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）（原汇添富恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII））2022 年年度报告

2022 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：2023 年 03 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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3月29日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

自2022年10月31日起，汇添富恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）转型为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）。本报告中，汇添富恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）的报告期自2022年01月01日起至2022年10月30日止，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）的报告期自2022年10月31日起至2022年12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....2
1.1 重要提示.....2
1.2 目录.....3
§2 基金简介.....6
2.1 基金基本情况（转型后）.....6
2.1 基金基本情况（转型前）.....6
2.2 基金产品说明（转型后）.....7
2.2 基金产品说明（转型前）.....8
2.3 基金管理人和基金托管人.....8
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....9
2.5 信息披露方式.....9
2.6 其他相关资料.....9
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....9
3.1 主要会计数据和财务指标（转型后）.....9
3.1 主要会计数据和财务指标（转型前）.....10
3.2 基金净值表现（转型后）.....12
3.2 基金净值表现（转型前）.....15
3.3 过去三年基金的利润分配情况（转型后）.....19
3.3 过去三年基金的利润分配情况（转型前）.....19
§4 管理人报告.....19
4.1 基金管理人及基金经理情况.....19
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的成员简介.....28
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....28
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....28
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....30
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....31
4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....31
4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....32
4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....33
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....33
§5 托管人报告.....33
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....33
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....33
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....33
§6 审计报告（转型后）.....34
6.1 审计报告的基本信息.....34
6.2 审计报告的基本内容.....34
§6 审计报告（转型前）.....36
6.1 审计报告的基本信息.....36
6.2 审计报告的基本内容.....36

§7 年度财务报表（转型后）.....38
7.1 资产负债表.....38
7.2 利润表.....39
7.3 净资产（基金净值）变动表.....40
7.4 报表附注.....41
§7 年度财务报表（转型前）.....73
7.1 资产负债表.....73
7.2 利润表.....74
7.3 净资产（基金净值）变动表.....76
7.4 报表附注.....77
§8 投资组合报告（转型后）.....115
8.1 期末基金资产组合情况.....115
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....116
8.3 期末按行业分类的权益投资组合.....116
8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细.....116
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....121
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....123
8.7 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.....123
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....123
8.9 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.....123
8.10 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.....123
8.11 投资组合报告附注.....124
§8 投资组合报告（转型前）.....124
8.1 期末基金资产组合情况.....124
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....125
8.3 期末按行业分类的权益投资组合.....125
8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细.....126
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....131
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....134
8.7 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.....134
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....134
8.9 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.....134
8.10 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.....134
8.11 投资组合报告附注.....134
§9 基金份额持有人信息（转型后）.....135
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....135
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....136
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....136
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....136
§9 基金份额持有人信息（转型前）.....137
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....137
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....137

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....138
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....138
§10 开放式基金份额变动（转型后）.....138
§10 开放式基金份额变动（转型前）.....139
§11 重大事件揭示.....139
11.1 基金份额持有人大会决议.....139
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....140
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....140
11.4 基金投资策略的改变.....140
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....140
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....140
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）.....141
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）.....143
11.8 其他重大事件（转型后）.....146
11.8 其他重大事件（转型前）.....146
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....147
12.1 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.....147
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....147
§13 备查文件目录.....147
13.1 备查文件目录.....147
13.2 存放地点.....148
13.3 查阅方式.....148

§2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型后）

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发起式联接基金（QDII）	
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	
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	
报告期末基金份额总额（份）	563,815,310.30	
基金合同存续期	不定期	
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）	317,028,693.80	246,786,616.50

2.1.1 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

2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	汇添富恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）
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
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	
报告期末基金份额总额（份）	552,823,110.77	
基金合同存续期	不定期	
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）	277,205,843.70	275,617,267.07

2.2 基金产品说明（转型后）

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。 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。

2.2.1 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。

2.2 基金产品说明（转型前）

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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇添富基金管理股份有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李鹏	张燕
	联系电话	021-28932888	0755-83199084
	电子邮箱	service@99fund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-888-9918	95555
传真		021-28932998	0755-83195201
注册地址		上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		上海市黄浦区外马路 728 号	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		200010	518040
法定代表人		李文	缪建民

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	中文	香港上海汇丰银行有限公司
	英文	The Hong Kong and Shanghai Banking Co. Ltd.
注册地址		香港中环皇后大道中一号汇丰总行大厦
办公地址		香港九龙深旺道一号,汇丰中心一座六楼
邮政编码		999077

注：本基金无境外投资顾问。

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金年度报告备置地点	上海市黄浦区外马路728号　汇添富基金管理股份有限公司

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层
注册登记机构	汇添富基金管理股份有限公司	上海市黄浦区外马路728号

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标（转型后）

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2022年10月31日（基金合同生效日）-2022年12月31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
本期已实现收益	-31,955,866.01	-28,998,453.16
本期利润	53,312,431.30	48,765,403.82
加权平均基金份额本期利润	0.1732	0.1960
本期加权平均净值利润率	26.92%	30.80%
本期基金份额净值增长率	35.78%	35.74%

3.1.2 期末数据和指标	2022年末	
期末可供分配利润	-99,297,017.04	-77,790,957.35
期末可供分配基金份额利润	-0.3132	-0.3152
期末基金资产净值	217,731,676.76	168,995,659.15
期末基金份额净值	0.6868	0.6848
3.1.3 累计期末指标	2022年末	
基金份额累计净值增长率	35.78%	35.74%

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(例如：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。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、本基金的《基金合同》生效日为2022年10月31日，至本报告期末未满一年，因此主要会计数据和财务指标只列示从基金合同生效日至2022年12月31日数据，特此说明。

3.1 主要会计数据和财务指标（转型前）

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2022年01月01日-2022年10月30日		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	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
本期已实现收益	-6,616,399.32	-5,401,495.24	-156,217.51	-64,730.96
本期利润	-66,005,397.37	-60,073,800.81	-3,465,036.01	-1,341,092.33
加权平均基金份额本期利润	-0.4017	-0.4630	-0.1166	-0.1036

本期加权平均净值利润率	-56.78%	-66.48%	-12.44%	-11.33%
本期基金份额净值增长率	-42.84%	-42.96%	-11.51%	-11.55%
3.1.2 期末数据和指标	2022年10月30日		2021年末	
期末可供分配利润	-137,000,510.51	-136,564,917.78	-4,875,143.22	-3,423,371.56
期末可供分配基金份额利润	-0.4942	-0.4955	-0.1151	-0.1155
期末基金资产净值	140,205,333.19	139,052,349.29	37,481,758.35	26,218,862.97
期末基金份额净值	0.5058	0.5045	0.8849	0.8845
3.1.3 累计期末指标	2022年10月30日		2021年末	
基金份额累计净值增长率	-49.42%	-49.55%	-11.51%	-11.55%

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(例如：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。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现（转型后）

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④	①－③	②－④
自基金合同生效日起至今	35.78%	3.26%	40.69%	3.43%	-4.91%	-0.17%
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
自基金合同生效日起至今	35.74%	3.26%	40.69%	3.43%	-4.95%	-0.17%

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

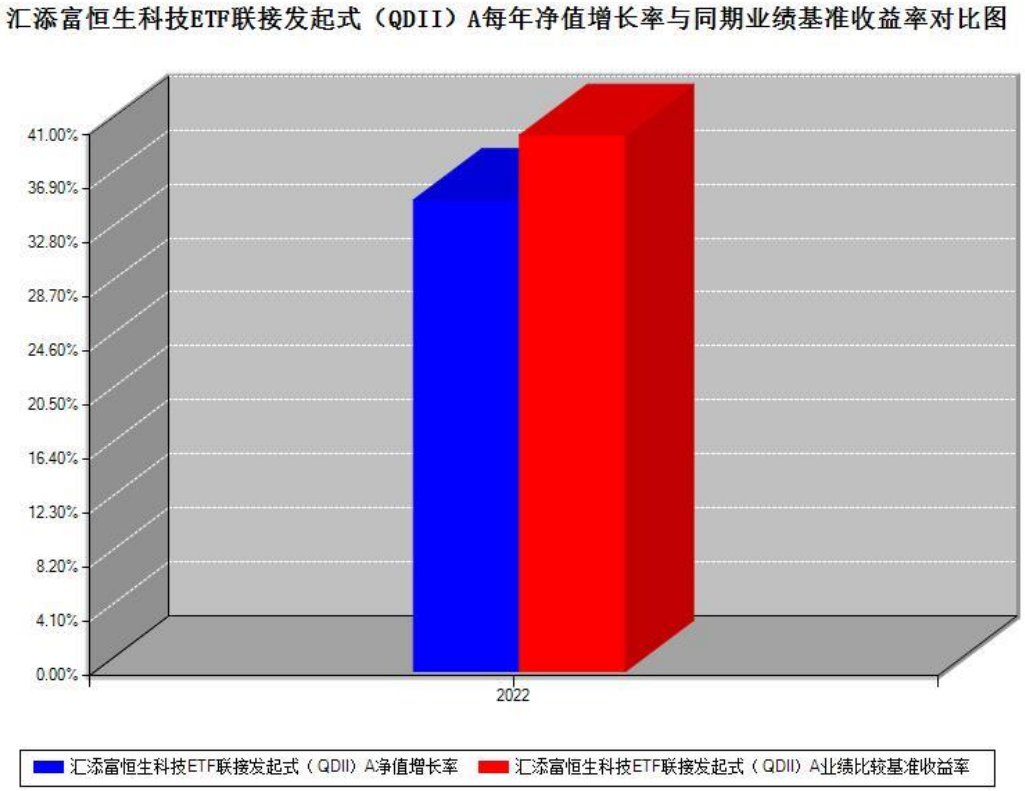
汇添富恒生科技ETF联接发起式（QDII）A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图

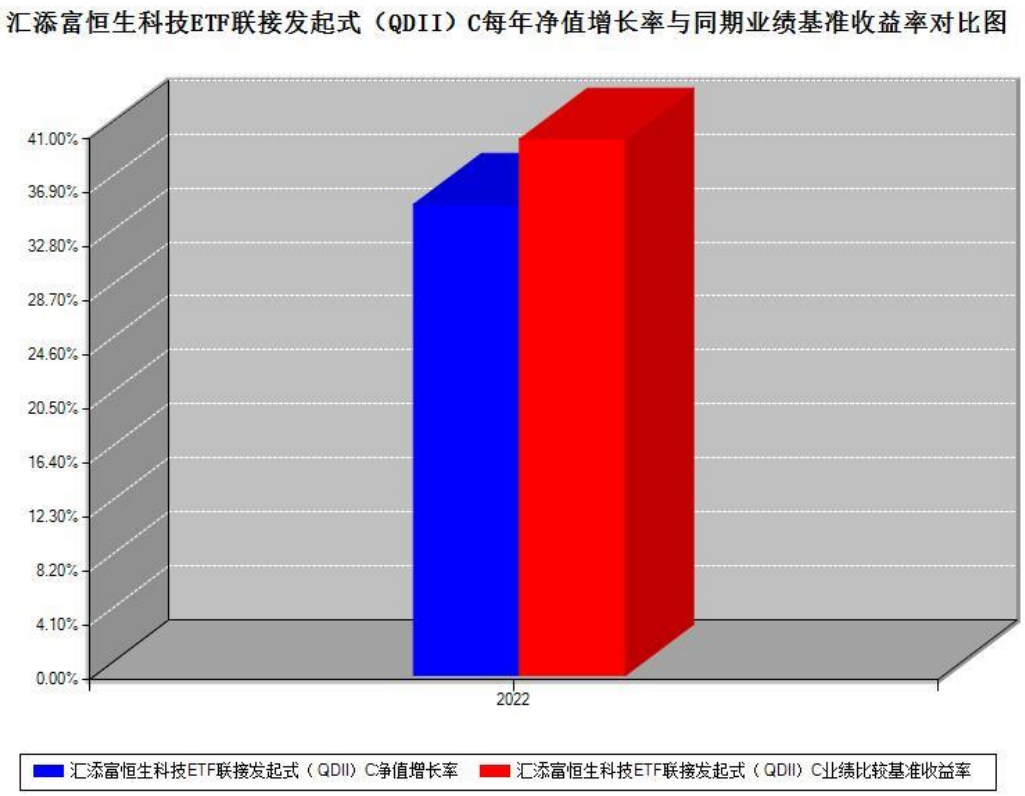
汇添富恒生科技ETF联接发起式（QDII）C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图

