

易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金 [2012] 第二季度报告

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
报告送出日期:二〇一二年七月十九日

§ 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、完整性承担个别及连带责任。

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2012年7月13日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配政策等，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。

基金过往业绩并不代表其未来表现。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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2012年4月1日起至2012年6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 易方达上证中盘ETF

基金主代码 510130

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

报告期末基金份额总额 426,685,089份

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。

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构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时，基金管理人会按照指数构成权重进行同步调整，基金经理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。

上证中盘指数 本基金股票型基金，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。

风险收益特征 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。

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

§ 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(2012年4月1日-2012年6月30日)

1.本期已实现收益 -46,187,877.72

2.本期利润 11,791,901.85

3.加权平均基金份额本期利润 0.0276

4.期末基金份额净值 976,812,596.78

5.期末基金份额总值 2,289.3

注:1.本基金于2010年5月28日进行了基金份额折算，折算比例为0.34394741。

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将低于所列数字。

3.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，本期利润为期末收益加上本期公允价值变动收益。

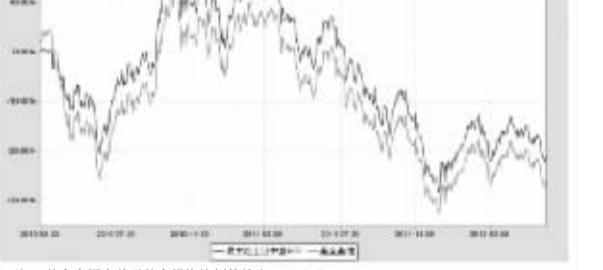
3.2 基金报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 1.18% 增值率标准差② 0.60% 业绩比较基准收益率③ 1.20% 基准收益率标准差④ 0.58% ⑤ -0.01%

过去三个月 3.22 日基合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金 累计净值增长率与业比较基准收益的历史走势图对比如图

2010年3月29日至2012年6月30日



注:1.基金合同中关于基金投资比例的约定:

(1)基金投资标的指数成份股及备选股的比例不低于基金资产净值的95%;

(2)本基金进入二级市场买卖的股票不得超出基金总资产的40%;

(3)本基金股票买卖实行T+0制度，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大于该账户可买卖股票数量的10倍;

(4)本基金投资组合应符合法律法规及监管部门的其他投资限制。

2.本基金的建仓期限为六个月，建仓期间本基金资产配置比例符合基金合同约定。

3.本基金合同生效至报告期末的基金份额净值增长率为-21.26%，同期业绩比较基准收益率为-26.15%。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理或基金经理助理简介

姓名	性别	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
张胜江	男	2010-3-29	-	硕士研究生，曾任易方达基金管理有限公司行业研究员、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。

注:1.此处的“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为公告确定的解聘日期。

2.证券从业的含义从行业分析师、证券从业人员资格管理办法的相关规定。

4.2 管理人对报告期内基金运作的总体评价

本报告期内，基金管理人遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同，基金招募说明书等法律文件规定的各项义务，以信守承诺、取信于社会投资人作为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则，运用科学有效的投资策略，在控制风险的前提下，使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、交易流程，以及强化事后分析评估机制来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人严格执行了严格的公平交易管理制度，投资决策委员会和交易室等部门，以及重视交易行为环节的公平交易制度，以时间优先、价格优先”的执行原则，通过投资交易系统中的公平交易模块，以及可能确保公平对待各组合分发的公平性，对场内交易、场外交易、按公平交易原则完善了相关分配机制。在本报告期内，公平交易制度执行情况良好。

4.4 立场交易行为的专项说明

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、交易流程，以及强化事后分析评估机制来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人严格执行了严格的公平交易管理制度，投资决策委员会和交易室等部门，以及重视交易行为环节的公平交易制度，以时间优先、价格优先”的执行原则，通过投资交易系统中的公平交易模块，以及可能确保公平对待各组合分发的公平性，对场内交易、场外交易、按公平交易原则完善了相关分配机制。在本报告期内，公平交易制度执行情况良好。

4.5 异常交易行为的专项说明

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、交易流程，以及强化事后分析评估机制来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人严格执行了严格的公平交易管理制度，投资决策委员会和交易室等部门，以及重视交易行为环节的公平交易制度，以时间优先、价格优先”的执行原则，通过投资交易系统中的公平交易模块，以及可能确保公平对待各组合分发的公平性，对场内交易、场外交易、按公平交易原则完善了相关分配机制。在本报告期内，公平交易制度执行情况良好。

