

汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2023 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的成员简介	16
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	16
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	16
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	17
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	19
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	19
§ 5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	19
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	19
5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	20
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	20
6.1 资产负债表	20
6.2 利润表	21
6.3 净资产（基金净值）变动表	22
6.4 报表附注	24
§ 7 投资组合报告	52
7.1 期末基金资产组合情况	52
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	52
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	53
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细	53
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	66
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	69
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	69

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	69
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细.....	69
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	69
7.11 投资组合报告附注.....	69
§ 8 基金份额持有人信息.....	70
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	70
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	70
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	71
8.4 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.....	71
§ 9 开放式基金份额变动.....	71
§ 10 重大事件揭示.....	72
10.1 基金份额持有人大会决议.....	72
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	72
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	72
10.4 基金投资策略的改变.....	72
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	73
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	73
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	73
10.8 其他重大事件.....	75
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	75
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况.....	76
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	76
§ 12 备查文件目录.....	76
12.1 备查文件目录.....	76
12.2 存放地点.....	76
12.3 查阅方式.....	76

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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）	447,724,668.18	
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	恒生 LOF	-
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）	385,197,470.83	62,527,197.35

2.2 基金产品说明

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。</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%。本基金的投资策略主要包括：股票投资策略、固定收益类资产投资策略、衍生品投资策略、资产支持证券投资策略、境内融资投资策略、参与境内转融通证券出借业务策略、境内存托凭证的投资策略。</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、</p>

	境外证券市场风险等特殊投资风险。
--	------------------

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	汇添富基金管理股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏
	联系电话	021-28932888
	电子邮箱	service@99fund.com
客户服务电话	400-888-9918	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	上海市黄浦区外马路728号	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	200010	100031
法定代表人	李文	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
	英文
注册地址	香港上海汇丰银行有限公司
办公地址	The Hong Kong and Shanghai Banking Co. Ltd.
办公地址	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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金中期报告备置地点	上海市黄浦区外马路728号 汇添富基金管理股份有限公司

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023年01月01日 - 2023年06月30日)	
	汇添富恒生指数（QDII-LOF）A	汇添富恒生指数（QDII-LOF）C
本期已实现收益	2,077,699.09	328,905.00
本期利润	-1,187,605.35	153,330.27
加权平均基金份额本期利润	-0.0031	0.0024
本期加权平均净值利润率	-0.36%	0.28%
本期基金份额净值增长率	-0.64%	-0.68%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年06月30日)	
期末可供分配利润	-15,055,789.49	-549,052.09
期末可供分配基金份额利润	-0.0391	-0.0088
期末基金资产净值	334,086,979.01	54,139,885.90
期末基金份额净值	0.8673	0.8659
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-18.64%	-19.77%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富恒生指数（QDII-LOF）A						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益	①—③	②—④

		准差②		率标准差 ④		
过去一个月	5.87%	1.27%	5.55%	1.30%	0.32%	-0.03%
过去三个月	-1.35%	1.11%	-2.20%	1.14%	0.85%	-0.03%
过去六个月	-0.64%	1.22%	-1.18%	1.26%	0.54%	-0.04%
过去一年	-5.30%	1.50%	-6.22%	1.55%	0.92%	-0.05%
自基金合同生效日起至今	-18.64%	1.43%	-20.69%	1.49%	2.05%	-0.06%
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
过去一个月	5.87%	1.27%	5.55%	1.30%	0.32%	-0.03%
过去三个月	-1.36%	1.11%	-2.20%	1.14%	0.84%	-0.03%
过去六个月	-0.68%	1.22%	-1.18%	1.26%	0.50%	-0.04%
过去一年	-5.38%	1.50%	-6.22%	1.55%	0.84%	-0.05%
自基金合同生效日起至今	-19.77%	1.43%	-20.69%	1.49%	0.92%	-0.06%

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



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2020 年 12 月 01 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。

本基金由原汇添富恒生指数分级证券投资基金于 2020 年 12 月 01 日转型而来。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限（年）	说明
		任职日期	离任日期		
乐无穹	本基金的基金经理	2023 年 04 月 13 日		9	国籍：中国。学历：复旦大学经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2014 年 7 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任

					<p>金融工程助理分析师、指数与量化投资部分析师。2019 年 4 月 15 日至今任中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 7 月 26 日至今任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2019 年 10 月 8 日至今任中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 4 月 29 日至 2022 年 11 月 21 日任汇添富中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月 8 日至今任汇添富中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月 27 日至今任汇添富中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2021 年 9 月 27 日至今任汇添富中证沪港深科技龙头交易型开放式指数证券投资</p>
--	--	--	--	--	--

