

信息披露 Disclosure

中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金

2019年第一季度报告

来看,报告期内表现出确保科创板顺利推出的决心,市场对此反应积极。

资金方面,货币与信用政策的宽松是驱动行情的重要因素,贷款利率正在修复2018年末扩大资产利用便利以及实体经济融资端的收缩。通过上述途上的资金持续流入,也有利于修复2018年以来的流动性,修复资金面,市场流动性改善,市场流动性改善,市场流动性改善。

主要消费行业中,白酒、乳制品季报预期较好,需求稳定且渠道库存低,禽养殖受益于非洲猪瘟影响持续发酵,1季报预期也较好。2018年11月以来,外资持续流入消费基金龙头,贵州茅台估值修复持续发酵,1季报预期也较好。

报告期内,本基金遵循指数基金的被动投资原则,保持了指数基金的基本属性。股票投资组合报告期内基本保持在95%—100%之间,基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目标。

截至本报告期末,本基金份额净值为2.5932元,本报告期份额净值增长率为42.65%,同期业绩比较基准增长率为42.00%。

4.0 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	2,344,270,138.97	89.87
2	其中:股票	2,344,270,138.97	89.87
3	固定收益投资	4,162,000.00	0.20
4	其中:债券	4,162,000.00	0.20
5	资产支持证券	—	—
6	金融衍生品投资	—	—
7	买入返售金融资产	—	—
8	其他资产	7,323,143.37	0.29
9	银行存款和结算备付金合计	21,377,000.00	0.83
10	其他流动资产	2,368,399,499.43	93.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	145,355,050.00	6.06
B	制造业	1,989,467,428.37	88.21
C	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
D	建筑业	109,782,083.00	4.57
E	交通运输、仓储和邮政业	—	—
F	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
G	批发和零售业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	金融业	—	—
J	房地产业	—	—
K	租赁和商务服务业	—	—
L	综合类	—	—
M	其他	—	—
N	其他	—	—
O	其他	—	—
P	其他	—	—
Q	其他	—	—
R	其他	—	—
S	其他	—	—
T	其他	—	—
U	其他	—	—
V	其他	—	—
W	其他	—	—
X	其他	—	—
Y	其他	—	—
Z	其他	—	—
合计	公允价值合计	2,344,270,138.97	89.87

5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	145,355,050.00	6.06
B	制造业	1,989,467,428.37	88.21
C	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
D	建筑业	109,782,083.00	4.57
E	交通运输、仓储和邮政业	—	—
F	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
G	批发和零售业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	金融业	—	—
J	房地产业	—	—
K	租赁和商务服务业	—	—
L	综合类	—	—
M	其他	—	—
N	其他	—	—
O	其他	—	—
P	其他	—	—
Q	其他	—	—
R	其他	—	—
S	其他	—	—
T	其他	—	—
U	其他	—	—
V	其他	—	—
W	其他	—	—
X	其他	—	—
Y	其他	—	—
Z	其他	—	—
合计	公允价值合计	2,344,270,138.97	89.87

5.2.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	145,355,050.00	6.06
B	制造业	1,989,467,428.37	88.21
C	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
D	建筑业	109,782,083.00	4.57
E	交通运输、仓储和邮政业	—	—
F	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
G	批发和零售业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	金融业	—	—
J	房地产业	—	—
K	租赁和商务服务业	—	—
L	综合类	—	—
M	其他	—	—
N	其他	—	—
O	其他	—	—
P	其他	—	—
Q	其他	—	—
R	其他	—	—
S	其他	—	—
T	其他	—	—
U	其他	—	—
V	其他	—	—
W	其他	—	—
X	其他	—	—
Y	其他	—	—
Z	其他	—	—
合计	公允价值合计	2,344,270,138.97	89.87

5.2.2.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.2.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	145,355,050.00	6.06
B	制造业	1,989,467,428.37	88.21
C	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
D	建筑业	109,782,083.00	4.57
E	交通运输、仓储和邮政业	—	—
F	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
G	批发和零售业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	金融业	—	—
J	房地产业	—	—
K	租赁和商务服务业	—	—
L	综合类	—	—
M	其他	—	—
N	其他	—	—
O	其他	—	—
P	其他	—	—
Q	其他	—	—
R	其他	—	—
S	其他	—	—
T	其他	—	—
U	其他	—	—
V	其他	—	—
W	其他	—	—
X	其他	—	—
Y	其他	—	—
Z	其他	—	—
合计	公允价值合计	2,344,270,138.97	89.87

