

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
报告期截止日期:二〇一八年一月二十日

1.1 重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员和基金托管人不存在虚假记载、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。
基金合同于2010年1月18日经中国证监会核准。基金合同自2010年1月18日开始执行。本报告中的财务数据、净值数据和投资组合报告等,仅在本基金存续期内存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
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基金的招募说明书、产品资料概要并接受其条款。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读基金的招募说明书、产品资料概要并接受其条款。

1.2 基本情况

基金名称:上证中央企业50交易型开放式指数证券投资基金

基金简称:上证央企50ETF

交易代码:510000

基金运作方式:交易型开放式

基金合同生效日:2009年1月20日

报告期末基金份额总额:117,969,210.00份

投资目标:紧密跟踪标的指数,实现跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,力争在扣除交易费用后的净值增长率与标的指数收益率相一致。

投资策略:本基金主要通过完全复制法,即完全按照标的指数的构成比例及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股的变动情况及时调整股票投资组合,以保证基金净值增长率与标的指数收益率相一致。

投资范围:本基金主要投资于上证中央企业50指数的成份股,同时可少量投资于与标的指数风格相似的股票,以及法律法规或中国证监会允许的其他金融工具。

投资限制:本基金在任何交易日买入股票的总市值不得超过基金资产净值的95%。

业绩比较基准:上证中央企业50指数

风险收益特征:本基金属于股票型基金,风险与收益大于混合型基金,风险与收益大于债券型基金,风险与收益大于货币市场基金。本基金为股票型基金,主要采用被动投资策略,通过完全复制法,即完全按照标的指数的构成比例及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股的变动情况及时调整股票投资组合,以保证基金净值增长率与标的指数收益率相一致。

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

报告期(2017年10月1日-2017年12月31日)

1.本期已实现收益:3,457,810.00

2.本期利润:8,394,882.25

3.加权平均基金份额本期利润:0.0676

4.期末基金资产净值:222,903,731.63

5.期末基金份额净值:1.3804

注:1.基金合同明确规定,本基金建仓期不超过3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;本基金的存续期,基金的存续期指基金的开放期与非开放期之和,且本基金与本基金管理人管理的其他投资基金组合在同一开放期进行操作的,由基金管理人根据基金的开放期与非开放期之和,将本基金与本基金管理人管理的其他投资基金组合的存续期进行统一计算。

2.本基金的存续期,基金的存续期指基金的开放期与非开放期之和,且本基金与本基金管理人管理的其他投资基金组合在同一开放期进行操作的,由基金管理人根据基金的开放期与非开放期之和,将本基金与本基金管理人管理的其他投资基金组合的存续期进行统一计算。

3.本基金的存续期指基金的开放期与非开放期之和,且本基金与本基金管理人管理的其他投资基金组合在同一开放期进行操作的,由基金管理人根据基金的开放期与非开放期之和,将本基金与本基金管理人管理的其他投资基金组合的存续期进行统一计算。

