中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金

2019年第二季度报告

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7月17日

§1 重要提示

基金管理人的董事会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规定,于2019年7月15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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年4月1日起至2019年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富中证金融地产ETF
场内简称	金融ETF
基金主代码	159931
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013年8月23日
报告期末基金份额总额	18,828,511.00份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	主要采取完全复制法,在正常市场情况下,日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.1%,年化跟踪误差不超过2%。
业绩比较基准	中证金融地产指数
风险收益特征	属股票型基金,预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本系列基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
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 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4月1日-2019年6月30日)
1.本期已实现收益	838,831.47
2.本期利润	300,482.91
3.加权平均基金份额本期利润	0.0154
4.期末基金资产净值	32,835,054.06
5.期末基金份额净值	1.7439

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、所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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.32%	1.53%	-0.16%	1.52%	0.48%	0.01%

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

注:本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2013年8月23日)起3个月,建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
过磊蓉	汇添富中证主要消费ETF、汇添富中证医药卫生ETF、汇添富中证能源ETF、汇添富中证金融地产ETF、汇添富沪深300ETF基金、汇添富深证300ETF联接基金、汇添富主要消费ETF联接基金、汇添富中证生物科技指数(LOF)基金、汇添富中证金融地产指数(LOF)基金、汇添富中证新能源汽车产业指数(LOF)基金、中证银行ETF基金、添富中证医药ETF联接基金、添富中证银行ETF联接基金的基金经理。	2015年8月3日	-	8年	国籍:中国,学历:中国科学技术大学金融工程博士研究生,相关业务资格:证券投资基金从业资格,从业经历:曾任国泰基金管理有限公司金融工程策略部分析师、量化投资策略基金经理助理,2010年6月加入汇添富基金管理股份有限公司任基金经理助理,2015年8月31日至今任主要消费ETF基金、中证医药卫生ETF基金、中证能源ETF基金、中证金融地产ETF基金、汇添富沪深300ETF基金、汇添富深证300ETF联接基金的基金经理,2015年8月31日至今任汇添富主要消费ETF联接基金、中证医药卫生ETF联接基金、中证能源ETF联接基金、中证金融地产ETF联接基金的基金经理,2015年8月31日至今任汇添富中证生物科技指数(LOF)基金的基金经理,2016年12月22日至今任汇添富中证生物科技指数(LOF)基金的基金经理,2016年12月26日至今任汇添富中证能源指数(LOF)基金的基金经理,2016年12月26日至今任汇添富中证医药指数(LOF)基金的基金经理,2018年1月22日至今任汇添富中证金融地产指数(LOF)基金的基金经理,2018年1月26日至今任汇添富中证能源指数(LOF)基金的基金经理,2018年1月26日至今任汇添富中证医药指数(LOF)基金的基金经理,2018年3月26日至今任汇添富中证新能源汽车产业指数(LOF)基金的基金经理,2018年10月26日至今任中证银行ETF基金的基金经理,2019年3月26日至今任添富中证医药ETF联接基金的基金经理,2019年4月15日至今任添富中证银行ETF联接基金的基金经理。

注:1、基金的首任基金经理,其"任职日期"为基金合同生效日,其"离职日期"为根据公司决议确定的解聘日期;

2、非首任基金经理,其"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期;

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为,本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视投资者利益保护,根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规,借鉴国际经验,建立了健全、有效的公平交易制度体系,形成涵盖开放式基金、特定客户资产管理以及社保与养老委托资产的投资管理,涉及交易所市场、银行间市场等各投资市场,债券、股票、回购等各投资标的,并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节的公平交易机制。

本报告期内,基金管理人对公平交易制度和公平交易机制实现了流程优化和进一步系统化,确保全程嵌入式风险控制体系的有效运行,包括投资独立决策、集中交易公平执行、交易严密监控和报告及时分析等在内的公平交易各环节执行情况良好。

本报告期内,通过投资交易监控、交易数据分析以及专项稽核检查,本基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的交易次数为3次,由于组合投资策略导致,并经过公司内部风控审核。经检查和分析未发现异常情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年2季度,中美贸易摩擦有所反复。5月初美国总统特朗普在推特上突然发布拟对来自中国的2000亿进口商品调高关税的言论,引起市场动荡。此后经过一系列磋商,6月底举行的G20大阪峰会上,中美元首会晤并取得了阶段性进展:一是美方表示不再对中国出口产品加征新的关税;二是双方同意在平等和相互尊重的基础上重启经贸磋商。三是特朗普同意美国的公司继续向华为出售零件。中美贸易摩擦的影响是长期的,对国内的经济增长和产业结构调整都将产生深远的影响,经历过数个季度的反复,资本市场对中美贸易战也已经有了较为充分的预期。

