



东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金
(东方汇理香港组合之子基金)

未经审计中期报告
截至 2021 年 6 月 30 日止六个月

东方汇理资产管理香港有限公司
香港金钟道 88 号
太古广场第一期 901-908 室
电话: (852) 2521 4231
传真: (852) 2868 1450
电邮: info@hk.amundi.com
网页: www.amundi.com/hkg

东方汇理香港组合

未经审计

中期报告

截至 2021 年 6 月 30 日止六个月

目录	页
管理层和行政管理	1
财务状况表 - 东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金(未经审计)	2 - 3
综合收益表 - 东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金(未经审计)	4
归属基金份额持有人净资产变动表 - 东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金(未经审计)	5 - 7
收益分派- 东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金(未经审计)	8 - 11
持有抵押品 - 东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金(未经审计)	12
投资组合 - 东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金(未经审计)	13 - 17
投资组合变动表 - 东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金(未经审计)	18

附注:

子基金的未经审计中期报告已依据截至 2020 年 12 月 31 日的年度报告中相同的会计政策所编制。

东方汇理香港组合

管理层和行政管理

基金管理人

东方汇理资产管理香港有限公司
香港金钟道 88 号
太古广场第一期 901-908 室

受托人和基金登记机构

汇丰机构信托服务(亚洲)有限公司
香港皇后大道中 1 号

基金管理人的董事

Gilles Guerrier de Dumast
Jean Yves Glain
Vincent Mortier
Zhong Xiao Feng 钟小锋
Thierry Ancona (2021 年 1 月 18 日委任)
Christianus Pellis (2021 年 1 月 4 日辞任)

法律顾问

的近律师行
香港中环遮打道 18 号历山大厦 5 楼

审计师

罗兵咸永道会计师事务所
香港皇后大道中 15 号
置地广场公爵大厦 21 楼

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金

财务状况表 (未经审计)
于 2021 年 6 月 30 日

	于 2021 年 6 月 30 日 美元	于 2020 年 12 月 31 日 美元
资产		
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	280,347,017	134,273,526
衍生金融工具	296,629	911,000
应收经纪款项	20,636,048	1,804,720
应收基金份额持有人款项	4,208,084	18,968,638
应收银行利息	-	3
应收股息	103,656	69,635
经纪存款	1,459,058	699,131
现金和现金等价物	8,865,742	6,951,031
资产总计	315,916,234	163,677,684
负债		
衍生金融工具	1,089,416	83,579
应付经纪款项	13,737,474	1,791,724
应付基金份额持有人款项	6,986,530	4,234,688
其他应付款项	533,426	374,661
负债合计(不含归属基金份额持有人的资产净值)	22,346,846	6,484,652
归属基金份额持有人的资产净值	293,569,388	157,193,032

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金

财务状况表 (未经审计)
于 2021 年 6 月 30 日 (续)

	基金份额数量		每基金份额归属 基金份额持有人资产净值	
	于 2021 年 6 月 30 日	于 2020 年 12 月 31 日	于 2021 年 6 月 30 日	于 2020 年 12 月 31 日
- 机构 III 美元累算	17,594.096	24,795.096	美元 26.76	美元 26.00
- 普通美元累算	513,223.127	410,465.898	美元 25.13	美元 24.63
- 普通美元分派	6,385,933.803	3,926,247.636	美元 19.05	美元 18.76
- 普通港元分派	28,475,321.889	12,407,202.703	港元 18.95	港元 18.64
- 普通人民币分派	364,455.355	165,356.521	离岸人民币 18.04	离岸人民币 17.87
- 普通澳元(对冲)分派	2,094,157.327	999,944.028	澳元 18.34	澳元 18.14
- 普通加元(对冲)分派	255,448.115	137,781.157	加元 27.02	加元 26.65
- 普通欧元(对冲)分派	178,032.578	147,548.571	欧元 16.75	欧元 16.54
- 普通英镑(对冲)分派	482,445.747	221,803.471	英镑 16.65	英镑 16.44
- 普通新西兰元(对冲)分派	70,673.667	122,946.975	新西兰元 19.92	新西兰元 19.69
- 普通人民币(对冲)分派	6,329,560.331	1,911,541.751	离岸人民币 18.61	离岸人民币 18.41
- M 人民币(对冲)累算	83,468,916.050	47,302,282.690	离岸人民币 1.3632	离岸人民币 1.3236
- M 人民币(对冲)分派	10,385,947.850	4,023,086.430	离岸人民币 1.3281	离岸人民币 1.3128

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金

综合收益表 (未经审计)

