

汇添富恒生指数分级证券投资基金 2020 年中期报告

2020 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：2020 年 08 月 28 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 2020 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 01 月 01 日起至 6 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	7
2.6 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的成员简介	11
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	43
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	43
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	43
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	56
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	59
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	59

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	59
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细.....	59
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	59
7.11 投资组合报告附注.....	59
§ 8 基金份额持有人信息	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	60
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	61
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	62
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.....	63
§ 9 开放式基金份额变动	63
§ 10 重大事件揭示	64
10.1 基金份额持有人大会决议.....	64
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.....	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	64
10.4 基金投资策略的改变.....	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	64
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.....	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	64
10.8 其他重大事件.....	66
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	69
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.....	69
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	70
§ 12 备查文件目录	70
12.1 备查文件目录.....	70
12.2 存放地点	70
12.3 查阅方式	70

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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）	344,822,585.32		
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	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）	70,221,451.00	70,221,451.00	204,379,683.32

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	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 $\times 95\%$ + 商业银行活期存款利率（税后） $\times 5\%$
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	贺倩
	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

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
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(2020年01月01日 - 2020年06月30日)
本期已实现收益	2,852,340.81
本期利润	-19,708,805.54
加权平均基金份额本期利润	-0.0676
本期加权平均净值利润率	-6.18%
本期基金份额净值增长率	-10.47%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年06月30日)
期末可供分配利润	41,957,285.14
期末可供分配基金份额利润	0.1220
期末基金资产净值	373,550,768.37
期末基金份额净值	1.083
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年06月30日)
基金份额累计净值增长率	23.82%

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

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	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	5.97%	1.29%	5.36%	1.33%	0.61%	-0.04%
过去三 个月	3.84%	1.41%	3.32%	1.43%	0.52%	-0.02%
过去六 个月	-10.47%	1.68%	-11.00%	1.74%	0.53%	-0.06%
过去一 年	-9.96%	1.34%	-10.48%	1.38%	0.52%	-0.04%
过去三 年	2.54%	1.14%	0.11%	1.16%	2.43%	-0.02%
自基金 合同生 效日起 至今	23.82%	1.08%	24.56%	1.11%	-0.74%	-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：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。

§ 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

汇添富基金管理股份有限公司经中国证监会证监基金字【2005】5 号文批准，于 2005 年 2 月 3 日正式成立。目前，公司注册资本为 132,724,224 元人民币。公司总部设在上海，在北京、上海、广州、成都等地设有分公司，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。

2020 上半年，汇添富基金新成立 11 只公开募集证券投资基金，包括 4 只债券型基金、5 只混合型基金、1 只基金中基金、1 只指数基金联接基金。截至 2020 年 6 月 30 日，公司共管理 154 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		
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，相关业务资格：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基金 (LOF) 的基金经理, 2014 年 3 月 6 日至今任汇添富恒生指数分级 (QDII) 基金的基金经理, 2015 年 1 月 6 日至今任汇添富深证 300ETF 基金、汇添富深证 300ETF 基金联接基金的基金经理, 2015 年 5 月 26 日至 2016 年 7 月 13 日任汇添富香港优势混合基金的基金经理, 2016 年 12 月 29 日至今任汇添富中证环境治理指数 (LOF) 基金的基金经理, 2017 年 5 月 18 日至今任汇添富优选回报混合基金的基金经理, 2017 年 11 月 24 日至今任汇添富中证港股通高股息投资指数 (LOF) 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“离职日期”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: 本报告期末本基金不存在基金经理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遵规守信情况的说明

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

本基金管理人高度重视投资者利益保护。公司投资交易风险控制体系由投资、研究、交易、营运、风险管理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。

4.4.2 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 34 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

回顾上半年，香港市场在内外多重因素的作用下维持震荡格局。我们认为相关市场的主要驱动因素如下：1) 海内外疫情发展带来的经济冲击不容小觑，全面影响上市公司经营水平，对香港市场产生较大压力；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) 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持续流入香港市场，为香港市场不断引入活水。总体来看，上半年香港市场呈现的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

