

信息披露

Disclosure

中证500信息技术指数交易型开放式指数证券投资基金

2019年第一季度报告

上表中的股票投资项可替代代估值增值,而2中的合计项中不可含可替代代估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A 农林、牧、渔业	—	—	—
B 采矿业	—	—	—
C 制造业	174,033,060.20	48.10	—
D 电力、热力、燃气及生产供应业	—	—	—
E 建筑业	—	—	—
F 批发和零售业	4,137,363.00	1.14	—
G 交通运输、仓储和邮政业	—	—	—
H 住宿和餐饮业	—	—	—
I 信息传输、软件和信息技术服务业	181,065,723.03	50.28	—
J 金融业	—	—	—
K 房地产业	—	—	—
L 租赁和商务服务业	—	—	—
M 科学研究和技术服务业	—	—	—
N 水利、环境和公共设施管理业	—	—	—
O 住宿、餐饮业	—	—	—
P 教育	—	—	—
Q 卫生健康业	—	—	—
R 文化、体育和娱乐业	—	—	—
S 综合	—	—	—
合计	300,077,527.03	80.02	—

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A 农林、牧、渔业	—	—	—
B 采矿业	—	—	—
C 制造业	174,372.21	0.06	—
D 电力、热力、燃气及生产供应业	—	—	—
E 建筑业	—	—	—
F 批发和零售业	—	—	—
G 交通运输、仓储和邮政业	—	—	—
H 住宿和餐饮业	—	—	—
I 信息传输、软件和信息技术服务业	32,002.04	0.01	—
J 金融业	134,343.09	0.04	—
K 房地产业	—	—	—
L 租赁和商务服务业	—	—	—
M 科学研究和技术服务业	—	—	—
N 水利、环境和公共设施管理业	—	—	—
O 住宿、餐饮业	—	—	—
P 教育	—	—	—
Q 卫生健康业	—	—	—
R 文化、体育和娱乐业	—	—	—
S 综合	—	—	—
合计	341,615.30	0.09	—

5.2.3 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股投资股票。

5.3 报告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

5.3.1 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000310	广联达	381,300	11,366,563.00	3.14
2	002049	紫光股份	237,800	10,080,122.00	2.86
3	002036	世纪华联	1,747,620	10,051,788.20	2.80
4	000088	中顺洁柔	881,620	10,402,758.20	2.90
5	002304	仙坛股份	142,750	10,306,022.00	2.88
6	002288	卫士通	328,620	9,842,169.00	2.72
7	300353	光环新网	515,900	9,729,376.00	2.69
8	000636	中国软件	166,600	9,266,300.00	2.60
9	002439	世纪华联	304,000	8,861,020.00	2.48
10	002010	华胜天成	686,471	7,284,308.04	2.05

5.3.2 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002268	普华永道	17,700	134,343.09	0.04
2	300762	上海钢联	224	82,476.37	0.02
3	002379	三钢股份	2,052	69,540.36	0.02
4	300766	银华互动	1,193	32,902.84	0.01
5	002682	雷柏科技	514	25,360.48	0.01

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	138041	招商银行	3,680	366,000.00	0.10

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金股指期货投资将

根据风险管理的原则,以套期保值为目的,对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等,

主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值

操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位调整的频率交易成本,跟踪误差,

达到有效跟踪的指数的目的。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.3 本期国债期货投资评价

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000310	广联达	381,300	11,366,563.00	3.14
2	002049	紫光股份	237,800	10,080,122.00	2.86
3	002036	世纪华联	1,747,620	10,051,788.20	2.80
4	000088	中顺洁柔	881,620	10,402,758.20	2.90
5	002304	仙坛股份	142,750	10,306,022.00	2.88
6	002288	卫士通	328,620	9,842,169.00	2.72
7	300353	光环新网	515,900	9,729,376.00	2.69
8	000636	中国软件	166,600	9,266,300.00	2.60
9	002439	世纪华联	304,000	8,861,020.00	2.48
10	002010	华胜天成	686,471	7,284,308.04	2.05

5.3.2 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002268	普华永道	17,700	134,343.09	0.04
2	300762	上海钢联	224	82,476.37	0.02
3	002379	三钢股份	2,052	69,540.36	0.02
4	300766	银华互动	1,193	32,902.84	0.01
5	002682	雷柏科技	514	25,360.48	0.01

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债期货	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
4	企业债券	—	—
5	中期票据	—	—
6	短期融资券	366,000.00	0.10
7	资产支持证券	—	—
8	其他	—	—
9	合计	366,000.00	0.10

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	138041	招商银行	3,680	366,000.00	0.10

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金股指期货投资将

根据风险管理的原则,以套期保值为目的,对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等,

主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值

操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位调整的频率交易成本,跟踪误差,

达到有效跟踪的指数的目的。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.3 本期国债期货投资评价

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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,如,还对相关证券的投资决策程序做出说明。