截至 2021 年 6 月 30 日期间

	由 2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 6 月 30 日 美元	由 2020 年 1 月 1 日 至 2020 年 6 月 30 日 美元
收入/(亏损)		
股息收入	865,409	183,235
存款利息收入	358	1,736
以公允价值计量且其变动计入当期损益的 金融资产及衍生金融工具净收益	6,191,698	7,212,574
汇兑亏损净额	(137,454)	(45,179)
净收益合计	<u>6,920,011</u>	<u>7,352,366</u>
费用		
管理费	2,383,773	474,032
受托人费用	159,235	31,777
基金登记机构费用	69,624	27,216
律师和专业咨询费	31,219	7,277
估值费用	75,477	62,763
银行和次保管人费用	15,580	3,255
交易成本	158,022	41,022
审计费	8,562	5,225
其他经营费用	36,813	97,234
经营费用合计	<u>2,938,305</u>	<u>749,801</u>
经营利润净额	3,981,706	6,602,565
融资成本		
分派予基金份额持有人	(1,382,162)	(232,324)
分派后及除税前净收益	<u>2,599,544</u>	<u>6,370,241</u>
海外预扣税	(197,573)	(34,978)
源自期间经营活动的归属基金份额持有人的 资产净值增加	<u><u>2,401,971</u></u>	<u><u>6,335,263</u></u>

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金

归属基金份额持有人净资产变动表 (未经审计)
截至 2021 年 6 月 30 日期间

	由 2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 6 月 30 日 美元	由 2020 年 1 月 1 日 至 2020 年 6 月 30 日 美元
期初归属基金份额持有人的资产净值	157,193,032	41,466,803
基金份额申购	336,072,484	116,288,157
基金份额赎回	(202,098,099)	(79,939,278)
净申购金额	133,974,385	36,348,879
源自期间经营活动的归属基金份额持有人的资产 净值增加	2,401,971	6,335,263
期末归属基金份额持有人的资产净值	293,569,388	84,150,945

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金

归属基金份额持有人净资产变动表 (未经审计)
截至 2021 年 6 月 30 日期间

	机构 III 美元累算		普通美元累算		普通美元分派		普通港元分派	
	由 2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 6 月 30 日 基金份额 数量	由 2020 年 1 月 1 日 至 2020 年 6 月 30 日 基金份额 数量	由 2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 6 月 30 日 基金份额 数量	由 2020 年 1 月 1 日 至 2020 年 6 月 30 日 基金份额 数量	由 2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 6 月 30 日 基金份额 数量	由 2020 年 1 月 1 日 至 2020 年 6 月 30 日 基金份额 数量	由 2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 6 月 30 日 基金份额 数量	由 2020 年 1 月 1 日 至 2020 年 6 月 30 日 基金份额 数量
期初	24,795.096	19,576.096	410,465.898	630,718.740	3,926,247.636	968,472.958	12,407,202.703	7,367,524.857
已申购基金份额	-	-	299,965.638	175,945.104	6,422,372.253	3,981,692.463	38,861,746.202	13,642,669.289
已赎回基金份额	(7,201.000)	-	(197,208.409)	(404,558.881)	(3,962,686.086)	(2,352,939.130)	(22,793,627.016)	(11,767,434.763)
期末	<u>17,594.096</u>	<u>19,576.096</u>	<u>513,223.127</u>	<u>402,104.963</u>	<u>6,385,933.803</u>	<u>2,597,226.291</u>	<u>28,475,321.889</u>	<u>9,242,759.383</u>
	普通人民币分派		普通澳元 (对冲)分派		普通加元(对冲)分派		普通英镑 (对冲)分派	
	由 2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 6 月 30 日 基金份额 数量	由 2020 年 1 月 1 日 至 2020 年 6 月 30 日 基金份额 数量	由 2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 6 月 30 日 基金份额 数量	由 2020 年 1 月 1 日 至 2020 年 6 月 30 日 基金份额 数量	由 2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 6 月 30 日 基金份额 数量	由 2020 年 1 月 1 日 至 2020 年 6 月 30 日 基金份额 数量	由 2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 6 月 30 日 基金份额 数量	由 2020 年 1 月 1 日 至 2020 年 6 月 30 日 基金份额 数量
期初	165,356.521	196,483.301	999,944.028	273,160.850	137,781.157	13,293.975	221,803.471	24,927.135
已申购基金份额	241,574.820	47,018.986	3,272,801.595	2,832,746.659	279,261.923	517,584.086	479,410.940	285,585.159
已赎回基金份额	(42,475.986)	(26,801.845)	(2,178,588.296)	(1,868,307.280)	(161,594.965)	(287,578.122)	(218,768.664)	(134,739.557)
期末	<u>364,455.355</u>	<u>216,700.442</u>	<u>2,094,157.327</u>	<u>1,237,600.229</u>	<u>255,448.115</u>	<u>243,299.939</u>	<u>482,445.747</u>	<u>175,772.737</u>

