

易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金

[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、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核结果不存在虚假记载、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。

基金净值表现和投资组合报告不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金投资于证券市场存在风险,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。

招募说明书

本报告期自2012年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:易方达深证100ETF联接

基金代码:110019

交易代码:110019

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2009年12月11日

报告期末基金份额总额:11,284,896,179.91份

投资目标:紧密跟踪目标指数,追求跟踪偏离度、跟踪误差最小化

本基金通过深证100ETF的被动基金,主要采用完全复制法实现对深证100指数的跟踪,并根据指数成份股的繁密程度,适度将年化跟踪误差控制在4%以内。在投资运作过程中,本基金在所选的指数、风格、成本等方面,将根据指数成份股的繁密程度,通过定期或不定期的调整,以期降低被动跟踪误差。

本基金通过深证100ETF的被动基金,主要采用完全复制法实现对深证100指数的跟踪,并根据指数成份股的繁密程度,适度将年化跟踪误差控制在4%以内。在投资运作过程中,本基金在所选的指数、风格、成本等方面,将根据指数成份股的繁密程度,通过定期或不定期的调整,以期降低被动跟踪误差。

§ 3 主要财务指标

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

-5,517,590.25

2.本期利润

94,264,859.46

3.加权平均基金份额本期利润

0.0084

4.期末基金份额净值

8,472,477,799.96

5.期末基金份额总额

0.7508

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.所述基金业收入指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计算用时实际收益水平要低于所列数字。

3.2.1 报告期基金份额净值增长率为及与其同期业绩比较基准收益率的比较

阶段

净值增长

净值增长

业绩比较

基准收益

率(%)

①(%)

②(%)

③(%)

④(%)

过去三个月 1.35% 1.18% 0.81% 1.21% 0.54% -0.03%

3.2.2 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

累计净值增长率为及与同期业绩比较基准收益率变动的历史走势对比图

(2009年12月1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本基金在任何交易日中,现金类资产不得超过基金资产净值的5%;

②本基金将部分股票投资于深证100指数基金,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5%;

③本基金不能够认购证券投资基金运作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,其市值不能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股票,其市值不能超过基金资产净值的10%;③同一基金管理人管理的全部基金持有一家上市公司的股票,其市值不能超过基金资产净值的5%;

④法律法规及基金合同规定的其他限制。

若将法律法规及中国证监会的相关规定定发生修改或变更,致使本款前述约定的投资禁止行为和投资限制条款被修改或取消,基金管理人在履行相关程序后,本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

3.2.3 基金合同生效以来至报告期末的基金份额净值增长率为-24.92%,同期业绩比较基准收益率为-27.18%。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期间 报告期内从业年限 说明

林飞 基金经理,曾任150指数基金经理,易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金经理,本基金的基金经理。2009-12-11 - 9年 博士研究生,曾任融通基金管理有限公司基金经理助理,易方达基金管理有限公司量化投资部基金经理助理,易方达基金管理有限公司量化投资部基金经理。

王建平 基金经理,曾任150指数基金经理,易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金经理,本基金的基金经理。2010-9-27 - 5年 博士研究生,曾任汇添富基金管理有限公司基金经理助理,易方达创业板基金基金经理,易方达货币基金经理,易方达货币基金经理,易方达货币基金经理。

注:1.此前的“任职日期”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,王建平的“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指标的评价说明

本基金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。

基金管理人和基金托管人代表本基金管理人向投资者保证基金投资决策在报告期间内,基金投资运作符合法律法规和基金合同的规定,为基金份额持有人谋取最大利益。

4.3 法律法规及基金合同规定的其他限制。

若将法律法规及中国证监会的相关规定定发生修改或变更,致使本款前述约定的投资禁止行为和投资限制条款被修改或取消,基金管理人在履行相关程序后,本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

3.2.4 管理人对宏观经济的专项说明

本基金期内,本公司旗下所有投资基金参与的证券交易公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易有3次,均为ETF基金被动跟踪标的指数和其他组合发

