

中证能源交易型开放式指数证券投资基金

2017年第三季度报告

建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。
3.2 其他指标
注:无

§ 4 管理人报告

姓名	职务	任本基金的基金经理时间	证券从业年限	说明
过桥前	过桥前	2015年8月2日	11年	过桥前

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“离任日期”为根据公司公告确定的解聘日期;
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,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为,为基金份额持有人合法权益的维护。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,建立了科学、有效的公平交易管理制度,形成涵盖开放式基金、特定客户资产管理以及社保、养老委托资产的投资管理,涉及交易所市场、银行间市场等投资市场,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,基金管理人对于公平交易制度和公平交易机制实施了流程优化和进一步系统化,确保全流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未出现参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较多的单边交易量超过该证券当日总成交量%的情况,经检查和统计分析未发现异常情形。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
2017年三季度沪深300指数上涨1.63%,全球股市表现良好,人民币升值近2%。6月开始的资产价格反弹一直持续的三季度,金融监管预期下降,流动性预期及风险偏好逐渐修复,叠加环保限产和供给侧改革带来的“涨价”行情,资产价格不断修复,尤其以商品和周期股的反弹最为显著。大小盘风格差异在三季度也已经出现平复状态,创业板指结束连续四个季度的下跌,三季度上涨2.69%,龙头

股行情向二线行情扩散,市场整体上依然认可行业龙头的投资逻辑,这也将是全年的主旋律。三季度末,房地产政策进一步收紧将拖累地产后周期的行情,环保督察力度不断加大,导致投资增速短期内下行和供需缺口再次出现。因此,预计四季度流动性需求平衡短期内仍然持续,经济数据也难有超预期表现,市场投资重点在低估值、业绩确定性较高的个股和行业上寻找补涨的机会,以及较低的波动率较高的风险收益比。

报告期内,本基金遵循指数基金的被动投资策略,保持了指数基金的基本属性,股票投资仓位报告期内基本保持在96%~100%之间,基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目标。

4.5 报告期内基金的业绩表现
报告期内中证能源指数上涨6.26%,本基金在报告期内累计收益率为7.98%,收益率超越业绩比较基准1.72%。收益率的差异因素主要来源于期间成份股分红、日常申购赎回、基金费用等因素。本基金日均跟踪误差为0.0681%,这一跟踪误差水平符合合同约定,在报告期内达到了投资目标。

4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明
报告期内,本基金已连续6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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	9,770,380.03	97.92
1.1	其中:股票	9,770,380.03	97.92
2	固定收益投资	—	—
2.1	其中:债券	—	—
3	货币资金	—	—
4	资产支持证券	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
7	其他资产	227,333.28	2.32
8	合计	10,000,125.29	100.00

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	637,772.06	0.63
B	采矿业	638,794.34	0.63
C	制造业	—	—
D	电力、热力、燃气及生产和服务供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	497,139.24	0.49
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
I	金融业	—	—
J	房地产业	—	—
K	租赁和商务服务业	—	—
L	科学研究和技术服务业	—	—
M	水利、环境和公共设施管理业	—	—
N	卫生和社会工作	—	—
O	教育	—	—
P	文化、体育和娱乐业	—	—
Q	综合	9,770,380.03	99.79

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

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:2017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。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月23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2017年7月1日起至9月30日止。

基金名称	中证能源交易型ETF
场内简称	能源ETF
交易代码	510010
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015年10月23日
报告期末基金份额总额	11,289,160.09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	本基金主要采用完全复制法,在正常市场情况下,日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.21%,年化跟踪误差率不超过0.25%。
业绩比较基准	中证能源指数收益率*95%+银行人民币同期存款利率*5%
风险收益特征	本基金属于中高风险品种,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金,主要投资于中证能源指数成份股及备选成份股,具有与标的指数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(2017年7月1日~2017年9月30日)
1.本期已实现收益	196,130.62
2.本期利润	460,559.71
3.报告期内基金净收益总额	6,000.00
4.期末基金资产净值	9,793,000.08
5.期末基金份额净值	0.8600

