

汇添富全球移动互联网灵活配置混合型证券投资 基金 2021 年第 2 季度报告

2021 年 06 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 07 月 21 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年7月19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04月01日起至2021年06月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	汇添富全球互联混合（QDII）
基金主代码	001668
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年01月25日
报告期末基金份额总额(份)	990,952,967.11
投资目标	本基金主要投资于全球移动互联主题相关公司的股票，通过对投资对象的精选和组合管理，在科学严格管理风险的前提下，谋求基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	本基金资产配置策略及股票投资策略适用于境内市场投资、境外市场投资及港股通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票的投资。本基金主要采用稳健的资产配置和积极的股票投资策略。在资产配置中，根据宏观经济和证券市场状况，通过分析全球经济形势、经济结构特征、地区及产业竞争优势以及股票市场、固定收益产品及货币市场工具等的预期风险收益特征，确定投资组合的投资范围和比例。在股票投资中，采用“自下而上”

	的策略，精选出全球移动互联主题相关公司中商业模式清晰、竞争优势明显、具有长期持续增长模式且估值水平相对合理的上市公司，精心科学构建股票投资组合，并辅以严格的投资组合风险控制，以获得中长期的较高投资收益。本基金投资策略的重点是精选股票策略。本基金的投资策略还包括：债券投资、衍生品投资。
业绩比较基准	人民币计价的中证海外中国互联网指数收益率*50%+中证移动互联网指数收益率*50%
风险收益特征	本基金为主要投资于全球移动互联主题相关公司股票的混合型基金，属于证券投资基金中高预期风险高预期收益的品种，其预期风险与预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。
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
境外资产托管人	英文名称:Brown Brothers Harriman & Co.
	中文名称:布朗兄弟哈里曼银行

§ 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04月01日 - 2021年06月30日)
1. 本期已实现收益	4,285,790.02
2. 本期利润	153,335,630.39
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1550
4. 期末基金资产净值	2,985,385,183.15
5. 期末基金份额净值	3.013

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
过去三个月	5.31%	1.11%	3.41%	1.33%	1.90%	-0.22%
过去六个月	4.29%	1.49%	-2.10%	1.68%	6.39%	-0.19%
过去一年	31.11%	1.44%	9.00%	1.60%	22.11%	-0.16%
过去三年	95.52%	1.37%	53.40%	1.62%	42.12%	-0.25%
自基金合同生效日起至今	201.30%	1.23%	85.30%	1.45%	116.00%	-0.22%

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

汇添富全球互联混合（QDII）累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2017年01月25日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 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 (年)	说明
		任职日期	离任日期		
杨璿	本基金的 基金经理	2017年01 月25日		11	<p>国籍:中国。学历:清华大学工程学硕士。从业资格:证券投资基金从业资格。</p> <p>从业经历:2010年8月加入汇添富基金管理股份有限公司,2010年8月至2017年1月担任公司的TMT行业分析师。2017年1月25日至今任汇添富全球移动互联网灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018年6月21日至今任汇添富文体娱乐主题混合型证券投资基金的基金经理。2018年7月5日至今任汇添富3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金(LOF)的基金经理。2019年1月18日至2020年12月22日任汇添富移动互联网股票型证券投资基金的基金经理。2020年5月25日至今任汇添富优质成长</p>

					混合型证券投资基金的基金经理。2020年11月18日至今任汇添富数字生活主题六个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021年2月24日至今任汇添富数字未来混合型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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的成员简介

注：本基金无境外投资顾问。

4.3 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立嵌入式全流程管控模式实现了不同组合之间公平交易的执行和实现。具体情况如下：

一、本基金管理人进一步完善了公司内部公平交易管理规范 and 流程，以确保公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略及投资品种。

二、本着“时间优先、价格优先”的原则，本基金管理人对满足限价条件且对同一证券

有相同交易需求的基金等投资组合采用了交易系统内的公平交易模块进行操作，实现事前和事中公平交易的管控。

三、对不同投资组合进行了同向交易价差分析，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溢价率进行了 T 分布检验。对于没有通过检验的交易，再根据交易价格、交易频率、交易数量和交易时间进行了具体分析，进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

四、根据交易价格、交易频率、交易数量等对不同组合之间的反向交易进行了综合分析。

通过上述管控措施的有效落实，本报告期内，本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易，也未出现本基金管理人管理的不同投资组合间有同向交易价差异异常的情况。

4.4.2 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 5 次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易，基金经理按内部规定履行了审批程序，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2021 年上半年，经过了年初延续去年的趋势性上涨、春节后的快速下跌，此后全球股指开始呈现一路向上的态势。新冠疫情在全球各地进展不一，中国大陆作为控制最好的地区，虽有部分省份出现零星病例，但整体非常稳定，为各行业的平稳发展创造了良好的环境。新兴市场疫情快速蔓延，对很多国家的供应链、生产产生了巨大影响；欧美等成熟市场由于疫苗接种的普及，疫情得到了有效的控制，虽然变异毒株使得疫苗的有效性下降，但经济重回正轨的趋势不变。

由于 2020 年疫情的影响，全球供应链普遍较为谨慎，对需求快速恢复的预期不足，导致产能扩张与供应链备货都非常有限。在今年全球普遍流动性宽松、美国刺激政策力度较大的背景下，需求端快速恢复，供给端出现显著压力，加上新兴市场的疫情蔓延，中国的供应链与品牌开始承接需求转移，我们观察到很多行业的龙头企业的全球份额得以快速提升。

