

# 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)2024年第3季 度报告

2024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：2024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 2024 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 2024 年 07 月 01 日起至 2024 年 09 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	汇添富恒生科技 ETF 联接发起式 (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	2022 年 10 月 31 日
报告期末基金份额总额(份)	1,113,815,719.83
投资目标	通过投资于目标 ETF，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	本基金主要投资于目标 ETF，方便特定的客户群通过本基金投资目标 ETF。本基金不参与目标 ETF 的投资管理。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：资产配置策略、目标 ETF 的投资策略、成份股/备选成份股投资策略、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	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

基准	后)*5%	
风险收益特征	<p>本基金为汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 的联接基金, 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。本基金通过投资目标 ETF, 紧密跟踪标的指数, 具有与标的指数相似的风险收益特征。</p> <p>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。</p>	
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 ETF 联接发起式 (QDII) A	汇添富恒生科技 ETF 联接发起式 (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)	554, 657, 967. 32	559, 157, 752. 51
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	

## 2.1 目标基金基本情况

基金名称	汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)
基金主代码	513260
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2022 年 08 月 31 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2022 年 09 月 13 日
基金管理人名称	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人名称	招商银行股份有限公司

## 2.2 目标基金产品说明

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。
投资策略	本基金主要采用完全复制法, 即完全按照标的指数的成份股组成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化进行相应调整。但在因特殊情况 (如流动性不足等) 导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时, 基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合, 追求尽可能贴近目标指数的表现。本基金的投资策略主要包括: 资产配置策略、债券投资策略、资产支持证

	券投资策略、金融衍生工具投资策略、参与境内融资投资策略、参与境内转融通证券出借业务策略、境内外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
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，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。

### § 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(2024年07月01日 - 2024年09月30日)	
	汇添富恒生科技 ETF 联接发起式 (QDII) A	汇添富恒生科技 ETF 联接发起式 (QDII) C
1. 本期已实现收益	401,641.92	178,240.32
2. 本期利润	97,673,335.66	95,809,472.15
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1877	0.1765
4. 期末基金资产净值	433,822,212.86	434,499,496.80
5. 期末基金份额净值	0.7821	0.7771

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

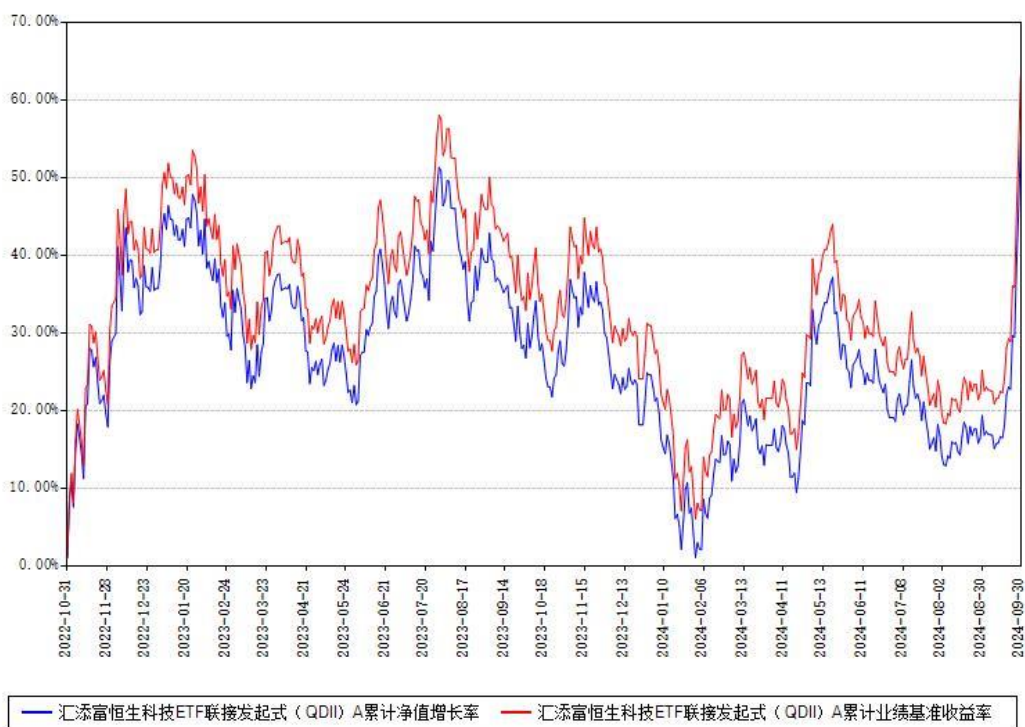
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富恒生科技 ETF 联接发起式 (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	①—③	②—④