注：本《基金合同》生效之日为 2022 年 10 月 31 日，截至本报告期末，基金成立未满一年。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。

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。

3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





注：本《基金合同》生效之日为 2022 年 10 月 31 日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.2 基金净值表现（转型前）

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 2022-08-01 至 2022-10-30	-29.57%	2.31%	-29.35%	2.35%	-0.22%	-0.04%
自 2022-05-01 至 2022-10-30	-30.85%	2.49%	-30.16%	2.54%	-0.69%	-0.05%
自 2021-11-01 至 2022-10-30	-48.88%	2.83%	-48.72%	2.93%	-0.16%	-0.10%

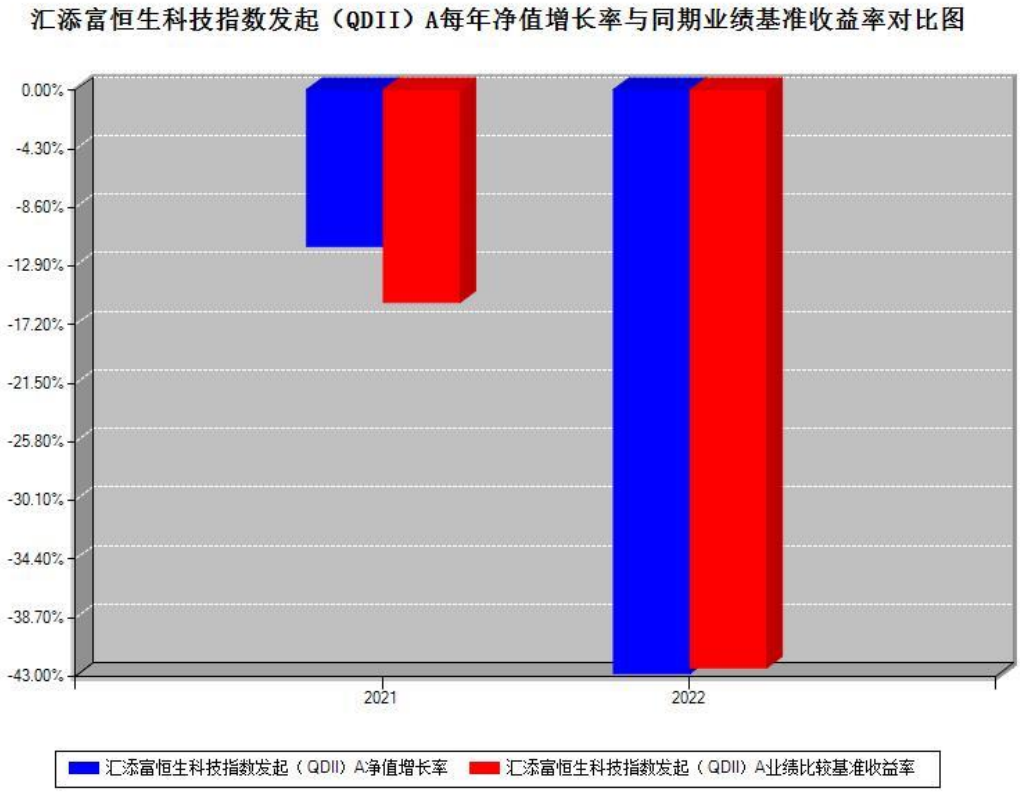
自2021-10-26至2022-10-30	-49.42%	2.81%	-51.43%	2.91%	2.01%	-0.10%
汇添富恒生科技指数发起（QDII）C						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
自2022-08-01至2022-10-30	-29.62%	2.31%	-29.35%	2.35%	-0.27%	-0.04%
自2022-05-01至2022-10-30	-30.95%	2.49%	-30.16%	2.54%	-0.79%	-0.05%
自2021-11-01至2022-10-30	-49.01%	2.83%	-48.72%	2.93%	-0.29%	-0.10%
自2021-10-26至2022-10-30	-49.55%	2.81%	-51.43%	2.91%	1.88%	-0.10%

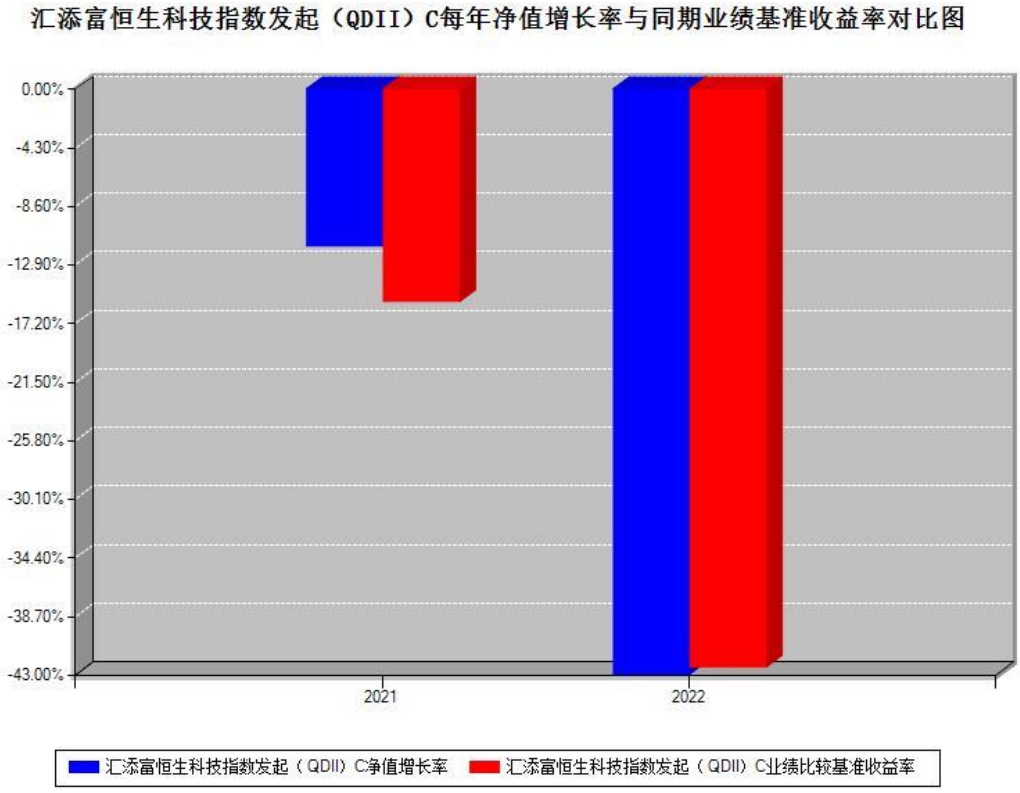
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2021 年 10 月 26 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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益

率的比较





注：本《基金合同》生效之日为 2021 年 10 月 26 日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况（转型后）

注：本《基金合同》生效之日为2022年10月31日，截至本报告期末未满三年，且未进行利润分配。

3.3 过去三年基金的利润分配情况（转型前）

注：本《基金合同》生效之日为2021年10月26日，截至本报告期末未满三年，且未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金成立于2005年2月，是中国一流的综合性资产管理公司之一。公司总部设立于上海，在北京、上海、广州、成都、南京、深圳等地设有分公司，在香港、上海、美国设有子公司——汇添富资产管理(香港)有限公司、汇添富资本管理有限公司、汇添富资产管理（美国）控股有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全，拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII基金管理人、RQFII基金管理人、QFII基金管理人、基金投资顾问等业务资格。

汇添富现已形成公募业务、私募资管业务、私募股权业务、养老金业务、电商业务、国际业务、基金投顾业务等七大业务板块，被誉为“选股专家”，赢得广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

成立以来，公司屡获殊荣，包括“金牛奖”“金基金奖”“明星基金奖”等多项权威荣誉奖项。汇添富始终坚持“客户第一”的价值观和“一切从长期出发”的经营理念，致力于打造中国最受认可的资产管理品牌。

2022年，汇添富基金新成立45只公募基金，包括18只混合型基金，17只股票型基金，10只债券型基金。2022年底，公司公募基金产品总数达270只，包括主动权益、指数、股债混合、债券、货币基金等覆盖各类风险收益特征的产品。

2022 年，汇添富基金继续坚持重度垂直兼顾开放的互联网金融平台战略，在不断夯实自有平台基础建设、全方位提升平台架构及安全系统的基础上，持续提升自有平台创新能力。从投资的生命周期各阶段出发，通过“渐进式”的创新和打磨，创造差异化的竞争优势。经过半年多的匠心打磨，推出了“指能添富”指数品牌以及对应的多项包括股债宝、指数热力

地图、指数雷达等多个指数相关功能。继续深耕基于社区的大社交板块，涵盖视频、直播、资讯等各个维度，为客户架设可链接的投资及资讯服务桥梁。年内致力于基于买方视角，大力进行投顾服务转型，全方面提升客户投资的服务体验。全年自有平台精准营销体系初见成效，实现了平台活跃度的大幅提升，力争形成长期增长的良性循环。对外合作上，进一步加深与多家互联网巨头的深度战略合作，继续大力开拓新型互联网销售及服务模式，实现与平台的合作共赢。

2022年，汇添富基金持续深化落实机构客户战略，机构业务规模保持较好的增长势头。公司为机构投资者提供综合解决方案，并深受机构投资者信任。与银行及理财子公司合作深入，保险委托管理规模同业领先。养老金业务方面，公司拥有全国社保基金境内投资管理人及基本养老保险基金投资管理人资格，也是全国社保基金境外配售策略管理人。养老金业务继续稳健发展，受托管理组合账户数量持续增加。同时在数字化建设上开展系统平台建设，为客户及团队赋能。

2022 年是渠道业务模式和客户需求发生较大改变的一年，公司始终秉持“客户第一”的价值观，围绕如何提升客户“获得感”，优化客户持有体验开展系列渠道服务和投资者教育工作。积极利用线上化数字营销工具，对客户进行分类经营和分层触达，建立精准的客户画像，提供标准化、体系化、专业化的客户陪伴。同时搭建了一站式投研资讯服务平台，提供紧贴市场的专业投资服务，以及便捷高效的营销辅助工具，赋能渠道客户经理。全年合计开展超4000余场“价值投资添富行” 线上、线下系列活动。持续大力开展目标收益定投、走进汇添富、走进上市公司、基金经理面对面等系列客户活动，营销培训活动覆盖至银行和券商的网点、营业部。

2022 年，汇添富基金继续提升客户服务能力，优化客户服务体系，为公司各项销售业务提供全方位支持。同时，持续优化电话服务、在线客服、短信系统等服务通道建设，丰富服务渠道，提升客户体验。

2022 年，香港子公司与母公司两地一体化运营、垂直化管理模式持续深化，并继续发挥显著成效，国际业务总资产管理规模稳步进步。汇添富香港于开曼群岛设立联接基金架构下的两支子母基金，汇添富权益大中华基金（CUAM EQUITY GREATER CHINA FUND和汇添富权益大中华主基金（CUAM EQUITY GREATER CHINA MASTER FUND）。 境外资产投资业绩稳健，为投资者全球资产分散化布局进一步打下基础，“中港策略”保持国际权威基金评级机构晨星五星评级，港币债券基金荣获晨星5星评级。客户服务方面，努力克服疫情影响，积极通过线上路演保持与全球央行、主权、养老、校务基金、家族信托等海外客户的持续沟通，进

