# 汇添富中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 3 季度报告

2021 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 10 月 27 日

# §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 10 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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 07 月 01 日起至 2021 年 09 月 30 日止。

# §2 基金产品概况

## 2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 汇添富中证人工智能主题 ETF |
| 场内简称 | AIETF |
| 基金主代码 | 159702 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2021 年 04 月 29 日 |
| 报告期末基金份额总额(份) | 18,931,077.00 |
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。 |
| 投资策略 | 本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成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化进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。<br>本基金的投资策略主要包括：资产配置策 |

| | |
|---|---|
| | 略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生工具投资策略、参与融资投资策略、参与转融通证券出借业务策略、可转债及可交换债投资策略、存托凭证的投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 中证人工智能主题指数收益率 |
| 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。同时本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，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 | 招商银行股份有限公司 |

注：扩位证券简称：AIETF。

# §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07月01日 - 2021年09月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 1,029,066.61 |
| 2.本期利润 | -2,108,386.19 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0992 |
| 4.期末基金资产净值 | 19,611,135.05 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0359 |

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。

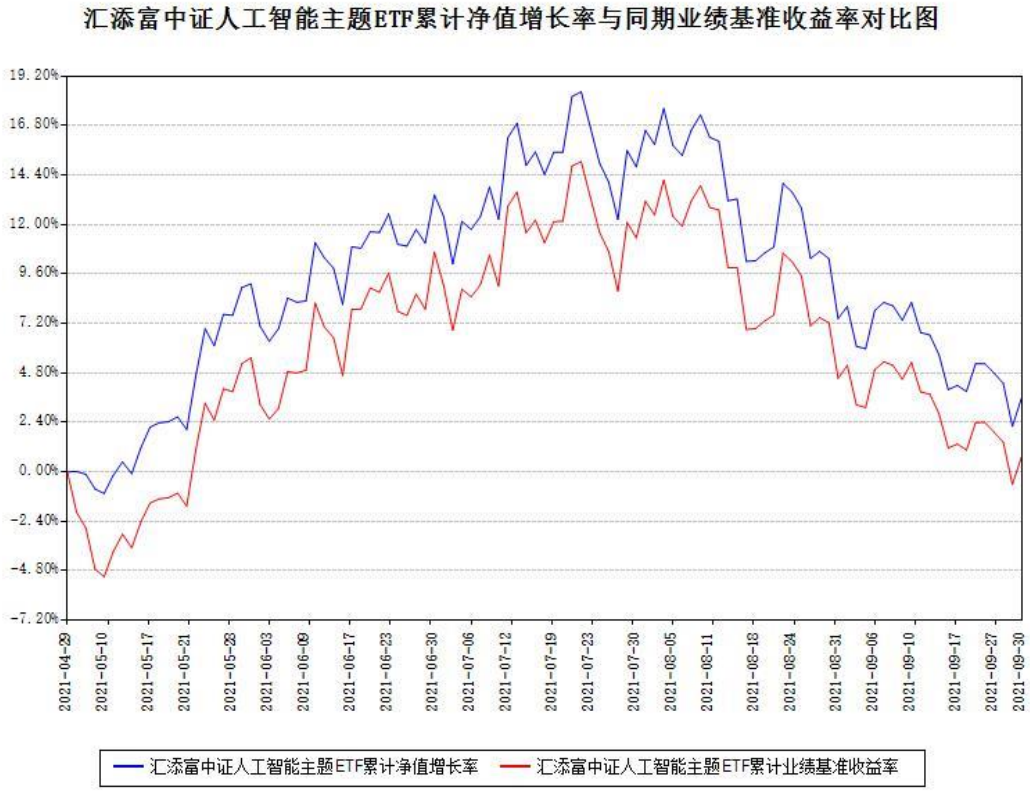
## 3.2 基金净值表现

### 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 | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三 | -8.67% | 1.36% | -8.97% | 1.38% | 0.30% | -0.02% |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 个月 | | | | | | |
| 自基金合同生效日起至今 | 3.59% | 1.28% | 0.74% | 1.38% | 2.85% | -0.10% |

### 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




注：1、本《基金合同》生效之日为 2021 年 04 月 29 日，截至本报告期末，基金成立未满一年。

2、本基金建仓期为本《基金合同》生效之日起 6 个月，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期中。

## §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（年） | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 乐无穹 | 本基金的基金经理 | 2021 年 04 月 29 日 | | 7 | 国籍:中国。学历:复旦大学经济学硕士。从业资格:证券投资基金从业资格。从业经历:2014 年 7 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任金融工程助理分析师、指数与量化投资部分析师。2019 年 4 月 15 日至今任中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 7 月 26 日至今任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 10 月 8 日至今任中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 4 月 29 日至今任汇添富中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月 8 日至今任汇添富中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月 27 日至今任汇添富中证芯片产业交易型开放式指数证券投资 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | 基金的基金经理。2021 年 9 月 27 日至今任汇添富中证沪港深科技龙头交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月 29 日至今任汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 9 月 29 日至今任汇添富中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金的基金经理。 |

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“离任日期”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。

### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：截至本报告期末，本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

## 4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本基金管理人在本报告期内遵守《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。本基金无重大违法、违规行为，本基金投资运作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

本基金管理人通过建立事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式，确保公平交易制度的执行和实现。具体情况如下：

一、本基金管理人建立了内部公平交易管理规范和流程，以确保公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种及投资管理的各个环节。

