

基金管理人:中信建投基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2019年4月19日

重要提示

基金管理人的董事局对本报告书所载资料进行逐项审核,保证不存在虚假记载、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。
基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4月18日复核了本基金报告期内的财务指标、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。投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本季度报告的财务数据未经审计。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告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 基金产品概况					
基金简称 中信建投中证北京50ETF					
基金代码 512980					
基金合同生效日 2018年09月27日					
报告期末基金份额总额 28,531,000份					
投资目标 该基金主要通过投资于标的指数成分股,跟踪标的指数的走势,力争取得与标的指数相似的收益。					
业绩比较基准 中证北京50交易型开放式指数基金					
基金管理人 中信建投基金管理有限公司					
基金托管人 招商银行股份有限公司					

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

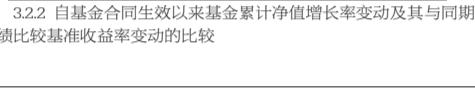
单位:人民币元					
主要财务指标					报告期(2019年01月01日—2019年03月31日)
1.本期已实现收益					13,560,067.00
2.本期利润					26,089,362.04
3.加权平均基金份额本期利润					0.2948
4.期末基金份额净值					46.0116,146.97
5.期末可供分配基金份额净值					1.0197

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后投资人的实际收益水平将低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告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



3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



中信建投中证北京50交易型开放式指数证券投资基金

2019年第一季度报告

上市公司的整体走势。

报告期内,本基金跟踪误差主要来自于成分股在基金资产中的权重与在所跟踪的指数中的权重结构上的差异。权重结构上的差异主要原因为三个方面:第一,股票数量的舍入取整;第二,适当提高了个别股票权重以提高可供赎回的篮子个数;第三,保证金和证券清算款占基金资产一定比例的占用。本基金管理人在量分析基础上,采取了适当的组合调整策略,尽可能地控制了基金的跟踪误差与偏离度。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中信建投中证北京50ETF基金份额净值为1.1917元,本期报告期内,基金份额净值增长率为29.96%,同期业绩比较基准收益率为30.95%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金份额净值预警说明

本报告期内,本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人低于二百人或基金份额净值低于五千万元的情形。

§ 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)	占基金资产的比例(%)
1	现金类投资	44,028,090.20	98.13
2	银行存款	44,028,090.20	98.13
3	定期存款	-	-
4	回购协议	-	-
5	货币市场基金	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他资产	603,576,011	1.29
9	合计	64,631,066.20	100.00

注:股票投资组合不包含可转债代款估值增值。

5.2 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 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债券投资组合

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	银行存款	44,028,090.20	98.13
2	定期存款	-	-
3	回购协议	-	-
4	同业存放	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售债券	-	-
8	其他资产	603,576,011	1.29
9	合计	64,631,066.20	100.00

注:股票投资组合不包含可转债代款估值增值。

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

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

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

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

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权证投资组合

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组合

5.11 报告组合报告附注

5.12 报告期内,本基金没有持有过权证。

5.13 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	142,228.00
2	应收券商清算款	400,765.62
3	应收利息	62,940
4	应收申购款	60,629
5	买入返售金融资产	603,576,011
6	其他应收款	1,098,566.00
7	其他	1,098,566.00
8	合计	603,576,011

注:股票投资组合不包含可转债代款估值增值。

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权证投资组合

5.15 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组合

5.16 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组合

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五名权证投资组合

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权证投资组合

5.19 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组合

5.20 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组合

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五名权证投资组合

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权证投资组合

5.23 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组合

5.24 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组合

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五名权证投资组合

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权证投资组合

5.27 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组合

5.28 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组合

5.29 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组合

5.30 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组合

5.31 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组合

5.32 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组合

5.33 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组合

5.34 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组合

5.35 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组合

5.36 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组合

5.37 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组合

5.38 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组合

5.39 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组合

5.40 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组合

5.41 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组合

5.42 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组合