

汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF） （原汇添富恒生指数分级证券投资基金）2020 年第 4 季度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2021 年 01 月 22 日

§ 1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年1月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2020年10月01日起至2020年12月31日止。其中，2020年12月01日起，“汇添富恒生指数分级证券投资基金”转型为“汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）”。汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）基金合同及托管协议即日生效。

§ 2 基金产品概况（转型后）

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	契约型开放式
基金合同生效日	2020年12月01日
报告期末基金份额总额(份)	272,933,545.54
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	本基金采用被动式指数化投资方法，按照标的指数的成份股及其权重来构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，以更好地实现本基金的投资目标。	
业绩比较基准	经人民币汇率调整的恒生指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%	
风险收益特征	本基金属于股票型基金，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。本基金主要投资于境外证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还将面临汇率风险、境外证券市场风险等特殊投资风险。	
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	
下属分级基金的基金简称	汇添富恒生指数（QDII-LOF）A	汇添富恒生指数（QDII-LOF）C
下属分级基金场内简称	添富恒生	
下属分级基金的交易代码	164705	010789
报告期末下属分级基金的份额总额(份)	272,180,645.16	752,900.38
境外资产托管人	英文名称:The Hong Kong and Shanghai Banking Co. Ltd.	
	中文名称:香港上海汇丰银行有限公司	

§ 2 基金产品概况（转型前）

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
报告期末基金份额总额(份)	399,122,158.12
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	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

准	后) ×5%		
风险收益特征	本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数及标的指数所表征的股票市场相似的风险收益特征，在股票基金中属于中等风险、中等收益的产品。本基金为境外证券投资的基金，主要投资于香港证券市场中具有良好流动性的金融工具。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。此外，从投资者具体持有的基金份额来看，在分级运作期内，由于基金收益分配的安排，稳健收益类的恒生 A 份额将表现出低风险、收益稳定的明显特征，其预期收益和预期风险要低于普通的股票型基金份额；积极收益类的恒生 B 份额则表现出高风险、高收益的显著特征，其预期收益和预期风险要高于普通的股票型基金份额。		
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		
下属分级基金的基金简称	恒生 A	恒生 B	添富恒生
下属分级基金场内简称	恒生 A	恒生 B	添富恒生
下属分级基金的交易代码	150169	150170	164705
报告期末下属分级基金的份额总额(份)	68,089,692.00	68,089,692.00	262,942,774.12
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
境外资产托管人	英文名称: The Hong Kong and Shanghai Banking Co. Ltd. 中文名称: 香港上海汇丰银行有限公司		

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2020年12月01日 - 2020年12月31日)	
	汇添富恒生指数（QDII-LOF）A	汇添富恒生指数（QDII-LOF）C
1. 本期已实现收益	-870,573.35	2,396.08
2. 本期利润	6,268,360.82	14,199.96

3. 加权平均基金份额 本期利润	0.0179	0.0455
4. 期末基金资产净值	295,523,108.74	817,445.35
5. 期末基金份额净值	1.0858	1.0857

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

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

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

3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2020年10月01日 - 2020年11月30日)
1. 本期已实现收益	-9,143,973.02
2. 本期利润	16,832,740.52
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0366
4. 期末基金资产净值	425,309,274.23
5. 期末基金份额净值	1.066

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

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

3.2 基金净值表现（转型后）

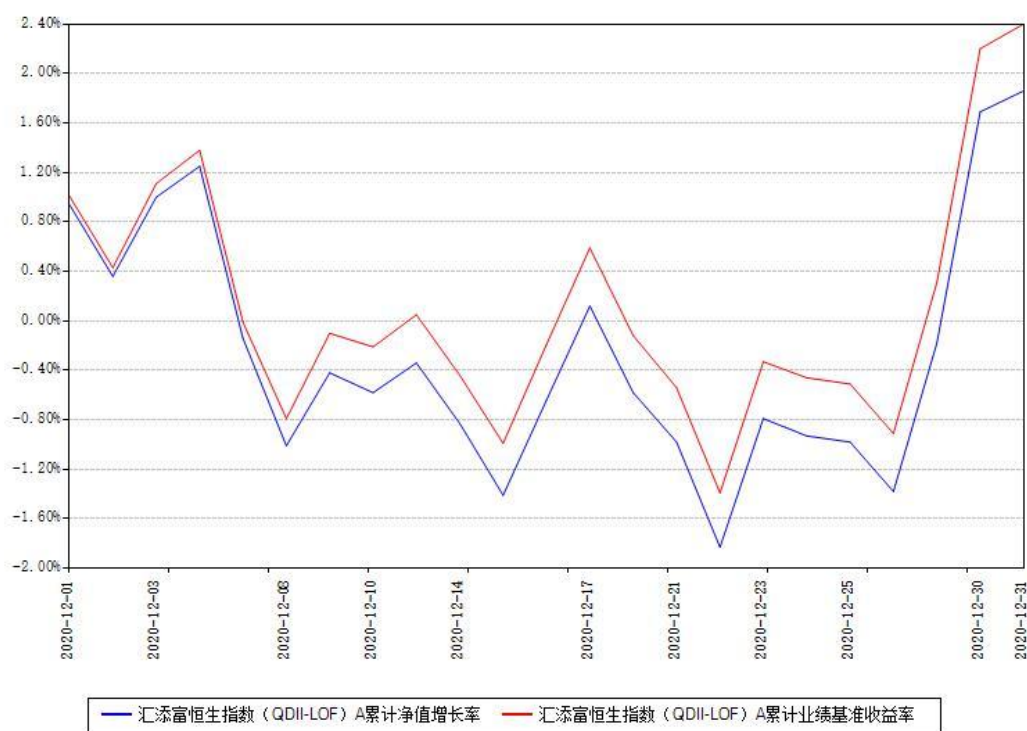
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