4.4.2 管理人对报告期内本基金运作合规性的说明

本基金报告期内不存在虚假记载、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。

5.1 报告期内本基金的财务指标

5.2 报告期末本基金的资产组合情况

5.3 报告期内本基金的利润分配情况

5.4 报告期内本基金的费用情况

5.5 报告期内本基金的净值表现

5.6 报告期内本基金的其他情况

5.7 报告期内本基金的其他情况

5.8 报告期内本基金的其他情况

5.9 报告期内本基金的其他情况

5.10 报告期内本基金的其他情况

5.11 报告期内本基金的其他情况

5.12 报告期内本基金的其他情况

5.13 报告期内本基金的其他情况

5.14 报告期内本基金的其他情况

5.15 报告期内本基金的其他情况

5.16 报告期内本基金的其他情况

5.17 报告期内本基金的其他情况

5.18 报告期内本基金的其他情况

5.19 报告期内本基金的其他情况

5.20 报告期内本基金的其他情况

5.21 报告期内本基金的其他情况

5.22 报告期内本基金的其他情况

5.23 报告期内本基金的其他情况

5.24 报告期内本基金的其他情况

5.25 报告期内本基金的其他情况

5.26 报告期内本基金的其他情况

5.27 报告期内本基金的其他情况

5.28 报告期内本基金的其他情况

5.29 报告期内本基金的其他情况

5.30 报告期内本基金的其他情况

5.31 报告期内本基金的其他情况

5.32 报告期内本基金的其他情况

5.33 报告期内本基金的其他情况

5.34 报告期内本基金的其他情况

5.35 报告期内本基金的其他情况

5.36 报告期内本基金的其他情况

5.37 报告期内本基金的其他情况

5.38 报告期内本基金的其他情况

5.39 报告期内本基金的其他情况

5.40 报告期内本基金的其他情况

5.41 报告期内本基金的其他情况

5.42 报告期内本基金的其他情况

5.43 报告期内本基金的其他情况

5.44 报告期内本基金的其他情况

5.45 报告期内本基金的其他情况

5.46 报告期内本基金的其他情况

5.47 报告期内本基金的其他情况

5.48 报告期内本基金的其他情况

5.49 报告期内本基金的其他情况

5.50 报告期内本基金的其他情况

5.51 报告期内本基金的其他情况

5.52 报告期内本基金的其他情况

5.53 报告期内本基金的其他情况

5.54 报告期内本基金的其他情况

5.55 报告期内本基金的其他情况

5.56 报告期内本基金的其他情况

5.57 报告期内本基金的其他情况

5.58 报告期内本基金的其他情况

5.59 报告期内本基金的其他情况

5.60 报告期内本基金的其他情况

5.61 报告期内本基金的其他情况

5.62 报告期内本基金的其他情况

5.63 报告期内本基金的其他情况

5.64 报告期内本基金的其他情况

5.65 报告期内本基金的其他情况

5.66 报告期内本基金的其他情况

5.67 报告期内本基金的其他情况

5.68 报告期内本基金的其他情况

5.69 报告期内本基金的其他情况

5.70 报告期内本基金的其他情况

5.71 报告期内本基金的其他情况

5.72 报告期内本基金的其他情况

5.73 报告期内本基金的其他情况

5.74 报告期内本基金的其他情况

5.75 报告期内本基金的其他情况

5.76 报告期内本基金的其他情况

5.77 报告期内本基金的其他情况

5.78 报告期内本基金的其他情况

5.79 报告期内本基金的其他情况

5.80 报告期内本基金的其他情况

5.81 报告期内本基金的其他情况

5.82 报告期内本基金的其他情况

5.83 报告期内本基金的其他情况

5.84 报告期内本基金的其他情况

5.85 报告期内本基金的其他情况

5.86 报告期内本基金的其他情况

5.87 报告期内本基金的其他情况

5.88 报告期内本基金的其他情况

5.89 报告期内本基金的其他情况

5.90 报告期内本基金的其他情况

5.91 报告期内本基金的其他情况

5.92 报告期内本基金的其他情况

5.93 报告期内本基金的其他情况

5.94 报告期内本基金的其他情况

5.95 报告期内本基金的其他情况

5.96 报告期内本基金的其他情况

5.97 报告期内本基金的其他情况

5.98 报告期内本基金的其他情况

5.99 报告期内本基金的其他情况

5.100 报告期内本基金的其他情况

5.101 报告期内本基金的其他情况

5.102 报告期内本基金的其他情况

5.103 报告期内本基金的其他情况

5.104 报告期内本基金的其他情况

5.105 报告期内本基金的其他情况

5.106 报告期内本基金的其他情况

5.107 报告期内本基金的其他情况

5.108 报告期内本基金的其他情况

5.109 报告期内本基金的其他情况

5.110 报告期内本基金的其他情况

5.111 报告期内本基金的其他情况

5.112 报告期内本基金的其他情况

5.113 报告期内本基金的其他情况

5.114 报告期内本基金的其他情况

5.115 报告期内本基金的其他情况

5.116 报告期内本基金的其他情况

5.117 报告期内本基金的其他情况

5.118 报告期内本基金的其他情况

5.119 报告期内本基金的其他情况

5.120 报告期内本基金的其他情况

5.121 报告期内本基金的其他情况

5.122 报告期内本基金的其他情况

5.123 报告期内本基金的其他情况

5.124 报告期内本基金的其他情况

5.125 报告期内本基金的其他情况

5.126 报告期内本基金的其他情况

5.127 报告期内本基金的其他情况

5.128 报告期内本基金的其他情况

5.129 报告期内本基金的其他情况

5.130 报告期内本基金的其他情况

5.131 报告期内本基金的其他情况

5.132 报告期内本基金的其他情况

5.133 报告期内本基金的其他情况

5.134 报告期内本基金的其他情况

5.135 报告期内本基金的其他情况

5.136 报告期内本基金的其他情况