

汇添富香港优势精选混合型证券投资基金 2021年第2季度报告

2021年06月30日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2021年07月21日

§ 1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年7月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年04月01日起至2021年06月30日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|---------------|---|
| 基金简称 | 汇添富香港优势精选混合(QDII) |
| 基金主代码 | 470888 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2014年01月17日 |
| 报告期末基金份额总额(份) | 141,833,439.71 |
| 投资目标 | 在香港证券市场精选具有持续竞争优势且估值有吸引力的公司股票等证券，通过有效的资产配置和组合管理，进行中长期投资布局，在有效管理风险的前提下，追求持续稳健的较高投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金主要采用稳健的资产配置和积极的股票投资策略。在资产配置中，根据宏观经济和证券市场状况，通过分析股票市场、固定收益产品及货币市场工具等的预期风险收益特征，确定投资组合的投资范围和比例。在股票投资中，采用“自下而上”的策略，精选出具有持续竞争优势，且估值有吸引力的股票，精心科学构建股票投资组合，并辅以严格的投资组合风险控制，以获得中长期的较高投资收益。本 |

| | |
|---------|---|
| | 基金投资策略的重点是精选股票策略。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略、股票投资策略、基金投资策略、固定收益产品投资策略、衍生工具投资策略。 |
| 业绩比较基准 | MSCI 中华指数(MSCI ZhongHua Index) |
| 风险收益特征 | 本基金为投资于香港证券市场的主动混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。 |
| 基金管理人 | 汇添富基金管理股份有限公司 |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 境外资产托管人 | 英文名称:Brown Brothers Harriman & Co. |
| | 中文名称:布朗兄弟哈里曼银行 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2021年04月01日 - 2021年06月30日) |
|-----------------|--------------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | 2,942,532.12 |
| 2. 本期利润 | 8,755,264.04 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0566 |
| 4. 期末基金资产净值 | 187,008,455.48 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.319 |

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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去三个月 | 4.60% | 1.51% | 1.53% | 0.99% | 3.07% | 0.52% |

| | | | | | | |
|-------------|--------|-------|--------|-------|---------|-------|
| 过去六个月 | -0.60% | 1.89% | 2.14% | 1.37% | -2.74% | 0.52% |
| 过去一年 | 11.87% | 1.83% | 25.46% | 1.33% | -13.59% | 0.50% |
| 过去三年 | 17.24% | 1.58% | 24.48% | 1.34% | -7.24% | 0.24% |
| 过去五年 | 62.13% | 1.37% | 83.27% | 1.19% | -21.14% | 0.18% |
| 自基金合同生效日起至今 | 36.76% | 1.32% | 70.20% | 1.21% | -33.44% | 0.11% |

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

汇添富香港优势精选混合(QDII)累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2014年01月17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。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 (年) | 说明 |
|-----|----------------------------------|-------------|------|---------------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 杨威风 | 本基金的基金经理, 汇添富资产管理(香港)有限公司股票投资副总监 | 2019年01月01日 | | 14 | <p>国籍:中国。 学历:香港大学工商管理学硕士。从业资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任东兴证券香港公司自营部投资总监职务, 香港广发资产管理基金经理助理, 瑞士信贷投资银行股票分析师。2017年12月加入汇添富资产管理(香港)有限公司, 任股票投资副总监。 2019年1月1日至今任汇添富港股通专注成长混合型证券投资基金的基金经理。 2019年1月1日至今任汇添富香港优势精选混合型证券投资基金的基金经理。 2019年1月18日至今任汇添富沪港</p> |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---------------------|
| | | | | | 深新价值股票型证券投资基金的基金经理。 |
|--|--|--|--|--|---------------------|

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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的成员简介

注:本基金无境外投资顾问。

4.3 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立嵌入式全流程管控模式实现了不同组合之间公平交易的执行和实现。具体情况如下:

一、本基金管理人进一步完善了公司内部公平交易管理规范 and 流程,以确保公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略及投资品种。

二、本着“时间优先、价格优先”的原则,本基金管理人对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合采用了交易系统中的公平交易模块进行操作,实现事前和事中公平交易的管控。

三、对不同投资组合进行了同向交易价差分析,具体方法为:在不同时间窗口(日内、3日内、5日内)下,对不同组合同一证券同向交易的溢价率进行了T分布检验。对于没有通过检验的交易,再根据交易价格、交易频率、交易数量和交易时间进行了具体分析,进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

四、根据交易价格、交易频率、交易数量等对不同组合之间的反向交易进行了综合分析。

通过上述管控措施的有效落实,本报告期内,本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易,也未出现本基金管理人管理的不同投资组合间有同向交易价差异异常的情况。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内,本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5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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2021年二季度,香港恒生指数上涨1.6%至28828点。同期,本基金净值上涨4.6%,恒生指数按人民币计价上涨0.2%,跑赢指数4.4%。

疫情依然是目前影响全球市场的一个主线,截至6月底,约2成的世界人口已经接种了一剂疫苗,但从结构来看,发达国家的接种率有50%以上,但低收入国家的接种率不到1%。这产生了全球经济复苏不均匀的格局,比如发达国家的PMI水平处于平均60水平,但低收入国家依然较难突破50。在此背景下,未来美国流动性的收紧也许会对这些低收入国家的经济造成较大的冲击,也许会对资本市场埋下系统性风险。中国方面,流动性收紧也是大概率事件,而由于年初已经出现了一轮估值修复,未来整体市场出现估值扩张的概率应该不大。因此,组合的投资主线依然聚焦在中长期成长确定性强的公司,并根据护城河的持续性来重仓个别优秀的企业。

