

华夏中证人工智能主题交易型开放式指数

证券投资基金

2020 年第 3 季度报告

2020 年 9 月 30 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年十月二十七日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 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 2020 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏中证人工智能主题 ETF
场内简称	AI 智能（扩位证券简称：人工智能 AI ETF）
基金主代码	515070
交易代码	515070
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 12 月 9 日
报告期末基金份额总额	1,249,970,185.00 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。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。
投资策略	主要投资策略包括组合复制策略，替代性策略，衍生品投资策略，债券投资策略，资产支持证券投资策略，融资、转融通证券出借业务投资策略等。
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	本基金为股票基金，其预期风险和预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§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
	(2020 年 7 月 1 日-2020 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	66,002,970.02
2.本期利润	-90,994,214.85

3.加权平均基金份额本期利润	-0.0834
4.期末基金资产净值	1,519,187,746.95
5.期末基金份额净值	1.2154

注：①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。

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	-1.56%	2.08%	-2.74%	2.10%	1.18%	-0.02%
过去六个月	18.62%	1.98%	16.51%	2.01%	2.11%	-0.03%
自基金合同生效起至今	21.54%	2.27%	24.42%	2.36%	-2.88%	-0.09%

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

华夏中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金
 累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2019 年 12 月 9 日至 2020 年 9 月 30 日)



注：①本基金合同于 2019 年 12 月 9 日生效。

②根据本基金的基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同中投资范围、投资限制的有关约定。

§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		
李俊	本基金的基金经理、数量投资部高级副总裁	2019-12-09	-	12 年	北京大学法学学士、工商管理硕士。曾任职于北京市金杜律师事务所证券部。2008 年 12 月加入华夏基金管理有限公司，曾任数量投资部研究员、基金经理助理等。

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②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合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司

开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》等法律法规和基金合同，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金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 5% 的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为中证人工智能主题指数，该指数选取为人工智能提供基础资源、技术以及应用支持的公司中选取代表性公司作为样本股，反映人工智能主题公司的整体表现。本基金主要采取复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。

3 季度，新冠肺炎疫情仍未结束，部分地区还存在反复，疫情控制较好的国家和地区经济逐渐从疫情中恢复过来，但疫情对全球的冲击短期内难言结束，并可能会从经济领域向其他领域扩散。国内方面，疫情控制较好，经济持续复苏。面对全新的国际国内环境，国家正式提出内外“双循环”，这是不容忽视的未来新的战略定位。政策方面，货币政策从极度宽松逐步回归到常态，更多着眼于未来。但在疫情尚未结束之前，保就业、维持经济基本稳定仍会是当下的重要考量因素，稳定内需的政策也在陆续出台。

市场方面，季初在北上资金持续流入、新发基金规模屡创新高等现象带动下，市场情绪极度亢奋，带动市场短期内迅速拉升，部分板块已出现泡沫化倾向，但另一方面，随着经济的恢复，以及国内明显着眼长远的战略定力，极度宽松货币政策逐渐退出只是时间问题；美国在华为问题上对中国科技的遏制意图以及对华为本身的不利影响、美国大选前围绕中国香港、台湾、南海问题以及意识形态的不断加码的施压则被市场选择性忽略，这都加大了市场

的脆弱性。随着 7 月中旬英国宣布停止在 5G 建设中使用华为设备、美国华为禁令、美国要求中国关闭休斯顿总领事馆，以及在香港、台湾、南海问题上向中国持续施压等因素不断兑现的冲击下，市场情绪开始回落。货币政策回归常态也抑制了市场风险偏好，在诸多因素影响下，市场震荡回调。

基金投资运作方面，报告期内，本基金在做好跟踪标的指数的基础上，认真应对投资者日常申购、赎回等工作。

为促进本基金的市场流动性提高和平稳运行，经上海证券交易所同意，部分证券公司被确认为本基金的流动性服务商。目前，本基金的流动性服务商包括华泰证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中国国际金融有限公司等。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 9 月 30 日，本基金份额净值为 1.2154 元，本报告期份额净值增长率为-1.56%，同期业绩比较基准增长率-2.74%。本基金本报告期跟踪偏离度为+1.18%，与业绩比较基准产生偏离的主要原因为日常运作费用、指数结构调整、申购赎回、成份股分红等产生的差异。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日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	1,502,080,008.25	97.62
	其中：股票	1,502,080,008.25	97.62
2	固定收益投资	200,164.16	0.01
	其中：债券	200,164.16	0.01
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-

	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	21,598,985.91	1.40
7	其他各项资产	14,826,118.05	0.96
8	合计	1,538,705,276.37	100.00

注：①股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

②报告期末,本基金参与转融通证券出借业务借出股票的公允价值为 48,919,817.00 元,占本基金期末资产净值的 3.22%。

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	912,196,135.21	60.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	13,029.12	0.00
F	批发和零售业	5,738,364.03	0.38
G	交通运输、仓储和邮政业	18,653.36	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	583,812,795.32	38.43
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	14,813.40	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	241,084.55	0.02
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	45,133.26	0.00
S	综合	-	-

合计	1,502,080,008.25	98.87
----	------------------	-------

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

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	002415	海康威视	2,434,230	92,768,505.30	6.11
2	002241	歌尔股份	2,116,736	85,579,636.48	5.63
3	000063	中兴通讯	1,837,080	60,807,348.00	4.00
4	600588	用友网络	1,513,210	57,819,754.10	3.81
5	603986	兆易创新	307,226	53,183,892.86	3.50
6	002230	科大讯飞	1,433,189	49,115,387.03	3.23
7	002049	紫光国微	395,900	47,025,002.00	3.10
8	600584	长电科技	1,045,700	37,425,603.00	2.46
9	603019	中科曙光	970,696	36,614,653.12	2.41
10	002236	大华股份	1,678,700	34,413,350.00	2.27

