

# 天弘恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）

## 2021年第3季度报告

2021年09月30日

基金管理人:天弘基金管理有限公司

基金托管人:平安银行股份有限公司

报告送出日期:2021年10月27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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年10月25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2021年07月06日起至2021年09月30日止。

## § 2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 天弘恒生科技指数   |
| 基金主代码      | 012348   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式、发起式   |
| 基金合同生效日    | 2021年07月06日  |
| 报告期末基金份额总额 | 1,490,105,408.11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的最小化，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。   |
| 投资策略       | 主要投资策略包括：大类资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、衍生品投资策略、资产支持证券投资策略、中国存托凭证投资策略。   |
| 业绩比较基准     | 恒生科技指数收益率（使用估值汇率折算）×95%+人民币活期存款收益率（税后）×5%  |
| 风险收益特征     | 本基金为股票型基金，风险和收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金为被动管理的指数型基金，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金可投资于境外证券，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投 |

|                 |                                    |                    |
|-----------------|------------------------------------|--------------------|
|                 | 资风险。                               |                    |
| 基金管理人           | 天弘基金管理有限公司                         |                    |
| 基金托管人           | 平安银行股份有限公司                         |                    |
| 下属分级基金的基金简称     | 天弘恒生科技指数A                          | 天弘恒生科技指数C          |
| 下属分级基金的交易代码     | 012348                             | 012349             |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 869, 187, 357. 07份                 | 620, 918, 051. 04份 |
| 境外投资顾问          | 英文名称:无                             |                    |
|                 | 中文名称:无                             |                    |
| 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07月06日 - 2021年09月30日) |                   |
|-----------------|--------------------------------|-------------------|
|                 | 天弘恒生科技指数A                      | 天弘恒生科技指数C         |
| 1. 本期已实现收益      | -4, 539, 240. 47               | -4, 179, 739. 98  |
| 2. 本期利润         | -57, 322, 714. 20              | -65, 420, 131. 90 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0. 1346                       | -0. 1680          |
| 4. 期末基金资产净值     | 712, 416, 846. 75              | 508, 685, 901. 91 |
| 5. 期末基金份额净值     | 0. 8196                        | 0. 8192           |

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（例如，开放式基金的申购赎回费等），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 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

天弘恒生科技指数A净值表现

| 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 | ①-③ | ②-④ |
|----|--------|-----------|------------|--------------|-----|-----|
|    |        |           |            |              |     |     |

|              |         |       |         |       |       |        |
|--------------|---------|-------|---------|-------|-------|--------|
|              |         |       |         | ④     |       |        |
| 自基金合同生效日起至至今 | -18.04% | 2.51% | -19.85% | 2.58% | 1.81% | -0.07% |

天弘恒生科技指数C净值表现

| 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    |
|--------------|---------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 自基金合同生效日起至至今 | -18.08% | 2.51%     | -19.85%    | 2.58%         | 1.77% | -0.07% |

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

天弘恒生科技指数A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021年07月06日-2021年09月30日)



天弘恒生科技指数C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：1、本基金合同于2021年07月06日生效，本基金合同生效起至披露时点不满1年。

2、按照本基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金的建仓期为2021年07月06日至2022年01月05日，截止本报告期末本基金仍处于建仓期。

## § 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 |        |  |
| 宋蕾 | 本基金基金经理 | 2021年07月    | -    | 9年     | 女，金融分析专业硕士。历任宝马汽车金融(中国)有限公司个人贷款结算专员、嘉实基金管理有限公司高级基金会计、北京千石创富资本管理有限公司产品经理、麦考瑞银行资产管理专员。2017年5 |

|    |         |          |   |    |  |
|----|---------|----------|---|----|--|
|    |         |          |   |    | 月加盟本公司，历任投资经理。   |
| 胡超 | 本基金基金经理 | 2021年07月 | - | 8年 | 男，金融学硕士。历任普华永道咨询（深圳）有限公司高级顾问、中合中小企业融资担保股份有限公司高级业务经理、中国人民财产保险股份有限公司海外投资业务主管。2016年6月加盟本公司，历任国际业务研究员。 |

注：1、上述任职日期/离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金未聘请境外投资顾问。

#### 4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况说明

本基金按照国家法律法规及基金合同的相关约定进行操作，不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

#### 4.4 公平交易专项说明

##### 4.4.1 公平交易制度的执行情况

公平交易的执行情况包括：建立统一的研究平台和公共信息平台，保证各组合得到公平的投资资讯；公平对待不同投资组合，禁止各投资组合之间进行以利益输送为目的的投资交易活动；在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，严格执行授权审批程序；实行集中交易制度和公平交易分配制度；建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度，保证不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息的相互隔离；加强对投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系等。

