

汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）（原汇添富恒生指数分级证券投资基金）2020 年年度报告

2020 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：2021 年 03 月 30 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 26 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。

汇添富恒生指数分级证券投资基金于 2020 年 12 月 01 日变更注册为汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）。基金托管人及基金注册登记机构不变，基金主代码亦保持不变。转型后基金调整运作方式、取消分级机制，基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等按照《汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）基金合同》相关规定进行运作。就前述修改变更事项，本基金管理人已按照相关法律法规及《基金合同》的约定履行了相关手续。

本报告期自 2020 年 01 月 01 日起至 2020 年 12 月 31 日止。其中，2020 年 12 月 01 日起，“汇添富恒生指数分级证券投资基金”转型为“汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）”。汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）基金合同及托管协议即日生效。

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）	7
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	8
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）	11
3.2 基金净值表现（转型前）	14
3.3 过去三年基金的利润分配情况（转型后）	16
3.3 过去三年基金的利润分配情况（转型前）	16
§ 4 管理人报告	16
4.1 基金管理人及基金经理情况	16
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的成员简介	22
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	22
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	23
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	24
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	25
4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	25
4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	26
4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	27
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	27
§ 5 托管人报告	27
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	27
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	27
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	28
§ 6 审计报告（转型后）	28
6.1 审计报告的基本信息	28
6.2 审计报告的基本内容	28
§ 6 审计报告（转型前）	30
6.1 审计报告的基本信息	30
6.2 审计报告的基本内容	30

§ 7 年度财务报告财务报表（转型后）	32
7.1 资产负债表.....	32
7.2 利润表	33
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	34
7.4 报表附注	35
§ 7 年度财务报告财务报表（转型前）	61
7.1 资产负债表.....	61
7.2 利润表	63
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	64
7.4 报表附注	65
§ 8 投资组合报告（转型后）	95
8.1 期末基金资产组合情况.....	95
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	95
8.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	96
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.....	96
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	108
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	110
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.....	110
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.....	110
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.....	110
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.....	111
8.11 投资组合报告附注.....	111
§ 8 投资组合报告（转型前）	111
8.1 期末基金资产组合情况.....	111
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	112
8.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	112
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.....	113
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	125
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	127
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.....	127
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.....	127
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.....	127
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.....	128
8.11 投资组合报告附注.....	128
§ 9 基金份额持有人信息（转型后）	128
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	128
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	129
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	129
9.4 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.....	130
§ 9 基金份额持有人信息（转型前）	130
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	130
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	130

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	132
9.4 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.....	132
§ 10 开放式基金份额变动（转型后）.....	132
§ 10 开放式基金份额变动（转型前）.....	133
§ 11 重大事件揭示.....	134
11.1 基金份额持有人大会决议.....	134
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.....	134
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	142
11.4 基金投资策略的改变.....	142
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	142
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.....	143
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）.....	143
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）.....	144
11.8 其他重大事件（转型后）.....	146
11.8 其他重大事件（转型前）.....	147
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	152
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.....	152
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	153
§ 13 备查文件目录.....	153
13.1 备查文件目录.....	154
13.2 存放地点.....	154
13.3 查阅方式.....	154

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）	
基金简称	汇添富恒生指数（QDII-LOF）	
基金主代码	164705	
基金运作方式	上市契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 12 月 01 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	
报告期末基金份额总额（份）	272,933,545.54	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2020 年 12 月 02 日	
下属分级基金的基金简称	汇添富恒生指数（QDII-LOF）A	汇添富恒生指数（QDII-LOF）C
下属分级基金场内简称	添富恒生	-
下属分级基金的交易代码	164705	010789
报告期末下属分级基金的份额总额（份）	272,180,645.16	752,900.38

2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	汇添富恒生指数分级证券投资基金	
基金简称	汇添富恒生指数分级	
基金主代码	164705	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 03 月 06 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	
报告期末基金份额总额（份）	399,122,158.12	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市	深圳证券交易所	

的证券交易所			
上市日期	2014 年 04 月 11 日		
下属分级基金的基金简称	恒生 A	恒生 B	添富恒生
下属分级基金场内简称	恒生 A	恒生 B	添富恒生
下属分级基金的交易代码	150169	150170	164705
报告期末下属分级基金的份额总额（份）	68,089,692.00	68,089,692.00	262,942,774.12

2.2 基金产品说明（转型后）

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	<p>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。当成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，以更好地实现本基金的投资目标。</p> <p>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%。</p>
业绩比较基准	经人民币汇率调整的恒生指数收益率×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。</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 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	本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。
业绩比较基准	经人民币汇率调整的恒生指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数及标的指数所表征的股票市场相似的风险收益特征，在股

	票基金中属于中等风险、中等收益的产品。本基金为境外证券投资的基金，主要投资于香港证券市场中具有良好流动性的金融工具。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，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。此外，从投资者具体持有的基金份额来看，在分级运作期内，由于基金收益分配的安排，稳健收益类的恒生 A 份额将表现出低风险、收益稳定的明显特征，其预期收益和预期风险要低于普通的股票型基金份额；积极收益类的恒生 B 份额则表现出高风险、高收益的显著特征，其预期收益和预期风险要高于普通的股票型基金份额。		
下属分级基金的风险收益特征	稳健收益类的恒生 A 份额将表现出低风险、收益稳定的明显特征，其预期收益和预期风险要低于普通的股票型基金份额	积极收益类的恒生 B 份额则表现出高风险、高收益的显著特征，其预期收益和预期风险要高于普通的股票型基金份额	添富恒生属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏	秦一楠
	联系电话	021-28932888	010-66060069
	电子邮箱	service@99fund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-888-9918	95599
传真		021-28932998	010-68121816
注册地址		上海市黄浦区北京东路666号H区（东座）6楼H686室	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址		上海市富城路99号震旦国际大楼20楼	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		200120	100031
法定代表人		李文	周慕冰

注：中国农业银行股份有限公司法定代表人已于2021年2月9日变更为谷澍。

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	《上海证券报》
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	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼 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 16 层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 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	2020 年 12 月 01 日（基金合同生效日）-2020 年 12 月 31 日	
	汇添富恒生指数（QDII-LOF）A	汇添富恒生指数（QDII-LOF）C
本期已实现收益	-870,573.35	2,396.08
本期利润	6,268,360.82	14,199.96
加权平均基金份额本期利润	0.0179	0.0455
本期加权平均净值利润率	1.68%	4.29%
本期基金份额净值增长率	1.86%	0.59%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	
期末可供分配利润	50,326,841.66	56,957.44
期末可供分配基金份额利润	0.1849	0.0757
期末基金资产净值	295,523,108.74	817,445.35
期末基金份额净值	1.0858	1.0857
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	
基金份额累计净值增长率	1.86%	0.59%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（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、汇添富恒生指数分级证券投资基金于 2020 年 12 月 01 日起正式转型为汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）。

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	2020 年 01 月 01 日- 2020 年 11 月 30 日	2019 年	2018 年
本期已实现收益	-4,748,921.10	10,598,018.72	50,776,429.60
本期利润	-22,048,161.37	39,394,032.15	-40,635,481.42
加权平均基金份额本期利润	-0.0670	0.1598	-0.1024
本期加权平均净值利润率	-6.19%	13.51%	-8.53%
本期基金份额净值增长率	-11.88%	11.71%	-8.37%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年 11 月 30 日	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	25,241,188.05	60,913,437.88	28,804,325.50
期末可供分配基金份额利润	0.0630	0.2690	0.0896
期末基金资产净值	425,309,274.23	279,200,509.12	362,057,111.68
期末基金份额净值	1.066	1.232	1.126
3.1.3 累计期末指标	2020 年 11 月 30 日	2019 年末	2018 年末
基金份额累	21.88%	38.31%	23.81%

计净值增长率			
--------	--	--	--

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（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。

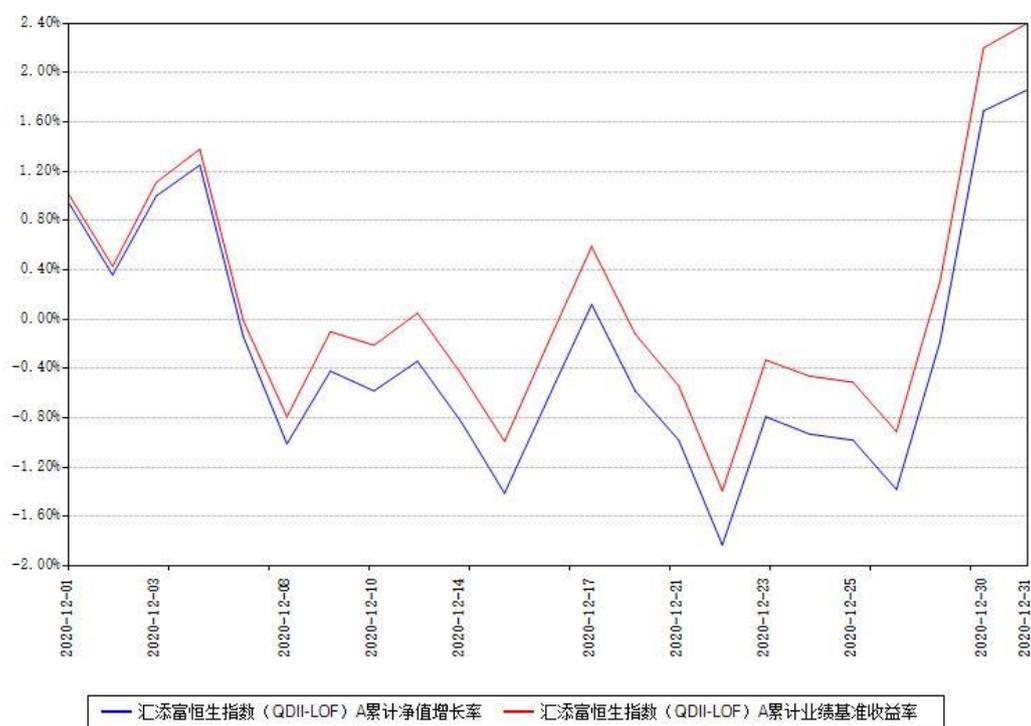
3.2 基金净值表现（转型后）

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

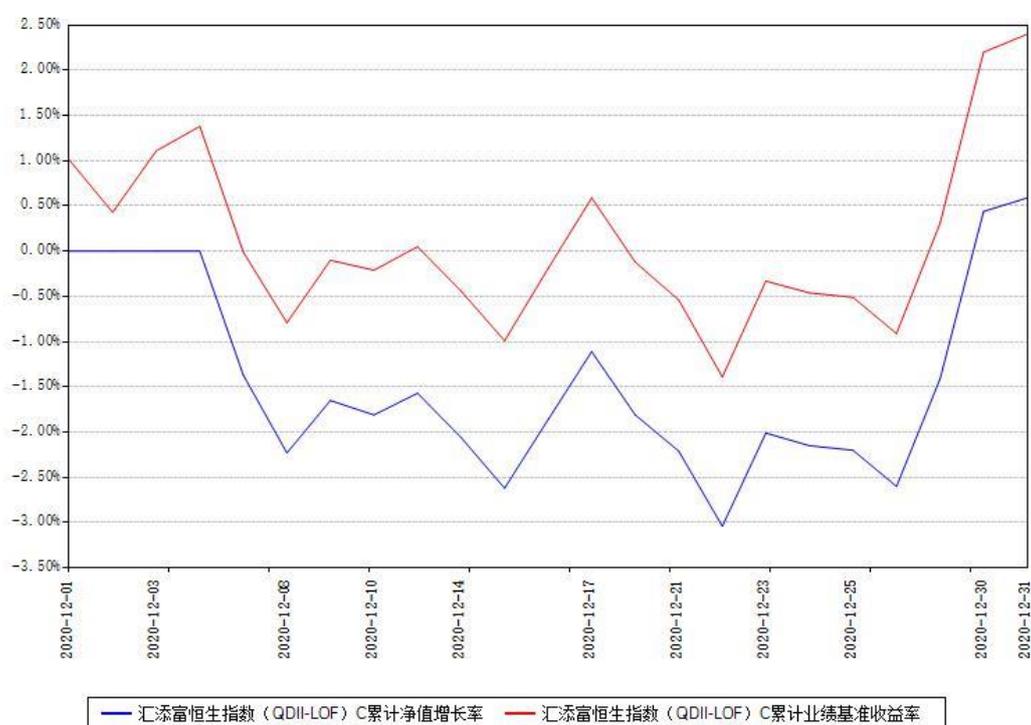
汇添富恒生指数（QDII-LOF）A						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效日起至今	1.86%	0.80%	2.40%	0.81%	-0.54%	-0.01%
汇添富恒生指数（QDII-LOF）C						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效日起至今	0.59%	0.76%	2.40%	0.81%	-1.81%	-0.05%

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

汇添富恒生指数（QDII-LOF）A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富恒生指数（QDII-LOF）C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图

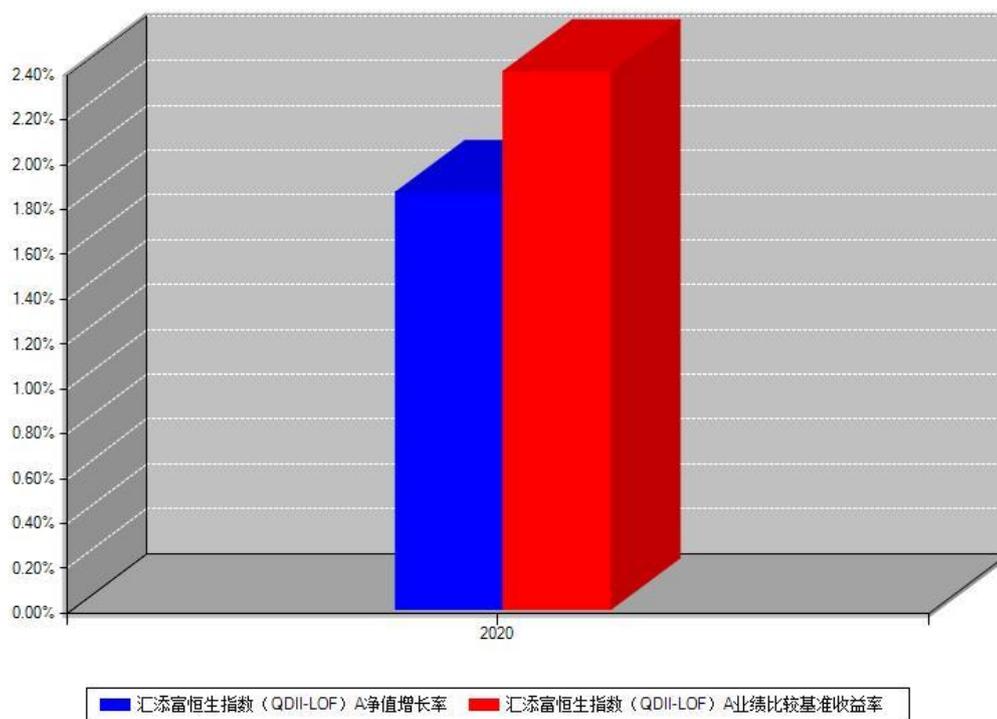


- 1、本《基金合同》生效之日为2020年12月01日，截至本报告期末，基金成立未满一年；
- 2、本基金的建仓期为6个月，截止本报告期末，本基金尚处于建仓期内，将在六个月建仓期结束时，确保各项资产配置比例符合合同约定；