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金

归属基金份额持有人净资产变动表 (未经审计)
截至 2021 年 6 月 30 日期间

	普通新西兰元 (对冲)分派		普通人民币 (对冲)分派		普通欧元 (对冲)分派		M 人民币(对冲)累算	
	由 2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 6 月 30 日 基金份额 数量	由 2020 年 1 月 1 日 至 2020 年 6 月 30 日 基金份额 数量	由 2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 6 月 30 日 基金份额 数量	由 2020 年 1 月 1 日 至 2020 年 6 月 30 日 基金份额 数量	由 2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 6 月 30 日 基金份额 数量	由 2020 年 1 月 1 日 至 2020 年 6 月 30 日 基金份额 数量	由 2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 6 月 30 日 基金份额 数量	由 2020 年 1 月 1 日 至 2020 年 6 月 30 日 基金份额 数量
期初	122,946.975	13,996.335	1,911,541.751	2,668,206.141	147,548.571	45,731.038	47,302,282.690	-
已申购基金份额	130,113.215	154,813.765	7,654,579.016	2,827,568.214	174,801.966	31,973.473	102,203,586.690	-
已赎回基金份额	(182,386.523)	(29,548.982)	(3,236,560.436)	(2,880,775.566)	(144,317.959)	(47,072.355)	(66,036,953.330)	-
年末	<u>70,673.667</u>	<u>139,261.118</u>	<u>6,329,560.331</u>	<u>2,614,998.789</u>	<u>178,032.578</u>	<u>30,632.156</u>	<u>83,468,916.050</u>	<u>-</u>
	M 人民币(对冲)分派							
	由 2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 6 月 30 日 基金份额 数量	由 2020 年 1 月 1 日 至 2020 年 6 月 30 日 基金份额 数量						
期初	4,023,086.430	-						
已申购基金份额	9,543,991.890	-						
已赎回基金份额	(3,181,130.470)	-						
期末	<u>10,385,947.850</u>	<u>-</u>						

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金

收益分派 (未经审计)

截至 2021 年 6 月 30 日止六个月

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金在 2021 和 2020 年 6 月 30 日期间进行了如下分派:

由 2021 年 1 月 1 日至
2021 年 6 月 30 日

普通美元分派

美元

- 美元 0.01561/基金份额, 计 3,926,247.636 基金份额, 于除息日 2021 年 1 月 4 日	61,289
- 美元 0.01632/基金份额, 计 6,786,360.062 基金份额, 于除息日 2021 年 2 月 1 日	110,753
- 美元 0.01612/基金份额, 计 6,415,135.687 基金份额, 于除息日 2021 年 3 月 1 日	103,412
- 美元 0.01433/基金份额, 计 6,666,363.237 基金份额, 于除息日 2021 年 4 月 1 日	95,529
- 美元 0.01569/基金份额, 计 7,206,231.805 基金份额, 于除息日 2021 年 5 月 3 日	113,066
- 美元 0.01487/基金份额, 计 7,083,574.817 基金份额, 于除息日 2021 年 6 月 1 日	105,333

普通港元分派

港元

- 港元 0.01551/基金份额, 计 12,407,202.703 基金份额, 于除息日 2021 年 1 月 4 日	192,436
- 港元 0.01622/基金份额, 计 24,741,286.295 基金份额, 于除息日 2021 年 2 月 1 日	401,304
- 港元 0.01601/基金份额, 计 26,890,784.134 基金份额, 于除息日 2021 年 3 月 1 日	430,521
- 港元 0.01426/基金份额, 计 32,402,754.740 基金份额, 于除息日 2021 年 4 月 1 日	462,063
- 港元 0.01560/基金份额, 计 32,625,300.788 基金份额, 于除息日 2021 年 5 月 3 日	508,955
- 港元 0.01479/基金份额, 计 30,356,527.909 基金份额, 于除息日 2021 年 6 月 1 日	448,973

普通人民币分派

离岸人民币

- 离岸人民币 0.01492/基金份额, 计 165,356.521 基金份额, 于除息日 2021 年 1 月 4 日	2,467
- 离岸人民币 0.01554/基金份额, 计 172,161.413 基金份额, 于除息日 2021 年 2 月 1 日	2,675
- 离岸人民币 0.01530/基金份额, 计 316,569.430 基金份额, 于除息日 2021 年 3 月 1 日	4,844
- 离岸人民币 0.01376/基金份额, 计 359,106.553 基金份额, 于除息日 2021 年 4 月 1 日	4,941
- 离岸人民币 0.01491/基金份额, 计 341,341.019 基金份额, 于除息日 2021 年 5 月 3 日	5,089
- 离岸人民币 0.01396/基金份额, 计 355,845.612 基金份额, 于除息日 2021 年 6 月 1 日	4,968

