

中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

2018年半年度报告摘要
2018年6月30日
基金管理人:中金基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

1.1 重要提示
基金管理人承诺:遵守法律法规,恪守基金管理人职责,诚实守信,勤勉尽责,严格按照法律法规和行业自律规范运作,审慎开展基金投资业务,构建科学、规范、完善的内部控制体系,有效防范、化解基金运作过程中的各类风险,确保基金资产的安全与完整,切实维护基金份额持有人的合法权益。

2.1 基金基本情况
基金名称:中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金
基金代码:000316
基金管理人:中金基金管理有限公司

2.2 基金产品说明
基金运作方式:契约型、开放式
基金存续期限:不定期
基金资产配置:本基金为股票型基金,股票资产占基金资产的 90%-95%

2.3 基金管理人、基金托管人
基金管理人:中金基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

2.4 信息披露方式
基金管理人网站:www.ciccfund.com
基金托管人网站:www.icbc.com.cn

3.1 主要会计数据和财务指标
项目 2018年1-6月 2018年1-6月 2017年1-6月
总资产 1,002,994.99
净资产 1,002,994.99

3.2 基金业绩比较基准
业绩比较基准:中证 500 指数收益率 x 1.05% + 银行活期存款利率 x 0.95%
业绩比较基准:中证 500 指数收益率 x 1.05% + 银行活期存款利率 x 0.95%

3.3 基金费用
基金管理费:按前一日基金资产净值 0.70% 的年费率计提
基金托管费:按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提

