

华富中证人工智能产业交易型开放式指数 证券投资基金 2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：华富基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2020 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
7.6 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	45

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	45
7.8 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贵金属投资明细	45
7.9 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	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.12 投资组合报告附注	45
§ 8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2 期末上市基金前十名持有人	46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	47
§ 9 开放式基金份额变动	47
§ 10 重大事件揭示	47
10.1 基金份额持有人大会决议	47
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	49
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
10.8 其他重大事件	51
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	52
11.1 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	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	52
§ 12 备查文件目录	52
12.1 备查文件目录	52
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华富中证人工智能产业 ETF
场内简称	人工智能
基金主代码	515980
交易代码	515980
基金运作方式	契约型开放（ETF）
基金合同生效日	2019 年 12 月 24 日
基金管理人	华富基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	449,064,500.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020 年 2 月 10 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证人工智能产业指数。在正常市场情况下，力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.20% 以内，年跟踪误差控制在 2% 以内。
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 0.20%，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	中证人工智能产业指数收益率
风险收益特征	<p>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。</p> <p>本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪中证人工智能产业指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。</p>

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	华富基金管理有限公司	招商银行股份有限公司	
信息披露 负责人	姓名	满志弘	张燕
	联系电话	021-68886996	0755-83199084
	电子邮箱	manzh@hffund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话	400-700-8001	95555	
传真	021-68887997	0755-83195201	
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区栖霞路 26 弄 1 号 3 层、4 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦	
办公地址	上海市浦东新区栖霞路 18 号陆家嘴富汇大厦 A 座 3 楼、5 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦	
邮政编码	200120	518040	
法定代表人	赵万利	李建红	

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.hffund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华富基金管理有限公司	上海市浦东新区栖霞路 18 号陆家嘴富汇大厦 A 座 3 楼、5 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年1月1日-2020年6月30日)
本期已实现收益	13,926,786.38
本期利润	13,333,564.62
加权平均基金份额本期利润	0.0294
本期加权平均净值利润率	2.71%
本期基金份额净值增长率	14.20%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	35,997,971.35
期末可供分配基金份额利润	0.0802
期末基金资产净值	512,791,651.08
期末基金份额净值	1.1419
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	14.19%

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) 以上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（例如，开放式基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3) 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数，表中的“期末”均指报告期最后一日，即 6 月 30 日。

3.2 基金净值表现

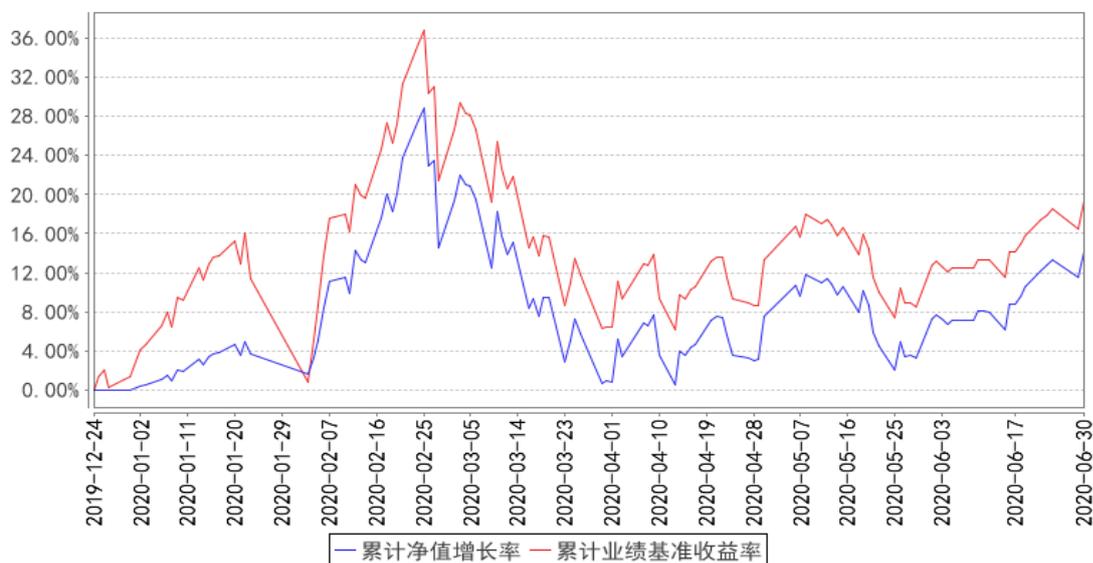
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	10.51%	1.31%	9.98%	1.30%	0.53%	0.01%
过去三个月	13.19%	1.78%	12.12%	1.80%	1.07%	-0.02%
过去六个月	14.20%	2.19%	17.84%	2.55%	-3.64%	-0.36%
自基金合同生效起至今	14.19%	2.13%	21.14%	2.50%	-6.95%	-0.37%

注：业绩比较基准收益率=中证人工智能产业指数收益率，业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

华富中证人工智能产业ETF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：根据《华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的规定，本基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%；股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金合同生效未满一年。本基金建仓期为2019年12月24日到2020年6月24日，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本报告期内，本基金严格执行了《华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人华富基金管理有限公司于2004年3月29日经中国证监会证监基金字[2004]47号文核准开业，4月19日在上海正式注册成立。注册资本2.5亿元，公司股东为华安证券股份有限公司、安徽省信用担保集团有限公司和合肥兴泰金融控股（集团）有限公司。截止2020年6月30日，本基金管理人管理了华富竞争力优选混合型证券投资基金、华富货币市场基金、华富成长趋势混合型证券投资基金、华富收益增强债券型证券投资基金、华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金、华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金、华富中证100指数证券投资基金、华富强化回报债券型证券投资基金、华富量子生命力混合型证券投资基金、华富中小板指数增强型