本基金本报告期基金份额净值增长率为-10.47%。同期业绩比较基准收益率为-11.00%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们对于 2020 下半年的港股投资机会持谨慎乐观的观点。站在战略资产配置资金的维度，港股仍处于“极低估值”区间，存在向上“均值回归”的动力，若市场波动加剧，反而为长线投资者提供买点；站在中短期资金的角度，“美元弱、港元强、人民币反弹”的汇率条件有助于估值修复，使得海外资金回流可能是下半年的主旋律；而南下资金尽管流入放缓，但趋势仍在延续。从结构性改革的角度来看，和美股相比，港股“金融地产+腾讯”的市值结构显得头重脚轻，“新经济”成色不足的问题长久困扰着投资者。随着恒指选股新规改革、中概股加速回归潮的到来，港股市场迎来“源头活水”，“新老交替”的产业结构为中长期估值抬升打下坚实基础。此外，港股国企私有化、红筹股 AH 上市加速，制度改革孕育无限新机。尽管海外“宽松依赖症”进入证伪期，港股短期走势或受到负面影响；但随着宏观从“疫情坑”走向结构“修复期”、汇率条件稳中向好、制度变迁加速，我们认为港股下半年依然具备向上的动力。综合以上观点，我们认为，2020 年港股虽然面临来自各个方面的挑战，但仍存在投资机会。

4.7 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。

4.8 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：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。

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《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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 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《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：汇添富恒生指数分级证券投资基金

报告截止日：2020 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 06 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	25,306,338.59	18,764,865.82
结算备付金		38,501.50	37,757.13
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	348,386,094.93	262,884,753.83
其中：股票投资		348,386,094.93	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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	4,219.53	3,710.39
应收股利		1,989,691.07	9,434.24
应收申购款		1,902,494.85	622,931.91
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		377,627,340.47	282,323,453.32
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 06 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付证券清算款		74.57	227.35
应付赎回款		3,411,865.02	2,425,240.92
应付管理人报酬		363,788.91	283,313.63
应付托管费		75,789.34	59,023.63
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	44,192.87	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	6.4.7.8	180,861.39	345,682.35
负债合计		4,076,572.10	3,122,944.20
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	239,702,523.70	125,655,476.82
未分配利润	6.4.7.10	133,848,244.67	153,545,032.30
所有者权益合计		373,550,768.37	279,200,509.12
负债和所有者权益总计		377,627,340.47	282,323,453.32

注：报告截止日 2020 年 06 月 30 日，本基金份额净值 1.083 元，基金份额总额 344,822,585.32 份。其中，本基金下属恒生 A 基金份额净值 1.022 元，基金份额总额 70,221,451.00 份；本基金下属恒生 B 基金份额净值 1.144 元，基金份额总额 70,221,451.00 份；本基金下属添富恒生基金份额净值 1.083 元，基金份额总额 204,379,683.32 份。

6.2 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 06 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 06 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日
一、收入		-16,890,171.30	39,173,445.78
1. 利息收入		86,576.10	53,017.11
其中：存款利息收入	6.4.7.11	86,576.10	53,017.11
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）		5,335,147.15	11,241,585.11
其中：股票投资收益	6.4.7.12	937,029.28	6,669,374.50

基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.2	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	4,398,117.87	4,572,210.61
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-22,561,146.35	27,651,685.91
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		118,287.61	96,392.90
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	130,964.19	130,764.75
减：二、费用		2,818,634.24	2,746,673.40
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,899,827.06	1,884,807.21
2. 托管费	6.4.10.2.2	395,797.28	392,668.14
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	324,218.15	236,742.24
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	2,014.87
7. 其他费用	6.4.7.21	198,730.20	230,440.94
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-19,708,805.54	36,426,772.38
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-19,708,805.54	36,426,772.38

6.3 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 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 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）	-	-19,708,805.54	-19,708,805.54
三、本期基金份额交易产生的基	114,047,046.88	12,017.91	114,059,064.79