4.6 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、交易流程，以及强化事后分析评估机制来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人严格执行了严格的公平交易管理制度，投资决策委员会和交易室等部门，以及重视交易行为环节的公平交易制度，以时间优先、价格优先”的执行原则，通过投资交易系统中的公平交易模块，以及可能确保公平对待各组合分发的公平性，对场内交易、场外交易、按公平交易原则完善了相关分配机制。在本报告期内，公平交易制度执行情况良好。

4.7 立场交易行为的专项说明

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、交易流程，以及强化事后分析评估机制来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人严格执行了严格的公平交易管理制度，投资决策委员会和交易室等部门，以及重视交易行为环节的公平交易制度，以时间优先、价格优先”的执行原则，通过投资交易系统中的公平交易模块，以及可能确保公平对待各组合分发的公平性，对场内交易、场外交易、按公平交易原则完善了相关分配机制。在本报告期内，公平交易制度执行情况良好。

4.8 立场交易行为的专项说明

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、交易流程，以及强化事后分析评估机制来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人严格执行了严格的公平交易管理制度，投资决策委员会和交易室等部门，以及重视交易行为环节的公平交易制度，以时间优先、价格优先”的执行原则，通过投资交易系统中的公平交易模块，以及可能确保公平对待各组合分发的公平性，对场内交易、场外交易、按公平交易原则完善了相关分配机制。在本报告期内，公平交易制度执行情况良好。

4.9 立场交易行为的专项说明

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、交易流程，以及强化事后分析评估机制来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人严格执行了严格的公平交易管理制度，投资决策委员会和交易室等部门，以及重视交易行为环节的公平交易制度，以时间优先、价格优先”的执行原则，通过投资交易系统中的公平交易模块，以及可能确保公平对待各组合分发的公平性，对场内交易、场外交易、按公平交易原则完善了相关分配机制。在本报告期内，公平交易制度执行情况良好。

4.10 立场交易行为的专项说明

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、交易流程，以及强化事后分析评估机制来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人严格执行了严格的公平交易管理制度，投资决策委员会和交易室等部门，以及重视交易行为环节的公平交易制度，以时间优先、价格优先”的执行原则，通过投资交易系统中的公平交易模块，以及可能确保公平对待各组合分发的公平性，对场内交易、场外交易、按公平交易原则完善了相关分配机制。在本报告期内，公平交易制度执行情况良好。

4.11 立场交易行为的专项说明

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、交易流程，以及强化事后分析评估机制来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人严格执行了严格的公平交易管理制度，投资决策委员会和交易室等部门，以及重视交易行为环节的公平交易制度，以时间优先、价格优先”的执行原则，通过投资交易系统中的公平交易模块，以及可能确保公平对待各组合分发的公平性，对场内交易、场外交易、按公平交易原则完善了相关分配机制。在本报告期内，公平交易制度执行情况良好。

4.12 立场交易行为的专项说明

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、交易流程，以及强化事后分析评估机制来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人严格执行了严格的公平交易管理制度，投资决策委员会和交易室等部门，以及重视交易行为环节的公平交易制度，以时间优先、价格优先”的执行原则，通过投资交易系统中的公平交易模块，以及可能确保公平对待各组合分发的公平性，对场内交易、场外交易、按公平交易原则完善了相关分配机制。在本报告期内，公平交易制度执行情况良好。

4.13 立场交易行为的专项说明

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、交易流程，以及强化事后分析评估机制来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人严格执行了严格的公平交易管理制度，投资决策委员会和交易室等部门，以及重视交易行为环节的公平交易制度，以时间优先、价格优先”的执行原则，通过投资交易系统中的公平交易模块，以及可能确保公平对待各组合分发的公平性，对场内交易、场外交易、按公平交易原则完善了相关分配机制。在本报告期内，公平交易制度执行情况良好。

4.14 立场交易行为的专项说明

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、交易流程，以及强化事后分析评估机制来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人严格执行了严格的公平交易管理制度，投资决策委员会和交易室等部门，以及重视交易行为环节的公平交易制度，以时间优先、价格优先”的执行原则，通过投资交易系统中的公平交易模块，以及可能确保公平对待各组合分发的公平性，对场内交易、场外交易、按公平交易原则完善了相关分配机制。在本报告期内，公平交易制度执行情况良好。

4.15 立场交易行为的专项说明

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、交易流程，以及强化事后分析评估机制来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人严格执行了严格的公平交易管理制度，投资决策委员会和交易室等部门，以及重视交易行为环节的公平交易制度，以时间优先、价格优先”的执行原则，通过投资交易系统中的公平交易模块，以及可能确保公平对待各组合分发的公平性，对场内交易、场外交易、按公平交易原则完善了相关分配机制。在本报告期内，公平交易制度执行情况良好。

