

# 汇添富移动互联股票型证券投资基金 2022 年 第 1 季度报告

2022 年 03 月 31 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：2022 年 04 月 22 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 2022 年 4 月 20 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 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 03 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况

基金简称	汇添富移动互联股票
基金主代码	000697
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 08 月 26 日
报告期末基金份额总额(份)	1,402,195,970.85
投资目标	本基金采用自下而上的投资方法，以基本面分析为立足点，精选移动互联主题的优质上市公司，结合市场脉络，做中长期布局，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	本基金为股票型基金。股票投资的主要策略包括资产配置策略和个股精选策略。其中，资产配置策略用于确定大类资产配置比例以有效规避系统性风

	<p>险；个股精选策略用于发掘移动互联主题相关的上市公司中商业模式独特、竞争优势明显，具有长期持续增长模式、估值水平相对合理的优质上市公司。</p> <p>本基金的投资策略还包括：债券投资策略、股指期货投资策略、权证投资策略、资产支持证券投资策略。</p>		
业绩比较基准	中证移动互联网指数*80%+中债综合指数*20%		
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。		
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		
下属分级基金的基金简称	汇添富移动互联股票 A	汇添富移动互联股票 C	汇添富移动互联股票 D
下属分级基金的交易代码	000697	015198	015199
报告期末下属分级基金的份额总额(份)	1,402,167,699.62	7,920.01	20,351.22

注：本基金于 2022 年 3 月 7 日新增 C 类、D 类份额。

### § 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(2022 年 01 月 01 日 - 2022 年 03 月 31 日)		
	汇添富移动互联股票 A	汇添富移动互联股票 C	汇添富移动互联股票 D
1. 本期已实现收益	-93,569,882.24	-301.93	-650.98
2. 本期利润	-888,828,772.70	-521.31	-1,395.36
3. 加权平均基金份额本	-0.5999	-0.0934	-0.1372

期利润			
4. 期末基金资产净值	2,416,611,914.62	13,642.51	35,062.64
5. 期末基金份额净值	1.723	1.723	1.723

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

汇添富移动互联股票 A						
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	-25.48%	1.64%	-20.48%	1.41%	-5.00%	0.23%
过去六个月	-17.36%	1.40%	-15.41%	1.18%	-1.95%	0.22%
过去一年	-8.84%	1.45%	-11.14%	1.16%	2.30%	0.29%
过去三年	55.09%	1.68%	25.57%	1.43%	29.52%	0.25%
过去五年	23.69%	1.70%	20.55%	1.38%	3.14%	0.32%
自基金合同生效日起至今	72.30%	2.18%	59.68%	1.60%	12.62%	0.58%
汇添富移动互联股票 C						
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
自基金合同生效日起至今	-5.43%	1.83%	-4.83%	1.68%	-0.60%	0.15%

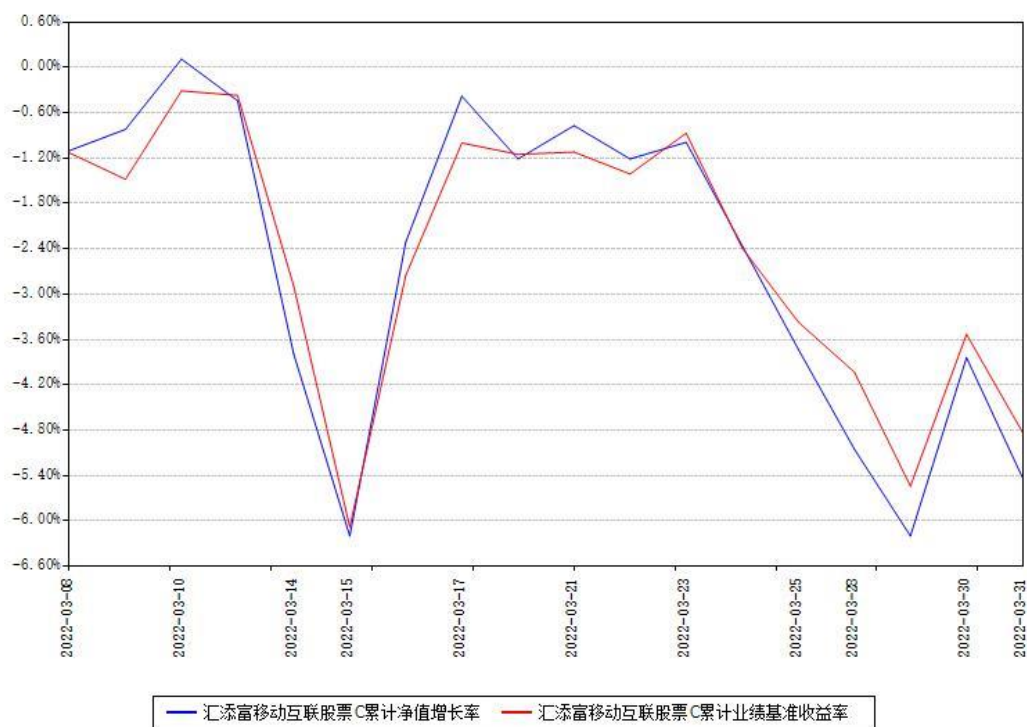
汇添富移动互联股票 D						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
自基金合同生效日起至今	-5.43%	1.83%	-4.83%	1.68%	-0.60%	0.15%

### 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

汇添富移动互联股票A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富移动互联股票C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富移动互联股票D累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：1、本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2014年08月26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。

