中证能源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：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10月22日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

§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10月18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2019年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富中证能源ETF
场内简称	能源ETF
基金主代码	159930
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	27,398,150.00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	中证能源指数
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7月1日-2019年9月30日）
1.本期已实现收益	168,757.15

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

2.本期利润	-991,546.74
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0477
4.期末基金资产净值	18,889,055.91
5.期末基金份额净值	0.6894

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	-5.34%	0.88%	-6.70%	0.93%	1.36%	-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

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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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		
过蓓蓓	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、汇添富深证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、汇添富中证中药指数（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。	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部助理分析师、量化投资部基金经理助理。2015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3日至今任中证主要消费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、汇添富中证主要消费ETF联接基金的基金经理，2015年8月18日至今任汇添富深证300ETF基金、汇添富深证300ETF基金联接基金的基金经理，2016年12月22日至今任汇添富中

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

					证生物科技指数（LOF）基金的基金经理，2016年12月29日至今任汇添富中证中药指数（LOF）基金的基金经理，2018年5月23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23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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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7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

三季度经济增速下行压力仍然较大，但9月的高频数据显示相对7…~8月较差的经济数据可能有所改善。在全球经济下行背景下，中国经济总体表现出更强的韧性。分项来看，受政策调控和融资收紧影响，三季度房地产投资增速持续进入下行区间；前期专项债集中发行叠加低基数的影响，基建投资稳中有升；在各项政策扶持下，制造业投资持续小幅反弹；消费在剔除汽车拖累后，总体保持平稳。贸易摩擦仍存在较大的不确定性，但市场对于贸易摩擦已经相对钝化，重点仍是政策落地和宏观数据能否提升经济阶段性企稳的预期。

货币政策方面，整体稳健货币政策的基调不变，央行货币政策委员会三季度例会显示政策强调定力，不搞大水漫灌，中长期大概率仍将维持流动性合理充裕，资金利率维持在较低水平。

资本市场的重要性进一步提升。9月证监会在京召开全面深化资本市场改革工作座谈会，部署了深化资本市场改革的12个方面重点任务。会议明确资本市场改革发展工作成果和目标，强调鼓励资本市场发展以及金融科技建设。外管局宣布取消QFII 和RQFII投资额度限制，海外增量资金有望持续进入A股。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

能源行业具有周期属性，和国际油价、国内工业生产需求、供给侧改革都有明显的相关性。能源ETF主要覆盖能源板块的上游部分，与能源价格有较强的正相关关系，投资者可通过能源ETF把握阶段性交易机会。

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0.6894元；本报告期基金份额净值增长率为-5.34%，业绩比较基准收益率为-6.70%。

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	18,918,997.77	99.44
	其中：股票	18,918,997.77	99.44
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	106,316.53	0.56
8	其他资产	468.94	0.00
9	合计	19,025,783.24	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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	15,946,417.37	84.42
C	制造业	2,012,712.94	10.66
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	550,832.46	2.92
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	409,035.00	2.17
	合计	18,918,997.77	100.16

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股票投资。

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（%）

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

1	601088	中国神华	155,407	2,918,543.46	15.45
2	600028	中国石化	560,708	2,814,754.16	14.90
3	601857	中国石油	410,046	2,538,184.74	13.44
4	601225	陕西煤业	241,924	2,111,996.52	11.18
5	002353	杰瑞股份	28,774	777,185.74	4.11
6	600583	海油工程	131,503	708,801.17	3.75
7	000723	美锦能源	74,800	684,420.00	3.62
8	600188	兖州煤业	53,725	572,171.25	3.03
9	000983	西山煤电	94,996	558,576.48	2.96
10	600688	上海石化	132,160	551,107.20	2.92

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。

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:报告期末本基金无股指期货持仓。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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	390.69
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	78.25
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	468.94

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未存在流通受限情况。

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。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

无

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	16,398,150.00
报告期期间基金总申购份额	11,000,000.00
减:报告期期间基金总赎回份额	-
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	27,398,150.00

§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能源交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；

2、《汇添富中证能源交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

3、《汇添富中证能源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能源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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

投资者可于本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10月22日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn