

汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式 证券投资基金 2023 年第 3 季度报告

2023 年 09 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 10 月 25 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 23 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 2023 年 07 月 01 日起至 2023 年 09 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式
基金主代码	014543
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 12 月 28 日
报告期末基金份额总额(份)	168,139,957.24
投资	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差

目标	的最小化。	
投资策略	本基金采用被动式指数化投资方法，按照标的指数的成份股及其权重来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进行相应调整。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。本基金的投资策略主要包括：股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、融资投资策略、国债期货投资策略、参与转融通证券出借业务策略、存托凭证的投资策略。	
业绩比较基准	中证沪港深云计算产业指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%	
风险收益特征	本基金为股票型基金，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。同时本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。 本基金将投资港股通标的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式 A	汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式 C
下属分级基金的交易代码	014543	014544
报告期末下属分级基金的份额总额(份)	92,104,827.07	76,035,130.17

§ 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07月01日 - 2023年09月30日)	
	汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式 A	汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式 C
1. 本期已实现收益	-779,906.19	-752,427.54
2. 本期利润	-14,352,652.93	-13,186,993.31
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1705	-0.1717
4. 期末基金资产净值	79,149,359.13	65,072,721.37
5. 期末基金份额净值	0.8593	0.8558

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。

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

汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式 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	-16.60%	1.75%	-16.42%	1.75%	-0.18%	0.00%
过去六个月	-17.34%	2.03%	-17.11%	2.03%	-0.23%	0.00%
过去一年	32.77%	1.95%	34.52%	1.96%	-1.75%	-0.01%
自基金合同生效日起至今	-14.07%	1.90%	-14.60%	1.93%	0.53%	-0.03%
汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式 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
过去三个	-16.65%	1.74%	-16.42%	1.75%	-0.23%	-0.01%

月						
过去六个月	-17.43%	2.03%	-17.11%	2.03%	-0.32%	0.00%
过去一年	32.46%	1.95%	34.52%	1.96%	-2.06%	-0.01%
自基金合同生效日起至今	-14.42%	1.90%	-14.60%	1.93%	0.18%	-0.03%

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

汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率对比图



汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式C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（2021年12月28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		
乐无穹	本基金的基金经理	2021年12月28日	-	9	国籍：中国。 学历：复旦大学经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2014年7月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任金融工程助理分析

				<p>师、指数与量化投资部分析师。</p> <p>2019 年 4 月 15 日至 2023 年 8 月 29 日任中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。</p> <p>2019 年 7 月 26 日至今任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 10 月 8 日至今任中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 4 月 29 日至 2022 年 11 月 21 日任汇添富中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2021 年 7 月 8 日至今任汇添富中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2021 年 7 月</p>
--	--	--	--	--

				<p>27 日至今任汇添富中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2021 年 9 月 27 日至今任汇添富中证沪港深科技龙头交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月 29 日至今任汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 9 月 29 日至今任汇添富中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金的基金经理。2021 年 10 月 26 日至 2022 年 10 月 30 日任汇添富恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）的基金经理。</p> <p>2021 年 10 月 29 日至今任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互</p>
--	--	--	--	---

					<p>通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月 28 日至今任汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 1 月 11 日至今任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 3 月 29 日至 2022 年 11 月 21 日任汇添富中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 6 月 13 日至 2023 年 9 月 28 日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 7 月 29 日至今任汇添富中证</p>
--	--	--	--	--	---

					<p>1000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 8 月 31 日至今任汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 的基金经理。2022 年 10 月 31 日至今任汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (QDII) 的基金经理。2022 年 12 月 7 日至今任汇添富恒生香港上市生物科技交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 的基金经理。2023 年 4 月 13 日至今任汇添富恒生指数型证券投资基金 (QDII-LOF) 的基金经理。2023 年 5 月 24 日至今任汇添富中证国新央企股东回报交易型开</p>
--	--	--	--	--	--

					<p>放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月 19 日至今任汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2023 年 8 月 23 日至今任汇添富中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

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和流程，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 14 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

2023 年三季度，市场先涨后跌，整体小幅下跌。分行业板块看，金融、周期类表现较好，成长型的传媒、计算机、新能源等跌幅居前。

全球来看，通胀普遍有所回落，美元指数 7 月下旬开始表现强势。9 月美联储议息会议维持现有利率水平不变。尽管加息周期接近尾声已成为市场共识，但此次会议点阵图显示政策取向偏向鹰派立场，年内加息一次概率提升，降息时间或将延后至明年下半年。

国际合作的角度来看，中美在 8 月成立贸易工作组，9 月下旬宣布成立经济、金融两个工作组，细分领域对话机制逐步建立。双方均强调了中美合作的重要性，未来在多个领域的沟通交流预计都将有所加强。

国内来看，7 月经济数据整体走弱，处于历史低位，8 月出现内生修复迹象，且普遍好

于市场预期。三季度多项经济刺激政策出台，覆盖民营经济、资本市场等多个层面，政治局会议继续强调稳增长基调，有望促进四季度经济的持续修复。货币政策方面，8月MLF调降15个BP，一年期LPR调降10个BP，9月下调金融机构存款准备金率0.25个百分点，市场流动性整体保持合理充裕。

资本市场方面，三季度市场整体小幅收跌，上半年表现强势的成长型板块在三季度走弱。经济数据阶段性走弱对市场情绪有所冲击，但市场整体位于估值低位，具备长期投资价值。

港股方面，当前整体估值性价比较高，具备底部修复的条件，且其中大批科技型企业也是本轮科技主题演绎的核心且稀缺的标的。

2023年起生成式人工智能获得市场广泛关注，从应用、算法到底层算力等产业链环节都值得重视。本基金跟踪中证沪港深云计算产业指数，同时覆盖A股、港股的云计算服务企业、为云计算提供硬件设备的企业等。港股部分的互联网龙头企业具备算法和模型潜力，而A股部分以算力基础设施为主。在人工智能产业前景广阔的背景之下，全球进入高算力投入阶段，服务器、光模块等领域订单充分、业绩弹性强。软件应用领域获得智能化赋能，商业价值提升预期强，预计从通用软件到细分垂直领域能够陆续看到突破。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式A类份额净值增长率为-16.60%，同期业绩比较基准收益率为-16.42%。本报告期汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式C类份额净值增长率为-16.65%，同期业绩比较基准收益率为-16.42%。

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

本基金为发起式基金，且截至本报告期末，本基金基金合同生效未满3年，暂不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

§ 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	135,748,704.59	91.02
	其中：股票	135,748,704.59	91.02
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	12,958,216.65	8.69
8	其他资产	437,438.35	0.29
9	合计	149,144,359.59	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 28,120,101.48 元，占期末净值比例为 19.5%。

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	37,335,716.00	25.89
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	69,685,975.11	48.32
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	606,912.00	0.42

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	107,628,603.11	74.63

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

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票组合。

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
10 能源	-	-
15 原材料	-	-
20 工业	-	-
25 可选消费	-	-
30 日常消费	-	-
35 医疗保健	-	-
40 金融	429,157.20	0.30
45 信息技术	8,529,692.02	5.91
50 电信服务	19,161,252.26	13.29
55 公用事业	-	-
60 房地产	-	-
合计	28,120,101.48	19.50

注：（1）以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

（2）由于四舍五入的原因市值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

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	00700	腾讯控股	53,800	15,116,632.86	10.48
2	300308	中际旭创	89,300	10,340,940.00	7.17
3	688111	金山办公	25,480	9,447,984.00	6.55
4	000938	紫光股份	318,200	7,499,974.00	5.20
5	600570	恒生电子	211,440	6,861,228.00	4.76
6	603019	中科曙光	162,900	6,278,166.00	4.35
7	000977	浪潮信息	143,300	5,389,513.00	3.74
8	600588	用友网络	286,500	4,761,630.00	3.30
9	300502	新易盛	98,720	4,541,120.00	3.15
10	600845	宝信软件	100,084	4,521,795.12	3.14

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

注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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、国家金融监督管理总局（前身为中国银保监会）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受到公开谴责、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	35,829.10
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	401,609.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	437,438.35

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：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

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

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式 A	汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式 C
本报告期期初基金份额总额	73,605,663.90	65,604,973.38
本报告期基金总申购份额	62,498,409.25	78,899,749.57
减：本报告期基金总赎回份额	43,999,246.08	68,469,592.78
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	92,104,827.07	76,035,130.17

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

单位：份

	汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式 A	汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式 C
报告期初持有的基金份额	10,002,790.18	-

报告期期间买入/申购总份 额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份 额	-	-
报告期期末管理人持有的 本基金份额	10,002,790.18	-
报告期期末持有的本基金 份额占基金总份额比例 (%)	10.86	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占 基金总份额 比例 (%)	发起份额总 数	发起份额占 基金总份额 比例 (%)	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有 资金	10,002,790.18	5.95	10,002,790.18	5.95	3 年
基金管理人高级 管理人员	-	-	-	-	
基金经理等人员	-	-	-	-	
基金管理人股东	-	-	-	-	
其他	361,871.28	0.22	-	-	
合计	10,364,661.46	6.17	10,002,790.18	5.95	

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式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、报告期内汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式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。

10.2 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

10.3 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

2023 年 10 月 25 日