

华富中证人工智能产业交易型开放式指数
证券投资基金
2021 年第 2 季度报告

2021 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

报告送出日期：2021 年 7 月 21 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 07 月 20 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 2021 年 04 月 01 日起至 2021 年 06 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

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
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
报告期末基金份额总额	389,064,500.00 份
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>
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

§ 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（2021年4月1日-2021年6月30日）
1. 本期已实现收益	-46,374.48
2. 本期利润	80,311,628.46
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1688
4. 期末基金资产净值	469,235,540.63
5. 期末基金份额净值	1.2061

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

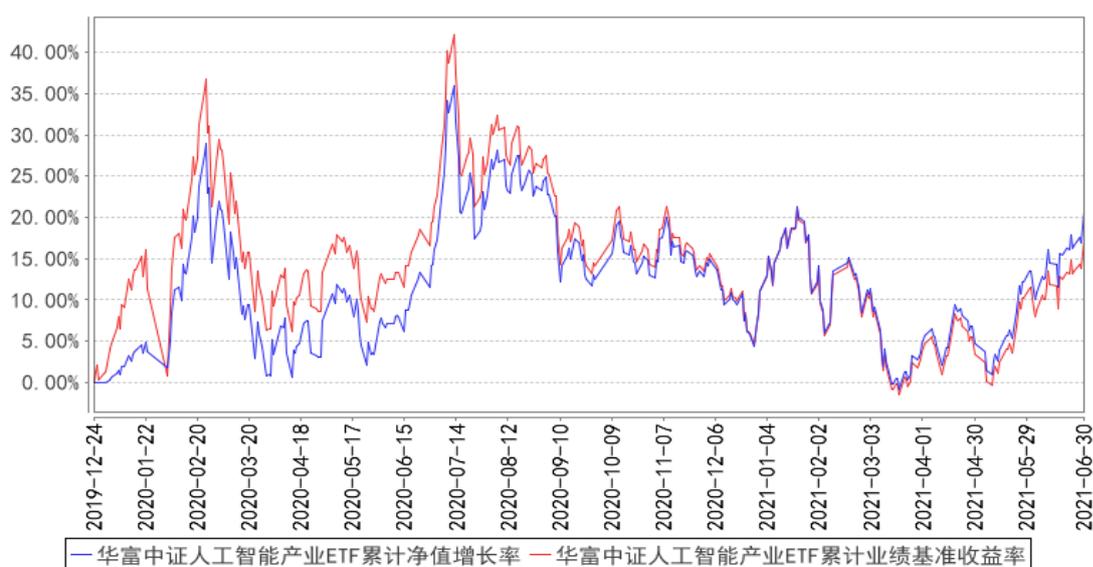
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	16.43%	1.44%	14.21%	1.45%	2.22%	-0.01%
过去六个月	8.60%	1.59%	5.60%	1.60%	3.00%	-0.01%
过去一年	5.62%	1.64%	-1.76%	1.65%	7.38%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	20.61%	1.81%	19.01%	1.97%	1.60%	-0.16%

注：本基金业绩比较基准收益率=中证人工智能产业指数收益率。

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

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对比图



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，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》的相关规定。

3.3 其他指标

§ 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		
张娅	华富中证人工智能产业交易型开放式	2019年12月24日	-	16年	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

	<p>指数基金基金经理、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平衡指数基金基金经理、华富中证人工智能产业交易型开放式指数基金联接基金基金经理、华富中债-安徽省公司信用类债券指数基金基金经理、华富新能源股票型发起式基金基金经理、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</p>				<p>化中心总经理。2017 年 4 月加入华富基金管理有限公司，2018 年 1 月 23 日至 2020 年 11 月 11 日任华富永鑫灵活配置混合型基金基金经理。</p>
<p>郜哲</p>	<p>华富中证人工智能产业交易型开放式</p>	<p>2019 年 12 月 24 日</p>	<p>-</p>	<p>7 年</p>	<p>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>

<p>指数基金基金经理、华富中证 100 指数基金基金经理、华富中小企业 100 指数增强型基金基金经理、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平衡指数基金基金经理、华富中证人工智能产业交易型开放式指数基金联接基金基金经理、华富中债-安徽省公司信用类债券指数基金基金经理、华富中证证券公司先锋策略交易型开放式指数基金基金经理、华富</p>				<p>2018 年 2 月 23 日至 2020 年 11 月 11 日任华富永鑫灵活配置混合型基金基金经理。</p>
--	--	--	--	---