外部环境角度,美联储6月议息会议决定维持联邦基金目标利率区间2.25%-2.50%不变,经济数据出现放缓迹象,点阵图也暗示了降息、宽松可能性有所增强。市场预期美国或在下半年进入降息周期。

从上半年的实体经济情况来看,房地产投资后续支撑减弱,制造业投资增速有所下滑,专项债对基建投资有所拉动,消费总体保持平稳。二季度经济指标有一定程度的回落,下半年经济下行压力仍较大。因此,今年在宏观调控方面政策仍可能重点实施逆周期调节,通过财政减税降费和货币政策保持流动性合理充裕等对经济形成一定的支撑。

资本市场方面,金融供给侧改革的提出或将加大企业直接融资的比例。科创板的推出定位于符合国家战略、突破关键核心技术、市场认可度高的科技创新企业,有利于更好的发挥资本市场的资源配置功能。另外,资本市场继续扩大对外开放,未来海外资金流入A股市场将是一个长期渐进的过程。

金融行业中,证券行业股票在一季度大幅上涨后有所回调,体现板块高波动属性;银行板块小幅上涨,目前估值仍处于相对低位,有着较高的估值、盈利性价比;地产板块当前政策以稳健主导,尚无显著收紧或放松的迹象,因城施策、适度调控仍是当前的主基调。

报告期内,本基金遵循指数基金的被动投资原则,保持了指数基金的本质属性。股票投资仓位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的。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.7439元;本报告期基金份额净值增长率为0.32%,业绩比较基准收益率为-0.16%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金已连续60个工作日基金资产净值低于五千万元,根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定,本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。

§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)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	32,607,715.00	98.89
	其中:股票	32,607,715.00	98.89
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	366,963.21	1.11
8	其他资产	354.12	0.00
9	合计	32,975,032.33	100.00

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	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
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	-	-
J	金融业	28,030,117.96	85.37
K	房地产业	4,477,828.80	13.64
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	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	99,768.24	0.30
	合计	32,607,715.00	99.31

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

注:本基金本报告期末未进行积极投资。

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通投票投资。

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	601318	中国平安	67,286	5,962,212.46	18.16
2	600036	招商银行	64,099	2,306,282.02	7.02
3	601166	兴业银行	90,358	1,652,647.82	5.03
4	600030	中信证券	49,149	1,170,237.69	3.56
5	601328	交通银行	170,537	1,043,686.44	3.18
6	600016	民生银行	154,170	978,979.50	2.98
7	601288	农业银行	237,876	856,353.60	2.61
8	600000	浦发银行	72,980	852,406.40	2.60
9	000002	万科A	30,231	840,724.11	2.56
10	601398	工商银行	133,882	788,564.98	2.40

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

注:本基金本报告期末未进行积极投资。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券投资。

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

注:本基金本报告期末未持有债券。

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

注: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

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

注: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

注:本报告期末本基金无股指期货持仓。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:报告期末本基金无国债期货持仓。

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

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	288.49
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	65.63
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	354.12

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注: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

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未进行积极投资,不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	21,328,511.00
报告期期间基金总申购份额	500,000.00
减:报告期期间基金总赎回份额	3,000,000.00
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	18,828,511.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注:本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

注:无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;

4、基金管理人业务资格批件、营业执照;

5、报告期内汇添富中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告;

6、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

上海市富城路99号震旦国际大楼20楼汇添富基金管理股份有限公司

9.3 查阅方式

投资者可于基金管理人办公时间预约查阅,或登录基金管理人网站www.99fund.com查阅,还可拨打基金管理人客户服务中心电话:400-888-9918查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司
2019年7月17日

中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金

2019年第二季度报告

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7月17日

§1 重要提示

基金管理人的董事会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规定,于2019年7月15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。 本报告中财务资料未经审计。 本报告期自2019年4月1日起至2019年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富中证主要消费ETF
场内简称	消费ETF
基金主代码	159928
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013年8月23日
报告期末基金份额总额	1,122,657,260.00份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	主要采取完全复制法,在正常市场情况下,日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.1%,年化跟踪误差不超过2%。
业绩比较基准	中证主要消费指数
风险收益特征	属股票型基金,预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本系列基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
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 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4月1日-2019年6月30日)
1.本期已实现收益	114,171,596.97
2.本期利润	286,974,723.69
3.加权平均基金份额本期利润	0.2851
4.期末基金资产净值	3,225,695,458.62
5.期末基金份额净值	2.8733

