

华富中证人工智能产业交易型开放式指数
证券投资基金
2023 年第 3 季度报告

2023 年 9 月 30 日

基金管理人：华富基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 10 月 25 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 24 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 2023 年 07 月 01 日起至 2023 年 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华富中证人工智能产业 ETF
场内简称	人工智能
基金主代码	515980
基金运作方式	契约型开放（ETF）
基金合同生效日	2019 年 12 月 24 日
报告期末基金份额总额	1,051,064,500.00 份
投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证人工智能产业指数。在正常市场情况下，力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.20% 以内，年跟踪误差控制在 2% 以内。
投资策略	本基金主要采用完全复制法，即按照标的指数成份股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动而进行相应的调整。但因特殊情况（如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等）导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.20%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	中证人工智能产业指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪中证人工智能产业指数，其风险收益特征与标的指数所表征

	的市场组合的风险收益特征相似。
基金管理人	华富基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

§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（2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日）
1. 本期已实现收益	-9,958,392.12
2. 本期利润	-144,488,592.50
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1643
4. 期末基金资产净值	884,135,156.59
5. 期末基金份额净值	0.8412

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

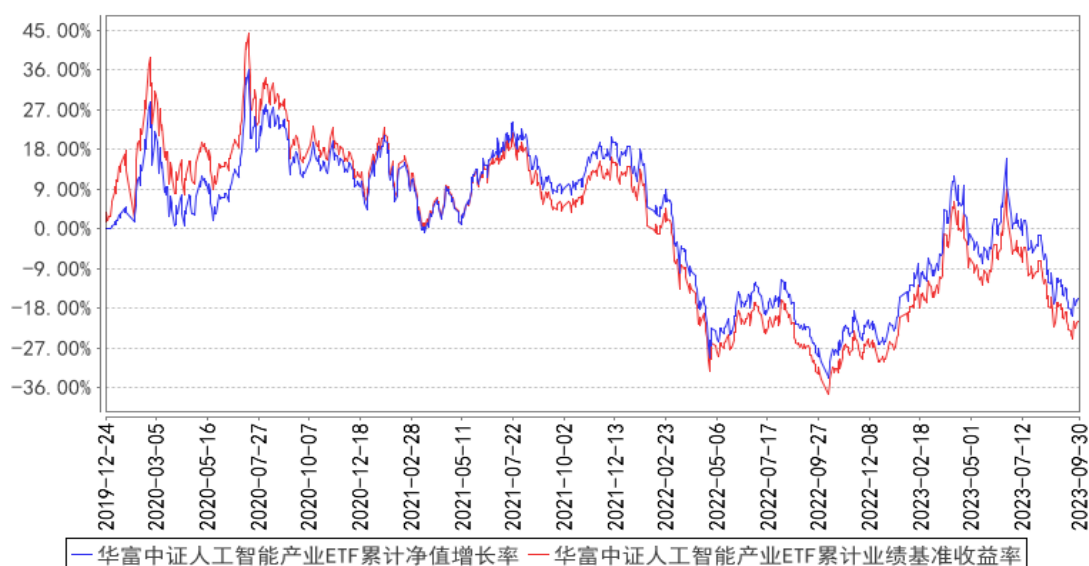
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	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	-16.84%	1.86%	-16.93%	1.88%	0.09%	-0.02%
过去六个月	-19.19%	2.14%	-19.86%	2.15%	0.67%	-0.01%
过去一年	20.58%	2.01%	19.86%	2.02%	0.72%	-0.01%
过去三年	-25.24%	1.74%	-31.82%	1.75%	6.58%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	-15.88%	1.81%	-21.05%	1.89%	5.17%	-0.08%

注：本基金业绩比较基准收益率=中证人工智能产业指数收益率。

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

华富中证人工智能产业ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金建仓期为2019年12月24日到2020年6月24日，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本报告期内，本基金严格执行了《华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的相关规定。

