

汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）2021 年第 3 季度报告

2021 年 09 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：2021 年 10 月 27 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10月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年07月01日起至2021年09月30日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|---------------|--|
| 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 |
| 报告期末基金份额总额(份) | 217,219,536.02 |
| 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。 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。 |
| 业绩比较 | 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 |

| | | |
|--------------------|---|--------------------|
| 基准 | 后)*5% | |
| 风险收益特征 | <p>本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。</p> <p>本基金主要投资于境外证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还将面临汇率风险、境外证券市场风险等特殊投资风险。</p> | |
| 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） | 206,984,190.37 | 10,235,345.65 |
| 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 | |

注：A类份额扩位证券简称：恒生LOF。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2021年07月01日 - 2021年09月30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 | 160,045.24 | -1,094.65 |
| 2. 本期利润 | -28,725,270.33 | -1,129,846.77 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.1450 | -0.1346 |
| 4. 期末基金资产净值 | 203,868,995.36 | 10,080,718.71 |
| 5. 期末基金份额净 | 0.9849 | 0.9849 |

| | | |
|---|--|--|
| 值 | | |
|---|--|--|

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 |
| 过去三个月 | -13.00% | 1.31% | -13.94% | 1.39% | 0.94% | -0.08% |
| 过去六个月 | -12.70% | 1.10% | -13.92% | 1.16% | 1.22% | -0.06% |
| 自基金合同生效日起至今 | -7.61% | 1.15% | -7.93% | 1.19% | 0.32% | -0.04% |
| 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 |
| 过去三个月 | -13.01% | 1.31% | -13.94% | 1.39% | 0.93% | -0.08% |
| 过去六个月 | -12.72% | 1.10% | -13.92% | 1.16% | 1.20% | -0.06% |
| 自基金合同生效日起至今 | -8.75% | 1.15% | -7.93% | 1.19% | -0.82% | -0.04% |

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、本基金由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。本基金自转型之日起至本报告期末未满一年。

2、本基金建仓期为自《基金合同》生效之日起6个月，截至本报告期末，本基金已完成建

仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 (年) | 说明 |
|-----|--------------|-----------------|------|---------------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 赖中立 | 本基金的 基金经理 | 2014年03 月06日 | | 14 | 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 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | <p>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遵规守信情况说明

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

本基金投资运作符合有关法规及基金合同的约定。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立事前、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中的公平交易模块，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，相关交易事前严格根据公司内部规定进行审批，事后对其交易时点、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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

回顾三季度，香港市场在内外部多重因素的作用下有较大程度下跌。我们认为相关市场的主要驱动因素如下：（1）美国通胀压力加大，工业和制造业快速修复，消费继续回暖，市场对美国退出QE购债存在一定程度担忧；（2）行业监管政策逐渐严格，自7月以来，“双减政策”“游戏防沉迷”“医美强监管”等政策相继出台，市场对政策面的情绪担忧较大。

（3）受到恒大事件的影响，市场波动加剧，市场对港股地产、金融企业风险更加担忧。总体来看，三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，以期为投资者带来与恒生指数一致的收益。

本基金本报告期 A 类基金份额净值增长率为-13.00%;C 类基金份额净值增长率为-13.01%。同期业绩比较基准收益率为-13.94%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额 (人民币元) | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-----------------------|----------------|------------------|
| 1 | 权益投资 | 194,807,498.43 | 90.58 |
| | 其中：普通股 | 192,527,621.47 | 89.52 |
| | 存托凭证 | - | - |
| | 优先股 | - | - |
| | 房地产信托 | 2,279,876.96 | 1.06 |
| 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 | 19,719,685.80 | 9.17 |
| 8 | 其他资产 | 545,950.94 | 0.25 |
| 9 | 合计 | 215,073,135.17 | 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 177,032,905.40 元，占期末净值比例为 82.75%。

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 | 194,807,498.43 | 91.05 |
| 合计 | 194,807,498.43 | 91.05 |

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 | 5,165,721.76 | 2.41 |
| 15 原材料 | - | - |
| 20 工业 | 8,008,422.87 | 3.74 |
| 25 可选消费 | 45,389,819.77 | 21.22 |
| 30 日常消费 | 4,038,131.73 | 1.89 |
| 35 医疗保健 | 10,383,628.05 | 4.85 |
| 40 金融 | 70,098,775.06 | 32.76 |
| 45 信息技术 | 9,459,096.41 | 4.42 |
| 50 电信服务 | 20,889,791.74 | 9.76 |
| 55 公用事业 | 6,050,185.05 | 2.83 |
| 60 房地产 | 15,323,925.99 | 7.16 |
| 合计 | 194,807,498.43 | 91.05 |

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。

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 | Tencent Holdings Ltd | 腾讯控股有限公司 | 700 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 41,500 | 15,951,516.19 | 7.46 |
| 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 | 211,800 | 15,870,967.61 | 7.42 |
| 3 | Alibaba Group Holding Limited | 阿里巴巴集团控股 | 9988 HK | 香港联合 | 中国香港 | 130,800 | 15,494,716.07 | 7.24 |

| | | | | | | | | |
|---|--|------------------------------|------------|-----------------|----------|-----------|---------------|------|
| | | 有限公司 | | 交易所 | | | | |
| 4 | Meituan | 美团 | 3690 HK | 香港 联合 交易所 | 中国 香港 | 68,000 | 13,969,416.53 | 6.53 |
| 5 | HSBC Holdings PLC | 汇丰 控股 有限公司 | 5 HK | 香港 联合 交易所 | 中国 香港 | 393,600 | 13,427,194.44 | 6.28 |
| 6 | 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 | 2,052,000 | 9,538,670.29 | 4.46 |
| 7 | Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd. | 香港 交易 及结 算所 有限 | 388 HK | 香港 联合 交 | 中国 香港 | 22,800 | 9,113,209.89 | 4.26 |

| | | 公司 | | 易 所 | | | | |
|----|--|--|------------|---------------------------------|------------------|---------|--------------|------|
| 8 | Wuxi Biologics (Cayman) Inc | 药明 生物 技术 有限 公司 | 2269 HK | 香 港 联 合 交 易 所 | 中 国 香 港 | 67,000 | 7,060,600.03 | 3.30 |
| 9 | Xiaomi Corporation | 小米 集团 | 1810 HK | 香 港 联 合 交 易 所 | 中 国 香 港 | 309,200 | 5,499,378.95 | 2.57 |
| 10 | 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 | 120,000 | 5,323,253.40 | 2.49 |

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

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、阿里巴巴集团控股有限公司、中国建设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。

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 | 543,101.63 |
| 4 | 应收利息 | 2,849.31 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |

| | | |
|---|----|------------|
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 545,950.94 |

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 汇添富恒生指数（QDII-LOF）A | 汇添富恒生指数（QDII-LOF）C |
|---------------|--------------------|--------------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 193,546,867.20 | 6,269,636.43 |
| 本报告期基金总申购份额 | 26,338,084.54 | 8,803,677.76 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 12,900,761.37 | 4,837,968.54 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 206,984,190.37 | 10,235,345.65 |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注：本基金的基金管理人本报告期末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

注：无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富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。

9.2 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

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 10 月 27 日