

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）2022 年第 4 季度 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2023 年 01 月 20 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 1 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 10 月 01 日起至 2022 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	汇添富恒生香港上市生物科技 ETF
场内简称	港股生物
基金主代码	513280
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2022 年 07 月 05 日
报告期末基金份额总额(份)	134,114,457.00
投资	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

目标	
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香港上市生物科技指数收益率
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。
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
境外资产托管人	英文名称: JPMorgan Chase & Co
	中文名称: 摩根大通

注：扩位证券简称：港股生物科技 ETF。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2022年10月01日 - 2022年12月31日)
1. 本期已实现收益	-1,717,056.34
2. 本期利润	46,483,117.16
3. 加权平均基金份额本期利润	0.2675
4. 期末基金资产净值	135,325,461.69
5. 期末基金份额净值	1.0090

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收

益)扣除相关费用和信用减值损失后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

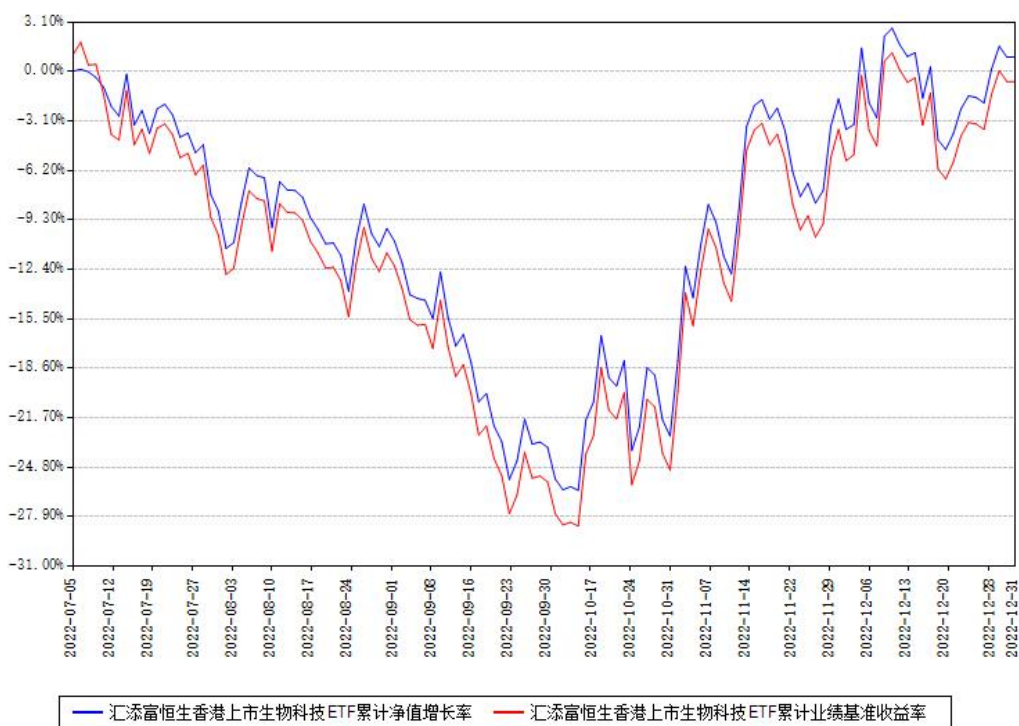
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	31.98%	2.87%	33.75%	3.04%	-1.77%	-0.17%
自基金合同生效日起至今	0.90%	2.42%	-0.63%	2.58%	1.53%	-0.16%

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

汇添富恒生香港上市生物科技ETF累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：1、本《基金合同》生效之日为 2022 年 07 月 05 日，截至本报告期末，基金成立未
满一年。

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

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年 限（年）	说明
		任职日期	离任日期		
赖中立	本基金的基 金经理	2022 年 07 月 05 日		15	国籍：中国。 学历：北京 大学中国经 济研究中心 金融学硕士。 从业资格： 证券投资基 金从业资格。 从业经历： 曾任泰达宏 利基金管理 有限公司风 险管理分析 师。2010 年 8 月加入汇 添富基金管 理股份有限 公司，历任 金融工程部 分析师、基 金经理助理。 2012 年 11 月 1 日至今 任汇添富黄 金及贵金属 证券投资基 金 (LOF) 的基 金经理。 2014 年 3 月 6 日至今任 汇添富恒生 指数型证券