证券投资基金、华富安鑫债券型证券投资基金、华富灵活配置混合型证券投资基金、华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金、华富恒稳纯债债券型证券投资基金、华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金、华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金、华富恒利债券型证券投资基金、华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金、华富安享债券型证券投资基金、华富安福债券型证券投资基金、华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富天益货币市场基金、华富天盈货币市场基金、华富产业升级灵活配置混合型证券投资基金、华富恒富 18 个月定期开放债券型证券投资基金、华富星玉衡一年定期开放混合型证券投资基金、华富富瑞 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华富可转债债券型证券投资基金、华富恒盛纯债债券型证券投资基金、华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金、华富恒欣纯债债券型证券投资基金、华富安兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华富科技动能混合型证券投资基金、华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金、华富中债-0-5 年中高等级信用债收益平衡指数证券投资基金、华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金共四十只基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
郜哲	华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理、华富永鑫灵活配置混合型基金基金经理、华富中证 100 指数基金基金经理、华富中小板指数增强型基金基	2019 年 12 月 24 日	-	6 年	北京大学理学博士，研究生学历，先后担任方正证券股份有限公司博士后研究员、上海同安投资管理有限公司高级研究员，2017 年 4 月加入华富基金管理有限公司。

	<p>金经理、华富中证5年恒定久期国开债指数型基金基金经理、华富中债-0-5年中高等级信用债收益平衡指数证券投资基金基金经理、华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金经理</p>				
<p>张娅</p>	<p>华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理、华富永鑫灵活配置混合型基金基金经理、华富中证5年恒定久期国开债指数型基金基金经理、华富中债-0-5年中高等级信用债收益</p>	<p>2019 年 12 月 24 日</p>	<p>-</p>	<p>15 年</p>	<p>美国肯特州立大学金融工程硕士，研究生学历，曾先后担任华泰柏瑞基金管理有限公司指数投资部总监兼基金经理、上海同安投资管理有限公司副总经理兼宏观量化中心总经理。2017 年 4 月加入华富基金管理有限公司。</p>

	平衡指数 证券投资 基金基金 经理、华 富中证人 工智能产 业交易型 开放式指 数证券投 资基金联 接基金基 金经理、 公司公募 投资决策 委员会委 员、公司 总经理助 理、指数 投资部总 监				
--	---	--	--	--	--

注：这里的任职日期指该基金成立之日。证券从业年限的计算标准上，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

本报告期内，本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法律法规，对本基金的管理始终按照基金合同、招募说明书的要求和公司制度的规定进行。本基金的交易行为合法合规，未发现异常情况；相关信息披露真实、完整、准确、及时；基金各种账户类、申购赎回、注册登记业务均按规定的程序进行，未出现重大违法违规或违反基金合同的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法规要求，结合实际情况，制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节全部纳入公平交易管理中，实行事前控制、事中监控、事后分析反馈的流程化管理。在制度和流程上确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金报告期内不存在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成交量的 5% 的情形。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年上半年，市场起伏波动较大，从宏观层面来看，未来 5-10 年内，确定性的经济主题是推进金融供给侧结构性改革、促进科技与资本深度融合、科创行业引领经济发展向创新驱动转型。这一过程中，经济转型必然带来经济增速下台阶，但只要同时伴随科技和产业的发展进步，期间仍很可能伴随权益市场的长牛。因此权益类资产是当下以及未来的优势资产，其中科创行业是重中之重。这也是自去年 11 月以来，科创板结构性行情延续的主要原因。

在 1 季度大涨大跌之后，2 季度随着 3 月底海外流动性危机引发的暴跌告一段落，海内外权益市场开始逐渐恢复到上涨趋势。初期经济形势尚不明朗，市场在 4 月还有较明显的灾后反弹特征，市场并无主线，随着 5 月底 PMI 显示需求有所恢复，股市也开始加速上涨，同时延续了疫情冲击前，盈利趋势更好的科创板的结构性行情。

我们的宏观配置系统自 5 月中旬判断市场重新进入科创板结构性牛市行情，于 5 月底判断经济进入复苏期，在 6 月底进一步判断股市进入快牛和全面普涨的牛市行情。

我们的华富人工智能指数 ETF 自 2019 年 2 月 10 日建仓完成后，保持平稳运作，严格紧密跟踪指数，自上市到 2020 年 7 月 14 日，跟踪同时，辅以打新策略，尽可能增厚收益，将持有人利益最大化。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金于 2019 年 12 月 24 日正式成立。截至 2020 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.1419 元，累计基金份额净值为 1.1419 元。本基金本报告期份额净值增长率为 14.20%，同期业绩比较基准收益率为 17.84%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2020 年 3 季度，我们判断经济和企业盈利的边际复苏是相对大概率会实现的情形，市场进一步的演进，主要取决于 7 月底政治局会议的重新定调，如果延续宽信用政策不变，预计股强债弱的格局仍不会有大的改变，如果政府认为复苏托底政策已然生效，宽信用政策暂告一段落，经济内在需求较弱，市场可能会重回震荡，股债的表现也可能发生反转。对于前期低估，受疫情影响较小，同时具有未来经济核心发动机行业属性的人工智能产业来说，3 季度仍是较好的布局