一步完善个性化客户服务体系，继续引导长期资金入市。

2022年以来，汇添富以爱能改变为任，积极投身公益慈善，履行社会责任。公司积极支持上海疫情防控，支援街道、社区、医院和学校防疫工作；继续为推动中西部欠发达地区教育发展和乡村振兴而不懈努力；发挥公司专业优势，发起“基业上善”慈善资产管理研修营项目并完成第一期培训，助力国内公益基金会慈善资产保值增值和公益行业可持续发展。面对2022年上海爆发的疫情，公司在全力保护投资者利益、维护资本市场稳定的基础上，和全上海同呼吸共命运，支持一线抗疫，共同守“沪”。2022年3月至5月，公司累计捐赠款物107.77万余元，用于“上海基金业致敬白衣天使”专项基金捐赠及瑞金医院、复旦大学、上海交通大学、以及部分街道社区抗疫物资捐赠。公司积极动员公司员工参与社区防疫服务工作，共有77人参与社区防疫志愿服务工作，超过员工总数10%，服务总时长超过2000小时。在教育扶贫方面，汇添富持续开展“河流•孩子”公益助学计划：2022年1月，通过“汇爱暖冬”联合捐赠行动，为全国10所添富小学筹集并捐赠价值近400万元的暖冬物资20000余份；2022年8月，以线上形式开展第十五期“河流•孩子”2022乡村优秀青年教师培训；2022年9月，组织员工回访云南怒江州平安寨添富小学并提供支教等公益志愿服务。在乡村振兴方面，汇添富全年先后向黄浦区2022年党建助力对口支援地区乡村振兴项目、内蒙古兴和县产业帮扶和养老助老帮扶等项目、青海玛多县教育扶贫项目捐赠，助力乡村振兴。2022年12月，在中国证券投资基金业协会及中国慈善联合会的指导和支持下，公司旗下上海汇添富公益基金会联合上海第一财经公益基金会发起并举办首期“基业上善”慈善资产管理研修营。汇添富基金发挥自身资产管理的专业能力，赋能公益事业的可持续发展，践行基金向善，助力共同富裕和社会进步。

2023 年，汇添富基金将继续秉持一贯的经营理念与原则，进一步加强风险管理能力，提升客户服务水平，推动业务稳步发展，为促进实体经济健康发展、提升中国居民财富水平而不懈努力。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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		8	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。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。

					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。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。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联接基金的基金经理。2022年7月29日至今任汇添富中证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。

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。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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	2022年10月30日	8	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。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。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。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。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联接基金的基金经理。2022 年 7 月 29 日至今任汇添富中证 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

					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。

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。

4.1.3 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 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司制定了《汇添富基金管理股份有限公司公平交易制度》，建立了健全、有效的公平交易制度体系，覆盖了公募基金、资产管理计划、社保组合、基本养老组合以及投资顾问业务等各类资产管理业务所涉及的所有投资组合；涵盖了境内外上市股票、债券等所有投资品种的一级市场申购、二级市场交易

等投资管理活动；贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行以及效果评估等投资管理活动的各个环节。具体控制措施包括：（1）在研究分析环节，公司建立了统一、规范和完善的投研平台信息管理系统，规范了研究人员的投资建议、研究报告的发布流程，使各投资组合经理在获取投资建议的及时性、准确性及深度等方面得到公平对待。（2）在投资决策环节，公司建立健全投资授权制度，明确投资决策委员会、分管投资副总、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限，合理确定各投资组合经理的投资权限。投资决策委员会和分管投资副总等管理机构和人员不得对投资组合经理在授权范围内的投资活动进行干预。投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序。另外，公司还建立机制要求公募投资组合经理与资产管理计划投资组合经理互相隔离，且不能互相授权投资事宜。（3）在交易执行环节，本公司设立了独立于投资管理职能的交易部门，实行了集中交易制度和公平的交易分配机制。对于交易所公开竞价的同向交易，内部制定了相应的交易管理规则，保证各投资组合获得公平的交易执行机会；对于银行间市场的现券、回购等场外交易，交易部在交易市场开展独立、公平的询价，确保交易得到公平执行；对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，集中交易室按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配，确保公平对待各投资组合。（4）在日常监控环节，公司通过日常监控分析、投资交易监控报告、专项稽核等形式，对投资交易全过程实施监督，对包括利益输送在内的各类异常交易行为进行核查。核查的范围包括不同时间窗口下的同向交易、反向交易、交易价差、收益率差异、场外交易分配、场外议价公允性等等。（5）在报告分析环节，公司按季度和年度编制公平交易分析报告，对不同组合间同一投资标的、临近交易日的同向交易和反向交易的合理性开展分析评估，并由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。

4.4.2 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中的公平交易模块，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。

4.4.3 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41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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022年，全球主要关注欧洲地缘冲突、全球疫情进展及美联储加息进度。

欧洲地缘冲突二月开始发酵，对全球市场都造成了短期剧烈冲击，并带来对能源供应的担忧。发达经济体通胀上行显著。美联储在一季度开始持续加息来应对通胀压力的意图明确，带来全球流动性冲击。随着四季度通胀数据改善，加息周期预计逐渐接近尾声。区域之间的经济周期出现一定错位，国内复苏预期与海外弱衰退的状态形成鲜明对比。四季度，国内市场在10月下跌之后迎来震荡上行，行情以复苏预期升温主导，交易情绪显著改善。12月7日，随着“新十条”出台，各项措施进一步优化调整，相关配套政策也陆续出台。但各地实际情况有所差异，市场对此也存在一定分歧，12月中下旬整体表现为缩量下跌行情。

国内来看，10月、11月经济数据略有不及预期。政策优化调整及落实的过程中，难以避免短期冲击，对经济复苏节奏产生一定扰动。12 月中央经济工作会议仍然以稳增长为主基调，强调了扩大内需的重要性，其他重点工作还包括加快建设现代化产业体系、切实落实“两个毫不动摇”、大力吸引和利用外资、有效防范化解重大经济金融风险等，表达了较为积极的政策态度。

资本市场方面，全年下跌行情在四季度有所扭转，但成交缩量明显。从资金流向观察来看，大量资金流入宽基类产品。行业板块中，消费、医药等前期下跌较多的板块出现底部修复行情，另有信创板块受到市场关注，涨幅较大。周期类板块下跌较多。

港股方面，3月份以来多次加息对港股市场带来较大冲击。加息预期逐步兑现之后，单次加息的市场冲击有所减弱。且伴随政策优化调整落地，港股市场在四季度表现强势。且中美监管合作持续推进、互联网领域监管常态化，此前的悲观预期反映较为充分，具备底部修复的条件。

2021 年初开始，整个互联网板块受监管力度加大影响而持续回调。监管框架现已逐渐成型，监管效果初步显现。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，覆盖了软件、电子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。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

本基金于2022年10月31日变更注册为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）。转型前，汇添富恒生科技指数发起(QDII)A 类份额净值增长率为-42.84%；汇添富恒生科技指数发起(QDII)C类份额净值增长率为-42.96%，同期业绩比较基准收益率均为-42.44%。转型后，汇添富恒生科技 ETF 联接发起式(QDII)A 类份额净值增长率为35.78%；汇添富恒生科技ETF联接发起式(QDII)C类份额净值增长率为35.74%，同期业绩比较基准收益率均为40.69%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2023年，美联储加息周期临近尾声，但未必能够很快看到降息，需要适度维持的高利率状态来控制通胀水平。但市场对流动性的边际改善预期已经形成，全球资金预计有望转向新兴市场。国内经济复苏与海外弱衰退形成对比，中国资产的全球吸引力进一步提升。2022 年全年海外资金流入不显著，但临近年末北上资金流入开始加速。随着互联互通的范围在品种上扩容到ETF、在股票标的范围上也有进一步扩大的规则出台，未来北上资金持续流入的空间打开。政策方面，稳增长基调不变，经济复苏和流动性适度的环境下，企业盈利也有望逐步改善。站在2022年末，资本市场已经经历一年多的冲击，当前已经出现较多积极的改变，使得我们能够对未来一年的资本市场保持乐观积极的态度。

4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人内部稽核监察工作主要包括以下几个方面：

1、持续提升合规法务管理

公司持续践行“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化，坚持“正直”、“客户第一”的公司价值观，完善合规管理体系，提升专业能力，优化合规资源配置，不断提升合规管理工作的有效性。公司坚持广泛开展合规培训、强化从业人员合规意识，不断夯实公司合规文化

体系基础;持续完善公司制度流程体系、优化合规管理制度机制,通过统一的合规审核标准、动态调整的合规管理指引，有效把控各类业务的合规关键点，防范潜在风险，保障各项业务规范开展；深入细致开展合规审查工作，为各部门提供有效的合规咨询与法务支持，督促强化一线合规执行效果；独立开展事后合规检查监督，查漏补缺、防微杜渐；优化从业人员管理机制,加强管理措施,严格执行合规考核问责机制,引导全体员工不断提升合规执业意识，强化公司合规履职保障。

2、完善投资合规风险控制工作

本基金管理人持续优化投资运作管理事前、事中、事后全流程的投资合规风险管理措施。

事前，加强新产品、新业务的风险识别、评估。在产品设计环节评估新产品、新业务的投资合规性，为管控新产品、新业务运作中的潜在投资合规风险奠定基础。此外，本基金管理人坚持制度先行，通过制定或修订各项投资管理制度，为业务的开展提供了科学规范的制度依据。

事中，管控措施不断完善。通过配置投资交易系统风控参数、加强事中流程审核等，有效保障投资交易行为合规。同时，通过对基金日常流动性、投资组合风险敞口等进行监控、分析、提示，完善日常投资合规风险监控体系。

事后，风险跟踪提示机制持续优化。通过对投资范围、投资限制、公平交易、异常交易情况等的跟踪、分析和提示，有效落实法律法规、基金合同及公司内部制度的各项要求。

3、加强稽核内审工作

通过开展日常风险排查，以及对重点业务开展专项稽核检查，尽早发现业务中存在的合规问题和风险隐患，并采取防范措施，督促责任部门落实整改；对风险事件和差错事件开展稽核审查，加强问责力度，促进业务合法合规开展；实施关键岗位离任审查，督促人员勤勉尽责、合规展业；配合监管检查与会计师事务所审计工作，通过问题反馈、实施整改，进一步完善公司内部控制管理机制。

通过上述工作，本报告期内，本基金管理人所管理的基金能够合法合规开展投资运作。本基金管理人将规范运作基金资产，加强风险控制，持续提高监察稽核工作的科学性和有效性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，并保持估值政策和程序的一贯性。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责构建估值决策体系、适时更新估值相关制度、指导并监督各类投资品种的估值程序。估值委员会由投资、研究、集中交易、合规稽核、风险管理、基金营运等部门中具有丰富从业经验和专业胜任能力的员工担任，且互相不存在直接的重大利益冲突。基金经理可参与估值委员会对于估值方法的讨论，但无最终决策权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理。

基金日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由管理人完成估值后，经托管人复核无误后由管理人对外公布。

4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；同一类别内每一基金份额享有同等分配权。

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.10 报告期内管理人对本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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不

存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告（转型后）

6.1 审计报告的基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2023）审字第 60466941_B270 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	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）全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了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）的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的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）的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了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）2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于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），并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	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）管理层对其他信息负责。 其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

	基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估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）的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督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）的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (2)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (3)评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (4)对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对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）持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致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）不能持续经营。 (5)评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	许培菁	韩云
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层	
审计报告日期	2023 年 03 月 31 日	

§6 审计报告（转型前）

6.1 审计报告的基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2023）审字第 60466941_B213 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	汇添富恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了汇添富恒生科技指数型发起式证券投资基金(QDII）的财务报表，包括 2022 年 10 月 30 日（基金合同失效前日）的资产负债表，2022 年 1 月 1 日至 2022 年 10 月 30 日（基金合同失效前日）止期间的利润表、净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的汇添富恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了汇添富恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）2022 年 10 月 30 日（基金合同失效前日）的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 10 月 30 日（基金合同失效前日）止期间的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于汇添富恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII），并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	汇添富恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）管理层对其他信息负责。 其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对

	其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估汇添富恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督汇添富恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (2)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (3)评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (4)对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对汇添富恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致汇添富恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）不能持续经营。 (5)评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

	我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	许培菁	韩云
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层	
审计报告日期	2023年03月31日	

§7 年度财务报表（转型后）

7.1 资产负债表

会计主体：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）

报告截止日：2022年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022年12月31日
资 产：		
银行存款	7.4.7.1	25,494,956.48
结算备付金		4,341,891.78
存出保证金		674,868.25
交易性金融资产	7.4.7.2	362,062,809.13
其中：股票投资		5,808,459.13
基金投资		356,254,350.00
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
债权投资	7.4.7.5	-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
应收清算款		303,659.90
应收股利		-
应收申购款		2,979,591.83
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		395,857,777.37
负债和净资产	**附注号**	**本期末**

		2022年12月31日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		0.91
应付赎回款		8,849,456.06
应付管理人报酬		12,861.39
应付托管费		2,572.30
应付销售服务费		34,345.75
应付投资顾问费		-
应交税费		63,669.86
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.7	167,535.19
负债合计		9,130,441.46
净资产：		
实收基金	7.4.7.8	563,815,310.30
未分配利润	7.4.7.9	-177,087,974.39
净资产合计		386,727,335.91
负债和净资产总计		395,857,777.37