但与此同时，由于阶段性的供需失衡，大宗商品价格快速上涨，带动整个产业链条的成本上涨，加上集装箱海运等供给极度紧张，导致通胀压力不断上升、进出口贸易不够顺畅，也带来了一些负面影响。

对于全球移动互联网面对的科技领域，我们分三条主线来进行论述。

1. 移动互联网板块，数字娱乐、数字广告、电子商务等需求旺盛，但中国互联网企业面临阶段性政策压力较大、部分企业处于投入周期，上半年表现远远落后于大市，是本只基金的最主要拖累；

2. 数字化软硬件板块，在疫情的催化下，行业发展进一步加速，但估值亦处于较高水平，表现居中；

3. 半导体板块，由于上述的阶段性供需失衡严重，很多企业的交货周期不断拉长、产品价格上涨，带来了较强的盈利向上周期，是表现最好的板块。

回顾上半年，我们减持了部分政策风险较高的子板块，增持了半导体板块与海外互联网部分个股。我们仍然看好在数字化浪潮的大背景下，那些提供基础软硬件、核心芯片、具备定价权的互联网龙头企业。国内的高压政策会影响小部分企业的正常运营与商业逻辑，但从海外的经验来看，并不会对大部分龙头企业的定价权、行业地位产生根本性的影响。

本基金本报告期基金份额净值增长率为 5.31%。同期业绩比较基准收益率为 3.41%。

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

无。

§ 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 (人民币元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,725,196,609.46	88.75
	其中：普通股	2,251,451,898.72	73.32
	存托凭证	473,744,710.74	15.43
	优先股	—	—
	房地产信托	—	—
2	基金投资	212,563.13	0.01
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—

4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	283,721,678.24	9.24
8	其他资产	61,544,478.11	2.00
9	合计	3,070,675,328.94	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 232,947,555.82 元，占期末净值比例为 7.80%。

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
美国	1,980,818,459.70	66.35
中国	377,055,506.82	12.63
中国香港	367,322,642.94	12.30
合计	2,725,196,609.46	91.28

注：按公允价值占基金资产净值比例从大到小排序；国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定；此处股票包括普通股和优先股；ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
10 能源	-	-

15 原材料	111,760.98	0.00
20 工业	34,211,188.73	1.15
25 可选消费	645,957,216.58	21.64
30 日常消费	65,847,413.76	2.21
35 医疗保健	1,139,250.53	0.04
40 金融	37,056,778.99	1.24
45 信息技术	1,803,372,781.94	60.41
50 电信服务	110,218,230.91	3.69
55 公用事业	18,428.04	0.00
60 房地产	27,263,559.00	0.91
合计	2,725,196,609.46	91.28

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

5.4 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及存托凭证投资明细

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	MICROSOFT CORP	微软公司	MSFT US	纳斯达克交易所	美国	87,450	153,041,093.32	5.13
2	AMAZON COM INC	亚马逊公司	AMZN US	纳斯达克交易所	美国	5,915	131,453,644.60	4.40

				达 克 交 易 所				
3	Facebook Inc		FB US	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	44,550	100,070,053.0 8	3.35
4	Tencent Holdings Ltd	腾讯控 股有 限公 司	700 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	190,10 0	92,376,190.27	3.09
5	Alphabet Inc.	谷歌 (Alphabet)	GOOG L US	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	5,770	91,017,177.73	3.05
6	Adobe Inc	奥多比公 司	ADBE US	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	23,350	88,339,890.71	2.96

				克 交 易 所				
7	Meituan	美团	3690 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	289,400	77,153,586.22	2.58
8	SALESFORCE.COM, INC.	赛富时公司	CRM US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	46,900	74,008,604.61	2.48
9	Sea Ltd		SE US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	41,400	73,441,259.24	2.46
10	ServiceNow, Inc.		NOW US	纽 约 证 券	美 国	17,750	63,015,126.20	2.11

				交易所				
--	--	--	--	-----	--	--	--	--

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9 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基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	PROSHARES ULTRAPRO SHORT QQQ	ETF 型	开放式	ProShares Trust	212,563.13	0.01

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，腾讯控股有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	697,819.62
2	应收证券清算款	48,972,591.66
3	应收股利	403,345.88
4	应收利息	18,832.72
5	应收申购款	11,451,888.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	61,544,478.11

5.10.4 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。

5.10.5 报告期末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。

§ 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	966,783,915.86
本报告期基金总申购份额	187,293,111.56
减：本报告期基金总赎回份额	163,124,060.31
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	990,952,967.11

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交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
----	------	------	---------	---------	------

1	申购	2021年05月06日	2,864,537.89	8,235,546.43	-
2	申购	2021年05月06日	3,777,897.79	10,861,456.14	-
3	申购	2021年06月16日	1,655,780.74	4,780,238.99	-
合计			8,298,216.42	23,877,241.56	

注：基金管理人于2021年5月6日分别使用自有资金8,235,556.43元申购本基金2,864,537.89份，使用10,861,466.14元申购本基金3,777,897.79份，适用费率为都为固定费用1000元，折扣为0.1折，实际交易费10元；于2021年6月16日使用自有资金4,780,478.00元申购本基金1,655,780.74份，折扣为0.1折，实际交易费239.01元；相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

§ 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

注：无。

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全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富全球移动互联灵活配置混合型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、报告期内汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金在指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

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼 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 07 月 21 日