

# 上证50交易型开放式指数证券投资基金

## 2015 第三季度报告

基金管理人：华夏基金管理有限公司  
基金托管人：中国工商银行股份有限公司  
报告送出日期：二〇一五年十月二十七日

### §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。  
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年10月22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预示其未来业绩，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。  
本报告自2015年10月27日起至2015年9月30日止。

### §2 基金产品概况

基金简称	华夏上证50ETF
场内简称	50ETF
基金代码	510100
交易所代码	510100
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2004年12月30日
报告期末基金份额总额	13,209,966,767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最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的构成成份股及其权重构建基金投资组合进行被动跟踪，并视标的指数的构成成份股及其权重的变动而进行相应调整，但在特殊情况下，会运用其他合理方法进行替代。
业绩比较基准	上证50指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，预期风险和预期收益高于货币型基金、债券型基金和混合型基金，属于证券投资基金中风险较高、收益中等的品种。
基金管理人	华夏基金管理有限公司
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

#### 3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期2015年7月1日-2015年9月30日
1.本期已实现收益	-6,518,097,651.94
2.本期利润	-9,338,509,886.43
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0041
4.期末基金资产净值	28,606,954,273.30
5.期末基金份额净值	2.151

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要低于所列数字。  
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。

3.2 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较  
本基金本报告期末未持有资产。  
5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.9 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.10 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.11 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.12 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.13 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.14 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.15 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.16 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.17 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.18 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.19 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.20 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.21 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.22 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.23 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.24 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.25 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.26 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.27 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.28 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.29 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.30 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.31 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.32 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.33 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.34 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.35 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.36 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.37 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.38 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.39 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.40 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.41 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.42 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.43 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.44 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.45 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.46 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.47 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.48 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.49 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.50 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.51 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.52 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.53 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.54 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.55 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.56 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.57 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.58 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.59 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.60 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.61 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.62 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.63 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.64 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.65 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.66 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.67 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.68 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.69 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.70 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.71 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.72 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.73 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.74 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.75 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.76 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.77 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.78 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.79 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.80 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.81 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.82 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.83 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.84 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.85 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.86 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.87 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.88 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.89 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.90 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.91 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.92 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.93 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.94 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.95 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.96 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.97 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.98 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.99 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.100 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.101 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.102 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.103 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.104 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.105 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.106 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.107 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.108 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.109 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.110 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.111 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.112 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.113 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.114 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.115 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.116 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.117 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.118 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.119 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.120 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.121 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.122 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.123 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.124 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.125 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.126 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.127 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.128 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.129 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.130 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.131 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.132 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.133 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.134 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.135 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.136 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.137 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.138 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.139 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.140 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.141 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.142 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.143 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.144 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.145 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.146 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.147 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.148 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.149 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.150 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.151 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.152 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.153 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.154 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.155 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.156 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.157 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.158 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.159 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.160 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.161 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.162 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.163 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.164 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.165 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.166 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.167 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.168 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.169 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.170 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.171 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.172 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.173 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.174 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.175 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.176 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.177 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.178 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.179 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.180 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.181 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.182 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.183 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.184 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.185 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.186 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.187 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.188 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.189 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.190 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.191 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.192 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.193 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.194 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.195 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.196 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.197 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.198 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.199 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.200 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.201 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.202 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.203 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.204 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.205 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.206 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.207 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.208 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.209 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.210 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.211 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.212 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.213 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.214 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.215 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.216 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.217 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.218 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.219 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.220 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.221 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细