注：1、报告截止日2022年12月31日，基金份额总额563,815,310.30份。本基金下属A类基金份额净值0.6868元，基金份额总额317,028,693.80份;本基金下属C类基金份额净值0.6848元，基金份额总额246,786,616.50份。

2、本基金合同于2022年10月31日生效，无上年度可比期间，因此资产负债表只列示 2022年12月31日数据，特此说明。

7.2 利润表

会计主体：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）

本报告期：2022年10月31日至2022年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022年10月31日（基金合同生效日）至2022年12月31日
一、营业总收入		**102,350,079.53**
1.利息收入		32,028.44
其中：存款利息收入	7.4.7.10	32,028.44
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-

买入返售金融资产收入		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-60,656,732.60
其中：股票投资收益	7.4.7.11	-66,532,956.14
基金投资收益	7.4.7.12	2,107,800.05
债券投资收益	7.4.7.13	34.72
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-
衍生工具收益	7.4.7.16	3,748,316.37
股利收益	7.4.7.17	20,072.40
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	163,032,154.29
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）		-161,110.08
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	103,739.48
减：二、营业总支出		**272,244.41**
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	94,632.31
2．托管费	7.4.10.2.2	18,926.47
3．销售服务费		67,360.45
4．投资顾问费		-
5．利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6．信用减值损失	7.4.7.20	-
7．税金及附加		6,821.77
8．其他费用	7.4.7.21	84,503.41
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**102,077,835.12**
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**102,077,835.12**
五、其他综合收益的税后净额		**-**
六、综合收益总额		**102,077,835.12**

注：本基金合同于2022年10月31日生效，本报表无上年度可比期间，特此说明。

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：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）

本报告期：2022年10月31日（基金合同生效日）至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2022年10月31日（基金合同生效日）至2022年12月31日

	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	552,823,110.77	-273,565,428.29	279,257,682.48
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	552,823,110.77	-273,565,428.29	279,257,682.48
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	10,992,199.53	96,477,453.90	107,469,653.43
（一）、综合收益总额	-	102,077,835.12	102,077,835.12
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	10,992,199.53	-5,600,381.22	5,391,818.31
其中：1.基金申购款	304,972,775.68	-111,858,924.62	193,113,851.06
2.基金赎回款	-293,980,576.15	106,258,543.40	-187,722,032.75
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	563,815,310.30	-177,087,974.39	386,727,335.91

注：本基金合同于2022年10月31日生效，本报表无上年度可比期间，特此说明。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

张晖	李骁	雷青松
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

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）（以下简称“本基金”），是由汇添富恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）变更而来。原汇添富恒生

科技指数型发起式证券投资基金（QDII）系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2021]2237 号文《关于准予汇添富恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集。基金合同于2021年10月26日生效。首次设立基金募集规模为27,529,757.64份基金份额，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）出具安永华明（2021）验字第60466941_B89号验资报告予以验证。

根据相关法律法规及《汇添富恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）基金合同》的规定，经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，自2022年10月31日起，汇添富恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）转型为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）。根据转型安排，修订后的《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》自2022年10月31日起生效，《汇添富恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）基金合同》同日起失效。本基金为契约型开放式、开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司，境外托管人为香港上海汇丰银行有限公司。

本基金的标的指数为恒生科技指数及其未来可能发生的变更。本基金投资于目标 ETF、标的指数的成份股、备选成份股和其他香港联合交易所上市的股票（含港股通标的股票）。此外，本基金还可投资于以下金融产品或工具：针对境外投资，本基金可投资于银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证、房地产信托凭证；在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可以进行境外证券借贷交易、境外正回购交易、逆回购交易。有关证券借贷交易的内容以专门签署的三方或多方协议约定为准。针对境内投资，本基金可投资于国内依法发行上市的股票、债券等金融工具，具体包括：股票（包含主板、创业板、其他依法上市的股票、存托凭证）、股指期货、国债期货、股票期权、债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可交换

债券、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具等资产以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。本基金为对冲外币的汇率风险，可以投资于境外外汇远期合约、结构性外汇远期合约、外汇期权及外汇期权组合、外汇互换协议、与汇率挂钩的结构性投资产品等金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%；每个交易日日终在扣除境内金融衍生品合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金通过投资于目标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。本基金的业绩比较基准为：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%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2022年12月31日的财务状况以及2022年10月31日（基金合同生效日）至2022年12月31日的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系2022年10月31日（基金合同生效日）至 2022年12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金

在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2)不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4)如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2)交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3)股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4)处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5)买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6)公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7)转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入；

(8)其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(2)同一类别内每一基金份额享有同等分配权；

(3)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目 。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

经营本部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；

（2）本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；

（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅

助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对本基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征增值税和企业所得税；

基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日
活期存款	25,494,956.48
等于：本金	25,490,745.00
加：应计利息	4,211.48
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	25,494,956.48

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		6,012,239.54	-	5,808,459.13	-203,780.41
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	境外 OTC 市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		311,639,619.25	-	356,254,350.00	44,614,730.75
其他		-	-	-	-
合计		317,651,858.79	-	362,062,809.13	44,410,950.34

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
（国债期货投资）	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
（外汇期货投资）	-	-	-	-
权益衍生工具	3,753,105.57	-	-	-
（权证投资）	-	-	-	-
（股指期货投资）	3,753,105.57	-	-	-

其他衍生工具	-	-	-	-
合计	3,753,105.57	-	-	-

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
HTI2301 HK	HSTECH Futures Jan23	20	3,727,826.03	-25,279.54
合计				-25,279.54
减：可抵销期货暂收款				-25,279.54
净额				-

注：在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的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。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内不存在债权投资减值准备计提情况。

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

7.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	27,535.19
其中：交易所市场	27,535.19
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	20,000.00
应付信息披露费	120,000.00
应付指数使用费	-
应付账户维护费	-
应付汇划费	-
应付上市费	-
应付持有人大会费-公证费	-
应付持有人大会费-律师费	-
其他	-
合计	167,535.19

7.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富恒生科技 ETF 联接发起式（QDII）A		
项目	本期 2022 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	277,205,843.70	277,205,843.70
本期申购	113,208,604.65	113,208,604.65
本期赎回（以“-”号填列）	-73,385,754.55	-73,385,754.55
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	317,028,693.80	317,028,693.80
汇添富恒生科技 ETF 联接发起式（QDII）C		
项目	本期 2022 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31	

	日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	275,617,267.07	275,617,267.07
本期申购	191,764,171.03	191,764,171.03
本期赎回（以“-”号填列）	-220,594,821.60	-220,594,821.60
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	246,786,616.50	246,786,616.50

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

汇添富恒生科技ETF联接发起式（QDII）A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-14,136,232.51	-122,864,278.00	-137,000,510.51
本期利润	-31,955,866.01	85,268,297.31	53,312,431.30
本期基金份额交易产生的变动数	-4,315,242.82	-11,293,695.01	-15,608,937.83
其中：基金申购款	-14,706,099.53	-27,403,194.74	-42,109,294.27
基金赎回款	10,390,856.71	16,109,499.73	26,500,356.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-50,407,341.34	-48,889,675.70	-99,297,017.04
汇添富恒生科技ETF联接发起式（QDII）C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-14,569,597.00	-121,995,320.78	-136,564,917.78
本期利润	-28,998,453.16	77,763,856.98	48,765,403.82
本期基金份额交易产生的变动数	3,872,132.48	6,136,424.13	10,008,556.61
其中：基金	-26,674,881.84	-43,074,748.51	-69,749,630.35

申购款			
基金赎回款	30,547,014.32	49,211,172.64	79,758,186.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-39,695,917.68	-38,095,039.67	-77,790,957.35

7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	19,976.01
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	11,729.55
其他	322.88
合计	32,028.44

注:“其他”为直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

7.4.7.11 股票投资收益

7.4.7.11.1 股票投资收益——股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-66,532,956.14
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-66,532,956.14

7.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	296,240,802.75
减：卖出股票成本总额	362,146,625.20
减：交易费用	627,133.69
买卖股票差价收入	-66,532,956.14

7.4.7.11.3 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无申购差价收入。

7.4.7.12 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
卖出/赎回基金成交总额	17,019,500.70
减：卖出/赎回基金成本总额	14,846,923.83
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	63,309.07
减：交易费用	1,467.75
基金投资收益	2,107,800.05

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	79.72
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-45.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	34.72

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,517,742.12
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,502,400.00
减：应计利息总额	15,387.12
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-45.00

7.4.7.14 资产支持证券投资收益

7.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

7.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具买卖权证差价收入。

7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2022 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	3,748,316.37
外汇期货投资收益	-
外汇远期投资收益	-
国债期货投资收益	-

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	20,072.40
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	20,072.40

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	162,824,828.88
——股票投资	118,210,098.13

——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	44,614,730.75
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	207,325.41
——权证投资	-
——期货投资	207,325.41
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	163,032,154.29

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年10月31日（基金合同生效日）至2022年12月31日
基金赎回费收入	103,739.48
替代损益	-
其他	-
合计	103,739.48

7.4.7.20 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年10月31日（基金合同生效日）至2022年12月31日
审计费用	3,398.63
信息披露费	78,492.03
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	1,673.38
指数使用费	-
持有人大会-公证费	-
持有人大会-律师费	-
开户费	-
上市费	-

其他	939.37
合计	84,503.41

7.4.7.22 分部报告

注：本基金目前以一个经营分部运作。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人,基金销售机构,基金注册登记机构,基金发起人
招商银行股份有限公司（"招商银行"）	基金托管人,基金代销机构
香港上海汇丰银行有限公司（The Hong Kong and Shanghai Banking Co. Ltd.）（"汇丰银行"）	境外资产托管人
东方证券股份有限公司（"东方证券"）	基金管理人的股东,基金代销机构
上海上报资产管理有限公司	基金管理人的股东
上海菁聚金投资管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
东航金控有限责任公司	基金管理人的股东
汇添富资本管理有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理（美国）控股有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理（香港）有限公司	基金管理人的全资子公司
东方证券承销保荐有限公司	基金管理人的股东的全资子公司
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批关键管理人员
汇添富投资管理有限公司	基金管理人的全资子公司的全资子公司
汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）	本基金是该基金的联接基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期2022年10月31日（基金合同生效日）至2022年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
东方证券	195,426,615.92	65.97

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期2022年10月31日（基金合同生效日）至2022年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
东方证券	3,004,755.00	100.00

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.4 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期2022年10月31日（基金合同生效日）至2022年12月31日	
	成交金额	占当期基金成交总额的比例（%）
东方证券	36,695,386.70	100.00

7.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期2022年10月31日（基金合同生效日）至2022年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
东方证券	156,341.14	79.61	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金

收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年10月31日（基金合同生效日）至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	94,632.31
其中：支付销售机构的客户维护费	99,847.45

注：本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF份额所对应的资产净值后余额（若为负数，则取0）的0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.5%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值扣除所持有目标 ETF 份额所对应的资产净值后的余额，若为负数，则E取0

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年10月31日（基金合同生效日）至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	18,926.47

注：本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取托管费。本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF份额所对应的资产净值后余额（若为负数，则取0）的0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.1%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值扣除所持有目标 ETF 份额所对应的资产净值后的余额，若为负数，则E取0

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期2022年10月31日（基金合同生效日）至2022年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	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	合计
招商银行股份有限公司	-	8,091.03	8,091.03
东方证券股份有限公司	-	98.73	98.73
汇添富基金管理股份有限公司	-	7,310.73	7,310.73
合计	-	15,500.49	15,500.49

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.25%。本基金C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.25%年费率计提。

计算方法如下：

H＝E×0.25%÷当年天数

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注:本基金本报告期未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

汇添富恒生科技 ETF 联接发起式（QDII）A	
项目	本期 2022 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2022 年 10 月 31 日）持有的基金份额	10,002,400.24
报告期初持有的基金份额	-
报告期间申购/买入总份额	-
报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	10,002,400.24
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例（%）	3.16
汇添富恒生科技 ETF 联接发起式（QDII）C	
项目	本期 2022 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2022 年 10 月 31 日）持有的基金份额	-
报告期初持有的基金份额	-
报告期间申购/买入总份额	-
报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例（%）	-