金净值变动数 (净值减少以 “-”号填列)			
其中: 1. 基金申 购款	242,161,484.15	8,247,772.78	250,409,256.93
2. 基金赎回款	-128,114,437.27	-8,235,754.87	-136,350,192.14
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)	239,702,523.70	133,848,244.67	373,550,768.37
项目	上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 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)	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)	-	36,426,772.38	36,426,772.38
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)	-102,477,988.02	-19,523,815.71	-122,001,803.73
其中: 1. 基金申 购款	95,049,115.06	2,774,518.17	97,823,633.23
2. 基金赎回款	-197,527,103.08	-22,298,333.88	-219,825,436.96
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)	124,821,532.56	151,660,547.77	276,482,080.33

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:

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

6.4 报表附注

6.4.1 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人募集,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。本基金为契约型开放式,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(The Hong Kong and Shanghai Banking Co., Ltd.)。

本基金的份额包括汇添富恒生指数分级证券投资基金之基础份额(简称“添富恒生份额”)、汇添富恒生指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(简称“恒生 A 份额”)与汇添富恒生指数分级证券投资基金之积极收益类份额(简称“恒生 B 份额”)。其中,恒生 A、恒生 B 的基金份额配比始终保持 1:1 的比率不变。本基金的基础份额为股票型基金,属于高风险、高收益的基金品种,其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。恒生 A 份额将具有低风险、收益稳定特征,其预期收益和预期风险要低于普通的股票型基金份额,类似于债券型基金份额。恒生 B 份额则具有高风险、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,类似于具有收益杠杆性的股票型基金份额。

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) $\times 5\%$ 。

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。

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 2020 年 06 月 30 日的财务状况以及 2020 年 01 月 01 日至 2020 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 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。

6.4.6.1 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。

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 2020 年 06 月 30 日
活期存款	25,306,338.59
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	25,306,338.59

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 06 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	352,192,787.53	348,386,094.93	-3,806,692.60

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		352,192,787.53	348,386,094.93	-3,806,692.60

6.4.7.3 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。

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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 06 月 30 日
应收活期存款利息	4,219.53
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	4,219.53

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 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 06 月 30 日
交易所市场应付交易费用	44,192.87

银行间市场应付交易费用	-
合计	44,192.87

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	11,265.27
应付证券出借违约金	-
应付审计费	44,753.80
应付信息披露费	59,672.34
应付指数使用费	35,334.72
应付账户维护费	-
应付汇划费	-
其他	29,835.26
合计	180,861.39

6.4.7.9 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 06 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	242,161,484.15	242,161,484.15
本期赎回（以“-”号填列）	-128,114,437.27	-128,114,437.27
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	344,822,585.32	239,702,523.70

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 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	2,852,340.81	-22,561,146.35	-19,708,805.54
本期基金份额交易产生的变动数	-21,808,493.55	21,820,511.46	12,017.91
其中：基金申购款	-38,640,127.50	46,887,900.28	8,247,772.78
基金赎回款	16,831,633.95	-25,067,388.82	-8,235,754.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	41,957,285.14	91,890,959.53	133,848,244.67

6.4.7.11 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 06 月 30 日
活期存款利息收入	73,194.10
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	9,981.74
其他	3,400.26
合计	86,576.10

注：“其他”为直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 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 06 月 30 日
卖出股票成交总额	25,690,253.16
减：卖出股票成本总额	24,753,223.88
买卖股票差价收入	937,029.28

6.4.7.13 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 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。

6.4.7.14.2 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。

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——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具投资收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	4,398,117.87
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	4,398,117.87

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-22,561,146.35
——股票投资	-22,561,146.35
——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	-22,561,146.35

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	130,964.19
替代损益	-
其他	-

合计	130,964.19
----	------------

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
交易所市场交易费用	324,218.15
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
合计	324,218.15

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
审计费用	44,753.80
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	1,141.26
指数使用费	63,327.54
持有人大会-公证费	-
持有人大会-律师费	-
开户费	-
上市费	29,835.26
其他	-
合计	198,730.20

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”）	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, 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 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 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	156,297,831.06	98.61	112,390,687.63	97.96

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 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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
------	---------------------------------------

称	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	125,038.58	99.47	44,192.87	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 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	89,913.23	99.23	25,212.35	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 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,899,827.06	1,884,807.21
其中：支付销售机构的客户维护费	279,702.70	233,103.31

