

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)2023年中期报 告

2023年06月30日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2023年08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。本中期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 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 06 月 30 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	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人	7
2.5 信息披露方式	7
2.6 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的成员简介	15
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
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	16
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
4.9 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	18
§ 5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	18
5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	18
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表	18
6.2 利润表	20
6.3 净资产（基金净值）变动表	21
6.4 报表附注	22
§ 7 投资组合报告	51
7.1 期末基金资产组合情况	51
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	51
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	52
7.4 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	52
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	56
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	59
7.7 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	59

7.8 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.....	59
7.9 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.....	59
7.10 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.....	59
7.11 投资组合报告附注.....	60
§ 8 基金份额持有人信息.....	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	60
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	61
8.3 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.....	61
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	62
§ 9 开放式基金份额变动.....	62
§ 10 重大事件揭示.....	62
10.1 基金份额持有人大会决议.....	63
10.2 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.....	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	63
10.4 基金投资策略的改变.....	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	63
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	63
10.8 其他重大事件.....	66
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	66
11.1 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.....	66
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	66
§ 12 备查文件目录.....	66
12.1 备查文件目录.....	67
12.2 存放地点.....	67
12.3 查阅方式.....	67

§ 2 基金简介

2.1 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)	809,948,323.24	
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)	355,297,434.01	454,650,889.23

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

2.2 基金产品说明

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	<p>本基金为汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 的联接基金, 其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金通过投资目标 ETF, 紧密跟踪标的指数, 具有与标的指数相似的风险收益特征。</p> <p>本基金主要投资于境外证券市场, 除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外, 本基金还将面临汇率风险、境外证券市场风险等特殊投资风险。</p>

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	<p>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。</p>
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	<p>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。</p> <p>本基金主要投资于境外证券市场, 除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外, 本基金还将面临汇率风险、境外证券市场风险等特殊投资风险。</p>

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
	联系电话	021-28932888
	电子邮箱	service@99fund.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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金中期报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 01 月 01 日 - 2023 年 06 月 30 日)	
	汇添富恒生科技 ETF 联接发起式 (QDII) A	汇添富恒生科技 ETF 联接发起式 (QDII) C
本期已实现收益	5,925,080.68	5,384,040.65
本期利润	-1,506,798.65	-2,721,591.00
加权平均基金份额本期利润	-0.0044	-0.0069
本期加权平均净值利	-0.66%	-1.03%

润率		
本期基金份额净值增长率	-2.77%	-2.86%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023 年 06 月 30 日)	
期末可供分配利润	-118,042,572.67	-152,229,348.97
期末可供分配基金份额利润	-0.3322	-0.3348
期末基金资产净值	237,254,861.34	302,421,540.26
期末基金份额净值	0.6678	0.6652
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023 年 06 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	32.03%	31.85%

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

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
过去一个月	9.31%	1.90%	9.52%	1.92%	-0.21%	-0.02%
过去三个月	-3.97%	1.64%	-4.03%	1.67%	0.06%	-0.03%
过去六个月	-2.77%	1.94%	-1.99%	1.97%	-0.78%	-0.03%
自基金合同生效日起至今	32.03%	2.40%	37.90%	2.48%	-5.87%	-0.08%

汇添富恒生科技ETF联接发起式(QDII)C						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	9.28%	1.90%	9.52%	1.92%	-0.24%	-0.02%
过去三个月	-4.04%	1.64%	-4.03%	1.67%	-0.01%	-0.03%
过去六个月	-2.86%	1.94%	-1.99%	1.97%	-0.87%	-0.03%
自基金合同生效日起至今	31.85%	2.40%	37.90%	2.48%	-6.05%	-0.08%

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，本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本基金由原汇添富恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）于2022年10月31日转型而来。

§ 4 管理人报告

4.1 基金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。

汇添富基金现已形成公募业务、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。

2023上半年，汇添富基金新成立27只公开募集证券投资基金，包括10只股票型基金、9只混合型基金、8只债券型基金。截至2023年6月30日，公司共管理297只公开募集证券投资基金，形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征，较为完善、有效的产品线。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		9	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

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

				<p>富恒生科技指数型发起式证券投资基金 (QDII) 的基金经理。</p> <p>2021 年 10 月 29 日至今任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。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</p>
--	--	--	--	---

