上证中央企业50交易型开放式指数证券投资基金

2012 半年度 报告摘要

2012年 6 月 30 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
送出日期：二〇一二年八月二十七日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2012 年 8 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计 。

本报告期自 2012 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	工银上证央企 ETF
基金主代码	510060
交易代码	510060
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2009年 8 月 26 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
报告期末基金份额总额	615,959,219.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2009年 10 月 27 日

2.2 基金产品说明

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相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金主要采取完全复制策略，跟踪标的指数的表现，即按照标的指数的成份股票的构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股票及其权重的变动进行相应调整。但在特殊情况下，本基金可以选择其它证券或证券组合对标的指数中的股票加以替换。
业绩比较基准	上证中央企业 50 指数收益率
风险收益特征	本基金属股票型基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制策略，跟踪上证中央企业 50 指数，是股票基金中风险中等、收益与市场平均水平大致相近的产品。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		工银瑞信基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱碧艳	张燕
	联系电话	400-811-9999	0755-83199084
	电子邮箱	customerservice@icbccs.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-811-9999	95555
传真		010-66583158	0755-83195201

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.icbccs.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2012 年 1 月 1 日 - 2012 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-19,253,370.58
本期利润	23,162,604.25
加权平均基金份额本期利润	0.0367
本期基金份额净值增长率	2.65%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	-0.4745
期末基金资产净值	670,720,877.80
期末基金份额净值	1.0889

注：1、所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、本期已实现收益是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、本基金基金合同生效日为 2009 年 8 月 26 日。

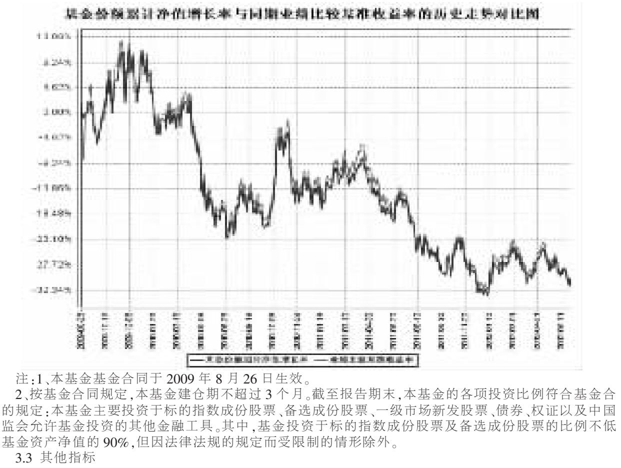
3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-4.14%	0.98%	-5.77%	1.01%	1.63%	-0.03%
过去三个月	-0.02%	0.96%	-2.18%	0.99%	2.16%	-0.03%
过去六个月	2.65%	1.10%	0.30%	1.14%	2.35%	-0.04%
过去一年	-17.30%	1.16%	-18.74%	1.20%	1.44%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-30.35%	1.33%	-30.85%	1.42%	0.50%	-0.09%

注：本基金基金合同生效日为 2009 年 8 月 26 日。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计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。

2、按基金合同规定，本基金建仓期不超过 3 个月。截至报告期末，本基金的各项投资比例符合基金合同的规定：本基金主要投资于标的指数成份股票、备选成份股票、一级市场新发股票、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，基金投资于标的指数成份股票及备选成份股票的比例不低于基金资产净值的 90%，但因法律法规的规定而受限制的情形除外。

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司，成立于 2005 年 6 月 21 日，是我国第一家由银行直接发起设立并控股的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币，注册地在北京。公司目前拥有共同基金募集和管理资格、境外证券投资管理业务资格、企业年金基金投资管理人资格、特定客户资产管理业务资格。2010 年 12 月，公司成为全国社保基金境内投资管理人。

