

# 汇添富中证环境治理指数型证券投资基金 (LOF) 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

## § 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	汇添富中证环境治理指数（LOF）
基金主代码	501030
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 12 月 29 日
报告期末基金份额总额	159,723,684.51 份
投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪中证环境治理指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，以便为投资者带来长期收益。
投资策略	本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。在正常市场情况下，日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。
业绩比较基准	中证环境治理指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型

	基金与货币市场基金，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司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	
下属分级基金的基金简称	汇添富中证环境治理指数 A	汇添富中证环境治理指数 C
下属分级基金的场内简称	环境治理	环境 C
下属分级基金的交易代码	501030	501031
报告期末下属分级基金的份额总额	92,944,052.17 份	66,779,632.34 份

### § 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）	
	汇添富中证环境治理指数 A	汇添富中证环境治理指数 C
1. 本期已实现收益	-2,370,441.69	-1,859,367.52
2. 本期利润	-4,942,932.66	-3,380,813.66
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0538	-0.0475
4. 期末基金资产净值	51,214,890.64	36,795,354.47
5. 期末基金份额净值	0.5510	0.5510

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

汇添富中证环境治理指数 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标	业绩比较基准	业绩比较基准	①—③	②—④
----	--------	--------	--------	--------	-----	-----

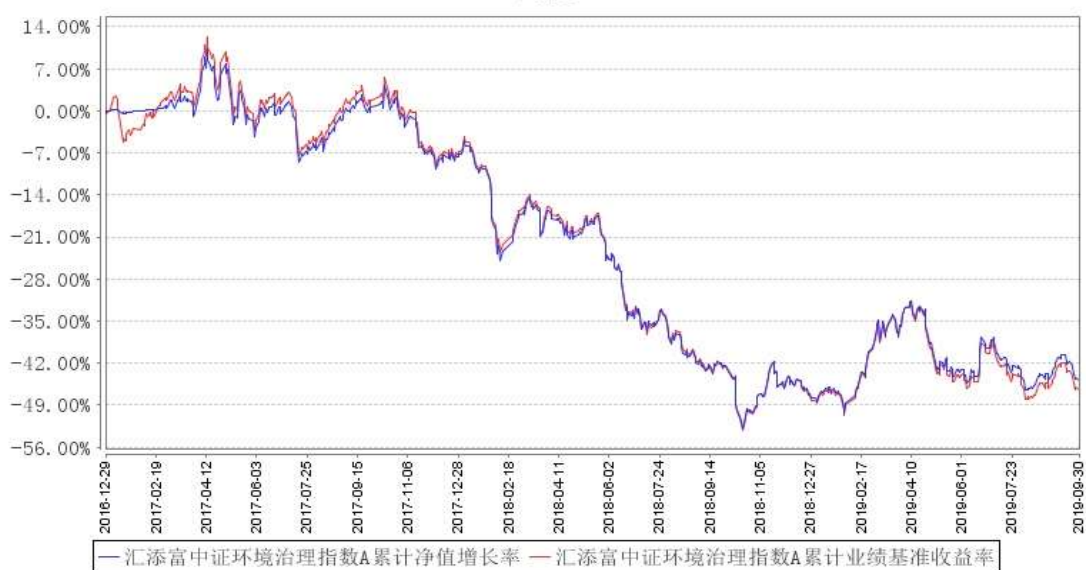
		准差②	收益率③	收益率标准差 ④		
过去三个月	-8.84%	1.22%	-10.38%	1.29%	1.54%	-0.07%

汇添富中证环境治理指数 C

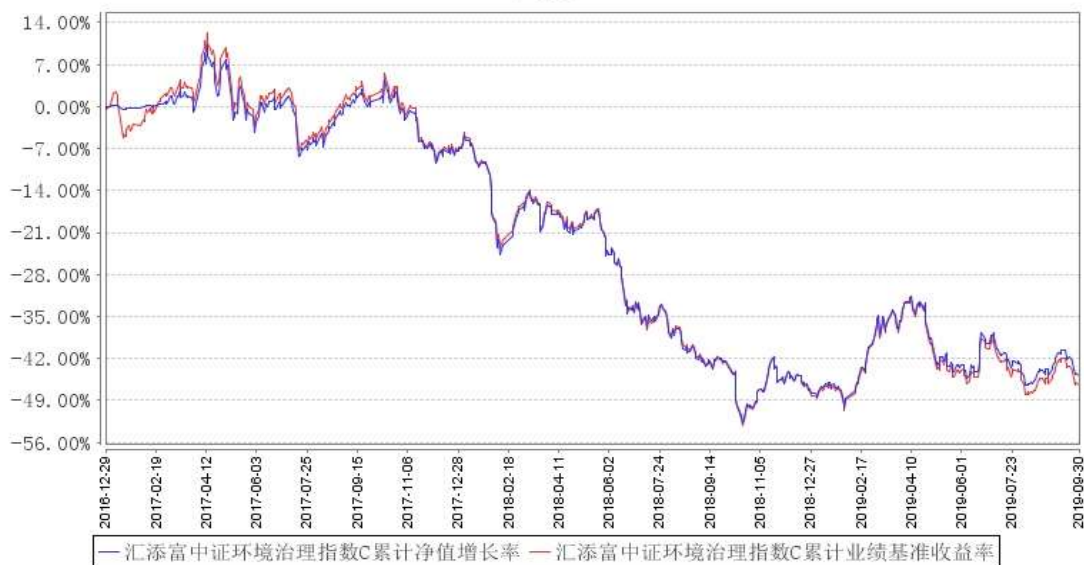
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-8.87%	1.22%	-10.38%	1.29%	1.51%	-0.07%