					<p>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。2023 年 4 月 13 日至今任汇添富恒生指数型证券投资基金 (QDII-LOF) 的基金经理。2023 年 5 月 24 日至今任汇添富中证国新央企股东回报交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月 19 日至今任汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。</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合规守信情况的说明

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 25 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

2023 年上半年,资本市场先在经济复苏背景下显现出修复行情,二季度市场整体显著回调。

上半年美联储累计加息三次,将联邦基金目标利率提升至 5.00%-5.25%区间。3 月议息会议声明文件对未来继续加息的表述有所弱化,5 月暗示后续加息暂缓但年内仍较难降息。市场普遍预期本轮加息周期接近尾声,但转向降息周期仍然需要一定时间。

全球来看,海外通胀回落速度较为缓慢,美元指数二季度阶段性走强,人民币兑美元贬值压力加大。北向资金二季度小幅净流入,较一季度显著放缓。

国内来看,3 月两会召开,仍然坚持以稳增长为中心,加强协同,共同促进高质量发展。经济数据在二季度普遍表现疲软。GDP 增速低于市场预期。6 月官方制造业 PMI 数据 49,较前值小幅企稳,但仍低于 50。1-5 月规模以上工业企业营业收入累计同比增长 0.1%,利润累计同比下滑 18.8%,相较 1-4 月累计营收增速下滑、累计利润增速降幅有所收窄。国内经济整体仍处于弱复苏阶段,内需修复动力不足、外需增长压力较大。经济发展模式转型阶段存在压力和挑战。在稳增长压力较大的背景下,政策层面有望持续发力。6 月 MLF 下调 10 个基点,随后一年期、五年期 LPR 均下调 10 个基点,有望减轻企业融资成本、居民债务负担压力。

资本市场方面,新一轮科技创新话题引发热议,信息技术领域表现强势,智能化相关子板块体现出较强的爆发力,并有向产业各领域扩散的态势。市场认知科技创新市场前景广阔。二季度市场有所回调,行业主题结构性分化显著。一季度表现强势的计算机、通信等板块在 4 月和 5 月显著回调,6 月开始重新受到市场关注。银行、证券等金融类资产则是 4 月表现强势之后进入回调。当前科技创新和中特估仍是市场重点关注的资本市场投资主线,对不同偏好的资金有差异化的吸引力。

港股方面,当前整体估值性价比较高,具备底部修复的条件,且其中大批科技型企业也是本轮科技主题演绎的核心且稀缺的标的。

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

本报告期汇添富恒生科技 ETF 联接发起式 (QDII) A 类份额净值增长率为-2.77%，同期业绩比较基准收益率为-1.99%。本报告期汇添富恒生科技 ETF 联接发起式 (QDII) C 类份额净值增长率为-2.86%，同期业绩比较基准收益率为-1.99%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年经济呈现弱复苏状态，复苏强度低于年初预期。分项来看，工业制造和投资相对具有韧性，消费和出口较为疲弱。但居民消费倾向有抬升迹象，结合收入提升预期，下半年内需动能有望出现改善。国内政策基调仍以稳增长为主，尽管难有强刺激，但或许可以期待整体托底和结构性的支持政策。

全球来看，美国通胀超预期回落，加息周期步入尾声成为市场共识，不排除下半年仍有加息的可能性。通胀数据及通胀预期仍然是加息节奏的关键指标。在全球流动性缓和的背景下，港股市场较低估值凸显配置价值，或在下半年体现出较强的弹性。

资本市场上半年整体表现为震荡修复。业绩角度来看，A 股整体盈利增速尚未明显改善，结构分化仍然较为显著，且与股价表现存在一定的错位。信息技术领域在全球智能化浪潮的背景下获得资金关注，长期市场空间充分，但短期能体现出实际业绩增长的比例有限。于此同时低估值高分红类的资产也获得了较多资金流入。创新成长和具备安全边际的低估值资产，形成了两种较为极端的投资偏好，预计仍然会是下半年市场的关注焦点。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 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