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。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除管理人之外的其他关联方本报告期末未投资本基金。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期2022年10月31日（基金合同生效日）至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	22,323,775.85	18,619.28
汇丰银行	3,171,180.63	1,356.73

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

于本报告期末，本基金持有342,750,000.00份目标ETF基金份额，占其总份额的比例为79.48%。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期未进行利润分配。于资产负债表日之后、财务报表批准日之前批准、公告或实施的利润分配情况详见资产负债表日后事项章节。

7.4.12 期末（2022年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末2022年12月31日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末2022年12月31日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：截至本报告期末2022年12月31日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不超过基金资产净值的10%。此外，基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基

金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，本基金本报告期末的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2022年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	25,494,956.48	-	-	-	-	-	25,494,956.48
结算备付金	34,703.74	-	-	-	-	4,307,188.04	4,341,891.78

存出保证金	759.36	-	-	-	-	674,108.89	674,868.25
交易性金融资产	-	-	-	-	-	362,062,809.13	362,062,809.13
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	303,659.90	303,659.90
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	2,979,591.83	2,979,591.83
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	25,530,419.58	-	-	-	-	370,327,357.79	395,857,777.37
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购	-	-	-	-	-	-	-

金融资产款							
应付清算款	-	-	-	-	-	0.91	0.91
应付赎回款	-	-	-	-	-	8,849,456.06	8,849,456.06
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	12,861.39	12,861.39
应付托管费	-	-	-	-	-	2,572.30	2,572.30
应付销售服务费	-	-	-	-	-	34,345.75	34,345.75
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	63,669.86	63,669.86
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	167,535.19	167,535.19
负债总计	-	-	-	-	-	9,130,441.46	9,130,441.46
利率敏感度缺口	25,530,419.58	-	-	-	-	361,196,916.33	386,727,335.91

表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末未持有债券资产及资产支持证券（不含可转换债券及可交换债券），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	3,171,209.83	-	3,171,209.83
结算备付金	-	4,307,188.04	-	4,307,188.04
存出保证金	-	674,108.89	-	674,108.89
交易性金融资产	-	5,808,459.13	-	5,808,459.13
衍生金融资产	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	13,960,965.89	-	13,960,965.89
以外币计价的负债				
短期借款	-	-	-	-

交易性金融负债	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	13,960,965.89	-	13,960,965.89

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	1.除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑基金管理人为降低汇率风险而可能采取的风险管理活动。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末2022年12月31日
	港币相对人民币升值5%	698,048.29
	港币相对人民币贬值5%	-698,048.29

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格

因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。

本基金管理人通过标准差、跟踪误差、beta 值等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	5,808,459.13	1.50
交易性金融资产—基金投资	356,254,350.00	92.12
交易性金融资产－债券投资	-	-
交易性金融资产－贵金属投资	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-
其他	-	-
合计	362,062,809.13	93.62

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变； 2.以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2022 年 12 月 31 日
	恒生科技指数(汇率调整)上涨 5%	17,719,399.81
	恒生科技指数(汇率调整)下跌 5%	-17,719,399.81

注：本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年12月31日
第一层次	362,062,809.13
第二层次	-
第三层次	-
合计	362,062,809.13

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

注：本基金本报告期末不存在第三层次公允价值余额。

7.4.14.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

注：本基金本报告期末不存在第三层次公允价值余额。

7.4.14.4 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.5 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 年度财务报表（转型前）

7.1 资产负债表

会计主体：汇添富恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）

报告截止日：2022 年 10 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022 年 10 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	33,386,377.74	6,307,551.98
结算备付金		4,837,336.95	921,976.08
存出保证金		2,222,492.66	244,446.42
交易性金融资产	7.4.7.2	249,744,986.20	56,831,135.21
其中：股票投资		249,744,986.20	56,831,135.21
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		2,298,697.05	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	891.18
资产总计		292,489,890.60	64,306,000.87
负债和净资产	**附注号**	**本期末**	**上年度末**

		2022年10月30日	2021年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		42.36	9.24
应付赎回款		12,984,131.76	543,777.45
应付管理人报酬		118,810.65	22,279.23
应付托管费		23,762.13	4,455.83
应付销售服务费		29,595.80	4,084.42
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.7	75,865.42	30,773.38
负债合计		13,232,208.12	605,379.55
净资产：			
实收基金	7.4.7.8	552,823,110.77	71,999,136.10
未分配利润	7.4.7.9	-273,565,428.29	-8,298,514.78
净资产合计		279,257,682.48	63,700,621.32
负债和净资产总计		292,489,890.60	64,306,000.87

注：1、报告截止日2022年10月30日，基金份额总额552,823,110.77份。本基金下属A类基金份额净值0.5058元，基金份额总额277,205,843.70份;本基金下属C类基金份额净值0.5045元，基金份额总额275,617,267.07份。

2、本基金合同生效日为2021年10月26日，上年度实际报告期间为2021年10月26日至2021年12月31日，特此说明。

3、比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年末”余额，上年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年末”余额。

7.2 利润表

会计主体：汇添富恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）

本报告期：2022年01月01日至2022年10月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间

		2022年01月01日至2022年10月30日	2021年10月26日（基金合同生效日）至2021年12月31日
一、营业总收入		**-124,722,291.58**	**-4,596,063.14**
1.利息收入		73,662.64	7,082.86
其中：存款利息收入	7.4.7.10	73,662.64	7,082.86
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-11,013,518.40	8,342.54
其中：股票投资收益	7.4.7.11	-8,258,448.85	-544.15
基金投资收益	7.4.7.12	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-3,875,011.76	-
股利收益	7.4.7.17	1,119,942.21	8,886.69
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-114,061,303.62	-4,585,179.87
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		81,511.97	-27,026.64
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	197,355.83	717.97
减：二、营业总支出		**1,356,906.60**	**210,065.20**
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	852,291.54	35,898.88
2．托管费	7.4.10.2.2	170,458.29	7,179.78
3．销售服务费		187,111.59	5,354.06
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．信用减值损失	7.4.7.20	-	-
7．税金及附加		343.49	-
8．其他费用	7.4.7.21	146,701.69	161,632.48
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**-126,079,198.18**	**-4,806,128.34**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**-126,079,198.18**	**-4,806,128.34**
五、其他综合收益的税后净额		**-**	**-**
六、综合收益总额		**-126,079,198.18**	**-4,806,128.34**

注：比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》

中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：汇添富恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）

本报告期：2022年01月01日至2022年10月30日

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年10月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	71,999,136.10	-8,298,514.78	63,700,621.32
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	71,999,136.10	-8,298,514.78	63,700,621.32
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	480,823,974.67	-265,266,913.51	215,557,061.16
（一）、综合收益总额	-	-126,079,198.18	-126,079,198.18
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	480,823,974.67	-139,187,715.33	341,636,259.34
其中：1.基金申购款	884,102,828.85	-257,161,908.10	626,940,920.75
2.基金赎回款	-403,278,854.18	117,974,192.77	-285,304,661.41
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	552,823,110.77	-273,565,428.29	279,257,682.48
项目	上年度可比期间 2021年10月26日（基金合同生效日）至2021年12月31日		

	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	27,529,757.64	-	27,529,757.64
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	44,469,378.46	-8,298,514.78	36,170,863.68
（一）、综合收益总额	-	-4,806,128.34	-4,806,128.34
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	44,469,378.46	-3,492,386.44	40,976,992.02
其中：1.基金申购款	52,128,513.50	-4,006,824.60	48,121,688.90
2.基金赎回款	-7,659,135.04	514,438.16	-7,144,696.88
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	71,999,136.10	-8,298,514.78	63,700,621.32

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

张晖	李骁	雷青松
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

汇添富恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2021]2237号文《关于准予汇添

富恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集。基金合同于2021年10月26日生效。首次设立基金募集规模为27,529,757.64份基金份额，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）出具安永华明（2021）验字第60466941_B89号验资报告予以验证。本基金为契约型开放式、发起式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司，境外托管人为香港上海汇丰银行有限公司。

本基金投资于标的指数的成份股、备选成份股和其他香港联合交易所上市的股票（含港股通标的股票）。此外，本基金还可投资于以下金融产品或工具：针对境外投资，本基金可投资于银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证、房地产信托凭证；在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可以进行境外证券借贷交易、境外正回购交易、逆回购交易。有关证券借贷交易的内容以专门签署的三方或多方协议约定为准。针对境内投资，本基金可投资于国内依法发行上市的股票、债券等金融工具，具体包括：股票（包含主板、创业板、其他依法上市的股票、存托凭证）、股指期货、国债期货、股票期权、债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具等资产以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。本基金为对冲外币的汇率风险，可以投资于境外外汇远期合约、结构性外汇远期合约、外汇期权及外汇期权组合、外汇互换协议、与汇率挂钩的结构性投资产品等金融工具。本基金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。本基金的业绩比较基准为：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%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的

具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2022年10月30日的财务状况以及2022年01月01日至2022年10月30日的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系2022年01月01日至 2022年10月30日（合同失效前日）止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大

事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2)不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4)如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2)交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3)股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4)处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5)买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6)公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7)转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入；

(8)其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法

与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(2)同一类别内每一基金份额享有同等分配权；

(3)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目 。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

经营本部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；

（2）本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；

（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

根据《企业会计准则第22号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号——金融资产转移》、《企业会计准则第24号——套期会计》、《企业会计准则第37号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自2022年1月1日开始按照新金融工具准则进行会计处理。此外，本基金亦已执行财政部于2022年发布的《关于印发(资产管理产品相关会计处理规定)的通知》（财会[2022]14号）。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余

成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

根据新金融工具准则的衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与原准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

于首次执行日（2022年1月1日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币6,307,551.98元，自应收利息转入的重分类金额为人民币653.24元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币6,308,205.22元。

结算备付金于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币921,976.08元，自应收利息转入的重分类金额为人民币237.94元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币922,214.02元。

应收利息于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币891.18元，转出至银行存款的重分类金额为人民币653.24元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币237.94元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对本基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业

税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征增值税和企业所得税；

基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 10 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	33,386,377.74	6,307,551.98
等于：本金	33,376,139.79	6,307,551.98
加：应计利息	10,237.95	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
合计	33,386,377.74	6,307,551.98

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 10 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		368,158,864.74	-	249,744,986.20	-118,413,878.54
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	境外 OTC 市场	-	-	-	-

	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		368,158,864.74	-	249,744,986.20	-118,413,878.54
项目		上年度末 2021 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		61,438,185.88	-	56,831,135.21	-4,607,050.67
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	境外 OTC 市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		61,438,185.88	-	56,831,135.21	-4,607,050.67

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 10 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
（国债期货投资）	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
（外汇期货投资）	-	-	-	-
权益衍生工具	10,844,176.69	-	-	-

（权证投资）	-	-	-	-
（股指期货投资）	10,844,176.69	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	10,844,176.69	-	-	-

项目	上年度末2021年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
（国债期货投资）	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
（外汇期货投资）	-	-	-	-
权益衍生工具	2,077,999.84	-	-	-
（权证投资）	-	-	-	-
（股指期货投资）	2,077,999.84	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,077,999.84	-	-	-

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
HTI2212 HK	HSTECH Futures Dec22	20	2,594,141.20	7,946.84

HTI2211 HK	HSTECH Futures Nov22	62	8,017,430.54	-240,551.79
合计				-232,604.95
减：可抵销期货暂收款				-232,604.95
净额				-

注：在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的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。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内不存在债权投资减值准备计提情况。

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年10月30日	上年度末 2021年12月31日
应收利息	-	891.18
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	891.18

7.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年10月30日	上年度末 2021年12月31日

应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	17,756.08	20,773.38
其中：交易所市场	17,756.08	20,773.38
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
应付审计费	16,601.37	5,000.00
应付信息披露费	41,507.97	5,000.00
应付指数使用费	-	-
应付账户维护费	-	-
应付汇划费	-	-
应付上市费	-	-
应付持有人大会费-公证费	-	-
应付持有人大会费-律师费	-	-
其他	-	-
合计	75,865.42	30,773.38

7.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富恒生科技指数发起（QDII）A		
项目	本期2022年01月01日至2022年10月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	42,356,901.57	42,356,901.57
本期申购	396,457,123.45	396,457,123.45
本期赎回（以“-”号填列）	-161,608,181.32	-161,608,181.32
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	277,205,843.70	277,205,843.70
汇添富恒生科技指数发起（QDII）C		
项目	本期2022年01月01日至2022年10月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	29,642,234.53	29,642,234.53
本期申购	487,645,705.40	487,645,705.40
本期赎回（以“-”	-241,670,672.86	-241,670,672.86