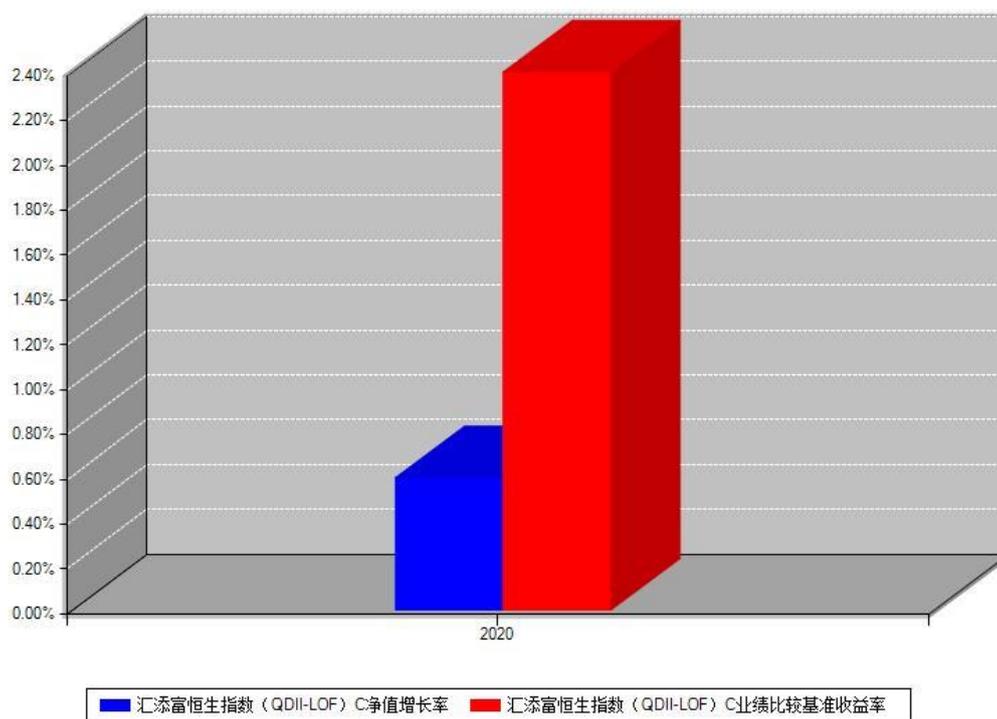
3、自 2020 年 12 月 1 日起汇添富恒生指数分级证券投资基金转型为汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）。

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

汇添富恒生指数（QDII-LOF）A 每年净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富恒生指数（QDII-LOF）C每年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2020年12月01日，截至本报告期末，基金成立未满一年；

2、本基金的建仓期为6个月，截止本报告期末，本基金尚处于建仓期内，将在六个月建仓期结束时，确保各项资产配置比例符合合同约定；

3、自2020年12月1日起汇添富恒生指数分级证券投资基金转型为汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）。

3.2 基金净值表现（转型前）

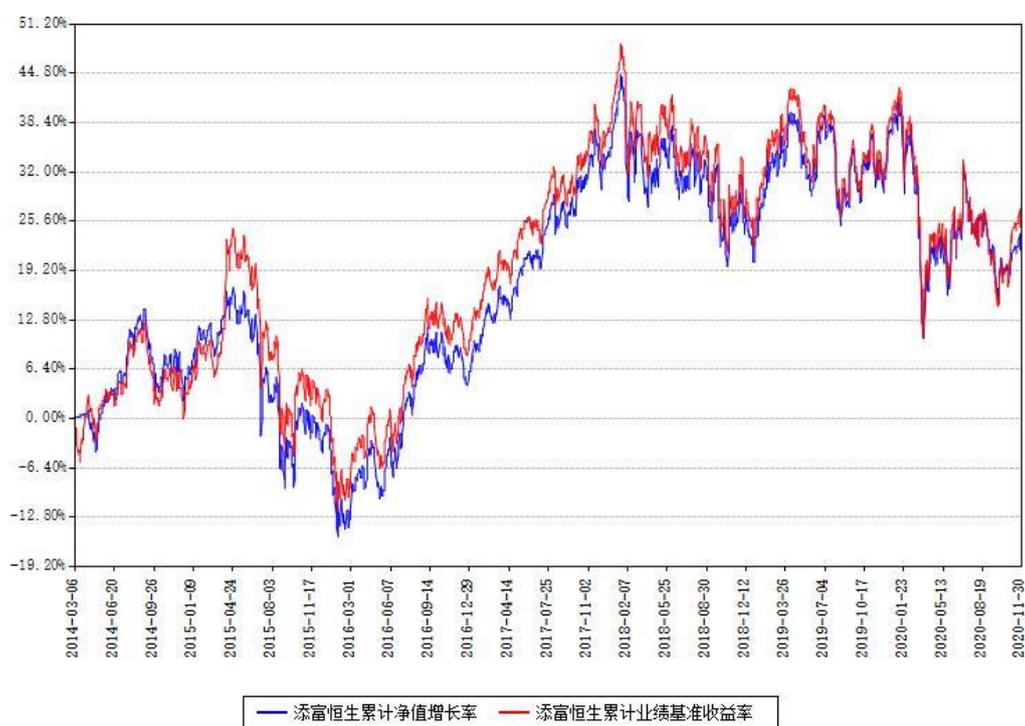
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-1.93%	0.80%	0.31%	0.98%	-2.24%	-0.18%
过去六个月	4.31%	1.08%	5.59%	1.16%	-1.28%	-0.08%
过去一年	-6.65%	1.37%	-5.10%	1.44%	-1.55%	-0.07%
过去三	-8.78%	1.17%	-8.66%	1.20%	-0.12%	-0.03%

年						
过去五年	24.89%	1.08%	22.46%	1.10%	2.43%	-0.02%
自基金合同生效日起至今	21.88%	1.08%	24.84%	1.11%	-2.96%	-0.03%

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

添富恒生累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图

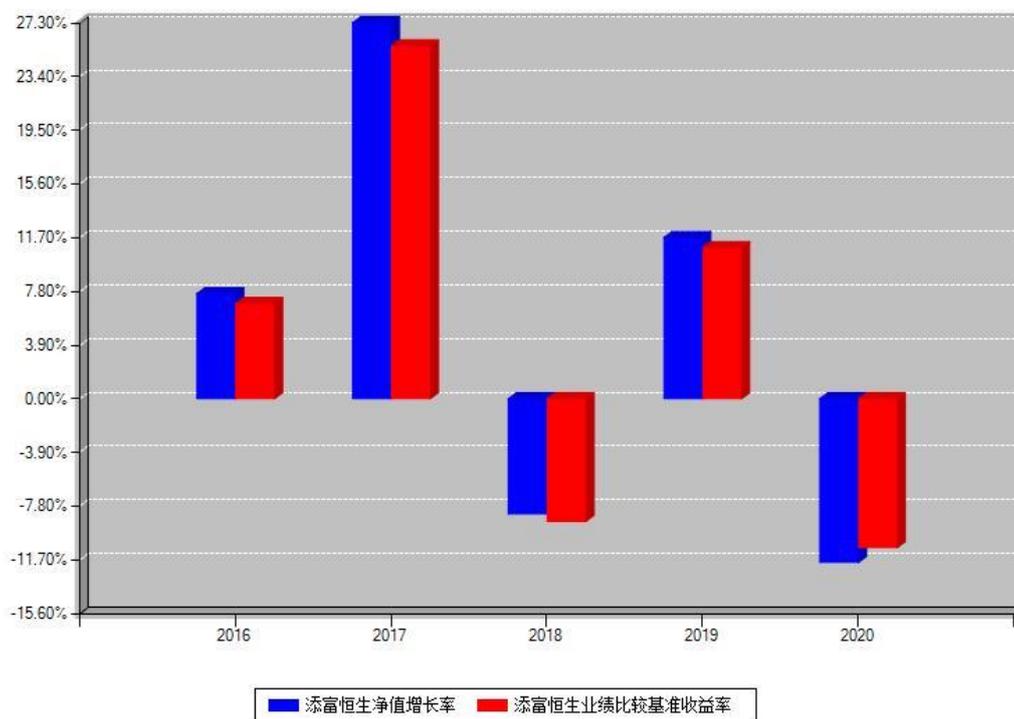


注：1、本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2014年03月06日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

2、自2020年12月1日起汇添富恒生指数分级证券投资基金转型为汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）。

3.2.3 过去5年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

添富恒生每年净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：1、本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2014年03月06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。

2、自2020年12月1日起汇添富恒生指数分级证券投资基金转型为汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）。

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2020年12月01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：本基金过去三年均未进行利润分配。

§ 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、南京等地设有分公司，在香港及上海设有子公司——汇添富资产管理（香港）有限公司和汇添富资本管理有限公司。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 基金管理人及 QFII 基金管理人等业务资格。

汇添富基金自成立以来，始终将投资业绩放在首位，形成了独树一帜的品牌优势，被誉为“选股专家”，并以优秀的长期投资业绩和一流的客户服务，赢得了广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

目前，汇添富基金已经发展成为长期业绩亮眼、产品布局完善、业务领域全面、资产管理规模居前的大型基金公司。2020 年，汇添富基金多位基金经理荣获“中国基金业英华奖·最佳基金经理”等奖项，旗下多只产品荣获“金牛奖”、“金基金奖”、“明星基金奖”等奖项。

2020 年，汇添富基金新成立 25 只公募基金，包括 18 只混合型基金，2 只股票型基金，5 只债券型基金。2020 年底，公司公募基金产品总数达 168 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。

2020 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。开创性地研发上线了组合发车、实盘等互联网产品形态，实现了跨 TA 转换等业内首创的功能，推出了 APP 简化版，满足了部分客户的极简需求，极大的提升了用户体验。与此同时，积极拥抱互联网变革，快速布局直播、短视频等赛道，初步搭建起数字化运营体系。其中，直播、短视频业务以自有平台及支付宝为主要阵地，以核心 IP 为亮点，以理财投教为内容抓手，通过持续运营，获得了广大投资人的喜爱；在数字化运营方面，围绕为客户提供更优质的投资服务目标，自有平台精准营销体系初见成效，实现了客户数、活跃度、保有量的齐头并进，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。

2020 年，汇添富基金持续推进大机构战略，机构业务规模保持较好的增长势头。公司深受专业机构投资者信任，获得所有大型银行及保险委外专户组合，且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。养老金业务规模快速增长，受托管理组合账户数量及规模持续增加。

2020 年，公司积极开展渠道服务和投资者教育工作，以“前瞻性”、“多层次”、“体

系化”、“全方位”的投顾服务不断提升汇添富品牌在渠道的影响力和认可度。同时公司在各渠道端开展“价值投资添富行”等线上、线下系列活动，全年合计开展超 3000 余场，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。

2020 年，汇添富基金持续提升客户服务能力，全方位优化客户服务体系。公司通过完善大客户平台建设，搭建全新客服体系，为公司各项销售业务提供全方位支持。同时，持续优化电话、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。

2020 年，香港子公司与母公司两地一体化运营、垂直化管理继续发挥显著成效，国际业务总资产管理规模取得长足进步，QDII 及港股通项下公募基金业绩优秀，“港股通”类委外专户管理规模继续保持领先，海外主动管理权益资产规模保持行业前列。2020 年，香港子公司在加强母公司投研一体化基础上，港股投资及海外债券投资业绩持续优异，汇添富中港策略基金获得晨星三年与五年的五星评级，根据彭博统计，中港策略基金在最近一年、三年、五年同类港股基金中业绩分别列第二、第二及第一位；汇添富精选美元债券基金获得晨星三年五星评级；汇添富港币债券基金获得晨星 5 年的 4 星评级。

2020 年初以来，汇添富一方面通过各种举措积极参与抗疫工作，另一方面继续为推动中西部贫困地区教育发展和产业脱贫而不懈努力。

疫情爆发初期，公司在做好自身复工复产、保护投资者利益、维护资本市场稳定的基础上，第一时间组织开展各项社会抗疫工作，倡导联合上海公募基金业充分发挥基金的力量，组织各种抗疫物资驰援武汉，共渡难关。抗疫项目包括“上海基金业致敬白衣天使”专项基金捐赠、湖北地区医疗防疫物资捐赠、“河流·孩子”项目学校“校园守护包”捐赠、“生命之光”慰问上海交通大学医学院附属医院一线的青年医护人员等抗疫项目。其中，汇添富建议并协助上海市基金同业公会紧急发起的“上海基金业致敬白衣天使”专项基金有 34 家会员单位与公会共同出资参与捐赠，募集资金 4748 万元，先后采取线上线下两种形式，兼顾中医西医两个系统，覆盖了上海援鄂医护人员、坚守上海抗疫一线医护人员、武汉抗疫一线医护人员、中国国际援助医疗队成员及其他为抗击疫情做出重要贡献的人员共计 4330 名。

在教育扶贫方面，汇添富连续第十三年开展“河流·孩子”公益助学计划，项目组在做好疫情防护的同时积极邀请公司员工、客户和合作伙伴前往公司援建的“添富小学”提供公益服务。公司党委下属的八个党支部通过实际行动支持和关怀各添富小学的发展，在第十三届“河流·孩子”2020 乡村优秀青年教师培训中，八个党支部的志愿讲师通过远程授课的形式为线上参训的 96 名乡村青年教师讲授了不同领域的知识和热门议题。截止目前，“河流

“孩子”项目先后援建 10 所“添富小学”，连续十三年培训乡村教师 1100 人次，受益学生逾万人，累计扶贫投入资金近 3000 万元，累计提供志愿服务 3 万多小时。

2020 年 11 月，汇添富在人民日报·国际金融报举办的第三届 CSR 先锋论坛奖项评选中获评“2020 年度社会责任先锋案例”。

2021 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		
赖中立	本基金的基金经理	2014 年 03 月 06 日		13	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股息投资指数发起式证券投资基金（LOF）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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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		
赖中立	本基金的基金经理	2014 年 03 月 06 日		13	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

					<p>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股息投资指数发起式证券投资基金（LOF）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。

4.1.3 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、基本养老保险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

本基金管理人高度重视投资者利益保护。报告期内，本基金管理人持续完善公司投资交

易业务流程和公平交易制度，进一步实现了流程化、体系化和系统化。公司投资交易风险控制体系由投资、研究、交易、风险管理、营运以及合规稽核等相关部门组成，各部门各司其职，对投资交易行为进行事前、事中和事后全程嵌入式的风险管控，确保公平交易制度的执行和实现。

对于同向交易，我们采集了本报告期内本公司旗下两两投资组合在相同时间窗口下（日内、3 日内和 5 日内）同买或者同卖同一证券时两者买卖均价存在的差异（即价差率）序列，然后按两两组合归类计算平均价差率。根据 95%置信区间下平均价差率的 T 检验显著程度、同向交易占优比等方面进行综合分析，来判断是否存在重大利益输送的可能性。本报告期内，未发现旗下投资组合之间存在利益输送情况。

对于反向交易，我们根据交易价格、交易频率、交易数量等进行了综合分析，未发现异常情况。

综合而言，本公司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，本公司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 39 次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易，基金经理按内部规定履行了审批程序，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

回顾 2020 年，香港市场呈现宽幅震荡的趋势。年初随着国内疫情的发生以及全球疫情的扩散，香港市场迎来了较大程度的跌幅。下半年，随着国内经济的企稳，以及全球流动性的持续宽松，香港市场也迎来一波较大幅度的上涨。恒生指数全年下跌 3.4%，港股估值仍处于历史极低水平。

我们认为相关市场的主要驱动因素如下：1) 全球经济受新冠疫情影响，出现了较大程度衰退，全球主要经济体除中国外均发生了 GDP 负增长，而香港的旅游、金融地产等经济板块也受到了不同程度的冲击；2) 全球各国央行货币政策宽松预期充分，海内外投资者对于权益资产配置的需求不断加大，对于香港市场整体估值起到了提升作用；3) 中美贸易摩擦出现缓和迹象，市场对于外部风险因素已经充分反映在价格内，边际上的改善带来市场情绪

的提升；4）横向来看，香港市场的长期配置价值依然全球领先，长期配置型海外资金与南下资金持续流入香港市场，为香港市场不断引入活水。

总体来看，2020 年香港市场呈现的震荡行情是以上驱动因素的综合体现。

报告期内，本基金按照基金合同，按照完全复制法进行恒生指数成份股指数化投资，严控基金跟踪误差，以期给投资者带来与恒生指数一致的收益。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