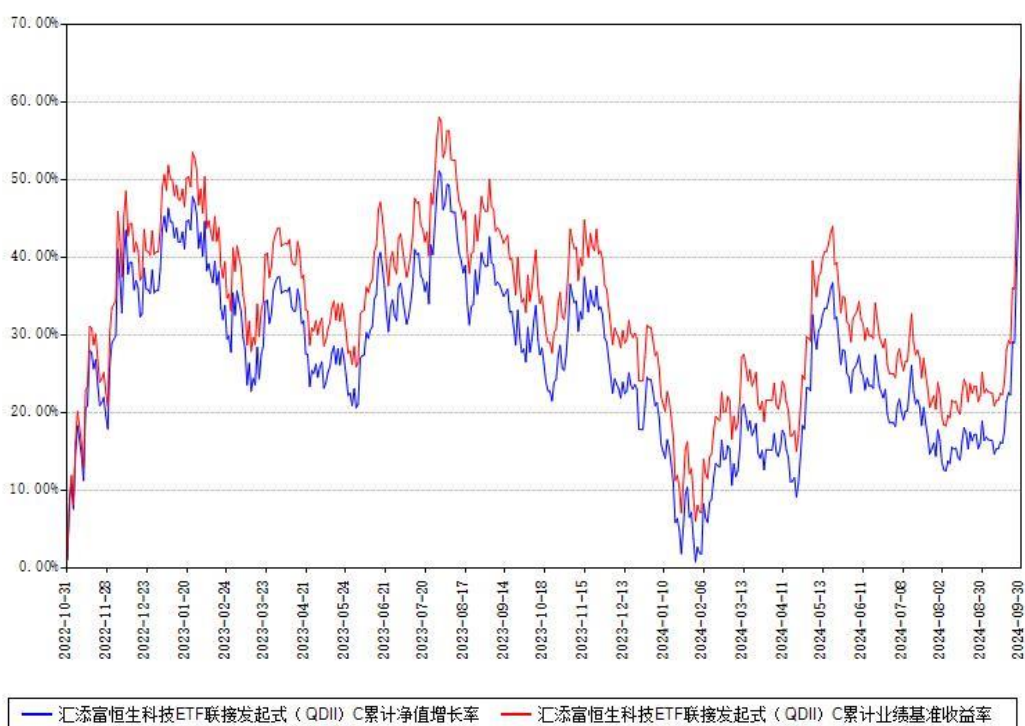
				④		
过去三个月	29.79%	2.00%	30.36%	2.02%	-0.57%	-0.02%
过去六个月	33.78%	1.97%	34.03%	1.99%	-0.25%	-0.02%
过去一年	17.80%	1.98%	18.39%	2.01%	-0.59%	-0.03%
自基金合同生效起至今	54.63%	2.12%	63.00%	2.17%	-8.37%	-0.05%
汇添富恒生科技 ETF 联接发起式 (QDII) C						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	29.73%	2.00%	30.36%	2.02%	-0.63%	-0.02%
过去六个月	33.68%	1.97%	34.03%	1.99%	-0.35%	-0.02%
过去一年	17.58%	1.98%	18.39%	2.01%	-0.81%	-0.03%
自基金合同生效起至今	54.03%	2.12%	63.00%	2.17%	-8.97%	-0.05%

### 3.2.2 自基金转型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ETF联接发起式（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ETF联接发起式（QDII）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（2022年10月31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。

本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

本基金由原汇添富恒生科技指数型发起式证券投资基金 (QDII) 于 2022 年 10 月 31 日转型而来。

## § 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	2022 年 10 月 31 日	-	10	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师、指数与量化投资部分析师。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。2019 年 7 月 26 日至 2024 年 4 月 19 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

					<p>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 2024 年 9 月 29 日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 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 互联互通交易型开放式指数证券投</p>
--	--	--	--	--	--



				<p>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 2023 年 11 月 28 日任汇添富 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 2024 年 2 月 7 日任汇添富中证 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</p>
--	--	--	--	---

					<p>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 2024 年 7 月 5 日任汇添富中证国新央企股东回报交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月 19 日至 2024 年 7 月 9 日任汇添富中证 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。2023 年 12 月 28 日至今任汇添富国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 2 月 5 日至今任汇添富 MSCI 美国</p>
--	--	--	--	--	---

					<p>50 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 的基金经理。2024 年 3 月 1 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发起式联接基金 (QDII) 的基金经理。2024 年 4 月 1 日至今任汇添富中证信息技术应用创新产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 4 月 19 日至今任汇添富国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

注: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。

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。

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 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，保障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，公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种，以及投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。

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，再根据同向交易占优比、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 1 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。

此外，为防范基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的潜在利益冲突，本基金管理人从投资指令、交易行为、交易监测等多方面，对兼任组合进行监控管理和分析评估。本报告期内兼任组合未出现违反公平交易或异常交易的情况。