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 3 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。

6.4.10.2.2 基金托管费

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 06 月 30 日	2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	395,797.28	392,668.14

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 3 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。

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。

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

注：本基金本报告期末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。

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。

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 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 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	21,026,036.62	73,166.10	4,936,273.74	38,467.41
汇丰银行	4,280,301.97	28.00	12,605,109.70	6,851.71

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。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2020 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 2020 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金融资产款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2020 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金融资产款余额。

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 2020 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同责任，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。

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。

本基金所持证券均在证券交易所上市；因此，除在附注 6.4.12 中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外，本报告期末本基金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。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、结算保证金、债券投资、买入返售金融资产及部分应收申购款等。本基金的生息负债主要为卖出回购金融资产款等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 末 2020 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	25,306,338.59	-	-	-	-	-	25,306,338.59
结算备付金	-	-	-	-	-	38,501.50	38,501.50
存出	-	-	-	-	-	-	-

保证 金							
交易 性金 融资 产	-	-	-	-	-	348,386,094.93	348,386,094.93
应收 股利	-	-	-	-	-	1,989,691.07	1,989,691.07
应收 利息	-	-	-	-	-	4,219.53	4,219.53
应收 申购 款	104,028.40	-	-	-	-	1,798,466.45	1,902,494.85
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	25,410,366.99	-	-	-	-	352,216,973.48	377,627,340.47
负债							

应付 赎回 款	-	-	-	-	-	3,411,865.02	3,411,865.02
应付 管理 人报 酬	-	-	-	-	-	363,788.91	363,788.91
应付 托管 费	-	-	-	-	-	75,789.34	75,789.34
应付 证券 清算 款	-	-	-	-	-	74.57	74.57
卖出 回购 金融 资产 款	-	-	-	-	-	-	-
应付 销售 服务 费	-	-	-	-	-	-	-
应付 交易 费用	-	-	-	-	-	44,192.87	44,192.87
应交 税费	-	-	-	-	-	-	-
应付	-	-	-	-	-	-	-

利息							
应付 利润	-	-	-	-	-	-	-
其他 负债	-	-	-	-	-	180,861.39	180,861.39
负债 总计	-	-	-	-	-	4,076,572.10	4,076,572.10
利率 敏感 度缺 口	25,410,366.99	-	-	-	-	348,140,401.38	373,550,768.37
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	-	-	-	-	-	262,884,753.83	262,884,753.83

产							
应收股利	-	-	-	-	-	9,434.24	9,434.24
应收利息	-	-	-	-	-	3,710.39	3,710.39
应收申购款	-	-	-	-	-	622,931.91	622,931.91
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	18,764,865.82	-	-	-	-	263,558,587.50	282,323,453.32
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,425,240.92	2,425,240.92
应付管理	-	-	-	-	-	283,313.63	283,313.63

人报 酬							
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	18,764,865.82	-	-	-	-	260,435,643.30	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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本报告期及上年度末计息资产仅包括银行存款、结算备付金、存出保证金及部分应收申购款，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。

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 2020 年 06 月 30 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	368.06	4,280,059.00	-	4,280,427.06
结算备付金	-	38,501.50	-	38,501.50
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	348,386,094.93	-	348,386,094.93
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	-	1,989,691.07	-	1,989,691.07
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产总计	368.06	354,694,346.50	-	354,694,714.56
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	368.06	354,694,346.50	-	354,694,714.56
项目	上年度末 2019 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

			币	
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	-	-	-	-
资产总计	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	-	-	-	-
资产负债表外外汇风险敞口净额	362.34	268,980,375.91	-	268,980,738.25

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑管理人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 06 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	港币相对人民币贬值 5%	-17,681,902.55	-13,449,018.80
	港币相对人民币升值 5%	17,681,902.55	13,449,018.80
	美元相对人民币贬值 5%	-18.40	-18.12
	美元相对人民币升值 5%	18.40	18.12

6.4.13.4.3 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和债券，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。

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 2020 年 06 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	348,386,094.93	93.26	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	348,386,094.93	93.26	262,884,753.83	94.16