§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		
张娅	本基金基金经理、公司总经理助理、指数投资部总监、公司公募投资决策委员会委员	2019年12月24日	-	十八年	美国肯特州立大学金融工程硕士，硕士研究生学历。曾先后担任华泰柏瑞基金管理有限公司指数投资部总监兼基金经理、上海同安投资管理有限公司副总经理兼宏观量化中心总经理。2017年4月加入华富基金管理有限公司，自2019年1月28日起任华富中证5年恒定久期国债指数型证券投资基金基金经理，自2019年12月24日起任华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2020年4月23日起任华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，自2020年8月3日起任华富中债-安徽省公司信用类债券指数证券投资基金基金经理，自2022年7月22日起任华富消费成长股票型证券投资基金基金经理，自2022年8月31日起任华富中证科创创业50指数增强型证券

					投资基金基金经理，具有基金从业资格。
郜哲	本基金基金经理	2019 年 12 月 24 日	-	九年	北京大学理学博士，硕士研究生学历。先后担任方正证券股份有限公司博士后研究员、上海同安投资管理有限公司高级研究员。2017 年 4 月加入华富基金管理有限公司，自 2018 年 2 月 23 日起任华富中证 100 指数证券投资基金基金经理，自 2019 年 12 月 24 日起任华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2020 年 4 月 23 日起任华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，自 2022 年 7 月 22 日起任华富消费成长股票型证券投资基金基金经理，自 2022 年 8 月 31 日起任华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金基金经理，具有基金从业资格。
李孝华	本基金基金经理、指数投资部权益指数经理	2023 年 2 月 9 日	-	十年	南开大学金融学硕士、硕士研究生学历。曾任金瑞期货研究所贵金属研究员、国泰信息技术有限公司量化投资平台设计与开发员、华泰柏瑞基金基金经理助理。2019 年 10 月加入华富基金管理有限公司，曾任基金经理助理，自 2021 年 5 月 7 日起任华富中证 100 指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 6 月 28 日起任华富中证证券公司先锋策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 8 月 11 日起任华富中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 11 月 17 日起任华富中小企业 100 指数增强型证券投资基金基金经理，自 2022 年 9 月 5 日起任华富灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2023 年 2 月 9 日起任华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2023 年 2 月 9 日起任华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，自 2023 年 2 月 9 日起任华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金基金经理，自 2023 年 3 月 24 日起任华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，具有基金从业资格。

注：1、上述任职日期为根据公司决定确定的聘任日期，离任日期为根据公司决定确定的解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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

本报告期内，本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法律法规，对本基金的管理始终按照基金合同、招募说明书的要求和公司制度的规定进行。本基金的交易行为合法合规，未发现异常情况；相关信息披露真实、完整、准确、及时；基金各种账户类、申购赎回、注册登记业务均按规定的程序进行，未出现重大违法违规或违反基金合同的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法规要求，结合实际情况，制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节全部纳入公平交易管理中，实行事前控制、事中监控、事后分析反馈的流程化管理。在制度和流程上确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金报告期内不存在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% 的情形。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2023 年三季度，权益市场波动较大，市场处于从政策底到市场底的过渡期，随着 7 月底政治局会议释放明显稳增长信号，市场阶段性企稳，但由于政策底出现后，经济实质好转的信号尚不明显，整个市场在 8、9 月间仍然较为弱势，处于寻底过程。

人工智能指数在三季度也未能幸免，指数下跌约-17%，前期相对强势的算力子板块领跌。但三季度的下跌更多是跟随市场风险偏好降低以及外资撤出影响所致，行业景气趋势并未出现变化。

三季度中，人工智能技术和商业化落地实质上均在向好发展。海外 AI 应用持续更新迭代，在用户使用体验和便捷性上有了长足的进步。算力部署需求也随之进一步增加。

国内算力公司在海外需求带领下，盈利预期持续提升，而国内应用端，AI 技术发展也有所提速，在海外公布了更高性能的开源大模型后，国内的 AIGC 大模型使用体验大幅提升，且在文生图，

