

建信中证500指数增强型证券投资基金

基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告日期:2014年8月25日

1.1 重要提示

基金管理人、基金托管人、基金销售机构均不存在虚假记载、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。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。基金托管人中信银行股份有限公司已于2014年8月21日复核了本报告内容,保证本报告内容真实、准确、完整,不存在虚假记载、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或保证最低收益。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。本半年度报告披露摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告全文。本半年度报告财务数据截止至2014年6月30日。本报告自2014年8月27日起生效。

1.2 基金简介

基金基本情况	
基金代码	建信中证500指数增强
基金代码	000478
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年11月27日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
期末基金份额总额	148,587,015.67
基金合同存续期	不定期
2.2 基金产品说明	
投资目标	本基金为股票指数增强型基金,在对标的指数进行有效跟踪的基础上,结合增强型的主观投资,力争获取高于标的指数的投资收益。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略,以中证500指数作为基金投资组合的跟踪标的,结合行业配置、基本面研究及量化模型等多种手段,在跟踪标的指数的基础上,通过行业配置、个股选择、资产配置和基金资产的长期增值。
业绩比较基准	95%×中证500指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金、另类投资型基金、股票型基金等证券投资基金。

2.3 基金管理人及基金托管人

基金管理人		基金托管人	
名称	建信基金管理有限责任公司	名称	中信银行股份有限公司
法定代表人	王卫	法定代表人	李庆萍
总经理	王卫	行长	李庆萍
注册地址	北京市西城区金融大街7号	注册地址	北京市东城区朝阳门内大街136号
办公地址	北京市西城区金融大街7号	办公地址	北京市东城区朝阳门内大街136号
客服电话	400-81-95531	客服电话	95558
网址	www.ccbfund.com	网址	www.citicbank.com

2.4 信息披露方式

基金半年度报告正文的备查地点:基金管理人及基金托管人住所。
基金半年度报告备查地点:基金管理人及基金托管人住所。

3.1 主要会计数据和财务指标

3.1.1 期间数据和指标		报告期(2014年1月27日至2014年6月30日)
本期已实现收益		2,372,171.71
本期利润		4,043,951.57
加权平均基金份额本期利润		0.0178
本期基金份额净值增长率		1.67%
3.1.2 期末数据和指标		报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润		0.0093
期末基金份额净值		151,063,907.86
期末基金份额总额		1,016.7

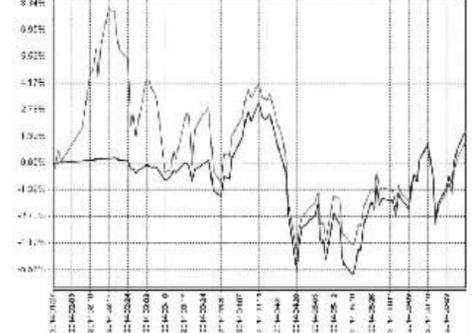
注:1.本基金基金合同自2014年1月27日起生效,至2014年6月30日未满六个月。
2.本期:指报告期自2014年1月27日起至2014年6月30日止,其他期间指除本报告期间之外所有期间。
3.期末可供分配利润以本基金当期实现的基金净收益为基础,扣除相关费用后的金额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
4.期末可供分配利润的计算方法:如果期末未分配利润的未实现部分为正数,则期末可供分配利润的金额等于未分配利润的未实现部分加上期末未分配利润的未实现部分为负数,期末可供分配利润的金额等于未分配利润(已实现部分)减去未实现部分。
5.上述基金净值指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
6.基金份额净值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。

3.2 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②	业绩比较基准收益率①	②-①
过去一个月	3.62%	0.99%	2.38%
过去三个月	3.48%	1.07%	2.11%
自基金合同生效以来	1.67%	0.85%	1.08%

注:本基金业绩比较基准为95%×中证500指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)。中证500指数由中证指数有限公司编制,旨在反映沪深两市中小市值公司的整体状况,中证500指数由中证指数有限公司编制,旨在反映沪深两市中小市值公司的整体状况。

3.3 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金基金合同于2014年11月27日生效,截止报告期末仍处于建仓期。

4.1 基金管理人及基金托管人

基金管理人:建信基金管理有限责任公司。基金托管人:中信银行股份有限公司。基金管理人及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。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。基金托管人中信银行股份有限公司已于2014年8月21日复核了本报告内容,保证本报告内容真实、准确、完整,不存在虚假记载、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或保证最低收益。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。本半年度报告披露摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告全文。本半年度报告财务数据截止至2014年6月30日。本报告自2014年8月27日起生效。