本基金于 2020 年 12 月 01 日变更注册为汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF），转型前基金本期（2020 年 01 月 01 日至 11 月 30 日）份额净值增长率为-11.88%。同期业绩比较基准收益率为-10.80%。转型后本基金本报告期 A 类基金份额净值增长率为 1.86%；C 类基金份额净值增长率为 0.59%。同期业绩比较基准收益率为 2.40%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们对香港市场 2021 年表现持有相对乐观的态度，主要原因有以下几个方面：

1）南下和海外增量资金将持续增配港股。南下资金持续净流入，2020 年港股通南下资金规模超过 6700 亿，创历史新高。海外资金 20 年 7 月份以来也在加速配置港股，累计净流入超 400 亿美金。展望全年，中国居民存款搬家，海外流动性大幅宽松，南下和海外资金将持续增配港股的趋势将持续。

2）宏观层面，疫苗接种持续推进，2021 年全球经济将共振复苏。利好港股市场进一步修复。中国 2020 年 GDP 同比+2.3%，21 年预计达到 9%-10%。美国方面，预计 20 年 GDP 增速 -4.3%，21 年将实际 3.1%的正增长。

3）全球流动性宽松仍是 2021 年的主基调。美联储平均通胀框架下，全球流动性大概率保持宽松。中国货币政策短期也不会有大幅的收紧。

4）企业盈利方面，国内和海外经济持续复苏背景下，港股企业盈利将显著复苏。预计 21 年净利润增速将达到 18%，显著好于 20 年-18%的增速。

5）估值层面，从全球横向比价来看，港股仍然处于估值洼地。当前恒生指数 PE 仅为 15 倍，在全球主要指数中处于最低水平。纵向来看，除了医疗保健、消费、科技，大部分行业的估值仍然具备较高的性价比。

总的来看我们对香港市场 2021 年的表现充满希望，在全球经济复苏、货币宽松、国内资金加速南下的背景下，港股市场有望迎来业绩修复、估值提升的双重利好。

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、进一步提升合规法务管理工作

强化合规审核和风险把控,为公司各项业务开展提供全面的合规法务咨询、审核与支持;开展多项合规检查,切实履行合规报告职责;贯彻资管新规及细则要求,持续落实相关业务整改;开展反洗钱培训与宣传,完善反洗钱可疑交易系统监测,持续加强洗钱风险管控;开展形式多样的合规培训与教育,促进人员合规执业,加强合规文化建设。

2、进一步完善投资风险控制工作

强化投资授权管理,优化内幕交易管控机制,避免利益输送及操纵市场等违法违规行为;根据今年新推出的投资业务特点,优化投资、交易合规监控逻辑和管控流程;完善公司关联交易、公平交易和异常交易管控逻辑,并通过制度和系统方式落实相关管控措施;建立跨部门沟通机制,全面提升投资团队合规管理意识和效率;完善公司对外行使投票表决权管理机制,防止利益冲突和防范利益输送行为;定期梳理合规风险案例,对投研人员进行合规培训;强化估值合规性管理,防范账户透支、估值异常等风险,维护持有人利益。

3、进一步加强稽核内审工作

通过对母子公司业务开展日常风险排查,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、人员行为监控和人员投资报备审查,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。本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,继续加强合规管理和风险控制,进一步提高稽核监察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

报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定。对于特定品种或者投资品种相同,但具有不同特征的,若协会有特定调整估值方法的通知的,例如《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》,应参照协会通知执行。

报告期内,公司制定了证券投资基金的估值政策和程序,并由投资研究部、固定收益部、集中交易室、基金营运部、风险管理及合规稽核人员、基金经理等组成了估值委员会,负责

研究、指导基金估值业务。估值委员会成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务但应参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权，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，保持估值政策和程序的一贯性。

日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为对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。登记在基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；同一类别内每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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

无。

§ 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—汇添富基金管理有限公司 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，汇添富基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持

有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，汇添富基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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（2021）审字第 60466941_B49 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	汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，自 2020 年 12 月 1 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日期间的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）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指数型证券投资基金（QDII-LOF）2020 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2020 年 12 月 1 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日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指数型证券投资基金（QDII-LOF），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	汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）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。

	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>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。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）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。</p> <p>治理层负责监督汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>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。</p> <p>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：</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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指数型证券投资基金（QDII-LOF）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指数型证券投资基金（QDII-LOF）不能持续经营。</p>

	(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	王珊珊	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16层	
审计报告日期	2021年03月26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（2021）审字第 60466941_B48 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	汇添富恒生指数分级证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了汇添富恒生指数分级证券投资基金的财务报表，包括 2020 年 11 月 30 日（即《汇添富恒生指数分级证券投资基金基金合同》失效前日，以下简称“基金合同失效前日”）的资产负债表，自 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 11 月 30 日（基金合同失效前日）期间的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的汇添富恒生指数分级证券投资基金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指数分级证券投资基金 2020 年 11 月 30 日（基金合同失效前日）的财务状况以及自 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 11 月 30 日（基金合同失效前日）期间的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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指数分级证券投资基金，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。</p>
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	汇添富恒生指数分级证券投资基金管理层对其他信息负责。其

	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>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。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估汇添富恒生指数分级证券投资基金的持续经营能力，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。</p> <p>治理层负责监督汇添富恒生指数分级证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>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。</p> <p>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：</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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指数分级证券投资基金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</p>

	事项或情况可能导致汇添富恒生指数分级证券投资基金不能持续经营。 (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	王珊珊	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16层	
审计报告日期	2021年03月26日	

§ 7 年度财务报告财务报表（转型后）

7.1 资产负债表

会计主体：汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）

报告截止日：2020年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020年12月31日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	22,824,492.06
结算备付金		89,087.60
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	278,474,254.28
其中：股票投资		278,474,254.28
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		54,966,410.86
应收利息	7.4.7.5	3,273.12
应收股利		5,704.16
应收申购款		728,106.04
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		357,091,328.12
负债和所有者权益	附注号	本期末

		2020 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		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		60,124,672.76
应付管理人报酬		252,158.30
应付托管费		78,799.46
应付销售服务费		24.25
应付交易费用	7.4.7.7	41,484.60
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	253,634.66
负债合计		60,750,774.03
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	167,813,484.92
未分配利润	7.4.7.10	128,527,069.17
所有者权益合计		296,340,554.09
负债和所有者权益总计		357,091,328.12

注：1、报告截止日 2020 年 12 月 31 日，本基金下属汇添富恒生指数（QDII-LOF）A 基金份额净值 1.0858 元，基金份额总额 272,180,645.16 份；本基金下属 C 类基金份额净值 1.0857 元，基金份额总额 752,900.38 份。

2、本基金合同于 2020 年 12 月 1 日生效。

7.2 利润表

会计主体：汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）

本报告期：2020 年 12 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2020 年 12 月 01 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		6,971,835.49
1. 利息收入		22,046.02
其中：存款利息收入	7.4.7.11	22,046.02
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		-

证券出借收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-2,116.68
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-47,827.64
基金投资收益	7.4.7.13	-
债券投资收益	7.4.7.14	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.14.2	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-
股利收益	7.4.7.17	45,710.96
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	7,150,738.05
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-200,087.42
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	1,255.52
减：二、费用		689,274.71
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	252,158.30
2. 托管费	7.4.10.2.2	78,799.46
3. 销售服务费		24.25
4. 交易费用	7.4.7.20	321,701.94
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	7.4.7.21	36,590.76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,282,560.78
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,282,560.78

注：本基金合同于 2020 年 12 月 01 日生效，本报无上年度可比期间，特此说明。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）

本报告期：2020 年 12 月 01 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2020 年 12 月 01 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	294,002,096.50	131,307,177.73	425,309,274.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,282,560.78	6,282,560.78

三、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）	-126,188,611.58	-9,062,669.34	-135,251,280.92
其中：1. 基金申购款	6,608,536.44	418,258.59	7,026,795.03
2. 基金赎回款	-132,797,148.02	-9,480,927.93	-142,278,075.95
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	167,813,484.92	128,527,069.17	296,340,554.09

注：本基金合同于 2020 年 12 月 01 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：

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

汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）（以下简称“本基金”），是由汇添富恒生指数分级证券投资基金变更而来。原汇添富恒生指数分级证券投资基金，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[2013]1247 号文《关于核准汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）募集的批复》的核准，由基金管理人汇添富基金管理股份有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2014 年 3 月 6 日正式生效，首次设立募集规模为 1,270,631,138.98 份基金份额。

2020 年 10 月 29 日，汇添富恒生指数分级证券投资基金基金份额持有人大会以现场方式召开，大会表决通过了《关于汇添富恒生指数分级证券投资基金转型的议案》，持有人大会决议生效公告日为 2020 年 10 月 30 日。根据转型安排，本基金以 2020 年 11 月 30 日为基金份额转换基准日，将该基准日在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司登记在册的

添富恒生份额、恒生 A 份额与恒生 B 份额将转换为汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）的 A 类基金份额的场内份额，在中国证券登记结算有限责任公司登记在册的添富恒生份额将转换为汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）的 A 类基金份额的场外份额。

根据 2020 年 12 月 2 日发布的《汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富恒生指数分级证券投资基金基金份额转换结果的公告》，本基金以 2020 年 11 月 30 日为基金份额转换基准日，将恒生 A 份额与恒生 B 份额转换为 136,179,383.00 份添富恒生份额的场内份额，之后将添富恒生份额的场内份额和场外份额分别转换为汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）A 类基金份额的场内份额和场外份额，分别为 143,224,278.00 份和 255,897,879.12 份。

自 2020 年 12 月 1 日起，《汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）基金合同》生效。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司，境外托管人为香港上海汇丰银行有限公司（The Hong Kong and Shanghai Banking Co., Ltd.）。

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化投资产品；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、与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构化投资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（包含中小板、创业板、其他依法上市股票），存托凭证，衍生工具（股指期货、国债期货、股票期权等），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：经人民币汇率调整的恒生指数收益率×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、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证监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〉》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

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2020年12月31日的财务状况以及2020年12月01日（基金合同生效日）至2020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

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

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2020年12月01日（基金合同生效日）至2020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分为以下两类:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项;

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主要包括股票投资。

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。”

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的股票,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;

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利,应当确认为当期收益。每日,本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益;

处置该金融资产或金融负债时,其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益,同时调整公允价值变动收益;

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;

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的,该金融负债或其一部分将终止确认;

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。

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小层次输入值，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。

本基金持有的金融工具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) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 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，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，实际发生时计入转融通证券出借业务利息收入；

(5) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(6) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的

差额入账；

(7) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 基金投资收益/（损失）于卖出/赎回基金成交日确认，并按卖出/赎回基金成交金额与其成本的差额入账；

(9) 资产支持证券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(10) 股指/国债期货投资收益/（损失）于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(11) 权证收益/（损失）于卖出成交日确认，并按卖出成交金额与其成本的差额入账；

(12) 股票股利收益于除息日确认，并按宣告的分红派息比例计算的金额扣除股票所在地适用的预缴所得税后的净额入账；基金投资在持有期间取得的红利于除息日确认；

(13) 公允价值变动收益/（损失）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；

(14) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

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在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他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。登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为对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。登记在基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

(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。

7.4.5 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。

7.4.6.1 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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 2020 年 12 月 31 日
活期存款	22,824,492.06
定期存款	-
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	-
合计	22,824,492.06

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动

股票		269,868,302.75	278,474,254.28	8,605,951.53
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		269,868,302.75	278,474,254.28	8,605,951.53

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日
应收活期存款利息	3,273.12
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	3,273.12

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 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	41,484.60
银行间市场应付交易费用	-
合计	41,484.60

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020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	-
应付审计费	90,000.00
应付信息披露费	120,000.00
应付指数使用费	43,634.66
应付账户维护费	-
应付汇划费	-
其他	-
合计	253,634.66

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富恒生指数（QDII-LOF）A		
项目	本期 2020 年 12 月 01 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	399,122,157.12	294,002,096.50
本期申购	5,596,383.58	5,596,383.58
本期赎回（以“-”号填列）	-132,537,895.54	-132,537,895.54
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	272,180,645.16	167,060,584.54

汇添富恒生指数（QDII-LOF）C		
项目	本期 2020 年 12 月 01 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	-	-
本期申购	1,012,152.86	1,012,152.86
本期赎回（以“-”号填列）	-259,252.48	-259,252.48
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	752,900.38	752,900.38

注：（1）申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

（2）本基金的基金份额转换基准日（折算基准日）为 2020 年 11 月 30 日。基金管理人在份额转换基准日进行转换，转换前基金份额总额 399,122,158.12 份，转换后基金份额总额 399,122,157.12 份。本基金合同于 2020 年 12 月 1 日生效。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

汇添富恒生指数（QDII-LOF）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	25,241,188.05	106,065,989.68	131,307,177.73
本期利润	-870,573.35	7,138,934.17	6,268,360.82
本期基金份额交易产生的变动数	25,956,226.96	-35,069,241.31	-9,113,014.35
其中：基金申购款	-1,144,197.84	1,490,396.20	346,198.36
基金赎回款	27,100,424.80	-36,559,637.51	-9,459,212.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	50,326,841.66	78,135,682.54	128,462,524.20
汇添富恒生指数（QDII-LOF）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	-	-	-

效日			
本期利润	2,396.08	11,803.88	14,199.96
本期基金份额交易产生的变动数	54,561.36	-4,216.35	50,345.01
其中：基金申购款	72,746.79	-686.56	72,060.23
基金赎回款	-18,185.43	-3,529.79	-21,715.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	56,957.44	7,587.53	64,544.97

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年12月01日（基金合同生效日）至2020年12月31日
活期存款利息收入	14,322.03
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	3,467.67
其他	4,256.32
合计	22,046.02

注：“其他”为直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年12月01日（基金合同生效日）至2020年12月31日
卖出股票成交总额	141,672,054.50
减：卖出股票成本总额	141,719,882.14
买卖股票差价收入	-47,827.64

7.4.7.13 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

7.4.7.14 债券投资收益

7.4.7.14.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益。

7.4.7.14.2 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

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——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具投资收益。

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年12月01日（基金合同生效日）至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	45,710.96
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	45,710.96

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年12月01日（基金合同生效日）至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	7,150,738.05
——股票投资	7,150,738.05
——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	-
——权证投资	-
——期货投资	-
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	7,150,738.05

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 12 月 01 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	1,255.52
替代损益	-
其他	-
合计	1,255.52

7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 12 月 01 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	321,701.94
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
合计	321,701.94

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 12 月 01 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	7,623.50
信息披露费	10,163.55
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	1,099.73
指数使用费	12,607.91
持有人大会-公证费	-
持有人大会-律师费	-
开户费	-
上市费	5,083.45
其他	12.62
合计	36,590.76

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
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	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”）	基金境外托管人
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东
东航金控有限责任公司	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
上海上报资产管理有限公司	基金管理人的股东
汇添富资产管理（香港）有限公司	基金管理人的子公司
汇添富资本管理有限公司	基金管理人的子公司
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

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 2020 年 12 月 01 日（基金合同生效日）至 2020 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	153,916,271.89	90.23

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期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：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 12 月 01 日（基金合同生效日）至 2020 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	123,132.59	96.10	41,484.60	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。

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 2020 年 12 月 01 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	252,158.30
其中：支付销售机构的客户维护费	53,910.30

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 12 月 01 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	78,799.46

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

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 2020 年 12 月 01 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富恒生指数（QDII-LOF）A	汇添富恒生指数（QDII-LOF）C	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	1.46	1.46
合计	-	1.46	1.46

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 0.10%。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 0.10% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

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：本基金本报告期末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：本基金本报告期末不存在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。

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：本基金本报告期末不存在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。

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自有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期末未运用自有资金投资本基金。

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 2020 年 12 月 01 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
农业银行	19,075,398.57	14,302.07
汇丰银行	3,749,093.49	19.96

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。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

7.4.12 期末（2020 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 2020 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金融资产款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2020 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金融资产款余额。

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 2020 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%，且同一基金管理人管理的全部基金不得持有同一机构 10%以上具有投票权的证券发行总量。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