时机。本基金将继续跟踪好标的指数，为投资者提供投资人工智能产业的有力工具。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为了有效控制基金估值流程，按照相关法律法规的规定，成立了估值委员会，并制订了相关制度和流程。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，保证估值未被歪曲以免对基金持有人产生不利影响。公司估值委员会主席为公司总经理，成员包括总经理、副总经理、运作保障部负责人、监察稽核部负责人以及基金核算、金融工程、行业研究等方面的骨干。估值委员会所有相关人员均具有丰富的行业分析经验和会计核算经验等证券基金行业从业经验和专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金智能产业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本期利润为元 13,333,564.62，期末可供分配利润为 35,997,971.35 元。本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2020年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,644,709.51	142,643,312.42
结算备付金		764,624.68	-
存出保证金		383,078.48	-
交易性金融资产	6.4.7.2	510,239,541.61	27,659,852.00
其中：股票投资		509,687,641.61	27,659,852.00
基金投资		-	-
债券投资		551,900.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	150,000,000.00
应收证券清算款		1,490,135.29	-
应收利息	6.4.7.5	863.67	110,794.41
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		515,522,953.24	320,413,958.83
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,916,736.99	25,307,892.04
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		209,325.13	28,292.52
应付托管费		41,865.00	5,658.50

应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	430,222.39	32,591.91
应交税费		1.49	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	133,151.16	4,347.83
负债合计		2,731,302.16	25,378,782.80
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	449,064,500.00	295,064,500.00
未分配利润	6.4.7.10	63,727,151.08	-29,323.97
所有者权益合计		512,791,651.08	295,035,176.03
负债和所有者权益总计		515,522,953.24	320,413,958.83

注：报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.1419 元，基金份额总额 449,064,500 份。

后附报表附注为本财务报表的组成部分。

6.2 利润表

会计主体：华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		17,905,509.10
1. 利息收入		397,723.13
其中：存款利息收入	6.4.7.11	147,003.22
债券利息收入		44.64
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		177,782.42
证券出借利息收入		-
其他利息收入		72,892.85
2. 投资收益（损失以“-”填列）		15,541,321.26
其中：股票投资收益	6.4.7.12	13,526,565.82
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	2,014,755.44
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-593,221.76
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 18	2, 559, 686. 47
减：二、费用		4, 571, 944. 48
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	1, 206, 545. 37
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	241, 309. 02
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6. 4. 7. 19	2, 948, 997. 65
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		0. 16
7. 其他费用	6. 4. 7. 20	175, 092. 28
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		13, 333, 564. 62
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		13, 333, 564. 62

注：后附报表附注为本财务报表的组成部分。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	295, 064, 500. 00	-29, 323. 97	295, 035, 176. 03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	13, 333, 564. 62	13, 333, 564. 62
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	154, 000, 000. 00	50, 422, 910. 43	204, 422, 910. 43
其中：1. 基金申购款	945, 000, 000. 00	155, 983, 798. 12	1, 100, 983, 798. 12
2. 基金赎回款	-791, 000, 000. 00	-105, 560, 887. 69	-896, 560, 887. 69
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填	-	-	-

列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	449,064,500.00	63,727,151.08	512,791,651.08

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

赵万里

曹华玮

邵恒

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华富人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金（以下简称本基金或基金）经中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）（证监许可[2019]1705号）核准。基金合同于2020年4月22日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定期。设立时募集资金到位情况经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）验资并出具《验资报告》（普华永道中天验字（2019）第0777号）。有关基金设立文件已按规定向中国证监会备案。本基金的管理人和基金份额登记机构为华富基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《华富人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的规定，基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%；股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为编制基础。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，同时参照中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》和中国证监会允许的基金行业实务操作，真实、完整地反映了基金的财务状况、经营成果和净值变动等有关信息。

6.4.3.1 会计年度

本基金本报告期为公历1月1日起至6月30日止。

6.4.3.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币；记账本位币单位为元。

6.4.3.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产在初始确认时划分为以下四类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项、可供出售金融资产。

金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要为权证投资）划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，其他金融资产划分为贷款和应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。

(2) 金融负债在初始确认时划分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（包括交易性金融负债和在初始确认时指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债）、其他金融负债。

6.4.3.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时，确认一项金融资产或金融负债。初始确认金融资产或金融负债时，按照公允价值计量；对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

本基金按照公允价值对金融资产进行后续计量，且不扣除将来处置该金融资产时可能发生的交易费用，但下列情况除外：(1) 持有至到期投资以及贷款和应收款项采用实际利率法，按摊余成本计量；(2) 在活跃市场中没有报价且其公允价值不能可靠计量的权益工具投资，以及与该权益工具挂钩并须通过交付该权益工具结算的衍生金融资产，按照成本计量。

本基金采用实际利率法，按摊余成本对金融负债进行后续计量，但下列情况除外：(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值计量，且不扣除将来结清金融负债时可能发生的交易费用；(2) 与在活跃市场中没有报价、公允价值不能可靠计量的权益工具挂钩并须通过交付该权益工具结算的衍生金融负债，按照成本计量；(3) 不属于指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债的财务担保合同，或没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益并将以低于市场利率贷款的贷款承诺，在初始确认后按照下列两项金额之中的较高者进行后续计量：1) 按照《企业会计准则第 13 号——或有事项》确定的金额；2) 初始确认金额扣除按照《企业会计准则第 14 号——收入》的原则确定的累积摊销额后的余额。

金融资产或金融负债公允价值变动形成的利得或损失，除与套期保值有关外，按照如下方法处理：(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债公允价值变动形成的利

