

中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金

2016年度报告摘要

基金管理人：中证基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
报告日期：2017年3月29日

1.1 重要提示

基金管理人的董事局、董事会或类似机构在对本报告所载资料进行审核时，确认其不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本报告经基金经理签字后，由基金管理人负责对外披露，基金托管人负责复核。

基金经理承诺：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请仔细阅读本基金的招募说明书及其更新、基金定期报告和其他相关信息。

本报告期告定期限为2016年7月28日至2016年12月31日。

基金名称：中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金

基金简称：中证国企 ETF

场内简称：上海国企

基金主代码：51010

基金运作方式：交易型开放式

基金合同生效日：2016年7月28日

基金管理人：中证基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告期末基金份额总额：15,266,091,004.00份

本报告期净值利润率：-1.30%

报告期末基金份额净值：1.00元

报告期利润：2016年7月28日至2016年12月31日

2.2 基金产品说明

投资目标：紧密跟踪标的指数，追求幅度和误差最小化。

投资策略：本基金通过量化方法，定期跟踪并调整组合配置比例，以期实现与标的指数相似的收益。

业绩比较基准：中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）的业绩比较基准为中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“标的指数”）。

风险收益特征：本基金是一只股票型基金，其预期风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，其主要投资于股票，因此本基金属于高风险、高收益品种。

2017年 A 股市场价格波动较为剧烈，但整体趋势向好，大涨大跌、涨跌分化现象或将持续，建议投资者关注行业龙头公司，把握结构性机会。

本基金将严格遵守《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规的规定，按照《基金合同》的约定，本着谨慎的原则，以追求跟踪标的指数的回报为目标，力争使基金净值增长率与业绩比较基准增长率的偏离度在正常范围内。

本基金将通过量化方法，定期跟踪并调整组合配置比例，以期实现与标的指数相似的收益。

4.4.5 管理人对宏观经济、证券市场及基金所处行业状况的简要评述

报告期内，本基金管理人对宏观经济、证券市场及基金所处行业状况的简要评述，以及对宏观经济、证券市场未来的简要展望，见“第十一部分”。

4.4.6 管理人对基金估值方法的说明

本基金采用在每日收盘后计算的基金资产净值除以当日的份额总数所得的基金份额净值作为基金份额的公允价值。

4.4.7 管理人对会计政策、会计估计和变更的说明

本基金在首次执行新金融工具准则时，对金融资产的分类、计量和减值、金融负债的分类和计量、套期会计、金融资产转移和公允价值计量等进行了追溯调整。

4.4.8 管理人对重要事项的说明

4.5 托管人报告

5.1 本报告期本基金托管人遵守了《基金合同》的各项规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，托管人尽职尽责，严格履行了托管人的义务。

5.2 本报告期本基金托管人未发现基金管理人有违反《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等法律、法规、规章、规范性文件以及《基金合同》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金投资运作、基金资产净值的计算、收益分配等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.4 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金估值核算、费用计提、基金信息披露等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.5 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金销售中存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.6 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金投资运作、基金资产净值的计算、收益分配等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.7 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金估值核算、费用计提、基金信息披露等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.8 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金销售中存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.9 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金投资运作、基金资产净值的计算、收益分配等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.10 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金估值核算、费用计提、基金信息披露等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.11 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金销售中存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.12 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金投资运作、基金资产净值的计算、收益分配等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.13 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金估值核算、费用计提、基金信息披露等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.14 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金销售中存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.15 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金投资运作、基金资产净值的计算、收益分配等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.16 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金估值核算、费用计提、基金信息披露等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.17 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金销售中存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.18 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金投资运作、基金资产净值的计算、收益分配等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.19 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金估值核算、费用计提、基金信息披露等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.20 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金销售中存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.21 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金投资运作、基金资产净值的计算、收益分配等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.22 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金估值核算、费用计提、基金信息披露等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.23 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金销售中存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.24 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金投资运作、基金资产净值的计算、收益分配等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.25 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金估值核算、费用计提、基金信息披露等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.26 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金销售中存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.27 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金投资运作、基金资产净值的计算、收益分配等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.28 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金估值核算、费用计提、基金信息披露等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.29 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金销售中存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.30 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金投资运作、基金资产净值的计算、收益分配等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.31 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金估值核算、费用计提、基金信息披露等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.32 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金销售中存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.33 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金投资运作、基金资产净值的计算、收益分配等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.34 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金估值核算、费用计提、基金信息披露等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.35 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金销售中存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.36 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金投资运作、基金资产净值的计算、收益分配等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.37 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金估值核算、费用计提、基金信息披露等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.38 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金销售中存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.39 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金投资运作、基金资产净值的计算、收益分配等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.40 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金估值核算、费用计提、基金信息披露等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.41 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金销售中存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.42 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金投资运作、基金资产净值的计算、收益分配等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.43 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金估值核算、费用计提、基金信息披露等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.44 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金销售中存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.45 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金投资运作、基金资产净值的计算、收益分配等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.46 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金估值核算、费用计提、基金信息披露等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.47 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金销售中存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.48 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金投资运作、基金资产净值的计算、收益分配等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.49 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金估值核算、费用计提、基金信息披露等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.50 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金销售中存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.51 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金投资运作、基金资产净值的计算、收益分配等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.52 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金估值核算、费用计提、基金信息披露等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.53 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金销售中存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.54 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金投资运作、基金资产净值的计算、收益分配等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.55 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金估值核算、费用计提、基金信息披露等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.56 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金销售中存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.57 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金投资运作、基金资产净值的计算、收益分配等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.58 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金估值核算、费用计提、基金信息披露等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.59 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金销售中存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.60 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金投资运作、基金资产净值的计算、收益分配等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.61 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金估值核算、费用计提、基金信息披露等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.62 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金销售中存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.63 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金投资运作、基金资产净值的计算、收益分配等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.64 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金估值核算、费用计提、基金信息披露等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.65 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金销售中存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.66 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金投资运作、基金资产净值的计算、收益分配等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.67 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金估值核算、费用计提、基金信息披露等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.68 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金销售中存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.69 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金投资运作、基金资产净值的计算、收益分配等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.70 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金估值核算、费用计提、基金信息披露等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.71 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金销售中存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.72 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金投资运作、基金资产净值的计算、收益分配等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.73 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金估值核算、费用计提、基金信息披露等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.74 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金销售中存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.75 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金投资运作、基金资产净值的计算、收益分配等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.76 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金估值核算、费用计提、基金信息披露等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.77 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金销售中存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.78 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金投资运作、基金资产净值的计算、收益分配等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.79 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金估值核算、费用计提、基金信息披露等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.80 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金销售中存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.81 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金投资运作、基金资产净值的计算、收益分配等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.82 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金估值核算、费用计提、基金信息披露等方面存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。

5.83 本报告期本基金托管人未发现基金管理人在基金销售中存在违法违规行为，损害基金份额持有人利益的情形。