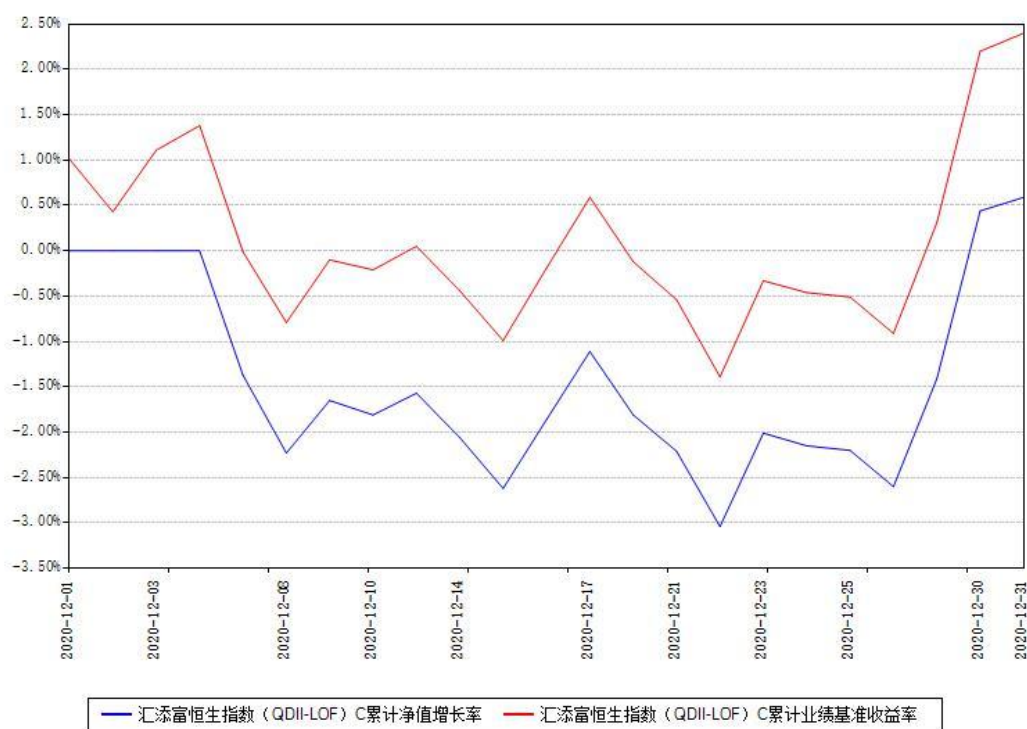
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效日起至今	0.59%	0.76%	2.40%	0.81%	-1.81%	-0.05%

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

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



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



注：1、本《基金合同》生效之日为2020年12月01日，截至本报告期末，基金成立未满一年；

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

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

3.2 基金净值表现（转型前）

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-1.93%	0.80%	0.31%	0.98%	-2.24%	-0.18%
过去六个月	4.31%	1.08%	5.59%	1.16%	-1.28%	-0.08%
过去一年	-6.65%	1.37%	-5.10%	1.44%	-1.55%	-0.07%
过去三	-8.78%	1.17%	-8.66%	1.20%	-0.12%	-0.03%

