# 中证能源交易型开放式指数证券投资基金

## 2018年第三季度报告

2018年9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：2018年10月26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2018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2018年7月1日起至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 |
| 交易代码 | 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 | 17,398,150.00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（2018年7月1日－2018年9月30日） |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 79,096.34 |
| 2.本期利润 | 1,116,195.82 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0585 |
| 4.期末基金资产净值 | 14,037,419.20 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.8068 |

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。

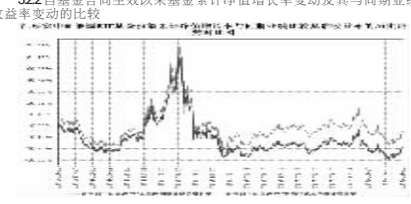
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 | 8.21% | 1.25% | 6.78% | 1.24% | 1.43% | 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（2018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 | | |
| 过蓉蓉 | 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）基金的基金经理。 | 2015年8月3日 | - | 7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日至今任汇添富保证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。 |

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管理人对报告期内本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

2018年三季度沪深300指数下跌2.05%，创业板指下跌12.16%，恒生指数下跌4.03%。全球贸易争端升级、新兴市场货币危机、美联储加息是影响三季度全球市场的主要因素。美国工业产出、ISM制造业和非制造业PMI等数据均显示强劲的增长动能，而通胀相对保持稳定，导致美元相对走强，全球范围内资金在不同资产流动带来压力，中美利差不断收窄，新兴市场资金流出增大。

三季度，金融去杠杆对A股的负面影响边际钝化，紧信用的环境得以改善，但信用放松的滞后效应导致三季度并未出现明显的融资上升，非金融企业盈利下滑短期尚未得到抑制，预计四季度A股市场还将面临企业下调盈利预期的压力。

从宏观经济基本面来看，9月以来生产数据依旧偏弱，发电耗煤量增速继续为负且扩大。汽车批零销量不见起色对社会零售品消费增速仍然是制约，海外油价不断攀升带来CPI增速回升压力。投资方面，房地产投资继续回落，基建与制造业投资增速改善，且将成为四季度支撑投资的最关键因素。9月下旬，促销费、降税费改革政策细则落地，未来执行力度能否超市场预期将成为影响风险溢价的焦点。四季度，外部的贸易摩擦、美联储加息对新兴市场冲击等还需观察，我国国内也做出相应对冲措施来稳定投资者预期，改善风险偏好，对市场整体仍需要维持谨慎。国际能源价格在今年受地缘政治因素影响上涨，中证能源是能源板块的上游部分，与能源价格有较强的正相关关系。

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0.8068元；本报告期基金份额净值增长率为8.21%，业绩比较基准收益率为6.78%。

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 | 14,025,072.96 | 98.54 |
| | 其中：股票 | 14,025,072.96 | 98.54 |
| 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 | 133,874.97 | 0.94 |
| 8 | 其他资产 | 73,683.13 | 0.52 |
| 9 | 合计 | 14,232,631.06 | 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 | 12,554,369.20 | 89.44 |
| C | 制造业 | 910,336.32 | 6.49 |
| 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 | 343,293.44 | 2.45 |
| 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 | 217,074.00 | 1.55 |
| | 合计 | 14,025,072.96 | 99.91 |

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（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 601857 | 中国石油 | 254,546 | 2,334,186.82 | 16.63 |
| 2 | 600028 | 中国石化 | 324,508 | 2,310,496.96 | 16.46 |
| 3 | 601088 | 中国神华 | 76,807 | 1,566,094.73 | 11.16 |
| 4 | 601225 | 陕西煤业 | 155,024 | 1,348,708.80 | 9.61 |
| 5 | 600256 | 广汇能源 | 156,287 | 798,626.57 | 5.69 |
| 6 | 600583 | 海油工程 | 85,303 | 576,648.28 | 4.11 |
| 7 | 000983 | 西山煤电 | 61,396 | 408,283.40 | 2.91 |
| 8 | 002353 | 杰瑞股份 | 18,674 | 406,719.72 | 2.90 |
| 9 | 600157 | 永泰能源 | 239,885 | 400,607.95 | 2.85 |
| 10 | 600188 | 兖州煤业 | 34,625 | 398,880.00 | 2.84 |

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证券。

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。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11投资组合报告附注

5.11.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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 | 270.83 |
| 2 | 应收证券清算款 | 73,381.39 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 30.91 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 73,683.13 |

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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 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 | 600157 | 永泰能源 | 400,607.95 | 2.85 | 重大事项停牌 |

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 | 19,398,150.00 |
| 报告期期间基金总申购份额 | - |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 2,000,000.00 |
| 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 | 17,398,150.00 |

§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

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

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
2018年10月26日

# 中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金

## 2018年第三季度报告

2018年9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：2018年10月26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2018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2018年7月1日起至9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 |
| 交易代码 | 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 | 17,828,511.00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（2018年7月1日－2018年9月30日） |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 304,128.62 |
| 2.本期利润 | 1,642,666.79 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0937 |
| 4.期末基金资产净值 | 26,741,355.45 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.4999 |

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。

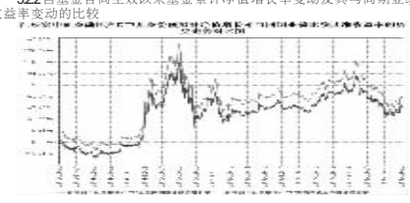
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 | 6.54% | 1.45% | 5.15% | 1.46% | 1.39% | -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（2018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 | | |
| 过蓉蓉 | 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）基金的基金经理。 | 2015年8月3日 | - | 7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日至今任汇添富保证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。 |

