

上证中央企业50交易型开放式指数证券投资基金

[2013] 第四季度报告

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:二〇一四年一月二十二日

§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。
基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年1月17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。
基金管理人过去业绩并不代表未来表现。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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称 上证中央企业50ETF

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1日

报告期末基金份额总额 505,959,219.00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，即按照指数的成份股的构成及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。在正常情况下，本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使基金的日均收益率与业绩比较基准收益率的偏离度的年度平均值不超过±0.2%，偏离度年度化标准差不超过2%。

业绩比较基准 上证中央企业50指数收益率。

风险收益特征 本基金为股票型基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制策略，跟踪上证中央企业50指数，是股票基金中风险中等、收益与市场平均水平大致相近的产品。

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10月1日-2013年12月31日)

1.本期已实现收益 -25,106,899.36

2.本期利润 -7,203,825.95

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0142

4.期末基金份额净值 510,378,208.46

5.期末基金份额净值 1.0087

注:1.本基金基金合同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。
2.(1)本已实现收益”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)扣除相关税费后的余额；(2)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.本基金合同规定，当期基金份额净值减去上一开放日基金份额净值的差额，折算比例为0.03964039。
4.所列数据截止到2013年12月31日。
5.本基金基金份额净值减去其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.1 本期基金份额净值减去其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.2 本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的对比图

基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的对比图

注:1.本基金基金合同于2009年8月26日生效。
2.按基金合同规定，本基金合同期不超过4个月。截至报告期末，本基金的各项投资比例符合基金合同的规定。
3.本基金投资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%。
4.其他指标

5.4 管理人报告

4.1 基金经理(基金经理小组)简介

姓名 职务 在本基金的基金任本基金的基金经理期间 证券从业年限 说明

赵栩 本基金的基 2011年10月 5 2008年加入工银瑞信，曾任风险管理部金融工程部经理，2011年10月18日至今日担任工银上证央企ETF基金经理，2012年10月10日至今日担任工银深证红利ETF联接基金基金经理，2013年5月28日起至今担任工银瑞信全球自然指数基金经理。

本基金的基 2011年10月 5 2010年1月10日-2011年10月18日，任招商证券的前10名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.5 其他基金经理

5.6 管理人对报告期内基金运作的总体情况

5.7 管理人对报告期内基金投资策略的其他重要信息

5.8 影响投资者决策的其他重要信息

5.9 备查文件目录

5.10 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.11 报告期末未持有处于转股期的可转换债券

5.12 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.13 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.15 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.16 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.17 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.18 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.19 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.20 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.21 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.22 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.23 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.24 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.25 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.26 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.27 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.28 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.29 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.30 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.31 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.32 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.33 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.34 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.35 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.36 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.37 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.38 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.39 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.40 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.41 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.42 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.43 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.44 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.45 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.46 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.47 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.48 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.49 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.50 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.51 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.52 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.53 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.54 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.55 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.56 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.57 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.58 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.59 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.60 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.61 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.62 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.63 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.64 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.65 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.66 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.67 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.68 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.69 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.70 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.71 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.72 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.73 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.74 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.75 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.76 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.77 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.78 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.79 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.80 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.81 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.82 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.83 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.84 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.85 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.86 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.87 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.88 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.89 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.90 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.91 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.92 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.93 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.94 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.95 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.96 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.97 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.98 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.99 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.10 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.11 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.12 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.13 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.15 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.16 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.17 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.18 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.19 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.20 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.21 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.22 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.23 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.24 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.25 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.26 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.27 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.28 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.29 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.30 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.31 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.32 报告期末持有的处于转股期