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。

本基金所持证券均在证券交易所上市；因此，本报告期末本基金的资产均能及时变现。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。本基金的生息资产主要为银行存款及部分应收申购款等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 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	22,824,492.06	-	-	-	-	-	22,824,492.06

结算备付金	-	-	-	-	-	89,087.60	89,087.60
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	-	278,474,254.28	278,474,254.28
应收股利	-	-	-	-	-	5,704.16	5,704.16
应收利息	-	-	-	-	-	3,273.12	3,273.12
应收申购款	12,169.53	-	-	-	-	715,936.51	728,106.04
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	54,966,410.86	54,966,410.86
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	22,836,661.59	-	-	-	-	334,254,666.53	357,091,328.12
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	60,124,672.76	60,124,672.76
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	252,158.30	252,158.30
应付托管费	-	-	-	-	-	78,799.46	78,799.46
应付	-	-	-	-	-	-	-

证券清算款							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	24.25	24.25
应付交易费用	-	-	-	-	-	41,484.60	41,484.60
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	253,634.66	253,634.66
负债总计	-	-	-	-	-	60,750,774.03	60,750,774.03
利率敏感度缺口	22,836,661.59	-	-	-	-	273,503,892.50	296,340,554.09

注：上表统计了本基金资产和负债的利率风险敞口。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

注：本基金本报告期末计息资产仅包括银行活期存款及部分应收申购款，且均以活期存款利率或相对固定的利率计息；假定利率变动仅影响其未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因而在本基金本报告期末未持有其他计息资产/负债的情况下，利率变动对基金资产净值的影响并不显著。

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 2020 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	339.23	3,748,882.10	-	3,749,221.33
结算备付金	-	89,087.60	-	89,087.60
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	278,474,254.28	-	278,474,254.28
衍生金融资产	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	3,168,726.33	-	3,168,726.33
应收利息	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产总计/增发证券	339.23	285,480,950.31	-	285,481,289.54
以外币计价的负债				
短期借款	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
应付证券	-	-	-	-

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	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-
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	339.23	285,480,950.31	-	285,481,289.54

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 2020 年 12 月 31 日
	美元相对人民币升值 5%	16.96
	美元相对人民币贬值 5%	-16.96
	港币相对人民币升值 5%	14,274,047.52
	港币相对人民币贬值 5%	-14,274,047.52

7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格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除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金

管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

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 2020 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	278,474,254.28	93.97
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	278,474,254.28	93.97

注：本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 80%，投资境外资产的比例不低于基金资产的 80%；投资于标的指数成份股、备选成份股、跟踪同一标的指数的基金、期货期权等相关衍生工具的合约市值的资产比例不得低于基金资产净值的 90%，不低于非现金基金资产的 80%；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，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上。

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 2020 年 12 月 31 日
	经人民币汇率调整的恒生指数收益率增加 5%	13,244,171.72
	经人民币汇率调整的恒生指数收益率减少 5%	-13,244,171.72

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 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日，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中属于第一层次的余额为人民币 278,474,254.28 元，无划分为第二层次和第三层次的余额。

7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不将相关股票和可转换债券等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，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。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。

7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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工具第三层次公允价值本期末未发生变动。

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2021 年 3 月 26 日经本基金的基金管理人批准。

§ 7 年度财务报告财务报表（转型前）

7.1 资产负债表

会计主体：汇添富恒生指数分级证券投资基金

报告截止日：2020 年 11 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 11 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	46,724,121.91	18,764,865.82
结算备付金		89,831.72	37,757.13
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	384,134,222.24	262,884,753.83
其中：股票投资		384,134,222.24	262,884,753.83
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	185,871.60	3,710.39
应收股利		189,206.31	9,434.24
应收申购款		260,635.73	622,931.91
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		431,583,889.51	282,323,453.32
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 11 月 30 日	上年度末 2019 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		-	-
应付证券清算款		242.57	227.35
应付赎回款		5,348,061.21	2,425,240.92
应付管理人报酬		459,139.17	283,313.63
应付托管费		95,653.99	59,023.63
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	93,362.09	9,456.32
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	278,156.25	345,682.35
负债合计		6,274,615.28	3,122,944.20

所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	294,002,096.50	125,655,476.82
未分配利润	7.4.7.10	131,307,177.73	153,545,032.30
所有者权益合计		425,309,274.23	279,200,509.12
负债和所有者权益总计		431,583,889.51	282,323,453.32

注：报告截止日 2020 年 11 月 30 日，本基金份额净值 1.066 元，基金份额总额 399,122,158.12 份。其中，本基金下属恒生 A 基金份额净值 1.041 元，基金份额总额 68,089,692.00 份；本基金下属恒生 B 基金份额净值 1.091 元，基金份额总额 68,089,692.00 份；本基金下属添富恒生基金份额净值 1.066 元，基金份额总额 262,942,774.12 份。

7.2 利润表

会计主体：汇添富恒生指数分级证券投资基金

本报告期：2020 年 01 月 01 日至 2020 年 11 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 01 月 01 日 至 2020 年 11 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		-16,073,072.71	44,334,060.73
1. 利息收入		320,787.35	113,348.49
其中：存款利息收入	7.4.7.11	320,787.35	113,348.49
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）		1,761,635.26	15,011,887.98
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-1,446,866.79	7,498,095.27
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.14.2	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-5,287,456.51	-
股利收益	7.4.7.17	8,495,958.56	7,513,792.71
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-17,299,240.27	28,796,013.43
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-1,146,789.19	214,017.47
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	290,534.14	198,793.36
减：二、费用		5,975,088.66	4,940,028.58
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,887,520.36	3,512,480.49

2. 托管费	7.4.10.2.2	809,900.06	731,766.68
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.20	832,768.53	302,400.27
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		61.55	2,320.55
7. 其他费用	7.4.7.21	444,838.16	391,060.59
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-22,048,161.37	39,394,032.15
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-22,048,161.37	39,394,032.15

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富恒生指数分级证券投资基金

本报告期：2020 年 01 月 01 日至 2020 年 11 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 11 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	125,655,476.82	153,545,032.30	279,200,509.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-22,048,161.37	-22,048,161.37
三、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）	168,346,619.68	-189,693.20	168,156,926.48
其中：1. 基金申购款	662,366,562.98	33,284,340.76	695,650,903.74
2. 基金赎回款	-494,019,943.30	-33,474,033.96	-527,493,977.26
四、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）	-	-	-
五、期末所有者	294,002,096.50	131,307,177.73	425,309,274.23

项目	上年度可比期间		
	2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
权益(基金净值)			
一、期初所有者权益(基金净值)	227,299,520.58	134,757,591.10	362,057,111.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	39,394,032.15	39,394,032.15
三、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)	-101,644,043.76	-20,606,590.95	-122,250,634.71
其中：1. 基金申购款	175,921,855.81	11,799,526.61	187,721,382.42
2. 基金赎回款	-277,565,899.57	-32,406,117.56	-309,972,017.13
四、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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	125,655,476.82	153,545,032.30	279,200,509.12

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

汇添富恒生指数分级证券投资基金（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[2013]1247 号文《关于核准汇添富恒生指数分级证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人汇添富基金管理股份有限公司向社会公开

发行募集，基金合同于 2014 年 3 月 6 日正式生效，首次设立募集规模为 1,270,631,138.98 份基金份额。

2020 年 10 月 29 日，汇添富恒生指数分级证券投资基金基金份额持有人大会以现场方式召开，大会表决通过了《关于汇添富恒生指数分级证券投资基金转型的议案》，持有人大会决议生效公告日为 2020 年 10 月 30 日。根据转型安排，本基金以 2020 年 11 月 30 日为基金份额转换基准日，将该基准日在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司登记在册的添富恒生份额、恒生 A 份额与恒生 B 份额将转换为汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）的 A 类基金份额的场内份额，在中国证券登记结算有限责任公司登记在册的添富恒生份额将转换为汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）的 A 类基金份额的场外份额。

根据 2020 年 12 月 2 日发布的《汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富恒生指数分级证券投资基金基金份额转换结果的公告》，本基金以 2020 年 11 月 30 日为基金份额转换基准日，将恒生 A 份额与恒生 B 份额转换为 136,179,383.00 份添富恒生份额的场内份额，之后将添富恒生份额的场内份额和场外份额分别转换为汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）A 类基金份额的场内份额和场外份额，分别为 143,224,278.00 份和 255,897,879.12 份。

自 2020 年 12 月 1 日起，《汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）基金合同》生效。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司，境外托管人为香港上海汇丰银行有限公司(The Hong Kong and Shanghai Banking Co., Ltd.)。

本基金主要投资于标的指数的成份股、备选成份股、替代性股票。为更好地实现投资目标，基金还可投资于债券、基金（包括股票基金、债券基金、交易所交易基金等）、金融衍生工具（包括远期合约、互换、期货、期权、权证等）、符合证监会要求的银行存款等货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金非现金资产的 80%。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：经人民币汇率调整的恒生指数收益率 $\times 95\%$ + 商业银行活期存款利率（税后） $\times 5\%$ 。

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、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证

券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证监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〉》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

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 2020 年 11 月 30 日（基金合同失效前日）的财务状况以及 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 11 月 30 日（基金合同失效前日）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

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

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 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 11 月 30 日（基金合同失效前日）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分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

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主要包括股票投资。

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

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的股票，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；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

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；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

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。

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。

本基金持有的金融工具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) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 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，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，实际发生时计入转融通证券出借业务利息收入；

(5) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(6) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(7) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 基金投资收益/（损失）于卖出/赎回基金成交日确认，并按卖出/赎回基金成交金额与其成本的差额入账；

(9) 资产支持证券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(10) 股指/国债期货投资收益/（损失）于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(11) 权证收益/（损失）于卖出成交日确认，并按卖出成交金额与其成本的差额入账；

(12) 股票股利收益于除息日确认，并按宣告的分红派息比例计算的金额扣除股票所在地适用的预缴所得税后的净额入账；基金投资在持有期间取得的红利于除息日确认；

(13) 公允价值变动收益/（损失）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；

(14) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他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) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 30%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，场外投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为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。场内基金份额收益分配方式只能为现金分红；场内基金份额具体收益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及登记机构的相关规定；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 每一基金份额享有同等分配权；

(5) 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。

7.4.5 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。

7.4.6.1 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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 2020 年 11 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	46,724,121.91	18,764,865.82
定期存款	-	-
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	-	-
合计	46,724,121.91	18,764,865.82

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 11 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	382,679,008.76	384,134,222.24	1,455,213.48
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	382,679,008.76	384,134,222.24	1,455,213.48
项目	上年度末 2019年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	244,130,300.08	262,884,753.83	18,754,453.75
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	244,130,300.08	262,884,753.83	18,754,453.75

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年11月30日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	180,617.36	3,710.39
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	5,254.24	-
应收债券利息	-	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	-	-

合计	185,871.60	3,710.39
----	------------	----------

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年11月30日	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	93,362.09	9,456.32
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	93,362.09	9,456.32

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年11月30日	上年度末 2019年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	8,058.82
应付证券出借违约金	-	-
应付审计费	82,376.50	90,000.00
应付信息披露费	109,836.45	220,000.00
应付指数使用费	31,026.75	27,623.53
应付账户维护费	-	-
应付汇划费	-	-
应付上市费	54,916.55	-
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	278,156.25	345,682.35

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年11月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	226,599,184.67	125,655,476.82
本期申购	662,366,562.98	662,366,562.98
本期赎回（以“-”号填列）	-494,019,943.30	-494,019,943.30

基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	4,176,353.77	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	399,122,158.12	294,002,096.50

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	60,913,437.88	92,631,594.42	153,545,032.30
本期利润	-4,748,921.10	-17,299,240.27	-22,048,161.37
本期基金份额交易产生的变动数	-30,923,328.73	30,733,635.53	-189,693.20
其中：基金申购款	-123,622,592.72	156,906,933.48	33,284,340.76
基金赎回款	92,699,263.99	-126,173,297.95	-33,474,033.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	25,241,188.05	106,065,989.68	131,307,177.73

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年 11月30日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年 12月31日
活期存款利息收入	296,074.08	103,139.28
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	21,010.40	9,983.14
其他	3,702.87	226.07
合计	320,787.35	113,348.49

注：“其他”为直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年11 月30日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12 月31日

卖出股票成交总额	138,171,402.03	127,032,848.18
减：卖出股票成本总额	139,618,268.82	119,534,752.91
买卖股票差价收入	-1,446,866.79	7,498,095.27

7.4.7.13 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。

7.4.7.14 债券投资收益

7.4.7.14.1 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。

7.4.7.14.2 资产支持证券投资收益

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。

7.4.7.15 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——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 11 月 30 日	上年度可比期间收益金额 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日
卖出权证成本总额	-	-
买卖权证差价收入应缴增值税	-	-
买卖权证差价收入	-	-
国债期货投资收益	-	-
股指期货投资收益	-5,287,456.51	-
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投资收益。

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 11 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	8,495,958.56	7,513,792.71
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	8,495,958.56	7,513,792.71
----	--------------	--------------

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2020年01月01日至2020年11月30日	2019年01月01日至2019年12月31日
1. 交易性金融资产	-17,299,240.27	28,796,013.43
——股票投资	-17,299,240.27	28,796,013.43
——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	-	-
——权证投资	-	-
——期货投资	-	-
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	-17,299,240.27	28,796,013.43

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年01月01日至2020年11月30日	2019年01月01日至2019年12月31日
基金赎回费收入	290,534.14	198,793.36
替代损益	-	-
其他	-	-
合计	290,534.14	198,793.36

7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年01月01日至2020年11月30日	2019年01月01日至2019年12月31日
交易所市场交易费用	832,768.53	302,400.27

银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
合计	832,768.53	302,400.27

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年11 月30日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12 月31日
审计费用	82,376.50	90,000.00
信息披露费	109,836.45	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	-	-
银行费用	7,704.59	3,977.83
指数使用费	129,584.00	117,082.76
持有人大会- 公证费	10,000.00	-
持有人大会- 律师费	50,000.00	-
开户费	-	-
上市费	54,916.55	60,000.00
其他	420.07	-
合计	444,838.16	391,060.59

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

2020年10月29日，汇添富恒生指数分级证券投资基金基金份额持有人大会以现场方式召开，大会表决通过了《关于汇添富恒生指数分级证券投资基金转型的议案》，持有人大会决议生效公告日为2020年10月30日。根据转型安排，本基金以2020年11月30日为基金份额转换基准日，将该基准日在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司登记在册的添富恒生份额、恒生A份额与恒生B份额将转换为汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）的A类基金份额的场内份额，在中国证券登记结算有限责任公司登记在册的添富恒生份额将转换为汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）的A类基金份额的场外份额。

根据2020年12月2日发布的《汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富恒生指数分

级证券投资基金基金份额转换结果的公告》，本基金以 2020 年 11 月 30 日为基金份额转换基准日，将恒生 A 份额与恒生 B 份额转换为 136,179,383.00 份添富恒生份额的场内份额，之后将添富恒生份额的场内份额和场外份额分别转换为汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）A 类基金份额的场内份额和场外份额，分别为 143,224,278.00 份和 255,897,879.12 份。

自 2020 年 12 月 1 日起，《汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）基金合同》生效。

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
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	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”）	基金境外托管人
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东
东航金控有限责任公司	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
上海上报资产管理有限公司	基金管理人的股东
汇添富资产管理（香港）有限公司	基金管理人的子公司
汇添富资本管理有限公司	基金管理人的子公司
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

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 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 11 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 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	389,397,599.49	93.53	140,218,559.85	98.18

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 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。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 11 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	311,518.70	97.47	93,362.09	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 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	112,175.53	99.31	9,456.32	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。

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 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 11 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,887,520.36	3,512,480.49
其中：支付销售机构的客户维护费	627,368.36	435,872.88

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.20% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授

权委托书，于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 11 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	809,900.06	731,766.68

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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：本基金本报告期末不存在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。

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：本基金本报告期末不存在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。