托管人声明：

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。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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：2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	30,849,155.54	25,494,956.48
结算备付金		4,623,983.94	4,341,891.78
存出保证金		459,414.92	674,868.25
交易性金融资产	6.4.7.2	505,128,139.64	362,062,809.13
其中：股票投资		888,957.44	5,808,459.13
基金投资		504,239,182.20	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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		107,645.21	303,659.90
应收股利		-	-
应收申购款		1,834,789.21	2,979,591.83
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		543,003,128.46	395,857,777.37
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		0.15	0.91
应付赎回款		3,038,965.67	8,849,456.06
应付管理人报酬		14,160.28	12,861.39
应付托管费		2,832.07	2,572.30
应付销售服务费		63,619.21	34,345.75
应付投资顾问费		-	-
应交税费		102,342.47	63,669.86
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-

其他负债	6.4.7.7	104,807.01	167,535.19
负债合计		3,326,726.86	9,130,441.46
净资产:			
实收基金	6.4.7.8	809,948,323.24	563,815,310.30
未分配利润	6.4.7.9	-270,271,921.64	-177,087,974.39
净资产合计		539,676,401.60	386,727,335.91
负债和净资产总计		543,003,128.46	395,857,777.37

注：1、报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 809,948,323.24 份。本基金下属汇添富恒生科技 ETF 联接发起式 (QDII) A 基金份额净值 0.6678 元，基金份额总额 355,297,434.01 份；本基金下属汇添富恒生科技 ETF 联接发起式 (QDII) C 基金份额净值 0.6652 元，基金份额总额 454,650,889.23 份。

2、本基金合同于 2022 年 10 月 31 日生效，上年度实际报告期间为 2022 年 10 月 31 日至 2022 年 12 月 31 日，特此说明。

6.2 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：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
一、营业总收入		-3,677,346.93
1. 利息收入		69,395.68
其中：存款利息收入	6.4.7.10	69,395.68
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）		11,536,035.32
其中：股票投资收益	6.4.7.11	185,504.75
基金投资收益	6.4.7.12	11,567,369.22
债券投资收益	6.4.7.13	453.95
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-217,292.60
股利收益	6.4.7.17	-
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)	6.4.7.18	-15,537,510.98
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		185,731.70
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	6.4.7.19	69,001.35
减: 二、营业总支出		551,042.72
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	79,885.15
2. 托管费	6.4.10.2.2	15,977.01
3. 销售服务费		323,492.26
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	6.4.7.20	-
7. 税金及附加		40,914.26
8. 其他费用	6.4.7.21	90,774.04
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		-4,228,389.65
减: 所得税费用		-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		-4,228,389.65
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-4,228,389.65

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

6.3 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: 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 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)	563,815,310.30	-177,087,974.39	386,727,335.91
加: 会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	563,815,310.30	-177,087,974.39	386,727,335.91
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	246,133,012.94	-93,183,947.25	152,949,065.69
(一)、综合收益总额	-	-4,228,389.65	-4,228,389.65
(二)、本期基金份额交易产生的	246,133,012.94	-88,955,557.60	157,177,455.34

基金净值变动数 (净值减少以 “-”号填列)			
其中: 1. 基金申 购款	869,752,786.95	-289,154,108.15	580,598,678.80
2. 基金赎回款	-623,619,774.01	200,198,550.55	-423,421,223.46
(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、本期末净 资产(基金净值)	809,948,323.24	-270,271,921.64	539,676,401.60

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

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

<u>张晖</u>	<u>李骁</u>	<u>雷青松</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 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、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、其他依法上市的公司股票、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 \times 95%+商业银行活期存款利率(税后) \times 5%。

6.4.2 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3号《半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。

6.4.3 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2023年06月30日的财务状况以及2023年01月01日至2023年06月30日的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 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法》、《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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日
活期存款	30,849,155.54
等于：本金	30,844,441.71
加：应计利息	4,713.83
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	30,849,155.54

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	889,621.27	-	888,957.44	-663.83
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	475,327,802.21	-	504,239,182.20	28,911,379.99
其他	-	-	-	-
合计	476,217,423.48	-	505,128,139.64	28,910,716.16

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 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	3,657,067.88	-	-	-
(权证投资)	-	-	-	-
(股指期货投资)	3,657,067.88	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	3,657,067.88	-	-	-

6.4.7.3.2 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
HTI2307	HSTECH Futures Jul23	20	3,594,511.54	-62,556.34
合计				-62,556.34
减：可抵销期货暂收款				-62,556.34
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。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 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。

