

易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金

【2011】第一季度报告

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:二〇一一年四月二十二日

基金管理人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。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年4月20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,也不保证基金份额持有人本金不受损失或本金不受损失。
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。

本基金资料未发生变动。
本报告期自2011年1月1日起至3月31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8月29日
报告期末基金份额总额	661,885,097.32
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。

本基金为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或成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化或成份股发生增发、配股及增发、股票回购、市场流动性不足等特殊情况发生,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。

本基金为股票型基金,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,采用完全复制法跟踪指数的表现,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

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2011年1月1日至2011年3月31日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	17,223,450.22	
2.本期利润	37,860,931.94	
3.加权平均基金份额本期利润	0.0593	
4.期末基金资产净值	2,134,581,715.20	
5.期末基金份额净值	3.225	

注:1.本基金已于2010年5月28日进行1/基金份额折算,折算比例为0.3439471。

2.本基金本报告期未发生申购赎回费用,计入费用后实际收益水平要低于前所列数字。

3.本基金已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)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。

4.本基金本报告期未发生申购赎回费用,计入费用后实际收益水平要低于前所列数字。

3.2 本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

中盘指数的投资策略,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。期望上证中盘ETF为投资者分享中国经济

的未来成长提供最佳的投资机会。

§ 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	2,111,330,153.12	98.82
2	其中:股票	2,111,330,153.12	98.82
3	固定收益投资	1,371,709.60	0.06
4	其中:债券	1,371,709.60	0.06
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
8	银行存款和结算备付金合计	22,418,310.71	1.05
9	其他各项资产	1,365,802.97	0.06
10	合计	2,136,485,975.82	100.00

注:1.上表中股票投资项下含可替代默认估值项,而2.的合计项下不含可替代默认估值项。

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	27,868,897.25	1.31
B	采掘业	199,019,498.83	9.32
C	制造业	952,519,954.74	44.62
C0	食品、饮料	83,243,240.68	3.90
C1	纺织、服装、皮毛	41,348,283.36	1.94
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	87,452,585.80	4.10
C5	电子	29,280,435.32	1.37
C6	金属、非金属	203,652,673.72	9.54
C7	机械、设备、仪表	366,524,986.94	17.17
C8	医药、生物制品	141,016,623.92	6.61
C9	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	96,297,465.35	4.51
E	建筑业	85,599,763.08	4.01
F	交通运输、仓储业	131,729,358.37	6.17
G	信息技术业	83,328,516.82	3.90
H	批发和零售业	102,665,805.25	4.81
I	金融、保险业	91,016,720.64	4.26
J	房地产业	198,134,927.97	9.23
K	社会服务业	27,405,940.90	1.28
L	传播与文化产业	11,405,644.88	0.53
M	综合类	104,338,437.04	4.89
N	合计	2,111,330,153.12	98.91

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	600585	海螺水泥	1,909,600	77,371,965.33	3.26
2	601989	中国重工	3,656,707	48,231,962.33	2.22
3	601766	中国南车	5,622,000	40,590,840.00	1.90
4	600795	国电电力	13,218,700	40,449,222.00	1.89
5	600739	辽宁成大	1,302,342	40,111,579.20	1.88
6	600887	伊利股份	1,144,592	39,545,653.60	1.85
7	600256	广汇股份	1,594,314	36,653,278.86	1.72
8	601299	中国北车	4,753,991	35,179,533.40	1.65
9	600068	贵州茅台	2,995,905	35,141,965.65	1.65
10	601009	南京银行	2,973,951	32,921,637.57	1.54

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	-	-
3	金融债	-	-
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	1,371,709.60	0.06
7	其他	-	-
8	合计	1,371,709.60	0.06

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十名债券投资明细

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	110016	川投转债	11,560	1,371,709.60	0.06

注:1.本基金本报告期末未持有以上债券。

5.6 报告期末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 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末持有的前十名证券的发行主体本期没有出现在被监管部门立案调查,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前

中受到公开谴责,或在报告编制日前