

# 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3季度报告

2019年09月30日

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10月25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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年10月24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7月1日起至9月30日止。

## § 2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 中信建投北京50ETF  |
| 场内简称       | 北京50   |
| 基金主代码      | 512850   |
| 交易代码       | 512850   |
| 基金运作方式     | 交易型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2018年09月27日  |
| 报告期末基金份额总额 | 25,531,953.00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的最小化。   |
| 投资策略       | 本基金主要采用完全复制法，即按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但因特殊情况（如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等）导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年跟踪 |

|        |  |
|--------|--|
|        | 误差不超过2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。                                 |
| 业绩比较基准 | 中证北京50指数收益率  |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于高风险/高收益的开放式基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。 |
| 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07月01日 - 2019年09月30日） |
|-----------------|--------------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 1,744,341.40                   |
| 2. 本期利润         | -6,344.01                      |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0002                        |
| 4. 期末基金资产净值     | 26,653,435.62                  |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.0439                         |

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 | ①-③ | ②-④ |
|----|--------|-----------|------------|--------------|-----|-----|
|    |        |           |            |              |     |     |

|       |        |       |        |       |       |        |
|-------|--------|-------|--------|-------|-------|--------|
|       |        |       |        | ④     |       |        |
| 过去三个月 | -1.03% | 1.22% | -1.22% | 1.27% | 0.19% | -0.05% |

### 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累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018年09月27日-2019年09月30日)



## § 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 |        |   |
| 王晓贞 | 本基金的基金经理 | 2018-09-27  | -    | 8年     | 中国籍，1982年11月生，山东大学理学硕士。曾任中航证券有限公司从事投资、研究工作；2016年11月加入中信建投基金管理有限公司，曾任产品与金融工程部基金经理，现任本公司投资部-多元资产配置部基金经理，担任中信建投中证北京50交易型 |

|  |  |  |  |  |                      |
|--|--|--|--|--|----------------------|
|  |  |  |  |  | 开放式指数证券投资基金<br>基金经理。 |
|--|--|--|--|--|----------------------|

注：1、任职日期、离任日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写。首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、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 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本报告期内，未出现涉及本基金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成交量5%的情况。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为中证北京50指数，中证北京50指数是将北京市地方国有企业以及北京市的科技和文化产业上市公司作为待选样本，选取市值最大的50只股票作为样本股，采用自由流通市值加权构建的股票指数，用以反映北京市属国企和科技文化产业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标的指数中的权重结构上的差异。权重结构上的差异主要源自以下三个方面：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对基金资产一定比例的占用。本基金管理人在定量分析基础上，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北京50ETF基金份额净值为1.0439元，本报告期内，基金份额净值增长率为-1.03%，同期业绩比较基准收益率为-1.22%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内未发生连续二十个工作日基金份额持有人数量不满200人的情形。

本基金自2019年6月27日至2019年9月18日，连续59个工作日资产净值低于5000万元。

### § 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              | 25,730,301.71 | 95.46         |
|    | 其中：股票             | 25,730,301.71 | 95.46         |
| 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      | 1,207,970.79  | 4.48          |
| 8  | 其他资产              | 15,387.85     | 0.06          |
| 9  | 合计                | 26,953,660.35 | 100.00        |

注：股票投资中包含可退替代款估值增值。

#### 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         | 10,026,905.15 | 37.62         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生 | 312,080.00    | 1.17          |

|   |                 |               |       |
|---|-----------------|---------------|-------|
|   | 产和供应业           |               |       |
| E | 建筑业             | -             | -     |
| F | 批发和零售业          | 241,752.00    | 0.91  |
| G | 交通运输、仓储和邮政业     | -             | -     |
| H | 住宿和餐饮业          | 339,158.00    | 1.27  |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 6,975,311.06  | 26.17 |
| J | 金融业             | 4,146,538.00  | 15.56 |
| K | 房地产业            | 1,214,118.50  | 4.56  |
| L | 租赁和商务服务业        | 415,693.00    | 1.56  |
| M | 科学研究和技术服务业      | -             | -     |
| N | 水利、环境和公共设施管理业   | 255,096.00    | 0.96  |
| 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       | 1,803,650.00  | 6.77  |
| S | 综合              | -             | -     |
|   | 合计              | 25,730,301.71 | 96.54 |

注：上述股票投资组合不包含可退替代款估值增值。

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无余额。

### 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

| 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  | 000725 | 京东方 A | 582,100 | 2,182,875.00 | 8.19         |
| 2  | 601169 | 北京银行  | 348,200 | 1,866,352.00 | 7.00         |
| 3  | 600015 | 华夏银行  | 250,900 | 1,851,642.00 | 6.95         |
| 4  | 000860 | 顺鑫农业  | 21,730  | 1,133,436.80 | 4.25         |
| 5  | 002410 | 广联达   | 27,893  | 989,922.57   | 3.71         |
| 6  | 600271 | 航天信息  | 45,600  | 955,320.00   | 3.58         |
| 7  | 002439 | 启明星辰  | 26,400  | 844,272.00   | 3.17         |

|    |        |      |        |            |      |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 8  | 300383 | 光环新网 | 38,400 | 713,472.00 | 2.68 |
| 9  | 000786 | 北新建材 | 34,600 | 622,800.00 | 2.34 |
| 10 | 600085 | 同仁堂  | 22,640 | 609,016.00 | 2.28 |

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无余额。

#### 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

无余额。

#### 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

无余额。

#### 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

无余额。

#### 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

无余额。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

无。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

#### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 基金投资的前十名股票未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   | 14,715.16 |
| 2  | 应收证券清算款 | -         |



|   |       |           |
|---|-------|-----------|
| 3 | 应收股利  | -         |
| 4 | 应收利息  | 672.69    |
| 5 | 应收申购款 | -         |
| 6 | 其他应收款 | -         |
| 7 | 其他    | -         |
| 8 | 合计    | 15,387.85 |

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无余额。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无余额。

#### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### § 6 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |               |
|---------------------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 39,531,953.00 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 25,000,000.00 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 39,000,000.00 |
| 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               | 25,531,953.00 |

### § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内，基金管理人未持有本基金份额。

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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 | 报告期内持有基金份额变化情况 | 报告期末持有基金情况 |
|---|----------------|------------|

| 资<br>者<br>类<br>别 | 序<br>号 | 持有基金<br>份额比例<br>达到或者<br>超过20%的<br>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<br>构           | 1      | 20190919                               | -             | 10,000,036.00 | 10,000,036.00 | -             | -      |
| 个<br>人           | 1      | 20190701-<br>20190930                  | 14,086,566.00 | -             | -             | 14,086,566.00 | 55.17% |

产品特有风险

本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，无影响投资者决策的其他重要信息。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《中信建投中证北京50交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《中信建投中证北京50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、基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

### 9.3 查阅方式

投资者可以在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

中信建投基金管理有限公司

2019年10月25日