

上证中央企业50交易型开放式指数证券投资基金

2018年半年度报告摘要

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:二〇一八年八月二十四日

1 重要提示
基金管理人、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2018年8月22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。
本报告自2018年10月1日起至06月30日止。

2 基金基本情况

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	央企50ETF
基金代码	510009
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2009年07月03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
境外托管人	招商银行股份有限公司
境外托管人基金托管人	招商银行股份有限公司
基金合同终止日	无约定
基金上市交易所	上海证券交易所
上市日期	2009年07月03日

2.1 基金产品说明

本基金为被动型指数基金,追求跟踪标的指数表现,追求跟踪标的指数的收益率,力争实现基金净值增长率与业绩比较基准收益率接近。
本基金为被动型指数基金,追求跟踪标的指数表现,追求跟踪标的指数的收益率,力争实现基金净值增长率与业绩比较基准收益率接近。

2.2 基金信息披露

本基金半年度报告正文的披露网站: www.icbchina.com.cn
基金半年度报告正文的披露网站: www.icbchina.com.cn

2.3 基金管理人及基金托管人

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
法定代表人	陈奕	缪建民
总经理	陈奕	缪建民
基金管理人地址	北京市西城区金融大街6号路业大厦12层	深圳市福田区深南大道1282号
基金托管人地址	深圳市福田区深南大道1282号	深圳市福田区深南大道1282号

2.4 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:上证中央企业50指数收益率×90%+银行活期存款利率×10%。

2.5 基金投资策略

本基金为被动型指数基金,追求跟踪标的指数表现,追求跟踪标的指数的收益率,力争实现基金净值增长率与业绩比较基准收益率接近。

2.6 基金费用

本基金的管理费、托管费、销售服务费、申购费、赎回费、基金转换费等费用,按照基金合同、招募说明书及相关法律法规的规定执行。

2.7 基金风险

本基金为被动型指数基金,追求跟踪标的指数表现,追求跟踪标的指数的收益率,力争实现基金净值增长率与业绩比较基准收益率接近。

2.8 基金其他重要信息

本基金的其他重要信息,请投资者仔细阅读基金合同、招募说明书及相关法律法规。

3 主要会计数据和财务指标

3.1 主要会计数据和财务指标

项目	金额单位:人民币元
本期基金份额净值增长率	10.37%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

项目	金额单位:人民币元
本期基金份额净值增长率	10.37%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%

3.2.2 基金净值表现

3.2.2.1 基金净值表现

项目	金额单位:人民币元
本期基金份额净值增长率	10.37%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%

3.2.2.2 基金净值表现

3.2.2.2.1 基金净值表现

项目	金额单位:人民币元
本期基金份额净值增长率	10.37%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%

3.2.2.2.2 基金净值表现

3.2.2.2.2.1 基金净值表现

项目	金额单位:人民币元
本期基金份额净值增长率	10.37%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%

3.2.2.2.2.2 基金净值表现

3.2.2.2.2.2.1 基金净值表现

项目	金额单位:人民币元
本期基金份额净值增长率	10.37%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%

3.2.2.2.2.2.2 基金净值表现

3.2.2.2.2.2.2.1 基金净值表现

项目	金额单位:人民币元
本期基金份额净值增长率	10.37%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%

3.2.2.2.2.2.2.2 基金净值表现

3.2.2.2.2.2.2.2.1 基金净值表现

项目	金额单位:人民币元
本期基金份额净值增长率	10.37%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%

3.2.2.2.2.2.2.2.2 基金净值表现

3.2.2.2.2.2.2.2.2.1 基金净值表现

项目	金额单位:人民币元
本期基金份额净值增长率	10.37%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%

3.2.2.2.2.2.2.2.2.2 基金净值表现

3.2.2.2.2.2.2.2.2.2.1 基金净值表现

项目	金额单位:人民币元
本期基金份额净值增长率	10.37%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%