					<p>基金的基金经 理。2021 年 9 月 29 日至今任汇添 富中证 800 交易 型开放式指数证 券投资基金联接 基金的基金经 理。2021 年 9 月 29 日至今任汇添 富中证沪港深科 技龙头指数型发 起式证券投资基金 的基金经理。 2021 年 10 月 26 日至 2022 年 10 月 30 日任汇添 富恒生科技指数 型发起式证券投 资基金（QDII） 的基金经理。 2021 年 10 月 29 日至今任汇添富 MSCI 中国 A50 互 联互通交易型开 放式指数证券投 资基金的基金经 理。2021 年 12 月 28 日至今任 汇添富中证沪港 深云计算产业指 数型发起式证券 投资基金的基金 经理。2022 年 1 月 11 日至今任 汇添富 MSCI 中 国 A50 互联互通 交易型开放式指 数证券投资基金 联接基金的基金 经理。2022 年 3 月 29 日至 2022 年 11 月 21 日任 汇添富中证人工 智能主题交易型</p>
--	--	--	--	--	---

					<p>开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 6 月 13 日至今任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 7 月 29 日至今任汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 8 月 31 日至今任汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2022 年 10 月 31 日至今任汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。2022 年 12 月 7 日至今任汇添富恒生香港上市生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2023 年 4 月 13 日至今任汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）的基金经理。2023 年 5 月 24 日至今任汇添富中证国新央企股东回</p>
--	--	--	--	--	--

					报交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月 19 日至今任汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。
赖中立	本基金的基金经理	2014 年 03 月 06 日	2023 年 04 月 13 日	16	<p>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 2023 年 4 月 13 日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 2023 年 4 月 13 日任汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的</p>

					<p>基金经理。2015 年 1 月 6 日至 2023 年 4 月 13 日任深证 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 2023 年 4 月 13 日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 2023 年 4 月 13 日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。2021 年 10 月 26 日至今任汇添富中证沪港深消费龙头指数型发起式证券投资基金的基金经理。2021 年 10 月 26 日至今任汇添富中证光伏产业指数增强型发起式证券投资基金的基金经</p>
--	--	--	--	--	---

					理。2022 年 3 月 29 日至今任汇添富中证科创创业 50 指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 7 月 5 日至今任汇添富恒生香港上市生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

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

3、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的成员简介

注:本基金无境外投资顾问。

4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

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

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

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 25 次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控，事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

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

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

国内来看，3 月两会召开，仍然坚持以稳增长为中心，加强协同，共同促进高质量发展。经济数据在二季度普遍表现疲软。GDP 增速低于市场预期。6 月官方制造业 PMI 数据 49，较前值小幅企稳，但仍低于 50。1-5 月规模以上工业企业营业收入累计同比增长 0.1%，利润累计同比下滑 18.8%，相较 1-4 月累计营收增速下滑、累计利润增速降幅有所收窄。国内经济整体仍处于弱复苏阶段，内需修复动力不足、外需增长压力较大。经济发展模式转型

阶段存在压力和挑战。在稳增长压力较大的背景下，政策层面有望持续发力。6月MLF下调10个基点，随后一年期、五年期LPR均下调10个基点，有望减轻企业融资成本、居民债务负担压力。

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

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

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富恒生指数（QDII-LOF）A类份额净值增长率为-0.64%，同期业绩比较基准收益率为-1.18%。本报告期汇添富恒生指数（QDII-LOF）C类份额净值增长率为-0.68%，同期业绩比较基准收益率为-1.18%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关

指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，并保持估值政策和程序的一贯性。

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。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。

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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—汇添富基金管理股份有限公司本报告期内基金的投资运作，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，汇添富基金管理股份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 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，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中期报告中的财务指标、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，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）

报告截止日：2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	26,601,071.39	30,500,271.60
结算备付金		98,255.58	94,552.63
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	361,602,849.36	357,976,387.95
其中：股票投资		361,602,849.36	357,976,387.95
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		1,885,808.18	16,500.00
应收申购款		700,266.46	1,031,067.62
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		390,888,250.97	389,618,779.80
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末
		2023年06月30日	2022年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		69.28	68.36
应付赎回款		2,120,100.48	3,125,797.23
应付管理人报酬		259,091.20	259,858.63
应付托管费		80,965.98	81,205.83
应付销售服务费		4,671.19	4,585.47
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	196,487.93	205,120.61
负债合计		2,661,386.06	3,676,636.13
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	391,598,982.18	386,769,025.76
未分配利润	6.4.7.9	-3,372,117.27	-826,882.09
净资产合计		388,226,864.91	385,942,143.67
负债和净资产总计		390,888,250.97	389,618,779.80

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 447,724,668.18 份。本基金下属汇添富恒生指数（QDII-LOF）A 基金份额净值 0.8673 元，基金份额总额 385,197,470.83 份；本基金下属汇添富恒生指数（QDII-LOF）C 基金份额净值 0.8659 元，基金份额总额 62,527,197.35 份。