本基金本报告期基金份额净值增长率为4.60%。同期业绩比较基准收益率为1.53%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额 (人民币元) | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|----|--------------|------------------|
| | | | |

| | | | |
|---|-----------------------|----------------|--------|
| 1 | 权益投资 | 166,749,848.79 | 87.00 |
| | 其中：普通股 | 166,749,848.79 | 87.00 |
| | 存托凭证 | - | - |
| | 优先股 | - | - |
| | 房地产信托 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| | 其中：远期 | - | - |
| | 期货 | - | - |
| | 期权 | - | - |
| | 权证 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售 金融资产 | - | - |
| 6 | 货币市场工具 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 23,154,962.70 | 12.08 |
| 8 | 其他资产 | 1,763,648.24 | 0.92 |
| 9 | 合计 | 191,668,459.73 | 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 14,383,667.71 元，占期末净值比例为 7.69%。

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

| 国家（地区） | 公允价值（人民币元） | 占基金资产净值比例 （%） |
|--------|----------------|------------------|
| 中国香港 | 166,749,848.79 | 89.17 |
| 合计 | 166,749,848.79 | 89.17 |

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

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---------|----------------|--------------|
| 10 能源 | - | - |
| 15 原材料 | 6,563,447.04 | 3.51 |
| 20 工业 | - | - |
| 25 可选消费 | 40,920,779.11 | 21.88 |
| 30 日常消费 | 4,122,332.34 | 2.20 |
| 35 医疗保健 | 87,466,104.49 | 46.77 |
| 40 金融 | 13,293,518.10 | 7.11 |
| 45 信息技术 | - | - |
| 50 电信服务 | 14,383,667.71 | 7.69 |
| 55 公用事业 | - | - |
| 60 房地产 | - | - |
| 合计 | 166,749,848.79 | 89.17 |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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

| 序号 | 公司名称（英文） | 公司名称（中文） | 证券代码 | 所在证券市场 | 所属国家（地区） | 数量（股） | 公允价值（人民币元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------------------------|----------|---------|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1 | Wuxi Biologics (Cayman) Inc | 药明生物技术有限 | 2269 HK | 香港联合 | 中国香港 | 155,500 | 18,411,975.01 | 9.85 |

| | | 公司 | | 交易所 | | | | |
|---|---|------------------|------------|---------|------|---------|---------------|------|
| 2 | WuXi Apptec Co., Ltd. | 无锡药明康德新药开发股份有限公司 | 2359 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 119,640 | 18,048,424.28 | 9.65 |
| 3 | Hygeia Healthcare Holdings Co., Limited | 海吉亚医疗控股有限公司 | 6078 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 184,000 | 15,616,477.44 | 8.35 |
| 4 | 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 | 80,000 | 14,644,608.00 | 7.83 |
| 5 | Tencent Holdings Ltd | 腾讯控股有限公司 | 700 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 29,600 | 14,383,667.71 | 7.69 |

| | | | | | | | | |
|---|--|------------------|------------|---------|------|--------|---------------|------|
| | | | | 交易所 | | | | |
| 6 | Meituan | 美团 | 3690 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 52,800 | 14,076,397.21 | 7.53 |
| 7 | 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 | 34,500 | 13,285,488.53 | 7.10 |
| 8 | Joinn Laboratories (China) Co., Ltd. | 北京昭衍新药研究中心股份有限公司 | 6127 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 98,000 | 10,192,980.00 | 5.45 |
| 9 | Hangzhou Tigermed Consulting Co., Ltd. | 杭州泰格医药科技 | 3347 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 62,000 | 9,389,190.72 | 5.02 |

| | | | | | | | | |
|----|----------------------------------|----------------|------------|---------------------------------|------------------|---------|--------------|------|
| | | 股份 有限 公司 | | 交 易 所 | | | | |
| 10 | New Horizon Health Limited | 诺辉 健康 | 6606 HK | 香 港 联 合 交 易 所 | 中 国 香 港 | 127,000 | 8,369,393.47 | 4.48 |

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

注：本基金本报告期末未持有基金投资。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，腾讯控股有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

5.10.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（人民币元） |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | 901,687.40 |
| 3 | 应收股利 | 44,074.04 |
| 4 | 应收利息 | 1,397.27 |
| 5 | 应收申购款 | 816,489.53 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,763,648.24 |

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------|----------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 165,954,904.91 |
| 本报告期基金总申购份额 | 21,840,836.21 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 45,962,301.41 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 141,833,439.71 |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注：本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

注：无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富亚洲澳洲成熟市场（除日本外）优势精选股票型证券投资基金募集的文件；

2、《汇添富香港优势精选混合型证券投资基金基金合同》；

3、《汇添富香港优势精选混合型证券投资基金托管协议》；

4、基金管理人业务资格批件、营业执照；

5、报告期内汇添富香港优势精选混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告；

6、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼 汇添富基金管理股份有限公司

9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 www.99fund.com 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司

2021 年 07 月 21 日