

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:二〇一五年十一月二十七日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事、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。

基金托管人和中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2015年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。基金管理人管理的其他基金的过往业绩并不保证本基金一定盈利。

基金的过往业绩并不表示其未来表现。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2015年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A 农、林、牧、渔业	-	-	-
B 采矿业	1,214,766,491.36	42%	
C 制造业	5,324,993,242.14	18.61	
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-	-
E 建筑业	1,632,562,594.93	5.71	
F 批发和零售业	-	-	-
G 交通运输、仓储和邮政业	527,483,903.26	1.88	
H 住宿和餐饮业	-	-	-
I 信息传输、软件和信息技术服务业	850,027,546.88	2.97	
J 金融业	17,882,774,389.87	62.55	
K 房地产业	396,394,927.98	1.38	
L 租赁和商务服务业	-	-	-
M 科学研究和技术服务业	-	-	-
N 水、环境和公共设施管理业	-	-	-
O 居民服务、修理和其他服务业	-	-	-
P 教育	-	-	-
Q 卫生和体育与社会工作	-	-	-
R 文化、体育和娱乐业	-	-	-
S 综合	-	-	-
合计	27,848,693,096.50	97.25	

5.3 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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	83,121,563	2,505,629,131.19	8.76
2	600036	招商银行	123,224,463	2,278,548,707.51	7.97
3	600016	民生银行	229,502,499	1,931,606,161.69	6.75
4	600000	浦发银行	86,982,886	1,446,525,394.19	5.06
5	601166	兴业银行	88,897,611	1,294,349,216.16	4.52
6	601323	交通银行	152,231,020	925,570,073.00	3.24
7	601700	中国银行	69,200,006	896,691,377.02	3.14
8	600030	中行证	60,248,635	818,176,463.30	2.86
9	601398	工商银行	196,402,790	805,646,852.90	2.82
10	600937	建设银行	62,866,850	801,348,462.26	2.80

金额单位:人民币元

§ 3 主要财务指标

单位:人民币元

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				
-6,518,697,661.94				
2.本期利润				
-9,335,1609,394.43				
3.加权平均基金份额本期利润				
-0.00041				
4.期末基金份额净值				
25,605,954.27				
5.期末可供分配基金份额利润				
2,151				

注:1.所列基金收益不包括持有人认购或交易基金的费用,计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

2.本期利润为利息收入、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,本期利润已进行分配。

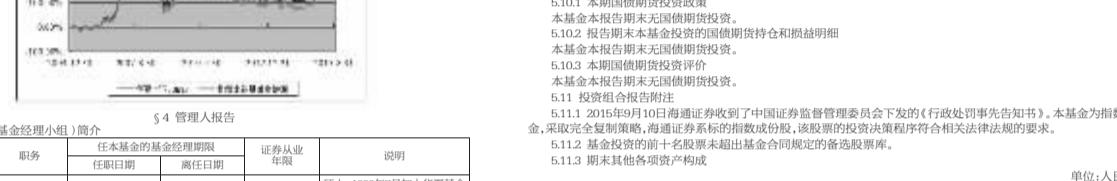
3.2.1 基金净值表现

基金的净值增长率为基金净值增长及其同期业绩比较基准收益的比较

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

(2015年12月30日至2015年9月30日)

§ 4 管理人报告



§ 5 投资组合报告

基金总资产为27,848,693,096.50元,基金总负债为2,151,000.00元,其中基金所负债务均为应付赎回款,因此基金净资产为25,605,954.27元。

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组合

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	83,121,563	2,505,629,131.19	8.76
2	600036	招商银行	123,224,463	2,278,548,707.51	7.97
3	600016	民生银行	229,502,499	1,931,606,161.69	6.75
4	600000	浦发银行	86,982,886	1,446,525,394.19	5.06
5	601166	兴业银行	88,897,611	1,294,349,216.16	4.52
6	601323	交通银行	152,231,020	925,570,073.00	3.24
7	601700	中国银行	69,200,006	896,691,377.02	3.14
8	600030	中行证	60,248,635	818,176,463.30	2.86
9	601398	工商银行	196,402,790	805,646,852.90	2.82
10	600937	建设银行	62,866,850	801,348,462.26	2.80

金额单位:人民币元

§ 6 开放式基金份额变动

报告期末基金份额总份额25,605,954.27份,本报告期无申购、赎回情况。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

基金管理人持有的固有资金投资本基金的情况

报告期内基金管理人持有的固有资金投资本基金的情况

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

§ 9 备查文件

§ 10 备查文件

§ 11 备查文件

§ 12 备查文件

§ 13 备查文件

§ 14 备查文件

§ 15 备查文件

§ 16 备查文件

§ 17 备查文件

§ 18 备查文件

§ 19 备查文件

§ 20 备查文件

§ 21 备查文件

§ 22 备查文件

§ 23 备查文件

§ 24 备查文件

§ 25 备查文件

§ 26 备查文件

§ 27 备查文件

§ 28 备查文件

§ 29 备查文件

§ 30 备查文件

§ 31 备查文件

§ 32 备查文件

§ 33 备查文件

§ 34 备查文件

§ 35 备查文件

§ 36 备查文件

§ 37 备查文件

§ 38 备查文件

§ 39 备查文件

§ 40 备查文件

§ 41 备查文件

§ 42 备查文件

§ 43 备查文件

§ 44 备查文件

§ 45 备查文件

§ 46 备查文件

§ 47 备查文件

§ 48 备查文件

§ 49 备查文件

§ 50 备查文件

§ 51 备查文件

§ 52 备查文件

§ 53 备查文件

§ 54 备查文件

§ 55 备查文件

§ 56 备查文件

§ 57 备查文件

§ 58 备查文件

§ 59 备查文件

§ 60 备查文件

§ 61 备查文件