3.4 基金投资组合
股票投资: 90.52%
债券投资: 9.48%

3.5 基金业绩
基金净值增长率: 12.90%
业绩比较基准收益率: 12.90%

3.6 基金持有人户数
基金持有人户数: 1,000 户

3.7 基金持有人结构
机构投资者: 99.99%
个人投资者: 0.01%

3.8 基金持有人集中度
前十名持有人持有基金份额: 0.00%

3.9 基金持有人集中度
前十名持有人持有基金份额: 0.00%

3.10 基金持有人集中度
前十名持有人持有基金份额: 0.00%

3.11 基金持有人集中度
前十名持有人持有基金份额: 0.00%

3.12 基金持有人集中度
前十名持有人持有基金份额: 0.00%

3.13 基金持有人集中度
前十名持有人持有基金份额: 0.00%

3.14 基金持有人集中度
前十名持有人持有基金份额: 0.00%

3.15 基金持有人集中度
前十名持有人持有基金份额: 0.00%

3.16 基金持有人集中度
前十名持有人持有基金份额: 0.00%

3.17 基金持有人集中度
前十名持有人持有基金份额: 0.00%

3.18 基金持有人集中度
前十名持有人持有基金份额: 0.00%

3.19 基金持有人集中度
前十名持有人持有基金份额: 0.00%

3.20 基金持有人集中度
前十名持有人持有基金份额: 0.00%

6.1 资产负债表
单位:人民币元
项目 2018年6月30日 2017年12月31日
资产 1,002,994.99 1,002,994.99

6.2 利润表
单位:人民币元
项目 2018年1-6月 2017年1-6月
营业收入 1,002,994.99 1,002,994.99

6.3 现金流量表
单位:人民币元
项目 2018年1-6月 2017年1-6月
经营活动产生的现金流量净额 1,002,994.99 1,002,994.99

6.4 所有者权益变动表
单位:人民币元
项目 2018年1-6月 2017年1-6月
所有者权益 1,002,994.99 1,002,994.99

6.5 投资组合
股票投资: 90.52%
债券投资: 9.48%

6.6 基金业绩
基金净值增长率: 12.90%
业绩比较基准收益率: 12.90%

6.7 基金持有人户数
基金持有人户数: 1,000 户

6.8 基金持有人结构
机构投资者: 99.99%
个人投资者: 0.01%

6.9 基金持有人集中度
前十名持有人持有基金份额: 0.00%

6.10 基金持有人集中度
前十名持有人持有基金份额: 0.00%

6.11 基金持有人集中度
前十名持有人持有基金份额: 0.00%

6.12 基金持有人集中度
前十名持有人持有基金份额: 0.00%

6.13 基金持有人集中度
前十名持有人持有基金份额: 0.00%

6.14 基金持有人集中度
前十名持有人持有基金份额: 0.00%

6.15 基金持有人集中度
前十名持有人持有基金份额: 0.00%

6.16 基金持有人集中度
前十名持有人持有基金份额: 0.00%

6.17 基金持有人集中度
前十名持有人持有基金份额: 0.00%

6.18 基金持有人集中度
前十名持有人持有基金份额: 0.00%

6.19 基金持有人集中度
前十名持有人持有基金份额: 0.00%

6.20 基金持有人集中度
前十名持有人持有基金份额: 0.00%

6.21 基金持有人集中度
前十名持有人持有基金份额: 0.00%

6.22 基金持有人集中度
前十名持有人持有基金份额: 0.00%

6.23 基金持有人集中度
前十名持有人持有基金份额: 0.00%

6.24 基金持有人集中度
前十名持有人持有基金份额: 0.00%

6.25 基金持有人集中度
前十名持有人持有基金份额: 0.00%

6.26 基金持有人集中度
前十名持有人持有基金份额: 0.00%

6.27 基金持有人集中度
前十名持有人持有基金份额: 0.00%

6.4.1.1 关联交易
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.1.2 关联交易
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.1.3 关联交易
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.1.4 关联交易
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.1.5 关联交易
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.1.6 关联交易
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.1.7 关联交易
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.1.8 关联交易
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.1.9 关联交易
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.1.10 关联交易
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.1.11 关联交易
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.1.12 关联交易
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.1.13 关联交易
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.1.14 关联交易
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.1.15 关联交易
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.1.16 关联交易
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.1.17 关联交易
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.1.18 关联交易
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.1.19 关联交易
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.1.20 关联交易
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.1.21 关联交易
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.1.22 关联交易
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.1.23 关联交易
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.1.24 关联交易
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.1.25 关联交易
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.1.26 关联交易
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.1.27 关联交易
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.8.3 期末债券正回购及其中作为抵押的债券
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.8.3.1 期末债券正回购
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.8.3.2 期末债券正回购
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.8.3.3 期末债券正回购
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.8.3.4 期末债券正回购
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.8.3.5 期末债券正回购
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.8.3.6 期末债券正回购
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.8.3.7 期末债券正回购
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.8.3.8 期末债券正回购
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.8.3.9 期末债券正回购
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.8.3.10 期末债券正回购
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.8.3.11 期末债券正回购
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.8.3.12 期末债券正回购
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.8.3.13 期末债券正回购
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.8.3.14 期末债券正回购
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.8.3.15 期末债券正回购
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.8.3.16 期末债券正回购
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.8.3.17 期末债券正回购
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.8.3.18 期末债券正回购
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.8.3.19 期末债券正回购
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.8.3.20 期末债券正回购
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.8.3.21 期末债券正回购
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.8.3.22 期末债券正回购
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.8.3.23 期末债券正回购
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.8.3.24 期末债券正回购
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.8.3.25 期末债券正回购
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

6.4.8.3.26 期末债券正回购
基金管理人、基金托管人及其关联方未参与本基金的投资决策。

7.1 期末基金资产组合情况
单位:人民币元
项目 金额 占基金资产净值比例(%)

7.1.1 权益类资产
股票 21,066,244.92 92.84%

7.1.2 固定收益类资产
债券 1,000,750.00 3.08%

7.1.3 货币类资产
银行存款 70,000.00 0.28%

7.1.4 其他资产
应收利息 21,066,244.92 92.84%

7.1.5 其他资产
其他 1,000,750.00 3.08%

7.1.6 其他资产
其他 70,000.00 0.28%

7.1.7 其他资产
其他 21,066,244.92 92.84%

7.1.8 其他资产
其他 1,000,750.00 3.08%

7.1.9 其他资产
其他 70,000.00 0.28%

7.1.10 其他资产
其他 21,066,244.92 92.84%

7.1.11 其他资产
其他 1,000,750.00 3.08%

7.1.12 其他资产
其他 70,000.00 0.28%

7.1.13 其他资产
其他 21,066,244.92 92.84%

7.1.14 其他资产
其他 1,000,750.00 3.08%

7.1.15 其他资产
其他 70,000.00 0.28%

7.1.16 其他资产
其他 21,066,244.92 92.84%

7.1.17 其他资产
其他 1,000,750.00 3.08%

7.1.18 其他资产
其他 70,000.00 0.28%

7.1.19 其他资产
其他 21,066,244.92 92.84%

7.1.20 其他资产
其他 1,000,750.00 3.08%

7.1.21 其他资产
其他 70,000.00 0.28%

7.1.22 其他资产
其他 21,066,244.92 92.84%

7.1.23 其他资产
其他 1,000,750.00 3.08%

7.1.24 其他资产
其他 70,000.00 0.28%

7.1.25 其他资产
其他 21,066,244.92 92.84%

7.1.26 其他资产
其他 1,000,750.00 3.08%