

基金管理人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本基金合同规定，于2010年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

基金的过往业绩并不预示其未来表现，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。

本报告中的财务资料未经审计。本报告自2009年10月1日起至12月31日止。

基金产品概况
基金名称: 上证中央企业50
基金代码: 510000
基金运作方式: 交易型开放式
基金合同生效日: 2009年08月26日

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
报告期(2009年10月01日-2009年12月31日)
1.本期实现收益: 238,119,926.01
2.本期基金份额净值增长率: 516,514,686.26

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数字。

(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) 本基金已于2009年09月29日进行了基金的折算,折算比例为0.62064039。

(4) 所有数据截止到2009年12月31日。

3.2 基金净值表现
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 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 16.07% 1.74% 16.01% 1.77% -0.04% -0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注: 1. 本基金基金合同于2009年8月26日生效,截至报告期末,本基金基金合同生效不满一年。

2. 本基金合同规定,本基金建仓期不超过3个月。截至报告期末,本基金已完成建仓,本基金主要投资于标的指数成份股,备选成份股等。一般风险收益来源,债券、货币及现金类资产占基金资产的比例不超过5%。

3. 本基金投资于标的指数的成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%,但因法律法规

上证中央企业50 交易型开放式指数证券投资基金

2009年第四季度报告

2009年12月31日

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:2010年01月20日

的规定而受到限制的情况除外。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现
本报告期基金份额净值为1.726元,本报告期内,基金份额净值增长率为16.07%,同期业绩比较基准增长率为16.61%,基金超额收益率为-0.54%。

5.1 报告期末基金资产组合情况
项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

Table with 2 columns: 项目, 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

Table with 2 columns: 行业类别, 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

5.3 其他资产构成
序号 名称 金额(元)

Table with 2 columns: 序号, 名称 金额(元)

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

5.8.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.8.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

5.8.3 其他资产构成
序号 名称 金额(元)

Table with 2 columns: 序号, 名称 金额(元)

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.5 报告期末持有的未到期资产支持证券

5.8.6 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.7 其他资产构成
序号 名称 金额(元)

Table with 2 columns: 序号, 名称 金额(元)

5.8.8 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.9 报告期末持有的未到期资产支持证券

5.8.10 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.11 其他资产构成
序号 名称 金额(元)

Table with 2 columns: 序号, 名称 金额(元)

5.8.12 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.13 报告期末持有的未到期资产支持证券

5.8.14 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.15 其他资产构成
序号 名称 金额(元)

Table with 2 columns: 序号, 名称 金额(元)

5.8.16 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.17 报告期末持有的未到期资产支持证券

5.8.18 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.19 其他资产构成
序号 名称 金额(元)

Table with 2 columns: 序号, 名称 金额(元)

5.8.20 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.21 报告期末持有的未到期资产支持证券

5.8.22 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.23 其他资产构成
序号 名称 金额(元)

Table with 2 columns: 序号, 名称 金额(元)

5.8.24 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.25 报告期末持有的未到期资产支持证券

5.8.26 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.27 其他资产构成
序号 名称 金额(元)

Table with 2 columns: 序号, 名称 金额(元)

5.8.28 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.29 报告期末持有的未到期资产支持证券

5.8.30 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.31 其他资产构成
序号 名称 金额(元)

Table with 2 columns: 序号, 名称 金额(元)

5.8.32 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.33 报告期末持有的未到期资产支持证券

5.8.34 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.35 其他资产构成
序号 名称 金额(元)

Table with 2 columns: 序号, 名称 金额(元)

5.8.36 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.37 报告期末持有的未到期资产支持证券

5.8.38 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.39 其他资产构成
序号 名称 金额(元)

Table with 2 columns: 序号, 名称 金额(元)

5.8.40 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.41 报告期末持有的未到期资产支持证券

5.8.42 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.43 其他资产构成
序号 名称 金额(元)

Table with 2 columns: 序号, 名称 金额(元)

5.8.44 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.45 报告期末持有的未到期资产支持证券

5.8.46 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.47 其他资产构成
序号 名称 金额(元)

Table with 2 columns: 序号, 名称 金额(元)

5.8.48 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.49 报告期末持有的未到期资产支持证券

5.8.50 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.51 其他资产构成
序号 名称 金额(元)

Table with 2 columns: 序号, 名称 金额(元)

5.8.52 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.53 报告期末持有的未到期资产支持证券

5.8.54 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.55 其他资产构成
序号 名称 金额(元)

Table with 2 columns: 序号, 名称 金额(元)

5.8.56 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.57 报告期末持有的未到期资产支持证券

5.8.58 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.59 其他资产构成
序号 名称 金额(元)

Table with 2 columns: 序号, 名称 金额(元)