截至 2012 年 6 月 30 日，公司旗下管理 24 只开放式基金——工银瑞信核心价值股票型基金、工银瑞信货币市场基金、工银瑞信精选平衡混合型基金、工银瑞信稳健成长股票型基金、工银瑞信增强收益债券型基金、工银瑞信红利股票型基金、工银瑞信中国机会全球配置股票型基金、工银瑞信信用添利债券型基金、工银瑞信大盘蓝筹股票型基金、工银瑞信沪深 300 指数基金、上证中央企业 50 交易型开放式指数基金、工银瑞信中小盘成长股票型基金、工银瑞信全球精选股票型基金、工银瑞信双利债券型基金、深证红利交易型开放式指数基金、工银瑞信深证红利 ETF 联接基金、工银瑞信四季收益债券基金、工银瑞信消费服务行业股票型基金、工银瑞信添颐债券型基金、工银瑞信主题策略股票型基金、工银瑞信保本混合型基金、工银瑞信睿智中证 500 指数分级基金、工银瑞信基本面量化策略股票型基金以及工银瑞信纯债定期开放债券型基金，证券投资基金管理规模达 679 亿元人民币。同时，公司还管理多个专户组合和企业年金组合，资产管理总规模逾 1100 亿元。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
何江	本基金的基金经理，工银沪深 300 基金的基金经理，工银深证红利 ETF 基金的基金经理，工银深证红利 ETF 联接基金的基金经理，工银中证 500 基金的基金经理。	2011年 5 月 25 日	-	7	先后在北京方速信融科技有限公司担任高级分析师，金诚信用评估有限公司担任分析师；2005年加入工银瑞信，曾任风险管理部投资风险管理业务主管，2011 年 5 月 25 日至今担任工银沪深 300 基金、工银上证央企 ETF 基金、工银深证红利 ETF 基金、工银深证红利 ETF 联接基金的基金经理；2012 年 1 月 31 日至今担任工银中证 500 基金的基金经理。
赵栩	本基金基金经理	2011年 10 月 18 日	-	4	2008年加入工银瑞信，曾任风险管理部金融工程分析师，2011 年 10 月 18 日至今担任工银上证央企 ETF 基金基金经理。

注：1、任职日期说明：

1)何江的任职日期为公司执委会决议日期。

2)赵栩的任职日期为公司执委会决议日期。

2、离任日期说明：无。

3、证券从业年限的计算标准：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4、本基金无基金经理助理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人认真遵循《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，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

4.3.1.1 公平交易原则

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，为公平对待不同基金份额持有人，公平对待基金持有人和其他资产委托人，在投资管理活动中公平对待公司所管理的不同基金财产和客户资产，不得直接或通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

4.3.1.2 适用范围

本制度适用于本公司所管理的不同投资组合，包括封闭式基金、开放式基金，以及社保组合、企业年金、特定客户资产管理组合等其他受托资产。基金经理，指管理公募基金基金经理，如封闭式基金、开放式基金。投资经理，指管理其他受托资产的投资经理，如企业年金、特定客户资产管理等专项受托资产。

4.3.1.3 公平交易的具体措施

4.3.1.3.1 在研究和投资决策环节：

4.3.1.3.1.1 在公司股票池的基础上，研究部根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等，参考公司《股票池管理办法》，建立股票池，各基金基金经理、其他受托资产投资经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合。

4.3.1.3.1.2 各基金基金经理、其他受托资产投资经理投资决策参照《投资授权管理办法》执行，在授权的范围内，独立、自主、审慎决策。

4.3.1.3.1.3 基金经理不得兼任投资经理，且各投资组合的基金经理、投资经理投资系统权限要严格分离。

4.3.1.3.1.4 对于涉及到关联交易的投资行为，参考公司《关联交易管理制度》执行。

4.3.1.3.2 在交易执行环节：

4.3.1.3.2.1 交易人员、投资交易系统权限的适当分离。在必要的情况下，对于社保基金或其他专项受托资产组合配备专门的交易员，未经授权，其他交易员不得参与社保基金或其他专项受托资产组合的日常交易，并进行交易系统权限的屏蔽。