6.4.7.4.2 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。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.5.2 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。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 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	504.45
其中：交易所市场	504.45
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	44,795.19
应付信息披露费	59,507.37
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	104,807.01

6.4.7.8 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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	317,028,693.80	317,028,693.80
本期申购	288,931,267.15	288,931,267.15
本期赎回 (以“-”号填列)	-250,662,526.94	-250,662,526.94
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	355,297,434.01	355,297,434.01
汇添富恒生科技 ETF 联接发起式 (QDII) C		
项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	246,786,616.50	246,786,616.50
本期申购	580,821,519.80	580,821,519.80
本期赎回 (以“-”号填列)	-372,957,247.07	-372,957,247.07
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	454,650,889.23	454,650,889.23

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.9 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
本期期初	-50,407,341.34	-48,889,675.70	-99,297,017.04
本期利润	5,925,080.68	-7,431,879.33	-1,506,798.65
本期基金份额交易产生的变动数	-5,543,971.38	-11,694,785.60	-17,238,756.98
其中：基金申购款	-42,501,322.47	-55,449,755.41	-97,951,077.88
基金赎回款	36,957,351.09	43,754,969.81	80,712,320.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-50,026,232.04	-68,016,340.63	-118,042,572.67
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
本期期初	-39,695,917.68	-38,095,039.67	-77,790,957.35

本期利润	5,384,040.65	-8,105,631.65	-2,721,591.00
本期基金份额 额交易产生 的变动数	-30,941,391.34	-40,775,409.28	-71,716,800.62
其中：基金 申购款	-86,921,182.29	-104,281,847.98	-191,203,030.27
基金赎回款	55,979,790.95	63,506,438.70	119,486,229.65
本期已分配 利润	-	-	-
本期末	-65,253,268.37	-86,976,080.60	-152,229,348.97

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	67,127.03
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	2,046.24
其他	222.41
合计	69,395.68

注：“其他”为直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 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
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	185,504.75
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	185,504.75

6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	6,212,769.75
减：卖出股票成本总额	6,012,239.54
减：交易费用	15,025.46

买卖股票差价收入	185,504.75
----------	------------

6.4.7.12 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	166,756,689.32
减：卖出/赎回基金成本总额	154,829,436.99
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	347,394.31
减：交易费用	12,488.80
基金投资收益	11,567,369.22

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	403.95
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	50.00
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	453.95

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	203,880.00
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	199,950.00
减：应计利息总额	3,880.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	50.00

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

6.4.7.14.1 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。

6.4.7.14.2 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。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 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 2023年01月01日至2023年06月30日
股指期货投资收益	-217,292.60
外汇期货投资收益	-
外汇远期投资收益	-
国债期货投资收益	-

6.4.7.17 股利收益

注：本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
1. 交易性金融资产	-15,500,234.18
——股票投资	203,116.58
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-15,703,350.76
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-37,276.80
——权证投资	-
——期货投资	-37,276.80
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	-15,537,510.98

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	69,001.35
替代损益	-
其他	-
合计	69,001.35

6.4.7.20 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	6,462.36
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	9.12
合计	90,774.04

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未发生与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位: 人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
东方证券	4,977,568.12	70.08

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位: 人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
东方证券	199,950.00	100.00

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 基金交易

金额单位: 人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
东方证券	312,245,352.30	100.00

6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 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	3,982.07	86.20	504.45	100.00

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	79,885.15
其中：支付销售机构的客户维护费	387,970.38

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：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	15,977.01

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：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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。

6.4.10.2.3 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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 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 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	-	26,145.92	26,145.92
东方证券股份有限公司	-	298.81	298.81
汇添富基金管理股份有限公司	-	28,874.34	28,874.34
合计	-	55,319.07	55,319.07

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：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 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：本基金本报告期末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。

6.4.10.4.2 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：本基金本报告期末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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 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	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

报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 (%)	2.82
汇添富恒生科技 ETF 联接发起式 (QDII) C	
项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 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。

6.4.10.5.2 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。

6.4.10.6 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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	29,115,139.66	60,840.08
汇丰银行	1,734,015.88	6,286.95

6.4.10.7 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。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

