

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  
送出日期:二〇一五年三月十七日

## § 1 重要提示

基金管理人、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、完整性承担责任。本基金报告已经二〇一五年二月二十日独立董事签字同意。

基金管理人已按规定将基金份额持有人名册报中国证监会备案，该报告经中国证监会核对，未发现该报告存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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及其摘要。

本年度报告摘要自年度报告正文之日，投资者欲了解详细内容，阅读年度报告全文。

本报告中财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期为二〇一四年1月1日起至12月31日止。

## § 2 基金简介

## 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
基金代码	510130
交易系统	交易所开放式(ETF)
基金成立日期	2010年3月20日
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
基金份额总额	206,285,099.00份
基金合同的存续期间	不适用
基金上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2010年6月23日

## 2.2 基金产品说明

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。
投资策略	本基金采取完全复制法跟踪标的指数，或根据指数成份股的涨跌或基差变化情况适时调整部分现金头寸，以降低跟踪误差。本基金将根据市场情况，通过定期或不定期的调整，优化组合的构成，使基金的跟踪误差和跟踪偏离度控制在合理的范围内。
业绩比较基准	上证中盘指数
风险收益特征	本基金是一只股票型基金，风险收益水平高于货币基金、债券基金与货币市场基金。本基金主要投资于股票，因此其预期收益和风险均高于货币基金、债券基金、货币市场基金，同时亦高于股票型基金。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	易方达基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
住所	广州市天河区珠江新城珠江新城路1号	北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人	陈志列	尚福山
联系人电话	020-38798888	010-66105799
电子邮箱	service@efunds.com.cn	custserv@icbc.com.cn
客户服务电话	400 881 8088	95588
传真	020-38799488	010-66105798

## 2.4 信息披露方式

披露基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
年度报告公告首部	广州市天河区珠江新城珠江新城路1号 广州银行大厦43楼

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2014年	2013年	2012年
本期实现收益	69,841.72	-95,212,351.23	-135,261,426.09
本期末基金平均份额本期利润	294,265,481.60	22,310,210.46	50,490,401.15
加权平均基金份额本期利润	1.0947	0.0369	0.0116
本期基金份额净值增长率	53.94%	3.76%	3.95%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末	2012年末
期末可供分配基金份额利润	-0.2072	-0.5651	-0.6499
期末基金资产净值	743,861,239.57	711,808,305.31	1,198,068,296.39
期末基金份额净值	3.6006	2.3242	2.2576

注:1. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2. 本公司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, 本利期初余额即为实现收益加上本期公允价值变动损益。

3. 本基金于2010年6月28日进行了基金份额折算, 折算比例为1.3430741。

4. 本基金于2011年6月20日将基金份额折算后以小数点后三位变更为小数点后四位, 小数点后第四位舍弃。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

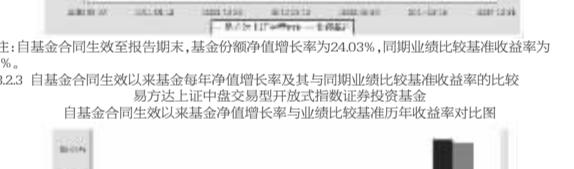
阶段	份额净值增长	份额净值增长	业绩比较基准	业绩比较基准收益率差
过去三个月	36.63%	1.47%	36.83%	-1.48%
过去六个月	63.91%	1.19%	63.57%	1.21%
过去一年	53.94%	1.16%	52.60%	1.18%
过去三年	66.03%	1.29%	62.4%	1.30%
过去五年	-	-	-	-
自基金合同生效之日起至今	1.37%	14.43%	1.42%	9.40%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2010年3月29日至2014年12月31日)

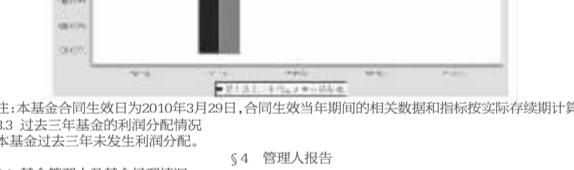


注:自基金合同生效至报告期末, 基金份额净值增长率为24.03%, 同期业绩比较基准收益率为14.63%。

3.2.3 自基金合同生效以来每年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

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图



注:本基金合同生效日为2010年3月29日, 合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未发生利润分配。