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

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2023年01月01日	2022年01月01日
		至2023年06月30日	至2022年06月30日
一、营业总收入		1,201,541.39	4,406,709.74
1. 利息收入		114,995.55	86,796.15
其中：存款利息收入	6.4.7.10	114,995.55	86,796.15

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）		4,378,995.78	2,002,645.90
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-573,937.09	-2,266,720.69
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	46,581.90	-
股利收益	6.4.7.17	4,906,350.97	4,269,366.59
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-3,440,879.17	2,139,455.08
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		136,649.81	157,312.23
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	11,779.42	20,500.38
减：二、营业总支出		2,235,816.47	1,669,557.36
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,547,850.88	1,141,073.73
2. 托管费	6.4.10.2.2	483,703.32	356,585.54
3. 销售服务费		27,623.21	16,984.94
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		148.64	-
8. 其他费用	6.4.7.21	176,490.42	154,913.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,034,275.08	2,737,152.38
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,034,275.08	2,737,152.38
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,034,275.08	2,737,152.38

6.3 净资产（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：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	386,769,025.76	-826,882.09	385,942,143.67
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	386,769,025.76	-826,882.09	385,942,143.67
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	4,829,956.42	-2,545,235.18	2,284,721.24
（一）、综合收益总额	-	-1,034,275.08	-1,034,275.08
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	4,829,956.42	-1,510,960.10	3,318,996.32
其中：1. 基金申购款	111,563,863.10	334,556.67	111,898,419.77
2. 基金赎回款	-106,733,906.68	-1,845,516.77	-108,579,423.45
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	391,598,982.18	-3,372,117.27	388,226,864.91
项目	上年度可比期间		
	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	242,667,089.12	13,753,404.42	256,420,493.54
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	242,667,089.12	13,753,404.42	256,420,493.54
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	68,704,699.36	862,356.26	69,567,055.62
（一）、综合收益	-	2,737,152.38	2,737,152.38

总额			
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	68,704,699.36	-1,874,796.12	66,829,903.24
其中：1. 基金申购款	164,582,728.18	-661,343.26	163,921,384.92
2. 基金赎回款	-95,878,028.82	-1,213,452.86	-97,091,481.68
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期末净资产（基金净值）	311,371,788.48	14,615,760.68	325,987,549.16

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富恒生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分级证券投资基金募集的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集。基金合同于2014年3月6日生效。首次设立基金募集规模为1,270,631,138.98份基金份额，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）出具安永华明（2014）验字第60466941_B03号验资报告予以验证。

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。本基金为上市契约型开放式，存续期限不定。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。

本基金投资于标的指数的成份股、备选成份股和其他香港联合交易所上市的股票（含港股通标的股票）。此外，本基金还可投资于以下金融产品或工具：针对境外投资，本基金可投资于银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证、房地产信托凭证；在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品、与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品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、其他依法上市的股票），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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于股票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，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金的业绩比较基准为：经人民币汇率调整的恒生指数收益率 \times 95%+商业银行活期存款利率（税后） \times 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说

明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

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

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

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

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

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

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

基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区

税收法律和法规执行，在境内暂免征增值税和企业所得税；

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日
活期存款	26,601,071.39
等于：本金	26,592,913.08
加：应计利息	8,158.31
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	26,601,071.39

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	400,760,690.40	-	361,602,849.36	39,157,841.04
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	400,760,690.40	-	361,602,849.36	-

				39,157,841.04
--	--	--	--	---------------

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内不存在债权投资减值准备计提情况。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	22,999.81
其中：交易所市场	22,999.81
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	74,795.19
应付信息披露费	59,507.37
应付指数使用费	39,185.56
应付账户维护费	-
应付汇划费	-
应付上市费	-
应付持有人大会费-公证费	-

应付持有人大会费-律师费	-
其他	-
合计	196,487.93

6.4.7.8 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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	379,001,713.72	331,490,972.20
本期申购	74,778,009.51	65,404,018.45
本期赎回（以“-”号填列）	-68,582,252.40	-59,984,946.46
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	385,197,470.83	336,910,044.19
汇添富恒生指数（QDII-LOF）C		
项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	63,200,747.55	55,278,053.56
本期申购	52,775,676.81	46,159,844.65
本期赎回（以“-”号填列）	-53,449,227.01	-46,748,960.22
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	62,527,197.35	54,688,937.99

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

汇添富恒生指数（QDII-LOF）A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-16,839,080.89	16,189,038.92	-650,041.97
本期利润	2,077,699.09	-3,265,304.44	-1,187,605.35
本期基金份额交易产生的变动数	-294,407.69	-691,010.17	-985,417.86
其中：基金申购款	-3,388,988.78	3,696,431.59	307,442.81
基金赎回款	3,094,581.09	-4,387,441.76	-1,292,860.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-15,055,789.49	12,232,724.31	-2,823,065.18
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
本期期初	14,630,716.36	-14,807,556.48	-176,840.12
本期利润	328,905.00	-175,574.73	153,330.27
本期基金份额交易产生的变动数	-178,170.12	-347,372.12	-525,542.24
其中：基金申购款	12,179,778.61	-12,152,664.75	27,113.86
基金赎回款	-12,357,948.73	11,805,292.63	-552,656.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,781,451.24	-15,330,503.33	-549,052.09