4.3.1.3.2.2 公平交易执行原则：价格优先、时间优先、综合平衡、比例实施，保证交易在不同基金资产、不同受托资产间的公正，保证公司所管理的不同基金资产、受托资产间的利益公平。

4.3.1.3.2.3 公平交易执行方法：

4.3.1.3.2.3.1 交易员必须严格按照"价格优先、时间优先"的交易执行原则，及时、迅速、准确地执行。

4.3.1.3.2.3.2 在投资交易系统中设置"公平交易模块"，对于涉及到同一证券品种的交易执行，系统自动通过公平交易模块完成。

4.3.1.3.2.4 对于银行间市场交易、交易所大宗交易、债券一级市场申购等非集中竞价交易，涉及到两个或以上基金或投资组合参与同一证券交易的情况， 各基金/投资经理在交易前独立确定各投资组合的交易价格和数量，中央交易室按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。参照《集中交易管理办法》，银行间市场债券买卖和回购交易，由交易员填写《银行间市场交易审批单》，经相关基金经理/投资经理、交易主管审批，并由交易员双人复核后方可执行。公司对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控，保证分配结果符合公平交易的原则。交易所大宗交易，填写《大宗交易申请表》，经公司主管领导、法律合规部审批后执行。债券一级市场交易，填写《债券投标审批表》及《债券分销审批表》，经公司主管领导、法律合规部审批后执行。其他非集中竞价交易，参考上述审批流程执行。

4.3.1.3.2.5 对于非公开发行股票申购， 各基金/投资经理在申购前参照《投资流通受限证券工作流程》，独立确定申购价格和数量，中央交易室按照价格优先、比例分配的原则进行分配。

4.3.1.3.2.6 对于由于特殊原因不能参与公平交易程序的交易指令，中央交易室填写《公平交易审批单》，经公司主管领导、法律合规部及其公司主管领导审核批准后执行。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理应在交易前独立确定各投资组合的交易价格和数量，有关申购方案和分配方案应报公司主管领导、法律合规部，以保证分配结果符合公平交易的原则。

4.3.1.3.2.7 公平交易争议处理

在公平交易执行过程中若发生争议，或出现基金/投资经理对交易员执行公平交易结果不满情况，交易主管将具体情况报告公司主管领导，公司主管领导与相关基金/投资经理、交易主管就争议内容进行协调处理。

4.3.1.3.3 公平交易的检查和价格监控

4.3.1.3.3.1 法律合规部可通过投资交易系统对于公平交易的执行情况进行稽核，并定期向督察长报告。如发现有疑问的交易情况，就交易时间、交易价格、交易数量、交易理由等提出疑问，由基金/投资经理作出合理解释。

4.3.1.3.3.2 风险管理部根据市场公认的第三方信息，对于投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，如发现异常情况的，基金/投资经理应对交易价格的异常情况进行合理性解释。

4.3.1.3.3.3 法律合规部应对不同投资组合在交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差进行监控，同时对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，如发现异常应向基金/投资经理提出，相关基金/投资经理应对异常交易情况进行合理性解释。风险管理部和法律合规部应对其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，对于异常交易发生前后不同投资组合买卖该异常交易证券的情况进行分析。相关基金/投资经理应对异常交易情况进行合理性解释。

4.3.1.3.4 评估和分析

4.3.1.3.4.1 风险管理部应分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗下(如日内、3 日内、5 日内)公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。如果在上述分析期间内，公司管理的所有投资组合同向交易价差出现异常情况，应重新核查公司投资决策和交易执行环节的内部控制，针对潜在问题完善公平交易制度，进行专项说明，提交法律合规部，法律合规部应将此说明载入监察稽核季度报告和年度报告中对此做专项说明。

4.3.1.3.4.2 中央交易室负责在各投资组合的定期报告中披露公司整体公平交易制度执行情况。法律合规部负责在各投资组合的定期报告中对异常交易行为进行专项说明，其中，如果报告期内所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%， 应说明该类交易的次数及原因。各投资组合的年度报告中，除上述内容外，还应披露公平交易制度和控制方法，并在公司整体公平交易制度执行情况中，对当年度同向交易价差做专项分析。其中，中央交易室负责公平交易制度的披露，法律合规部负责公平交易控制方法的披露，风险管理部负责按本制度 4.3.1.3.4.1 条的规定对公平交易制度执行情况中当年度同向交易价差的专项分析。