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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,如,还对相关证券的投资决策程序做出说明。

5.11.2 报告期末本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库,本基金管理人从制度和流

程上要求股票必须事先入库再买入。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	27,324.03
2	应收证券清算款	1,011,747.04
3	应收股利	—
4	应收利息	722.27
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,039,793.34

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.2 报告期末积极投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

5.6 开放式基金份额变动

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002379	三钢股份	66,546.36	0.02	新发上市

5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期末,基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内,基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

5.8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者	持有基金份额比例达到或超过20%的时间区	期初份额	本期净申购	期末份额	持有份额	占份额比例
1	2018/03/01-2019/03/31	194,010,000.00	204,221,500.00	0.00	398,231,500.00	83.04

本基金存在持有基金份额超过20%的基金份额持有人,在特定赎回比例及市场条件下,若基金管理人未通过

申购份额包含红利再投资和份额赎回。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、《中证500信息技术交易型开放式指数证券投资基金合同》;

2、《中证500信息技术交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;

3、《中证500信息技术交易型开放式指数证券投资基金2019年1季度报告原文》;

4、《中证500信息技术交易型开放式指数证券投资基金2019年1季度报告原文》;

5、《中证500信息技术交易型开放式指数证券投资基金2019年1季度报告原文》;

6、《中证500信息技术交易型开放式指数证券投资基金2019年1季度报告原文》;

7、《中证500信息技术交易型开放式指数证券投资基金2019年1季度报告原文》;

8、《中证500信息技术交易型开放式指数证券投资基金2019年1季度报告原文》;

9、《中证500信息技术交易型开放式指数证券投资基金2019年1季度报告原文》;

10、《中证500信息技术交易型开放式指数证券投资基金2019年1季度报告原文》;

11、《中证500信息技术交易型开放式指数证券投资基金2019年1季度报告原文》;

12、《中证500信息技术交易型开放式指数证券投资基金2019年1季度报告原文》;

13、《中证500信息技术交易型开放式指数证券投资基金2019年1季度报告原文》;

14、《中证500信息技术交易型开放式指数证券投资基金2019年1季度报告原文》;

15、《中证500信息技术交易型开放式指数证券投资基金2019年1季度报告原文》;

16、《中证500信息技术交易型开放式指数证券投资基金2019年1季度报告原文》;

17、《中证500信息技术交易型开放式指数证券投资基金2019年1季度报告原文》;

18、《中证500信息技术交易型开放式指数证券投资基金2019年1季度报告原文》;

19、《中证500信息技术交易型开放式指数证券投资基金2019年1季度报告原文》;

20、《中证500信息技术交易型开放式指数证券投资基金2019年1季度报告原文》;

21、《中证500信息技术交易型开放式指数证券投资基金2019年1季度报告原文》;

22、《中证500信息技术交易型开放式指数证券投资基金2019年1季度报告原文》;

23、《中证500信息技术交易型开放式指数证券投资基金2019年1季度报告原文》;

24、《中证500信息技术交易型开放式指数证券投资基金2019年1季度报告原文》;

25、《中证500信息技术交易型开放式指数证券投资基金2019年1季度报告原文》;

26、《中证500信息技术交易型开放式指数证券投资基金2019年1季度报告原文》;

27、《中证500信息技术交易型开放式指数证券投资基金2019年1季度报告原文》;

28、《中证500信息技术交易型开放式指数证券投资基金2019年1季度报告原文》;

29、《中证500信息技术交易型开放式指数证券投资基金2019年1季度报告原文》;

30、《中证500信息技术交易型开放式指数证券投资基金2019年1季度报告原文》;

31、《中证500信息技术交易型开放式指数证券投资基金2019年1季度报告原文》;

32、《中证500信息技术交易型开放式指数证券投资基金2019年1季度报告原文》;

33、《中证500信息技术交易型开放式指数证券投资基金2019年1季度报告原文》;

34、《中证500信息技术交易型开放式指数证券投资基金2019年1季度报告原文》;

35、《中证500信息技术交易型开放式指数证券投资基金2019年1季度报告原文》;

36、《中证500信息技术交易型开放式指数证券投资基金2019年1季度报告原文》;

37、《中证500信息技术交易型开放式指数证券投资基金2019年1季度报告原文》;

38、《中证500信息技术交易型开放式指数证券投资基金2019年1季度报告原文》;

39、《中证500信息技术交易型开放式指数证券投资基金2019年1季度报告原文》;

40、《中证500信息技术交易型开放式指数证券投资基金2019年1季度报告原文》;

41、《中证500信息技术交易型开放式指数证券投资基金2019年1季度报告原文》;

42、《中证500信息技术交易型开放式指数证券投资基金2019年1季度报告原文》;

43、《中证500信息技术交易型开放式指数证券投资基金2019年1季度报告原文》;