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 2020 年 06 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	恒生指数（汇率调整）上涨 5%	17,135,619.12	13,214,572.40
	恒生指数（汇率调整）下跌 5%	-17,135,619.12	-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。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日，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	348,386,094.93	92.26
	其中：普通股	342,830,918.23	90.79
	存托凭证	—	—
	优先股	—	—
	房地产信托	5,555,176.70	1.47
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	25,344,840.09	6.71
8	其他各项资产	3,896,405.45	1.03
9	合计	377,627,340.47	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 342,830,918.23 元，占期末净值比例为 91.78%。

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	348,386,094.93	93.26
合计	348,386,094.93	93.26

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

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	14,103,952.06	3.78
15 原材料	—	—
20 工业	10,721,861.35	2.87
25 可选消费	19,626,847.78	5.25
30 日常消费	9,303,897.93	2.49
35 医疗保健	8,278,104.80	2.22
40 金融	174,349,165.13	46.67
45 信息技术	5,173,929.69	1.39
50 电信服务	54,783,627.94	14.67
55 公用事业	15,581,169.96	4.17
60 房地产	36,463,538.29	9.76
合计	348,386,094.93	93.26

7.3.2 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股票。

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	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股有限公司	700 HK	香港联合交易所	中国香港	87,500	39,851,103.60	10.67
2	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	547,800	36,177,649.83	9.68
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	975,600	32,259,704.72	8.64

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	5,101,000	29,214,798.15	7.82
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	281,000	19,892,439.60	5.33
6	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	56,500	17,031,088.80	4.56
7	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	3,478,000	14,931,638.30	4.00

8	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	13,830,258.02	3.70
9	Bank of China Limited	中国银行股份有限公司	3988 HK	香港联合交易所	中国香港	3,745,000	9,817,790.14	2.63
10	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	6,629,784.06	1.77
11	CLP Holdings Ltd.	中电控股有限公司	2 HK	香港联合交易所	中国香港	89,500	6,213,218.88	1.66
12	CK Hutchison	长江	1 HK	香	中国	127,108	5,782,055.47	1.55

	Holdings Limited	和记 实业 有限 公司		港 联 合 交 易 所	香港			
13	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	96,000	5,555,176.70	1.49
14	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	503,209	5,515,814.75	1.48
15	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	122,108	5,153,070.92	1.38
16	China Life Insurance Company	中国 人寿	2628 HK	香 港	中 国 香 港	351,000	5,001,632.06	1.34

	Limited	保险 股份 有限 公司		联 合 交 易 所				
17	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	4,925,976.40	1.32
18	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	4,914,763.92	1.32
19	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	4,777,473.89	1.28
20	Sino Biopharmaceutical Limited	中国 生物 制药	1177 HK	香 港 联	中 国 香 港	356,000	4,747,695.74	1.27

		有限 公司		合 交 易 所				
21	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	4,290,071.44	1.15
22	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	152,000	4,075,038.53	1.09
23	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	3,929,093.65	1.05
24	China Overseas Land & Investment Ltd.	中国 海外 发展 有限	688 HK	香 港 联 合	中 国 香 港	181,000	3,877,050.41	1.04

		公司		交易所				
25	Sunny Optical Technology (Group) Company Limited	舜宇光学科技(集团)有限公司	2382 HK	香港联合交易所	中国香港	33,600	3,805,756.42	1.02
26	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	3,709,881.75	0.99
27	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	264,000	3,530,409.06	0.95
28	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	130,000	3,514,917.12	0.94

				易 所				
29	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	1,142,000	3,369,369.59	0.90
30	Shenzhou International Group Holdings Ltd.	申洲 国际 集团 控股 有限 公司	2313 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	39,000	3,327,296.54	0.89
31	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	361,000	3,139,237.52	0.84
32	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	260,000	2,897,431.68	0.78

				所				
33	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	2,658,909.66	0.71
34	WH Group Limited	万洲国际有限公司	288 HK	香港联合交易所	中国香港	416,500	2,526,173.13	0.68
35	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	65,500	2,521,847.99	0.68
36	New World Development Co. Ltd.	新世界发展有限公司	2909 HK	香港联合交易所	中国香港	72,250	2,428,654.27	0.65