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	111,914.20
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	2,848.72
其他	232.63
合计	114,995.55

注：“其他”为直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	30,992,540.36
减：卖出股票成本总额	31,415,529.09
减：交易费用	150,948.36
买卖股票差价收入	-573,937.09

6.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无买卖债券差价收入。

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
卖出权证成交总额	48,098.70
减：卖出权证成本总额	-
减：交易费用	115.87
减：买卖权证差价收入应缴纳 增值税额	1,400.93
买卖权证差价收入	46,581.90

6.4.7.16.2 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其他投资收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	4,906,350.97
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	4,906,350.97

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-3,440,879.17
——股票投资	-3,440,879.17
——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	-3,440,879.17

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	11,779.42
替代损益	-
其他	-
合计	11,779.42

6.4.7.20 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	2,262.16
指数使用费	77,392.53
持有人大会-公证费	-
持有人大会-律师费	-
开户费	-
上市费	-
其他	12,533.17
合计	176,490.42

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

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

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人, 基金销售机构
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”）	境外资产托管人

东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东, 基金代销机构
--------------------	------------------

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 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	59,564,308.28	85.73	84,935,545.60	86.67

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
东方证券	47,651.24	94.04	22,999.81	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
东方证券	67,948.53	94.55	26,974.41	100.00

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,547,850.88	1,141,073.73
其中：支付销售机构的客户维护费	510,095.96	345,768.48

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 个工作日内从基金资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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	483,703.32	356,585.54

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 个工作日内从基金资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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富恒生指数（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	-	1,607.88	1,607.88
合计	-	1,607.88	1,607.88
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富恒生指数（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	-	1,285.90	1,285.90
合计	-	1,285.90	1,285.90

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

销售服务费每日计提，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付指令，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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期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。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 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	20,625,543.80	80,659.86	26,666,685.04	80,035.34
汇丰银行	5,975,527.59	31,254.34	1,346,677.65	22.58

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期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。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金根据基金合同和招募说明书约定的投资策略，按照标的指数的成份股及其权重，构建基金的股票投资组合。经基金管理人董事会和基金托管人审核同意，投资于基金托管人汇丰银行发行的股票汇丰控股。于本报告期末，本基金按照指数权重比例持有汇丰控股 524,400.00 股。（于上年度可比期间，本基金按照指数权重比例持有汇丰控股 534,000.00 股。）

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期未进行利润分配。于资产负债表日之后、财务报表批准日之前批准、公

告或实施的利润分配情况详见资产负债表日后事项章节。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2023 年 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2023 年 06 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

金销售资格的金融机构进行。另外，基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具

还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 06 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月- 1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	26,601,071.39	-	-	-	-	-	26,601,071.39
结算备付金	663.99	-	-	-	-	97,591.59	98,255.58
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	-	361,602,849.36	361,602,849.36
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	1,885,808.18	1,885,808.18
应收申购款	18,044.84	-	-	-	-	682,221.62	700,266.46

递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	26,619,780.22	-	-	-	-	364,268,470.75	390,888,250.97
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	69.28	69.28
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,120,100.48	2,120,100.48
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	259,091.20	259,091.20
应付托管费	-	-	-	-	-	80,965.98	80,965.98
应付销售服务费	-	-	-	-	-	4,671.19	4,671.19
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-

应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	196,487.93	196,487.93
负债总计	-	-	-	-	-	2,661,386.06	2,661,386.06
利率敏感度缺口	26,619,780.22	-	-	-	-	361,607,084.69	388,226,864.91
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	30,500,271.60	-	-	-	-	-	30,500,271.60
结算备付金	-	-	-	-	-	94,552.63	94,552.63
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	-	357,976,387.95	357,976,387.95
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-

应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	16,500.00	16,500.00
应收申购款	23,118.08	-	-	-	-	1,007,949.54	1,031,067.62
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	30,523,389.68	-	-	-	-	359,095,390.12	389,618,779.80
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	68.36	68.36
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,125,797.23	3,125,797.23
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	259,858.63	259,858.63
应付托管费	-	-	-	-	-	81,205.83	81,205.83

应付销售服务费	-	-	-	-	-	4,585.47	4,585.47
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	205,120.61	205,120.61
负债总计	-	-	-	-	-	3,676,636.13	3,676,636.13
利率敏感度缺口	30,523,389.68	-	-	-	-	355,418,753.99	385,942,143.67

