

**华夏中证人工智能主题交易型开放式指数**

**证券投资基金**

**2022 年第 3 季度报告**

**2022 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：二〇二二年十月二十五日

## §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 2022 年 10 月 21 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 2022 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 AIETF）
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	759,470,185.00 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，存托凭证投资策略，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
	(2022 年 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	-14,642,503.76
2.本期利润	-155,584,502.70
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2085

4.期末基金资产净值	607,941,965.42
5.期末基金份额净值	0.8005

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)扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

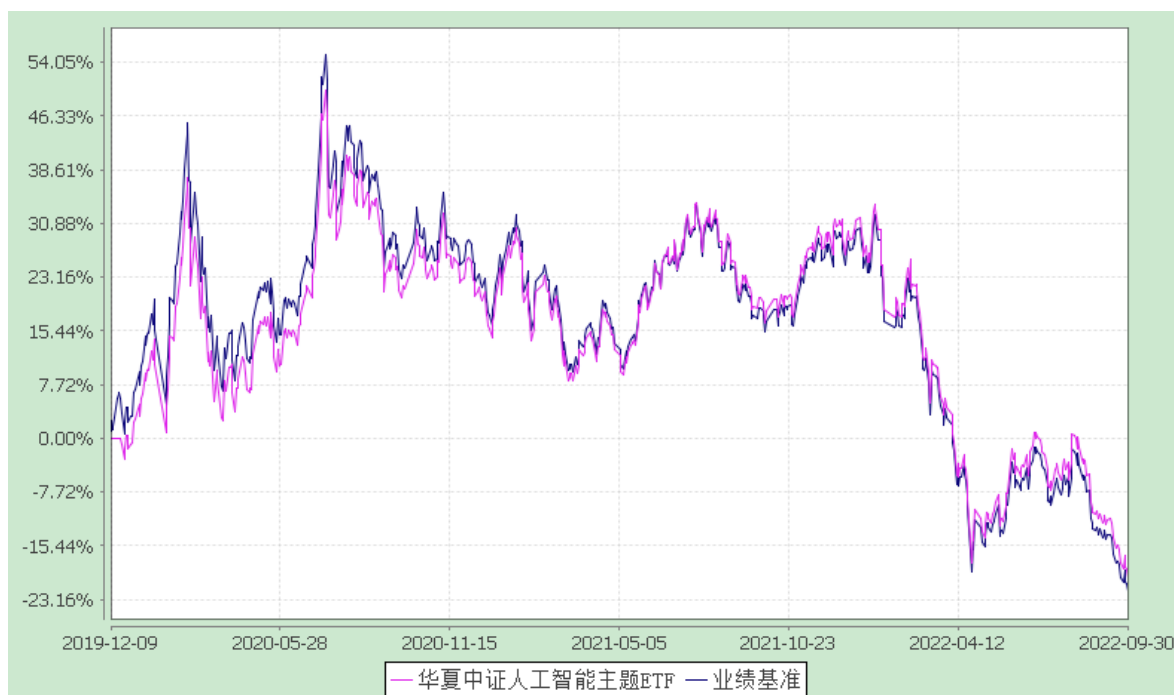
### 3.2 基金净值表现

#### 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	-20.59%	1.39%	-21.02%	1.40%	0.43%	-0.01%
过去六个月	-23.45%	1.86%	-24.42%	1.87%	0.97%	-0.01%
过去一年	-32.33%	1.71%	-33.27%	1.72%	0.94%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-19.95%	1.80%	-22.02%	1.84%	2.07%	-0.04%

#### 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的历史走势对比图  
 (2019 年 12 月 9 日至 2022 年 9 月 30 日)



## §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	2019-12-09	-	14 年	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。历任数量投资部研究员、基金经理助理、华夏新趋势灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2018 年 1 月 17 日至 2021 年 5 月 26 日期间）、华夏新锦绣灵活配置混合型证券投资基金基金经理

					经理(2019 年 1 月 31 日至 2021 年 5 月 26 日期间)、华夏中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理 (2019 年 9 月 17 日至 2021 年 12 月 13 日期间)、华夏中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金经理 (2020 年 4 月 3 日至 2021 年 12 月 13 日期间)、上证金融地产交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理 (2017 年 12 月 11 日至 2022 年 3 月 14 日期间) 等。
--	--	--	--	--	---

注：①上述“任职日期”和“离任日期”为根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。首任基金经理的，其“任职日期”为基金合同生效日。

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、安全高效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，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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% 的交易共有 25 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