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。

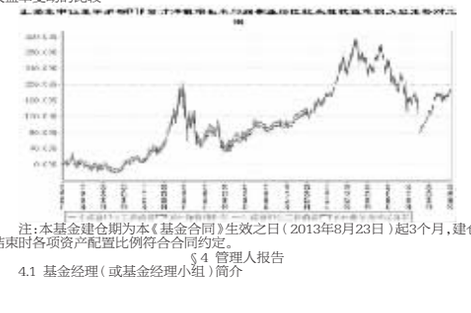
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	10.84%	1.88%	9.66%	1.90%	1.18%	-0.02%

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



注:本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2013年8月23日)起3个月,建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
过磊蓉	汇添富中证主要消费ETF、汇添富中证医药卫生ETF、汇添富中证能源ETF、汇添富中证金融地产ETF、汇添富沪深300ETF基金、汇添富深证300ETF联接基金、汇添富主要消费ETF联接基金、汇添富中证生物科技指数(LOF)基金、汇添富中证金融地产指数(LOF)基金、汇添富中证新能源汽车产业指数(LOF)基金、中证银行ETF基金、添富中证医药ETF联接基金、添富中证银行ETF联接基金的基金经理。	2015年8月3日	-	8年	国籍:中国,学历:中国科学技术大学金融工程博士研究生,相关业务资格:证券投资基金从业资格,从业经历:曾任国泰基金管理有限公司金融工程策略部分析师、量化投资策略基金经理助理,2010年6月加入汇添富基金管理股份有限公司任基金经理助理,2015年8月31日至今任主要消费ETF基金、中证医药卫生ETF基金、中证能源ETF基金、中证金融地产ETF基金、汇添富沪深300ETF基金、汇添富深证300ETF联接基金的基金经理,2015年8月31日至今任中证主要消费ETF联接基金、中证医药卫生ETF联接基金、中证能源ETF联接基金、中证金融地产ETF联接基金的基金经理,2015年8月31日至今任汇添富主要消费ETF联接基金的基金经理,2016年12月22日至今任汇添富中证生物科技指数(LOF)基金的基金经理,2016年12月26日至今任汇添富中证能源指数(LOF)基金的基金经理,2016年12月26日至今任汇添富中证医药指数(LOF)基金的基金经理,2018年1月22日至今任汇添富中证金融地产指数(LOF)基金的基金经理,2018年1月26日至今任汇添富中证能源指数(LOF)基金的基金经理,2018年1月26日至今任汇添富中证医药指数(LOF)基金的基金经理,2018年3月26日至今任添富中证医药ETF联接基金的基金经理,2019年3月26日至今任添富中证新能源汽车产业指数(LOF)基金的基金经理,2018年10月26日至今任中证银行ETF基金的基金经理,2019年3月26日至今任添富中证医药ETF联接基金的基金经理,2019年4月15日至今任添富中证银行ETF联接基金的基金经理。

注:1、基金的首任基金经理,其"任职日期"为基金合同生效日,其"离职日期"为根据公司决议确定的解聘日期;

2、非首任基金经理,其"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期;

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为,本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视投资者利益保护,根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规,借鉴国际经验,建立了健全、有效的公平交易制度体系,形成涵盖开放式基金、特定客户资产管理以及社保与养老委托资产的投资管理,涉及交易所市场、银行间市场等各投资市场,债券、股票、回购等各投资标的,并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节的公平交易机制。 本报告期内,基金管理人对公平交易制度和公平交易机制实现了流程优化和进一步系统化,确保全程嵌入式风险控制体系的有效运行,包括投资独立决策、研究公平分享、集中交易公平执行、交易严密监控和报告及时分析等在内的公平交易各环节执行情况良好。 本报告期内,通过投资交易监控、交易数据分析以及专项稽核检查,本基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的交易次数为3次,由于组合投资策略导致,经检查和分析未发现异常情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年2季度,A股市场行情焦灼,大盘价值股体现出明显的抗跌性,沪深300二季度微跌1.21%,创业板跌幅达10.75%。行业板块方面,食品饮料涨幅12.14%,远超其他行业,传媒行业二季度下跌15.79%,成为拖累创业板指的重要因素。