二、本着“时间优先、价格优先”的原则，对同一证券有相同交易需求的投资组合采用交易系统中的公平交易模块，实现事中交易执行层面的公平管控。

三、对不同投资组合进行同向交易价差分析，具体方法为：在不同时间窗口（日内、3日内、5日内）下，对不同组合同一证券同向交易的平均价差率进行T检验。对于未通过T检验的交易，再根据同向交易占优比、交易价格、交易频率、交易数量和交易时间等进行具体分析，进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

四、对于反向交易，根据交易顺序、交易时间窗口跨度、交易价格、交易数量占市场成交量比值、组合规模、市场收益率变化等综合判断交易是否涉及利益输送。

综上，本基金管理人通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估，严格执行了公平交易制度，公平对待了旗下各投资组合。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本公司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成交量的5%的情况有4次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易，相关交易事前严格根据公司内部规定进行审批，事后对其交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

## 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度市场整体震荡微跌，但继续体现出结构化行情。本季煤炭、有色、钢铁等周期类板块表现强势，消费、医药等跌幅较大。但9月下旬以来行情反转显著，消费、医药领涨，而周期板块大幅下跌。

全球来看，疫情整体趋于缓和，美国劳动力市场出现改善，通涨压力、供需矛盾均有所显现。美联储货币政策正常化的预期逐步落地，但流动性收紧的影响很大程度上已经在前期的反复中体现并消化。

对国内而言，货币政策仍有空间，且能够相对保持独立和定力。二季度货币政策报告提出“发挥结构性货币政策工具的牵引带动作用”，预计政策导向上总量角度仍将保持流动性合理适度，而主要通过结构性工具进行精准调整。

但已披露的7月、8月经济数据表现不佳，工业生产、消费、投资的分项增速数据多数低于预期。疫情仍有区域性反复、房地产政策趋严、能耗双控等，均对经济增长造成了一定

影响，使得四季度稳增长压力提升。

人工智能是科技前沿板块主题，覆盖了底层硬件、技术算法及终端应用的各个环节。在全社会数字化、智能化的大趋势下，人工智能是具备长期确定性的主题赛道。当前 AI 企业已经从技术驱动逐步转向商业驱动，有效赋能实体产业。人工智能板块在二季度表现强势，三季度出现较大调整。整个产业目前仍然景气度高企，龙头企业估值安全边际较高，具备长期投资价值。

报告期内，本基金处于建仓阶段。在建仓期结束后，股票投资仓位将基本保持在 95%～100%之间，以实现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

本基金本报告期基金份额净值增长率为-8.67%。同期业绩比较基准收益率为-8.97%。

### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，自 2021 年 7 月 28 日起至 2021 年 9 月 30 日，本基金连续 45 个工作日基金资产净值低于五千万元。

## §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 | 19,428,336.52 | 98.38 |
| | 其中：股票 | 19,428,336.52 | 98.38 |
| 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 | 246,519.98 | 1.25 |
| 8 | 其他资产 | 74,027.28 | 0.37 |
| 9 | 合计 | 19,748,883.78 | 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 | 9,745,164.72 | 49.69 |
| 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 | 9,683,171.80 | 49.38 |
| 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 | 19,428,336.52 | 99.07 |

### 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持有积极投资的股票组合。

### 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 | 600588 | 用友网络 | 28,000 | 927,640.00 | 4.73 |
| 2 | 002415 | 海康威视 | 16,800 | 924,000.00 | 4.71 |
| 3 | 002230 | 科大讯飞 | 17,000 | 899,300.00 | 4.59 |
| 4 | 603501 | 韦尔股份 | 3,500 | 849,135.00 | 4.33 |
| 5 | 300454 | 深信服 | 3,500 | 821,100.00 | 4.19 |
| 6 | 002236 | 大华股份 | 30,700 | 728,204.00 | 3.71 |
| 7 | 000938 | 紫光股份 | 24,500 | 611,030.00 | 3.12 |
| 8 | 603486 | 科沃斯 | 3,900 | 592,410.00 | 3.02 |
| 9 | 600845 | 宝信软件 | 7,680 | 506,880.00 | 2.58 |
| 10 | 000977 | 浪潮信息 | 17,400 | 496,248.00 | 2.53 |

### 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持有积极投资的股票。

## 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投资。

## 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前十名证券的发行主体没有被中国证监会及其派出机构、交易所立案调查，或在报告编制日前一年内收到公开谴责、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 | 73,956.77 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |

| | | |
|---|---|---|
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 70.51 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 74,027.28 |

### 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持有积极投资的股票。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---|---|
| 本报告期期初基金份额总额 | 21,931,077.00 |
| 本报告期基金总申购份额 | 44,000,000.00 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 47,000,000.00 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 18,931,077.00 |

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。

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注: 本基金的基金管理人本报告期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者超过 20%的情况

| 投 | 报告期内持有基金份额变化情况 | 报告期末持有基金情 |
|---|---|---|

| 资者类别 | | | | | | 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 | 份额占比（%） |
| 机构 | 1 | 2021年7月29日至2021年7月29日,2021年8月4日至2021年8月4日,2021年8月9日至2021年8月10日 | 2,221,549.00 | 38,379,131.00 | 38,648,847.00 | 1,951,833.00 | 10.31 |
| | 2 | 2021年7月27日至2021年7月27日 | - | 21,204,000.00 | 21,204,000.00 | - | - |

产品特有风险

1、持有人大会投票权集中的风险

当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。

2、基金规模较小导致的风险

持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。

3、提前终止基金合同的风险

持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于5000万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。

## 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、中国证监会批准汇添富中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；

2、《汇添富中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

3、《汇添富中证人工智能主题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人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金在规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

上海市黄浦区外马路 728 号　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

2021 年 10 月 27 日