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

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

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 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 11 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 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
农业银行	23,399,765.97	296,022.01	12,716,192.08	92,328.57
汇丰银行	23,324,355.94	52.07	6,048,673.74	10,810.71

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。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

7.4.12 期末（2020 年 11 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 2020 年 11 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金融资产款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2020 年 11 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金融资产款余额。

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 2020 年 11 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%，且同一基金管理人管理的全部基金不得持有同一机构 10%以上具有投票权的证券发行总量。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。

本基金所持证券均在证券交易所上市；因此，本报告期末本基金的资产均能及时变现。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。本基金的生息资产主要为银行存款及部分应收申购款等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年11 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	46,724,121.91	-	-	-	-	-	46,724,121.91
结算备付金	-	-	-	-	-	89,831.72	89,831.72
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	-	384,134,222.24	384,134,222.24

应收股利	-	-	-	-	-	189,206.31	189,206.31
应收利息	-	-	-	-	-	185,871.60	185,871.60
应收申购款	31,837.91	-	-	-	-	228,797.82	260,635.73
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	46,755,959.82	-	-	-	-	384,827,929.69	431,583,889.51
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,348,061.21	5,348,061.21
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	459,139.17	459,139.17
应付托管费	-	-	-	-	-	95,653.99	95,653.99
应付证券清算款	-	-	-	-	-	242.57	242.57
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售	-	-	-	-	-	-	-

服务费							
应付交易费用	-	-	-	-	-	93,362.09	93,362.09
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	278,156.25	278,156.25
负债总计	-	-	-	-	-	6,274,615.28	6,274,615.28
利率敏感度缺口	46,755,959.82	-	-	-	-	378,553,314.41	425,309,274.23
上年度末 2019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	18,764,865.82	-	-	-	-	-	18,764,865.82
结算备付金	-	-	-	-	-	37,757.13	37,757.13
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	-	262,884,753.83	262,884,753.83
应收股利	-	-	-	-	-	9,434.24	9,434.24
应收利息	-	-	-	-	-	3,710.39	3,710.39
应收申购	23,219.30	-	-	-	-	599,712.61	622,931.91

款							
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	18,788,085.12	-	-	-	-	263,535,368.20	282,323,453.32
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,425,240.92	2,425,240.92
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	283,313.63	283,313.63
应付托管费	-	-	-	-	-	59,023.63	59,023.63
应付证券清算款	-	-	-	-	-	227.35	227.35
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	9,456.32	9,456.32
应交	-	-	-	-	-	-	-

税费							
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	345,682.35	345,682.35
负债总计	-	-	-	-	-	3,122,944.20	3,122,944.20
利率敏感 度缺 口	18,788,085.12	-	-	-	-	260,412,424.00	279,200,509.12

注：上表统计了本基金资产和负债的利率风险敞口。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

注：本基金本报告期末及上年度末计息资产仅包括银行活期存款及部分应收申购款，且均以活期存款利率或相对固定的利率计息；假定利率变动仅影响其未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因而在本基金本报告期末及上年度末未持有其他计息资产/负债的情况下，利率变动对基金资产净值的影响并不显著。

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 2020 年 11 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	342.00	23,324,128.16	-	23,324,470.16
结算备付金	-	89,831.72	-	89,831.72
存出保证	-	-	-	-

金				
交易性金融资产	-	384,134,222.24	-	384,134,222.24
衍生金融资产	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
应收利息	-	16.27	-	16.27
应收股利	-	116,607.68	-	116,607.68
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产总计/增发证券	342.00	407,664,806.07	-	407,665,148.07
以外币计价的负债				
短期借款	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-
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 外汇风险敞口 净额	342.00	407,664,806.07	-	407,665,148.07
	上年度末 2019 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	362.34	6,048,430.71	-	6,048,793.05
结算备付金	-	37,757.13	-	37,757.13
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	262,884,753.83	-	262,884,753.83
衍生金融资产	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-
应收股利	-	9,434.24	-	9,434.24
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产总计/增发证券	362.34	268,980,375.91	-	268,980,738.25
以外币计价的负债				
短期借款	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
应付证券	-	-	-	-

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	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-
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	362.34	268,980,375.91	-	268,980,738.25

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 2020 年 11 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	港币相对人民币贬值 5%	-20,383,240.30	-13,449,018.80
	港币相对人民币升值 5%	20,383,240.30	13,449,018.80
	美元相对人民币贬值 5%	-17.10	-18.12
	美元相对人民币升值 5%	17.10	18.12

7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格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除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

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 2020 年 11 月 30 日		上年度末 2019 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	384,134,222.24	90.32	262,884,753.83	94.16
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	384,134,222.24	90.32	262,884,753.83	94.16

注：本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金非现金资产的 80%。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上。

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 2020 年 11 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	经人民币汇率调整的恒生指数收益率增加 5%	18,993,423.02	13,214,572.40
	经人民币汇率调整的恒生指数收益率减少 5%	-18,993,423.02	-13,214,572.40

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 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 11 月 30 日（基金合同失效前日），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中属于第一层次的余额为人民币 384,134,222.24 元，无划分为第二层次和第三层次的余额（于 2019 年 12 月 31 日，属于第一层次的余额为人民币 262,884,753.83 元，无划分为第二层次和第三层次的余额）。

7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不将相关股票和可转换债券等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，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。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。

7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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工具第三层次公允价值本期未发生变动。

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2021 年 3 月 26 日经本基金的基金管理人批准。

§ 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	278,474,254.28	77.98
	其中：普通股	274,790,227.67	76.95
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	3,684,026.61	1.03
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	22,913,579.66	6.42
8	其他各项资产	55,703,494.18	15.60
9	合计	357,091,328.12	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 262,496,156.53 元，占期末净值比例为 88.58%。

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	278,474,254.28	93.97
合计	278,474,254.28	93.97

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

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
10 能源	6,679,642.20	2.25
15 原材料	-	-
20 工业	6,428,924.20	2.17
25 可选消费	46,835,405.99	15.80
30 日常消费	6,893,031.60	2.33
35 医疗保健	12,485,303.53	4.21
40 金融	117,931,581.52	39.80
45 信息技术	17,102,318.37	5.77
50 电信服务	34,124,714.61	11.52
55 公用事业	9,147,347.69	3.09
60 房地产	20,845,984.57	7.03
合计	278,474,254.28	93.97

8.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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	AIA Group Limited	友邦保险控股	1299 HK	香港联合交易	中国香港	365,000	29,183,867.00	9.85

		有限公司		所				
2	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股有限公司	700 HK	香港联合交易所	中国香港	55,900	26,534,889.26	8.95
3	HSBC Holdings PLC	汇丰控股有限公司	5 HK	香港联合交易所	中国香港	624,400	21,414,940.65	7.23
4	China Construction Bank Corporation	中国建设银行股份有限公司	939 HK	香港联合交易所	中国香港	3,266,000	16,190,409.85	5.46
5	Ping An Insurance (Group) Company of China, Ltd.	中国平安保险(集团)股份有限公司	2318 HK	香港联合交易所	中国香港	180,000	14,392,044.00	4.86

		公司						
6	Meituan	美团	369 0 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	55,800	13,835,450.6 4	4.67
7	Xiaomi Corporation	小米 集团	181 0 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	473,400	13,227,954.8 8	4.46
8	Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd.	香港 交易 及 结 算 所 有 限 公 司	388 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	36,400	13,020,170.8 0	4.39
9	Alibaba Group Holding Limited	阿 里 巴 巴 集 团 控 股 有 限 公 司	998 8 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	62,800	12,294,071.1 4	4.15
1 0	Industrial and Commercial Bank of China Limited	中 国 工 商	139 8 HK	香 港 联 合	中 国 香 港	2,227,00 0	9,427,891.37	3.18

		银行 股份 有限 公司		交 易 所				
1 1	Wuxi Biologics (Cayman) Inc	药明生 物技 术有 限公 司	226 9 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	98,500	8,522,278.31	2.88
1 2	China Mobile Limited	中 国 移 动 有 限 公 司	941 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	185,500	6,900,690.52	2.33
1 3	Bank of China Limited	中 国 银 行 股 份 有 限 公 司	398 8 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	2,398,00 0	5,348,369.71	1.80
1 4	Techtronic Industries Co. Ltd.	创 科 实 业 有 限 公 司	669 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	47,000	4,375,013.05	1.48

1 5	Geely Automobile Holdings Limited	吉利汽车控股有限公司	175 HK	香港联合交易所	中国香港	178,000	3,970,015.88	1.34
1 6	CK Hutchison Holdings Limited	长江和记实业有限公司	1 HK	香港联合交易所	中国香港	81,608	3,715,834.54	1.25
1 7	Link Real Estate Investment Trust	领展房地产投资信托基金	823 HK	香港联合交易所	中国香港	62,000	3,684,026.61	1.24
1 8	CLP Holdings Ltd.	中电控股有限公司	2 HK	香港联合交易所	中国香港	61,000	3,681,080.87	1.24
1 9	ANTA Sports Products Limited	安踏体育用品	202 0 HK	香港联合交	中国香港	33,000	3,413,439.35	1.15

		品有限公司		易所				
20	Galaxy Entertainment Group Limited	银河娱乐集团有限公司	27 HK	香港联合交易所	中国香港	65,000	3,296,072.65	1.11
21	China Mengniu Dairy Co. Ltd.	中国蒙牛乳业有限公司	2319 HK	香港联合交易所	中国香港	83,000	3,269,266.42	1.10
22	CNOOC Limited	中国海洋石油有限公司	883 HK	香港联合交易所	中国香港	539,000	3,257,163.63	1.10
23	China Life Insurance Company Limited	中国人寿保险股份有限公司	2628 HK	香港联合交易所	中国香港	225,000	3,238,209.90	1.09

		限公司						
2 4	Shenzhou International Group Holdings Ltd.	申洲国际集团控股有限公司	231 3 HK	香港联合交易所	中国香港	25,000	3,198,232.00	1.08
2 5	The Hong Kong and China Gas Co. Ltd.	香港中华煤气有限公司	3 HK	香港联合交易所	中国香港	322,209	3,140,310.52	1.06
2 6	Sunny Optical Technology (Group) Company Limited	舜宇光学科技(集团)有限公司	238 2 HK	香港联合交易所	中国香港	21,500	3,070,765.62	1.04
2 7	Sun Hung Kai Properties Ltd.	新鸿基地产发展	16 HK	香港联合交易所	中国香港	35,000	2,945,740.00	0.99

		有限公司						
28	CK Asset Holdings Limited	长江实业集团有限公司	1113 HK	香港联合交易所	中国香港	78,108	2,616,404.92	0.88
29	Hang Seng Bank Ltd.	恒生银行有限公司	11 HK	香港联合交易所	中国香港	23,100	2,599,379.89	0.88
30	China Resources Land Limited	华润置地有限公司	1109 HK	香港联合交易所	中国香港	96,000	2,585,518.08	0.87
31	Sands China Ltd.	金沙中国有限公司	1928 HK	香港联合交易所	中国香港	85,600	2,453,111.28	0.83
32	BOC Hong Kong (Holdings) Limited	中银香港(控股)	2388 HK	香港联合交易所	中国香港	111,500	2,205,307.21	0.74

		有限公司		所				
333	Sino Biopharmaceutical Limited	中国生物制药有限公司	1177 HK	香港联合交易所	中国香港	341,500	2,155,650.45	0.73
334	China Petroleum & Chemical Corporation	中国石油化工股份有限公司	386 HK	香港联合交易所	中国香港	732,000	2,137,799.27	0.72
335	Country Garden Holdings Co. Ltd	碧桂园控股有限公司	2007 HK	香港联合交易所	中国香港	233,000	2,102,214.73	0.71
336	CSPC Pharmaceutical Group Limited	石药集团有限公司	1093 HK	香港联合交易所	中国香港	270,800	1,807,374.77	0.61
3	Wharf Real	九	199	香	中	50,000	1,698,008.70	0.57

7	Estate Investment Company Limited	龙仓置业地产投资有限公司	7 HK	港 联 合 交 易 所	国 香 港			
3 8	MTR Corporation Ltd.	香港铁路有限公司	66 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	46,500	1,696,556.87	0.57
3 9	China Overseas Land & Investment Ltd.	中国海外发展有限公司	688 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	115,500	1,638,950.82	0.55
4 0	Power Assets Holdings Limited	电能实业有限公司	6 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	42,000	1,484,652.96	0.50
4 1	New World Development Co. Ltd.	新世界发展有	17 HK	香 港 联 合 交 易	中 国 香 港	46,250	1,405,223.19	0.47

		限公司		所				
4 2	WH Group Limited	万洲国际有限公司	288 HK	香港联合交易所	中国香港	244,500	1,337,576.37	0.45
4 3	Budweiser Brewing Company APAC Limited	百威亚太控股有限公司	187 6 HK	香港联合交易所	中国香港	60,000	1,292,759.04	0.44
4 4	Petrochina Company Limited	中国石油天然气股份有限公司	857 HK	香港联合交易所	中国香港	636,000	1,284,679.30	0.43
4 5	Henderson Land Development Co. Ltd.	恒基兆业地产有限公司	12 HK	香港联合交易所	中国香港	43,991	1,119,993.70	0.38

4 6	Hang Lung Properties Ltd.	恒隆地产有限公司	101 HK	香港联合交易所	中国香港	61,000	1,049,903.82	0.35
4 7	CITIC Limited	中国中信股份有限公司	267 HK	香港联合交易所	中国香港	220,000	1,016,532.79	0.34
4 8	Hengan International Group Company Limited	恒安国际集团有限公司	104 4 HK	香港联合交易所	中国香港	21,500	993,429.77	0.34
4 9	Bank of Communications Co.,Ltd.	交通银行股份有限公司	332 8 HK	香港联合交易所	中国香港	264,000	910,991.14	0.31
5 0	CK Infrastructure Holdings Limited	长江基建集团	103 8 HK	香港联合交易所	中国香港	24,000	841,303.34	0.28

		有限公司		所				
5 1	AAC Technologies Holdings Inc.	瑞声科技控股有限公司	2018 HK	香港联合交易所	中国香港	22,000	803,597.87	0.27
5 2	China Unicom (Hong Kong) Ltd.	中国联合网络通信(香港)股份有限公司	762 HK	香港联合交易所	中国香港	184,000	689,134.83	0.23

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。

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	占期末基金资产净值比例（%）
1	Meituan	3690 HK	17,285,532.08	5.83

2	Alibaba Group Holding Limited	9988 HK	5,958,909.59	2.01
3	ANTA Sports Products Limited	2020 HK	3,632,760.48	1.23
4	Budweiser Brewing Company APAC Limited	1876 HK	1,635,536.78	0.55
5	Wharf Real Estate Investment Company Limited	1997 HK	396,437.20	0.13

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	占期末基金资产净值比例（%）
1	AIA Group Limited	1299 HK	13,463,920.40	4.54
2	HSBC Holdings PLC	5 HK	12,289,920.41	4.15
3	Tencent Holdings Ltd	700 HK	11,848,708.17	4.00
4	China Construction Bank Corporation	939 HK	9,093,224.68	3.07
5	Alibaba Group Holding Limited	9988 HK	8,646,224.33	2.92
6	Ping An Insurance (Group) Company of China, Ltd.	2318 HK	8,092,853.69	2.73
7	Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd.	388 HK	6,863,989.91	2.32
8	Xiaomi Corporation	1810 HK	6,462,923.71	2.18
9	Industrial and Commercial Bank of China Limited	1398 HK	5,111,667.99	1.72
10	China Mobile Limited	941 HK	3,940,862.20	1.33
11	Meituan	3690 HK	3,460,595.32	1.17
12	Bank of China Limited	3988 HK	3,009,374.14	1.02
13	Wuxi Biologics	2269 HK	2,987,620.13	1.01