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币	合计

			种折合 人民币	
以外币 计价的 资产				
银行存款	16,141.71	5,959,199.78	-	5,975,341.49
结算备 付金	-	97,591.59	-	97,591.59
存出保 证金	-	-	-	-
交易性 金融资 产	-	361,602,849.36	-	361,602,849.36
衍生金 融资产	-	-	-	-
买入返 售金融 资产	-	-	-	-
债权投 资	-	-	-	-
应收清 算款	-	-	-	-
应收股 利	-	94,854.04	-	94,854.04
应收申 购款	-	-	-	-
递延所 得税资 产	-	-	-	-
其他资 产	-	-	-	-
资产合 计	16,141.71	367,754,494.77	-	367,770,636.48
以外币 计价的 负债				
短期借 款	-	-	-	-
交易性 金融负 债	-	-	-	-
衍生金 融负债	-	-	-	-

卖出回购金融资产款	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净额	16,141.71	367,754,494.77	-	367,770,636.48
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	137,743.70	10,579,432.37	-	10,717,176.07
结算备	-	94,552.63	-	94,552.63

付金				
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	357,976,387.95	-	357,976,387.95
衍生金融资产	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	137,743.70	368,650,372.95	-	368,788,116.65
以外币计价的负债				
短期借款	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管	-	-	-	-

理人报酬				
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净额	137,743.70	368,650,372.95	-	368,788,116.65

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	1. 除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑基金管理人为降低汇率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	美元相对人民币升值 5%	807.09	6,887.19
	美元相对人民币贬值 5%	-807.09	-6,887.19
	港币相对人民币升值 5%	18,387,724.74	18,432,518.65
	港币相对人民币贬值 5%	-18,387,724.74	-18,432,518.65

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	361,602,849.36	93.14	357,976,387.95	92.75
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	361,602,849.36	93.14	357,976,387.95	92.75

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变； 2. 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	恒生指数(汇率调整)上涨 5%	17,810,707.25	17,606,713.35
	恒生指数(汇率调整)下跌 5%	-17,810,707.25	-17,606,713.35

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

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

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 06 月 30 日
第一层次	361,602,849.36
第二层次	-
第三层次	-
合计	361,602,849.36

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	361,602,849.36	92.51
	其中：普通股	358,193,828.31	91.64
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	3,409,021.05	0.87
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	26,699,326.97	6.83
8	其他各项资产	2,586,074.64	0.66
9	合计	390,888,250.97	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 314,807,265.81 元，占期末净值比例为 81.09%。

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
中国香港	361,602,849.36	93.14
合计	361,602,849.36	93.14

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

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

7.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
10 能源	14,868,490.25	3.83
15 原材料	2,462,627.02	0.63
20 工业	13,254,147.36	3.41
25 可选消费	85,906,434.30	22.13
30 日常消费	14,278,646.64	3.68
35 医疗保健	7,874,417.28	2.03
40 金融	125,346,818.20	32.29
45 信息技术	13,243,434.13	3.41
50 电信服务	48,999,535.25	12.62
55 公用事业	12,023,205.23	3.10
60 房地产	23,345,093.70	6.01
合计	361,602,849.36	93.14

7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

注：本报告期末未持有积极投资。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

7.4.1 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）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地）	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
----	----------	---------	------	--------	---------	-------	------	--------------

		文)			区))
1	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股	700 HK	香港联合交易所	中国香港	97,600	29,839,108.2 4	7.69
2	HSBC Holdings PLC	汇丰控股	5 HK	香港联合交易所	中国香港	524,400	29,492,665.0 3	7.60
3	Alibaba Group Holding Ltd	阿里巴巴	998 8 HK	香港联合交易所	中国香港	388,100	29,055,019.5 7	7.48
4	AIA Group Ltd	友邦保险	129 9 HK	香港联合交易所	中国香港	388,600	28,340,060.9 5	7.30
5	Meituan	美团-W	369 0 HK	香港联合交易所	中国香港	187,050	21,091,412.7 1	5.43
6	China Construction Bank Corp	建设银行	939 HK	香港联合交易所	中国香港	3,603,00 0	16,842,002.2 8	4.34

7	China Mobile Ltd	中国移动	941 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	204,500	12,076,301.4 9	3.11
8	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	香港 交易 所	388 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	40,100	10,913,956.6 9	2.81
9	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	中国 平安	231 8 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	210,500	9,674,727.98	2.49
1 0	Industrial & Commercial Bank of China Ltd	工 商 银 行	139 8 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	2,457,00 0	9,468,974.31	2.44
1 1	Bank of China Ltd	中 国 银 行	398 8 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	2,785,00 0	8,062,622.90	2.08
1 2	BYD Co Ltd	比 亚 迪	121 1 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	32,500	7,491,087.50	1.93
1 3	JD.com Inc	京 东	961 8	香 港	中 国	57,700	7,043,447.77	1.81