5月流动性压力稍显,五一长假结束后第一天,特朗普突然发布拟提高关税的言论引发市场悲观情绪加剧,叠加4月份经济数据环比出现一定下滑,市场加速回落进入震荡调整。6月美联储议息会议显示偏鸽派,全球货币宽松预期再起,至月末G20峰会上中美元首会晤使得中美贸易摩擦取得阶段性缓和,市场风险偏好出现提升。 整个二季度,影响国内市场的主要事件还有包商银行事件引发的信用风险冲击,银行间信用利差分层,国内流动性保持合理宽松予以对冲。通胀在二季度走高,主要是因为食品CPI贡献,而且经济运行数据中除社会消费品零售数据表现尚可,其余数据均低于预期,强化了以主要消费行业为代表的内需增长板块的预期,外资也大幅流入主要消费板块。 一季度业绩改善和估值修复促成了主要消费板块的上涨。二季度估值修复进入尾声,市场出于对大部分行业业绩下滑压力的担忧,确定性较强的、依靠内需拉动的消费板块继续维持强势。同时,农业板块因为非洲猪瘟疫情的蔓延,在上半年表现亦非常突出。 主要消费指数投资于食品饮料、农林牧渔、商贸零售三大板块,都是人们日常生活密不可分的板块,也是其能够在经济弱势环境下保持较为稳健的业绩增长的主要原因。 报告期内,本基金遵循指数基金的被动投资原则,保持了指数基金的本质属性。股票投资仓位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的。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金份额净值为2.8733元,本报告期份额净值增长率为10.84%,同期业绩比较基准增长率为9.66%。

4.6 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)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	3,205,559,170.56	99.05
	其中:股票	3,205,559,170.56	99.05
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	30,680,785.24	0.95
8	其他资产	28,240.53	0.00
9	合计	3,236,268,196.33	100.00

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	444,650,152.69	13.78
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,629,449,089.61	81.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	130,772,792.88	4.05
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	-	-
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	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,204,872,035.18	99.35

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	363,431.25	0.01
C	制造业	193,958.09	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
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	39,603.76	0.00
J	金融业	33,869.94	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	33,165.74	0.00
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	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.00
S	综合	-	-
	合计	687,135.38	0.02

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通投资股票投资组合。

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	600519	贵州茅台	513,387	505,172,808.00	15.66
2	000858	五粮液	4,002,075	472,044,746.25	14.63
3	600887	伊利股份	12,573,488	420,080,234.08	13.02
4	300498	温氏股份	7,651,527	274,383,758.22	8.51
5	603288	海天味业	1,670,514	175,403,970.00	5.44
6	002304	洋河股份	1,243,259	151,130,564.04	4.69
7	000568	泸州老窖	1,510,251	122,073,588.33	3.78
8	002714	牧原股份	1,720,033	101,120,740.07	3.13
9	601933	永辉超市	7,894,576	80,603,620.96	2.50
10	000876	新希望	4,347,234	75,511,454.58	2.34

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	600968	海油发展	102,375	363,431.25	0.01
2	603915	国茂股份	2,523	58,710.21	0.00
3	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.00
4	603217	元利科技	584	39,268.16	0.00
5	603863	松炀资源	1,612	37,204.96	0.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券投资。

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

注:本基金本报告期末未持有债券投资。

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

注: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

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

注:本基金本报告期末未持有权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期末无股指期货持仓。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:报告期末本基金无国债期货持仓。

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

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	24,283.01
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,957.52
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,240.53

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注: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

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未进行积极投资,不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	869,657,260.00
报告期期间基金总申购份额	286,000,000.00
减:报告期期间基金总赎回份额	33,000,000.00
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	1,122,657,260.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注:本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2019年4月1日至2019年4月24日	100,000,000.00	-	30,000,000.00	70,000,000.00	19.45%

产品特有风险

本基金在报告期内,存在报告期间单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情形,可能会存在以下风险:

1)基金净值大幅波动的风险:当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时,基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券,可能会或证券价格波动,导致本基金的收益水平发生波动。同时,因巨额赎回,份额净值小数保留位数与方式、管理费及托管费等费用计提等原因,可能会导致基金份额净值出现大幅波动;

2)巨额赎回的风险:当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时,可能触发本基金巨额赎回条款,基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额;

3)流动性风险:当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时,可能导致本基金的流动性风险;

4)基金提前终止、转型或与其他基金合并的风险:当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时,可能导致在其赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元,可能导致本基金面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

5)基金规模过小导致的风险:当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时,可能导致基金规模过小,基金可能