	(Cayman) Inc			
14	CK Hutchison Holdings Limited	1 HK	2,106,373.63	0.71
15	CLP Holdings Ltd.	2 HK	2,068,540.78	0.70
16	Link Real Estate Investment Trust	823 HK	2,059,824.82	0.70
17	Geely Automobile Holdings Limited	175 HK	1,952,254.78	0.66
18	Techtronic Industries Co. Ltd.	669 HK	1,947,723.71	0.66
19	Galaxy Entertainment Group Limited	27 HK	1,883,031.06	0.64
20	China Life Insurance Company Limited	2628 HK	1,835,126.86	0.62

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	28,909,176.13
卖出收入（成交）总额	141,672,054.50

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

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

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

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国证监会及其派出机构、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。

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	应收证券清算款	54,966,410.86
3	应收股利	5,704.16
4	应收利息	3,273.12
5	应收申购款	728,106.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	55,703,494.18

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	384,134,222.24	89.01
	其中：普通股	378,536,394.92	87.71
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-

	房地产信托	5,597,827.32	1.30
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	46,813,953.63	10.85
8	其他各项资产	635,713.64	0.15
9	合计	431,583,889.51	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 361,521,087.60 元，占期末净值比例为 85.00%。

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	384,134,222.24	90.32
合计	384,134,222.24	90.32

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

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
10 能源	11,305,150.04	2.66
15 原材料	-	-
20 工业	10,419,147.05	2.45
25 可选消费	40,972,692.81	9.63

30 日常消费	7,897,986.11	1.86
35 医疗保健	15,260,695.68	3.59
40 金融	177,737,980.75	41.79
45 信息技术	22,103,389.50	5.20
50 电信服务	51,001,994.82	11.99
55 公用事业	14,327,323.71	3.37
60 房地产	33,107,861.77	7.78
合计	384,134,222.24	90.32

8.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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	AIA Group Limited	友邦保险控股有限公司	1299 HK	香港联合交易所	中国香港	539,600	38,902,201.10	9.15
2	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股有限公司	700 HK	香港联合交易所	中国香港	80,500	38,462,997.41	9.04

		司						
3	HSBC Holdings PLC	汇丰控股有限公司	5 HK	香港联合交易所	中国香港	976,000	34,374,529.6 8	8.08
4	China Construction Bank Corporation	中国建设银行股份有限公司	939 HK	香港联合交易所	中国香港	5,102,000	26,325,879.1 9	6.19
5	Ping An Insurance (Group) Company of China, Ltd.	中国平安保险(集团)股份有限公司	231 8 HK	香港联合交易所	中国香港	281,000	21,701,340.5 7	5.10
6	Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd.	香港交易及结算所有	388 HK	香港联合交易所	中国香港	56,800	18,577,997.3 4	4.37

		限公司						
7	Alibaba Group Holding Limited	阿里巴巴集团控股有限公司	9988 HK	香港联合交易所	中国香港	76,700	17,015,307.32	4.00
8	Xiaomi Corporation	小米集团	1810 HK	香港联合交易所	中国香港	738,000	16,597,439.19	3.90
9	Industrial and Commercial Bank of China Limited	中国工商银行股份有限公司	1398 HK	香港联合交易所	中国香港	3,479,000	14,526,412.82	3.42
10	China Mobile Limited	中国移动有限公司	941 HK	香港联合交易所	中国香港	289,500	11,400,014.38	2.68
11	Wuxi Biologics (Cayman) Inc	药明	2269	香港	中国	138,000	9,006,255.77	2.12

		生物技术有限公司	HK	联合交易所	香港			
1 2	Bank of China Limited	中国银行股份有限公司	398 8 HK	香港联合交易所	中国香港	3,746,000	8,710,782.83	2.05
1 3	CK Hutchison Holdings Limited	长江和记实业有限公司	1 HK	香港联合交易所	中国香港	127,108	6,067,841.98	1.43
1 4	CLP Holdings Ltd.	中电控股有限公司	2 HK	香港联合交易所	中国香港	95,500	5,900,293.31	1.39
1 5	Techtronic Industries Co. Ltd.	创科实业有限公司	669 HK	香港联合交易所	中国香港	69,000	5,817,760.15	1.37

1 6	CNOOC Limited	中国海洋石油有限公司	883 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	842,000	5,809,536.54	1.37
1 7	Link Real Estate Investment Trust	领展房地产投资信托基金	823 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	97,000	5,597,827.32	1.32
1 8	China Life Insurance Company Limited	中国人寿保险股份有限公司	262 8 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	351,000	5,236,786.13	1.23
1 9	Galaxy Entertainment Group Limited	银河娱乐集团有限公司	27 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	102,000	5,107,296.06	1.20
2	The Hong Kong	香	3	香	中	503,209	5,099,077.08	1.20

0	and China Gas Co. Ltd.	港中华煤气有限公司	HK	港联合交易所	国香港			
2 1	Geely Automobile Holdings Limited	吉利汽车控股有限公司	175 HK	香港联合交易所	中国香港	278,000	5,084,297.10	1.20
2 2	Sun Hung Kai Properties Ltd.	新鸿基地产发展有限公司	16 HK	香港联合交易所	中国香港	54,500	4,787,135.30	1.13
2 3	Sunny Optical Technology (Group) Company Limited	舜宇光学科技(集团)有限公司	238 2 HK	香港联合交易所	中国香港	33,600	4,345,733.55	1.02
2 4	Shenzhou International	申洲	231 3	香港	中国	39,000	4,342,474.66	1.02

	Group Holdings Ltd.	国际集团控股有限公司	HK	联合交易所	香港			
2 5	China Resources Land Limited	华润置地有限公司	110 9 HK	香港联合交易所	中国香港	152,000	4,334,327.42	1.02
2 6	China Mengniu Dairy Co. Ltd.	中国蒙牛乳业有限公司	231 9 HK	香港联合交易所	中国香港	130,000	4,324,822.32	1.02
2 7	Hang Seng Bank Ltd.	恒生银行有限公司	11 HK	香港联合交易所	中国香港	36,100	4,139,056.94	0.97
2 8	CK Asset Holdings Limited	长江实业集团有限公司	111 3 HK	香港联合交易所	中国香港	113,108	4,074,833.50	0.96

		公司						
29	BOC Hong Kong (Holdings) Limited	中银香港 (控股) 有限公司	2388 HK	香港联合交易所	中国香港	174,500	3,739,346.10	0.88
30	Sands China Ltd.	金沙中国有限公司	1928 HK	香港联合交易所	中国香港	133,600	3,605,557.52	0.85
31	Sino Biopharmaceutical Limited	中国生物制药有限公司	1177 HK	香港联合交易所	中国香港	534,500	3,538,190.10	0.83
32	China Petroleum & Chemical Corporation	中国石油化工股份有限公司	386 HK	香港联合交易所	中国香港	1,144,000	3,407,783.46	0.80
33	Country Garden Holdings Co. Ltd	碧桂园	2007	香港	中国	361,000	3,137,227.47	0.74

		园 控 股 有 限 公 司	HK	联 合 交 易 所	香 港			
3 4	China Overseas Land & Investment Ltd.	中 国 海 外 发 展 有 限 公 司	688 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	181,000	2,897,070.83	0.68
3 5	CSPC Pharmaceutical Group Limited	石 药 集 团 有 限 公 司	109 3 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	422,800	2,716,249.81	0.64
3 6	MTR Corporation Ltd.	香 港 铁 路 有 限 公 司	66 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	72,500	2,587,276.58	0.61
3 7	New World Development Co. Ltd.	新 世 界 发 展 有 限 公 司	17 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	72,250	2,409,734.81	0.57
3 8	Power Assets Holdings Limited	电 能	6 HK	香 港	中 国	65,500	2,267,985.71	0.53

		实业有限公司		联合交易所	香港			
39	Petrochina Company Limited	中国石油天然气股份有限公司	857 HK	香港联合交易所	中国香港	996,000	2,087,830.04	0.49
40	WH Group Limited	万洲国际有限公司	288 HK	香港联合交易所	中国香港	382,000	2,052,134.98	0.48
41	Henderson Land Development Co. Ltd.	恒基兆业地产有限公司	12 HK	香港联合交易所	中国香港	68,991	1,902,894.24	0.45
42	CITIC Limited	中国中信股份有	267 HK	香港联合交易所	中国香港	343,000	1,764,028.49	0.41

		限公司						
4 3	Hang Lung Properties Ltd.	恒隆地产有限公司	101 HK	香港联合交易所	中国香港	95,000	1,549,586.55	0.36
4 4	Wharf Real Estate Investment Company Limited	九龙仓置业地产投资有限公司	199 7 HK	香港联合交易所	中国香港	50,000	1,529,727.68	0.36
4 5	Hengan International Group Company Limited	恒安国际集团有限公司	104 4 HK	香港联合交易所	中国香港	33,500	1,521,028.81	0.36
4 6	Bank of Communications Co., Ltd.	交通银行股份有限公司	332 8 HK	香港联合交易所	中国香港	413,000	1,503,648.05	0.35

4 7	AAC Technologies Holdings Inc.	瑞声科技控股有限公司	2018 HK	香港联合交易所	中国香港	31,500	1,160,216.76	0.27
4 8	China Unicom (Hong Kong) Ltd.	中国联合网络通信(香港)股份有限公司	762 HK	香港联合交易所	中国香港	288,000	1,138,983.03	0.27
4 9	CK Infrastructure Holdings Limited	长江基建集团有限公司	1038 HK	香港联合交易所	中国香港	31,500	1,059,967.61	0.25
5 0	Swire Pacific Ltd.	太古股份有限公司 A	19 HK	香港联合交易所	中国香港	23,500	887,496.65	0.21

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。

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	HSBC Holdings PLC	5 HK	29,596,139.59	10.60
2	AIA Group Limited	1299 HK	24,722,794.34	8.85
3	Tencent Holdings Ltd	700 HK	21,938,026.67	7.86
4	Alibaba Group Holding Limited	9988 HK	20,174,432.42	7.23
5	China Construction Bank Corporation	939 HK	18,728,744.32	6.71
6	Xiaomi Corporation	1810 HK	15,729,053.89	5.63
7	Ping An Insurance (Group) Company of China, Ltd.	2318 HK	14,354,347.63	5.14
8	Industrial and Commercial Bank of China Limited	1398 HK	10,403,804.72	3.73
9	Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd.	388 HK	10,320,734.89	3.70
10	China Mobile Limited	941 HK	9,274,283.13	3.32
11	Wuxi Biologics (Cayman) Inc	2269 HK	8,390,562.64	3.01
12	Bank of China Limited	3988 HK	6,769,342.63	2.42
13	CLP Holdings Ltd.	2 HK	4,069,847.38	1.46
14	CK Hutchison Holdings Limited	1 HK	3,863,955.47	1.38
15	CNOOC Limited	883 HK	3,857,158.24	1.38
16	The Hong Kong and China Gas Co. Ltd.	3 HK	3,755,892.54	1.35

17	China Resources Land Limited	1109 HK	3,476,171.62	1.25
18	Link Real Estate Investment Trust	823 HK	3,403,950.99	1.22
19	China Life Insurance Company Limited	2628 HK	3,374,283.41	1.21
20	Techtronic Industries Co. Ltd.	669 HK	3,185,298.85	1.14

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	Tencent Holdings Ltd	700 HK	22,893,350.97	8.20
2	AIA Group Limited	1299 HK	13,729,470.95	4.92
3	HSBC Holdings PLC	5 HK	10,402,596.49	3.73
4	China Construction Bank Corporation	939 HK	9,415,247.61	3.37
5	Ping An Insurance (Group) Company of China, Ltd.	2318 HK	7,347,043.83	2.63
6	Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd.	388 HK	6,225,406.79	2.23
7	Industrial and Commercial Bank of China Limited	1398 HK	5,141,220.21	1.84
8	China Mobile Limited	941 HK	4,980,593.20	1.78
9	Bank of China Limited	3988 HK	3,547,086.38	1.27
10	CNOOC Limited	883 HK	2,213,939.67	0.79
11	China Shenhua Energy Company Limited	1088 HK	2,027,859.61	0.73
12	CK Hutchison Holdings Limited	1 HK	2,024,381.02	0.73

13	China Life Insurance Company Limited	2628 HK	2,008,897.37	0.72
14	Techtronic Industries Co. Ltd.	669 HK	1,895,357.91	0.68
15	CK Asset Holdings Limited	1113 HK	1,877,741.16	0.67
16	The Hong Kong and China Gas Co. Ltd.	3 HK	1,861,578.88	0.67
17	CLP Holdings Ltd.	2 HK	1,832,978.53	0.66
18	Alibaba Group Holding Limited	9988 HK	1,827,917.65	0.65
19	China Resources Land Limited	1109 HK	1,740,297.77	0.62
20	Galaxy Entertainment Group Limited	27 HK	1,696,641.70	0.61

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	278,166,977.50
卖出收入（成交）总额	138,171,402.03

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

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

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

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国证监会及其派出机构、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。

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	应收证券清算款	-
3	应收股利	189,206.31
4	应收利息	185,871.60
5	应收申购款	260,635.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	635,713.64

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（%）

				(%)		
汇添富恒生指数（QDII-LOF）A	22,103	12,314.19	50,946,159.00	18.72	221,234,486.16	81.28
汇添富恒生指数（QDII-LOF）C	119	6,326.89	0.00	0.00	752,900.38	100.00
合计	22,222	12,282.13	50,946,159.00	18.67	221,987,386.54	81.33

9.2 期末上市基金前十名持有人

汇添富恒生指数（QDII-LOF）A			
序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	杨继耘	5,628,771.00	7.92
2	廖雪静	5,126,367.00	7.21
3	李燕欢	1,892,663.00	2.66
4	郭峰	953,801.00	1.34
5	何惠忠	910,672.00	1.28
6	中国国际金融股份有限公司	908,223.00	1.28
7	王鹏	890,105.00	1.25
8	吴旋玲	820,423.00	1.15
9	陈远亮	729,677.00	1.03
10	佟健	724,138.00	1.02
汇添富恒生指数（QDII-LOF）C			
序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
		0.00	0.00

注：本基金为LOF基金，上表持有人为场内持有人。

9.3 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	汇添富恒生指数（QDII-LOF）A	30,147.30	0.01
	汇添富恒生指数	2,157.46	0.29

	(QDII-LOF) C		
	合计	32,304.76	0.01

9.4 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	汇添富恒生指数（QDII-LOF）A	0
	汇添富恒生指数（QDII-LOF）C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富恒生指数（QDII-LOF）A	0
	汇添富恒生指数（QDII-LOF）C	0
	合计	0

§ 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（%）
恒生A	193	352,796.33	66,221,175	97.26	1,868,517	2.74
恒生B	3,345	20,355.66	417,404	0.61	67,672,288	99.39
添富恒生	20,242	12,989.96	100,033,108	38.04	162,909,666.12	61.96
合计	23,780	16,783.94	166,671,687	41.76	232,450,471.12	58.24

9.2 期末上市基金前十名持有人

恒生 A			
序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	中国太平洋人寿保险股份有限公司-分红-个人分红	42,363,348	62.22
2	中国太平洋人寿保险股份有限公司-传统-普通保险产品	16,571,120	24.34
3	广发基金-招商银行-招商财富资产管理有限公司	5,949,502	8.74
4	中国国际金融股份有限公司	896,000	1.32
5	中国银河证券股份有限公司	441,204	0.65
6	吴志刚	240,000	0.35
7	闵敏	238,200	0.35
8	周绍勋	143,413	0.21
9	戴忆晨	102,600	0.15
10	朱永寿	100,268	0.15
恒生 B			
序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	杨继耘	5,501,000	8.08
2	廖雪静	5,010,000	7.36
3	李燕欢	1,849,700	2.72
4	尹瑛姬	1,608,572	2.36
5	郭峰	932,150	1.37
6	何惠忠	890,000	1.31
7	王鹏	869,900	1.28
8	吴旋玲	801,800	1.18
9	佟健	707,700	1.04
10	李锡祥	702,600	1.03
添富恒生			
序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	陈远亮	729,677	10.36
2	何青	456,000	6.47
3	张卓君	407,749	5.79
4	任晓光	348,496	4.95