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管理人对报告期内本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

2018年三季度沪深300指数下跌2.05%，创业板指下跌12.16%，恒生指数下跌4.03%。全球贸易争端升级、新兴市场货币危机、美联储加息是影响三季度全球市场的主要因素。美国工业产出、ISM制造业和非制造业PMI等数据均显示强劲的增长动能，而通胀相对保持稳定，导致美元相对走强，全球范围内资金在不同资产流动带来压力，中美利差不断收窄，新兴市场资金流出增大。

三季度，金融去杠杆对A股的负面影响边际钝化，紧信用的环境得以改善，但信用放松的滞后效应导致三季度并未出现明显的融资上升，非金融企业盈利下滑短期尚未得到抑制，预计四季度A股市场还将面临企业下调盈利预期的压力。

从宏观经济基本面来看，9月以来生产数据依旧偏弱，发电耗煤量增速继续为负且扩大。汽车批零销量不见起色对社会零售品消费增速仍然是制约，海外油价不断攀升带来CPI增速回升压力。投资方面，房地产投资继续回落，基建与制造业投资增速改善，且将成为四季度支撑投资的最关键因素。9月下旬，促销费、降税费改革政策细则落地，未来执行力度能否超市场预期将成为影响风险溢价的焦点。四季度，外部的贸易摩擦、美联储加息对新兴市场冲击等还需观察，我国国内也做出相应对冲措施来稳定投资者预期，改善风险偏好，对市场整体仍需要维持谨慎。银行目前PE估值和PB估值均在5年低位，中长期仍具较好配置价值，且经济下行期财政政策和表内信贷料会有松绑，银行基本面压力不大。

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14999元；本报告期基金份额净值增长率为6.54%，业绩比较基准收益率为5.15%。

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 | 26,696,111.50 | 99.20 |
| | 其中：股票 | 26,696,111.50 | 99.20 |
| 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 | 215,509.89 | 0.80 |
| 8 | 其他资产 | 180.94 | 0.00 |
| 9 | 合计 | 26,911,802.33 | 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 | 12,452,584.10 | 19.85 |
| J | 金融业 | 3,357,322.00 | 5.35 |
| 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 | 47,620.00 | 0.18 |
| | 合计 | 26,696,111.50 | 99.83 |

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（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 601318 | 中国平安 | 66,486 | 4,554,291.00 | 17.03 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 63,199 | 1,939,577.31 | 7.25 |
| 3 | 601166 | 兴业银行 | 76,558 | 1,221,100.10 | 4.57 |
| 4 | 600016 | 民生银行 | 174,170 | 1,104,237.80 | 4.13 |
| 5 | 601328 | 交通银行 | 168,637 | 984,840.08 | 3.68 |
| 6 | 601288 | 农业银行 | 235,176 | 914,834.64 | 3.42 |
| 7 | 600030 | 中信证券 | 48,549 | 810,282.81 | 3.03 |
| 8 | 600000 | 浦发银行 | 72,080 | 765,489.60 | 2.86 |
| 9 | 601398 | 工商银行 | 132,382 | 763,844.14 | 2.86 |
| 10 | 000002 | 万科A | 29,831 | 724,893.30 | 2.71 |

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。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11投资组合报告附注

5.11.1

本基金投资前十名证券中的浦发银行（600000）于2018年1月20日公告收到银监会四川监管局行政处罚决定书（[2018]2号），银监会四川监管局针对授信管理违规执行罚款46.15万元。我司经过研究评估，认为此事件对浦发银行经营业绩未产生重大的实质影响，对其投资价值未产生实质影响。本基金持有该股经过合理的投资决策授权审批，符合指数基金投资管理规定。

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 | 142.06 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 38.88 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 180.94 |

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 | 17,328,511.00 |
| 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 | - |
| 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 | 17,828,511.00 |

§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

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层 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
2018年10月26日

# 汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金(LOF)

## 2018年第三季度报告

2018年9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：2018年10月26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2018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2018年7月1日起至9月30日止。

§2基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 汇添富中证互联网医疗指数(LOF) |
| 交易代码 | 501007 |
| 基金运作方式 | 上市契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016年12月22日 |
| 报告期末基金份额总额 | 70,890,425.73份 |
| 投资目标 | 本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪中证互联网医疗主题指数，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跟踪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。本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的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%。 |
| 业绩比较基准 | 中证互联网医疗主题指数收益率×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 | 汇添富中证互联网医疗指数A / 汇添富中证互联网医疗指数C |
| 下属分级基金的场内简称 | 互联医疗 / 互联医C |
| 下属分级基金的交易代码 | 501007 / 501008 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 45,113,124.83份 / 25,777,300.90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（2018年7月1日－2018年9月30日） | |
|---|---|---|
| | 汇添富中证互联网医疗指数A | 汇添富中证互联网医疗指数C |
| 1. 本期已实现收益 | 81,543.42 | 42,075.71 |
| 2. 本期利润 | - 5,225,408.75 | - 2,963,743.78 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | - 0.1154 | - 0.1124 |
| 4. 期末基金资产净值 | 39,983,987.40 | 22,754,846.35 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.8863 | 0.8827 |

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

汇添富中证互联网医疗指数A

| 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 | - 11.50% | 1.88% | - 10.99% | 1.90% | - 0.51% | - 0.02% |

汇添富中证互联网医疗指数C

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较