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

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

添富恒生累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



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

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

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限 (年)	说明
		任职日期	离任日期		
赖中立	本基金的基金经理	2014年03月06日		13	国籍:中国。学历:北京大学中国经济研究中心金融学硕士。从业资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任泰达宏利基金管理有限公司风险管理分析师。2010年8月加入汇添富基金管理股份有限公司,历任金融工程部分析师、基金经理助理。2012年11月1日至今任汇添富黄金及贵金属证券投资基金(LOF)的基金经理。2014年3月6日至今任汇添富恒生指数型证券投资基金(QDII-LOF)的基金经理。2015年1月6日至今任汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015年1月6日至今任深证300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2015年5月26日至2016年7月13日任汇添富香港优势精选混合型证券投资基金的基金经理。2016年12月29日至今任汇添富中证环境治理指数型证券投资基金(LOF)的基金经理。2017年5月18日至今任汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年11月24日至今任汇添富

					中证港股通高股息投资指数发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。
--	--	--	--	--	----------------------------------

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

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

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限 (年)	说明
		任职日期	离任日期		
赖中立	本基金的基金经理	2014年03月06日		13	国籍:中国。学历:北京大学中国经济研究中心金融学硕士。从业资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任泰达宏利基金管理有限公司风险管理分析师。2010年8月加入汇添富基金管理股份有限公司,历任金融工程部分析师、基金经理助理。2012年11月1日至今任汇添富黄金及贵金属证券投资基金(LOF)的基金经理。2014年3月6日至今任汇添富恒生指数型证券投资基金(QDII-LOF)的基金经理。2015年1月6日至今任汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。

					<p>2015年1月6日至今任深证300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2015年5月26日至2016年7月13日任汇添富香港优势精选混合型证券投资基金的基金经理。2016年12月29日至今任汇添富中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）的基金经理。2017年5月18日至今任汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年11月24日至今任汇添富中证港股通高股息投资指数发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

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

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

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的成员简介

注：本基金无境外投资顾问。

4.3 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人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 4 次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易，基金经理按内部规定履行了审批程序，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

回顾四季度，香港市场在内外部多重因素的作用下维持震荡上扬格局。我们认为相关市场的主要驱动因素如下：1) 四季度欧美新冠疫情二次爆发，市场波动加剧，但不改上涨趋势，四季度全球主要指数均录得正收益。2) 全球流动性仍保持较为宽松状态，为应对疫情全球主要经济体均维持了货币层面的稳定。3) 美国总统大选尘埃落定，市场风险偏好提升。4) 中国的疫情控制情况良好，企业盈利预期较为明确，人民币兑美元稳步上升。总体来看，四季度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。

汇添富恒生指数分级证券投资基金自 2020 年 10 月 1 日至 2020 年 11 月 30 日的净值增长率为 4.51%，同期业绩比较基准收益率为 8.02%。自 2020 年 12 月 1 日本基金转型后，截

止本报告期末 A 类基金份额净值增长率为 1.86%；C 类基金份额净值增长率为 0.59%，同期业绩比较基准收益率为 2.40%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 投资组合报告（转型后）

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额 (人民币元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	278,474,254.28	77.98
	其中：普通股	274,790,227.67	76.95
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	3,684,026.61	1.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售 金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	22,913,579.66	6.42
8	其他资产	55,703,494.18	15.60

9	合计	357,091,328.12	100.00
---	----	----------------	--------

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 262,496,156.53 元，占期末净值比例为 88.58%。

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
中国香港	278,474,254.28	93.97
合计	278,474,254.28	93.97

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

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

5.3.1 报告期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

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

5.3.2 报告期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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

5.4.1 报告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前十名股票及存托凭证投资明细

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	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	365,000	29,183,867.00	9.85
2	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股有限公司	700 HK	香港联合交易所	中国香港	55,900	26,534,889.26	8.95
3	HSBC Holdings PLC	汇丰控股有限公司	5 HK	香港联	中国香港	624,400	21,414,940.65	7.23

		公司		合 交 易 所				
4	China Construction Bank Corporation	中国 建设 银行 股份 有限 公司	939 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	3,266,000	16,190,409.85	5.46
5	Ping An Insurance (Group) Company of China, Ltd.	中 国 平 安 保 险 (集 团) 股 份 有 限 公 司	2318 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	180,000	14,392,044.00	4.86
6	Meituan	美 团	3690 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	55,800	13,835,450.64	4.67
7	Xiaomi Corporation	小 米 集 团	1810 HK	香 港 联	中 国 香 港	473,400	13,227,954.88	4.46

				合 交 易 所				
8	Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd.	香港 交易 及结 算所 有限 公司	388 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	36,400	13,020,170.80	4.39
9	Alibaba Group Holding Limited	阿 里 巴 巴 集 团 控 股 有 限 公 司	9988 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	62,800	12,294,071.14	4.15
10	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	2,227,000	9,427,891.37	3.18

