组合情况

3.3.35 基金资产组合情况
3.3.36 基金资产组合情况

3.3.37 基金资产组合情况
3.3.38 基金资产组合情况

3.3.39 基金资产组合情况
3.3.40 基金资产组合情况

3.3.41 基金资产组合情况
3.3.42 基金资产组合情况

3.3.43 基金资产组合情况
3.3.44 基金资产组合情况

3.3.45 基金资产组合情况
3.3.46 基金资产组合情况

3.3.47 基金资产组合情况
3.3.48 基金资产组合情况

3.3.49 基金资产组合情况
3.3.50 基金资产组合情况

3.3.51 基金资产组合情况
3.3.52 基金资产组合情况

3.3.53 基金资产组合情况
3.3.54 基金资产组合情况

3.3.55 基金资产组合情况
3.3.56 基金资产组合情况

3.3.57 基金资产组合情况
3.3.58 基金资产组合情况

3.3.59 基金资产组合情况
3.3.60 基金资产组合情况

3.3.61 基金资产组合情况
3.3.62 基金资产组合情况

3.3.63 基金资产组合情况
3.3.64 基金资产组合情况

3.3.65 基金资产组合情况
3.3.66 基金资产组合情况

3.3.67 基金资产组合情况
3.3.68 基金资产组合情况

3.3.69 基金资产组合情况
3.3.70 基金资产组合情况

3.3.71 基金资产组合情况
3.3.72 基金资产组合情况

3.3.73 基金资产组合情况
3.3.74 基金资产组合情况

3.3.75 基金资产组合情况
3.3.76 基金资产组合情况

3.3.77 基金资产组合情况
3.3.78 基金资产组合情况

3.3.79 基金资产组合情况
3.3.80 基金资产组合情况

3.3.81 基金资产组合情况
3.3.82 基金资产组合情况

3.3.83 基金资产组合情况
3.3.84 基金资产组合情况

3.3.85 基金资产组合情况
3.3.86 基金资产组合情况

3.3.87 基金资产组合情况
3.3.88 基金资产组合情况

3.3.89 基金资产组合情况
3.3.90 基金资产组合情况

3.3.91 基金资产组合情况
3.3.92 基金资产组合情况

3.3.93 基金资产组合情况
3.3.94 基金资产组合情况

3.3.95 基金资产组合情况
3.3.96 基金资产组合情况

3.3.97 基金资产组合情况
3.3.98 基金资产组合情况

3.3.99 基金资产组合情况
3.3.100 基金资产组合情况

3.3.101 基金资产组合情况
3.3.102 基金资产组合情况

3.3.103 基金资产组合情况
3.3.104 基金资产组合情况

3.3.105 基金资产组合情况
3.3.106 基金资产组合情况

3.3.107 基金资产组合情况
3.3.108 基金资产组合情况

3.3.109 基金资产组合情况
3.3.110 基金资产组合情况

3.3.111 基金资产组合情况
3.3.112 基金资产组合情况

3.3.113 基金资产组合情况
3.3.114 基金资产组合情况

3.3.115 基金资产组合情况
3.3.116 基金资产组合情况

3.3.117 基金资产组合情况
3.3.118 基金资产组合情况

3.3.119 基金资产组合情况
3.3.120 基金资产组合情况

3.3.121 基金资产组合情况
3.3.122 基金资产组合情况

3.3.123 基金资产组合情况
3.3.124 基金资产组合情况

3.3.125 基金资产组合情况
3.3.126 基金资产组合情况

3.3.127 基金资产组合情况
3.3.128 基金资产组合情况

3.3.129 基金资产组合情况
3.3.130 基金资产组合情况

3.3.131 基金资产组合情况
3.3.132 基金资产组合情况

3.3.133 基金资产组合情况
3.3.134 基金资产组合情况

3.3.135 基金资产组合情况
3.3.136 基金资产组合情况

3.3.137 基金资产组合情况
3.3.138 基金资产组合情况

3.3.139 基金资产组合情况
3.3.140 基金资产组合情况

3.3.141 基金资产组合情况
3.3.142 基金资产组合情况

3.3.143 基金资产组合情况
3.3.144 基金资产组合情况

3.3.145 基金资产组合情况
3.3.146 基金资产组合情况

3.3.147 基金资产组合情况
3.3.148 基金资产组合情况

3.3.149 基金资产组合情况
3.3.150 基金资产组合情况

3.3.151 基金资产组合情况
3.3.152 基金资产组合情况

3.3.153 基金资产组合情况
3.3.154 基金资产组合情况

3.3.155 基金资产组合情况
3.3.156 基金资产组合情况

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

2011 半年度 报告摘要

2011年6月30日

基金管理人设有估值委员会,负责公司营运估值由估值委员会成员,研究员、投资风险管理部、监察部和核算部指定人员担任。估值委员会负责审核和确定估值政策和程序,指导和监督整个估值流程。估值委员会成员由基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金服务机构、基金注册登记机构、基金估值服务机构等各方专业胜任人员组成,基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金服务机构、基金注册登记机构、基金估值服务机构等各方专业胜任人员组成,基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金服务机构、基金注册登记机构、基金估值服务机构等各方专业胜任人员组成。