得或损失，计入公允价值变动收益；在资产持有期间所取得的利息或现金股利，确认为投资收益；处置时，将实际收到的金额与初始入账金额之间的差额确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。(2) 可供出售金融资产的公允价值变动计入其他综合收益；持有期间按实际利率法计算的利息，计入投资收益；可供出售权益工具投资的现金股利，于被投资单位宣告发放股利时计入投资收益；处置时，将实际收到的金额与账面价值扣除原直接计入其他综合收益的公允价值变动累计额之后的差额确认为投资收益。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产；当金融负债的现时义务全部或部分解除时，相应终止确认该金融负债或其一部分。

6.4.3.5 金融资产和金融负债的估值原则

(1) 估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定相关金融资产和金融负债的公允价值。公司将估值技术使用的输入值分以下层级，并依次使用：

- 1) 第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；
- 2) 第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值，包括：活跃市场中类似资产或负债的报价；非活跃市场中相同或类似资产或负债的报价；除报价以外的其他可观察输入值，如在正常报价间隔期间可观察的利率和收益率曲线等；市场验证的输入值等；
- 3) 第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值，包括不能直接观察或无法由可观察市场数据验证的利率、股票波动率、企业合并中承担的弃置义务的未来现金流量、使用自身数据做出的财务预测等。

(2) 估值方法及关键假设

1) 根据《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证券监督管理委员会公告〔2017〕13号）规定，在下列情况下本基金采用的估值方法及关键假设如下：

① 对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确

定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。

② 对不存在活跃市场的投资品种，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

③ 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，对估值进行调整并确定公允价值。

2) 对于发行时明确一定期限限售期的股票（包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），根据中国证券投资基金业协会《关于发布《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》的通知》（中基协发〔2017〕6 号），估值处理如下：

① 流通受限股票按以下公式确定估值日该流通受限股票的价值： $FV=S \times (1-LoMD)$

其中：FV：估值日该流通受限股票的价值；S：估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值；LoMD：该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣。

② 引入看跌期权计算该流通受限股票对应的流动性折扣。 $LoMD=P/S$ ，P 是估值日看跌期权的价值。

③ 证券投资基金持有的流通受限股票在估值日按平均价格亚式期权模型确定估值日看跌期权的价值。

6.4.3.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表列示。

6.4.3.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.3.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，

申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.3.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

6.4.3.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

6.4.3.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。期末可供分配利润指期末资产负债表未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从持有人权益转出。

6.4.3.12 其他重要的会计政策和会计估计

无。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期本基金会计政策无变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期本基金会计估计无变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期本基金无重大会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局《关于企业所得税若干优惠政策的通知》(财税〔2008〕1号)、《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》(财税〔2012〕85号)、《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》(财税〔2015〕101号)、《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》(财税〔2016〕36号)、《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》(财税〔2016〕46号)、《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税〔2016〕140号)、《关于资管产品增值税有关问题的通知》(财税〔2017〕56号)、《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》(财税〔2016〕70号)、《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》(财税〔2017〕90号)及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(一) 自2018年1月1日起,资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。

(二) 对基金买卖股票、债券的差价收入,暂免征收企业所得税;

(三) 证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

主要税种及税率列示如下:

税 种	计 税 依 据	税 率
增值税	金融服务销售额	3%
城市维护建设税	应缴流转税税额	7%
教育费附加	应缴流转税税额	3%
地方教育附加[注]	应缴流转税税额	1%、2%

[注]: 接地方税务局通知,自2019年7月1日起调整地方教育附加税税率,由原来的1%调整为2%。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
活期存款	2,644,709.51
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	2,644,709.51

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	510,294,952.65	509,687,641.61	-607,311.04
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	551,900.00	551,900.00
	银行间市场	-	-
	-	-	-
	合计	551,900.00	551,900.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	510,846,852.65	510,239,541.61	-607,311.04

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	301.20
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	344.10
应收债券利息	45.97
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	172.40
合计	863.67

注：本表列示的其他为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	430,222.39
银行间市场应付交易费用	-
-	-
合计	430,222.39

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付审计费	32,820.06
应付指数使用费	40,658.76
应付信息披露费	59,672.34
合计	133,151.16

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	295,064,500.00	295,064,500.00
本期申购	945,000,000.00	945,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-791,000,000.00	-791,000,000.00
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	449,064,500.00	449,064,500.00

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-15,234.69	-14,089.28	-29,323.97
本期利润	13,926,786.38	-593,221.76	13,333,564.62
本期基金份额交易产生的变动数	22,086,419.66	28,336,490.77	50,422,910.43
其中：基金申购款	93,560,549.17	62,423,248.95	155,983,798.12
基金赎回款	-71,474,129.51	-34,086,758.18	-105,560,887.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	35,997,971.35	27,729,179.73	63,727,151.08

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	121,320.43
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	23,853.54
其他	1,829.25
合计	147,003.22

注：本表列示的其他为结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	10,018,116.75
股票投资收益——赎回差价收入	3,508,449.07
股票投资收益——申购差价收入	-

股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	13,526,565.82

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	827,752,449.07
减：卖出股票成本总额	817,734,332.32
买卖股票差价收入	10,018,116.75

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
赎回基金份额对价总额	896,560,887.69
减：现金支付赎回款总额	639,026,174.69
减：赎回股票成本总额	254,026,263.93
赎回差价收入	3,508,449.07

6.4.7.13 债券投资收益

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,014,755.44
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,014,755.44

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
------	----------------------------

1. 交易性金融资产	-593,221.76
股票投资	-593,221.76
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
-	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-593,221.76

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	2,559,686.47
合计	2,559,686.47

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	2,948,997.65
银行间市场交易费用	-
-	-
合计	2,948,997.65

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	32,820.06
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	6,941.12
指数使用费	75658.76
合计	175,092.28