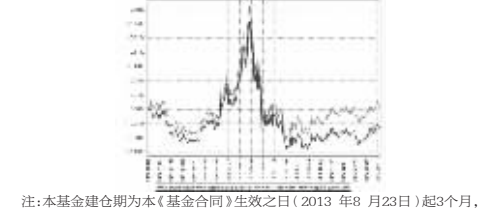
注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	1-3	2-4
过去三个月	7.08%	1.15%	6.26%	1.15%	1.72%	0.00%

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:本基金建仓期为自本基金(基金合同)生效之日起(2013年7月23日)起3个月,建仓结束

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:2017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。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月23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2017年7月1日起至9月30日止。

基金名称	中证能源交易型ETF
场内简称	能源ETF
交易代码	510010
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015年10月23日
报告期末基金份额总额	12,289,160.09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	本基金主要采用完全复制法,在正常市场情况下,日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.21%,年化跟踪误差率不超过0.25%。
业绩比较基准	中证能源指数收益率*95%+银行人民币同期存款利率*5%
风险收益特征	本基金属于中高风险品种,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金,主要投资于中证能源指数成份股及备选成份股,具有与标的指数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

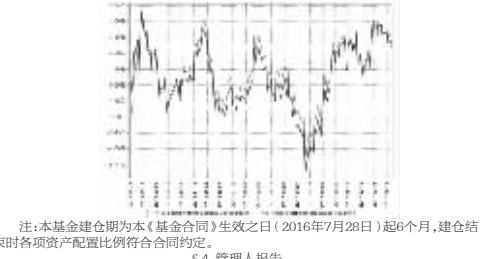
主要财务指标	报告期(2017年7月1日~2017年9月30日)
1.本期已实现收益	51,015,729.44
2.本期利润	126,356,467.47
3.报告期内基金净收益总额	600,000.00
4.期末基金资产净值	12,443,780,361.89
5.期末基金份额净值	1.0110

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	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	1-3	2-4
过去三个月	0.89%	0.62%	0.16%	0.62%	0.73%	-0.01%



注:本基金建仓期为自本基金(基金合同)生效之日起(2016年7月28日)起6个月,建仓结束

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:2017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。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月23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2017年7月1日起至9月30日止。

基金名称	中证能源交易型ETF
场内简称	能源ETF
交易代码	510010
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015年10月23日
报告期末基金份额总额	1,109,191.23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	本基金主要采用完全复制法,在正常市场情况下,日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.21%,年化跟踪误差率不超过0.25%。
业绩比较基准	中证能源指数收益率*95%+银行人民币同期存款利率*5%
风险收益特征	本基金属于中高风险品种,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金,主要投资于中证能源指数成份股及备选成份股,具有与标的指数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(2017年7月1日~2017年9月30日)
1.本期已实现收益	42,115,460.00
2.本期利润	17,328,567.47
3.报告期内基金净收益总额	600,000.00
4.期末基金资产净值	1,843,235,028.18
5.期末基金份额净值	1.6610

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。

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。

2.1 目标基金基本情况

基金名称	中证能源交易型ETF
场内简称	能源ETF
交易代码	510010
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015年10月23日
报告期末基金份额总额	1,109,191.23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	本基金主要采用完全复制法,在正常市场情况下,日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.21%,年化跟踪误差率不超过0.25%。
业绩比较基准	中证能源指数收益率*95%+银行人民币同期存款利率*5%
风险收益特征	本基金属于中高风险品种,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金,主要投资于中证能源指数成份股及备选成份股,具有与标的指数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

2.2 目标基金产品说明

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	本基金主要采用完全复制法,在正常市场情况下,日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.21%,年化跟踪误差率不超过0.25%。
业绩比较基准	中证能源指数收益率*95%+银行人民币同期存款利率*5%
风险收益特征	本基金属于中高风险品种,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金,主要投资于中证能源指数成份股及备选成份股,具有与标的指数相似的风险收益特征。