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托管人——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、基金份额申购赎回核算、基金费用开支及净值计算、基金份额持有人权益保护等方面,在重要方面严格履行了基金托管人应尽的义务,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度基金报告中财务数据等信息的真实性、准确性、完整性发表意见
本托管人对本半年度基金报告中财务数据等信息的真实性、准确性、完整性发表意见,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

本托管人根据中国证监会颁布的法律法规、基金合同和托管协议,对基金管理人编制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数据、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合等信息进行了核查,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
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 期末, 2011年6月30日, 上年度末, 2010年12月31日. Rows include 资产, 负债, 所有者权益, 未分配利润, etc.

6.2 利润表
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 本期, 2011年1月1日至2011年6月30日, 上年同期, 2010年7月1日至2010年12月31日. Rows include 营业收入, 公允价值变动收益, 投资收益, 其他收入, 营业支出, 营业利润, 所得税费用, 净利润, 其他综合收益, 综合收益总额, 归属于母公司的净利润, 归属于母公司的综合收益总额, 归属于母公司的所有者权益, 归属于母公司的未分配利润, 归属于母公司的其他综合收益, 归属于母公司的所有者权益, 归属于母公司的未分配利润, 归属于母公司的其他综合收益.

注:1.上述期间市场利率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证券费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金净额后的净额。债券利息收入不计利息。

6.4.2 关联方交易
6.4.2.1 基金管理费
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 本期, 2011年1月1日至2011年6月30日, 上年同期, 2010年7月1日至2010年12月31日. Rows include 基金管理费, 基金托管费, 销售服务费, 其他费用.

注:1.本基金管理费按前一日基金资产净值的0.5%的年费率计提,计算方法如下:
H=E*0.5%/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-前一日基金持有的上述中盘ETF公允价值的1/10以累计。

基金管理人每日计算,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,具体如下:
H=E*0.5%/当年天数
H为每日应计提的客户维护费
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-前一日基金持有的上述中盘ETF公允价值的1/10以累计。

基金管理人每日计算,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。

6.4.2.2 基金托管费
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 本期, 2011年1月1日至2011年6月30日, 上年同期, 2010年7月1日至2010年12月31日. Rows include 基金托管费, 基金销售服务费, 其他费用.

注:本基金托管费按前一日基金资产净值的0.1%的年费率计提,计算方法如下:
H=E*0.1%/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-前一日基金持有的上述中盘ETF公允价值的1/10以累计。

基金管理人每日计算,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。

6.4.2.3 关联方交易
6.4.2.3.1 基金管理费
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 本期, 2011年1月1日至2011年6月30日, 上年同期, 2010年7月1日至2010年12月31日. Rows include 基金管理费, 基金托管费, 销售服务费, 其他费用.

注:1.本基金管理费按前一日基金资产净值的0.5%的年费率计提,计算方法如下:
H=E*0.5%/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-前一日基金持有的上述中盘ETF公允价值的1/10以累计。

基金管理人每日计算,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。

6.4.2.3.2 基金托管费
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 本期, 2011年1月1日至2011年6月30日, 上年同期, 2010年7月1日至2010年12月31日. Rows include 基金托管费, 基金销售服务费, 其他费用.

注:本基金托管费按前一日基金资产净值的0.1%的年费率计提,计算方法如下:
H=E*0.1%/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-前一日基金持有的上述中盘ETF公允价值的1/10以累计。

基金管理人每日计算,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。

6.4.2.3.3 关联方交易
6.4.2.3.3.1 基金管理费
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 本期, 2011年1月1日至2011年6月30日, 上年同期, 2010年7月1日至2010年12月31日. Rows include 基金管理费, 基金托管费, 销售服务费, 其他费用.

注:1.本基金管理费按前一日基金资产净值的0.5%的年费率计提,计算方法如下:
H=E*0.5%/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-前一日基金持有的上述中盘ETF公允价值的1/10以累计。

基金管理人每日计算,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。

6.4.2.3.3.2 基金托管费
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 本期, 2011年1月1日至2011年6月30日, 上年同期, 2010年7月1日至2010年12月31日. Rows include 基金托管费, 基金销售服务费, 其他费用.

注:本基金托管费按前一日基金资产净值的0.1%的年费率计提,计算方法如下:
H=E*0.1%/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-前一日基金持有的上述中盘ETF公允价值的1/10以累计。

基金管理人每日计算,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。

6.4.2.3.3.3 关联方交易
6.4.2.3.3.3.1 基金管理费
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 本期, 2011年1月1日至2011年6月30日, 上年同期, 2010年7月1日至2010年12月31日. Rows include 基金管理费, 基金托管费, 销售服务费, 其他费用.