于本报告期末, 本基金持有 497,277,300.00 份目标 ETF 基金份额, 占其总份额的比例为 83.40%。

6.4.11 利润分配情况

注: 本基金本报告期末进行利润分配。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。

6.4.12 期末 (2023 年 06 月 30 日) 本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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。

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注:截至本报告期末 2023 年 06 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注:截至本报告期末 2023 年 06 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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注:截至本报告期末 2023 年 06 月 30 日止,本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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。

6.4.13.3 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。

6.4.13.3.1 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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年06 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	30,849,155.54	-	-	-	-	-	30,849,155.54
结算备付金	163,894.63	-	-	-	-	4,460,089.31	4,623,983.94
存出保证金	46,246.18	-	-	-	-	413,168.74	459,414.92
交易性金融资产	-	-	-	-	-	505,128,139.64	505,128,139.64
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	107,645.21	107,645.21
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	1,834,789.21	1,834,789.21
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-

其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	31,059,296.35	-	-	-	-	511,943,832.11	543,003,128.46
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	-	-	-	-	-	0.15	0.15
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,038,965.67	3,038,965.67
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	14,160.28	14,160.28
应付托管费	-	-	-	-	-	2,832.07	2,832.07
应付销售服务费	-	-	-	-	-	63,619.21	63,619.21
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	102,342.47	102,342.47
应付利润	-	-	-	-	-	-	-

递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	104,807.01	104,807.01
负债总计	-	-	-	-	-	3,326,726.86	3,326,726.86
利率敏感度缺口	31,059,296.35	-	-	-	-	508,617,105.25	539,676,401.60
上年度末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。

6.4.13.4.1.2 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。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位:人民币元

项目	本期末 2023 年 06 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	-	1,734,046.90	-	1,734,046.90
结算备付金	-	4,460,089.31	-	4,460,089.31
存出保证金	-	413,168.74	-	413,168.74
交易性金融资产	-	888,957.44	-	888,957.44
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	-	7,496,262.39	-	7,496,262.39
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	-	-	-	-
资产负债表外汇率风险敞口净额	-	7,496,262.39	-	7,496,262.39
	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
项目	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

6.4.13.4.2.2 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 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	港币相对人民币升值 5%	374,813.12	698,048.29
	港币相对人民币贬值 5%	-374,813.12	-698,048.29

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日		上年度末 2022 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	888,957.44	0.16	5,808,459.13	1.50
交易性金融资产—基金投资	504,239,182.20	93.43	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	505,128,139.64	93.60	362,062,809.13	93.62

6.4.13.4.3.2 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 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	恒生科技指数 (汇率调整) 上涨 5%	24,865,007.97	17,719,399.81
	恒生科技指数 (汇率调整) 下跌 5%	-24,865,007.97	-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。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 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 2023 年 06 月 30 日
第一层次	505,128,139.64
第二层次	-
第三层次	-
合计	505,128,139.64

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 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。

6.4.14.4 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。

6.4.15 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 投资组合报告

7.1 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	888,957.44	0.16
	其中：普通股	888,957.44	0.16
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	504,239,182.20	92.86
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	35,473,139.48	6.53
8	其他各项资产	2,401,849.34	0.44
9	合计	543,003,128.46	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 633,728.48 元，占期末净值比例为 0.12%。

7.2 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	888,957.44	0.16
合计	888,957.44	0.16

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。

7.3 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	383,384.18	0.07
30 日常消费	41,278.89	0.01
35 医疗保健	-	-
40 金融	7,855.27	0.00
45 信息技术	202,472.34	0.04
50 电信服务	253,966.76	0.05
55 公用事业	-	-
60 房地产	-	-
合计	888,957.44	0.16

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.4 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	Li Auto Inc	理想汽车	2015 HK	香港联合交易所	中国香港	700	87,449.80	0.02
2	Meituan	美团-W	3690 HK	香港	中国香港	700	78,930.71	0.01

				联合交易所				
3	Xiaomi Corp	小米集团	1810 HK	香港联合交易所	中国香港	7,800	77,092.28	0.01
4	Alibaba Group Holding Ltd	阿里巴巴	9988 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	74,864.78	0.01
5	JD.com Inc	京东集团	9618 HK	香港联合交易所	中国香港	600	73,242.09	0.01
6	Kuaishou Technology	快手	1024 HK	香港联合交易所	中国香港	1,400	69,120.84	0.01
7	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股	700 HK	香港联合交易所	中国香港	200	61,145.71	0.01
8	Baidu Inc	百度	9888 HK	香港联合	中国香港	400	48,975.58	0.01