普通澳元(对冲)分派

澳元

- 澳元 0.00721/基金份额, 计 999,944.028 基金份额, 于除息日 2021 年 1 月 4 日	7,210
- 澳元 0.00968/基金份额, 计 1,838,015.495 基金份额, 于除息日 2021 年 2 月 1 日	17,792
- 澳元 0.01293/基金份额, 计 2,060,581.191 基金份额, 于除息日 2021 年 3 月 1 日	26,643
- 澳元 0.01135/基金份额, 计 2,857,553.706 基金份额, 于除息日 2021 年 4 月 1 日	32,433
- 澳元 0.01237/基金份额, 计 2,412,874.629 基金份额, 于除息日 2021 年 5 月 3 日	29,847
- 澳元 0.01193/基金份额, 计 2,315,858.574 基金份额, 于除息日 2021 年 6 月 1 日	27,628

普通加元(对冲)分派

加元

- 加元 0.01638/基金份额, 计 137,781.157 基金份额, 于除息日 2021 年 1 月 4 日	2,257
- 加元 0.01854/基金份额, 计 212,127.933 基金份额, 于除息日 2021 年 2 月 1 日	3,933
- 加元 0.02139/基金份额, 计 230,827.756 基金份额, 于除息日 2021 年 3 月 1 日	4,937
- 加元 0.01937/基金份额, 计 286,451.464 基金份额, 于除息日 2021 年 4 月 1 日	5,549
- 加元 0.02231/基金份额, 计 297,012.207 基金份额, 于除息日 2021 年 5 月 3 日	6,626
- 加元 0.02082/基金份额, 计 282,234.909 基金份额, 于除息日 2021 年 6 月 1 日	5,876

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金

收益分派 (未经审计)

截至 2021 年 6 月 30 日止六个月 (续)

由 2021 年 1 月 1 日至
2021 年 6 月 30 日

普通英镑(对冲)分派

英镑

- 英镑 0.00484/基金份额, 计 221,803.471 基金份额, 于除息日 2021 年 1 月 4 日	1,074
- 英镑 0.00738/基金份额, 计 409,512.541 基金份额, 于除息日 2021 年 2 月 1 日	3,022
- 英镑 0.01208/基金份额, 计 472,835.523 基金份额, 于除息日 2021 年 3 月 1 日	5,712
- 英镑 0.01054/基金份额, 计 478,350.568 基金份额, 于除息日 2021 年 4 月 1 日	5,042
- 英镑 0.01197/基金份额, 计 545,358.634 基金份额, 于除息日 2021 年 5 月 3 日	6,528
- 英镑 0.01197/基金份额, 计 472,884.672 基金份额, 于除息日 2021 年 6 月 1 日	5,660

普通新西兰元(对冲)分派

新西兰元

- 新西兰元 0.01237/基金份额, 计 122,946.975 基金份额, 于除息日 2021 年 1 月 4 日	1,521
- 新西兰元 0.01306/基金份额, 计 68,746.053 基金份额, 于除息日 2021 年 2 月 1 日	898
- 新西兰元 0.01703/基金份额, 计 56,419.805 基金份额, 于除息日 2021 年 3 月 1 日	961
- 新西兰元 0.01592/基金份额, 计 43,672.628 基金份额, 于除息日 2021 年 4 月 1 日	695
- 新西兰元 0.01797/基金份额, 计 61,812.146 基金份额, 于除息日 2021 年 5 月 3 日	1,111
- 新西兰元 0.01696/基金份额, 计 72,139.304 基金份额, 于除息日 2021 年 6 月 1 日	1,223

普通人民币(对冲)分派

离岸人民币

- 离岸人民币 0.05471/基金份额, 计 1,911,541.751 基金份额, 于除息日 2021 年 1 月 4 日	104,580
- 离岸人民币 0.05728/基金份额, 计 4,769,354.145 基金份额, 于除息日 2021 年 2 月 1 日	273,189
- 离岸人民币 0.05761/基金份额, 计 5,859,478.917 基金份额, 于除息日 2021 年 3 月 1 日	337,565
- 离岸人民币 0.05478/基金份额, 计 6,735,343.356 基金份额, 于除息日 2021 年 4 月 1 日	368,962
- 离岸人民币 0.05854/基金份额, 计 6,701,385.352 基金份额, 于除息日 2021 年 5 月 3 日	392,299
- 离岸人民币 0.05096/基金份额, 计 6,097,464.298 基金份额, 于除息日 2021 年 6 月 1 日	310,727

普通欧元(对冲)分派

欧元

- 欧元 0.00376/基金份额, 计 221,602.108 基金份额, 于除息日 2021 年 3 月 1 日	833
- 欧元 0.00244/基金份额, 计 194,935.220 基金份额, 于除息日 2021 年 4 月 1 日	476
- 欧元 0.00317/基金份额, 计 187,612.730 基金份额, 于除息日 2021 年 5 月 3 日	595
- 欧元 0.00337/基金份额, 计 187,792.274 基金份额, 于除息日 2021 年 6 月 1 日	633