### 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，国际方面，俄乌战争仍在进行，正从 1.0 版本向 2.0 版本切换；高通胀依然在全球蔓延，美联储继续收紧货币政策，但本轮通胀形成的原因较为复杂，既有长期因素，也有短期因素。所谓长期因素即当前的逆全球化，作为当前及未来一段时间的世界主基调，过去的分工与资源有效配置将逐渐被打断，也意味着，至少在相当长一段时间里，低通胀红利的时代已经过去了。而几个阶段性的因素，无论是中美贸易摩擦加征关税、还是疫情及应对疫情的天量宽松、亦或俄乌战争及外溢效应，这几个因素，都围绕着当前的经济贸易体系，在原料端，生产端，需求端，扰动着当前业已疲弱的经济、贸易体系，共同助推了本轮通胀。其中，尤以美国的极度宽松最为突出。因素的复杂性，也意味着控制通胀显然不是加息一项即可以实现的，因此加息在很大程度上，也是美联储重拾美元信用，甚至不排除有来自选举因素、政治施压等方面的综合考量。但作为全球货币，美联储的动作，美元指数的大幅回升，也给全球经济与金融带来很大的冲击。

国内方面，疫情阶段性反复，经济缓慢复苏。房地产依然是经济的最大拖累因素，需要谨慎提防硬着陆风险；基建在当下是最为确定的抓手，但基建对经济的拉动作用远不及地产；

出口较为稳定，边际上有所放缓，或与海外货币收紧需求抑制有关，在美联储持续加息带来的世界经济衰退阴影下，出口有一定的隐忧，但当前世界经济的问题，不仅仅是需求的问题，也是供给的问题，这对于供应链较为齐全的中国乃至诸多东亚经济体而言，其实相对优势更为明显；消费的数据有所改善，能否持续尚待观察。通胀方面，横向比较，中国较为可控，目前主要集中在食品价格。货币政策整体宽松。汇率方面，在美联储加息、欧元区陷入困境背景下，美元指数持续上涨，人民币相对美元贬值，但对一篮子货币仍然维持在较强区间，与主要非美元货币相比，展现出较强韧性和稳定性。事实上，当前的国际环境为人民币国际化提供了很好的契机。

市场方面，美联储为代表的骤松骤紧的货币政策是当前市场最大的背景，是资本市场最主要的压制因素，地缘因素以及对于经济的担忧也抑制了风险偏好。报告期内，市场持续调整。

基金投资运作方面，作为被动指数基金，本基金主要采取复制指数的投资策略，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、中国国际金融股份有限公司、中泰证券股份有限公司、海通证券股份有限公司等。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 9 月 30 日，本基金份额净值为 0.8005 元，本报告期份额净值增长率为 -20.59%，同期业绩比较基准增长率-21.02%。本基金本报告期跟踪偏离度为+0.43%，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	602,440,728.00	98.94



	其中：股票	602,440,728.00	98.94
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	5,467,875.79	0.90
8	其他资产	959,447.22	0.16
9	合计	608,868,051.01	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 33,191,002.00 元,占本基金期末资产净值的 5.46%。

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	352,371,221.78	57.96
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	250,000,956.63	41.12
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	24,767.35	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	43,782.24	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	602,440,728.00	99.10

### 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	2,124,321	64,621,844.82	10.63
2	002230	科大讯飞	1,313,939	43,123,477.98	7.09
3	603501	韦尔股份	502,470	40,262,921.10	6.62
4	002920	德赛西威	196,291	27,078,343.45	4.45
5	600588	用友网络	1,213,787	21,362,651.20	3.51
6	603019	中科曙光	827,360	19,624,979.20	3.23
7	002405	四维图新	1,677,000	19,352,580.00	3.18
8	300454	深信服	175,810	17,581,000.00	2.89
9	688008	澜起科技	319,780	16,734,087.40	2.75
10	002236	大华股份	1,270,100	16,320,785.00	2.68

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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

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

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	75,068.02
2	应收证券清算款	868,632.39
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	15,746.81
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	959,447.22

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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	600588	用友网络	5,280,000.00	0.87	转融通出借证券受限
2	603019	中科曙光	3,320,800.00	0.55	转融通出借证券受限
3	688008	澜起科技	2,668,830.00	0.44	转融通出借证券受限
4	300454	深信服	1,350,000.00	0.22	转融通出借证券受限

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

本报告期期初基金份额总额	721,970,185.00
报告期期间基金总申购份额	97,500,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	60,000,000.00
报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	759,470,185.00

## §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	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	持有基金	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占

者类别	号	份额比例达到或者超过 20% 的时间区间					比
机构	1	2022-07-01 至 2022-09-30	397,442,400.00	48,120,000.00	6,740,000.00	438,822,400.00	57.78%
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。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

2022 年 7 月 7 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。

2022 年 7 月 20 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。

2022 年 7 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。

2022 年 7 月 30 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。

2022 年 8 月 10 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。

2022 年 8 月 12 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。

2022 年 8 月 13 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。

2022 年 8 月 19 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。

2022 年 9 月 1 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。

2022 年 9 月 3 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。

2022 年 9 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。

### 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

资管理人资格、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、首批公募 MOM 基金管理人、首批纳入互联互通 ETF 基金管理人、首批北交所主题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，国内首家承诺“碳中和”具体目标和路径的公募基金公司，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。

## §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

二〇二二年十月二十五日