### 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

汇添富中证环境治理指数A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



汇添富中证环境治理指数C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2016 年 12 月 29 日）起 6 个月，建仓期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		
赖中立	汇添富黄金及贵金属基金(LOF)的基金经理、汇添富恒生指数分级(QDII)基金、汇添富深证300ETF基金、汇添富深证300ETF联接基金、汇添富中证环境治理指数(LOF)基	2016年12月29日	-	12年	国籍：中国，学历：北京大学中国经济研究中心金融学硕士，相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任泰达宏利基金管理有限公司风险管理分析师。2010年8月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任金

	<p>金、汇添富 优选回报混 合基金、汇 添富中证港 股通高股息 投资指数 （LOF）基金 的基金经 理。</p>			<p>融工程部分析 师、基金经理 助理。2012 年 11 月 1 日至今 任汇添富黄金 及贵金属基金 （LOF）的基金 经理，2014 年 3 月 6 日至今 任汇添富恒生 指数分级 （QDII）基金 的基金经理， 2015 年 1 月 6 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， 2015 年 5 月 26 日至 2016 年 7 月 13 日任汇 添富香港优势 混合基金的基 金经理，2016 年 12 月 29 日 至今任汇添富 中证环境治理 指数（LOF）基 金的基金经 理，2017 年 5 月 18 日至今 任汇添富优选 回报混合基金 的基金经理， 2017 年 11 月 24 日至今任汇 添富中证港股 股通高股息投 资指数（LOF） 基金的基金经 理。</p>
--	---	--	--	--

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合规守信情况的说明

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

回顾 2019 年三季度，A 股市场出现了窄幅震荡的走势，而环境治理板块也跟随市场表现。在两年的去杠杆政策下，资金密集型的环保板块整体债务融资开始收紧，有息负债率从 2017 年的 52.06% 下降到 2018 年的 50.92%。而随着融资端的约束，板块扣非净利润也呈现较大降幅。因此，2019 年三季度以来，环保行业相对于市场其他行业而言表现并不突出。另一方面，环保行业的相关政策不断推出，对环保行业的上市公司业绩起到一定程度的支撑作用，而环保企业自身也在积极进行调整以适应当前的宏观经济环境。总体来看，2019 年前三季度环保行业仍处于转型调整的阶段中，市场表现较为平淡。

报告期内，本基金按照基金合同，按照完全复制法进行中证环境治理指数成份股指数化投资，严控基金跟踪误差，以期为投资者带来与中证环境治理指数一致的收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末汇添富中证环境治理指数 A 基金份额净值为 0.5510 元，本报告期基金份额净值增长率为-8.84%；截至本报告期末汇添富中证环境治理指数 C 基金份额净值为 0.5510 元，本报告期基金份额净值增长率为-8.87%；同期业绩比较基准收益率为-10.38%。

#### 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	81,886,462.11	92.45
	其中：股票	81,886,462.11	92.45
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	5,709,829.27	6.45
8	其他资产	982,249.34	1.11
9	合计	88,578,540.72	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	24,993,009.71	28.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	14,998,390.27	17.04
E	建筑业	5,005,094.80	5.69
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	-	-
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	3,356,796.20	3.81
N	水利、环境和公共设施管理业	33,401,936.11	37.95
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	81,755,227.09	92.89

### 5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

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	53,036.38	0.06
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	78,198.64	0.09
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	131,235.02	0.15

### 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。

### 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	300007	汉威科技	200,800	2,610,400.00	2.97
2	002479	富春环保	353,859	2,586,709.29	2.94
3	603686	龙马环卫	213,680	2,476,551.20	2.81
4	603568	伟明环保	116,022	2,410,937.16	2.74
5	600323	瀚蓝环境	135,131	2,394,521.32	2.72

6	000598	兴蓉环境	440,549	2,110,229.71	2.40
7	300495	美尚生态	165,689	2,071,112.50	2.35
8	002887	绿茵生态	134,010	2,063,754.00	2.34
9	000925	众合科技	313,713	2,035,997.37	2.31
10	000035	中国天楹	352,273	2,000,910.64	2.27

### 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	603927	中科软	884	78,198.64	0.09
2	300790	宇瞳光学	671	31,094.14	0.04
3	603786	科博达	816	21,942.24	0.02

### 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：本基金本报告期末未持有股指期货。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

## 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	17,461.12
2	应收证券清算款	102,072.63
3	应收股利	-
4	应收利息	1,218.98
5	应收申购款	861,496.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	982,249.34

### 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：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。本基金本报告期末未进行指数投资，不存在流通受限情况。

#### 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

序号	股票代码	公司名称	流通受限部分的公 允价值（元）	占基金资产净 值比例（%）	流通受限情况 说明
1	603786	科博达	21,942.24	0.02	新股流通受限

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富中证环境治理指数 A	汇添富中证环境治理指数 C
报告期期初基金份额总额	85,860,729.41	63,077,770.61
报告期期间基金总申购份额	36,157,454.95	80,004,814.61
减：报告期期间基金总赎回份额	29,074,132.19	76,302,952.88
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	92,944,052.17	66,779,632.34

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## §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

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环境治理指数型证券投资基金（LOF）募集的文件；

- 2、《汇添富中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《汇添富中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）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环境治理指数型证券投资基金（LOF）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](http://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