5.4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理的声明

经中国证监会证监基金字[2001]4号文批准, 本基金管理人于2001年4月17日成立, 注册资本1.2亿元人民币, 总部设在北京, 广州、上海、南京、成都公司及香港公司, 资产管理子公司。本基金管理人秉承“取信于市场, 取信于社会”的宗旨, 坚持“在诚信规范的前提下, 通过专业化运作和团队协作实现持续稳健增长”的经营理念, 以严格的内部控制、规范的运作和良好的投资业绩, 赢得市场认可。2004年10月, 本基金管理人得到全国社会保障基金理事会、企业年金基金管理人资格; 2007年12月, 获得合格境内机构投资者(QDII)资格; 2008年2月, 获得从事特定客户资产管理业务资格, 截至2014年12月31日, 本基金资产管理人旗下共管理6只开放式基金, 1只封闭式基金和多个全国社保基金资产组合、企业年金及特定客户资产管理业务, 资产管理总规模达4200亿元。

4.2 基金经理(或基金经理)及其任职情况

基金经理从没有因违法违规行为受到任何处罚。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和操作方法

公司根据《证券投资基金公平交易制度指导意见》等法规制定了《公平交易制度》, 内容主要包括公平交易的适用范围、公平交易的原则和内容、公平交易的实施和监控、交易执行程序、反向交易控制、公平交易绩效评估报告等。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

公司严格按照《公平交易制度》各条款的规定, 在投资决策、研究分析、投资交易、业绩评估等环节, 通过建立科学合理的内部控制制度, 有效防范利益输送行为, 促进公司旗下各基金公平对待所有客户, 保护基金份额持有人的利益。

4.3.3 公平交易制度执行的监督情况

公司设立公平交易监督小组, 对公司旗下各基金公平交易情况进行定期和不定期的检查, 通过定期和不定期的检查, 确保公平交易制度的执行效果。

4.3.4 公平交易制度执行的效果

公司严格按照《公平交易制度》的规定, 在投资决策、研究分析、投资交易、业绩评估等环节, 通过建立科学合理的内部控制制度, 有效防范利益输送行为, 促进公司旗下各基金公平对待所有客户, 保护基金份额持有人的利益。

4.4 管理人对报告期内合规经营情况的说明

4.4.1 管理人对基金运作合法合规性的说明

本基金报告期内, 基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同, 勤勉尽责地履行诚实信用、勤勉尽责的义务, 诚实守信地履行受托管理职责, 未发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.4.2 管理人对基金投资运作的说明

本基金报告期内, 基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同, 勤勉尽责地履行诚实信用、勤勉尽责的义务, 诚实守信地履行受托管理职责, 未发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.4.3 管理人对基金投资组合的说明

本基金报告期内, 基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同, 勤勉尽责地履行诚实信用、勤勉尽责的义务, 诚实守信地履行受托管理职责, 未发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.4.4 管理人对基金投资决策和流程的说明

本基金报告期内, 基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同, 勤勉尽责地履行诚实信用、勤勉尽责的义务, 诚实守信地履行受托管理职责, 未发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.4.5 管理人对基金投资组合的评价

本基金报告期内, 基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同, 勤勉尽责地履行诚实信用、勤勉尽责的义务, 诚实守信地履行受托管理职责, 未发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.4.6 管理人对报告期内合规经营情况的说明

本基金报告期内, 基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同, 勤勉尽责地履行诚实信用、勤勉尽责的义务, 诚实守信地履行受托管理职责, 未发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.4.7 管理人对基金投资决策和流程的说明

本基金报告期内, 基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同, 勤勉尽责地履行诚实信用、勤勉尽责的义务, 诚实守信地履行受托管理职责, 未发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.4.8 管理人对基金投资组合的评价

本基金报告期内, 基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同, 勤勉尽责地履行诚实信用、勤勉尽责的义务, 诚实守信地履行受托管理职责, 未发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.4.9 管理人对基金投资决策和流程的说明

本基金报告期内, 基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同, 勤勉尽责地履行诚实信用、勤勉尽责的义务, 诚实守信地履行受托管理职责, 未发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.4.10 管理人对报告期内合规经营情况的说明

本基金报告期内, 基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同, 勤勉尽责地履行诚实信用、勤勉尽责的义务, 诚实守信地履行受托管理职责, 未发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.4.11 管理人对基金投资决策和流程的说明