					<p>投资基金 (QDII- LOF) 的基金 经理。2015 年 1 月 6 日 至今任汇添 富深证 300 交易型开放 式指数证券 投资基金联 接基金的基 金经理。 2015 年 1 月 6 日至今任 深证 300 交 易型开放式 指数证券投 资基金的基 金经理。 2015 年 5 月 26 日至 2016 年 7 月 13 日 任汇添富香 港优势精选 混合型证券 投资基金的 基金经理。 2016 年 12 月 29 日至今 任汇添富中 证环境治理 指数型证券 投资基金 (LOF) 的基 金经理。 2017 年 5 月 18 日至今任 汇添富优选 回报灵活配 置混合型证 券投资基金 的基金经理。 2017 年 11 月 24 日至今 任汇添富中 证港股通高</p>
--	--	--	--	--	--

					<p>股息投资指数发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。</p> <p>2021 年 10 月 26 日至今任汇添富中证沪港深消费龙头指数发起式证券投资基金的基金经理。</p> <p>2021 年 10 月 26 日至今任汇添富中证光伏产业指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。</p> <p>2022 年 3 月 29 日至今任汇添富中证科创创业 50 指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。</p> <p>2022 年 7 月 5 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。</p>
乐无穹	本基金的基金经理	2022 年 12 月 07 日		8	<p>国籍：中国。</p> <p>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</p>

					<p>业经历：</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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</p>
--	--	--	--	--	---

					<p>深互联网交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2021 年 7 月 27 日至今任汇添富中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2021 年 9 月 27 日至今任汇添富中证沪港深科技龙头交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月 29 日至今任汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 9 月 29 日至今任汇添富中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金的基金经理。2021 年 10 月 26 日至 2022 年 10 月 30 日任汇添富恒生科技指数型发起式证券投资基金 (QDII)</p>
--	--	--	--	--	---

					<p>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</p>
--	--	--	--	--	--

					<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
--	--	--	--	--	---

注:1、基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期;

2、非首任基金经理,其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期;

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：截至本报告期末，本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的成员简介

注： 本基金无境外投资顾问。

4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本基金管理人在本报告期内遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金无重大违法、违规行为，本基金投资运作符合有关法规及基金合同的约定。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式，确保公平交易制度的执行和实现。具体情况如下：

一、本基金管理人建立了内部公平交易管理规范 and 流程，以确保公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种及投资管理的各个环节。

二、本着“时间优先、价格优先”的原则，对同一证券有相同交易需求的投资组合采用交易系统内的公平交易模块，实现事中交易执行层面的公平管控。

三、对不同投资组合进行同向交易价差分析，具体方法为：在不同时间窗口（日内、3 日内、5 日内）下，对不同组合同一证券同向交易的平均价差率进行 T 检验。对于未通过 T 检验的交易，再根据同向交易占比、交易价格、交易频率、交易数量和交易时间等进行具体分析，进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

四、对于反向交易，根据交易顺序、交易时间窗口跨度、交易价格、交易数量占市场成交量比值、组合规模、市场收益率变化等综合判断交易是否涉及利益输送。

综上，本基金管理人通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估，严格执行了公平交易制度，公平对待了旗下各投资组合。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 8 次，投资组合因投资策略与

其他组合发生反向交易。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控，事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2022 年四季度市场主要指数震荡反弹，行业方面，消费、传媒、医药等前期大幅回调的板块上涨明显，周期、成长板块下跌，能源中的石油石化、煤炭是四季度下跌最多的一级行业。四季度的反弹始于极度悲观情绪的修复，叠加防控政策的变化，市场预期反应走在前，因此出现了政策明确转变后，板块冲高回落的特征，12 月后半月行业较普遍回调。

海外在连续快速加息后，转为经济衰退预期，叠加欧洲超预期的暖冬天气，油价、天然气价格大幅回落，通胀指标有所缓解。海外市场分析预期美联储加息将持续至 2023 年年中，利率水平预期仍将维持高位。利率水平的上升，使得全球未来经济增长预期有所下调，汇率波动有所加剧，成长股面临增长和估值的双重压力。国内通胀水平稳定，也给了国内较好的流动性和利率水平的空间，经济周期的时差效应，使得稳增长政策可以继续出台。四季度货币政策例会强调经济三重压力，货币发力、财政兜底或将成为 2023 年宏观格局。11 月以来，收益率曲线扁平、利率债和信用债普遍回调，说明市场对货币政策在 2023 年逐步退出宽松有所预期。

