

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

重要提示
基金管理人承诺:本基金的投资资产配置比例,将严格遵守基金合同、基金招募说明书及相关法律法规的规定...

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年度 报告摘要

2.1 基金基本情况
基金名称:易方达深证100ETF联接
基金代码:110119
交易代码:110119
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日期:2009年12月1日

2.2 基金投资策略
本基金为深证100ETF的联接基金,深证100ETF是采用完全复制法跟踪深证100指数的交易型开放式指数基金...

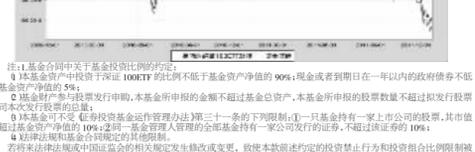
2.3 基金管理人、基金托管人
基金管理人:易方达基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司

2.4 基金业绩
截至2011年12月31日,本基金资产净值为18,944,156,728.22元,基金份额净值为1.001元...

3.1 主要财务数据和财务指标
3.1.1 期间数据和指标
2011年 2010年 2009年12月1日至2011年12月31日

3.1.2 期末数据和指标
2011年末 2010年末 2009年末
期末可供分配基金份额利润: -0.0254

3.2 基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较
阶段 净值增长率 业绩比较基准收益率



注:1.本基金合同中关于业绩比较基准的约定
2.本基金管理人投资于深证100ETF的比例不低于基金资产净值的90%

注:1.本基金合同于2009年12月1日成立,自2009年12月1日起开始运作
2.截至2011年12月31日,本基金资产净值为18,944,156,728.22元

4.1 基金管理人及其主要人员情况
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

4.2 基金管理人内部控制制度
基金管理人内部控制制度包括:投资管理业务、基金募集业务、基金销售业务、基金注册登记业务、基金清算业务

4.3 基金管理人内部控制制度的执行情况
基金管理人内部控制制度执行情况良好,各项业务均符合法律法规和基金合同的要求

4.4 基金管理人内部控制制度的完善性
基金管理人内部控制制度完善,能够有效防范和控制风险,保障基金财产的安全

4.5 基金管理人内部控制制度的有效性
基金管理人内部控制制度有效,能够及时发现和纠正问题,确保基金运作的合规性

2011年12月31日
关联方名称 成交金额 占当期债券成交总额的比例

广发证券 64,749.16 5.36%
广发证券 373,058.93 5.04%

2011年12月31日
关联方名称 成交金额 占当期债券成交总额的比例

广发证券 64,749.16 5.36%
广发证券 373,058.93 5.04%

Table with columns: 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(%)

注:1.买入金额按买入成交金额(成交均价乘以成交数量)计算,不考虑相关交易费用

8.5 买入金额按买入成交金额(成交均价乘以成交数量)计算,不考虑相关交易费用

Table with columns: 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(%)

注:1.买入金额按买入成交金额(成交均价乘以成交数量)计算,不考虑相关交易费用

8.5.3 买入金额按买入成交金额(成交均价乘以成交数量)计算,不考虑相关交易费用

Table with columns: 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(%)

注:1.买入金额按买入成交金额(成交均价乘以成交数量)计算,不考虑相关交易费用

8.5.3 买入金额按买入成交金额(成交均价乘以成交数量)计算,不考虑相关交易费用

Table with columns: 项目, 2011年1月1日至2011年12月31日, 2010年1月1日至2010年12月31日

注:1.基金资产净值调整后的前一交易日基金资产净值的0.5%的年度费率,计算方法如下:

H=H0*(1-R)^N, H0为初始基金资产净值, H为调整后的前一交易日基金资产净值

注:1.基金资产净值调整后的前一交易日基金资产净值的0.1%的年度费率,计算方法如下:

H=H0*(1-R)^N, H0为初始基金资产净值, H为调整后的前一交易日基金资产净值