				交易所				
9	NetEase Inc	网易	9999 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	300	42,208.24	0.01
10	Semiconductor Manufacturing International Corp	中芯 国际	981 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	2,000	37,616.78	0.01
11	Lenovo Group Ltd	联想 集团	992 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	4,000	30,130.31	0.01
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	400	28,821.09	0.01
13	XPeng Inc	小鹏 汽车	9868 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	600	27,659.40	0.01
14	JD Health International Inc	京东 健康	6618 HK	香港 联合 交易	中国 香港	600	27,355.15	0.01

				所				
15	Haier Smart Home Co Ltd	海尔智家	6690 HK	香港联合交易所	中国香港	1,200	27,272.17	0.01
16	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	9,000	17,176.49	0.00
17	Bilibili Inc	哔哩哔哩	9626 HK	香港联合交易所	中国香港	140	15,063.31	0.00
18	Trip.com Group Ltd	携程集团	9961 HK	香港联合交易所	中国香港	50	12,566.59	0.00
19	Kingsoft Corp Ltd	金山软件	3888 HK	香港联合交易所	中国香港	400	11,377.23	0.00
20	Kingdee International Software Group Co Ltd	金蝶国际	268 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	9,662.35	0.00
21	Alibaba Health	阿里	241	香	中国	2,000	8,685.05	0.00

	Information Technology Ltd	健康	HK	港 联 合 交 易 所	香 港			
22	ZhongAn Online P&C Insurance Co Ltd	众安 在线	6060 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	400	7,855.27	0.00
23	China Literature Ltd	阅文 集团	772 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	200	6,075.85	0.00
24	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	300	5,238.69	0.00
25	GDS Holdings Ltd	万国 数据	9698 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	200	1,973.04	0.00
26	NIO Inc	蔚来 汽车	9866 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	20	1,398.64	0.00

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 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	Li Auto Inc	2015 HK	87,058.94	0.02
2	Meituan	3690 HK	81,330.66	0.02
3	Alibaba Group Holding Ltd	9988 HK	77,539.36	0.02
4	JD.com Inc	9618 HK	75,910.73	0.02
5	Xiaomi Corp	1810 HK	74,735.26	0.02
6	Kuaishou Technology	1024 HK	70,759.60	0.02
7	Tencent Holdings Ltd	700 HK	62,411.61	0.02
8	Baidu Inc	9888 HK	51,380.06	0.01
9	NetEase Inc	9999 HK	40,688.15	0.01
10	Semiconductor Manufacturing International Corp	981 HK	36,758.84	0.01
11	Lenovo Group Ltd	992 HK	29,296.38	0.01
12	Sunny Optical Technology Group Co Ltd	2382 HK	27,354.66	0.01
13	JD Health International Inc	6618 HK	26,794.28	0.01
14	Haier Smart Home Co Ltd	6690 HK	26,593.66	0.01
15	XPeng Inc	9868 HK	22,590.31	0.01
16	SenseTime Group Inc	20 HK	17,507.71	0.00
17	Bilibili Inc	9626 HK	15,578.00	0.00
18	Trip.com Group Ltd	9961 HK	12,467.76	0.00
19	Kingsoft Corp Ltd	3888 HK	11,954.70	0.00
20	Kingdee International Software Group Co Ltd	268 HK	9,630.17	0.00

