

汇添富中证500指数型发起式证券投资基金(LOF)

2019年第二季度报告

无。

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	投资组合	持仓市值(元)	占基金总资产比例(%)
1	股票投资	338,198,276.63	69.73
2	债券投资	338,198,276.63	69.73
3	基金投资	76,608,609.09	15.68
4	货币市场投资	94,900,000.00	19.60
5	其他资产	-	-
6	其他负债	-	-

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

行业名称	持仓市值(元)	占基金总资产比例(%)
A 医药生物	3,626,200.00	0.74
B 制造业	11,713,468.00	2.42
C 信息技术	48,049,725.00	9.93
D 消费品	9,479,112.00	1.97
E 金融	17,520,260.00	3.62
F 其他	11,713,238.00	2.42
G 公用事业	2,007,370.00	0.42
H 交通运输	32,759,248.00	6.83
I 可选消费	14,938,582.00	3.10
J 能源	18,356,420.00	3.81
K 房地产	4,544,776.00	0.95
L 周期性消费品	3,868,688.00	0.81
M 其他	4,544,776.00	0.95
N 其他	52,641,333.00	11.00

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

行业名称	持仓市值(元)	占基金总资产比例(%)
A 医药生物	3,626,200.00	0.74
B 制造业	11,713,468.00	2.42
C 信息技术	48,049,725.00	9.93
D 消费品	9,479,112.00	1.97
E 金融	17,520,260.00	3.62
F 其他	11,713,238.00	2.42
G 公用事业	2,007,370.00	0.42
H 交通运输	32,759,248.00	6.83
I 可选消费	14,938,582.00	3.10
J 能源	18,356,420.00	3.81
K 房地产	4,544,776.00	0.95
L 周期性消费品	3,868,688.00	0.81
M 其他	4,544,776.00	0.95
N 其他	52,641,333.00	11.00

5.4 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股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	持仓市值(元)	公允价值占基金资产净值比例(%)
1	000333	振业集团	30,720	1.07
2	300252	金通灵	24,776	0.87
3	002915	欣龙无纺	23,553	0.84
4	000802	中际光电	20,800	0.75
5	600286	中国铝业	19,968	0.72

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	持仓市值(元)	公允价值占基金资产净值比例(%)
1	000000	国债逆回购	46,893	1.65
2	000000	国债逆回购	46,893	1.65
3	000000	国债逆回购	46,893	1.65
4	000000	国债逆回购	46,893	1.65
5	000000	国债逆回购	46,893	1.65

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五名贵金属投资明细

序号	贵金属代码	贵金属名称	持仓市值(元)	公允价值占基金资产净值比例(%)
1	000000	国债逆回购	46,893	1.65
2	000000	国债逆回购	46,893	1.65
3	000000	国债逆回购	46,893	1.65
4	000000	国债逆回购	46,893	1.65
5	000000	国债逆回购	46,893	1.65

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权证投资明细

序号	权证代码	权证名称	持仓市值(元)	公允价值占基金资产净值比例(%)
1	000000	国债逆回购	46,893	1.65
2	000000	国债逆回购	46,893	1.65
3	000000	国债逆回购	46,893	1.65
4	000000	国债逆回购	46,893	1.65
5	000000	国债逆回购	46,893	1.65

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股指期货投资明细

序号	股指期货代码	股指期货名称	持仓市值(元)	公允价值占基金资产净值比例(%)
1	000000	国债逆回购	46,893	1.65
2	000000	国债逆回购	46,893	1.65
3	000000	国债逆回购	46,893	1.65
4	000000	国债逆回购	46,893	1.65
5	000000	国债逆回购	46,893	1.65

5.9 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国债期货投资明细

序号	国债期货代码	国债期货名称	持仓市值(元)	公允价值占基金资产净值比例(%)
1	000000	国债逆回购	46,893	1.65
2	000000	国债逆回购	46,893	1.65
3	000000	国债逆回购	46,893	1.65
4	000000	国债逆回购	46,893	1.65
5	000000	国债逆回购	46,893	1.65

5.10 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

序号	权证代码	权证名称	持仓市值(元)	公允价值占基金资产净值比例(%)
1	000000	国债逆回购	46,893	1.65
2	000000	国债逆回购	46,893	1.65
3	000000	国债逆回购	46,893	1.65
4	000000	国债逆回购	46,893	1.65
5	000000	国债逆回购	46,893	1.65

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国证监会及其派出机构、证券交易所立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。
 5.11.2 本基金投资的前十名股票中没有超出基金合同规定的备选股票库。
 5.11.3 其他资产构成

5.12 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业名称	持仓市值(元)	公允价值占基金资产净值比例(%)
A 医药生物	3,626,200.00	0.74
B 制造业	11,713,468.00	2.42
C 信息技术	48,049,725.00	9.93
D 消费品	9,479,112.00	1.97
E 金融	17,520,260.00	3.62
F 其他	11,713,238.00	2.42
G 公用事业	2,007,370.00	0.42
H 交通运输	32,759,248.00	6.83
I 可选消费	14,938,582.00	3.10
J 能源	18,356,420.00	3.81
K 房地产	4,544,776.00	0.95
L 周期性消费品	3,868,688.00	0.81
M 其他	4,544,776.00	0.95
N 其他	52,641,333.00	11.00

5.13 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指期货投资明细

序号	股指期货代码	股指期货名称	持仓市值(元)	公允价值占基金资产净值比例(%)
1	000000	国债逆回购	46,893	1.65
2	000000	国债逆回购	46,893	1.65
3	000000	国债逆回购	46,893	1.65
4	000000	国债逆回购	46,893	1.65
5	000000	国债逆回购	46,893	1.65