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华富基金管理有限公司	基金管理人、注册登记人、销售机构
招商银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
华安证券股份有限公司（“华安证券”）	基金管理人的股东、代销机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
华安证券	861,938,728.07	41.44

注：本基金成立于2019年12月24日，无上年度可比期间。

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例（%）
华安证券	-	-

注：本基金本报告期和上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）

华安证券	260,000,000.00	100.00
------	----------------	--------

注：本基金成立于 2019 年 12 月 24 日，无上年度可比期间。

6.4.10.1.4 权证交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期权证 成交总额的比例 (%)
-	-	-

注：本基金本报告期和上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
华安证券	802,734.52	41.82	55,184.72	12.83

注：本基金成立于 2019 年 12 月 24 日，无上年度可比期间。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,206,545.37
其中：支付销售机构的客户维护费	-

注：基金管理费按前一日基金资产净值 0.50% 的年费率逐日计提，按月支付。计算方法 $H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金管理费，E 为前一日基金资产净值）。本基金成立于 2019 年 12 月 24 日，无上年度可比期间。本基金成立于 2019 年 12 月 24 日，无上年度可比期间。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

当期发生的基金应支付的托管费	241,309.02
----------------	------------

注：基金托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率逐日计提，按月支付。计算方法 $H = E \times \text{托管费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金托管费，E 为前一日基金资产净值）。本基金成立于 2019 年 12 月 24 日，无上年度可比期间。本基金成立于 2019 年 12 月 24 日，无上年度可比期间。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：报告期内未发生转融通证券出借业务

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内和上年度可比期间本基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金本报告期和上年度可比期间基金管理人之外的其他关联方没有投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	2,644,709.51	121,320.43

注：本表仅列示活期存款余额及产生利息。本基金成立于 2019 年 12 月 24 日，无上年度可比期间。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间内未参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末(2020年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300840	酷特智能	2020年6月30日	2020年7月8日	新股流通受限	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300843	胜蓝股份	2020年6月23日	2020年7月2日	新股流通受限	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300845	捷安高科	2020年6月24日	2020年7月3日	新股流通受限	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300846	首都在线	2020年6月22日	2020年7月1日	新股流通受限	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
300847	中船汉光	2020年6月29日	2020年7月9日	新股流通受限	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-
688377	迪威尔	2020年6月29日	2020年7月8日	新股流通受限	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48	-
688518	联赢激光	2020年6月12日	2020年12月22日	科创板新股锁定	7.81	20.83	14,111	110,206.91	293,932.13	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
128112	歌尔转2	2020年6月12日	2020年7月13日	新债未上市	100.00	100.00	5,519	551,900.00	551,900.00	-

6.4.12.1.3 受限证券类别：资产支持证券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6.4.12.1.4 受限证券类别：权证										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：份)	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：期末无参与转融通证券出借业务的证券

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人已建立董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

董事会下设风险管理委员会，负责对公司风险管理制度进行审查并提供咨询和建议。总经理下设投资决策委员会和风险控制委员会，负责对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和监控。公司设督察长，组织、指导公司监察稽核工作，监督检查基金及公司运作的合法合规情况和公司的内部风险控制情况。公司设有独立的监察稽核部门，监察稽核部有权对公司各部门内部风险控制制度的建立和落实情况进行检查，对公司的内部风险控制制度的合理性、有效性进行分析，提出改进意见，上报总经理，通报督察长。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有信用债。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有信用债。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可银行间同业市场交易。因此除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括市场价格风险、利率风险和外汇风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金以摊余成本计价，并通过“影子定价”机制以确保按摊余成本计算的基金资产净值近似反映基金资产的公允价值，因此本基金的运作存在相应的利率风险。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感度缺口进行监控。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年6月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	2,644,709.51	-	-	-	-	-	2,644,709.51
结算备付金	764,624.68	-	-	-	-	-	764,624.68
存出保证金	383,078.48	-	-	-	-	-	383,078.48
交易性金融资产	-	-	551,900.00	-	-	509,687,641.61	510,239,541.61

买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	863.67	863.67
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,490,135.29	1,490,135.29
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	3,792,412.67	0.00	551,900.00	0.00	0.00	511,178,640.57	515,522,953.24
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	209,325.13	209,325.13
应付托管费	-	-	-	-	-	41,865.00	41,865.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,916,736.99	1,916,736.99
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	430,222.39	430,222.39
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	1.49	1.49
其他负债	-	-	-	-	-	133,151.16	133,151.16
负债总计	-	-	-	-	-	2,731,302.16	2,731,302.16
利率敏感度缺口	3,792,412.67	0.00	551,900.00	0.00	0.00	508,447,338.41	512,791,651.08
上年度末							
2019年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	142,643,312.42	-	-	-	-	-	142,643,312.42
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	-	27,659,852.00	27,659,852.00
买入返售金融资产	150,000,000.00	-	-	-	-	-	150,000,000.00

应收利息	-	-	-	-	-	110,794.41	110,794.41
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	292,643,312.42	0.00	0.00	0.00	0.00	27,770,646.41	320,413,958.83
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	28,292.52	28,292.52
应付托管费	-	-	-	-	-	5,658.50	5,658.50
应付证券清算款	-	-	-	-	-	25,307,892.04	25,307,892.04
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	32,591.91	32,591.91
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	4,347.83	4,347.83
负债总计	-	-	-	-	-	25,378,782.80	25,378,782.80
利率敏感度缺口	292,643,312.42	0.00	0.00	0.00	0.00	2,391,863.61	295,035,176.03

注：本表按照金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者作为期限分类标准

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除利率外其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
分析	市场利率下降 25 基点	7,905.97	-
	市场利率上升 25 基点	-7,905.97	-