5.8.60 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.61 报告期末持有的未到期资产支持证券

5.8.62 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.63 其他资产构成
序号 名称 金额(元)

Table with 2 columns: 序号, 名称 金额(元)

5.8.64 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.65 报告期末持有的未到期资产支持证券

5.8.66 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.67 其他资产构成
序号 名称 金额(元)

Table with 2 columns: 序号, 名称 金额(元)

5.8.68 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.69 报告期末持有的未到期资产支持证券

5.8.70 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.71 其他资产构成
序号 名称 金额(元)

Table with 2 columns: 序号, 名称 金额(元)

5.8.72 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.73 报告期末持有的未到期资产支持证券

5.8.74 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.75 其他资产构成
序号 名称 金额(元)

Table with 2 columns: 序号, 名称 金额(元)

5.8.76 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.77 报告期末持有的未到期资产支持证券

5.8.78 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.79 其他资产构成
序号 名称 金额(元)

Table with 2 columns: 序号, 名称 金额(元)

5.8.80 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.81 报告期末持有的未到期资产支持证券

5.8.82 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.83 其他资产构成
序号 名称 金额(元)

Table with 2 columns: 序号, 名称 金额(元)

5.8.84 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.85 报告期末持有的未到期资产支持证券

5.8.86 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.87 其他资产构成
序号 名称 金额(元)

Table with 2 columns: 序号, 名称 金额(元)

5.8.88 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.89 报告期末持有的未到期资产支持证券

5.8.90 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.91 其他资产构成
序号 名称 金额(元)

Table with 2 columns: 序号, 名称 金额(元)

5.8.92 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.93 报告期末持有的未到期资产支持证券

5.8.94 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.95 其他资产构成
序号 名称 金额(元)

Table with 2 columns: 序号, 名称 金额(元)

5.8.96 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.97 报告期末持有的未到期资产支持证券

5.8.98 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.99 其他资产构成
序号 名称 金额(元)

Table with 2 columns: 序号, 名称 金额(元)

5.8.100 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.101 报告期末持有的未到期资产支持证券

5.8.102 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.103 其他资产构成
序号 名称 金额(元)

Table with 2 columns: 序号, 名称 金额(元)

5.8.104 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.105 报告期末持有的未到期资产支持证券

5.8.106 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.107 其他资产构成
序号 名称 金额(元)

Table with 2 columns: 序号, 名称 金额(元)

5.8.108 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.109 报告期末持有的未到期资产支持证券

5.8.110 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.111 其他资产构成
序号 名称 金额(元)

Table with 2 columns: 序号, 名称 金额(元)

5.8.112 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.113 报告期末持有的未到期资产支持证券

5.8.114 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.115 其他资产构成
序号 名称 金额(元)

Table with 2 columns: 序号, 名称 金额(元)

5.8.116 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.117 报告期末持有的未到期资产支持证券

5.8.118 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.119 其他资产构成
序号 名称 金额(元)

Table with 2 columns: 序号, 名称 金额(元)

5.8.120 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.121 报告期末持有的未到期资产支持证券

5.8.122 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.123 其他资产构成
序号 名称 金额(元)

Table with 2 columns: 序号, 名称 金额(元)

5.8.124 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.125 报告期末持有的未到期资产支持证券

5.8.126 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.127 其他资产构成
序号 名称 金额(元)

Table with 2 columns: 序号, 名称 金额(元)

5.8.128 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.129 报告期末持有的未到期资产支持证券

5.8.130 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.131 其他资产构成
序号 名称 金额(元)

Table with 2 columns: 序号, 名称 金额(元)

5.8.132 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.133 报告期末持有的未到期资产支持证券

5.8.134 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.135 其他资产构成
序号 名称 金额(元)

Table with 2 columns: 序号, 名称 金额(元)

5.8.136 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.137 报告期末持有的未到期资产支持证券

5.8.138 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.139 其他资产构成
序号 名称 金额(元)

Table with 2 columns: 序号, 名称 金额(元)

5.8.140 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.141 报告期末持有的未到期资产支持证券

5.8.142 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.143 其他资产构成
序号 名称 金额(元)

Table with 2 columns: 序号, 名称 金额(元)

5.8.144 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.145 报告期末持有的未到期资产支持证券

5.8.146 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.147 其他资产构成
序号 名称 金额(元)

Table with 2 columns: 序号, 名称 金额(元)

5.8.148 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.149 报告期末持有的未到期资产支持证券

5.8.150 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.151 其他资产构成
序号 名称 金额(元)

Table with 2 columns: 序号, 名称 金额(元)

5.8.152 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.153 报告期末持有的未到期资产支持证券

5.8.154 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.155 其他资产构成
序号 名称 金额(元)