4.3.1.4 报告

公司相关部门如果发现涉嫌违背公平交易原则的行为，应及时向公司管理层汇报并采取相关控制和改进措施。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

为了公平对待各类投资人，保护各类投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章，拟定了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》，对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定，并规定对买卖股票、债券时候的价格和市场价格差距较大，可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期，按照时间优先、价格优先的原则，本公司对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合，均采用了系统中的公平交易模块进行操作，实现了公平交易；且本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况有一次。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内，本基金跟踪标的指数的日均偏离度为 0.06%，偏离度年化标准差为 1.25%。本基金跟踪误差产生的主要来源是：1)标的指数成份股中法律法规禁止本基金投资的股票的影响；2)申购赎回的影响；3)成份股票的停牌；4)指数中成份股票的调整；等。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率为 2.65%，业绩比较基准增长率为 0.30%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金为指数型基金，基金管理人将继续按照基金合同的要求，坚持指数化投资策略，通过运用定量分析等技术，分析和应对导致基金跟踪误差的因素，继续努力将基金的跟踪误差控制在较低水平。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.6.1 参与估值流程各方及人员(或小组)的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

4.6.1.1 职责分工

(1)参与估值小组成员为 4 人，分别是公司运作部负责人、研究部负责人、风险管理部负责人、法律合规部负责人，组长由运作部负责人担任。

(2)各部门负责人也可推荐代表各部门参与估值小组的成员，如需更换，由相应部门负责人提出。小组成员需经运作部主管副总批准同意。

4.6.1.2 专业胜任能力及相关工作经历

小组由具有多年从事估值运作、证券行业研究、风险管理及熟悉业内法律法规的专家型人员组成。

4.6.2 基金经理参与或决定估值的程度

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

4.6.3 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.6.4 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

尚无已签约的任何定价服务。本基金所采用的估值流程及估值结果均已经过会计师事务所鉴证，并经托管银行复核确认。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内，本基金未满足基金合同中关于收益分配的条件，未实施利润分配。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 半年度财务会计报告 (未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：上证中央企业 50 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日： 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2012年 6 月 30 日	上年度末 2011年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款		4,062,570.54	4,260,566.53
结算备付金		603.28	3,094.86
存出保证金		-	-
交易性金融资产		662,855,028.12	721,021,624.98
其中：股票投资		662,855,028.12	721,021,624.98
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		815.87	924.98
应收股利		5,224,858.43	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		672,143,876.24	725,286,211.35
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012年 6 月 30 日	上年度末 2011年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		842,449.54	33,862.84
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		278,500.72	307,077.77
应付托管费		55,700.13	61,415.57
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		22,580.87	16,569.49
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		223,767.18	394,569.40
负债合计		1,422,998.44	813,495.07
所有者权益：			
实收基金		962,984,510.70	1,067,731,643.81
未分配利润		-292,263,632.90	-343,258,927.53
所有者权益合计		670,720,877.80	724,472,716.28
负债和所有者权益总计		672,143,876.24	725,286,211.35

注：1、报告截止日 2012 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0889 元，基金份额总额 615,959,219.00 份；股票投资项含可退替代款估值增值。

2、本基金基金合同生效日为 2009 年 08 月 26 日。

6.2 利润表

会计主体：上证中央企业 50 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2012年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
一、收入		25,643,245.01	4,264,923.74
1.利息收入		14,298.48	28,012.91
其中：存款利息收入		14,298.48	26,751.38
债券利息收入		-	1,261.53
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-16,795,983.15	-20,793,789.61
其中：股票投资收益		-29,322,905.94	-36,284,147.85
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	692,581.77
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		12,526,922.79	14,797,776.47
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		42,415,974.83	24,977,209.30
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		8,954.85	53,491.14
减：二、费用		2,480,640.76	3,729,635.10
1.管理人报酬		1,769,350.18	2,437,676.62
2.托管费		353,869.97	487,535.38
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		132,983.37	580,427.40
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		224,437.24	223,995.70
三、利润总额 (亏损总额以"-"号填列)		23,162,604.25	535,288.64
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		23,162,604.25	535,288.64