37	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	994,000	2,333,455.56	0.62
38	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	343,000	2,280,896.22	0.61
39	Hengan International Group Company Limited	恒 安 国 际 集 团 有 限 公 司	1044 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	33,500	1,857,434.57	0.50
40	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	67,991	1,825,907.55	0.49
41	Bank of	交 通	3328	香	中 国	413,000	1,803,258.44	0.48

	Communications Co., Ltd.	银行股份有限公司	HK	香港联合交易所	香港			
42	China Shenhua Energy Company Limited	中国神华能源股份有限公司	1088 HK	香港联合交易所	中国香港	160,000	1,771,342.85	0.47
43	Wharf Real Estate Investment Company Limited	九龙仓置业地产投资有限公司	1997 HK	香港联合交易所	中国香港	50,000	1,689,864.00	0.45
44	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	1,593,222.05	0.43
45	Want Want China Holdings Limited	中国旺旺	151 HK	香港	中国香港	263,000	1,405,373.11	0.38

		控 股 有 限 公 司		联 合 交 易 所				
46	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	1,368,173.27	0.37
47	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	36,500	1,330,288.34	0.36
48	Sino Land Co. Ltd.	信 和 置 业 有 限 公 司	83 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	148,000	1,318,093.92	0.35
49	China Unicom (Hong Kong) Ltd.	中 国 联 合 网 络	762 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	288,000	1,102,266.32	0.30

		通信 (香港) 股份 有限 公司		合 交 易 所				
50	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	882,246.02	0.24

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。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	HSBC Holdings PLC	5 HK	20,940,311.86	7.50
2	AIA Group Limited	1299 HK	13,492,341.32	4.83
3	China Construction Bank Corporation	939 HK	11,068,050.60	3.96
4	Tencent Holdings Ltd	700 HK	9,309,812.52	3.33
5	Ping An Insurance	2318 HK	8,333,510.15	2.98

	(Group) Company of China, Ltd.			
6	Industrial and Commercial Bank of China Limited	1398 HK	6,246,074.37	2.24
7	China Mobile Limited	941 HK	5,442,301.97	1.95
8	Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd.	388 HK	4,670,799.71	1.67
9	Bank of China Limited	3988 HK	3,824,891.77	1.37
10	The Hong Kong and China Gas Co. Ltd.	3 HK	2,265,102.28	0.81
11	CLP Holdings Ltd.	2 HK	2,245,480.56	0.80
12	CK Hutchison Holdings Limited	1 HK	2,242,850.54	0.80
13	CNOOC Limited	883 HK	2,234,733.66	0.80
14	China Resources Land Limited	1109 HK	2,081,909.01	0.75
15	Link Real Estate Investment Trust	823 HK	2,018,021.73	0.72
16	Sun Hung Kai Properties Ltd.	16 HK	1,802,133.34	0.65
17	China Life Insurance Company Limited	2628 HK	1,765,022.57	0.63
18	CK Asset Holdings Limited	1113 HK	1,728,295.73	0.62
19	Hang Seng Bank Ltd.	11 HK	1,679,965.25	0.60
20	Galaxy Entertainment Group	27 HK	1,567,254.26	0.56