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2017年7月1日~2017年9月30日)
1.本期已实现收益	42,115,460.00
2.本期利润	17,328,567.47
3.报告期内基金净收益总额	600,000.00
4.期末基金资产净值	1,843,235,028.18
5.期末基金份额净值	1.6610

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。

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。

2017年第三季度报告

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	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	1-3	2-4
过去三个月	0.89%	0.62%	0.16%	0.62%	0.73%	-0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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:本基金建仓期为自本基金(基金合同)生效之日起(2016年9月18日)起6个月,建仓结束

§ 4 管理人报告

姓名	职务	任本基金的基金经理时间	证券从业年限	说明
过桥前	过桥前	2015年9月18日	17年	过桥前

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“离任日期”为根据公司公告确定的解聘日期;
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,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为,为基金份额持有人合法权益的维护。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,建立了科学、有效的公平交易管理制度,形成涵盖开放式基金、特定客户资产管理以及社保、养老委托资产的投资管理,涉及交易所市场、银行间市场等投资市场,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,基金管理人对于公平交易制度和公平交易机制实施了流程优化和进一步系统化,确保全流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未出现参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较多的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的情况,经检查和统计分析未发现异常情形。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

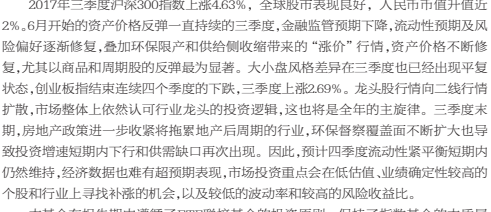
2017年三季度沪深300指数上涨4.63%,全球股市表现良好,人民币升值近2%。6月开始的资产价格反弹一直持续的三季度,金融监管预期下降,流动性预期及风险偏好逐渐修复,叠加环保限产和供给侧改革带来的“涨价”行情,资产价格不断修复,尤其以商品和周期股的反弹最为显著。大小盘风格差异在三季度也已出现平复状态,创业板指结束连续四个季度的下跌,三季度上涨2.69%,龙头

2017年第三季度报告

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	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	1-3	2-4
过去三个月	0.89%	0.62%	0.16%	0.62%	0.73%	-0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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:本基金建仓期为自本基金(基金合同)生效之日起(2016年9月18日)起6个月,建仓结束

§ 4 管理人报告

姓名	职务	任本基金的基金经理时间	证券从业年限	说明
过桥前	过桥前	2015年9月18日	17年	过桥前

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“离任日期”为根据公司公告确定的解聘日期;
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,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为,为基金份额持有人合法权益的维护。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,建立了科学、有效的公平交易管理制度,形成涵盖开放式基金、特定客户资产管理以及社保、养老委托资产的投资管理,涉及交易所市场、银行间市场等投资市场,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,基金管理人对于公平交易制度和公平交易机制实施了流程优化和进一步系统化,确保全流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未出现参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较多的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的情况,经检查和统计分析未发现异常情形。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年三季度沪深300指数上涨4.63%,全球股市表现良好,人民币升值近2%。6月开始的资产价格反弹一直持续的三季度,金融监管预期下降,流动性预期及风险偏好逐渐修复,叠加环保限产和供给侧改革带来的“涨价”行情,资产价格不断修复,尤其以商品和周期股的反弹最为显著。大小盘风格差异在三季度也已出现平复状态,创业板指结束连续四个季度的下跌,三季度上涨2.69%,龙头

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

注：本基金本报告期末未持有任何权证股票资产。					
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	600038	中信银行	220,549	1,300,497.28	11.29
2	600088	中视传媒	50,297	1,239,794.68	12.66
3	600067	中国船舶	146,436	1,214,115.64	11.87
4	601226	欧陆集团	38,109	732,211.20	6.99
5	600157	本钢集团	148,386	536,340.65	5.48
6	000063	西南证券	47,296	497,621.76	4.83
7	600068	上海银行	66,600	414,314.65	4.22
8	600635	南华生物	66,231	407,410.48	4.17
9	600268	三爱富	10,267	394,766.07	4.02
10	600689	徽商银行	36,394	368,559.00	3.95