医药在四季度反弹幅度在一级行业里靠前，整体反弹超 10%，估值有所修复。四季度的医药反弹，主要是由于前期大幅回调对行业负面信息的充分消化，以及后疫情时代自我健康管理催生的“防疫工具包”需求增加。2023 年，A 股医药反弹值得重视；细分领域，“中药”和“生物科技”代表的“中”、“西”依然是近 10 年来医药内部分化的两条主线，投资价值不容忽视。尤其是生物科技所面临的医药消费需求恢复，以及创新药逐渐脱离资本驱动，向着原创型创新发展，都给予生物科技在 2023 年较强的业绩支撑。

报告期内，本基金按照基金合同，按照完全复制法进行指数化投资，严控基金跟踪误差，以为投资者带来与跟踪指数一致的收益。

本基金本报告期基金份额净值增长率为 31.98%。同期业绩比较基准收益率为 33.75%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额 (人民币元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	127,951,587.93	92.38
	其中：普通股	127,951,587.93	92.38
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售 金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	7,241,864.14	5.23
8	其他资产	3,314,377.78	2.39
9	合计	138,507,829.85	100.00

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
中国香港	127,951,587.93	94.55
合计	127,951,587.93	94.55

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

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

5.3.1 报告期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
10 能源	-	-
15 原材料	-	-
20 工业	-	-
25 可选消费	16,532,210.16	12.22
30 日常消费	-	-
35 医疗保健	111,419,377.77	82.33
40 金融	-	-
45 信息技术	-	-
50 电信服务	-	-
55 公用事业	-	-
60 房地产	-	-
合计	127,951,587.93	94.55

5.3.2 报告期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

注：本报告期末未持有积极投资。

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

5.4.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	Wuxi Biologics	药明生物	2269 HK	香港联合交易所	中国香港	272,000	14,541,720.98	10.75

	Cayman Inc							
2	JD Health Intern ationa l Inc	京东健 康	6618 HK	香港联 合交易 所	中国香 港	179,05 0	11,411 ,718.5 4	8.43
3	CSPC Pharma ceutic al Group Ltd	石药集 团	1093 HK	香港联 合交易 所	中国香 港	1,362, 000	9,976, 396.67	7.37
4	Sino Biopha rmaceu tical Ltd	中国生 物制药	1177 HK	香港联 合交易 所	中国香 港	1,816, 000	7,413, 354.92	5.48
5	Innove nt Biolog ics Inc	信达生 物	1801 HK	香港联 合交易 所	中国香 港	208,00 0	6,224, 305.36	4.60
6	Alibab a Health Inform ation Techno	阿里健 康	241 HK	香港联 合交易 所	中国香 港	862,00 0	5,120, 491.62	3.78

	logy Ltd							
7	Genscr ipt Biotec h Corp	金斯瑞 生物科 技	1548 HK	香港联 合交易 所	中国香 港	216,00 0	4,794, 716.05	3.54
8	Shando ng Weigao Group Medica l Polyme r Co Ltd	威高股 份	1066 HK	香港联 合交易 所	中国香 港	399,20 0	4,571, 527.18	3.38
9	WuXi AppTec Co Ltd	药明康 德	2359 HK	香港联 合交易 所	中国香 港	56,900	4,190, 691.34	3.10
10	Sinoph arm Group Co Ltd	国药控 股	1099 HK	香港联 合交易 所	中国香 港	214,80 0	3,806, 788.02	2.81

5.4.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票及存托凭证投资明细

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

注： 本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

注： 本基金本报告期末未持有基金投资。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国人民银行及其派出机构、中国银保监会及其派出机构、中国证监会及其派出机构、国家市场监督管理总局及机关单位、交易所立案调查，或在报告编制日前一年内收到公开谴责、处罚的情况。

5.10.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	3,314,377.78
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,314,377.78

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	198,114,457.00
本报告期基金总申购份额	9,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	73,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	134,114,457.00

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准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）募集的文件；
- 2、《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）基金合同》；
- 3、《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）托管协议》；

4、基金管理人业务资格批件、营业执照；

5、报告期内汇添富恒生香港上市生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）在
规定报刊上披露的各项公告；

6、中国证监会要求的其他文件。

9.2 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

9.3 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 01 月 20 日