号填列）		
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	275,617,267.07	275,617,267.07

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

汇添富恒生科技指数发起（QDII）A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-237,741.05	-4,637,402.17	-4,875,143.22
本期利润	-6,616,399.32	-59,388,998.05	-66,005,397.37
本期基金份额交易产生的变动数	-7,282,092.14	-58,837,877.78	-66,119,969.92
其中：基金申购款	-13,022,992.05	-98,432,150.19	-111,455,142.24
基金赎回款	5,740,899.91	39,594,272.41	45,335,172.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-14,136,232.51	-122,864,278.00	-137,000,510.51
汇添富恒生科技指数发起（QDII）C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-178,860.55	-3,244,511.01	-3,423,371.56
本期利润	-5,401,495.24	-54,672,305.57	-60,073,800.81
本期基金份额交易产生的变动数	-8,989,241.21	-64,078,504.20	-73,067,745.41
其中：基金申购款	-18,225,731.42	-127,481,034.44	-145,706,765.86
基金赎回款	9,236,490.21	63,402,530.24	72,639,020.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-14,569,597.00	-121,995,320.78	-136,564,917.78

7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年10月30日	上年度可比期间 2021年10月26日（基金合同生效日）至2021年12月31日
活期存款利息收入	53,030.22	3,431.82
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	19,336.54	3,498.10
其他	1,295.88	152.94
合计	73,662.64	7,082.86

注:“其他”为直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

7.4.7.11 股票投资收益

7.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年10月30日	上年度可比期间 2021年10月26日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出股票成交总额	77,637,238.54	106,147.58
减：卖出股票成本总额	84,925,753.62	106,691.73
减：交易费用	969,933.77	-
买卖股票差价收入	-8,258,448.85	-544.15

7.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无基金投资收益。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

7.4.7.14 资产支持证券投资收益

7.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖资产支持证券差价收入。

7.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比区间均无衍生工具买卖权证差价收入。

7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额2022年01月01日至2022年10月30日	上年度可比期间收益金额2021年10月26日（基金合同生效日）至2021年12月31日
国债期货投资收益	-	-
股指期货投资收益	-3,875,011.76	-
外汇期货投资收益	-	-
外汇远期投资收益	-	-

注：本基金上年度可比期间无衍生工具其他投资收益。

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年10月30日	上年度可比期间 2021年10月26日（基金合同生效日）至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,119,942.21	8,886.69
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,119,942.21	8,886.69

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年01月01日至2022年10月30日	上年度可比期间 2021年10月26日（基金合同生效日）至2021年12月31日
1.交易性金融资产	-113,806,827.87	-4,607,050.67
——股票投资	-113,806,827.87	-4,607,050.67
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-

——其他	-	-
2.衍生工具	-254,475.75	21,870.80
——权证投资	-	-
——期货投资	-254,475.75	21,870.80
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-114,061,303.62	-4,585,179.87

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年10月30日	上年度可比期间 2021年10月26日（基金合同生效日）至2021年12月31日
基金赎回费收入	197,355.83	717.97
替代损益	-	-
其他	-	-
合计	197,355.83	717.97

7.4.7.20 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年10月30日	上年度可比期间 2021年10月26日（基金合同生效日）至2021年12月31日
审计费用	16,601.37	5,000.00
信息披露费	41,507.97	5,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	-	-
银行费用	76,260.56	14,254.67
指数使用费	-	-
持有人大会-公证费	-	-
持有人大会-律师费	-	-
开户费	400.00	-
上市费	-	-

其他	11,931.79	137,377.81
合计	146,701.69	161,632.48

7.4.7.22 分部报告

注：本基金目前以一个经营分部运作。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人,基金销售机构,基金注册登记机构,基金发起人
招商银行股份有限公司（"招商银行"）	基金托管人,基金代销机构
香港上海汇丰银行有限公司（The Hong Kong and Shanghai Banking Co. Ltd.）（"汇丰银行"）	境外资产托管人
东方证券股份有限公司（"东方证券"）	基金管理人的股东,基金代销机构
上海上报资产管理有限公司	基金管理人的股东
上海菁聚金投资管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
东航金控有限责任公司	基金管理人的股东
汇添富资本管理有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理（美国）控股有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理（香港）有限公司	基金管理人的全资子公司
东方证券承销保荐有限公司	基金管理人的股东的全资子公司
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批关键管理人员
汇添富投资管理有限公司	基金管理人的全资子公司的全资子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名	本期2022年01月01日至2022年	上年度可比期间2021年10月26日

称	10月30日		（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
东方证券	9,901,544.46	2.11	20,243,130.46	32.84

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

7.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期2022年01月01日至2022年10月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
东方证券	7,921.22	2.78	5,902.82	33.24
关联方名称	上年度可比期间2021年10月26日（基金合同生效日）至2021年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
东方证券	16,194.26	35.09	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间

	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 10 月 30 日	2021 年 10 月 26 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	852,291.54	35,898.88
其中：支付销售机构的客户维护费	278,395.88	9,779.27

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.5%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 10 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 10 月 26 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	170,458.29	7,179.78

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.1%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 10 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	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	合计

招商银行股份有限公司	-	36,028.31	36,028.31
东方证券股份有限公司	-	156.25	156.25
汇添富基金管理股份有限公司	-	14,950.99	14,950.99
合计	-	51,135.55	51,135.55
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间2021年10月26日（基金合同生效日）至2021年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	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	合计
招商银行股份有限公司	-	1,473.98	1,473.98
汇添富基金管理股份有限公司	-	556.55	556.55
合计	-	2,030.53	2,030.53

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.25%。本基金C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.25%年费率计提。

计算方法如下：

H＝E×0.25%÷当年天数

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业

务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

汇添富恒生科技指数发起（QDII）A		
项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 10 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 10 月 26 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2021 年 10 月 26 日）持有的基金份额	-	10,002,400.24
报告期初持有的基金份额	10,002,400.24	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,002,400.24	10,002,400.24
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例（%）	3.61	23.61
汇添富恒生科技指数发起（QDII）C		
项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 10 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 10 月 26 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2021 年 10 月 26 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金	-	-

份额		
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例（%）	-	-

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。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期2022年01月01日至2022年10月30日		上年度可比期间2021年10月26日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	33,037,935.00	52,545.16	6,117,925.20	3,429.37
汇丰银行	348,442.74	485.06	189,626.78	2.45

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期未进行利润分配。于资产负债表日之后、财务报表批准日之前批准、公告或实施的利润分配情况详见资产负债表日后事项章节。

7.4.12 期末（2022年10月30日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末2022年10月30日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末2022年10月30日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：截至本报告期末2022年10月30日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不超过基金资产净值的10%。此外，基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，本基金本报告期末的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法

对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 10 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	33,386,377.74	-	-	-	-	-	33,386,377.74
结算备付金	2,855.77	-	-	-	-	4,834,481.18	4,837,336.95
存出保证金	-	-	-	-	-	2,222,492.66	2,222,492.66
交易性金融资产	-	-	-	-	-	249,744,986.20	249,744,986.20
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	2,298,697.05	2,298,697.05
递延所得税资	-	-	-	-	-	-	-

产							
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	33,389,233.51	-	-	-	-	259,100,657.09	292,489,890.60
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	42.36	42.36
应付赎回款	-	-	-	-	-	12,984,131.76	12,984,131.76
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	118,810.65	118,810.65
应付托管费	-	-	-	-	-	23,762.13	23,762.13
应付销售服务费	-	-	-	-	-	29,595.80	29,595.80
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付	-	-	-	-	-	-	-

利润							
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	75,865.42	75,865.42
负债总计	-	-	-	-	-	13,232,208.12	13,232,208.12
利率敏感度缺口	33,389,233.51	-	-	-	-	245,868,448.97	279,257,682.48
上年度末2021年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	6,307,551.98	-	-	-	-	-	6,307,551.98
结算备付金	-	-	-	-	-	921,976.08	921,976.08
存出保证金	-	-	-	-	-	244,446.42	244,446.42
交易性金融资产	-	-	-	-	-	56,831,135.21	56,831,135.21
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-

应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	891.18	891.18
资产总计	6,307,551.98	-	-	-	-	57,998,448.89	64,306,000.87
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	9.24	9.24
应付赎回款	-	-	-	-	-	543,777.45	543,777.45
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	22,279.23	22,279.23
应付托管费	-	-	-	-	-	4,455.83	4,455.83
应付销售服务	-	-	-	-	-	4,084.42	4,084.42

费							
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	30,773.38	30,773.38
负债总计	-	-	-	-	-	605,379.55	605,379.55
利率敏感度缺口	6,307,551.98	-	-	-	-	57,393,069.34	63,700,621.32

表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末均未持有债券资产及资产支持证券（不含可转换债券及可交换债券），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末2022年10月30日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币				

计价的资产				
银行存款	-	348,443.24	-	348,443.24
结算备付金	-	4,834,481.18	-	4,834,481.18
存出保证金	-	2,222,492.66	-	2,222,492.66
交易性金融资产	-	249,744,986.20	-	249,744,986.20
衍生金融资产	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	257,150,403.28	-	257,150,403.28
以外币计价的负债				
短期借款	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-

应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	257,150,403.28	-	257,150,403.28
项目	上年度末2021年12月31日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	1,893.58	187,734.84	-	189,628.42
结算备付金	-	921,976.08	-	921,976.08
存出保证金	-	244,446.42	-	244,446.42

交易性金融资产	-	56,831,135.21	-	56,831,135.21
衍生金融资产	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	1.05	-	1.05
资产合计	1,893.58	58,185,293.60	-	58,187,187.18
以外币计价的负债				
短期借款	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托	-	-	-	-

管费				
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	1,893.58	58,185,293.60	-	58,187,187.18

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	1.除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑基金管理人为降低汇率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末2022年10月30日	上年度末2021年12月31日
	美元相对人民币升值5%	-	94.68
	美元相对人民币贬值5%	-	-94.68
	港币相对人民币升值5%	12,857,520.16	2,909,264.68
	港币相对人民币贬值5%	-12,857,520.16	-2,909,264.68

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。

本基金管理人通过标准差、跟踪误差、beta 值等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 10 月 30 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	249,744,986.20	89.43	56,831,135.21	89.22
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	249,744,986.20	89.43	56,831,135.21	89.22

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变； 2.以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022 年 10 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	恒生科技指数(汇率调整)上涨 5%	12,816,760.99	2,586,832.85
	恒生科技指数(汇率调整)下跌 5%	-12,816,760.99	-2,586,832.85

注：本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为

市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年10月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	249,744,986.20	56,831,135.21
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	249,744,986.20	56,831,135.21

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

注：本基金本报告期末以及上年度末均不存在第三层次公允价值余额。

7.4.14.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

注：本基金本报告期末以及上年度末均不存在第三层次公允价值余额。

7.4.14.4 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.5 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告（转型后）

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	5,808,459.13	1.47
	其中：普通股	5,808,459.13	1.47
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	356,254,350.00	90.00
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	29,836,848.26	7.54
8	其他各项资产	3,958,119.98	1.00
9	合计	395,857,777.37	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 4,135,318.86 元，占期末净值比例为1.07%。

8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
中国香港	5,808,459.13	1.50
合计	5,808,459.13	1.50

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。

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

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	2,308,198.50	0.60
30 日常消费	-	-
35 医疗保健	-	-
40 金融	65,298.04	0.02
45 信息技术	1,616,670.41	0.42
50 电信服务	1,818,292.18	0.47
55 公用事业	-	-
60 房地产	-	-
合计	5,808,459.13	1.50

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

金额单位：人民币元

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	占基金资产净值比例（%）
1	Kuaishou Technology	快手	1024 HK	香港联	中国香港	8,500	539,468.08	0.14

				合交易所				
2	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股	700 HK	香港联合交易所	中国香港	1,600	477,363.49	0.12
3	Meituan	美团－W	3690 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	468,162.81	0.12
4	Xiaomi Corp	小米集团	1810 HK	香港联合交易所	中国香港	46,600	455,392.62	0.12
5	Alibaba Group Holding Ltd	阿里巴巴	9988 HK	香港联合交易所	中国香港	5,900	454,562.77	0.12
6	JD.com Inc	京东集团	9618 HK	香港联合交易所	中国香港	2,200	432,735.72	0.11
7	JD Health International Inc	京东健康	6618 HK	香港联合交	中国香港	4,450	283,619.92	0.07