	新能源股票型发起式基金基金经理				
--	-----------------	--	--	--	--

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 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度经济见顶回落，PPI 大幅上行，根据华富宏观模型目前国内经济仍然处于滞胀期。在地产“三条红线”限制下及政府停止逆周期刺激后，反映地产和基建未来景气的建筑业 PMI 订单下滑接近 3%。二季度 PMI 各项指标平滑后指标明显走低，社融增速持续下滑。值得一提的是，

大宗商品在本报告期产生较大波动，由于海外供给以及国内碳中和约束，铜、铝、钢铁、煤炭等价格出现大幅上涨，5 月 PPI 达到 9%，PPI 同比增长幅度创 13 年新高，PPI 与 CPI 的剪刀差创历史新高。随后在国内行政调控下，大宗商品回调明显，通胀预期有所减弱。

资产表现上，随着货币宽松持续，市场从 1 季度的大幅调整后开始走稳。市场热门板块从原先抱团增长具有确定性，靠低折现率提升估值，流入业绩具有高增长的板块。总体来看 2 季度业绩更好的板块，表现更为出色。煤炭、钢铁等资源类板块，受益于大宗商品价格上涨，在二季度表现出色。医美、新能源、半导体、CRO 等板块受益于板块景气度持续提升，更是创下历史新高。2021 年 2 季度，沪深 300 指数上涨 3.48%，中小 100 指数上涨 11.29%，创业板上涨 26.05%。

本基金在 2 季度内以跟踪指数为投资目标，报告期内保持平稳运作，严格紧密跟踪指数，辅以打新策略，尽可能增厚收益，将持有人利益最大化。

展望 2021 年三季度，追求盈利高增速依然会是市场主线，特别是在资金成本较低，但是高增长的优质企业稀缺的情况下，未来结构性牛市特征将更为明显。从这两年科技表现来看，在技术优势明显的领域，下游需求一旦启动，就容易造成相关概念股业绩和估值提升的戴维斯双击。目前人工智能无论从服务器为代表的基础架构，还是在人脸识别、语音识别等应用端来看，技术上我国不存在障碍甚至具有优势。本基金将继续跟踪好标的指数，同时辅以打新策略，为投资者提供投资投资人工智能产业的有力工具。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止本期末，华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金份额净值为 1.2061 元，累计份额净值为 1.2061 元。本报告期的基金份额净值增长率为 16.43%，同期业绩比较基准收益率为 14.21%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 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	466,761,823.75	99.01

	其中：股票	466,761,823.75	99.01
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	3,335,727.12	0.71
8	其他资产	1,335,206.88	0.28
9	合计	471,432,757.75	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	252,870,930.40	53.89
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	212,053,419.63	45.19
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	464,924,350.03	99.08

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

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	11,290.28	0.00

B	采矿业	-	-
C	制造业	1,572,210.68	0.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	25,371.37	0.01
F	批发和零售业	95,577.58	0.02
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	46,251.64	0.01
J	金融业	34,721.10	0.01
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	39,030.68	0.01
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	1,837,473.72	0.39

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	603501	韦尔股份	149,134	48,021,148.00	10.23
2	002230	科大讯飞	702,862	47,499,413.96	10.12
3	002415	海康威视	672,169	43,354,900.50	9.24
4	600588	用友网络	641,664	21,341,744.64	4.55
5	603486	科沃斯	86,700	19,774,536.00	4.21
6	688169	石头科技	10,682	13,470,002.00	2.87
7	603160	汇顶科技	90,346	11,711,551.98	2.50
8	000977	浪潮信息	400,233	11,258,554.29	2.40
9	603019	中科曙光	398,322	10,997,670.42	2.34
10	688008	澜起科技	173,759	10,839,086.42	2.31

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	688626	翔宇医疗	3,652	380,392.32	0.08
2	688625	呈和科技	2,672	113,907.36	0.02
3	688216	气派科技	2,000	95,280.00	0.02
4	300919	中伟股份	540	88,020.00	0.02
5	300957	贝泰妮	345	86,926.20	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。

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：本基金本报告期内未投资股指期货。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	198,929.10
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	687.17
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	1,135,590.61
9	合计	1,335,206.88

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

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	688626	翔宇医疗	380,392.32	0.08	新股流通受限

2	688625	呈和科技	113,907.36	0.02	新股流通受限
3	688216	气派科技	95,280.00	0.02	新股流通受限
4	300957	贝泰妮	86,926.20	0.02	新股流通受限

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	535,064,500.00
报告期期间基金总申购份额	51,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	197,000,000.00
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	389,064,500.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本报告期内本基金管理人没有申购、赎回或者买卖本基金份额的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内本基金管理人没有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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额
产品特有风险						
无						

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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、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
- 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托管协议
- 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
- 4、报告期内华富中证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

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

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，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

2021年7月21日