

上证中央企业50交易型开放式指数证券投资基金

[2015] 第二季度报告

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:二〇一五年七月二十一日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事及董事会秘书在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、完整性承担个别及连带责任。

基金托管人及招行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年7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信息，确认报告内容真实无误、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。

本报告期财务资料未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 上证中央企业ETF

场内简称 沪基ETF

交易代码 510160

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 229,859,219.00份

投资目标 本基金追求与股票市场一致的回报，即通过跟踪上证中央企业50指数，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。

投资策略 本基金主要通过构建股票投资组合，拟将基金资产投资于上证中央企业50指数成分股及其权重股，同时根据对标的指数成份股及其权重股的动态调整情况，在正常情况下，本基金对所持有的股票的平均仓位是：力争使基金日均收益率与业绩比较基准日均收益率的差值绝对值不超过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 本基金为交易型基金，主要采用完全复制法跟踪上证中央企业50指数，是股票基金中风险中等，收益与股市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

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2015年4月1日 - 2015年6月30日)

1.本期已实现收益 149,942,060.29

2.期初现金及现金等价物余额 94,949,636.95

3.期末现金及现金等价物余额 500,765,940.88

4.期末基金份额净值 1.0026

5.期末基金份额总值 21,776,000.00

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列示数字。

(2)“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。

3.所列数据截止至2015年6月30日。

3.2.1 本报告期内基金业绩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① (%) 净值增长标准差② (%) 业绩比较基准收益率③ (%) 收益率标准差④ (%) ①-③ (%) ②-④ (%)

过去三个月 11.31% 2.68% 10.43% 2.79% 0.88% -0.07%

3.2.2 本报告期内业绩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.本基金业绩合同于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9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；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净资产值的90%。

3.其他指标

无。

§ 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 证券从业年限 说明

赵超 本基金的基金经理 2011年10月18日 - 7 2008年加入汇添富，曾任风险管理部

基金经理，2010年10月至今担任汇添富红利50基金经

理，2013年5月26日至今担任汇添富

定期开放债券基金经理，2013年5月26日至今担任汇添富

货币基金经理。

4.2 其他管理人对报告期内本基金运作和净值表现的说明

4.3 公平交易制度执行情况

4.4 报告期内基金的投资组合及行业配置情况

4.5 报告期内基金的利润分配情况

4.6 报告期内基金的分红情况

4.7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金报告期未有运用固有资金投资本基金的情况。

4.8 报告期内基金的费用计提、支付及返还情况

4.9 报告期内基金的销售费用计提、支付及返还情况

4.10 报告期内基金的申购费、赎回费情况

4.11 报告期内基金的转换费情况

4.12 报告期内基金的定期定额投资情况

4.13 报告期内实施份额折算的基金情况

4.14 报告期内实施上市交易的基金情况

4.15 报告期内实施滚动发行的基金情况

4.16 报告期内实施定期定额赎回业务的基金情况

4.17 报告期内实施巨额赎回的基金情况

4.18 报告期内实施暂停赎回业务的基金情况

4.19 报告期内实施暂停申购业务的基金情况

4.20 报告期内实施暂停申购赎回业务的基金情况

4.21 报告期内实施暂停申购、赎回业务的基金情况

4.22 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回业务的基金情况

4.23 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购业务的基金情况

4.24 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换业务的基金情况

4.25 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.26 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.27 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.28 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.29 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.30 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.31 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.32 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.33 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.34 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.35 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.36 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.37 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.38 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.39 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.40 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.41 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.42 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.43 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.44 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.45 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.46 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.47 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.48 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.49 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.50 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.51 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.52 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.53 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.54 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.55 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.56 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.57 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.58 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.59 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.60 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.61 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.62 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.63 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.64 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.65 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.66 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.67 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.68 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.69 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.70 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.71 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.72 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.73 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.74 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.75 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况

4.76 报告期内实施暂停申购、赎回、定期定额赎回、定期定额申购、定期定额转换、定期定额转换业务的基金情况