

汇添富恒生科技指数型发起式证券投资基金 （QDII）2021 年第 4 季度报告

2021 年 12 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 01 月 24 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 2022 年 1 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 2021 年 10 月 26 日（基金合同生效日）起至 2021 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	汇添富恒生科技指数发起（QDII）
基金主代码	013127
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 10 月 26 日
报告期末基金份额总额(份)	71,999,136.10
投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
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 0.5%，年跟踪误差不超过 5%。本基金的投资策略主要包括：股票投资策略、固定收益类资产投资策略、衍生品投资策略、资产支持证券投资策略、境内融资投资策略、参与境内转融通证券出借业务策略、境内存托凭证的投资策略。
业绩比较基准	经人民币汇率调整的恒生科技指数收益率*95%+商业银行活期存款利率(税后)*5%

风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。 本基金主要投资于境外证券市场，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，本基金还将面临汇率风险、境外证券市场风险等特殊投资风险。	
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	汇添富恒生科技指数发起（QDII）A	汇添富恒生科技指数发起（QDII）C
下属分级基金的交易代码	013127	013128
报告期末下属分级基金的份额总额（份）	42,356,901.57	29,642,234.53
境外资产托管人	英文名称:The Hong Kong and Shanghai Banking Co. Ltd.	
	中文名称:香港上海汇丰银行有限公司	

§ 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(2021年10月26日(基金合同生效日) - 2021年12月31日)	
	汇添富恒生科技指数发起（QDII）A	汇添富恒生科技指数发起（QDII）C
1. 本期已实现收益	-156,217.51	-64,730.96
2. 本期利润	-3,465,036.01	-1,341,092.33
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1166	-0.1036
4. 期末基金资产净值	37,481,758.35	26,218,862.97
5. 期末基金份额净值	0.8849	0.8845

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、本基金的《基金合同》生效日为2021年10月26日，至本报告期末不满一季度，因此主要财务指标只列示从基金合同生效日至2021年12月31日数据，特此说明。

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

汇添富恒生科技指数发起（QDII）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
自基金合同生效日起至今	-11.51%	1.45%	-15.62%	1.61%	4.11%	-0.16%
汇添富恒生科技指数发起（QDII）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	-11.55%	1.45%	-15.62%	1.61%	4.07%	-0.16%

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

汇添富恒生科技指数发起（QDII）A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富恒生科技指数发起（QDII）C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：1、本《基金合同》生效之日为2021年10月26日，截至本报告期末，基金成立未满一年。

2、本基金建仓期为本《基金合同》生效之日起6个月，截至本报告期末，本基金尚处于建

仓期中。

§ 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10 月26日		7	<p>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。</p> <p>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师、指数与量化投资部分析师。2019年4月15日至今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。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日至今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。2021年7月8日至今任汇添</p>

				<p>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。2021年7月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。</p> <p>2021年10月26日至今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。2021年10月29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的基金经理。</p> <p>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。</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《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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的成员简介

注：本基金无境外投资顾问。

4.3 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 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11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。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

四季度A股市场行情略显平淡，市场整体震荡，主要指数振幅均有收窄。前期表现强势的周期、新能源等板块出现调整，传媒、国防军工等表现强势。而前三季度下跌较多的消费、医药等行业则有所修复。港股市场10月小幅反弹后普遍下跌，恒指及恒生科技指数均在本季度收跌。

12月，中央政治局会议和中央经济工作会议召开，均指出要保持经济运行在合理区间，释放稳增长信号。中央政治局会议强调了明年经济工作稳字当头、稳中求进，中央经济工作会议也以稳增长为主基调，提出着力扩大内需、激发市场活力。货币政策方面，会议指出稳健的货币政策要灵活适度，保持流动性合理充裕。随后即出现接连降准、降息，一年期LPR调降5bp至3.80%，但作为大量存量房贷和企业中长期贷款基准的五年期LPR暂未有调整。

经济基本面角度，当前面临需求收缩、供给冲击和预期转弱等多重压力，叠加外部复杂环境和全球疫情升级演变，不确定性进一步提升。因而政策面发力意图明显，尤其是需求导向的角度。

资本市场方面，金融开放继续升级。今年以来北上资金已累计流入超过4000亿元，保持了历年来稳步流入的趋势。12月，内地及香港两地证监会联合公告，已就ETF纳入互联互通标的整体方案达成共识，下一步沪深港交易所及中国结算将积极推进相关技术准备。届时北上或南下资金能够直接进行ETF交易，互联互通品种和标的范围进一步扩大，有望提升两地市场活跃度。

科技板块在过去三年表现亮眼，已经成为资本市场重要的主题赛道之一。本基金跟踪恒生科技指数，是港股科技板块的标杆指数，主要覆盖资讯科技业，成份股集合了信息技术领域硬件制造、软件服务、互联网平台等多种业态。今年以来港股互联网板块受监管力度加大而持续回调。随着监管框架逐渐成型，市场对监管规则的预期逐步明确，未来进一步冲击的空间有限。而芯片、电子等硬科技制造领域是长期战略性支持的重要方向。港股科技聚集了众多A股稀缺的科技领域标的，具有独特的配置价值。

报告期内，本基金处于建仓阶段。在建仓期结束后，股票及期货等权益资产的投资仓位将基本保持在 90%~95%之间，以实现有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

本基金本报告期 A 类基金份额净值增长率为-11.51%;C 类基金份额净值增长率为-11.55%。同期业绩比较基准收益率为-15.62%。

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 (人民币元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	56,831,135.21	88.38
	其中：普通股	56,831,135.21	88.38
	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	7,229,528.06	11.24
8	其他资产	245,337.60	0.38
9	合计	64,306,000.87	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 43,352,687.71 元，占期末净值比例为 68.06%。

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	56,831,135.21	89.22
合计	56,831,135.21	89.22

注：按公允价值占基金资产净值比例从大到小排序；国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定；此处股票包括普通股和优先股；ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

5.3.1 报告期末指数投资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（%）
10 能源	-	-
15 原材料	-	-
20 工业	-	-
25 可选消费	16,387,105.29	25.73
30 日常消费	2,253,332.17	3.54
35 医疗保健	1,343,586.61	2.11
40 金融	633,689.06	0.99
45 信息技术	23,089,485.94	36.25
50 电信服务	13,123,936.14	20.60
55 公用事业	-	-
60 房地产	-	-
合计	56,831,135.21	89.22

5.3.2 报告期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

注：本报告期末未持有积极投资。

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

5.4.1 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及存托凭证投资明细

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家 (地区)	数量 (股)	公允价值 (人民币元)	占基金资产净值比例 (%)
1	Sunny Optical Technology (Group) Company Limited	舜宇光学科技 (集团) 有限公司	2382 HK	香港联合交易所	中国香港	25,000	5,040,504.00	7.91
2	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股有限公司	700 HK	香港联合交易所	中国香港	12,900	4,817,887.87	7.56
3	Xiaomi Corporation	小米集团	1810 HK	香港联	中国香港	306,400	4,734,688.90	7.43

				合 交 易 所				
4	Meituan	美团	3690 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	24,800	4,570,318.59	7.17
5	Alibaba Group Holding Limited	阿 里 巴 巴 集 团 控 股 有 限 公 司	9988 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	46,500	4,520,387.76	7.10
6	Kuaishou Technology	快 手 科 技	1024 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	69,500	4,094,111.56	6.43
7	JD.com, Inc.	京 东 集 团 股 份 有 限	9618 HK	香 港 联 合	中 国 香 港	17,450	3,909,190.88	6.14

		公司		交易所				
8	Semiconductor Manufacturing International Corporation	中芯国际集成电路制造有限公司	981 HK	香港联合交易所	中国香港	180,000	2,746,154.88	4.31
9	NetEase, Inc	网易公司	9999 HK	香港联合交易所	中国香港	20,700	2,665,580.40	4.18
10	Haier Smart Home Co., Ltd.	海尔智家股份有限公司	6690 HK	香港联合交易所	中国香港	96,200	2,591,620.30	4.07

5.4.2 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及存托凭证投资明细

注: 本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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五名债券投资明细

注：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

注：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	期货品种_股指	HSTECH Futures Jan22	-	-

注：期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中，具体投资情况详见下表（买入持仓量以正数表示、卖出持仓量以负数表示）：

代码	名称	持仓量（买/卖）（单位：手）	合约市值	公允价值变动
HTI2201	HSTECH Futures Jan22	9	2,099,870.64	21,870.80
公允价值变动总额合计				21,870.80
期货投资本期收益				0.00
期货投资本期公允价值变动				21,870.80

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

注：本基金本报告期末未持有基金投资。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，腾讯控股有限公司、美团、阿里巴巴集团控股有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主

体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	244,446.42
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	891.18
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	245,337.60

5.10.4 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。

5.10.5 报告期末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情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富恒生科技指数发起 (QDII) A	汇添富恒生科技指数发起 (QDII) C
基金合同生效日 (2021年10月26 日) 基金份额总额	22,641,094.28	4,888,663.36
本报告期基金总申购 份额	20,423,193.58	31,705,319.92
减：本报告期基金总 赎回份额	707,386.29	6,951,748.75
本报告期基金拆分变	-	-

动份额		
本报告期末基金份额总额	42,356,901.57	29,642,234.53

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	认购	2021年10月18日	10,002,400.24	10,000,000.00	-
合计			10,002,400.24	10,000,000.00	

注：基金管理人2021年10月18日使用自有资金10,001,000.00元认购本基金份额10,002,400.24份，实际费用1,000.00元。相关费用符合招募说明书和相关公告的规定。

§ 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	10,002,400.24	13.89	10,002,400.24	13.89	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	237,649.51	0.33	-	-	
合计	10,240,049.75	14.22	10,002,400.24	13.89	

§ 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

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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额

		到或者超过 20%的时间区间					
机构	1	2021 年 10 月 26 日至 2021 年 12 月 6 日	10,002,400.24	-	-	10,002,400.24	13.89

产品特有风险

1、持有人大会投票权集中的风险

当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。

2、巨额赎回的风险

持有基金份额比例较高的投资者大量赎回时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。

3、基金规模较小导致的风险

持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。

4、基金净值大幅波动的风险

持有基金份额比例较高的投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。

5、提前终止基金合同的风险

基金合同生效满三年之日（指自然日），若基金规模低于 2 亿元人民币的，本基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。《基金合同》生效三年后继续存续的，持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。

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恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）募集的文件；
- 2、《汇添富恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）基金合同》；

- 3、《汇添富恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）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

2022 年 01 月 24 日