5.2.2.2.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.2.2.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	145,355,050.00	6.06
B	制造业	1,989,467,428.37	88.21
C	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
D	建筑业	109,782,083.00	4.57
E	交通运输、仓储和邮政业	—	—
F	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
G	批发和零售业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	金融业	—	—
J	房地产业	—	—
K	租赁和商务服务业	—	—
L	综合类	—	—
M	其他	—	—
N	其他	—	—
O	其他	—	—
P	其他	—	—
Q	其他	—	—
R	其他	—	—
S	其他	—	—
T	其他	—	—
U	其他	—	—
V	其他	—	—
W	其他	—	—
X	其他	—	—
Y	其他	—	—
Z	其他	—	—
合计	公允价值合计	2,344,270,138.97	89.87

5.2.2.2.2.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.2.2.2.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	145,355,050.00	6.06
B	制造业	1,989,467,428.37	88.21
C	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
D	建筑业	109,782,083.00	4.57
E	交通运输、仓储和邮政业	—	—
F	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
G	批发和零售业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	金融业	—	—
J	房地产业	—	—
K	租赁和商务服务业	—	—
L	综合类	—	—
M	其他	—	—
N	其他	—	—
O	其他	—	—
P	其他	—	—
Q	其他	—	—
R	其他	—	—
S	其他	—	—
T	其他	—	—
U	其他	—	—
V	其他	—	—
W	其他	—	—
X	其他	—	—
Y	其他	—	—
Z	其他	—	—
合计	公允价值合计	2,344,270,138.97	89.87

5.2.2.2.2.2.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.2.2.2.2.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	145,355,050.00	6.06
B	制造业	1,989,467,428.37	88.21
C	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
D	建筑业	109,782,083.00	4.57
E	交通运输、仓储和邮政业	—	—
F	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
G	批发和零售业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	金融业	—	—
J	房地产业	—	—
K	租赁和商务服务业	—	—
L	综合类	—	—
M	其他	—	—
N	其他	—	—
O	其他	—	—
P	其他	—	—
Q	其他	—	—
R	其他	—	—
S	其他	—	—
T	其他	—	—
U	其他	—	—
V	其他	—	—
W	其他	—	—
X	其他	—	—
Y	其他	—	—
Z	其他	—	—
合计	公允价值合计	2,344,270,138.97	89.87

5.2.2.2.2.2.2.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.2.2.2.2.2.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	145,355,050.00	6.06
B	制造业	1,989,467,428.37	88.21
C	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
D	建筑业	109,782,083.00	4.57
E	交通运输、仓储和邮政业	—	—
F	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
G	批发和零售业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	金融业	—	—
J	房地产业	—	—
K	租赁和商务服务业	—	—
L	综合类	—	—
M	其他	—	—
N	其他	—	—
O	其他	—	—
P	其他	—	—
Q	其他	—	—
R	其他	—	—
S	其他	—	—
T	其他	—	—
U	其他	—	—
V	其他	—	—
W	其他	—	—
X	其他	—	—
Y	其他	—	—
Z	其他	—	—
合计	公允价值合计	2,344,270,138.97	89.87

5.2.2.2.2.2.2.2.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.2.2.2.2.2.2.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	145,355,050.00	6.06
B	制造业	1,989,467,428.37	88.21
C	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
D	建筑业	109,782,083.00	4.57
E	交通运输、仓储和邮政业	—	—
F	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
G	批发和零售业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	金融业	—	—
J	房地产业	—	—
K	租赁和商务服务业	—	—
L	综合类	—	—
M	其他	—	—
N	其他	—	—
O	其他	—	—
P	其他	—	—
Q	其他	—	—
R	其他	—	—
S	其他	—	—
T	其他	—	—
U	其他	—	—
V	其他	—	—
W	其他	—	—
X	其他	—	—
Y	其他	—	—
Z	其他	—	—
合计	公允价值合计	2,344,270,138.97	89.87

基金管理人:汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2019年4月20日

1 重要提示
基金管理人及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2019年4月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告自2019年1月1日起至2019年3月31日止。

2 基金产品概况

基金简称	中证主要消费ETF
场内简称	消费ETF
基金代码	159929
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015年10月29日
报告期末基金份额总额	109,487,260,000份
投资策略	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
业绩比较基准	中证主要消费指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%
风险收益特征	本基金属于主要投资于股票的基金,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2019年1月1日至2019年3月31日)
1.本期已实现收益	11,721,886.47
2.本期公允价值变动收益	603,202,262.27
3.本期公允价值变动损益	603,202,262.27
4.本期公允价值变动损益	603,202,262.27
5.本期公允价值变动损益	603,202,262.27
6.本期公允价值变动损益	603,202,262.27
7.本期公允价值变动损益	603,202,262.27
8.本期公允价值变动损益	603,202,262.27
9.本期公允价值变动损益	603,202,262.27
10.本期公允价值变动损益	603,202,262.27
11.本期公允价值变动损益	603,202,262.27
12.本期公允价值变动损益	603,202,262.