

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年七月十八日
§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及高级管理人员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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年7月12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。

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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2013年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	工银上证央企ETF
交易代码	510060
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2009年8月26日
报告期末基金份额总额	553,959,219.00份

投资目标 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，实现与标的指数表现一致的长期投资收益。

投资策略 本基金主要采取完全复制策略，跟踪标的指数的表现，即按照标的指数的成份股的构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。在特殊情况下，本基金可以选择其他证券组合对本基金进行有效替代以替换单独投资于混合基金、债券基金、货币市场基金、现金等金融工具。

风险收益特征 是股票基金中风险中等，收益与市场平均水平大致相当的产品。

基金管理人 工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人 招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 单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2013年4月1日 - 2013年6月30日)
1.本期已实现收益	4,483,140.39
2.本期利润	-68,659,706.17
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1250
4.期末基金资产净值	535,739,022.28
5.期末基金份额净值	0.9671

注：①上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示数字。

②“期初已实现收益”指本基金本期利息收入、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。

③本基金已于2009年09月28日进行了基金份额折算，折算比例为0.63964039。

④所列数据截止到2013年6月30日。

⑤基金净值

3.2 本基金未定期报告。

3.3 本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(%)	净值增长率标准差(%)	业绩比较基准收益率(%)	业绩比较基准收益率标准差(%)	①-③	②-④
过去三个月	-11.50%	1.34%	-12.59%	1.36%	1.09%	-0.02%

3.3.2 自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



注：1、本基金基金合同于2009年8月26日生效。

2、按基金合同约定，本基金建仓期不超过3个月。截至报告期末，本基金的各项投资比例符合基金合

上证中央企业50交易型开放式指数证券投资基金

2013 第二季度报告

同的规定，本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%。

3.3 其他指标

§ 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限	证券从业年限	说明
何江	指数投资部总监，本基金的基金经理	2011年5月25日	8	先后在北京方正证券研究所担任高级分析师，金诚信咨询有限公司担任分析师，现任方正证券研究所副研究员。2005年加入工银瑞信，现任指数投资部副总监，曾任风险管理部总经理助理、风险管理部总经理。2012年5月12日至2013年5月12日，担任上证央企50交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2013年5月12日至今，担任上证央企50交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金报告期内不存在损害基金份额持有人利益的行为，遵循了法律法规及基金合同的规定，依法履行了信息披露义务，勤勉尽责地管理基金资产，没有发生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

为公平对待各类投资人，保护各类投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《基金管理公司内部控制制度指引》等法律法规和公司内部规定，拟定了《公平交易管理制度》，并严格遵守。公司对交易行为的公平性进行监控，对买卖股票、债券时的价格和市场价格的差距较大，可能在操纵股价、利益输送等违法违纪情况进行监控。本报告期，按照时间优先、价格优先的交易原则，本公司对满足足额条件且对同一证券有相同交易需求的基金投资组合，均采用了系统化的公平交易模块进行操作，实现了公平交易，未出现清算不公的情况。且本基金及本基金与基金管理人管的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易。

4.3.2 平等交易行为的专项说明

本基金报告期内未出现不公平交易的情况。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金的投资组合报告

4.4.1 报告期内基金的资产配置状况

本基金报告期内，本基金跟踪标的指数的成份股及备选成份股的均偏离度为0.04%，偏离度年化标准差为1.47%。本基金跟踪误差产生的主要来源是①标的指数成份股或备选成份股的停牌；④指数成分股的调换；⑤指数成分股的调整。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金报告期内基金净值增长率为-11.50%，业绩比较基准收益率为-12.59%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

本基金管理人将继续按照基金合同的要求，坚持指数化投资策略，通过运用定量化分析等技术、分析和应对导致基金跟踪误差的因素，继续努力将基金的跟踪误差控制在较低水平。

4.6 报告期内基金组合投资的前十名股票、债券明细

4.7 报告期内基金投资组合的重大关联交易明细

4.8 报告期内接待机构调研、沟通、交流的记录

4.9 报告期内基金的利润分配情况

4.10 报告期内基金持有的流通受限证券

4.11 报告期内基金投资组合的重大关联交易

4.12 报告期内基金的其他重大信息

4.13 其他需要说明的事项

4.14 公平交易制执行情况

4.15 公平交易制执行情况

4.16 公平交易制执行情况

4.17 公平交易制执行情况

4.18 公平交易制执行情况

4.19 公平交易制执行情况

4.20 公平交易制执行情况

4.21 公平交易制执行情况

4.22 公平交易制执行情况

4.23 公平交易制执行情况

4.24 公平交易制执行情况

4.25 公平交易制执行情况

4.26 公平交易制执行情况

4.27 公平交易制执行情况

4.28 公平交易制执行情况

4.29 公平交易制执行情况

4.30 公平交易制执行情况

4.31 公平交易制执行情况

4.32 公平交易制执行情况

4.33 公平交易制执行情况

4.34 公平交易制执行情况

4.35 公平交易制执行情况

4.36 公平交易制执行情况

4.37 公平交易制执行情况

4.38 公平交易制执行情况

4.39 公平交易制执行情况

4.40 公平交易制执行情况

4.41 公平交易制执行情况

4.42 公平交易制执行情况

4.43 公平交易制执行情况

4.44 公平交易制执行情况

4.45 公平交易制执行情况

4.46 公平交易制执行情况

4.47 公平交易制执行情况

4.48 公平交易制执行情况

4.49 公平交易制执行情况

4.50 公平交易制执行情况

4.51 公平交易制执行情况

4.52 公平交易制执行情况

4.53 公平交易制执行情况

4.54 公平交易制执行情况

4.55 公平交易制执行情况

4.56 公平交易制执行情况

4.57 公平交易制执行情况

4.58 公平交易制执行情况

4.59 公平交易制执行情况

4.60 公平交易制执行情况

4.61 公平交易制执行情况

4.62 公平交易制执行情况

4.63 公平交易制执行情况

4.64 公平交易制执行情况

4.65 公平交易制执行情况

4.66 公平交易制执行情况

4.67 公平交易制执行情况

4.68 公平交易制执行情况

4.69 公平交易制执行情况

4.70 公平交易制执行情况

4.71 公平交易制执行情况

4.72 公平交易制执行情况

4.73 公平交易制执行情况

4.74 公平交易制执行情况

4.75 公平交易制执行情况

4.76 公平交易制执行情况

4.77 公平交易制执行情况

4.78 公平交易制执行情况

4.79 公平交易制执行情况

4.80 公平交易制执行情况