

信息披露 Disclosure

上证中央企业50交易型开放式指数证券投资基金

[2016] 第一季度报告

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:二〇一六年四月二十二日

§ 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基金合同的有关规定，于2016年4月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告内容，保证报告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。

报告期利润未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基本产品概况

基金简称	上证中央企业50交易型开放式指数证券投资基金
场内简称	央企ETF
交易代码	E10000
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2009年8月30日
报告期末基金份额总额	170,969,210.0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回报。

投资策略

本基金主要通过观察宏观经济指标、政策指数的表观、跟踪标的指数成分股及其权重的变化并结合对市场的分析，在正常情况下，本基金对所持有的股票的平均持仓比例为：方便基金管理公司决策与操作的最低比例

40%，最高比例为60%；股票配置比例为20%，债券配置比例不超过20%。

业绩比较基准

本基金中证50指数收益率

基金净值增长率

基金净值增长率

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

于所列示的收益。

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.所列数据截至2016年3月31日。

3.2 基金的净值表现

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

过去三个月 -14.20% 2.41% -13.96% 2.42% -0.24% -0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

单位:份额:净值增长率,业绩比较基准收益率,净值增长率标准差

图:净值增长率,业绩比较基准收益率,净值增长率标准差

注:1.基金合同于2009年8月30日生效。

2.按基金合同规定,本基金建仓期不超过12个月。截至本报告期末,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资产净值的90%。

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		说明
		任职日期	离任日期	
赵相	本基金的基金经理	2011年10月18日	-	8

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同,招募说明书等有关基金法律文件的规定,依据诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金资产,在控制风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益,无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

4.3.1 公平交易制度的执行情况

4.3.2 公平交易制度的执行情况

4.3.3 公平交易制度的执行情况

4.3.4 公平交易制度的执行情况

4.3.5 公平交易制度的执行情况

4.3.6 公平交易制度的执行情况

4.3.7 公平交易制度的执行情况

4.3.8 公平交易制度的执行情况

4.3.9 公平交易制度的执行情况

4.3.10 公平交易制度的执行情况

4.3.11 公平交易制度的执行情况

4.3.12 公平交易制度的执行情况

4.3.13 公平交易制度的执行情况

4.3.14 公平交易制度的执行情况

4.3.15 公平交易制度的执行情况

4.3.16 公平交易制度的执行情况

4.3.17 公平交易制度的执行情况

4.3.18 公平交易制度的执行情况

4.3.19 公平交易制度的执行情况

4.3.20 公平交易制度的执行情况

4.3.21 公平交易制度的执行情况

4.3.22 公平交易制度的执行情况

4.3.23 公平交易制度的执行情况

4.3.24 公平交易制度的执行情况

4.3.25 公平交易制度的执行情况

4.3.26 公平交易制度的执行情况

4.3.27 公平交易制度的执行情况

4.3.28 公平交易制度的执行情况

4.3.29 公平交易制度的执行情况

4.3.30 公平交易制度的执行情况

4.3.31 公平交易制度的执行情况

4.3.32 公平交易制度的执行情况

4.3.33 公平交易制度的执行情况

4.3.34 公平交易制度的执行情况

4.3.35 公平交易制度的执行情况

4.3.36 公平交易制度的执行情况

4.3.37 公平交易制度的执行情况

4.3.38 公平交易制度的执行情况

4.3.39 公平交易制度的执行情况

4.3.40 公平交易制度的执行情况

4.3.41 公平交易制度的执行情况

4.3.42 公平交易制度的执行情况

4.3.43 公平交易制度的执行情况

4.3.44 公平交易制度的执行情况

4.3.45 公平交易制度的执行情况

4.3.46 公平交易制度的执行情况

4.3.47 公平交易制度的执行情况

4.3.48 公平交易制度的执行情况

4.3.49 公平交易制度的执行情况

4.3.50 公平交易制度的执行情况

4.3.51 公平交易制度的执行情况

4.3.52 公平交易制度的执行情况

4.3.53 公平交易制度的执行情况

4.3.54 公平交易制度的执行情况

4.3.55 公平交易制度的执行情况

4.3.56 公平交易制度的执行情况

4.3.57 公平交易制度的执行情况

4.3.58 公平交易制度的执行情况

4.3.59 公平交易制度的执行情况

4.3.60 公平交易制度的执行情况

4.3.61 公平交易制度的执行情况

4.3.62 公平交易制度的执行情况

4.3.63 公平交易制度的执行情况

4.3.64 公平交易制度的执行情况

4.3.65 公平交易制度的执行情况

4.3.66 公平交易制度的执行情况

4.3.67 公平交易制度的执行情况

4.3.68 公平交易制度的执行情况

4.3.69 公平交易制度的执行情况

4.3.70 公平交易制度的执行情况

4.3.71 公平交易制度的执行情况

4.3.72 公平交易制度的执行情况

4.3.73 公平交易制度的执行情况

4.3.74 公平交易制度的执行情况

4.3.75 公平交易制度的执行情况

4.3.76 公平交易制度的执行情况

4.3.77 公平交易制度的执行情况

4.3.78 公平交易制度的执行情况

4.3.79 公平交易制度的执行情况

4.3.80 公平交易制度的执行情况

4.3.81 公平交易制度的执行情况

4.3.82 公平交易制度的执行情况

4.3.83 公平交易制度的执行情况

4.3.84 公平交易制度的执行情况

4.3.85 公平交易制度的执行情况

4.3.86 公平交易制度的执行情况

4.3.87 公平交易制度的执行情况

4.3.88 公平交易制度的执行情况

4.3.89 公平交易制度的执行情况

4.3.90 公平交易制度的执行情况

4.3.91 公平交易制度的执行情况

4.3.92 公平交易制度的执行情况

4.3.93 公平交易制度的执行情况

4.3.94 公平交易制度的执行情况

4.3.95 公平交易制度的执行情况

4.3.96 公平交易制度的执行情况

4.3.97 公平交易制度的执行情况

4.3.98 公平交易制度的执行情况

4.3.99 公平交易制度的执行情况

4.3.100 公平交易制度的执行情况

4.3.101 公平交易制度的执行情况

4.3.102 公平交易制度的执行情况

4.3.103 公平交易制度的执行情况

4.3.104 公平交易制度的执行情况

4.3.105 公平交易制度的执行情况

4.3.106 公平交易制度的执行情况

4.3.107 公平交易制度的执行情况

4.3.108 公平交易制度的执行情况

4.3.109 公平交易制度的执行情况

4.3.110 公平交易制度的执行情况

4.3.111 公平交易制度的执行情况

4.3.112 公平交易制度的执行情况

4.3.113 公平交易制度的执行情况

4.3.114 公平交易制度的执行情况

4.3.115 公平交易制度的执行情况

4.3.116 公平交易制度的执行情况</