M 人民币 (对冲)分派

离岸人民币

- 离岸人民币 0.01188/基金份额, 计 4,023,086.430 基金份额, 于除息日 2021 年 1 月 4 日	47,794
- 离岸人民币 0.01088/基金份额, 计 7,711,385.820 基金份额, 于除息日 2021 年 4 月 1 日	83,900

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金

收益分派 (未经审计)

截至 2021 年 6 月 30 日止六个月 (续)

由 2020 年 1 月 1 日
至 2020 年 6 月 30 日

普通美元分派

美元

- 美元 0.00997/基金份额, 计 968,472.958 基金份额, 于除息日 2020 年 1 月 2 日	9,656
- 美元 0.01055/基金份额, 计 1,755,508.483 基金份额, 于除息日 2020 年 2 月 3 日	18,521
- 美元 0.01030/基金份额, 计 2,270,408.471 基金份额, 于除息日 2020 年 3 月 2 日	23,385
- 美元 0.00823/基金份额, 计 1,817,360.707 基金份额, 于除息日 2020 年 4 月 1 日	14,957
- 美元 0.00932/基金份额, 计 1,804,093.759 基金份额, 于除息日 2020 年 5 月 4 日	16,814
- 美元 0.01059/基金份额, 计 1,854,286.814 基金份额, 于除息日 2020 年 6 月 1 日	19,637

普通港元分派

港元

- 港元 0.00995/基金份额, 计 7,367,524.857 基金份额, 于除息日 2020 年 1 月 2 日	73,307
- 港元 0.01050/基金份额, 计 9,058,627.477 基金份额, 于除息日 2020 年 2 月 3 日	95,116
- 港元 0.01029/基金份额, 计 9,071,870.581 基金份额, 于除息日 2020 年 3 月 2 日	93,350
- 港元 0.00818/基金份额, 计 8,494,749.660 基金份额, 于除息日 2020 年 4 月 1 日	69,487
- 港元 0.00925/基金份额, 计 8,865,494.625 基金份额, 于除息日 2020 年 5 月 4 日	82,006
- 港元 0.01052/基金份额, 计 8,650,976.478 基金份额, 于除息日 2020 年 6 月 1 日	91,008

普通人民币分派

离岸人民币

- 离岸人民币 0.01024/基金份额, 计 196,483.301 基金份额, 于除息日 2020 年 1 月 2 日	2,012
- 离岸人民币 0.01073/基金份额, 计 185,024.224 基金份额, 于除息日 2020 年 2 月 3 日	1,985
- 离岸人民币 0.01062/基金份额, 计 185,024.224 基金份额, 于除息日 2020 年 3 月 2 日	1,965
- 离岸人民币 0.00861/基金份额, 计 205,238.745 基金份额, 于除息日 2020 年 4 月 1 日	1,767
- 离岸人民币 0.00968/基金份额, 计 205,238.745 基金份额, 于除息日 2020 年 5 月 4 日	1,987
- 离岸人民币 0.01110/基金份额, 计 202,856.451 基金份额, 于除息日 2020 年 6 月 1 日	2,252

普通澳元(对冲)分派

澳元

- 澳元 0.00005/基金份额, 计 273,160.850 基金份额, 于除息日 2020 年 1 月 2 日	14
- 澳元 0.00160/基金份额, 计 319,993.245 基金份额, 于除息日 2020 年 2 月 3 日	512
- 澳元 0.00319/基金份额, 计 1,273,795.743 基金份额, 于除息日 2020 年 3 月 2 日	4,063
- 澳元 0.00457/基金份额, 计 1,274,324.507 基金份额, 于除息日 2020 年 4 月 1 日	5,824
- 澳元 0.00581/基金份额, 计 1,300,197.154 基金份额, 于除息日 2020 年 5 月 4 日	7,554
- 澳元 0.00917/基金份额, 计 725,739.860 基金份额, 于除息日 2020 年 6 月 1 日	6,655

普通人民币(对冲)分派

离岸人民币

- 离岸人民币 0.02325/基金份额, 计 2,668,206.141 基金份额, 于除息日 2020 年 1 月 2 日	62,036
- 离岸人民币 0.02322/基金份额, 计 2,533,027.619 基金份额, 于除息日 2020 年 2 月 3 日	58,817
- 离岸人民币 0.02210/基金份额, 计 2,025,603.323 基金份额, 于除息日 2020 年 3 月 2 日	44,766
- 离岸人民币 0.01438/基金份额, 计 1,911,200.680 基金份额, 于除息日 2020 年 4 月 1 日	27,483
- 离岸人民币 0.01296/基金份额, 计 1,905,338.797 基金份额, 于除息日 2020 年 5 月 4 日	24,693
- 离岸人民币 0.02658/基金份额, 计 2,483,467.181 基金份额, 于除息日 2020 年 6 月 1 日	66,011

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金

收益分派 (未经审计)

截至 2021 年 6 月 30 日止六个月 (续)

