中信证券股份有限公司交易型开放式指数证券投资基金2019年第一季度报告

2019-04-29

基金管理人：中信证券股份有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日：2019年4月29日

重要提示

基金管理人的董事会、董事及其董事会成员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和连带责任。

基金管理人的董事会董事代表基金管理人保证本季度报告所载财务指标、净值表现和投资组合情况等内容真实、准确、完整。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年4月29日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合情况等内容，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，也不保证最低投资收益。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资者在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务数据和投资组合情况等内容截至2019年3月31日止。

基金产品概况

基金简称	中证500交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510500
交易代码	510500
基金运作方式	契约型开放式，交易型开放式
基金合同生效日	2013-12-31
报告期末基金份额总额	21,745,717.00
投资目标	本基金为指数型股票基金，主要投资于标的指数成分股及备选成分股。为了更好地实现投资目标，本基金将在扣除成本后，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。如果预期成分股发生调整，或因为其他原因导致标的指数不再具有代表性，或因为其他原因导致标的指数编制方法发生重大变化，或因为其他原因导致本基金与标的指数的偏离或跟踪误差超过上述范围，本基金将采取措施尽快调整投资组合，以期将偏离或跟踪误差控制在上述范围内。
投资策略	本基金采用指数化投资方法，通过对标的指数成分股的分析，根据其流动性、市值规模、行业分布、盈利能力等因素对成分股进行筛选，并结合成分股的权重、预期现金股息率、预期盈利增长率、市盈率、市净率、换手率、波动率、流动性等因素对成分股的预期收益风险进行综合评估，在此基础上对成分股进行优化配置，以期获得与标的指数长期收益率相一致的投资组合。
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为指数型股票基金，其长期风险和预期收益率水平高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。
基金管理人	中信证券股份有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	中证500交易型开放式指数证券投资基金发起式A
下属分级基金的交易代码	510500
报告期末下属分级基金的份额总额	21,745,717.00

主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期（2019-01-01 至 2019-03-31）
1.本期已实现收益	-1,197,000.00
2.本期利润	-1,197,000.00
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0550
4.期末基金资产净值	19,763,179.00
5.期末基金份额净值	0.9088

注：1.本期已实现收益指本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动损益）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损益。

2.所列数据截至报告期末最后一个交易日（或报告期末）。

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
过去一个月	-1.71%	0.71%	-1.71%	0.71%	0.00%	0.00%
过去三个月	-5.50%	0.71%	-5.50%	0.71%	0.00%	0.00%

注：1.本期已实现收益指本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动损益）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损益。

2.所列数据截至报告期末最后一个交易日（或报告期末）。

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
过去一个月	-1.71%	0.71%	-1.71%	0.71%	0.00%	0.00%
过去三个月	-5.50%	0.71%	-5.50%	0.71%	0.00%	0.00%

注：1.本期已实现收益指本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动损益）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损益。

2.所列数据截至报告期末最后一个交易日（或报告期末）。

本报告期内，本基金日均跟踪偏离度的绝对值未超过0.35%，年跟踪误差未超过4%，符合基金合同规定。

管理人对报告期内基金运作遵守情况的说明

本报告期内，本基金管理人在投资组合管理、风险管理、内部控制、信息披露、基金资产估值、基金份额申购赎回等方面，均按照国家有关法律、法规、基金合同、招募说明书等有关规定进行运作，未发生违反法律、法规、基金合同、招募说明书等有关规定的情况。

管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（试行）》、《证券投资基金管理公司内部控制大纲（试行）》、《证券投资基金管理公司公平交易制度实施细则（试行）》、《证券投资基金管理公司公平交易制度评估报告编制指引（试行）》等法律法规的规定，结合公司实际情况，对投资决策、交易执行、信息管理、内部控制、监察稽核等方面采取了有效的控制措施，以保证公平交易制度的有效执行。

本报告期内，公司公平交易制度的执行情况如下：

1、投资决策方面：公司建立了投资决策委员会、投资管理部门、交易部门、风险管理部门、监察稽核部门等部门组成的投资决策体系，各部门分工明确、责任明确。