	基点		
--	----	--	--

注：该基金于 2019 年 12 月 24 日成立，2019 年 12 月 31 日非该基金报告期，故无上年度末利率风险的敏感性分析。

6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的其他价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	509,687,641.61	99.39	27,659,852.00	9.38
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	551,900.00	0.11	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	510,239,541.61	99.50	27,659,852.00	9.38

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数外其他市场变量保持不变		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
	本期末（2020 年 6 月 30 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）	
分析	沪深 300 指数上升百分之五	21,796,292.18	—

	沪深 300 指数下降百分之五	-21,796,292.18	-
--	-----------------	----------------	---

注：该基金于 2019 年 12 月 24 日成立，2019 年 12 月 31 日非该基金报告期，故无上年度末其他价格风险的敏感性分析。

6.4.13.4.3 采用风险价值法管理风险

假设	1. 置信区间（95%）		
	2. 观察期（1 年）		
	-		
分析	风险价值 （单位：人民币元）	本期末（2020 年 6 月 30 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
	-	-	-
	合计	231,018,709.60	-

注：该基金于 2019 年 12 月 24 日成立，2019 年 12 月 31 日非该基金报告期，故无上年度末的风险价值。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	509,687,641.61	98.87
	其中：股票	509,687,641.61	98.87
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	551,900.00	0.11
	其中：债券	551,900.00	0.11
	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	3,409,334.19	0.66
-	-	-	-

8	其他各项资产	1,874,077.44	0.36
9	合计	515,522,953.24	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	214,909,846.63	41.91
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	294,114,058.92	57.36
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	509,023,905.55	99.27

7.2.2 报告期末积极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	638,971.17	0.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.00
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	12,097.57	0.00
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	663,835.06	0.13

7.2.3 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沪港通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	002230	科大讯飞	1,428,453	53,466,995.79	10.43
2	002415	海康威视	1,313,009	39,849,823.15	7.77
3	000977	浪潮信息	689,500	27,014,610.00	5.27
4	603019	中科曙光	621,368	23,860,531.20	4.65
5	603160	汇顶科技	83,040	18,509,616.00	3.61
6	002405	四维图新	1,054,474	17,388,276.26	3.39
7	002236	大华股份	863,996	16,597,363.16	3.24
8	002439	启明星辰	368,417	15,499,303.19	3.02
9	002065	东华软件	1,183,238	14,814,139.76	2.89
10	300383	光环新网	563,300	14,685,231.00	2.86
11	002373	千方科技	605,224	14,519,323.76	2.83
12	300212	易华录	228,720	12,808,320.00	2.50
13	600845	宝信软件	211,019	12,467,002.52	2.43
14	002241	歌尔股份	420,300	12,340,008.00	2.41

15	600699	均胜电子	485,120	11,550,707.20	2.25
16	600410	华胜天成	827,230	11,250,328.00	2.19
17	600536	中国软件	141,200	11,183,040.00	2.18
18	000938	紫光股份	215,322	9,254,539.56	1.80
19	300166	东方国信	724,502	8,991,069.82	1.75
20	002368	太极股份	204,700	8,943,343.00	1.74
21	600797	浙大网新	1,079,111	8,891,874.64	1.73
22	002152	广电运通	657,600	8,509,344.00	1.66
23	000063	中兴通讯	205,710	8,255,142.30	1.61
24	300168	万达信息	358,910	7,921,143.70	1.54
25	300098	高新兴	1,246,900	7,556,214.00	1.47
26	300036	超图软件	290,484	7,314,387.12	1.43
27	300223	北京君正	69,800	7,045,612.00	1.37
28	002402	和而泰	421,850	6,838,188.50	1.33
29	300024	机器人	487,612	6,665,656.04	1.30
30	601360	三六零	355,070	6,501,331.70	1.27
31	002912	中新赛克	38,417	6,284,637.03	1.23
32	600728	XD 佳都科	679,927	6,194,134.97	1.21
33	600756	浪潮软件	290,000	5,365,000.00	1.05
34	600718	东软集团	450,760	5,183,740.00	1.01
35	603881	数据港	45,681	4,936,745.67	0.96
36	300474	景嘉微	67,700	4,556,210.00	0.89
37	300523	辰安科技	94,207	4,412,655.88	0.86
38	600850	华东电脑	175,300	4,296,603.00	0.84
39	002383	合众思壮	441,584	4,278,948.96	0.83
40	300020	银江股份	371,114	4,230,699.60	0.83
41	002151	北斗星通	116,352	3,726,754.56	0.73
42	002920	德赛西威	60,400	3,704,332.00	0.72
43	300075	数字政通	258,900	3,430,425.00	0.67
44	300188	美亚柏科	153,765	3,049,159.95	0.59
45	300454	深信服	14,313	2,947,905.48	0.57
46	300302	同有科技	216,700	2,745,589.00	0.54
47	000555	神州信息	156,916	2,413,368.08	0.47
48	300448	浩云科技	247,400	2,362,670.00	0.46
49	300590	移为通信	72,250	2,352,460.00	0.46
50	300559	佳发教育	97,050	2,059,401.00	0.40

7.3.2 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	688518	联赢激光	14,111	293,932.13	0.06