		集团	HK	联合交易所	香港			
14	Xiaomi Corp	小米集团	1810 HK	香港联合交易所	中国香港	582,400	5,756,223.55	1.48
15	CNOOC Ltd	中国海洋石油	883 HK	香港联合交易所	中国香港	519,000	5,359,285.34	1.38
16	Wuxi Biologics Cayman Inc	药明生物	2269 HK	香港联合交易所	中国香港	126,500	4,379,474.15	1.13
17	Sun Hung Kai Properties Ltd	新鸿基地产	16 HK	香港联合交易所	中国香港	48,000	4,367,972.45	1.13
18	China Merchants Bank Co Ltd	招商银行	3968 HK	香港联合交易所	中国香港	129,500	4,250,512.20	1.09
19	Techtronic Industries Co Ltd	创科实业	669 HK	香港联合交易所	中国香港	51,500	4,043,089.75	1.04

				交易所				
20	CK Hutchison Holdings Ltd	长和	1 HK	香港联合交易所	中国香港	89,108	3,931,154.74	1.01
21	CLP Holdings Ltd	中电控股	2 HK	香港联合交易所	中国香港	67,000	3,761,954.99	0.97
22	PetroChina Co Ltd	中国石油	857 HK	香港联合交易所	中国香港	708,000	3,537,969.17	0.91
23	China Petroleum & Chemical Corp	中国石化	386 HK	香港联合交易所	中国香港	824,000	3,487,075.88	0.90
24	Link REIT	领展房产基金	823 HK	香港联合交易所	中国香港	85,000	3,409,021.05	0.88
25	ANTA Sports Products Ltd	安踏体育	2020 HK	香港联合交易所	中国香港	45,000	3,321,202.46	0.86

				所				
2 6	Galaxy Entertainment Group Ltd	银河娱乐	27 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	72,000	3,299,213.23	0.85
2 7	China Resources Land Ltd	华润置地	110 9 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	106,000	3,244,632.02	0.84
2 8	NetEase Inc	网易	999 9 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	23,000	3,235,965.40	0.83
2 9	Li Ning Co Ltd	李宁	233 1 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	79,000	3,070,055.10	0.79
3 0	China Life Insurance Co Ltd	中国人寿	262 8 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	247,000	2,974,141.52	0.77
3 1	Baidu Inc	百度	988 8 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	23,550	2,883,437.13	0.74
3	China Mengniu	蒙	231	香	中	105,000	2,855,833.05	0.74

2	Dairy Co Ltd	牛乳业	9 HK	港 联 合 交 易 所	国 香 港			
3 3	BOC Hong Kong Holdings Ltd	中银香港	238 8 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	123,000	2,716,014.78	0.70
3 4	Nongfu Spring Co Ltd	农夫山泉	963 3 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	67,000	2,671,667.55	0.69
3 5	CK Asset Holdings Ltd	长实集团	111 3 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	65,608	2,625,234.05	0.68
3 6	Hang Seng Bank Ltd	恒生银行	11 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	25,400	2,611,139.56	0.67
3 7	Semiconductor Manufacturing International Corp	中芯国际	981 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	138,500	2,604,962.29	0.67
3 8	China Resources Beer Holdings Co Ltd	华润啤	291 HK	香 港 联	中 国 香	54,000	2,569,005.07	0.66

		酒		合交易所	港			
39	China Shenhua Energy Co Ltd	中国神华	1088 HK	香港联合交易所	中国香港	112,500	2,484,159.86	0.64
40	ENN Energy Holdings Ltd	新奥能源	2688 HK	香港联合交易所	中国香港	26,300	2,366,612.02	0.61
41	Hong Kong & China Gas Co Ltd	香港中华煤气	3 HK	香港联合交易所	中国香港	372,619	2,325,814.99	0.60
42	Sands China Ltd	金沙中国有限公司	1928 HK	香港联合交易所	中国香港	94,000	2,313,985.40	0.60
43	CITIC Ltd	中信股份	267 HK	香港联合交易所	中国香港	242,000	2,086,164.15	0.54
44	MTR Corp Ltd	港铁公司	66 HK	香港联合	中国香港	61,500	2,041,263.72	0.53

				交易所				
4 5	China Overseas Land & Investment Ltd	中国海外发展	688 HK	香港联合交易所	中国香港	127,500	2,007,795.85	0.52
4 6	Wharf Real Estate Investment Co Ltd	九龙仓置业	199 7 HK	香港联合交易所	中国香港	55,000	1,985,253.44	0.51
4 7	Zijin Mining Group Co Ltd	紫金矿业	289 9 HK	香港联合交易所	中国香港	180,000	1,908,498.60	0.49
4 8	Shenzhou International Group Holdings Ltd	申洲国际	231 3 HK	香港联合交易所	中国香港	27,500	1,895,245.14	0.49
4 9	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	石药集团	109 3 HK	香港联合交易所	中国香港	296,800	1,863,513.35	0.48
5 0	Haier Smart Home Co Ltd	海尔智家	669 0 HK	香港联合交易所	中国香港	81,000	1,840,871.37	0.47