报告期内，公司公平交易程序运作良好，未出现异常情况；场外、网下业务公平交易制度执行情况良好，未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析，对各投资组合不同时间窗口（1日、3日、5日）内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验，未发现违反公平交易原则的异常交易。

本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为，公平交易制度的整体执行情况良好。

#### 4.4.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未产生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，未导致不公平交易和利益输送。

#### 4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

本基金跟踪的标的指数为香港恒生科技指数，该指数反映经筛选后最大30家与科技主题高度相关的香港上市公司，采用流通市值加权法计算，且每只成份股的权重上限设定为8%。

报告期内，尽管新冠疫苗在全球进一步普及，但由于德尔塔病毒在全球的蔓延，经济活动扩张速度有所放缓。美联储公布9月议息会议结果，维持基准利率不变的同时释放了较为明确的减量信号，且最早可能在11月议息会议上宣布。国内方面，央行强调在外部环境更趋严峻复杂，国内经济恢复仍然不稳固、不均衡的情况下，货币政策维持偏松的立场，并加强财政、产业、监管政策之间的协调。

互联互通时代，香港市场是中国权益市场的重要组成部分。但香港市场同时受到境外市场和A股市场的影响，在海外流动性收紧预期、互联网反垄断监管不断加码、以及中国地产信用风险放大的作用下，科技龙头公司的股价出现较大的波动，并带动香港市场出现一定的回调。报告期内，恒生科技指数下跌25.18%。

本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资，股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组合及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。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、赎回及成份股调整等工作。截至2021年09月30日，天弘恒生科技指数A基金份额净值为0.8196元，天弘恒生科技指数C基金份额净值为0.8192元。报告期内份额净值增长率天弘恒生科技指数A为-18.04%，同期业绩比较基准增长率为-19.85%；天弘恒生科技指数C为-18.08%，同期业绩比较基准增长率为-19.85%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

### § 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   | 1,122,758,645.99 | 89.29        |
|    | 其中：普通股 | 1,122,758,645.99 | 89.29        |

|   |                   |                  |        |
|---|-------------------|------------------|--------|
|   | 存托凭证              | -                | -      |
|   | 优先股               | -                | -      |
|   | 房地产信托             | -                | -      |
| 2 | 基金投资              | -                | -      |
| 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      | 125,463,692.14   | 9.98   |
| 8 | 其他资产              | 9,268,625.23     | 0.74   |
| 9 | 合计                | 1,257,490,963.36 | 100.00 |

注：本报告期末，本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为805,358,082.54元，占基金资产净值的比例为65.95%。

## 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(%) |
|--------|------------------|--------------|
| 中国香港   | 1,122,758,645.99 | 91.95        |
| 合计     | 1,122,758,645.99 | 91.95        |

注：国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定。

## 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(%) |
|------|------------|--------------|
| 能源   | -          | -            |
| 基础材料 | -          | -            |
| 工业   | -          | -            |



|         |                  |       |
|---------|------------------|-------|
| 消费者非必需品 | 382,347,722.13   | 31.31 |
| 消费者常用品  | -                | -     |
| 医疗保健    | 44,731,156.70    | 3.66  |
| 金融      | 14,481,848.40    | 1.19  |
| 信息技术    | 407,109,807.50   | 33.34 |
| 电信服务    | 274,088,111.26   | 22.45 |
| 公用事业    | -                | -     |
| 房地产     | -                | -     |
| 合计      | 1,122,758,645.99 | 91.95 |

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<br>(英文)             | 公司名称<br>(中文) | 证券<br>代码             | 所在<br>证券<br>市场      | 所属国<br>家(地<br>区) | 数量<br>(股)     | 公允价<br>值(人民<br>币元) | 占基金资产<br>净值比例<br>(%) |
|----|--------------------------|--------------|----------------------|---------------------|------------------|---------------|--------------------|----------------------|
| 1  | Meituan                  | 美团           | KYG59<br>66910<br>41 | 香港<br>证券<br>交易<br>所 | 中国香<br>港         | 467,8<br>00   | 96,101,<br>368.41  | 7.87                 |
| 2  | Tencent Ho<br>ldings Ltd | 腾讯控<br>股     | KYG87<br>57216<br>34 | 香港<br>证券<br>交易<br>所 | 中国香<br>港         | 242,1<br>00   | 93,056,<br>917.32  | 7.62                 |
| 3  | JD.com Inc               | 京东集<br>团     | KYG82<br>08B10<br>14 | 香港<br>证券<br>交易<br>所 | 中国香<br>港         | 380,1<br>50   | 89,685,<br>973.35  | 7.34                 |
| 4  | Kuaishou T<br>echnology  | 快手           | KYG53<br>26310<br>28 | 香港<br>证券<br>交易<br>所 | 中国香<br>港         | 1,27<br>1,000 | 87,564,<br>352.80  | 7.17                 |
| 5  | SUNNY OPTI<br>CAL        | 舜宇光<br>学科技   | KYG85<br>86D10<br>97 | 香港<br>证券<br>交易<br>所 | 中国香<br>港         | 495,3<br>00   | 84,503,<br>473.77  | 6.92                 |

