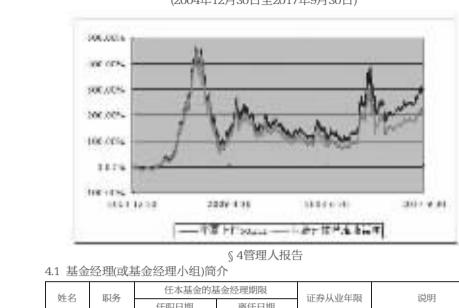


上证50交易型开放式指数证券投资基金

2017年第三季度报告



2017年第三季度报告

上证50前阶段增长率为4.80%。本基金本报告期回报幅度为4.15%，与业绩比较基准产生偏离的主要原因为日常经营费用、指数结构调整、申购赎回、成份股分红等产生的影响。

4.45 报告期末基金持有人数或基金份额净值情况说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金持有人数不足二百人或者基金资产净值低于五万元的情形。

5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权证投资	36,042,567,152.45	99.35
其中国债		36,042,567,152.45	99.35
2	银行存款	-	-
其中：定期存款	-	-	
货币市场基金	-	-	
3	券商回购	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-	
6	银行存款和结算备付金合计	124,602,492.31	0.34
7	其他各项资产	111,390,144.00	0.31
8	合计	36,276,556,152.79	100.00

注：报告期投资的公允价值包含可赎回代销的估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A 农、林、牧、渔业	-	-	-
B 建筑业	1,314,541,971.67	3.63	
C 制造业	6,377,706,134.40	17.05	
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	276,295,386.00	0.76	
E 建筑装饰业	2,706,000,364.44	6.16	
F 批发和零售业	26,399.00	0.00	
G 交通运输、仓储和邮政业	643,608,777.81	1.79	
H 住宿和餐饮业	-	-	
I 信息传输、软件和信息技术服务业	409,525,890.00	1.10	
J 金融业	23,599,133,521.21	66.01	
K 房屋建筑业	1,090,439,419.00	3.02	
L 相关代理服务和服务业	79,324.72	0.00	
M 科学研究、技术服务和地质勘查业	43,691.27	0.00	
N 水利、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 卫生和社会工作	-	-	
R 文化、体育和娱乐业	31,224.46	0.00	
S 住宿和餐饮业	-	-	
T 合计	36,042,567,152.45	100.00	

注：报告期投资的公允价值包含可赎回代销的估值增值。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资组合

5.2.3 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	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	14.69
2	601328	交通银行	10.00
3	601336	华泰证券	8.00
4	601398	工商银行	7.00
5	601628	浦发银行	4.02
6	601631	兴业银行	3.99
7	601653	招商银行	3.70
8	601661	平安银行	3.67
9	601666	兴业股份	2.00
10	601667	招商财险	1.96

注：报告期投资的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

5.3 主要财务指标和基金净值表现

5.3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2017年1月1日-2017年9月30日)
1.本期利润	1,715,918,796.10
2.本期利润	1,715,918,796.10
3.期末基金资产净值	1,014,14
4.期末基金份额净值	36,269,085,070.00
5.期末净资产收益率	2.76%

注：所列财务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有所变动。

5.3.2 本期已实现收益扣除非经常性损益后的净利润、本期利润、本期利润扣除非经常性损益的金额

5.3.3 期末可供分配利润、期末基金资产净值

5.3.4 期末基金份额净值

5.3.5 期末可供分配基金份额总额

5.3.6 期末基金资产总值

5.3.7 期末基金资产净值

5.3.8 期末基金份额净值

5.3.9 期末可供分配基金份额总额

5.3.10 期末基金资产总值

5.3.11 期末基金份额净值

5.3.12 期末可供分配基金份额总额

5.3.13 期末基金资产总值

5.3.14 期末基金份额净值

5.3.15 期末可供分配基金份额总额

5.3.16 期末基金资产总值

5.3.17 期末基金份额净值

5.3.18 期末可供分配基金份额总额

5.3.19 期末基金资产总值

5.3.20 期末基金份额净值

5.3.21 期末可供分配基金份额总额

5.3.22 期末基金资产总值

5.3.23 期末基金份额净值

5.3.24 期末可供分配基金份额总额

5.3.25 期末基金资产总值

5.3.26 期末基金份额净值

5.3.27 期末可供分配基金份额总额

5.3.28 期末基金资产总值

5.3.29 期末基金份额净值

5.3.30 期末可供分配基金份额总额

5.3.31 期末基金资产总值

5.3.32 期末基金份额净值

5.3.33 期末可供分配基金份额总额

5.3.34 期末基金资产总值

5.3.35 期末基金份额净值

5.3.36 期末可供分配基金份额总额

5.3.37 期末基金资产总值

5.3.38 期末基金份额净值

5.3.39 期末可供分配基金份额总额

5.3.40 期末基金资产总值

5.3.41 期末基金份额净值

5.3.42 期末可供分配基金份额总额

5.3.43 期末基金资产总值

5.3.44 期末基金份额净值

5.3.45 期末可供分配基金份额总额

5.3.46 期末基金资产总值

5.3.47 期末基金份额净值

5.3.48 期末可供分配基金份额总额

5.3.49 期末基金资产总值

5.3.50 期末基金份额净值

5.3.51 期末可供分配基金份额总额

5.3.52 期末基金资产总值

5.3.53 期末基金份额净值

5.3.54 期末可供分配基金份额总额

5.3.55 期末基金资产总值

5.3.56 期末基金份额净值

5.3.57 期末可供分配基金份额总额

5.3.58 期末基金资产总值

5.3.59 期末基金份额净值

5.3.60 期末可供分配基金份额总额

5.3.61 期末基金资产总值

5.3.62 期末基金份额净值

5.3.63 期末可供分配基金份额总额

5.3.64 期末基金资产总值

5.3.65 期末基金份额净值

5.3.66 期末可供分配基金份额总额

5.3.67 期末基金资产总值

5.3.68 期末基金份额净值

5.3.69 期末可供分配基金份额总额

5.3.70 期末基金资产总值

5.3.71 期末基金份额净值

5.3.72 期末可供分配基金份额总额

5.3.73 期末基金资产总值

5.3.74 期末基金份额净值

5.3.75 期末可供分配基金份额总额

5.3.76 期末基金资产总值

5.3.77 期末基金份额净值

5.3.78 期末可供分配基金份额总额

5.3.79 期末基金资产总值

5.3.80 期末基金份额净值

5.3.81 期末可供分配基金份额总额

5.3.82 期末基金资产总值

5.3.83 期末基金份额净值

5.3.84 期末可供分配基金份额总额

5.3.85 期末基金资产总值

5.3.86 期末基金份额净值

5.3.87 期末可供分配基金份额总额

5.3.88 期末基金资产总值

5.3.89 期末基金份额净值

5.3.90 期末可供分配基金份额总额

5.3.91 期末基金资产总值

5.3.92 期末基金份额净值

5.3.93 期末可供分配基金份额总额

5.3.94 期末基金资产总值