4.2 基金管理人及基金托管人

基金管理人:建信基金管理有限责任公司。基金托管人:中信银行股份有限公司。基金管理人及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。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。基金托管人中信银行股份有限公司已于2014年8月21日复核了本报告内容,保证本报告内容真实、准确、完整,不存在虚假记载、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或保证最低收益。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。本半年度报告披露摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告全文。本半年度报告财务数据截止至2014年6月30日。本报告自2014年8月27日起生效。

4.3 基金管理人及基金托管人

基金管理人:建信基金管理有限责任公司。基金托管人:中信银行股份有限公司。基金管理人及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。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。基金托管人中信银行股份有限公司已于2014年8月21日复核了本报告内容,保证本报告内容真实、准确、完整,不存在虚假记载、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或保证最低收益。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。本半年度报告披露摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告全文。本半年度报告财务数据截止至2014年6月30日。本报告自2014年8月27日起生效。

4.4 基金管理人及基金托管人

基金管理人:建信基金管理有限责任公司。基金托管人:中信银行股份有限公司。基金管理人及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。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。基金托管人中信银行股份有限公司已于2014年8月21日复核了本报告内容,保证本报告内容真实、准确、完整,不存在虚假记载、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或保证最低收益。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。本半年度报告披露摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告全文。本半年度报告财务数据截止至2014年6月30日。本报告自2014年8月27日起生效。

4.5 基金管理人及基金托管人

基金管理人:建信基金管理有限责任公司。基金托管人:中信银行股份有限公司。基金管理人及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。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。基金托管人中信银行股份有限公司已于2014年8月21日复核了本报告内容,保证本报告内容真实、准确、完整,不存在虚假记载、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或保证最低收益。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。本半年度报告披露摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告全文。本半年度报告财务数据截止至2014年6月30日。本报告自2014年8月27日起生效。

4.6 基金管理人及基金托管人

基金管理人:建信基金管理有限责任公司。基金托管人:中信银行股份有限公司。基金管理人及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。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。基金托管人中信银行股份有限公司已于2014年8月21日复核了本报告内容,保证本报告内容真实、准确、完整,不存在虚假记载、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或保证最低收益。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。本半年度报告披露摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告全文。本半年度报告财务数据截止至2014年6月30日。本报告自2014年8月27日起生效。

4.7 基金管理人及基金托管人

基金管理人:建信基金管理有限责任公司。基金托管人:中信银行股份有限公司。基金管理人及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。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。基金托管人中信银行股份有限公司已于2014年8月21日复核了本报告内容,保证本报告内容真实、准确、完整,不存在虚假记载、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或保证最低收益。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。本半年度报告披露摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告全文。本半年度报告财务数据截止至2014年6月30日。本报告自2014年8月27日起生效。

4.8 基金管理人及基金托管人

基金管理人:建信基金管理有限责任公司。基金托管人:中信银行股份有限公司。基金管理人及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。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。基金托管人中信银行股份有限公司已于2014年8月21日复核了本报告内容,保证本报告内容真实、准确、完整,不存在虚假记载、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或保证最低收益。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。本半年度报告披露摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告全文。本半年度报告财务数据截止至2014年6月30日。本报告自2014年8月27日起生效。

2014年半年度报告摘要

2014年6月30日

资产

项目	期末余额
货币资金	7,891,890.38
银行存款	3,589,033.43
存放同业款项	152,280.20
买入返售金融资产	143,008,851.42
其中:股票质押式回购	143,008,851.42
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
期货投资	-
买入返售金融资产	-
应收利息	2,006.96
应收股利	-
其他应收款	1,773.41
其他资产	-
资产总计	152,907,460.71

负债

项目	期末余额
短期借款	-
交易性金融负债	-
应付账款	-
应付利息	116.85
应付股利	1,018,992.13
应付债券	125,428.74
其他应付款	25,085.72
其他负债	-
负债合计	465,292.57

所有者权益

项目	期末余额
实收资本	1,016.70
资本公积	151,063,907.86
未分配利润	152,907,460.71
所有者权益合计	152,907,460.71

6.1 主要财务指标

1. 本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
2. 本基金业绩比较基准为95%×中证500指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)。
3. 期末可供分配利润以本基金当期实现的基金净收益为基础,扣除相关费用后的金额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
4. 期末可供分配利润的计算方法:如果期末未分配利润的未实现部分为正数,则期末可供分配利润的金额等于未分配利润的未实现部分加上期末未分配利润的未实现部分为负数,期末可供分配利润的金额等于未分配利润(已实现部分)减去未实现部分。
5. 上述基金净值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。
6. 基金份额净值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。

6.2 投资组合

1. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
2. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
3. 报告期末本基金投资组合资产配置情况

6.3 投资组合

1. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
2. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
3. 报告期末本基金投资组合资产配置情况