|    |                             |      |              |         |      |           |               |      |
|----|-----------------------------|------|--------------|---------|------|-----------|---------------|------|
| 6  | Alibaba Group Holding Ltd   | 阿里巴巴 | KYG017191142 | 香港证券交易所 | 中国香港 | 703,900   | 83,384,790.81 | 6.83 |
| 7  | Xiaomi Corp                 | 小米集团 | KYG9830T1067 | 香港证券交易所 | 中国香港 | 4,659,400 | 82,871,300.96 | 6.79 |
| 8  | SMIC                        | 中芯国际 | KYG8020E1199 | 香港证券交易所 | 中国香港 | 3,416,500 | 62,757,596.25 | 5.14 |
| 9  | JD Health International Inc | 京东健康 | KYG5074A1004 | 香港证券交易所 | 中国香港 | 851,500   | 53,272,229.31 | 4.36 |
| 10 | Haier Smart Home Co Ltd     | 海尔智家 | CNE1000048K8 | 香港证券交易所 | 中国香港 | 1,837,400 | 42,016,738.99 | 3.44 |

#### 5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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名的前五名债券投资明细

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

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

| 序号 | 衍生品类别 | 衍生品名称                | 公允价值(人民币元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-------|----------------------|------------|--------------|
| 1  | 股指期货  | HSTECH Futures Oct21 | -          | -            |

注：金融衍生品投资项下的股指期货投资净额为0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为0。本报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细为：HSTECH Futures Oct21买入持仓量148手，合约市值人民币37,425,553.72元，公允价值变动人民币-639,717.31元。

#### 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

本基金本报告期末未持有基金。

#### 5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本报告期内未发现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查，未发现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.10.2 基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

#### 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   | 9,254,491.23 |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 14,134.00    |
| 5  | 应收申购款   | -            |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 其他      | -            |
| 8  | 合计      | 9,268,625.23 |

#### 5.10.4 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。

#### 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 5.10.6 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

|                                    | 天弘恒生科技指数A      | 天弘恒生科技指数C      |
|------------------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日(2021年07月06日)基金份额总额         | 116,851,343.82 | 279,591,033.00 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额              | 796,417,948.24 | 479,894,721.23 |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额            | 44,081,934.99  | 138,567,703.19 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -              | -              |
| 报告期期末基金份额总额                        | 869,187,357.07 | 620,918,051.04 |

注：本基金合同于2021年07月06日生效。

#### § 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   | 2021-07-20 | 20,161,290.32 | 20,000,000.00 | 0.0001 |
| 合计 |      |            | 20,161,290.32 | 20,000,000.00 |        |

注：基金管理人在本报告期内关于本基金的交易委托天弘基金直销中心办理，根据本基金法律文件及相关法规，依照适用费率收取交易费用，其中适用费率保留至小数点后4位，小数点后第5位四舍五入。

#### § 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   | 10,000,277.81 | 0.67%        | 10,000,277.81 | 0.67%        | 三年         |
| 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          | -             | -            | -             | -            | -          |
| 合计          | 10,000,277.81 | 0.67%        | 10,000,277.81 | 0.67%        | -          |

## § 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超过20%的情况

本报告期内，本基金未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过本基金总份额20%的情况。

### 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准天弘恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）募集的文件
- 2、天弘恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）基金合同
- 3、天弘恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）托管协议
- 4、天弘恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）招募说明书
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告
- 6、中国证监会规定的其他文件

### 10.2 存放地点

天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

### 10.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所及网站或基金托管人的办公场所免费查阅备查文件，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

公司网站：[www.thfund.com.cn](http://www.thfund.com.cn)

天弘基金管理有限公司  
二〇二一年十月二十七日