由 2020 年 1 月 1 日
至 2020 年 6 月 30 日

普通新西兰元(对冲)分派

新西兰元

- 新西兰元 0.00421/基金份额, 计 13,996.335 基金份额, 于除息日 2020 年 1 月 2 日	59
- 新西兰元 0.00533/基金份额, 计 10,505.911 基金份额, 于除息日 2020 年 2 月 3 日	56
- 新西兰元 0.00642/基金份额, 计 11,212.310 基金份额, 于除息日 2020 年 3 月 2 日	72
- 新西兰元 0.01011/基金份额, 计 10,688.875 基金份额, 于除息日 2020 年 4 月 1 日	108
- 新西兰元 0.01120/基金份额, 计 11,073.787 基金份额, 于除息日 2020 年 5 月 4 日	124
- 新西兰元 0.01266/基金份额, 计 121,828.260 基金份额, 于除息日 2020 年 6 月 1 日	1,542

普通英镑(对冲)分派

英镑

- 英镑 0.00037/基金份额, 计 44,146.211 基金份额, 于除息日 2020 年 4 月 1 日	16
- 英镑 0.00327/基金份额, 计 62,595.063 基金份额, 于除息日 2020 年 5 月 4 日	205
- 英镑 0.00730/基金份额, 计 76,653.730 基金份额, 于除息日 2020 年 6 月 1 日	560

普通加元(对冲)分派

加元

- 加元 0.00955/基金份额, 计 13,293.975 基金份额, 于除息日 2020 年 1 月 2 日	127
- 加元 0.01196/基金份额, 计 93,268.725 基金份额, 于除息日 2020 年 2 月 3 日	1,115
- 加元 0.01536/基金份额, 计 67,208.713 基金份额, 于除息日 2020 年 3 月 2 日	1,032
- 加元 0.01135/基金份额, 计 72,308.816 基金份额, 于除息日 2020 年 4 月 1 日	821
- 加元 0.01031/基金份额, 计 60,663.753 基金份额, 于除息日 2020 年 5 月 4 日	625
- 加元 0.01600/基金份额, 计 132,117.031 基金份额, 于除息日 2020 年 6 月 1 日	2,114

普通欧元(对冲)分派

欧元

- 欧元 0.00209/基金份额, 计 3,739.117 基金份额, 于除息日 2020 年 6 月 1 日	8
--	---

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金

持有抵押品 (未经审计)

于 2021 年 6 月 30 日

于 2021 年 6 月 30 日，东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金向摩根士丹利 (“对手方”) 收取了 10,000 美元的现金抵押，该现金抵押占在 2021 年 9 月到期的远期外汇合约的合约价值 0.16%。在财务状况表中识别为应付经纪款项。所收取的现金抵押存放于银行户口内，从中赚取了利息 9 美元，并已将该利息退回对手方。

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金

投资组合 (未经审计)
于 2021 年 6 月 30 日

	持有数量	公允价值 美元	资产净值 的%
上市股票 (按来源地)			
股票 (95.50%)			
加拿大 (1.44%)			
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	51,100	4,215,750	1.44
		<u>4,215,750</u>	<u>1.44</u>
中国 (10.13%)			
宁德时代新能源科技股份有限公司	49,000	4,055,999	1.38
大全新能源有限公司	30,395	1,976,283	0.68
万国数据控股有限公司	12,692	996,195	0.34
京东集团股份有限公司	186,800	7,346,101	2.50
恩智浦半导体公司	24,290	4,996,939	1.70
药明生物技术有限公司	482,500	8,841,241	3.01
广州小鹏汽车科技有限公司	34,362	1,526,360	0.52
		<u>29,739,118</u>	<u>10.13</u>
德国 (1.37%)			
BIONTECH SE	17,926	4,013,273	1.37
		<u>4,013,273</u>	<u>1.37</u>
日本 (6.30%)			
DAIFUKU CO LTD (大福株式会社)	59,200	5,381,818	1.84
NABTESCO CORP (纳博特斯克株式会社)	65,300	2,471,033	0.84
NIDEC CORPORATION (日本电产科宝株式会社)	59,500	6,902,086	2.35
TOKYO ELECTRON LTD (东京威力科创)	8,600	3,725,453	1.27
		<u>18,480,390</u>	<u>6.30</u>
瑞士 (1.91%)			
STMICROELECTRONICS NV (意法半导体)	154,557	5,609,564	1.91
		<u>5,609,564</u>	<u>1.91</u>
台湾 (1.72%)			
SEA LTD	18,409	5,055,111	1.72
		<u>5,055,111</u>	<u>1.72</u>
英国 (1.50%)			
ALPHAWAVE IP GROUP PLC	46,933	233,408	0.08
SEGRO PLC REIT	276,192	4,176,015	1.42
		<u>4,409,423</u>	<u>1.50</u>