				所				
5 1	Lenovo Group Ltd	联想集团	992 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	242,000	1,822,883.54	0.47
5 2	Geely Automobile Holdings Ltd	吉利汽车	175 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	201,000	1,771,639.89	0.46
5 3	Power Assets Holdings Ltd	电能实业	6 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	46,000	1,740,974.83	0.45
5 4	Sunny Optical Technology Group Co Ltd	舜宇光学科技	238 2 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	23,700	1,707,649.87	0.44
5 5	JD Health International Inc	京东健康	661 8 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	37,050	1,689,180.30	0.44
5 6	Xinyi Solar Holdings Ltd	信义光能	968 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	162,000	1,351,714.88	0.35
5	Budweiser	百	187	香	中	66,100	1,231,046.14	0.32

7	Brewing Co APAC Ltd	威亚太	6 HK	香港联合交易所	国香港			
58	Sino Biopharmaceutical Ltd	中国生物制药	1177 HK	香港联合交易所	中国香港	378,500	1,189,985.76	0.31
59	Trip.com Group Ltd	携程集团	9961 HK	香港联合交易所	中国香港	4,650	1,168,692.63	0.30
60	Longfor Group Holdings Ltd	龙湖集团	960 HK	香港联合交易所	中国香港	63,000	1,105,933.45	0.28
61	WH Group Ltd	万洲国际	288 HK	香港联合交易所	中国香港	277,500	1,061,775.22	0.27
62	China Resources Power Holdings Co Ltd	华润电力	836 HK	香港联合交易所	中国香港	64,000	1,044,418.94	0.27
63	Henderson Land Development Co Ltd	恒基地	12 HK	香港联	中国香	47,991	1,030,949.09	0.27

		产		合	港			
				交				
				易				
				所				
6 4	Haidilao International Holding Ltd	海底捞	686 2 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	64,000	1,017,275.85	0.26
6 5	China Unicom Hong Kong Ltd	中国联通	762 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	202,000	964,722.99	0.25
6 6	Chow Tai Fook Jewellery Group Ltd	周大福	192 9 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	66,600	864,566.46	0.22
6 7	China Resources Mixc Lifestyle Services Ltd	华润万象生活	120 9 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	22,800	817,722.50	0.21
6 8	New World Development Co Ltd	新世界发展	17 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	45,250	804,353.79	0.21
6 9	CK Infrastructure Holdings Ltd	长江基建集	103 8 HK	香港 联合 交	中国 香港	20,500	783,429.46	0.20

		团		易所				
7 0	Alibaba Health Information Technology Ltd	阿里健康	241 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	180,000	781,654.64	0.20
7 1	Xinyi Glass Holdings Ltd	信义玻璃	868 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	68,000	764,874.61	0.20
7 2	Tingyi Cayman Islands Holding Corp	康师傅控股	322 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	64,000	718,701.85	0.19
7 3	Hengan International Group Co Ltd	恒安国际	104 4 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	23,000	699,782.82	0.18
7 4	Country Garden Services Holdings Co Ltd	碧桂园服务	609 8 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	73,000	681,121.94	0.18
7 5	Zhongsheng Group Holdings Ltd	中升控股	881 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	24,000	662,719.22	0.17

7 6	Hang Lung Properties Ltd	恒 隆 地 产	101 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	59,000	658,201.52	0.17
7 7	Country Garden Holdings Co Ltd	碧 桂 园	200 7 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	414,000	606,902.55	0.16
7 8	China Hongqiao Group Ltd	中 国 宏 桥	137 8 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	94,500	554,128.42	0.14
7 9	Hansoh Pharmaceutical Group Co Ltd	翰 森 制 药	369 2 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	38,000	441,444.02	0.11
8 0	Orient Overseas International Ltd	东 方 海 外 国 际	316 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	4,000	387,600.39	0.10

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

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超期初基金资产净值 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	Meituan	3690 HK	4,660,676.24	1.21
2	Alibaba Group Holding Ltd	9988 HK	3,879,507.24	1.01
3	Zijin Mining Group Co Ltd	2899 HK	1,911,232.36	0.50
4	Tencent Holdings Ltd	700 HK	1,788,360.45	0.46
5	JD Health International Inc	6618 HK	1,735,249.07	0.45
6	AIA Group Ltd	1299 HK	1,305,465.69	0.34
7	China Construction Bank Corp	939 HK	1,287,510.72	0.33
8	China Mobile Ltd	941 HK	1,263,119.48	0.33
9	China Resources Power Holdings Co Ltd	836 HK	1,094,764.48	0.28
10	Trip.com Group Ltd	9961 HK	1,091,863.28	0.28
11	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	2318 HK	1,054,092.17	0.27
12	Link REIT	823 HK	941,637.23	0.24
13	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	388 HK	934,059.65	0.24
14	BYD Co Ltd	1211 HK	845,474.02	0.22
15	Bank of China Ltd	3988 HK	819,472.85	0.21
16	HSBC Holdings PLC	5 HK	733,285.24	0.19
17	Industrial & Commercial Bank of China Ltd	1398 HK	726,497.85	0.19
18	JD.com Inc	9618 HK	647,336.17	0.17
19	Baidu Inc	9888 HK	602,840.59	0.16
20	Wuxi Biologics Cayman Inc	2269 HK	556,199.83	0.14