	Limited			
--	---------	--	--	--

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	Tencent Holdings Ltd	700 HK	8,005,229.22	2.87
2	AIA Group Limited	1299 HK	2,120,035.52	0.76
3	HSBC Holdings PLC	5 HK	1,754,344.35	0.63
4	China Construction Bank Corporation	939 HK	1,744,312.84	0.62
5	Ping An Insurance (Group) Company of China, Ltd.	2318 HK	1,159,412.95	0.42
6	Industrial and Commercial Bank of China Limited	1398 HK	994,024.60	0.36
7	China Mobile Limited	941 HK	956,754.80	0.34
8	Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd.	388 HK	748,675.52	0.27
9	Bank of China Limited	3988 HK	617,746.14	0.22
10	CK Hutchison Holdings Limited	1 HK	397,753.80	0.14
11	CNOOC Limited	883 HK	387,139.13	0.14
12	The Hong Kong and China Gas Co. Ltd.	3 HK	368,697.83	0.13
13	CLP Holdings Ltd.	2 HK	336,685.31	0.12
14	CK Asset Holdings Limited	1113 HK	301,811.79	0.11
15	China Resources Land Limited	1109 HK	294,021.66	0.11
16	China Life Insurance Company Limited	2628 HK	284,236.13	0.10
17	Galaxy Entertainment Group Limited	27 HK	268,327.78	0.10
18	Hang Seng Bank Ltd.	11 HK	265,849.52	0.10
19	Sun Hung Kai Properties Ltd.	16 HK	246,232.89	0.09
20	China Petroleum & Chemical Corporation	386 HK	239,900.47	0.09

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	132,815,711.33
卖出收入（成交）总额	25,690,766.00

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

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。

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	应收证券清算款	-
3	应收股利	1,989,691.07

4	应收利息	4,219.53
5	应收申购款	1,902,494.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,896,405.45

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 (%)
恒 生 A	213	329,678.17	67,733,621.00	96.46	2,487,830.00	3.54
恒 生 B	3,662	19,175.71	167,104.00	0.24	70,054,347.00	99.76
添 富 恒 生	23,142	8,831.55	46,818,600.53	22.91	157,561,082.79	77.09
合 计	27,017	12,763.17	114,719,325.53	33.27	230,103,259.79	66.73

8.2 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	42,865,348.00	61.04
2	中国太平洋人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	17,071,120.00	24.31
3	广发基金—招商银行—招商财富资产管理有限公司	5,949,502.00	8.47
4	中国银河证券股份有限公司	951,650.00	1.36
5	中国国际金融股份有限公司	896,000.00	1.28
6	郭薇	334,106.00	0.48
7	吴志刚	240,000.00	0.34
8	闵敏	238,200.00	0.34
9	周绍勋	143,333.00	0.20
10	戴忆晨	102,600.00	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	5,501,000.00	7.83
2	廖雪静	5,010,000.00	7.13
3	李燕欢	1,849,700.00	2.63
4	郭峰	1,182,750.00	1.68
5	何惠忠	890,000.00	1.27
6	王鹏	869,900.00	1.24
7	吴旋玲	801,800.00	1.14
8	佟健	707,700.00	1.01
9	李锡祥	702,600.00	1.00
10	陈卫	685,800.00	0.98
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	729,677.00	8.72
2	张卓君	550,004.00	6.57
3	邵常红	524,200.00	6.26
4	任晓光	348,496.00	4.16
5	周绍勋	277,509.00	3.32
6	徐满东	222,998.00	2.66
7	张大妹	213,348.00	2.55
8	李皓圻	189,523.00	2.26
9	王洪武	166,301.00	1.99
10	徐硕望	165,100.00	1.97

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	恒生 A	0.00	0.00
从业人员持有本	恒生 B	0.00	0.00

基金	添富恒生	39,728.56	0.02
	合计	39,728.56	0.01

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	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

§ 9 开放式基金份额变动

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	—	—	201,470,367.15
减：本报告期基金总赎回份额	—	—	87,423,320.27
本报告期基金拆分变动份额	3,194,078.00	3,194,078.00	10,564,509.77

本报告期期末基金份额总额	70,221,451.00	70,221,451.00	204,379,683.32
--------------	---------------	---------------	----------------

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，本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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。

10.4 基金投资策略的改变

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

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。

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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	----	------	-----------	----

	单元 数量	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	156,297,831.06	98.61	125,038.58	99.47	
Credit Suisse	-	2,208,646.27	1.39	662.59	0.53	
方正证券	2	-	-	-	-	
海通证券	1	-	-	-	-	
华泰证券	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	-	-	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
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,同一基金管理人托管在同一托管银行的基金可以共用同一交易单元进行交易。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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	上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 01 月 03 日

	公告		
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	2020 年 03 月 30 日

		券日报	
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 30 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

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、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分级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。

12.2 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

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

2020 年 08 月 28 日