生的反向交易。

4.4 报告期内基金的证券投资和业绩表现说明

注:1.本基金在2006年4月14日进行了基金份额折算,折算比例为0.94948342。

2.本基金已于2010年11月19日进行了基金份额折算,折算比例为1,即每一份基金份额折算成5份。

3.所持基金份额不包括持有人从认购或交易基金的各项费用,计算用时实际收益水平要低于所列数字。

4.本期已实现收益指基金利息收入、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。

3.2.5 基金净值表现

3.2.1 报告期基金份额净值增长率为及与其同期业绩比较基准收益率的比较

阶段

净值增长

净值增长

业绩比较

基准收益

率(%)

①(%)

②(%)

③(%)

④(%)

过去三个月 1.38% 1.25% 0.83% 1.27% 0.55% -0.02%

3.2.2 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交易型开放式指数基金

累计净值增长率为及与同期业绩比较基准收益率变动的历史走势对比图

(2006年3月24日至2012年6月30日)

注:1.本基金在2006年3月24日进行了基金份额折算,折算比例为1.00479777。

2.本基金在2010年3月24日进行了基金份额折算,折算比例为1,即每一份基金份额折算成5份。

3.所持基金份额不包括持有人从认购或交易基金的各项费用,计算用时实际收益水平要低于所列数字。

4.本期已实现收益指基金利息收入、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。

4.4 报告期内基金的证券投资和业绩表现说明

注:1.本基金在2006年4月14日进行了基金份额折算,折算比例为0.94948342。

2.本基金已于2010年11月19日进行了基金份额折算,折算比例为1,即每一份基金份额折算成5份。

3.所持基金份额不包括持有人从认购或交易基金的各项费用,计算用时实际收益水平要低于所列数字。

4.本期已实现收益指基金利息收入、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。

3.2.3 基金净值表现

3.2.1 报告期基金份额净值增长率为及与其同期业绩比较基准收益率的比较

阶段

净值增长

净值增长

业绩比较

基准收益

率(%)

①(%)

②(%)

③(%)

④(%)

过去三个月 1.38% 1.25% 0.83% 1.27% 0.55% -0.02%

3.2.4 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交易型开放式指数基金

累计净值增长率为及与同期业绩比较基准收益率变动的历史走势对比图

(2006年3月24日至2012年6月30日)

注:1.本基金在2006年3月24日进行了基金份额折算,折算比例为1.00479777。

2.本基金在2010年3月24日进行了基金份额折算,折算比例为1,即每一份基金份额折算成5份。

3.所持基金份额不包括持有人从认购或交易基金的各项费用,计算用时实际收益水平要低于所列数字。

4.本期已实现收益指基金利息收入、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。

3.2.2 基金净值表现

3.2.1 报告期基金份额净值增长率为及与其同期业绩比较基准收益率的比较

阶段

净值增长

净值增长

业绩比较

基准收益

率(%)

①(%)

②(%)

③(%)

④(%)

过去三个月 1.38% 1.25% 0.83% 1.27% 0.55% -0.02%

3.2.5 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交易型开放式指数基金

累计净值增长率为及与同期业绩比较基准收益率变动的历史走势对比图

(2006年3月24日至2012年6月30日)

注:1.本基金在2006年3月24日进行了基金份额折算,折算比例为1.00479777。

2.本基金在2010年3月24日进行了基金份额折算,折算比例为1,即每一份基金份额折算成5份。

3.所持基金份额不包括持有人从认购或交易基金的各项费用,计算用时实际收益水平要低于所列数字。

4.本期已实现收益指基金利息收入、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。

3.2.3 基金净值表现

3.2.1 报告期基金份额净值增长率为及与其同期业绩比较基准收益率的比较

阶段

净值增长

净值增长

业绩比较

基准收益

率(%)

①(%)

②(%)

③(%)

④(%)

过去三个月 1.38% 1.25% 0.83% 1.27% 0.55% -0.02%

3.2.6