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。

7.5.2 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	Kuaishou Technology	1024 HK	583,996.20	0.15
2	Alibaba Group Holding Ltd	9988 HK	515,620.98	0.13
3	Meituan	3690 HK	502,905.77	0.13
4	Tencent Holdings Ltd	700 HK	500,418.36	0.13
5	JD.com Inc	9618 HK	480,166.87	0.12
6	Xiaomi Corp	1810 HK	474,687.43	0.12
7	NetEase Inc	9999 HK	300,244.22	0.08
8	JD Health International Inc	6618 HK	287,770.44	0.07
9	Baidu Inc	9888 HK	258,293.24	0.07
10	Semiconductor Manufacturing International Corp	981 HK	247,172.87	0.06
11	Haier Smart Home Co Ltd	6690 HK	238,113.32	0.06
12	Sunny Optical Technology Group Co Ltd	2382 HK	224,472.70	0.06
13	Kingdee International Software Group Co Ltd	268 HK	180,153.02	0.05
14	Bilibili Inc	9626 HK	176,774.72	0.05
15	Lenovo Group Ltd	992 HK	162,227.53	0.04
16	Li Auto Inc	2015 HK	153,742.31	0.04
17	Alibaba Health Information Technology Ltd	241 HK	145,049.61	0.04
18	SenseTime Group Inc	20 HK	122,196.41	0.03
19	Kingsoft Corp Ltd	3888 HK	100,204.16	0.03
20	Trip.com Group Ltd	9961 HK	90,096.93	0.02

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。

7.5.3 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	889,621.27
卖出收入 (成交) 总额	6,212,769.75

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。

7.6 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。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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 Jul23	-	-

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
HTI2307	HSTECH Futures Jul23	20	3,594,511.54	-62,556.34
公允价值变动总额合计				-62,556.34
期货投资本期收益				-217,292.60
期货投资本期公允价值变动				-37,276.80

7.10 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	交易性开放式	汇添富基金管理股份有限公司	504,239,182.20	93.43

				司		
--	--	--	--	---	--	--

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

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。

7.11.2

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。

7.11.3 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	459,414.92
2	应收清算款	107,645.21
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,834,789.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,401,849.34

7.11.4 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。

7.11.5 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 基金份额持有人信息

8.1 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	持有份额	占总份额	

				比例 (%)		比例 (%)
汇添富恒生科技 ETF 联接发起式 (QDII) A	6,811	52,165.24	10,706,773.75	3.01	344,590,660.26	96.99
汇添富恒生科技 ETF 联接发起式 (QDII) C	37,052	12,270.62	2,085,443.52	0.46	452,565,445.71	99.54
合计	43,863	18,465.41	12,792,217.27	1.58	797,156,105.97	98.42

8.2 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	23,562,747.52	6.63
	汇添富恒生科技 ETF 联接发起式 (QDII) C	356,698.28	0.08
	合计	23,919,445.80	2.95

8.3 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

8.4 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	1.23	10,002,400.24	1.23	3 年
基金管理人高级管理人员	15,672,207.50	1.93	-	-	
基金经理等人员	-	-	-	-	
基金管理人股东	-	-	-	-	
其他	8,247,238.30	1.02	-	-	
合计	33,921,846.04	4.18	10,002,400.24	1.23	

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富恒生科技 ETF 联接发起式 (QDII) A	汇添富恒生科技 ETF 联接发起式 (QDII) C
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
本报告期期初基金份额总额	317,028,693.80	246,786,616.50
本报告期基金总申购份额	288,931,267.15	580,821,519.80
减：本报告期基金总赎回份额	250,662,526.94	372,957,247.07
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	355,297,434.01	454,650,889.23

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 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

10.6.2 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	4,977,568.12	70.08	3,982.07	86.20	
Sanford C. Bernstein	-	2,124,822.89	29.92	637.44	13.80	
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	-	-	-	-	
高盛中国	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	-	-	-	-	
天风证券	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。

10.7.2 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	199,950.00	100.00	-	-	-	-	312,245,352.30	100.00
Sanford C. Bernstein	-	-	-	-	-	-	-	-

安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-	-	-
高盛中国	-	-	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
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, 同一基金管理人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。

10.8 其他重大事件

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交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (QDII) 2023 年境外市场节假日暂停申购、赎回等业务的公告	中证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 01 月 20 日
2	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 年第四季度报告	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	2023 年 01 月 20 日
3	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	2023 年 02 月 22 日
4	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	2023 年 03 月 13 日
5	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 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站	2023 年 03 月 31 日
6	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2023 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	2023 年 04 月 21 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富恒生科技指数型发起式证券投资基金 (QDII) 募集的文件；
- 2、《汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)基金合同》；
- 3、《汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (QDII)

在规定报刊上披露的各项公告；

- 6、中国证监会要求的其他文件。

12.2 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

12.3 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 08 月 31 日