#### 4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2024 年三季度资本市场先经历震荡下行，在十一前一周迎来快速反弹行情，主要指数点位快速修复至 2023 年三季度左右的点位，部分大市值指数已修复至 2023 年上半年的点

位。

9 月美联储议息会议超预期降息 50 个基点，为近四年来首次降息，且点阵图显示年内仍有较大概率继续降息。

国内来看，9 月召开的政治局会议政策发力整体超预期，提出加大财政货币逆周期调节力度。财政政策方面，支出要保证必要的财政支出，发行使用好超长期特别国债和地方政府专项债，并发挥政府投资带动作用。货币政策方面，要实施有力度的降息。在地产、资本市场等领域的表述也体现了政策的关切和对群众关注的回应。

会后，各领域政策迅速推出。9 月 27 日，央行降息降准落地，并拟创设多种货币政策工具支持市场稳定发展。降准预计向市场提供长期流动性约一万亿，降低政策利率有望带动各期限报价、贷款利率相应下行。同时央行主动引导商业银行降低存量房贷利率，一线城市限购政策也陆续放开。

此次政策推出力度超过市场预期，对资本市场情绪带来显著提振，9 月底市场热情极高，促使各板块估值显著修复。港股市场方面，今年上半年体现出和 A 股较为同步的涨跌节奏，但显示出更强的弹性。随着中国经济的修复，出现了全球资金重配置带来的回流，南向资金也在今年以来加速流入。且当前港股头部企业的基本面扎实稳健，有望持续吸引资金配置。

在政策推出之际，市场情绪首先回暖，此后随着政策逐步落地，结合经济实质性修复，有望带来长期投资机遇。

恒生科技指数是港股科技板块的标杆性指数，以互联网龙头企业为基础，同时还覆盖了软件、电子、造车新势力等信息技术领域的科技企业，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。

本报告期汇添富恒生科技 ETF 联接发起式 (QDII) A 类份额净值增长率为 29.79%，同期业绩比较基准收益率为 30.36%。本报告期汇添富恒生科技 ETF 联接发起式 (QDII) C 类份额净值增长率为 29.73%，同期业绩比较基准收益率为 30.36%。

#### 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	-	-
	其中：普通股	-	-
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	809,072,133.60	87.37
3	固定收益投资	10,025,336.99	1.08
	其中：债券	10,025,336.99	1.08
	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	42,411,974.47	4.58
8	其他资产	64,483,942.94	6.96
9	合计	925,993,388.00	100.00

### 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

注：本基金本报告期末未持有权益投资。

### 5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

注：本基金本报告期末未持有权益投资。

#### 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

注：本基金本报告期末未持有权益投资。

#### 5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

债券信用等级	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
A-至 A+	10,025,336.99	1.15

注：本基金债券投资组合主要采用穆迪、标准普尔等国际权威评级机构提供的债券信用评级信息。

#### 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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	019749	24 国债 15	100,000	10,025,336.99	1.15

#### 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_指数	HSTECH Futures Dec24	-	-

2	期货品种_指数	HSTECH Futures Oct24	-	-
---	---------	-------------------------	---	---

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	
HTI2412	HSTECH Futures	Dec24	15.00	3,287,793.88	831,450.38
HTI2410	HSTECH Futures	Oct24	10.00	2,167,057.59	487,282.23
公允价值变动总额合计			1,318,732.61		
期货投资本期收益			-185,020.96		
期货投资本期公允价值变动			1,532,619.17		

### 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

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	恒生科技 ETF 基金	股票型	交易型 开放式	汇添富基金管理股份有限公司	809,072,133.60	93.18

### 5.10 投资组合报告附注

#### 5.10.1

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。

#### 5.10.2



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	480,564.01
2	应收证券清算款	4,481,168.48
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	59,522,210.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	64,483,942.94

### 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:本基金本报告期末未持有股票。

## § 6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	汇添富恒生科技 ETF 联接发起式 (QDII) A	汇添富恒生科技 ETF 联接发起式 (QDII) C
本报告期期初基金份额总额	511,117,813.00	547,119,971.76
本报告期基金总申购份额	114,022,660.62	337,456,151.22
减:本报告期基金总赎回份额	70,482,506.30	325,418,370.47
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	554,657,967.32	559,157,752.51

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

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	10,002,400.24	0.90	10,002,400.24	0.90	3 年
基金管理人高级管理人员	7,907.05	0.00	-	-	
基金经理等人员	66,111.33	0.01	-	-	
基金管理人股东	-	-	-	-	
其他	12,560,753.35	1.13	-	-	
合计	22,637,171.97	2.03	10,002,400.24	0.90	

## § 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、《汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)基金合同》；
- 3、《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)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交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (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](http://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

2024 年 10 月 25 日