				易所				
8	NetEase Inc	网易	9999 HK	香港联合交易所	中国香港	2,700	276,154.42	0.07
9	Semiconductor Manufacturing International Corp	中芯国际	981 HK	香港联合交易所	中国香港	16,500	246,435.33	0.06
10	Baidu Inc	百度	9888 HK	香港联合交易所	中国香港	2,350	234,478.91	0.06
11	Haier Smart Home Co Ltd	海尔智家	6690 HK	香港联合交易所	中国香港	9,800	232,857.62	0.06
12	Sunny Optical Technology Group Co Ltd	舜宇光学科技	2382 HK	香港联合交易所	中国香港	2,800	232,232.33	0.06
13	Kingdee International Software Group Co Ltd	金蝶国际	268 HK	香港联合交易所	中国香港	11,000	164,486.74	0.04

14	Lenovo Group Ltd	联想集团	992 HK	香港联合交易所	中国香港	28,000	160,324.10	0.04
15	Bilibili Inc	哔哩哔哩	9626 HK	香港联合交易所	中国香港	920	153,513.81	0.04
16	Li Auto Inc	理想汽车	2015 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	137,206.27	0.04
17	Alibaba Health Information Technology Ltd	阿里健康	241 HK	香港联合交易所	中国香港	22,000	130,685.40	0.03
18	SenseTime Group Inc	商汤集团股份有限公司	20 HK	香港联合交易所	中国香港	60,000	118,983.56	0.03
19	Kingsoft Corp Ltd	金山软件	3888 HK	香港联合交易所	中国香港	3,800	88,594.52	0.02
20	Trip.com Group Ltd	携程集团	9961 HK	香港	中国香港	350	85,539.54	0.02

				联合交易所				
21	Hua Hong Semiconductor Ltd	华虹半导体	1347 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	73,024.82	0.02
22	BYD Electronic International Co Ltd	比亚迪电子	285 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	67,263.23	0.02
23	ZhongAn Online P&C Insurance Co Ltd	众安在线	6060 HK	香港联合交易所	中国香港	3,400	65,298.04	0.02
24	China Literature Ltd	阅文集团	772 HK	香港联合交易所	中国香港	1,800	48,718.95	0.01
25	AAC Technologies Holdings Inc	瑞声科技	2018 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	47,807.81	0.01
26	Ping An Healthcare and Technology Co Ltd	平安好医生	1833 HK	香港联合	中国香港	2,000	38,053.30	0.01

				交易所				
27	XPeng Inc	小鹏汽车	9868 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	34,256.90	0.01
28	GDS Holdings Ltd	万国数据	9698 HK	香港联合交易所	中国香港	1,400	25,636.85	0.01
29	Ming Yuan Cloud Group Holdings Ltd	明源云	909 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	25,083.02	0.01
30	NIO Inc	蔚来汽车	9866 HK	香港联合交易所	中国香港	150	10,518.25	0.00

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

8.5.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

注：本基金本报告期无买入权益投资。

8.5.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	Xiaomi Corp	1810 HK	25,577,528.19	6.61

2	Tencent Holdings Ltd	700 HK	23,419,765.84	6.06
3	Meituan	3690 HK	23,231,500.83	6.01
4	JD.com Inc	9618 HK	22,101,314.42	5.71
5	Alibaba Group Holding Ltd	9988 HK	21,997,745.27	5.69
6	Kuaishou Technology	1024 HK	20,064,146.79	5.19
7	Semiconductor Manufacturing International Corp	981 HK	17,678,578.69	4.57
8	NetEase Inc	9999 HK	16,517,333.21	4.27
9	JD Health International Inc	6618 HK	14,808,195.39	3.83
10	Sunny Optical Technology Group Co Ltd	2382 HK	14,123,206.53	3.65
11	Haier Smart Home Co Ltd	6690 HK	13,023,662.36	3.37
12	Baidu Inc	9888 HK	11,792,732.11	3.05
13	Lenovo Group Ltd	992 HK	10,774,242.70	2.79
14	Kingdee International Software Group Co Ltd	268 HK	8,757,549.45	2.26
15	Alibaba Health Information Technology Ltd	241 HK	6,009,535.19	1.55
16	Li Auto Inc	2015 HK	5,849,019.99	1.51
17	Kingsoft Corp Ltd	3888 HK	5,457,832.50	1.41
18	SenseTime Group Inc	20 HK	5,194,505.00	1.34
19	BYD Electronic International Co Ltd	285 HK	4,289,069.59	1.11
20	Trip.com Group Ltd	9961 HK	4,274,198.12	1.11

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	-
卖出收入（成交）总额	296,240,802.75

注："买入成本"、"卖出收入"均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

8.9 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

金额单位：人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	期货品种_指数	HSTECH Futures Jan23	-	-

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

HTI2301 HSTECH Futures Jan23　20　3,727,826.03　-25,279.54

公允价值变动总额合计　-25,279.54

期货投资本期收益　3,748,316.37

期货投资本期公允价值变动　207,325.41

8.10 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

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	汇添富恒生科技ETF(QDII)	股票型	交易型开放式	汇添富基金管理股份有限公	356,254,350.00	92.12

				司		

8.11 投资组合报告附注

8.11.1

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。

8.11.2

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。

8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	674,868.25
2	应收清算款	303,659.90
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,979,591.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,958,119.98

8.11.4 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。

8.11.5 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。

§8 投资组合报告（转型前）

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	249,744,986.20	85.39
	其中：普通股	249,744,986.20	85.39
	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	38,223,714.69	13.07
8	其他各项资产	4,521,189.71	1.55
9	合计	292,489,890.60	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 180,530,106.54 元，占期末净值比例为64.65%。

8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
中国香港	249,744,986.20	89.43
合计	249,744,986.20	89.43

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。

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

8.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

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	96,160,228.40	34.43
30 日常消费	-	-

35 医疗保健	-	-
40 金融	2,905,854.67	1.04
45 信息技术	83,226,747.89	29.80
50 电信服务	67,452,155.24	24.15
55 公用事业	-	-
60 房地产	-	-
合计	249,744,986.20	89.43

8.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

注：本报告期末未持有积极投资。

8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

8.4.1 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所有权益投资明细

金额单位：人民币元

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	占基金资产净值比例（%）
1	Xiaomi Corp	小米集团	1810 HK	香港联合交易所	中国香港	2,889,200	23,012,794.66	8.24
2	Meituan	美团－W	3690 HK	香港联合交易所	中国香港	177,100	19,703,397.58	7.06
3	Alibaba Group Holding Ltd	阿里巴巴	9988 HK	香港联合交易	中国香港	344,200	19,414,360.92	6.95

				所				
4	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股	700 HK	香港联合交易所	中国香港	101,200	18,561,774.49	6.65
5	JD.com Inc	京东集团	9618 HK	香港联合交易所	中国香港	132,650	17,763,007.36	6.36
6	Semiconductor Manufacturing International Corp	中芯国际	981 HK	香港联合交易所	中国香港	1,153,500	16,963,628.23	6.07
7	Kuaishou Technology	快手	1024 HK	香港联合交易所	中国香港	481,800	14,434,970.83	5.17
8	NetEase Inc	网易	9999 HK	香港联合交易所	中国香港	185,000	14,355,237.52	5.14
9	Haier Smart Home Co Ltd	海尔智家	6690 HK	香港联合交易所	中国香港	628,600	11,742,023.90	4.20
10	Sunny Optical	舜宇	2382	香	中国	183,900	11,347,033.94	4.06

	Technology Group Co Ltd	光学科技	HK	港联合交易所	香港			
11	JD Health International Inc	京东健康	6618 HK	香港联合交易所	中国香港	286,950	11,074,094.20	3.97
12	Baidu Inc	百度	9888 HK	香港联合交易所	中国香港	150,900	10,434,229.64	3.74
13	Lenovo Group Ltd	联想集团	992 HK	香港联合交易所	中国香港	1,864,000	10,317,959.13	3.69
14	Kingdee International Software Group Co Ltd	金蝶国际	268 HK	香港联合交易所	中国香港	717,000	7,741,264.44	2.77
15	Kingsoft Corp Ltd	金山软件	3888 HK	香港联合交易所	中国香港	247,400	5,186,300.26	1.86
16	Li Auto Inc	理想汽车	2015 HK	香港联	中国香港	98,500	4,831,542.31	1.73

				合交易所				
17	Alibaba Health Information Technology Ltd	阿里健康	241 HK	香港联合交易所	中国香港	1,394,000	4,316,559.61	1.55
18	SenseTime Group Inc	商汤集团股份有限公司	20 HK	香港联合交易所	中国香港	3,457,000	3,757,695.74	1.35
19	BYD Electronic International Co Ltd	比亚迪电子	285 HK	香港联合交易所	中国香港	203,500	3,736,248.40	1.34
20	Trip.com Group Ltd	携程集团	9961 HK	香港联合交易所	中国香港	22,750	3,628,280.97	1.30
21	ZhongAn Online P&C Insurance Co Ltd	众安在线	6060 HK	香港联合交易所	中国香港	219,700	2,905,854.67	1.04
22	Hua Hong Semiconductor Ltd	华虹半导体	1347 HK	香港联合交	中国香港	151,000	2,548,908.15	0.91

				易所				
23	China Literature Ltd	阅文集团	772 HK	香港联合交易所	中国香港	118,800	2,257,122.07	0.81
24	Bilibili Inc	哔哩哔哩	9626 HK	香港联合交易所	中国香港	35,340	2,222,520.43	0.80
25	AAC Technologies Holdings Inc	瑞声科技	2018 HK	香港联合交易所	中国香港	187,000	2,186,386.05	0.78
26	Ping An Healthcare and Technology Co Ltd	平安好医生	1833 HK	香港联合交易所	中国香港	129,900	1,720,491.08	0.62
27	XPeng Inc	小鹏汽车	9868 HK	香港联合交易所	中国香港	54,400	1,291,955.39	0.46
28	Ming Yuan Cloud Group Holdings Ltd	明源云	909 HK	香港联合交易所	中国香港	255,000	892,101.41	0.32

29	GDS Holdings Ltd	万国数据	9698 HK	香港联合交易所	中国香港	79,600	722,727.74	0.26
30	NIO Inc	蔚来汽车	9866 HK	香港联合交易所	中国香港	10,040	674,515.08	0.24

8.4.2 积极投资期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

8.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Xiaomi Corp	1810 HK	31,205,640.32	48.99
2	Meituan	3690 HK	30,535,133.43	47.94
3	Alibaba Group Holding Ltd	9988 HK	29,980,025.06	47.06
4	Kuaishou Technology	1024 HK	29,929,986.07	46.99
5	Tencent Holdings Ltd	700 HK	29,415,461.89	46.18
6	JD.com Inc	9618 HK	28,369,045.01	44.53
7	NetEase Inc	9999 HK	22,564,822.23	35.42
8	Sunny Optical Technology Group Co Ltd	2382 HK	22,311,863.53	35.03
9	Semiconductor Manufacturing International Corp	981 HK	18,456,342.28	28.97

10	Baidu Inc	9888 HK	17,900,208.18	28.10
11	Haier Smart Home Co Ltd	6690 HK	15,595,678.84	24.48
12	JD Health International Inc	6618 HK	14,621,507.07	22.95
13	Lenovo Group Ltd	992 HK	12,779,598.52	20.06
14	Li Auto Inc	2015 HK	12,038,865.19	18.90
15	Kingdee International Software Group Co Ltd	268 HK	9,799,537.88	15.38
16	SenseTime Group Inc	20 HK	8,460,419.52	13.28
17	Kingsoft Corp Ltd	3888 HK	5,789,321.96	9.09
18	Alibaba Health Information Technology Ltd	241 HK	5,747,695.74	9.02
19	Bilibili Inc	9626 HK	5,546,066.25	8.71
20	XPeng Inc	9868 HK	4,707,742.22	7.39
21	ZhongAn Online P&C Insurance Co Ltd	6060 HK	4,613,477.52	7.24
22	BYD Electronic International Co Ltd	285 HK	4,002,704.24	6.28
23	Hua Hong Semiconductor Ltd	1347 HK	3,992,587.37	6.27
24	Trip.com Group Ltd	9961 HK	3,829,321.35	6.01
25	China Literature Ltd	772 HK	3,737,704.49	5.87
26	AAC Technologies Holdings Inc	2018 HK	3,095,716.90	4.86
27	Ping An Healthcare and Technology Co Ltd	1833 HK	2,613,493.01	4.10
28	ASMPT Ltd	522 HK	2,403,229.32	3.77
29	Ming Yuan Cloud Group Holdings Ltd	909 HK	2,334,334.10	3.66
30	NIO Inc	9866 HK	2,080,937.31	3.27
31	GDS Holdings Ltd	9698 HK	1,945,886.23	3.05