5.14 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国债期货投资明细

序号	国债期货代码	国债期货名称	持仓市值(元)	公允价值占基金资产净值比例(%)
1	000000	国债逆回购	46,893	1.65
2	000000	国债逆回购	46,893	1.65
3	000000	国债逆回购	46,893	1.65
4	000000	国债逆回购	46,893	1.65
5	000000	国债逆回购	46,893	1.65

5.15 投资组合报告附注

5.15.1 报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国证监会及其派出机构、证券交易所立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。
 5.15.2 本基金投资的前十名股票中没有超出基金合同规定的备选股票库。
 5.15.3 其他资产构成

5.16 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业名称	持仓市值(元)	公允价值占基金资产净值比例(%)
A 医药生物	3,626,200.00	0.74
B 制造业	11,713,468.00	2.42
C 信息技术	48,049,725.00	9.93
D 消费品	9,479,112.00	1.97
E 金融	17,520,260.00	3.62
F 其他	11,713,238.00	2.42
G 公用事业	2,007,370.00	0.42
H 交通运输	32,759,248.00	6.83
I 可选消费	14,938,582.00	3.10
J 能源	18,356,420.00	3.81
K 房地产	4,544,776.00	0.95
L 周期性消费品	3,868,688.00	0.81
M 其他	4,544,776.00	0.95
N 其他	52,641,333.00	11.00

5.17 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指期货投资明细

序号	股指期货代码	股指期货名称	持仓市值(元)	公允价值占基金资产净值比例(%)
1	000000	国债逆回购	46,893	1.65
2	000000	国债逆回购	46,893	1.65
3	000000	国债逆回购	46,893	1.65
4	000000	国债逆回购	46,893	1.65
5	000000	国债逆回购	46,893	1.65

5.18 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国债期货投资明细

序号	国债期货代码	国债期货名称	持仓市值(元)	公允价值占基金资产净值比例(%)
1	000000	国债逆回购	46,893	1.65
2	000000	国债逆回购	46,893	1.65
3	000000	国债逆回购	46,893	1.65
4	000000	国债逆回购	46,893	1.65
5	000000	国债逆回购	46,893	1.65

5.19 投资组合报告附注

5.19.1 报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国证监会及其派出机构、证券交易所立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。
 5.19.2 本基金投资的前十名股票中没有超出基金合同规定的备选股票库。
 5.19.3 其他资产构成

5.20 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业名称	持仓市值(元)	公允价值占基金资产净值比例(%)
A 医药生物	3,626,200.00	0.74
B 制造业	11,713,468.00	2.42
C 信息技术	48,049,725.00	9.93
D 消费品	9,479,112.00	1.97
E 金融	17,520,260.00	3.62
F 其他	11,713,238.00	2.42
G 公用事业	2,007,370.00	0.42
H 交通运输	32,759,248.00	6.83
I 可选消费	14,938,582.00	3.10
J 能源	18,356,420.00	3.81
K 房地产	4,544,776.00	0.95
L 周期性消费品	3,868,688.00	0.81
M 其他	4,544,776.00	0.95
N 其他	52,641,333.00	11.00

5.21 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指期货投资明细

序号	股指期货代码	股指期货名称	持仓市值(元)	公允价值占基金资产净值比例(%)
1	000000	国债逆回购	46,893	1.65
2	000000	国债逆回购	46,893	1.65
3	000000	国债逆回购	46,893	1.65
4	000000	国债逆回购	46,893	1.65
5	000000	国债逆回购	46,893	1.65

5.22 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国债期货投资明细

序号	国债期货代码	国债期货名称	持仓市值(元)	公允价值占基金资产净值比例(%)
1	000000	国债逆回购	46,893	1.65
2	000000	国债逆回购	46,893	1.65
3	000000	国债逆回购	46,893	1.65
4	000000	国债逆回购	46,893	1.65
5	000000	国债逆回购	46,893	1.65

5.23 投资组合报告附注

5.23.1 报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国证监会及其派出机构、证券交易所立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。
 5.23.2 本基金投资的前十名股票中没有超出基金合同规定的备选股票库。
 5.23.3 其他资产构成

5.24 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业名称	持仓市值(元)	公允价值占基金资产净值比例(%)
A 医药生物	3,626,200.00	0.74
B 制造业	11,713,468.00	2.42
C 信息技术	48,049,725.00	9.93
D 消费品	9,479,112.00	1.97
E 金融	17,520,260.00	3.62
F 其他	11,713,238.00	2.42
G 公用事业	2,007,370.00	0.42
H 交通运输	32,759,248.00	6.83
I 可选消费	14,938,582.00	3.10
J 能源	18,356,420.00	3.81
K 房地产	4,544,776.00	0.95
L 周期性消费品	3,868,688.00	0.81
M 其他	4,544,776.00	0.95
N 其他	52,641,333.00	11.00

5.25 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指期货投资明细

序号	股指期货代码	股指期货名称	持仓市值(元)	公允价值占基金资产净值比例(%)
1	000000	国债逆回购	46,893	1.65
2	000000	国债逆回购	46,893	1.65
3	000000	国债逆回购	46,893	1.65
4	000000	国债逆回购	46,893	1.65
5	000000	国债逆回购	46,893	1.65

5.26 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国债期货投资明细

序号	国债期货代码	国债期货名称	持仓市值(元)	公允价值占基金资产净值比例(%)
1	000000	国债逆回购	46,893	1.65
2	000000	国债逆回购	46,893	1.65
3	000000	国债逆回购	46,893	1.65
4	000000	国债逆回购	46,893</	