4.16 立场交易行为的专项说明

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、交易流程，以及强化事后分析评估机制来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人严格执行了严格的公平交易管理制度，投资决策委员会和交易室等部门，以及重视交易行为环节的公平交易制度，以时间优先、价格优先”的执行原则，通过投资交易系统中的公平交易模块，以及可能确保公平对待各组合分发的公平性，对场内交易、场外交易、按公平交易原则完善了相关分配机制。在本报告期内，公平交易制度执行情况良好。

4.17 立场交易行为的专项说明

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、交易流程，以及强化事后分析评估机制来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人严格执行了严格的公平交易管理制度，投资决策委员会和交易室等部门，以及重视交易行为环节的公平交易制度，以时间优先、价格优先”的执行原则，通过投资交易系统中的公平交易模块，以及可能确保公平对待各组合分发的公平性，对场内交易、场外交易、按公平交易原则完善了相关分配机制。在本报告期内，公平交易制度执行情况良好。

4.18 立场交易行为的专项说明

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、交易流程，以及强化事后分析评估机制来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人严格执行了严格的公平交易管理制度，投资决策委员会和交易室等部门，以及重视交易行为环节的公平交易制度，以时间优先、价格优先”的执行原则，通过投资交易系统中的公平交易模块，以及可能确保公平对待各组合分发的公平性，对场内交易、场外交易、按公平交易原则完善了相关分配机制。在本报告期内，公平交易制度执行情况良好。

4.19 立场交易行为的专项说明

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、交易流程，以及强化事后分析评估机制来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人严格执行了严格的公平交易管理制度，投资决策委员会和交易室等部门，以及重视交易行为环节的公平交易制度，以时间优先、价格优先”的执行原则，通过投资交易系统中的公平交易模块，以及可能确保公平对待各组合分发的公平性，对场内交易、场外交易、按公平交易原则完善了相关分配机制。在本报告期内，公平交易制度执行情况良好。

4.20 立场交易行为的专项说明

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、交易流程，以及强化事后分析评估机制来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人严格执行了严格的公平交易管理制度，投资决策委员会和交易室等部门，以及重视交易行为环节的公平交易制度，以时间优先、价格优先”的执行原则，通过投资交易系统中的公平交易模块，以及可能确保公平对待各组合分发的公平性，对场内交易、场外交易、按公平交易原则完善了相关分配机制。在本报告期内，公平交易制度执行情况良好。

4.21 立场交易行为的专项说明

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、交易流程，以及强化事后分析评估机制来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人严格执行了严格的公平交易管理制度，投资决策委员会和交易室等部门，以及重视交易行为环节的公平交易制度，以时间优先、价格优先”的执行原则，通过投资交易系统中的公平交易模块，以及可能确保公平对待各组合分发的公平性，对场内交易、场外交易、按公平交易原则完善了相关分配机制。在本报告期内，公平交易制度执行情况良好。

4.22 立场交易行为的专项说明

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、交易流程，以及强化事后分析评估机制来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人严格执行了严格的公平交易管理制度，投资决策委员会和交易室等部门，以及重视交易行为环节的公平交易制度，以时间优先、价格优先”的执行原则，通过投资交易系统中的公平交易模块，以及可能确保公平对待各组合分发的公平性，对场内交易、场外交易、按公平交易原则完善了相关分配机制。在本报告期内，公平交易制度执行情况良好。

4.23 立场交易行为的专项说明

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、交易流程，以及强化事后分析评估机制来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人严格执行了严格的公平交易管理制度，投资决策委员会和交易室等部门，以及重视交易行为环节的公平交易制度，以时间优先、价格优先”的执行原则，通过投资交易系统中的公平交易模块，以及可能确保公平对待各组合分发的公平性，对场内交易、场外交易、按公平交易原则完善了相关分配机制。在本报告期内，公平交易制度执行情况良好。

4.24 立场交易行为的专项说明

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、交易流程，以及强化事后分析评估机制来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人严格执行了严格的公平交易管理制度，投资决策委员会和交易室等部门，以及重视交易行为环节的公平交易制度，以时间优先、价格优先”的执行原则，通过投资交易系统中的公平交易模块，以及可能确保公平对待各组合分发的公平性，对场内交易、场外交易、按公平交易原则完善了相关分配机制。在本报告期内，公平交易制度执行情况良好。