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

8.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Meituan	3690 HK	8,918,904.20	14.00
2	JD.com Inc	9618 HK	6,371,573.37	10.00
3	Alibaba Group Holding Ltd	9988 HK	6,046,297.49	9.49
4	Kuaishou Technology	1024 HK	5,631,907.83	8.84
5	Sunny Optical Technology Group Co Ltd	2382 HK	4,976,052.36	7.81
6	Semiconductor Manufacturing International Corp	981 HK	4,074,986.36	6.40
7	Xiaomi Corp	1810 HK	3,724,367.39	5.85
8	JD Health International Inc	6618 HK	3,555,329.49	5.58
9	Haier Smart Home Co Ltd	6690 HK	3,507,791.73	5.51
10	Tencent Holdings Ltd	700 HK	3,382,507.24	5.31
11	NetEase Inc	9999 HK	3,359,136.82	5.27
12	ASMPT Ltd	522 HK	2,978,277.53	4.68
13	Li Auto Inc	2015 HK	2,897,687.96	4.55
14	Lenovo Group Ltd	992 HK	2,816,633.70	4.42
15	Baidu Inc	9888 HK	1,548,106.86	2.43
16	Kingdee International Software Group Co Ltd	268 HK	1,385,783.84	2.18
17	Tongcheng Travel Holdings Ltd	780 HK	1,323,764.38	2.08
18	SenseTime Group Inc	20 HK	1,152,565.79	1.81
19	BYD Electronic International Co Ltd	285 HK	948,899.56	1.49
20	Kingsoft Corp Ltd	3888 HK	945,026.68	1.48

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	391,646,432.48
卖出收入（成交）总额	77,637,238.54

注："买入成本"、"卖出收入"均按买入或卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

8.9 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

金额单位：人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	期货品种_指数	HSTECH Futures Dec22	-	-
2	期货品种_指数	HSTECH Futures Nov22	-	-

代码	名称	持仓量（买/卖）（单位：手）	合约市值	公允价值变动
HTI2212	HSTECH Futures Dec22	20	2,594,141.20	7,946.84
HTI2211	HSTECH Futures Nov22	62	8,017,430.54	-240,551.79

公允价值变动总额合计 -232,604.95

期货投资本期收益 -3,875,011.76

期货投资本期公允价值变动 -254,475.75

8.10 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。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1

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。

8.11.2

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。

8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,222,492.66
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,298,697.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,521,189.71

8.11.4 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。

8.11.5 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。

§9 基金份额持有人信息（转型后）

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
汇添富恒生科技ETF联接发起式（QDII）	6,128	51,734.45	10,651,718.49	3.36	306,376,975.31	96.64

A						
汇添富恒生科技ETF联接发起式（QDII）C	9,588	25,739.11	7,290,630.07	2.95	239,495,986.43	97.05
合计	15,716	35,875.24	17,942,348.56	3.18	545,872,961.74	96.82

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	汇添富恒生科技ETF联接发起式（QDII）A	19,516,182.65	6.16
	汇添富恒生科技ETF联接发起式（QDII）C	266,344.81	0.11
	合计	19,782,527.46	3.51

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	汇添富恒生科技ETF联接发起式（QDII）A	>100
	汇添富恒生科技ETF联接发起式（QDII）C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富恒生科技ETF联接发起式（QDII）A	0
	汇添富恒生科技ETF联接发起式（QDII）C	0
	合计	0

9.4 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	1.77	10,002,400.24	1.77	3年

基金管理人高级管理人员	14,585,576.47	2.59	-	-	
基金经理等人员	-	-	-	-	
基金管理人股东	-	-	-	-	
其他	5,196,950.99	0.92	-	-	
合计	29,784,927.70	5.28	10,002,400.24	1.77	

§9 基金份额持有人信息（转型前）

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
汇添富恒生科技指数发起（QDII）A	6,170	44,928.01	10,002,400.24	3.61	267,203,443.46	96.39
汇添富恒生科技指数发起（QDII）C	9,996	27,572.76	768,814.34	0.28	274,848,452.73	99.72
合计	16,166	34,196.65	10,771,214.58	1.95	542,051,896.19	98.05

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	汇添富恒生科技指数发起（QDII）A	10,509,242.54	3.79
	汇添富恒生科技指数发起（QDII）C	264,932.08	0.10
	合计	10,774,174.62	1.95

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	汇添富恒生科技指数发起（QDII）A	>100
	汇添富恒生科技指数发起（QDII）C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富恒生科技指数发起（QDII）A	0
	汇添富恒生科技指数发起（QDII）C	0
	合计	0

9.4 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	1.81	10,002,400.24	1.81	3 年
基金管理人高级管理人员	7,576,885.69	1.37	-	-	
基金经理等人员	-	-	-	-	
基金管理人股东	-	-	-	-	
其他	3,197,288.93	0.58	-	-	
合计	20,776,574.86	3.76	10,002,400.24	1.81	

§10 开放式基金份额变动（转型后）

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
基金合同生效日（2022 年 10 月 31 日）基金份额总额	277,205,843.70	275,617,267.07
基金合同生效日起至	113,208,604.65	191,764,171.03

报告期期末基金总申购份额		
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	73,385,754.55	220,594,821.60
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	317,028,693.80	246,786,616.50

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。

§10 开放式基金份额变动（转型前）

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
本报告期期初基金份额总额	42,356,901.57	29,642,234.53
本报告期基金总申购份额	396,457,123.45	487,645,705.40
减：本报告期基金总赎回份额	161,608,181.32	241,670,672.86
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	277,205,843.70	275,617,267.07

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。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

自 2022 年 07 月 15 日起，孙乐女士担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

2022 年 10 月 31 日原“汇添富恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）”转型为“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）”。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）的投资策略请详见 2022 年 10 月 31 日刊登在本公司网站的《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》。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）自本基金合同生效日起至本报告期末，为本基金进行审计。本报告期内应付未付的审计费用为人民币 20,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人及相关高级管理人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2022 年 08 月 04 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局
受到的具体措施类型	警示函行政监管措施
受到稽查或处罚等措施的原因	对某单一资管计划投资者，未及时提供信息

	披露文件
管理人采取整改措施的情况	公司已完成整改并通过监管验收
其他	无

注：报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查、处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	佣金	占当期佣金总量的比例（%）	
东方证券	2	195,426,615.92	65.97	156,341.14	79.61	
Sanford C. Bernstein	-	81,211,758.51	27.41	24,363.57	12.41	
天风证券	2	19,602,428.29	6.62	15,681.93	7.99	
安信证券	2	-	-	-	-	
财达证券	2	-	-	-	-	
德邦证券	2	-	-	-	-	
东北证券	2	-	-	-	-	
东方财富	2	-	-	-	-	
高盛高华	2	-	-	-	-	
广发证券	4	-	-	-	-	
国金证券	2	-	-	-	-	
国泰君安	2	-	-	-	-	
国信证券	2	-	-	-	-	
海通证券	2	-	-	-	-	
开源证券	2	-	-	-	-	
申万宏源证券	2	-	-	-	-	
招商证券	2	-	-	-	-	
中信建投证券	2	-	-	-	-	
中信证券	2	-	-	-	-	

中原证券	2	-	-	-	-	

注:此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例（%）	成交金额	占当期权证成交总额的比例（%）	成交金额	占当期基金成交总额的比例（%）
东方证券	3,004,755.00	100.00	-	-	-	-	36,695,386.70	100.00
Sanford C. Bernstein	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-	-	-
高盛高华	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序：

（1）基金交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。

（2）交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。

（3）投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例，并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整，使得总的交易量的分配符合综合排名，同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的30%。

（4）每半年综合考虑近半年及最新的评分情况，作为增加或更换券商交易单元的依据。

（5）调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定，投资总监审批。

（6）成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成；更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。

（7）调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用，基金会计应负责协助及时催缴。

（8）按照《关于基金管理公司向会员租用交易单元有关事项的通知》规定，同一基金管理公司托管在同一托管银行的基金可以共用同一交易单元进行交易。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	佣金	占当期佣金总量的比例（%）	
Sanford C. Bernstein	-	125,986,751.71	26.85	37,796.20	13.28	
广发证券	4	115,905,013.04	24.70	82,793.17	29.09	
开源证券	2	48,536,632.18	10.34	38,829.38	13.64	
东方财富	2	47,394,849.43	10.10	23,697.26	8.33	

东北证券	2	30,606,933.46	6.52	24,485.67	8.60	
国泰君安	2	22,821,649.80	4.86	18,257.35	6.41	
国信证券	2	16,168,639.99	3.45	12,934.94	4.54	
安信证券	2	14,931,282.21	3.18	11,945.15	4.20	
中信证券	2	12,049,073.63	2.57	9,639.20	3.39	
东方证券	2	9,901,544.46	2.11	7,921.22	2.78	
天风证券	2	8,389,344.00	1.79	6,711.34	2.36	
JPMorgan Securities	-	6,889,069.11	1.47	2,066.75	0.73	
CICC Hong Kong Securities	-	3,923,129.11	0.84	3,923.15	1.38	
国金证券	2	3,769,676.81	0.80	3,015.76	1.06	
Jefferies International	-	2,010,082.05	0.43	603.02	0.21	
财达证券	2	-	-	-	-	
德邦证券	2	-	-	-	-	
高盛高华	2	-	-	-	-	
海通证券	2	-	-	-	-	
申万宏源证券	2	-	-	-	-	
招商证券	2	-	-	-	-	
中信建投证券	2	-	-	-	-	
中原证券	2	-	-	-	-	

注:此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例（%）	成交金额	占当期权证成交总额的比例（%）	成交金额	占当期基金成交总额的比例（%）
Sanford C. Bernstein	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-

国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
JPMorgan Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
CICC Hong Kong Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
Jefferies International	-	-	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高盛高华	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序：

（1）基金交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。

（2）交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。

（3）投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例，并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整，使得总的交易量的分配符合综合排名，同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的30%。

（4）每半年综合考虑近半年及最新的评分情况，作为增加或更换券商交易单元的依据。

（5）调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定，投资总监审批。

（6）成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成；更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。

（7）调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用，基金会计应负责协助及时催缴。

（8）按照《关于基金管理公司向会员租用交易单元有关事项的通知》规定，同一基金管理公司托管在同一托管银行的基金可以共用同一交易单元进行交易。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

11.8 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于汇添富恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）转型为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）并修订法律文件的公告	中证报,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2022年10月31日
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）法律文件	公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2022年10月31日
3	关于汇添富基金管理股份有限公司调整旗下部分基金申购起点金额、最低赎回份额、最低保留份额及单笔最低转换份额的公告	上交所,上证报,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2022年12月12日
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新招募说明书	上交所,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2022年12月12日
5	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金2023年非港股通交易日暂停申购、赎回等业务的公告	上证报,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2022年12月31日

11.8 其他重大事件（转型前）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	上交所,上证报,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2022年01月01日
2	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金2021年第4季度报告	上交所,上证报,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2022年01月24日
3	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金2021年年度报告	上交所,上证报,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网	2022年03月31日

		站	
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新招募说明书及基金产品资料概要	上交所,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2022年04月21日
5	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金2022年第一季度报告	上交所,上证报,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2022年04月22日
6	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金2022年第二季度报告	上交所,上证报,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2022年07月21日
7	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金2022年中期报告	上交所,上证报,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2022年08月31日
8	关于防范不法分子冒用汇添富基金名义进行非法活动的重要提示	公司网站	2022年09月21日
9	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金2022年第三季度报告	上交所,上证报,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2022年10月26日

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 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、《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》；

5、《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》；

6、基金管理人业务资格批件、营业执照；

7、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；

8、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；

9、中国证监会要求的其他文件。

13.2 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

13.3 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03月31日