

## 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

## [2012]第四季度报告

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:二〇一三年一月二十二日

§ 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同，于2013年1月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现、持有人大会召集及表决情况等，报告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。

报告期末基金财务资料未经审计。

报告期自2012年10月1日至2012年12月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称:易方达上证中盘ETF联接

基金主代码:110021

交易代码:110021

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2010年3月31日

报告期末基金份额总额:1,265,618,914.54份

紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。

力争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。

本基金为上证中盘ETF的联接基金，上证中盘ETF是采用完全复制法实现对上证中盘指数的全被动指数基金，本基金主要通过投资于上证中盘ETF，实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争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。

本基金是指数型股票基金，属于证券投资基金中的高风险高收益品种，理论上其风险收益水平高于混合型基金、债券基金和货币市场基金。

本基金为上证中盘ETF的联接基金，主要通过投资于上证中盘ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与上证中盘指数的表现密切相关。

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

§ 2.1 基金基本情况

基金名称:易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金

基金主代码: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

基金份额上市的证券交易所:上海证券交易所

上市日期:2010年6月23日

基金管理人名称:易方达基金管理有限公司

基金托管人名称:中国工商银行股份有限公司

§ 2.2 基金产品概况

紧密跟踪业绩比较基准，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组成及权重构建股票投资组合，但是当指数编制方法变更、成份股发生变动、成份股因为自由流通量发生变化、成份股派发现金股息、配股及增发、股票长期停牌、市场流动性不足等情况发生，基金管理人会按照指数的成份股组成及权重进行同步调整，基金经理将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。

本基金的业绩表现与上证中盘指数的表现密切相关。

投资目标:紧密跟踪业绩比较基准，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组成及权重构建股票投资组合，但是当指数编制方法变更、成份股发生变动、成份股因为自由流通量发生变化、成份股派发现金股息、配股及增发、股票长期停牌、市场流动性不足等情况发生，基金管理人会按照指数的成份股组成及权重进行同步调整，基金经理将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。

本基金的业绩表现与上证中盘指数的表现密切相关。

投资策略:本基金为上证中盘ETF的联接基金，主要通过投资于上证中盘ETF，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与上证中盘指数的表现密切相关。

业绩比较基准:上证中盘指数收益率×95%+货币市场基金收益率(税后)×5%。

本基金是指数型股票基金，属于证券投资基金中的高风险高收益品种，理论上其风险收益水平高于混合型基金、债券基金和货币市场基金。

本基金为上证中盘ETF的联接基金，主要通过投资于上证中盘ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与上证中盘指数的表现密切相关。

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10月1日-2012年12月31日)

1.本期已实现收益 -16,728,596.16

2.本期利润 59,504,424.93

3.加权平均基金份额本期利润 0.0547

4.期末基金份额净值 1,004,949,748.19

5.期末基金份额净值 0.7940

注:1.所列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要低于不计相关费用的水平。

2.本期利润为本期已实现收益加上本期利润。

3.2.1 本基金报告期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 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④

过去三个月 6.22% 1.18% 7.18% 1.26% -0.96% -0.08%

3.2.2 本基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

基金名称:易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金

基金主代码: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:530,685,089.00份

本基金的业绩表现与上证中盘指数的表现密切相关。

本基金的业绩表现与上证中盘指数的表现密切相关。

3.2.3 基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年10月1日-2012年12月31日)

1.本期已实现收益 -66,127,647.60

2.本期利润 79,393,355.31

3.加权平均基金份额本期利润 0.1637

4.期末基金份额净值 1,198,068,298.39

5.期末基金份额净值 2.2576

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

2.所列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要低于所列数字。

3.本期已实现收益为本期已实现收益加上本期利润。

4.4.2 基金净值表现

4.4.3 管理人对宏观经济的展望

4.4.4 管理人对证券市场的展望

4.4.5 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.6 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.7 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.8 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.9 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.10 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.11 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.12 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.13 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.14 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.15 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.16 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.17 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.18 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.19 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.20 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.21 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.22 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.23 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.24 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.25 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.26 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.27 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.28 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.29 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.30 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.31 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.32 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.33 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.34 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.35 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.36 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.37 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.38 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.39 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.40 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.41 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.42 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.43 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.44 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.45 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.46 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.47 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.48 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.49 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.50 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.51 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.52 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.53 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.54 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.55 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.56 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.57 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.58 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.59 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.60 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.61 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.62 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.63 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.64 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.65 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.66 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.67 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.68 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.69 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.70 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.71 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.72 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.73 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.74 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.75 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.76 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.77 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.78 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.79 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.80 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.81 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.82 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.83 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.84 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.85 管理人对本基金投资策略的说明

4.4.86 管理人对本基金投资策略的说明