注：本基金基金合同生效日为 2009 年 08 月 26 日。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：上证中央企业 50 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2012年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,067,731,643.81	-343,258,927.53	724,472,716.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	23,162,604.25	23,162,604.25
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-104,747,133.11	27,832,690.38	-76,914,442.73
其中：1.基金申购款	159,465,784.45	-44,604,773.01	114,861,011.44
2.基金赎回款	-264,212,917.56	72,437,463.39	-191,775,454.17
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	962,984,510.70	-292,263,632.90	670,720,877.80
项目	上年度可比期间 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,267,845,569.52	-195,255,970.35	1,072,589,599.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	535,288.64	535,288.64
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-215,747,826.15	28,712,558.75	-187,035,267.40
其中：1.基金申购款	184,480,025.26	-22,462,135.44	162,017,889.82
2.基金赎回款	-400,227,851.41	51,174,694.19	-349,053,157.22
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,052,097,743.37	-166,008,122.96	886,089,620.41

注：本基金基金合同生效日为 2009 年 08 月 26 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

______ 郭特华 ______ ______ 夏洪彬 ______ ____ 朱辉毅 ____
基金管理公司负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

工银瑞信上证中央企业 50 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称"本基金")，系经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监基金字[2009]577 号文《关于同意工银瑞信上证中央企业 50 交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》批准，由工银瑞信基金管理有限公司作为发起人于 2009 年 7 月 20 日至 2009 年 8 月 20 日向社会公开募集， 募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2009)验字第 60438506_A02 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2009 年 8 月 26 日生效，本次募集的募集金额总额为人民币 4,533,767,374.00 元(含募集股票)，其中有效认购款项在基金验资确认日之前产生的利息共计人民币 87,780.00 元。按照每份基金份额 1.00 元人民币计算，设立募集期间募集的有效份额为 4,533,679,594.00 份基金份额；利息结转的基金份额为 87,780.00 份基金份额，两项合计共 4,533,767,374.00 份基金份额。本基金为交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司， 注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司上海分公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金股票资产跟踪的标的指数为上证中央企业 50 指数。本基金主要投资于标的指数成份股票、备选成份股票、一级市场新发股票、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，基金投资于标的指数成份股票及备选成份股票的比例不低于基金资产净值的 90%，但因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金的业绩比较基准为：上证中央企业 50 指数。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(统称"企业会计准则")、中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定而编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2012 年 06 月 30 日的财务状况以及 2012 年上半年度经营成果和净值变动情况。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无差错更正事项。

6.4.6 税项

1.印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券(股票)交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2.营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3.个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自 2005 年 6 月 13 日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税[2005]102 号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按 50%计算应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期与本基金存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
工银瑞信基金管理有限公司	基金管理人
招商银行股份有限公司	基金托管人

注：1、本报告期本基金关联方未发生变化。

2、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期末及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,769,350.18	2,437,676.62
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：1、基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.50%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.50%/当年天数

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

2、基金管理费每日计提，按月支付。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	353,869.97	487,535.38

注：1、基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.10%/当年天数

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

2、基金托管费每日计提，按月支付。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人在本报告期内与上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末与上年度末均未投资本基金。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	4,062,570.54	13,725.15	13,128,267.41	25,552.03

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末(2012 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场正回购余额，因此没有作为抵押的债券。-

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场正回购余额，因此没有作为抵押的债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	662,855,028.12	98.62
	其中：股票	662,855,028.12	98.62
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	4,063,173.82	0.60
6	其他各项资产	5,225,674.30	0.78
7	合计	672,143,876.24	100.00