写真，办公等领域逐渐出现高用户黏性的应用。

本基金在 2023 年三季度，密切跟踪指数，为看好人工智能行业的基金投资人谋求与业绩基准基本一致的投资回报。

展望 2023 年四季度，在经历了第三季度的调整之后，当前行业多数公司的估值均在较为合理的区间，行业配置性价比较三季度初有明显提升。而行业的景气趋势也仍在持续向好。算力端在政策鼓励以及实际商业需求的共同催化下持续快速发展，应用端 AIGC 产品用户体验不断提升，预计四季度将出现可对标甚至超越海外 ChatGPT 用户体验的产品。而除了 AIGC，自动驾驶、人形机器人的技术和商业化进程也在加速。我们对人工智能行业的发展保持乐观。

本基金在 2023 年四季度，将继续紧密跟踪业绩基准，为看好人工智能发展方向的投资者提供投资人工智能产业的有利工具。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止本期末，本基金份额净值为 0.8412 元，累计基金份额净值为 0.8412 元。报告期，本基金份额净值增长率为-16.84%，同期业绩比较基准收益率为-16.93%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或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	879,114,019.44	98.82
	其中：股票	879,114,019.44	98.82
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	10,193,152.99	1.15
8	其他资产	319,974.51	0.04
9	合计	889,627,146.94	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	454,504,939.41	51.41
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	424,432,116.35	48.01
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	878,937,055.76	99.41

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

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	144,746.52	0.02
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	9,036.72	0.00
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	24,022.44	0.00
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	177,805.68	0.02

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 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	002230	科大讯飞	1,382,214	70,022,961.24	7.92
2	300308	中际旭创	485,300	56,197,740.00	6.36
3	688111	金山办公	127,860	47,410,488.00	5.36
4	002415	海康威视	1,278,769	43,222,392.20	4.89
5	603501	韦尔股份	379,036	35,273,090.16	3.99
6	603019	中科曙光	882,022	33,993,127.88	3.84
7	002920	德赛西威	212,526	30,527,234.64	3.45
8	688008	澜起科技	580,698	28,860,690.60	3.26
9	000977	浪潮信息	760,833	28,614,929.13	3.24
10	601360	三六零	2,619,081	25,745,566.23	2.91

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

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	688469	中芯集成	4,396	22,683.36	0.00
2	301325	曼恩斯特	237	18,881.79	0.00
3	688484	南芯科技	440	17,723.20	0.00
4	688352	颀中科技	1,264	15,521.92	0.00
5	301382	蜂助手	408	15,348.96	0.00

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。

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。

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

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

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

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

本基金投资的前十名证券发行主体未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是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	319,974.51
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	319,974.51

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：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

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

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	688469	中芯集成	22,683.36	0.00	新股流通受限
2	301325	曼恩斯特	18,881.79	0.00	新股流通受限
3	688484	南芯科技	17,723.20	0.00	新股流通受限
4	688352	颀中科技	15,521.92	0.00	新股流通受限
5	301382	蜂助手	15,348.96	0.00	新股流通受限

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告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

报告期期初基金份额总额	680,064,500.00
报告期期间基金总申购份额	667,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	296,000,000.00
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	1,051,064,500.00

§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

注：本报告期内本基金管理人没有申购、赎回或者买卖本基金份额的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内本基金管理人没有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 (%)
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
联接基金	1	2023.7.1-2023.9.30	192,572,300.00	130,000,000.00	61,750,000.00	260,822,300.00	24.8200
产品特有风险							
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、华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- 2、华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- 3、华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金招募说明书
- 4、报告期内华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

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,相关公开披露信息也可以登录基金管理人网站查阅。

华富基金管理有限公司

2023 年 10 月 25 日