2、本基金于2022年03月07日新增C、D类份额，新增份额自实际有资产之日起披露业绩

数据。

## § 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		
张朋	本基金的 基金经理	2020 年 12 月 22 日		10	<p>国籍：中国。学历：硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2012 年起从事证券研究和投资工作，曾任职于东方证券、光大证券，曾任申万菱信基金管理有限公司基金经理。2020 年 7 月加入汇添富基金管理股份有限公司。2020 年 12 月 22 日至今任汇添富移动互联股票型证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月 7 日至今任汇添富精选核心优势一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月 28 日</p>

					至今任汇添富港股通专注成长混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月 21 日至今任汇添富品牌价值一年持有期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 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 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、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内的公平交易模块,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，本基金管理人管理的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 7 次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控，事后对交易时点、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

本季度沪深 300、创业板指分别下跌 14.5%、20.0%，中证移动互联指数下跌 25.1%。国内宏观经济“供给冲击、需求收缩、预期转弱”的局面延续，外部俄乌战争引致原材料价格进一步上涨，加剧了全球通胀水平，也加速了美国加息进度。由俄乌战争引发的关于中美关系的担忧也造成了海外资金流向的波动。实体产业层面，尽管面临上述困难，我们观察到国内部分行业在 1-2 月还是有明显的恢复，但随着 3 月份深圳、上海和吉林疫情的发生，国内防疫政策也进一步收紧，许多行业重新进入下行通道，预计复苏的时间可能进一步延后。整体来看，本季度是一个艰难的季度，诸多不利因素同时影响着实体经济和权益投资，这在过往也是不太多见的。

从行业表现看，在全球能源价格高企的环境下，本季度煤炭板块表现一支独秀，全年指数上涨 23.4% 遥遥领先，地产、银行板块小幅为正，其他二十多个行业均为负收益，其中电子、军工、汽车、家电跌幅居前，幅度均超过 20%。这些板块整体处于中游，同时受到上游材料涨价和下游需求不振的不利影响，表现较差。

本基金组合中，消费电子板块及其相关的半导体、互联网板块跌幅较大，少数基本面特别强劲或者需求以海外市场为主的个股表现相对坚挺。消费电子制造业我们做了小幅减持，半导体板块的持仓也做了部分调整，主要增加了部分长期成长空间较大的个股配置，并对半

导体板块整体供需格局缓解带来的负向 Beta 保持关注。在海外较国内经济复苏相对更为明确的情况下，我们也增加了部分相关个股的配置。

本季度市场在多重利空的集中考验下，我们对组合中的大部分个股的长期成长仍具信心，当经济预期开始好转，市场回暖，公司将恢复强劲成长势头；但市场剧烈调整的过程中，也显示了我们对于个别公司的研究还不够深入全面，未来我们的投资将更加深入和聚焦，并在板块内继续坚持子行业相对均衡、个股适度集中的配置方法，努力获取 A 股科技板块长周期的成长收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期 A 类基金份额净值增长率为-25.48%，同期业绩比较基准收益率为-20.48%；本基金本报告期内新增 C 类份额，自实际有资产之日起至报告期末的份额净值增长率为-5.43%；同期业绩比较基准收益率为-4.83%。本基金本报告期内新增 D 类份额，自实际有资产之日起至报告期末的份额净值增长率为-5.43%；同期业绩比较基准收益率为-4.83%。

#### 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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,010,208,504.08	82.96
	其中：股票	2,010,208,504.08	82.96
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	411,714,204.90	16.99
8	其他资产	1,204,558.12	0.05
9	合计	2,423,127,267.10	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	1,211,258,464.75	50.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,705,025.00	1.31
E	建筑业	7,110.12	0.00
F	批发和零售业	306,040.55	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	16,541.00	0.00
H	住宿和餐饮业	7,603.20	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	440,059,429.72	18.21
J	金融业	242,253,535.66	10.02
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	46,991,716.72	1.94
M	科学研究和技术服务业	58,181.26	0.00
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	15,752.10	0.00
R	文化、体育和娱乐业	37,529,104.00	1.55
S	综合	-	-
	合计	2,010,208,504.0	83.18

		8	
--	--	---	--

## 5.2.2 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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 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	300059	东方财富	5,742,149	145,506,055.66	6.02
2	688798	艾为电子	786,314	134,302,431.20	5.56
3	002415	海康威视	2,670,413	109,486,933.00	4.53
4	002475	立讯精密	3,360,542	106,529,181.40	4.41
5	688508	芯朋微	1,150,189	102,447,334.23	4.24
6	300661	圣邦股份	297,300	94,951,746.00	3.93
7	603893	瑞芯微	1,034,800	93,266,524.00	3.86
8	600570	恒生电子	1,789,683	79,569,306.18	3.29
9	300628	亿联网络	997,500	77,555,625.00	3.21
10	603501	韦尔股份	362,120	70,034,008.00	2.90

#### 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：本基金本报告期末投资股指期货。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末投资国债期货。

#### 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人民银行及其派出机构、中国银保监会及其派出机构、中国证监会及其派出机构、国家市场监督管理总局及机关单位、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	700,663.09
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	503,895.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,204,558.12

#### 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

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	300661	圣邦股份	29,027,358.00	1.20	大宗交易流通受限

### § 6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	汇添富移动互联股票 A	汇添富移动互联股票 C	汇添富移动互联股票 D
本报告期期初基金份额总额	1,541,310,049.22	-	-
本报告期基金总申购份额	90,424,186.86	10,729.00	20,351.22
减:本报告期基金总赎回份额	229,566,536.46	2,808.99	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期末基金份额总额	1,402,167,699.62	7,920.01	20,351.22

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

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本基金的基金管理人本报告期末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

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移动互联股票型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富移动互联股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富移动互联股票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、报告期内汇添富移动互联股票型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](http://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

2022 年 04 月 22 日