注：1、由于四舍五入的原因公允价值占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差；

2、股票投资项含可退替代款估值增值。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	92,510,302.66	13.79
C	制造业	70,821,735.59	10.56
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	24,826,540.03	3.70
C7	机械、设备、仪表	45,995,195.56	6.86
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	26,663,779.40	3.98
E	建筑业	54,628,406.46	8.14
F	交通运输、仓储业	19,358,413.78	2.89
G	信息技术业	29,872,122.24	4.45
H	批发和零售贸易	4,638,164.30	0.69
I	金融、保险业	335,077,620.69	49.96
J	房地产业	23,823,604.98	3.55
K	社会服务业	5,460,878.02	0.81
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	662,855,028.12	98.83

注：1、合计项不含可退替代款估值增值；

2、由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

7.2.2 积极投资按行业分类的股票投资组合

无。

7.3 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

7.3.1 期末指数投资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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601328	交通银行	13,798,515	62,645,258.10	9.34
2	600030	中信证券	3,361,454	42,455,164.02	6.33
3	601288	农业银行	16,040,600	41,545,154.00	6.19
4	601088	中国神华	1,609,945	36,191,563.60	5.40
5	601601	中国太保	1,536,421	34,077,817.78	5.08
6	601939	建设银行	7,972,722	33,485,432.40	4.99
7	601818	光大银行	11,303,466	32,101,843.44	4.79
8	601988	中国银行	9,908,892	27,943,075.44	4.17
9	601668	中国建筑	7,332,400	24,490,216.00	3.65
10	601998	中信银行	5,982,978	23,931,912.00	3.57

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于公司网站的半年度报告正文。

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

无。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601818	光大银行	14,718,346.00	2.03
2	601288	农业银行	9,873,705.11	1.36
3	601669	中国水电	4,947,519.00	0.68
4	601117	中国化学	2,939,195.00	0.41
5	600271	航天信息	2,906,507.19	0.40
6	601336	新华保险	1,558,755.70	0.22
7	601299	中国北车	1,485,152.50	0.20
8	600030	中信证券	872,991.00	0.12
9	601088	中国神华	760,770.00	0.11
10	601601	中国太保	615,480.00	0.08
11	600028	中国石化	597,456.00	0.08
12	600048	保利地产	582,957.73	0.08
13	601668	中国建筑	506,260.00	0.07
14	600489	中金黄金	360,179.80	0.05
15	600900	长江电力	356,224.00	0.05
16	601857	中国石油	340,218.00	0.05
17	600050	中国联通	321,892.06	0.04
18	600999	招商证券	314,685.00	0.04
19	601628	中国人寿	312,330.00	0.04
20	601989	中国重工	290,841.00	0.04

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票；

2、买入金额按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601998	中信银行	4,693,792.37	0.65
2	601988	中国银行	3,665,399.45	0.51
3	601179	中国西电	3,282,003.63	0.45
4	601866	中海集运	3,047,861.64	0.42
5	600508	上海能源	2,682,648.42	0.37
6	601939	建设银行	2,347,733.74	0.32
7	601857	中国石油	1,857,777.64	0.26
8	600030	中信证券	1,833,909.76	0.25
9	601088	中国神华	1,761,165.44	0.24
10	601601	中国太保	1,284,294.00	0.18
11	601766	中国南车	966,036.80	0.13
12	601328	交通银行	931,995.00	0.13
13	601668	中国建筑	746,198.00	0.10
14	600050	中国联通	744,366.00	0.10
15	600048	保利地产	681,241.06	0.09
16	600875	东方电气	526,640.00	0.07
17	600068	葛洲坝	522,730.07	0.07
18	601898	中煤能源	518,334.05	0.07
19	601788	光大证券	452,339.65	0.06
20	600900	长江电力	447,341.53	0.06

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、卖出金额按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本(成交)总额	45,635,412.17
卖出股票收入(成交)总额	39,778,432.92

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。.