2	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.03
3	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.02
4	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.01
5	605166	聚合顺	1,641	26,009.85	0.01
6	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
7	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
8	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
9	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
10	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
11	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
12	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
13	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002230	科大讯飞	155,658,109.78	52.76
2	002415	海康威视	133,661,355.62	45.30
3	000977	浪潮信息	82,465,338.32	27.95
4	002373	千方科技	52,266,062.08	17.72
5	002236	大华股份	50,822,996.39	17.23
6	002405	四维图新	44,911,515.82	15.22
7	002065	东华软件	44,735,950.66	15.16
8	300383	光环新网	44,107,918.01	14.95
9	300166	东方国信	40,375,376.12	13.68
10	000063	中兴通讯	30,310,758.99	10.27
11	300212	易华录	28,678,975.91	9.72
12	002439	启明星辰	26,087,747.31	8.84
13	300168	万达信息	25,881,515.71	8.77
14	300098	高新兴	25,711,712.33	8.71
15	002241	歌尔股份	25,571,197.65	8.67
16	002368	太极股份	25,553,844.68	8.66
17	300024	机器人	25,153,309.05	8.53
18	300036	超图软件	24,900,351.74	8.44
19	603019	中科曙光	23,774,172.00	8.06
20	002912	中新赛克	21,745,991.47	7.37
21	002383	合众思壮	21,271,044.15	7.21
22	000938	紫光股份	19,777,328.80	6.70
23	603160	汇顶科技	19,608,517.51	6.65
24	002402	和而泰	18,810,669.96	6.38
25	600699	均胜电子	15,410,927.60	5.22

26	002151	北斗星通	14,315,627.26	4.85
27	300020	银江股份	13,388,441.04	4.54
28	300523	辰安科技	13,004,546.16	4.41
29	002139	拓邦股份	12,921,529.79	4.38
30	300075	数字政通	12,141,597.65	4.12
31	300188	美亚柏科	11,491,209.99	3.89
32	600845	宝信软件	10,787,906.46	3.66
33	600728	XD 佳都科	10,421,259.00	3.53
34	600536	中国软件	10,027,886.00	3.40
35	300047	天源迪科	9,423,321.58	3.19
36	600410	华胜天成	8,791,957.00	2.98
37	000555	神州信息	8,579,399.75	2.91
38	002152	广电运通	8,102,523.00	2.75
39	600797	浙大网新	7,930,348.00	2.69
40	300302	同有科技	7,848,206.10	2.66
41	300223	北京君正	7,664,367.09	2.60
42	601360	三六零	7,233,549.99	2.45
43	300367	东方网力	7,197,837.53	2.44
44	300590	移为通信	7,105,026.35	2.41

注：本表列示“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002230	科大讯飞	101,612,122.13	34.44
2	002415	海康威视	96,082,006.38	32.57
3	000977	浪潮信息	65,376,072.34	22.16
4	002373	千方科技	38,205,613.00	12.95
5	002236	大华股份	33,019,209.85	11.19
6	300383	光环新网	31,387,749.08	10.64
7	002405	四维图新	30,437,053.68	10.32
8	002065	东华软件	30,093,787.87	10.20
9	300166	东方国信	28,297,658.43	9.59
10	000063	中兴通讯	21,403,771.70	7.25
11	300212	易华录	19,682,906.17	6.67
12	300168	万达信息	19,331,324.64	6.55
13	300098	高新兴	18,815,543.51	6.38
14	300024	机器人	17,579,239.60	5.96
15	300036	超图软件	17,406,259.94	5.90
16	002368	太极股份	16,688,118.98	5.66

17	002241	歌尔股份	16,412,076.30	5.56
18	002383	合众思壮	15,920,994.58	5.40
19	002912	中新赛克	15,841,150.98	5.37
20	603019	中科曙光	15,658,762.87	5.31
21	002402	和而泰	12,671,233.34	4.29
22	002139	拓邦股份	12,517,111.43	4.24
23	002439	启明星辰	11,935,299.07	4.05
24	002151	北斗星通	11,662,760.76	3.95
25	000938	紫光股份	11,480,694.63	3.89
26	300020	银江股份	9,791,309.41	3.32
27	300047	天源迪科	9,021,309.19	3.06
28	600699	均胜电子	8,646,906.38	2.93
29	300523	辰安科技	8,629,449.58	2.92
30	300075	数字政通	8,321,478.70	2.82
31	300188	美亚柏科	8,197,407.88	2.78
32	300367	东方网力	6,976,316.27	2.36
33	600728	XD 佳都科	6,976,209.33	2.36
34	000555	神州信息	5,968,058.02	2.02

注：本表列示“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,257,626,986.22
卖出股票收入（成交）总额	827,752,449.07

注：本表列示“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。买入包括新股、配股、债转股及行权等获得的股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	551,900.00	0.11
8	同业存单	-	-

-	-	-	-
9	其他	-	-
10	合计	551,900.00	0.11

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	128112	歌尔转 2	5,519	551,900.00	0.11

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的情况，在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	383,078.48
2	应收证券清算款	1,490,135.29
3	应收股利	-
4	应收利息	863.67
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

-	-	-
8	其他	-
9	合计	1,874,077.44

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688518	联赢激光	293,932.13	0.06	新股流通受限
2	688377	迪威尔	129,619.48	0.03	新股流通受限

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
12,220	36,748.32	46,142,706.00	10.28	402,921,794.00	89.72

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
招商银行股份有限公司—华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金	19,000,000.00	4.23

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	信泰人寿保险股份有	7,726,000.00	1.72

	限公司一分红产品		
2	顾春华	7,521,200.00	1.67
3	徐玉莲	5,162,100.00	1.15
4	徐铭辰	4,470,300.00	1.00
5	上海人寿保险股份有限公司一万能产品 1	4,367,700.00	0.97
6	张武	3,065,800.00	0.68
7	天风证券股份有限公司	3,000,000.00	0.67
8	方正证券股份有限公司	2,913,980.00	0.65
9	赵志龙	2,850,000.00	0.63
10	张中华	2,800,000.00	0.62
11	招商银行股份有限公司一华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金	19,000,000.00	4.23