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。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	HSBC Holdings PLC	5 HK	6,441,864.36	1.67
2	Tencent Holdings Ltd	700 HK	3,811,654.43	0.99
3	Meituan	3690 HK	2,715,383.99	0.70
4	Alibaba Group Holding Ltd	9988 HK	1,429,775.30	0.37
5	AIA Group Ltd	1299 HK	1,341,370.57	0.35
6	China Mobile Ltd	941 HK	1,053,163.51	0.27
7	China Construction Bank Corp	939 HK	1,053,106.32	0.27
8	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	2318 HK	954,694.66	0.25
9	CNOOC Ltd	883 HK	740,513.72	0.19
10	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	388 HK	721,330.31	0.19
11	JD.com Inc	9618 HK	667,062.33	0.17
12	Industrial & Commercial Bank of China Ltd	1398 HK	587,429.14	0.15
13	BYD Co Ltd	1211 HK	457,883.45	0.12
14	Xiaomi Corp	1810 HK	369,316.81	0.10
15	Sun Hung Kai Properties Ltd	16 HK	327,821.66	0.08
16	Bank of China Ltd	3988 HK	326,187.95	0.08
17	Link REIT	823 HK	324,536.67	0.08
18	China Petroleum & Chemical Corp	386 HK	316,696.85	0.08
19	China Merchants Bank Co Ltd	3968 HK	287,586.53	0.07
20	Wuxi Biologics Cayman Inc	2269 HK	279,443.97	0.07

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	38,482,869.67
卖出收入（成交）总额	30,992,540.36

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

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

注：本基金本报告期末未持有基金投资。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

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

7.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	1,885,808.18
4	应收利息	-
5	应收申购款	700,266.46
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	2,586,074.64

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
汇添富恒生指数（QDII-LOF）A	20,621	18,679.86	23,821.00	0.01	385,173,649.83	99.99
汇添富恒生指数（QDII-LOF）C	4,555	13,727.16	1,112,925.43	1.78	61,414,271.92	98.22
合计	25,176	17,783.79	1,136,746.43	0.25	446,587,921.75	99.75

8.2 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	9.90
2	廖雪静	5,126,367.00	9.02
3	李燕欢	1,892,663.00	3.33
4	郭峰	953,801.00	1.68

5	何惠忠	910,672.00	1.60
6	吴旋玲	820,423.00	1.44
7	陈远亮	729,677.00	1.28
8	李锡祥	718,919.00	1.26
9	方放	695,701.00	1.22
10	陈卫	679,229.00	1.20
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。

8.3 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	226,023.18	0.06
	汇添富恒生指数（QDII-LOF）C	7,294.71	0.01
	合计	233,317.89	0.05

8.4 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 开放式基金份额变动

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	-
本报告期期初基金份额总额	379,001,713.72	63,200,747.55
本报告期基金总申购份额	74,778,009.51	52,775,676.81
减：本报告期基金总赎回份额	68,582,252.40	53,449,227.01
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	385,197,470.83	62,527,197.35

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本基金基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
东方证券	1	59,564,308.28	85.73	47,651.24	94.04	
Sanford C. Bernstein	-	9,910,939.55	14.27	2,973.43	5.87	
Goldman Sachs	-	-	-	47.80	0.09	
方正证券	1	-	-	-	-	
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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	债券回购交易	权证交易	基金交易
------	------	--------	------	------

	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
Sanford C. Bernstein	-	-	-	-	297.45	0.62	-	-
Goldman Sachs	-	-	-	-	47,801.25	99.38	-	-
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：

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）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, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 01 月 17 日
2	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 年第四季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 01 月 20 日
3	关于防范不法分子冒用汇添富基金名义进行非法活动的重要提示	公司网站	2023 年 03 月 13 日
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 年年度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 03 月 31 日
5	关于汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）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, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 04 日
6	汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）基金经理变更公告	上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 14 日
7	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新招募说明书及基金产品资料概要	上交所, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 17 日
8	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2023 年第一季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 21 日
9	关于汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）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, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 05 月 24 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

注：无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富恒生指数分级证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）基金合同》；
- 3、《汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）在规定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

12.3 查阅方式

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

汇添富基金管理股份有限公司

2023 年 08 月 31 日