注:1.本基金管理费按前一日基金资产净值的0.5%的年费率计提,计算方法如下:
H=E*0.5%/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-前一日基金持有的上述中盘ETF公允价值的1/10以累计。

基金管理人每日计算,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。

6.4.2.3.3.3.2 基金托管费
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 本期, 2011年1月1日至2011年6月30日, 上年同期, 2010年7月1日至2010年12月31日. Rows include 基金托管费, 基金销售服务费, 其他费用.

注:本基金托管费按前一日基金资产净值的0.1%的年费率计提,计算方法如下:
H=E*0.1%/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-前一日基金持有的上述中盘ETF公允价值的1/10以累计。

基金管理人每日计算,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。

6.4.2.3.3.3.3 关联方交易
6.4.2.3.3.3.3.1 基金管理费
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 本期, 2011年1月1日至2011年6月30日, 上年同期, 2010年7月1日至2010年12月31日. Rows include 基金管理费, 基金托管费, 销售服务费, 其他费用.

注:1.本基金管理费按前一日基金资产净值的0.5%的年费率计提,计算方法如下:
H=E*0.5%/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-前一日基金持有的上述中盘ETF公允价值的1/10以累计。

基金管理人每日计算,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。

6.4.2.3.3.3.3.2 基金托管费
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 本期, 2011年1月1日至2011年6月30日, 上年同期, 2010年7月1日至2010年12月31日. Rows include 基金托管费, 基金销售服务费, 其他费用.

注:本基金托管费按前一日基金资产净值的0.1%的年费率计提,计算方法如下:
H=E*0.1%/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-前一日基金持有的上述中盘ETF公允价值的1/10以累计。

基金管理人每日计算,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。

6.4.2.3.3.3.3.3 关联方交易
6.4.2.3.3.3.3.3.1 基金管理费
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 本期, 2011年1月1日至2011年6月30日, 上年同期, 2010年7月1日至2010年12月31日. Rows include 基金管理费, 基金托管费, 销售服务费, 其他费用.

注:1.本基金管理费按前一日基金资产净值的0.5%的年费率计提,计算方法如下:
H=E*0.5%/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-前一日基金持有的上述中盘ETF公允价值的1/10以累计。

基金管理人每日计算,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。

6.4.2.3.3.3.3.3.2 基金托管费
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 本期, 2011年1月1日至2011年6月30日, 上年同期, 2010年7月1日至2010年12月31日. Rows include 基金托管费, 基金销售服务费, 其他费用.

注:本基金托管费按前一日基金资产净值的0.1%的年费率计提,计算方法如下:
H=E*0.1%/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-前一日基金持有的上述中盘ETF公允价值的1/10以累计。

基金管理人每日计算,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。

6.4.2.3.3.3.3.3.3 关联方交易
6.4.2.3.3.3.3.3.3.1 基金管理费
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 本期, 2011年1月1日至2011年6月30日, 上年同期, 2010年7月1日至2010年12月31日. Rows include 基金管理费, 基金托管费, 销售服务费, 其他费用.

注:以上关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占期末资产净值比例(%). Rows include 1. 601666 平煤股份, 2. 600429 华谊集团, 3. 600223 瀚宇博张, 4. 601901 华信国际, 5. 600997 开滦股份, 6. 600395 盛江股份, 7. 600508 上海能源, 8. 601101 华彬国际, 9. 600688 岳阳纸业, 10. 600674 中国船舶.

注:投资者欲了解本报告期内期末投资的所有股票明细,应阅读发表于www.efunds.com.cn网站的半年度报告正文。
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

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%). Rows include 1. 600688 华泰证券, 2. 600795 国电电力, 3. 601766 中国通海, 4. 600887 伊利股份, 5. 600739 辽宁成大, 6. 600688 华泰证券, 7. 600299 中海发展, 8. 600560 青岛海尔, 9. 600518 康美药业, 10. 601666 平煤股份, 11. 600415 小商品城, 12. 601009 南京银行, 13. 601186 中国铁建, 14. 600875 东方电气, 15. 600198 兴州集团, 16. 600132 银河科技, 17. 600309 烟台万润, 18. 600256 广汇股份, 19. 600150 东方股份, 20. 600050 中国联通.

注:买入金额按买卖成交金额(成交均价乘以成交量)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

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期末基金资产净值比例(%). Rows include 1. 600688 华泰证券, 2. 600795 国电电力, 3. 601766 中国通海, 4. 600887 伊利股份, 5. 600739 辽宁成大, 6. 600688 华泰证券, 7. 600299 中海发展, 8. 600560 青岛海尔, 9. 600518 康美药业, 10. 601666 平煤股份, 11. 600415 小商品城, 12. 601009 南京银行, 13. 601186 中国铁建, 14. 600875 东方电气, 15. 600198 兴州集团, 16. 600132 银河科技, 17. 600309 烟台万润, 18. 600256 广