5	徐满东	222,998	3.17
6	夏建辉	220,000	3.12
7	李皓炘	192,523	2.73
8	司徒芾沙	149,497	2.12
9	周绍勋	120,265	1.71
10	王静	113,879	1.62

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	恒生 A	0.00	0.00
	恒生 B	0.00	0.00
	添富恒生	30,047.76	0.01
	合计	30,047.76	0.01

9.4 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	恒生 A	0
	恒生 B	0
	添富恒生	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	恒生 A	0
	恒生 B	0
	添富恒生	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

项目	汇添富恒生指数（QDII-LOF）A	汇添富恒生指数（QDII-LOF）C
基金合同生效日（2020年12月01日）基金份额总额	399,122,157.12	-
基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额	5,596,383.58	1,012,152.86
减：基金合同生效日	132,537,895.54	259,252.48

起至报告期期末基金总赎回份额		
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	272,180,645.16	752,900.38

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	恒生 A	恒生 B	添富恒生
基金合同生效日（2014年03月06日）基金份额总额	109,711,438.00	109,711,438.00	1,051,208,262.98
本报告期初基金份额总额	73,415,529.00	73,415,529.00	79,768,126.67
本报告期基金总申购份额	-	-	662,366,562.98
减：本报告期基金总赎回份额	-	-	494,019,943.30
本报告期基金拆分变动份额	-5,325,837.00	-5,325,837.00	14,828,027.77
本报告期末基金份额总额	68,089,692.00	68,089,692.00	262,942,774.12

注：1、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。2、本基金的基金份额转换基准日为2020年11月30日。基金管理人在份额转换基准日进行转换，最终将添富恒生份额、恒生A份额与恒生B份额转换为汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）的A类基金的份额，转换后的汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）的A类基金份额为：399,122,157.12份。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

2020 年 10 月 29 日，汇添富恒生指数分级证券投资基金的基金管理人汇添富基金管理股份有限公司以现场方式召集召开了本基金的基金份额持有人大会。出席本次大会的汇添富恒生指数分级证券投资基金添富恒生份额的基金份额持有人所持份额共计 200,957,066.98 份，占权益登记日该类基金总份额 389,520,775.51 份的 51.591%；出席本次大会的汇添富恒生指数分级证券投资基金恒生 A 份额的基金份额持有人所持份额共计 81,339,577.00 份，占权益登记日该类基金总份额 150,386,855.00 份的 54.087%；出席本次大会的汇添富恒生指数分级证券投资基金恒生 B 份额的基金份额持有人所持份额共计 81,339,577.00 份，占权益登记日该类基金总份额 150,386,855.00 份的 54.087%。上述出席情况达到本基金在权益登记日各类基金总份额的 50%以上（即到会者出示的全部有效凭证所代表的添富恒生份额、恒生 A 份额与恒生 B 份额占权益登记日各自基金总份额的 50%以上），达到法定开会条件。会议审议了《关于汇添富恒生指数分级证券投资基金转型的议案》，本次大会决议自该日起生效。

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

- 1、基金管理人于 2020 年 1 月 2 日公告，楚天舒女士不再担任汇添富沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，由董瑾女士单独管理该基金。
- 2、基金管理人于 2020 年 1 月 2 日公告，增聘董瑾女士为汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理，楚天舒女士不再担任上述基金的基金经理。
- 3、基金管理人于 2020 年 1 月 2 日公告，楚天舒女士不再担任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，由吴振翔先生单独管理该基金。
- 4、基金管理人于 2020 年 1 月 2 日公告，增聘董瑾女士为中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，楚天舒女士不再担任上述基金的基金经理。
- 5、基金管理人于 2020 年 1 月 2 日公告，增聘董瑾女士为汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理，楚天舒女士不再担任上述基金的基金经理。
- 6、基金管理人于 2020 年 1 月 7 日公告，增聘杨靖先生为汇添富中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金的基金经理，与何旻先生共同管理该基金。

7、《汇添富大盘核心资产增长混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 1 月 8 日正式生效，王栩先生任该基金的基金经理。

8、基金管理人于 2020 年 1 月 9 日公告，自 2020 年 1 月 7 日起，郑慧莲女士恢复履行汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富多元收益债券型证券投资基金、汇添富双利增强债券型证券投资基金、汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金、汇添富年年泰定期开放混合型证券投资基金、汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金、汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金、汇添富盈鑫灵活配置混合型证券投资基金、汇添富达欣灵活配置混合型证券投资基金、汇添富熙和精选混合型证券投资基金、汇添富全球消费行业混合型证券投资基金、汇添富消费升级混合型证券投资基金、汇添富内需增长股票型证券投资基金的基金经理职务。

9、《汇添富中债 7-10 年国开行债券指数证券投资基金基金合同》于 2020 年 1 月 14 日正式生效，何旻先生任该基金的基金经理。

10、基金管理人于 2020 年 2 月 27 日公告，郑慧莲女士不再担任汇添富多元收益债券型证券投资基金的基金经理，由曾刚先生单独管理该基金。

11、基金管理人于 2020 年 2 月 27 日公告，增聘徐寅喆女士为汇添富全额宝货币市场基金的基金经理，陶然先生不再担任上述基金的基金经理。

12、基金管理人于 2020 年 2 月 27 日公告，增聘温开强先生为汇添富收益快钱货币市场基金的基金经理，陶然先生不再担任上述基金的基金经理。

13、基金管理人于 2020 年 2 月 27 日公告，增聘徐寅喆女士为汇添富收益快线货币市场基金的基金经理，陶然先生不再担任上述基金的基金经理。

14、基金管理人于 2020 年 2 月 27 日公告，郑慧莲女士不再担任汇添富双利增强债券型证券投资基金的基金经理，由曾刚先生单独管理该基金。

15、基金管理人于 2020 年 2 月 27 日公告，陶然先生不再担任汇添富现金宝货币市场基金的基金经理，由蒋文玲女士单独管理该基金。

16、基金管理人于 2020 年 2 月 27 日公告，增聘温开强先生为汇添富理财 60 天债券型证券投资基金的基金经理，与徐寅喆女士共同管理该基金。

17、基金管理人于 2020 年 2 月 29 日公告，聘任王骏杰为汇添富全额宝货币市场基金、汇添富收益快线货币市场基金和汇添富收益快钱货币市场基金的基金经理助理，协助上述基金的基金经理开展投资管理工作。陶然不再担任汇添富和聚宝货币市场基金、汇添

富理财 7 天债券型证券投资基金的基金经理助理。

18、基金管理人于 2020 年 3 月 4 日公告，聘任李云鑫为汇添富达欣灵活配置混合型证券投资基金、汇添富熙和精选混合型证券投资基金的基金经理助理，协助上述基金的基金经理开展投资管理工作。

19、《汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》于 2020 年 3 月 5 日正式生效，吴振翔先生和董瑾女士任该基金的基金经理。

20、《汇添富中盘积极成长混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 3 月 13 日正式生效，郑磊先生任该基金的基金经理。

21、基金管理人于 2020 年 3 月 20 日公告，聘任李云鑫为汇添富盈泰灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理，协助上述基金的基金经理开展投资管理工作。

22、基金管理人于 2020 年 3 月 21 日公告，增聘谭志强先生为汇添富社会责任混合型证券投资基金的基金经理，雷鸣先生不再担任上述基金的基金经理。

23、基金管理人于 2020 年 3 月 21 日公告，增聘马翔先生为汇添富盈安灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，与曾刚先生和吴江宏先生共同管理该基金。

24、基金管理人于 2020 年 3 月 25 日公告，徐光先生不再担任汇添富丰润中短债债券型证券投资基金的基金经理，由蒋文玲女士单独管理该基金。

25、基金管理人于 2020 年 3 月 25 日公告，蒋文玲女士不再担任汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金的基金经理，由曾刚先生和郑慧莲女士共同管理该基金。

26、基金管理人于 2020 年 3 月 25 日公告，增聘杨靖先生为汇添富鑫利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，吴江宏先生不再担任上述基金的基金经理。

27、基金管理人于 2020 年 3 月 25 日公告，增聘刘通先生为汇添富鑫瑞债券型证券投资基金的基金经理，胡娜女士和陆文磊先生不再担任上述基金的基金经理。

28、基金管理人于 2020 年 3 月 25 日公告，吴江宏先生不再担任汇添富鑫盛定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，由胡娜女士单独管理该基金。

29、基金管理人于 2020 年 3 月 25 日公告，增聘刘通先生为汇添富鑫泽定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，徐光先生和陆文磊先生不再担任上述基金的基金经理。

30、基金管理人于 2020 年 3 月 25 日公告，吴江宏先生和曾刚先生不再担任汇添富盈安灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，由马翔先生单独管理该基金。

31、基金管理人于 2020 年 3 月 25 日公告，吴江宏先生不再担任汇添富盈泰灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，由曾刚先生单独管理该基金。

32、《汇添富鑫福债券型证券投资基金基金合同》于 2020 年 3 月 30 日正式生效，徐光先生任该基金的基金经理。

33、《汇添富多策略纯债债券型证券投资基金基金合同》于 2020 年 4 月 1 日正式生效，刘通先生任该基金的基金经理。

34、《汇添富中短债债券型证券投资基金基金合同》于 2020 年 4 月 9 日正式生效，徐光先生任该基金的基金经理。

35、基金管理人于 2020 年 4 月 16 日公告，聘任李云鑫为汇添富多元收益债券型证券投资基金的基金经理助理，协助上述基金的基金经理开展投资管理工作。

36、《汇添富积极投资核心优势三个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》于 2020 年 4 月 26 日正式生效，袁建军先生任该基金的基金经理。

37、基金管理人于 2020 年 5 月 21 日公告，增聘赵剑先生为汇添富环保行业股票型证券投资基金的基金经理，赵鹏程先生不再担任上述基金的基金经理。

38、基金管理人于 2020 年 5 月 21 日公告，增聘李云鑫先生为汇添富盈泰灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，曾刚先生不再担任上述基金的基金经理。

39、《汇添富稳健增益一年持有期混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 5 月 22 日正式生效，赵鹏飞先生和叶盛先生任该基金的基金经理。

40、《汇添富优质成长混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 5 月 25 日正式生效，杨璿先生任该基金的基金经理。

41、基金管理人于 2020 年 5 月 30 日公告，刘江先生不再担任汇添富创新医药主题混合型证券投资基金的基金经理，由郑磊先生单独管理该基金。

42、基金管理人于 2020 年 6 月 5 日公告，徐光先生不再担任汇添富 AAA 级信用纯债债券型证券投资基金的基金经理，由杨靖先生单独管理该基金。

43、基金管理人于 2020 年 6 月 6 日公告，曾刚先生不再担任汇添富保鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，由吴江宏先生单独管理该基金。

44、基金管理人于 2020 年 6 月 6 日公告，增聘叶盛先生为汇添富民丰回报混合型证券投资基金的基金经理，与赵鹏飞先生共同管理该基金，吴江宏先生不再担任上述基金的基金经理。

45、基金管理人于 2020 年 6 月 6 日公告，增聘徐一恒先生为汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金的基金经理，与郑慧莲女士共同管理该基金，吴江宏先生不再担任上述基金的基金经理。

46、基金管理人于 2020 年 6 月 6 日公告，增聘徐一恒先生为汇添富年年泰定期开放混合型证券投资基金的基金经理，与曾刚先生和郑慧莲女士共同管理该基金。

47、基金管理人于 2020 年 6 月 6 日公告，增聘徐一恒先生为汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金的基金经理，与郑慧莲女士共同管理该基金，曾刚先生不再担任上述基金的基金经理。

48、基金管理人于 2020 年 6 月 6 日公告，增聘徐一恒先生为汇添富实业债债券型证券投资基金的基金经理，曾刚先生和蒋文玲女士不再担任上述基金的基金经理。

49、基金管理人于 2020 年 6 月 11 日公告，郑慧莲女士不再担任汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理，由吴江宏先生单独管理该基金。

50、基金管理人于 2020 年 6 月 11 日公告，增聘李云鑫先生为汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，与曾刚先生共同管理该基金，郑慧莲女士不再担任上述基金的基金经理。

51、基金管理人于 2020 年 6 月 11 日公告，增聘李云鑫先生为汇添富达欣灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，与曾刚先生共同管理该基金，郑慧莲女士不再担任上述基金的基金经理。

52、基金管理人于 2020 年 6 月 11 日公告，增聘刘通先生为汇添富多元收益债券型证券投资基金的基金经理，与曾刚先生共同管理该基金。

53、基金管理人于 2020 年 6 月 11 日公告，增聘赵鹏程先生为汇添富弘安混合型证券投资基金的基金经理，与吴江宏先生共同管理该基金。

54、基金管理人于 2020 年 6 月 11 日公告，增聘杨靖先生为汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金的基金经理，与胡昕炜先生和曾刚先生共同管理该基金。

55、基金管理人于 2020 年 6 月 11 日公告，增聘赵鹏程先生为汇添富添福吉祥混合型证券投资基金的基金经理，与吴江宏先生共同管理该基金。

56、基金管理人于 2020 年 6 月 11 日公告，增聘李云鑫先生为汇添富熙和精选混合型证券投资基金的基金经理，与曾刚先生共同管理该基金，郑慧莲女士不再担任上述基金的基金经理。

57、基金管理人于 2020 年 6 月 11 日公告，增聘赵鹏程先生为汇添富盈润混合型证券投资基金的基金经理，与吴江宏先生共同管理该基金。

58、基金管理人于 2020 年 6 月 11 日公告，增聘赵鹏程先生为汇添富盈鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，郑慧莲女士不再担任上述基金的基金经理。

59、基金管理人于 2020 年 6 月 12 日公告，聘任李云鑫为汇添富双利增强债券型证券投资基金的基金经理助理，协助上述基金的基金经理开展投资管理工作。

60、基金管理人于 2020 年 6 月 13 日公告，曾刚先生不再担任汇添富可转换债券债券型证券投资基金的基金经理，由吴江宏先生单独管理该基金。

61、基金管理人于 2020 年 6 月 13 日公告，陆文磊先生不再担任汇添富增强收益债券型证券投资基金的基金经理，由徐光先生单独管理该基金。

62、《汇添富创新增长一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 6 月 22 日正式生效，马翔先生任该基金的基金经理。

63、基金管理人于 2020 年 7 月 1 日公告，增聘董超先生为汇添富逆向投资混合型证券投资基金的基金经理，与顾耀强先生共同管理该基金。

64、基金管理人于 2020 年 7 月 1 日公告，胡昕炜先生不再担任汇添富全球消费行业混合型证券投资基金的基金经理，由郑慧莲女士单独管理该基金。

65、基金管理人于 2020 年 7 月 3 日公告，增聘胡奕女士为汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，与李云鑫先生共同管理该基金，曾刚先生不再担任上述基金的基金经理。

66、基金管理人于 2020 年 7 月 3 日公告，增聘胡奕女士为汇添富达欣灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，与李云鑫先生共同管理该基金，曾刚先生不再担任上述基金的基金经理。

67、基金管理人于 2020 年 7 月 3 日公告，增聘胡奕女士为汇添富弘安混合型证券投资基金的基金经理，与吴江宏先生和赵鹏程先生共同管理该基金。

68、基金管理人于 2020 年 7 月 3 日公告，增聘胡奕女士为汇添富睿丰混合型证券投资基金（LOF）的基金经理，与刘伟林先生和曾刚先生共同管理该基金。

69、基金管理人于 2020 年 7 月 3 日公告，增聘胡奕女士为汇添富添福吉祥混合型证券投资基金的基金经理，与吴江宏先生和赵鹏程先生共同管理该基金。

70、基金管理人于 2020 年 7 月 3 日公告，增聘胡奕女士为汇添富熙和精选混合型证

券投资基金的基金经理，与李云鑫先生共同管理该基金，曾刚先生不再担任上述基金的基金经理。

71、基金管理人于 2020 年 7 月 3 日公告，增聘胡奕女士为汇添富新睿精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，与刘伟林先生和曾刚先生共同管理该基金。