6.4 投资组合

1. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
2. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
3. 报告期末本基金投资组合资产配置情况

6.5 投资组合

1. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
2. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
3. 报告期末本基金投资组合资产配置情况

6.6 投资组合

1. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
2. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
3. 报告期末本基金投资组合资产配置情况

6.7 投资组合

1. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
2. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
3. 报告期末本基金投资组合资产配置情况

6.8 投资组合

1. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
2. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
3. 报告期末本基金投资组合资产配置情况

6.9 投资组合

1. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
2. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
3. 报告期末本基金投资组合资产配置情况

6.10 投资组合

1. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
2. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
3. 报告期末本基金投资组合资产配置情况

6.11 投资组合

1. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
2. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
3. 报告期末本基金投资组合资产配置情况

6.12 投资组合

1. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
2. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
3. 报告期末本基金投资组合资产配置情况

6.13 投资组合

1. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
2. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
3. 报告期末本基金投资组合资产配置情况

6.14 投资组合

1. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
2. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
3. 报告期末本基金投资组合资产配置情况

6.15 投资组合

1. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
2. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
3. 报告期末本基金投资组合资产配置情况

6.16 投资组合

1. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
2. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
3. 报告期末本基金投资组合资产配置情况

6.17 投资组合

1. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
2. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
3. 报告期末本基金投资组合资产配置情况

6.18 投资组合

1. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
2. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
3. 报告期末本基金投资组合资产配置情况

6.19 投资组合

1. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
2. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
3. 报告期末本基金投资组合资产配置情况

6.20 投资组合

1. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
2. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
3. 报告期末本基金投资组合资产配置情况

6.21 投资组合

1. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
2. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
3. 报告期末本基金投资组合资产配置情况

6.22 投资组合

1. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
2. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
3. 报告期末本基金投资组合资产配置情况

6.23 投资组合

1. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
2. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
3. 报告期末本基金投资组合资产配置情况

6.24 投资组合

1. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
2. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
3. 报告期末本基金投资组合资产配置情况

6.25 投资组合

1. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
2. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
3. 报告期末本基金投资组合资产配置情况

6.26 投资组合

1. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
2. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
3. 报告期末本基金投资组合资产配置情况

6.27 投资组合

1. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
2. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
3. 报告期末本基金投资组合资产配置情况

6.28 投资组合

1. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
2. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
3. 报告期末本基金投资组合资产配置情况

6.29 投资组合

1. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
2. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
3. 报告期末本基金投资组合资产配置情况

6.30 投资组合

1. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
2. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
3. 报告期末本基金投资组合资产配置情况

6.31 投资组合

1. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
2. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
3. 报告期末本基金投资组合资产配置情况

2014年半年度报告摘要

2014年6月30日

资产

项目	期末余额
货币资金	7,891,890.38
银行存款	3,589,033.43
存放同业款项	152,280.20
买入返售金融资产	143,008,851.42
其中:股票质押式回购	143,008,851.42
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
期货投资	-
买入返售金融资产	-
应收利息	2,006.96
应收股利	-
其他应收款	1,773.41
其他资产	-
资产总计	152,907,460.71

负债

项目	期末余额
短期借款	-
交易性金融负债	-
应付账款	-
应付利息	116.85
应付股利	1,018,992.13
应付债券	125,428.74
其他应付款	25,085.72
其他负债	-
负债合计	465,292.57

所有者权益

项目	期末余额
实收资本	1,016.70
资本公积	151,063,907.86
未分配利润	152,907,460.71
所有者权益合计	152,907,460.71

6.1 主要财务指标

1. 本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
2. 本基金业绩比较基准为95%×中证500指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)。
3. 期末可供分配利润以本基金当期实现的基金净收益为基础,扣除相关费用后的金额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
4. 期末可供分配利润的计算方法:如果期末未分配利润的未实现部分为正数,则期末可供分配利润的金额等于未分配利润的未实现部分加上期末未分配利润的未实现部分为负数,期末可供分配利润的金额等于未分配利润(已实现部分)减去未实现部分。
5. 上述基金净值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。
6. 基金份额净值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。

6.2 投资组合

1. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
2. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
3. 报告期末本基金投资组合资产配置情况

6.3 投资组合

1. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
2. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
3. 报告期末本基金投资组合资产配置情况

6.4 投资组合

1. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
2. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
3. 报告期末本基金投资组合资产配置情况

6.5 投资组合

1. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
2. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
3. 报告期末本基金投资组合资产配置情况

6.6 投资组合

1. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
2. 报告期末本基金投资组合资产配置情况
3. 报告期末本基金投资组合资产配置情况

6.7 投资组合

1.