5.4.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票及存托凭证投资明细

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

注：本基金本报告期末未持有基金投资。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	54,966,410.86
3	应收股利	5,704.16
4	应收利息	3,273.12
5	应收申购款	728,106.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	55,703,494.18

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 5 投资组合报告（转型前）

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额 (人民币元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	384,134,222.24	89.01
	其中：普通股	378,536,394.92	87.71
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	5,597,827.32	1.30
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售 金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	46,813,953.63	10.85

8	其他资产	635,713.64	0.15
9	合计	431,583,889.51	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 361,521,087.60 元，占期末净值比例为 85.00%。

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
中国香港	384,134,222.24	90.32
合计	384,134,222.24	90.32

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

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

5.3.1 报告期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
10 能源	11,305,150.04	2.66
15 原材料	-	-
20 工业	10,419,147.05	2.45
25 可选消费	40,972,692.81	9.63
30 日常消费	7,897,986.11	1.86
35 医疗保健	15,260,695.68	3.59
40 金融	177,737,980.75	41.79
45 信息技术	22,103,389.50	5.20
50 电信服务	51,001,994.82	11.99
55 公用事业	14,327,323.71	3.37
60 房地产	33,107,861.77	7.78
合计	384,134,222.24	90.32

5.3.2 报告期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

注：本报告期末未持有积极投资的股票。

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

5.4.1 报告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前十名股票及存托凭证投资明细

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	AIA Group Limited	友邦保险控股有限公司	1299 HK	香港联合交易所	中国香港	539,600	38,902,201.10	9.15
2	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股有限公司	700 HK	香港联合交易所	中国香港	80,500	38,462,997.41	9.04
3	HSBC Holdings PLC	汇丰控股有限公司	5 HK	香港联	中国香港	976,000	34,374,529.68	8.08

		公司		合 交 易 所				
4	China Construction Bank Corporation	中国 建设 银行 股份 有限 公司	939 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	5,102,000	26,325,879.19	6.19
5	Ping An Insurance (Group) Company of China, Ltd.	中国 平安 保险 (集 团) 股份 有限 公司	2318 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	281,000	21,701,340.57	5.10
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	56,800	18,577,997.34	4.37
7	Alibaba Group Holding Limited	阿里 巴巴 集团	9988 HK	香 港 联	中 国 香 港	76,700	17,015,307.32	4.00

		控 股 有 限 公 司		合 交 易 所				
8	Xiaomi Corporation	小米 集团	1810 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	738,000	16,597,439.19	3.90
9	Industrial and Commercial Bank of China Limited	中 国 工 商 银 行 股 份 有 限 公 司	1398 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	3,479,000	14,526,412.82	3.42
10	China Mobile Limited	中 国 移 动 有 限 公 司	941 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	289,500	11,400,014.38	2.68

5.4.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票及存托凭证投资明细

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

注：本基金本报告期末未持有基金投资。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	189,206.31
4	应收利息	185,871.60
5	应收申购款	260,635.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	635,713.64

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

项目	汇添富恒生指数（QDII-LOF）A	汇添富恒生指数（QDII-LOF）C
基金合同生效日（2020 年 12 月 01 日）基金份额总额	399,122,157.12	-
本报告期基金总申购份额	5,596,383.58	1,012,152.86
减：本报告期基金总赎回份额	132,537,895.54	259,252.48
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	272,180,645.16	752,900.38

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

项目	恒生 A	恒生 B	添富恒生
本报告期期初基金份额总额	69,483,358.00	69,483,358.00	190,556,809.98
本报告期基金总申购份额	-	-	375,367,334.89
减：本报告期基金总赎回份额	-	-	305,768,702.75
本报告期基金拆分变动份额	-1,393,666.00	-1,393,666.00	2,787,332.00

本报告期末基金份额总额	68,089,692.00	68,089,692.00	262,942,774.12
-------------	---------------	---------------	----------------

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

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

注：本基金的基金管理人本报告期末未运用固有资金投资本基金。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

注：本基金的基金管理人本报告期末未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	1	2020年10月21日至2020年12月30日	-	143,539,712.92	93,539,712.92	50,000,000.00	18.32
产品特有风险							
1、持有人大会投票权集中的风险 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语							

权。

2、巨额赎回的风险 持有基金份额比例较高的投资者大量赎回时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。

3、基金规模较小导致的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。

4、基金净值大幅波动的风险 持有基金份额比例较高的投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。

5、提前终止基金合同的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或其他基金合并。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

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

9.2 存放地点

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼 汇添富基金管理股份有限公司

9.3 查阅方式

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

汇添富基金管理股份有限公司

2021 年 01 月 22 日