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金

投资组合 (未经审计)

于 2021 年 6 月 30 日 (续)

	持有数量	公允价值 美元	资产净值 的%
上市股票 (按来源地) (续)			
股票 (95.50%) (续)			
美国 (71.13%)			
AMAZON COM INC (亚马逊公司)	1,991	6,849,359	2.33
AUTODESK INC (欧特克软件有限公司)	12,472	3,640,577	1.24
BOOKING HOLDINGS INC	2,220	4,857,560	1.65
BRISTOL MYERS SQUIBB COMPANY (必治妥施贵宝)	94,268	6,298,988	2.15
BUMBLE INC-A	45,411	2,615,674	0.89
COSTAR GROUP INC (中光学集团)	43,561	3,607,722	1.23
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	10,459	2,628,451	0.90
DARLING INGREDIENTS INC	54,505	3,679,088	1.25
DATADOG INC - CLASS A	33,796	3,517,488	1.20
EQUINIX INC REIT	6,634	5,324,448	1.81
EXACT SCIENCES CORP	57,940	7,202,521	2.45
GREEN PLAINS INC	35,603	1,196,973	0.41
HUBSPOT INC	9,793	5,706,577	1.94
INTEL CORP (英特尔公司)	76,741	4,308,240	1.47
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC (美国江森自控有限公司)	101,490	6,965,259	2.37
LEMONADE INC	23,226	2,541,157	0.87
MARVELL TECHNOLOGY INC (美满电子科技有限公司)	170,029	9,917,792	3.38
MASTERCARD INCORPORATED A SHRS (万事达卡公司)	12,381	4,520,179	1.54
MERCK & CO INC (默克药厂股份有限公司)	91,577	7,121,943	2.43
MICRON TECHNOLOGY (美光科技公司)	83,005	7,053,765	2.40
NVIDIA CORPORATION (辉达公司)	8,833	7,067,283	2.41
OKTA INC	14,039	3,435,063	1.17
PALO ALTO NETWORKS INC (帕罗奥图网路)	21,201	7,866,631	2.68
PALOMAR HOLDINGS INC	63,449	4,787,862	1.63
PAYPAL HOLDINGS INC (贝宝支付公司)	24,130	7,033,412	2.40
PLUG POWER INC (普拉格能源)	45,485	1,555,132	0.53
RINGCENTRAL INC	25,988	7,551,593	2.57
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	113,109	4,636,338	1.58
SCHNEIDER ELECTRIC SE (施耐德电气有限公司)	36,154	5,688,659	1.94
SOLAREdge TECHNOLOGIES INC	15,809	4,369,133	1.49
SPLUNK INC	36,868	5,330,375	1.82
STRYKER CORPORATION (史塞克公司)	6,610	1,716,815	0.58
SUNNOVA ENERGY INTERNATIONAL	85,428	3,217,218	1.10
SVB FINANCIAL GROUP (硅谷银行金融集团)	7,184	3,997,393	1.36
SYNCHRONY FINANCIAL	124,821	6,056,315	2.06
TELADOC HEALTH	19,304	3,210,062	1.09
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC (泰莱达科技)	12,283	5,144,489	1.75
TRANSUNION (环联)	73,845	8,108,919	2.76
TWILIO INC - A SHRS	12,594	4,964,051	1.69

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金

投资组合 (未经审计)

于 2021 年 6 月 30 日 (续)

	持有数量	公允价值 美元	资产净值 的%
上市/报价投资 (按来源地) (续)			
股票 (95.50%) (续)			
美国 (71.13%) (续)			
UPSTART HOLDINGS INC	10,831	1,352,792	0.46
VEEVA SYSTEMS INC A SHRS	16,266	5,057,913	1.72
ZENDESK INC	49,350	7,123,179	2.43
		208,824,388	71.13
		280,347,017	95.50
股票合计			