3.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2 基金净值表现

3.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.1 基金净值表现

项目	金额单位:人民币元
本期基金份额净值增长率	10.37%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%

3.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2 基金净值表现

3.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.1 基金净值表现

项目	金额单位:人民币元
本期基金份额净值增长率	10.37%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%

3.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2 基金净值表现

3.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.1 基金净值表现

项目	金额单位:人民币元
本期基金份额净值增长率	10.37%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%

3.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2 基金净值表现

3.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.1 基金净值表现

项目	金额单位:人民币元
本期基金份额净值增长率	10.37%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%

3.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2 基金净值表现

3.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.1 基金净值表现

项目	金额单位:人民币元
本期基金份额净值增长率	10.37%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%

3.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2 基金净值表现

3.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.1 基金净值表现

项目	金额单位:人民币元
本期基金份额净值增长率	10.37%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%

3.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2 基金净值表现

3.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.1 基金净值表现

项目	金额单位:人民币元
本期基金份额净值增长率	10.37%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%

3.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2 基金净值表现

3.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.1 基金净值表现

项目	金额单位:人民币元
本期基金份额净值增长率	10.37%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%

3.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2 基金净值表现

3.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.1 基金净值表现

项目	金额单位:人民币元
本期基金份额净值增长率	10.37%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%

3.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2 基金净值表现

3.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.1 基金净值表现

项目	金额单位:人民币元
本期基金份额净值增长率	10.37%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

项目	金额单位:人民币元
本期基金份额净值增长率	10.37%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

项目	金额单位:人民币元
本期基金份额净值增长率	10.37%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

项目	金额单位:人民币元
本期基金份额净值增长率	10.37%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

项目	金额单位:人民币元
本期基金份额净值增长率	10.37%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

项目	金额单位:人民币元
本期基金份额净值增长率	10.37%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

项目	金额单位:人民币元
本期基金份额净值增长率	10.37%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

项目	金额单位:人民币元
本期基金份额净值增长率	10.37%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

项目	金额单位:人民币元
本期基金份额净值增长率	10.37%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

项目	金额单位:人民币元
本期基金份额净值增长率	10.37%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

项目	金额单位:人民币元
本期基金份额净值增长率	10.37%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

项目	金额单位:人民币元
本期基金份额净值增长率	10.37%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

项目	金额单位:人民币元
本期基金份额净值增长率	10.37%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	-0.26%

各部门负责人也可推荐本部门参与估值小组的成员,如需要,由相应部门负责人提出,小组成员经运作部主管副总批准同意。

4.6.1.2 专业性胜任能力及相关工作经历
小组由具有多年从事估值工作、证券行业研究、风险管理及熟悉业内法律法规的专家人员组成。

4.6.2 基金估值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
尚未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审定,并经托管银行复核确认。

4.7 管理人对外报告期内估值变动情况的说明
本报告期内,本基金未实施利润分配,符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人人数或基金资产净值预警情形的说明
本基金在报告期内没有触及2014年8月8日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定的条件。

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
本基金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、基金费用开支等方面上,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》等相关法律法规,在重要方面的运作严格按照基金合同的有关规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告财务信息真实、准确和完整发表意见
本半年度报告中财务报告、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
报告截止日:2018年6月30日

资产	期初	期末
货币资金	1,000,000.00	1,000,000.00
结算备付金	1,000,000.00	1,000,000.00
应收利息	1,000,000.00	1,000,000.00
应收股利	1,000,000.00	1,000,000.00
买入返售金融资产	1,000,000.00	1,000,000.00
其他应收款	1,000,000.00	1,000,000.00
其他流动资产	1,000,000.00	1,000,000.00
流动资产合计	1,000,000.00	1,000,000.00
非流动资产	1,000,000.00	1,000,000.00
可供出售金融资产	1,000,000.00	1,000,000.00
持有至到期投资	1,000,000.00	1,000,000.00
长期股权投资	1,000,000.00	1,000,000.00
投资性房地产	1,000,000.00	1