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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

本基金本报告期末未持有权证。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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、处罚的情形。

7.9.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	5,224,858.43
4	应收利息	815.87
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,225,674.30

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.9.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

7.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前五名股票中未存在流通受限情况。

7.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
17,919	34,374.64	125,968,771.00	20.45%	489,990,448.00	79.55%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	国泰君安-招行-国泰君安上证央企指数增强集合资产管理计划	66,721,617.00	10.83%
2	中国石化财务有限责任公司	25,588,685.00	4.15%
3	王红	12,580,000.00	2.04%
4	东海证券-兴业银行-东风 2 号集合资产管理计划	8,288,800.00	1.35%
5	中国太平洋人寿保险股份有限公司-分红-个人分红	5,000,000.00	0.81%
6	武丽芳	3,807,139.00	0.62%
7	大连保税区龙飞国际工贸有限公司	3,198,201.00	0.52%
8	施再麟	2,977,792.00	0.48%
9	晏淑敏	2,558,561.00	0.42%
10	林翠玲	2,445,889.00	0.40%

注：以上数据由中国证券登记结算有限公司提供，持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

本基金管理人的从业人员本报告期末未持有本开放式基金。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2009 年 8 月 26 日)基金份额总额	4,533,767,374.00
本报告期期初基金份额总额	682,959,219.00
本报告期基金总申购份额	102,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	169,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	615,959,219.00

注：本基金已于 2009 年 9 月 28 日进行了基金份额折算，折算比例为 0.63964039。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人：
本报告期，基金管理人未发生重大人事变动。
2、基金托管人托管部门：
本报告期，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期没有改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
民族证券	1	54,776,683.68	65.23%	46,560.13	64.69%	-
西南证券	1	25,578,112.03	30.46%	22,329.68	31.03%	-
广发证券	1	3,255,999.88	3.88%	2,773.06	3.85%	-
国信证券	1	317,897.00	0.38%	270.21	0.38%	-
招商证券	1	45,760.00	0.05%	38.89	0.05%	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-

注：1.券商的选择标准和程序

(1)选择标准：注重综合服务能力

a)券商财务状况良好、经营行为规范、风险管理先进、投资风格与工银瑞信有互补性、在最近一年内无重大违规行为。

b)券商具有较强的综合研究能力：能及时、全面、定期提供高质量的关于宏观、行业、资本市场、个股分析的报告及其他丰富全面的信息咨询服务；有很强的分析能力，能根据工银瑞信所管理基金的特定要求，提供专门研究报告；具有开发量化投资组合模型的能力以及其他综合服务能力。

c)与其他券商相比，该券商能够提供最佳交易执行和优惠合理的佣金率。

(2)选择程序

a)确定券商数量：根据以上标准对不同券商进行考察、选择和确定。投资研究部门(权益投资部，固定收益部，专户投资部，研究部和中央交易室)根据公司基金规模和服务需求等因素确定对合作券商的数量，每年根据公司经营规模变化及券商评估结果决定是否需要新增或调整合作券商，选定的名单需经主管投资副总和总经理审批同意。

b)签订委托协议：与被选择的券商签订委托代理协议，明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等，经签章有效。委托代理协议一式五份，协议双方及证券主管机关各留存一份，工银瑞信法律合规部留存备案，并报相关证券主管机关留存报备。

2.券商的评估，保留和更换程序

(1)席位的租用期限暂定为一年，合同到期 15 天内，投资研究部门将根据各券商研究在服务期间的综合证券服务质量等情况，进行评估。

(2)对于符合标准的券商，工银瑞信将与其续约；对于不能达到标准的券商，不与其续约，并根据券商选择标准和程序，重新选择其它经营稳健、研究能力强、综合服务质量高的证券经营机构，租用其交易席位。

(3)若券商提供的综合证券服务不符合要求，工银瑞信有权按照委托协议规定，提前中止租用其交易席位。

证券公司席位的变更情况

在报告期内本基金新增西南证券股份有限公司的 26436 上海交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。