72、基金管理人于 2020 年 7 月 3 日公告，增聘胡奕女士为汇添富盈润混合型证券投资基金的基金经理，与吴江宏先生和赵鹏程先生共同管理该基金。

73、《汇添富中盘价值精选混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 7 月 8 日正式生效，胡昕炜先生任该基金的基金经理。

74、基金管理人于 2020 年 7 月 10 日公告，何旻先生不再担任汇添富中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金的基金经理，由杨靖先生单独管理该基金。

75、基金管理人于 2020 年 7 月 10 日公告，增聘徐光先生为汇添富双利增强债券型证券投资基金的基金经理，与曾刚先生共同管理该基金。

76、《汇添富聚焦价值成长三个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》于 2020 年 7 月 13 日正式生效，袁建军先生任该基金的基金经理。

77、《汇添富开放视野中国优势六个月持有期股票型证券投资基金基金合同》于 2020 年 7 月 22 日正式生效，劳杰男先生任该基金的基金经理。

78、《汇添富稳健收益混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 7 月 23 日正式生效，赵鹏飞先生任该基金的基金经理。

79、《汇添富策略增长两年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 7 月 24 日正式生效，马翔先生任该基金的基金经理。

80、《汇添富科创板 2 年定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 7 月 28 日正式生效，马翔先生任该基金的基金经理。

81、基金管理人于 2020 年 7 月 30 日公告，增聘李彪先生为汇添富养老目标日期 2040 五年持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理，与蔡健林先生共同管理该基金。

82、基金管理人于 2020 年 7 月 30 日公告，增聘李彪先生为汇添富养老目标日期 2050 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的基金经理，与蔡健林先生共同管理该基金。

83、基金管理人于 2020 年 8 月 6 日公告，增聘李云鑫先生为汇添富民丰回报混合型证券投资基金的基金经理，与叶盛先生和赵鹏飞先生共同管理该基金。

84、基金管理人于 2020 年 8 月 6 日公告，增聘徐一恒先生为汇添富稳健收益混合型

证券投资基金的基金经理，与赵鹏飞先生共同管理该基金。

85、《汇添富医疗积极成长一年持有期混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 8 月 21 日正式生效，郑磊先生任该基金的基金经理。

86、基金管理人于 2020 年 8 月 27 日公告，增聘王骏杰先生为汇添富和聚宝货币市场基金的基金经理，与徐寅喆女士共同管理该基金。

87、基金管理人于 2020 年 8 月 27 日公告，增聘王骏杰先生为汇添富汇鑫浮动净值型货币市场基金的基金经理，与徐寅喆女士和蒋文玲女士共同管理该基金。

88、基金管理人于 2020 年 9 月 2 日公告，增聘杨靖先生为汇添富鑫成定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，徐光先生不再担任上述基金的基金经理。

89、基金管理人于 2020 年 9 月 5 日公告，顾耀强先生不再担任汇添富逆向投资混合型证券投资基金的基金经理，由董超先生单独管理该基金。

90、《汇添富稳健添盈一年持有期混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 9 月 10 日正式生效，刘江先生和徐一恒先生任该基金的基金经理。

91、基金管理人于 2020 年 9 月 19 日公告，曾刚先生不再担任汇添富多元收益债券型证券投资基金的基金经理，由刘通先生单独管理该基金。

92、基金管理人于 2020 年 9 月 19 日公告，曾刚先生不再担任汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金的基金经理，由胡昕炜先生和杨靖先生共同管理该基金。

93、基金管理人于 2020 年 9 月 19 日公告，曾刚先生不再担任汇添富年年泰定期开放混合型证券投资基金的基金经理，由郑慧莲女士和徐一恒先生共同管理该基金。

94、基金管理人于 2020 年 9 月 19 日公告，曾刚先生不再担任汇添富睿丰混合型证券投资基金（LOF）的基金经理，由刘伟林先生和胡奕女士共同管理该基金。

95、基金管理人于 2020 年 9 月 19 日公告，曾刚先生不再担任汇添富双利增强债券型证券投资基金的基金经理，由徐光先生单独管理该基金。

96、基金管理人于 2020 年 9 月 19 日公告，曾刚先生不再担任汇添富新睿精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，由刘伟林先生和胡奕女士共同管理该基金。

97、《汇添富创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 10 月 13 日正式生效，劳杰男先生任该基金的基金经理。

98、《汇添富品牌驱动六个月持有期混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 10 月 19 日正式生效，郑慧莲女士任该基金的基金经理。

99、基金管理人于 2020 年 10 月 31 日公告，吴江宏先生不再担任汇添富弘安混合型证券投资基金的基金经理，由赵鹏程先生和胡奕女士共同管理该基金。

100、基金管理人于 2020 年 10 月 31 日公告，增聘叶盛先生为汇添富稳健添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理，蒋文玲女士不再担任上述基金的基金经理。

101、《汇添富稳健汇盈一年持有期混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 11 月 4 日正式生效，杨靖先生和李云鑫先生任该基金的基金经理。

102、《汇添富盛和 66 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2020 年 11 月 6 日正式生效，杨靖先生任该基金的基金经理。

103、《汇添富数字生活主题六个月持有期混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 11 月 18 日正式生效，杨璿先生任该基金的基金经理。

104、《汇添富高质量成长精选 2 年持有期混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 12 月 2 日正式生效，刘江先生任该基金的基金经理。

105、基金管理人于 2020 年 12 月 24 日公告，增聘张朋先生为汇添富移动互联股票型证券投资基金的基金经理，杨璿先生不再担任上述基金的基金经理。

106、2020 年 8 月，中国农业银行总行决定刘琳任托管业务部副总裁。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

2020 年 12 月 1 日原“汇添富恒生指数分级证券投资基金”转型为“汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）”。汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）的投资策略请详见 2020 年 11 月 28 日刊登在本公司网站的《汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）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（2020 年 12 月 01 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 90,000.00

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

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。

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	1	153,916,271.89	90.23	123,132.59	96.10	
Credit Suisse	-	16,664,958.74	9.77	4,999.49	3.90	
方正证券	2	-	-	-	-	
海通证券	1	-	-	-	-	
华泰证券	1	-	-	-	-	
华西证券	1	-	-	-	-	
招商证券	1	-	-	-	-	
中信证券	1	-	-	-	-	

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	-	-	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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:

本基金本报告期内新增 0 家证券公司的 0 个交易单元:。

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 (%)	
东方证券	1	389,397,599.49	93.53	311,518.70	97.47	
Credit Suisse	-	26,941,292.89	6.47	8,082.38	2.53	
方正证券	2	-	-	-	-	
海通证券	1	-	-	-	-	
华泰证券	1	-	-	-	-	
华西证券	1	-	-	-	-	
招商证券	1	-	-	-	-	
中信证券	1	-	-	-	-	

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	-	-	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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。

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：

本基金本报告期内新增 1 家证券公司的 1 个交易单元：华西证券（深交所单元）。

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	关于汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）A 类基金份额的场内份额停复牌的公告	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 12 月 01 日
2	汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）开放日常申购、赎回、定期定额投资业务公告	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 12 月 01 日
3	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富恒生指数分级证券投资基金基金份额转换结果的公告	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 12 月 02 日
4	关于汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）因境外主要市场节假日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 12 月 23 日
5	汇添富基金管理股份有限公司关于暂停泰诚财富基金销售(大连)有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	上证报, 公司网站	2020 年 12 月 09 日

6	汇添富基金管理股份有限公司关于终止与部分代销机构合作关系的公告	证券时报, 公司网站	2020 年 12 月 19 日
7	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与北京电盈基金销售有限公司合作关系的公告	中证报, 公司网站	2020 年 12 月 28 日
8	关于汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）因境外主要市场节假日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 12 月 29 日
9	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金开展线上直销系统费率优惠活动的公告	上交所, 公司网站, 深交所, 证券日报	2020 年 12 月 30 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部分基金参加交通银行开展的费率优惠活动的公告	上证报, 公司网站	2020 年 01 月 02 日
2	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金之恒生 A 份额本次定期折算期间约定年基准收益率的公告	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 01 月 03 日
3	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间添富恒生份额、恒生 A 份额停复牌的公告	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 01 月 03 日
4	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 01 月 06 日
5	关于添富恒生份额、恒生 A 份额定期份额折算后复牌首日前收盘价调整的公告	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 01 月 06 日
6	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金非港股通交易日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 01 月 17 日
7	汇添富基金旗下 139 只基金 2019 年第 4 季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 01 月 21 日
8	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金暂停申购、赎回等业务的公告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所, 证券日报	2020 年 01 月 31 日

9	汇添富基金旗下 139 只基金 2019 年年度报告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所, 证券日报	2020 年 03 月 30 日
10	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金非港股通交易日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 03 月 31 日
11	汇添富基金管理股份有限公司关于北京分公司办公地址变更的公告	中证报, 上交所, 公司网站, 深交所	2020 年 04 月 01 日
12	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金因境外主要市场节假日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 04 月 09 日
13	汇添富基金管理股份有限公司关于根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改旗下部分基金基金合同及托管协议并更新招募说明书	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所, 证券日报	2020 年 04 月 14 日
14	汇添富基金旗下 145 只基金 2020 年 1 季度报告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所, 证券日报	2020 年 04 月 21 日
15	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金非港股通交易日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 04 月 24 日
16	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金中基金（FOF）资产管理计划通过直销渠道申赎本公司旗下公募基金免除相关费用的公告	中证报, 公司网站	2020 年 04 月 29 日
17	汇添富基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金在招商银行定投起点的公告	上证报, 公司网站	2020 年 05 月 16 日
18	汇添富基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金在招商银行定投起点的公告	证券时报, 公司网站	2020 年 06 月 04 日
19	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金非港股通交易日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 06 月 19 日
20	关于汇添富恒生指数分级证券投资	上证报, 公司网站,	2020 年 06 月 30 日

	资基金非港股通交易日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	深交所	
21	汇添富基金旗下 151 只基金 2020 年 2 季度报告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所, 证券日报	2020 年 07 月 21 日
22	汇添富基金管理股份有限公司关于调整特定投资群体通过直销中心申购旗下部分基金的费率优惠方案的公告	上证报, 公司网站	2020 年 08 月 06 日
23	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2020 年中期报告提示性公告	上交所, 证券时报, 公司网站, 深交所	2020 年 08 月 28 日
24	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金产品资料概要	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所, 证券日报	2020 年 09 月 01 日
25	汇添富基金管理股份有限公司关于设立南京分公司的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 09 月 05 日
26	汇添富恒生指数分级证券投资基金暂停大额申购、定期定额投资公告	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 09 月 15 日
27	汇添富基金管理股份有限公司关于召开汇添富恒生指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 09 月 28 日
28	汇添富基金管理股份有限公司关于召开汇添富恒生指数分级证券投资基金基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 09 月 28 日
29	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金非港股通交易日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 09 月 28 日
30	汇添富基金管理股份有限公司关于召开汇添富恒生指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 09 月 29 日
31	汇添富基金管理股份有限公司关于召开汇添富恒生指数分级证券投资基金基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 09 月 29 日
32	汇添富基金管理股份有限公司关	上证报, 公司网站,	2020 年 09 月 30 日

	于召开汇添富恒生指数分级证券投资基金基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	深交所	
33	汇添富基金管理股份有限公司关于召开汇添富恒生指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 09 月 30 日
34	汇添富基金管理股份有限公司关于召开汇添富恒生指数分级证券投资基金基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 10 月 09 日
35	汇添富基金管理股份有限公司关于召开汇添富恒生指数分级证券投资基金基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 10 月 10 日
36	汇添富基金管理股份有限公司关于召开汇添富恒生指数分级证券投资基金基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 10 月 12 日
37	汇添富恒生指数分级证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 10 月 13 日
38	汇添富基金管理股份有限公司关于召开汇添富恒生指数分级证券投资基金基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 10 月 13 日
39	汇添富基金管理股份有限公司关于召开汇添富恒生指数分级证券投资基金基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 10 月 14 日
40	汇添富基金管理股份有限公司关于召开汇添富恒生指数分级证券投资基金基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 10 月 15 日
41	汇添富基金管理股份有限公司关于召开汇添富恒生指数分级证券投资基金基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 10 月 16 日
42	汇添富基金管理股份有限公司关于召开汇添富恒生指数分级证券投资基金基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 10 月 17 日
43	汇添富基金管理股份有限公司关于召开汇添富恒生指数分级证券	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 10 月 19 日

	投资基金基金份额持有人大会相关事项的提示性公告		
44	汇添富恒生指数分级证券投资基金添富恒生份额恢复场内申购业务并取消场外申购和定期定额投资业务金额上限的公告	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 10 月 19 日
45	汇添富基金管理股份有限公司关于召开汇添富恒生指数分级证券投资基金基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 10 月 20 日
46	汇添富基金管理股份有限公司关于召开汇添富恒生指数分级证券投资基金基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 10 月 21 日
47	汇添富基金管理股份有限公司关于召开汇添富恒生指数分级证券投资基金基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 10 月 22 日
48	汇添富恒生指数分级证券投资基金添富恒生份额暂停场内申购业务并暂停场外大额申购和定期定额投资业务的公告	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 10 月 22 日
49	汇添富恒生指数分级证券投资基金非港股通交易日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 10 月 23 日
50	汇添富基金管理股份有限公司关于召开汇添富恒生指数分级证券投资基金基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 10 月 23 日
51	汇添富基金管理股份有限公司关于召开汇添富恒生指数分级证券投资基金基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 10 月 24 日
52	汇添富基金管理股份有限公司关于召开汇添富恒生指数分级证券投资基金基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 10 月 26 日
53	汇添富基金管理股份有限公司关于召开汇添富恒生指数分级证券投资基金基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 10 月 27 日
54	汇添富基金旗下 160 只基金 2020 年 3 季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 10 月 28 日
55	汇添富基金管理股份有限公司关	上证报, 公司网站	2020 年 10 月 28 日

	于暂停大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告		
56	汇添富基金管理股份有限公司关于召开汇添富恒生指数分级证券投资基金基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 10 月 28 日
57	汇添富基金管理股份有限公司关于召开汇添富恒生指数分级证券投资基金基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 10 月 29 日
58	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金基金份额持有人大会期间的停牌提示性公告	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 10 月 29 日
59	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富恒生指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 10 月 30 日
60	汇添富基金管理股份有限公司关于北京分公司办公地址变更的公告	上交所, 证券时报, 公司网站, 深交所	2020 年 11 月 04 日
61	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富恒生指数分级证券投资基金实施转型的公告	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 11 月 24 日
62	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金的恒生 A 份额、恒生 B 份额终止上市的公告	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 11 月 25 日
63	汇添富恒生指数分级证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额投资、跨系统转托管等业务的公告	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 11 月 27 日
64	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金的恒生 A 份额、恒生 B 份额终止上市的提示性公告	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 11 月 27 日
65	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金转型并变更基金名称的提示性公告	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 11 月 28 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

投	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
---	----------------	------------

资 者 类 别	序 号	持 有 基 金 份 额 比 例 达 到 或 者 超 过 20% 的 时 间 区 间	期 初 份 额	申 购 份 额	赎 回 份 额	持 有 份 额	份 额 占 比 (%)
机 构	1	2020 年 10 月 21 日 至 2020 年 12 月 30 日	-	143,539,712.92	93,539,712.92	50,000,000.00	18.32
产品特有风险							
<p>1、持有人大会投票权集中的风险 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p> <p>2、巨额赎回的风险 持有基金份额比例较高的投资者大量赎回时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。</p> <p>3、基金规模较小导致的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。</p> <p>4、基金净值大幅波动的风险 持有基金份额比例较高的投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。</p> <p>5、提前终止基金合同的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。</p>							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：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指数分级证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富恒生指数分级证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富恒生指数分级证券投资基金托管协议》；
- 4、《汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）基金合同》；
- 5、《汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）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指数分级证券投资基金和汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）在指定报刊上披露的各项公告；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

13.2 存放地点

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼 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

2021 年 03 月 30 日