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

注：本报告期末基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019年12月24日） 基金份额总额	295,064,500.00
本报告期期初基金份额总额	295,064,500.00
本报告期基金总申购份额	945,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	791,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	449,064,500.00

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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1. 2020年2月27日,经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过,因工作安排,龚炜先生不再担任华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。
2. 2020年2月27日,经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过,因工作安排,龚炜先生不再担任华富量子生命力混合型证券投资基金基金经理的职务。
3. 2020年2月27日,经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过,因工作安排,龚炜先生不再担任华富灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。
4. 2020年2月27日,经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过,因工作安排,龚炜先生不再担任华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。
5. 2020年2月27日,经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过,因工作安排,龚炜先生不再担任华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。
6. 2020年2月27日,经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过,因工作安排,龚炜先生不再担任华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。
7. 2020年4月21日,华富基金管理有限公司第六届董事会第六次会议审议通过,因工作需要,聘任邵恒先生担任公司副总经理职务。
8. 2020年5月11日,经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过,因工作安排,倪莉莎女士不再担任华富天盈货币市场基金基金经理的职务。
9. 2020年5月11日,经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过,因工作需要,增聘陶祺先生为华富富瑞3个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。
10. 2020年5月11日,经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过,因工作需要,增聘陶祺先生为华富恒盛纯债债券型证券投资基金基金经理。
11. 2020年5月11日,经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过,因工作需要,增聘陶祺先生为华富货币市场基金基金经理。
12. 2020年5月11日,经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过,因工作需要,增聘陶祺先生为华富安兴39个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。
13. 2020年6月28日,华富基金管理有限公司第六届董事会第七次会议审议通过,因工作需要,章宏韬先生不再担任公司董事长职务,聘任赵万利先生担任公司董事长。
14. 本基金本报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内没有发生诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未有改聘为其审计的会计师事务所情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金的管理人、托管人及其高级管理人员报告期内未受监管部门的稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华安证券	4	861,938,728.07	41.44%	802,734.52	41.82%	-
国信证券	1	781,456,092.20	37.57%	712,162.07	37.10%	-
中泰证券	1	275,897,389.49	13.26%	256,952.43	13.39%	-
兴业证券	1	93,784,879.41	4.51%	85,468.77	4.45%	-
方正证券	1	64,022,794.37	3.08%	59,625.48	3.11%	-
天风证券	1	2,857,752.02	0.14%	2,604.29	0.14%	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-

申万宏源	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中国国际金 融证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中银证券	1	-	-	-	-	-

注：1) 根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号），我公司重新修订了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序，比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，选择了研究能力强、内部管理规范、信息资讯服务能力强的几家券商租用了基金专用交易单元。

2) 本报告期本基金新增以上交易单元。

3) 此处的佣金指基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华安证券	-	-	260,000,000.00	100.00%	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

民生证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中国国际 金融证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中银证券	-	-	-	-	-	-

注：债券交易中的企业债及可分离债的成交金额按净价统计，可转债的成交金额按全价统计。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《关于调整华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金指数许可使用费收取下限的公告》	中国证监会指定媒介	2020年1月2日
2	《华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）》	中国证监会指定媒介	2020年1月3日
3	《华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金招募说明书提示性公告》	中国证监会指定媒介	2020年1月3日
4	《华富基金管理有限公司关于公司住所变更的公告》	中国证监会指定媒介	2020年1月8日
5	《关于《华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》的更正公告》	中国证监会指定媒介	2020年2月5日
6	《华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告》	中国证监会指定媒介	2020年2月5日
7	《华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》	中国证监会指定媒介	2020年2月5日
8	《华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书提示性公告》	中国证监会指定媒介	2020年2月5日
9	《华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金调整交易结算模式并修订招募说明书的公告》	中国证监会指定媒介	2020年2月5日
10	《华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）》	中国证监会指定媒介	2020年2月5日
11	《华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）--修订版》	中国证监会指定媒介	2020年2月5日

12	《华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金招募说明书提示性公告》	中国证监会指定媒介	2020 年 2 月 5 日
13	《关于华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金增加招商证券为申购赎回代办券商的公告》	中国证监会指定媒介	2020 年 2 月 27 日
14	《华富基金管理有限公司关于旗下部分基金招募说明书（更新）的提示性公告》	中国证监会指定媒介	2020 年 2 月 29 日
15	《华富基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告》	中国证监会指定媒介	2020 年 3 月 13 日
16	《华富基金管理有限公司关于旗下上海证券交易所上市基金增加扩位证券简称的公告》	中国证监会指定媒介	2020 年 3 月 14 日
17	《华富基金管理有限公司关于系统暂停服务的通知》	中国证监会指定媒介	2020 年 3 月 28 日
18	《华富基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》	中国证监会指定媒介	2020 年 4 月 22 日
19	《华富基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年第一季度报告提示性公告》	中国证监会指定媒介	2020 年 4 月 22 日
20	《华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 1 季度报告》	中国证监会指定媒介	2020 年 4 月 22 日
21	《华富基金管理有限公司关于暂停泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理相关销售业务的公告》	中国证监会指定媒介	2020 年 5 月 8 日
22	《华富基金管理有限公司关于恢复银联支付通道服务的公告》	中国证监会指定媒介	2020 年 6 月 1 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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:本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、华富人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金基金合同

- 2、华富人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- 3、华富人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金招募说明书
- 4、报告期内华富人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，相关公开披露信息也可以登录基金管理人网站查阅。

华富基金管理有限公司

2020年8月31日