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	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）	200,164.16	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	200,164.16	0.01

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	123051	今天转债	891	108,229.77	0.01

2	113569	科达转债	880	89,249.60	0.01
3	123059	银信转债	23	2,684.79	0.00
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

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

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

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

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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未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	614,800.38

2	应收证券清算款	14,166,921.86
3	应收股利	-
4	应收利息	44,395.81
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,826,118.05

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113569	科达转债	89,249.60	0.01

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，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

本报告期初基金份额总额	630,470,185.00
报告期基金总申购份额	1,284,000,000.00
减：报告期基金总赎回份额	664,500,000.00
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	1,249,970,185.00

§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

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§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	份额占比
华夏中证人工智能主题 ETF 联接	1	2020-07-15 至 2020-09-30	3,238,000.00	669,684,000.00	194,000,000.00	478,922,000.00	38.31%
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。</p> <p>在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、报告期内披露的主要事项

2020 年 7 月 2 日发布华夏基金管理有限公司住所变更公告。

2020 年 8 月 22 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告。

2020 年 8 月 29 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告。

2020 年 9 月 12 日发布华夏基金管理有限公司关于上海分公司营业场所变更的公告。

2020 年 9 月 23 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告。

2020 年 9 月 24 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告。

2、其他相关信息

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州和青岛设有分公司，在香港、深圳、上海设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、境内首批中日互通 ETF 基金管理人，首批商品期货 ETF 基金管理人，以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

华夏基金是境内 ETF 基金资产管理规模最大的基金管理公司之一，在 ETF 基金管理方面积累了丰富的经验，目前旗下管理华夏上证 50ETF、华夏沪深 300ETF、华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF、华夏中证 500ETF、华夏中小板 ETF、华夏创业板 ETF、华夏上证科创板 50 成份 ETF、华夏中证央企 ETF、华夏中证四川国改 ETF、华夏中证浙江国资创新发展 ETF、华夏战略新兴成指 ETF、华夏中证 5G 通信主题 ETF、华夏中证人工智能主题 ETF、华夏国证半导体芯片 ETF、华夏中证新能源汽车 ETF、华夏粤港澳大湾区创新 100ETF、华夏消费 ETF、华夏金融 ETF、华夏医药 ETF、华夏中证全指证券公司 ETF、华夏中证银行 ETF、华夏中证全指房地产 ETF、华夏创蓝筹 ETF、华夏创成长 ETF、华夏恒生 ETF、华夏沪港通恒生 ETF、华夏野村日经 225ETF、华夏 3-5 年中高级可质押信用债 ETF、华夏饲料豆粕期货 ETF 和华夏黄金 ETF，初步形成了覆盖大盘蓝筹、宽基指数、中小创指数、主题指数、行业指数、Smart Beta 策略、海外市场指数、信用债指数、商品指数等较为完整的产品线。

华夏基金以深入的投资研究为基础，尽力捕捉市场机会，为投资人谋求良好的回报。根据银河证券基金研究中心基金业绩统计报告，2020 年在基金分类排名中（截至 2020 年 9 月 30 日数据），华夏双债债券(A 类)、华夏聚利债券（A）及华夏债券(A 类)在“债券基金-普通债券型基金-普通债券型基金（可投转债）（A 类）”中分别排序 1/187、2/187 和 7/187；华夏鼎利债券（A 类）在“债券基金-普通债券型基金-普通债券型基金(二级)(A 类)”中排序 2/241；华夏鼎琪三个月定开债券在“债券基金-定期开放式纯债债券型基金-定期开放式纯债债券型基金（A 类）”中排序 8/341；华夏可转债增强债券(A 类) 在“债券基金-可转换债券型基金-可转换债券型基金（A 类）”中排序 5/36；华夏创新前沿股票在“股票基金-标准股票型基金-

标准股票型基金（A 类）”中排序 6/203；华夏科技成长股票在“股票基金-行业主题股票型基金-TMT 与信息技术行业股票型基金（A 类）”中排序 1/10；华夏医疗健康混合(C 类)在“混合基金-偏股型基金-普通偏股型基金（非 A 类）”中排序 7/42；华夏移动互联混合（QDII）和华夏新时代混合（QDII）在“QDII 基金-QDII 混合基金-QDII 混合基金（A 类）”中分别排序 3/35 和 4/35；华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数(C 类)在“股票基金-标准指数股票型基金-标准策略指数股票型基金（非 A 类）”中排序 9/21；华夏创业板 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-规模指数股票 ETF 基金”中排序 1/78；华夏消费 ETF 及华夏医药 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-行业指数股票 ETF 基金”中分别排序 1/35 和 2/35；华夏战略新兴成指 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-主题指数股票 ETF 基金”中排序 6/53；华夏创成长 ETF 及华夏创蓝筹 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-策略指数股票 ETF 基金”中分别排序 2/16 和 3/16；华夏创业板 ETF 联接及华夏中小板 ETF 联接在“股票基金-股票 ETF 联接基金-规模指数股票 ETF 联接基金（A 类）”中分别排序 1/61 和 9/61；华夏战略新兴成指 ETF 联接在“股票基金-股票 ETF 联接基金-主题指数股票 ETF 联接基金（非 A 类）”中排序 2/28。

在客户服务方面，3 季度，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户使用的便利性和服务体验：（1）优化部分直销电子交易支付渠道，提高了相关支付限额，为投资者交易提供了便利；（2）华夏基金管家客户端优化了基金筛选功能，方便客户多维度对基金进行筛选与定位；（3）开展“以家人之名”、“误入弹幕，找出它”、“看人家一岁的时候”等活动，为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《华夏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、《华夏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、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司
二〇二〇年十月二十七日