衍生金融工具	待交付合约	交换对象	结算日	公允价值 美元	资产净值 的%
远期外汇合约					
香港上海汇丰 银行有限公司 ("汇丰")	澳元 4,900	美元 3,719	2021 年 7 月 30 日	(40)	-
汇丰	澳元 78,575	美元 59,526	2021 年 7 月 30 日	(528)	-
汇丰	澳元 317,013	美元 240,048	2021 年 7 月 30 日	(2,017)	-
汇丰	澳元 425,763	美元 320,118	2021 年 7 月 30 日	(430)	-
汇丰	澳元 1,143,911	美元 862,160	2021 年 7 月 30 日	(3,246)	-
汇丰	澳元 2,022,413	美元 1,537,925	2021 年 7 月 30 日	(19,382)	-
汇丰	澳元 37,400,613	美元 28,207,467	2021 年 7 月 30 日	(124,955)	(0.04)
汇丰	加元 62,976	美元 51,280	2021 年 7 月 30 日	(424)	-
汇丰	加元 162,549	美元 132,047	2021 年 7 月 30 日	(781)	-
汇丰	加元 7,423,372	美元 6,024,032	2021 年 7 月 30 日	(29,295)	(0.01)
汇丰	离岸人民币 3,900	美元 601	2021 年 7 月 30 日	2	-
汇丰	离岸人民币 149,518	美元 23,103	2021 年 7 月 30 日	(9)	-
汇丰	离岸人民币 306,271	美元 47,290	2021 年 7 月 30 日	16	-
汇丰	离岸人民币 2,521,587	美元 389,777	2021 年 7 月 30 日	(301)	-
汇丰	离岸人民币 2,613,942	美元 403,607	2021 年 7 月 30 日	135	-
汇丰	离岸人民币 8,161,524	美元 1,257,331	2021 年 7 月 30 日	3,272	-
汇丰	离岸人民币 13,711,638	美元 2,108,688	2021 年 7 月 30 日	9,168	-
汇丰	离岸人民币 108,094,234	美元 16,623,614	2021 年 7 月 30 日	72,276	0.02
汇丰	离岸人民币 116,777,885	美元 17,959,057	2021 年 7 月 30 日	78,083	0.03
汇丰	欧元 65,140	美元 77,820	2021 年 7 月 30 日	(525)	-
汇丰	欧元 2,923,167	美元 3,488,941	2021 年 7 月 30 日	(20,296)	(0.01)
汇丰	英镑 196,981	美元 272,510	2021 年 7 月 30 日	(369)	-
汇丰	英镑 198,600	美元 276,412	2021 年 7 月 30 日	(2,034)	-
汇丰	英镑 212,674	美元 294,745	2021 年 7 月 30 日	(923)	-
汇丰	英镑 7,679,761	美元 10,701,294	2021 年 7 月 30 日	(91,228)	(0.03)
汇丰	新西兰元 12,912	美元 9,027	2021 年 7 月 30 日	(5)	-
汇丰	新西兰元 2,818,128	美元 1,972,695	2021 年 7 月 30 日	(3,618)	-
汇丰	新西兰元 62,704	美元 44,267	2021 年 7 月 30 日	(455)	-

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金

投资组合 (未经审计)

于 2021 年 6 月 30 日 (续)

衍生金融工具 (续)	待交付合约	交换对象	结算日	公允价值 美元	资产净值 的%
汇丰	美元 251	英镑 180	2021 年 7 月 30 日	3	-
汇丰	美元 2,844	英镑 2,048	2021 年 7 月 30 日	15	-
汇丰	美元 3,187	欧元 2,665	2021 年 7 月 30 日	24	-
汇丰	美元 7,294	离岸人民币 47,412	2021 年 7 月 30 日	(29)	-
汇丰	美元 15,870	离岸人民币 102,737	2021 年 7 月 30 日	1	-
汇丰	美元 18,749	离岸人民币 121,377	2021 年 7 月 30 日	1	-
汇丰	美元 24,502	澳元 32,357	2021 年 7 月 30 日	206	-
汇丰	美元 31,761	加元 39,353	2021 年 7 月 30 日	(18)	-
汇丰	美元 62,795	澳元 82,575	2021 年 7 月 30 日	793	-
汇丰	美元 65,699	离岸人民币 425,705	2021 年 7 月 30 日	(54)	-
汇丰	美元 68,991	离岸人民币 447,869	2021 年 7 月 30 日	(186)	-
汇丰	美元 79,591	离岸人民币 516,503	2021 年 7 月 30 日	(186)	-
汇丰	美元 81,732	加元 100,839	2021 年 7 月 30 日	299	-
汇丰	美元 106,589	离岸人民币 690,656	2021 年 7 月 30 日	(88)	-
汇丰	美元 136,024	离岸人民币 882,725	2021 年 7 月 30 日	(319)	-
汇丰	美元 141,679	澳元 188,437	2021 年 7 月 30 日	190	-
汇丰	美元 144,362	澳元 192,088	2021 年 7 月 30 日	131	-
汇丰	美元 161,497	离岸人民币 1,049,811	2021 年 7 月 30 日	(653)	-
汇丰	美元 222,440	离岸人民币 1,439,702	2021 年 7 月 30 日	69	-
汇丰	美元 253,059	英镑 181,856	2021 年 7 月 30 日	1,813	-
汇丰	美元 404,659	加元 499,295	2021 年 7 月 30 日	1,454	-
汇丰	美元 523,038	澳元 689,145	2021 年 7 月 30 日	5,589	-
汇丰	美元 1,034,244	新西兰元 1,468,253	2021 年 7 月 30 日	8,349	-
汇丰	美元 1,081,015	澳元 1,426,954	2021 年 7 月 30 日	9,577	-
法国巴黎银行	加元 3,600,000	美元 2,973,873	2021 年 9 月 10 日	(66,725)	(0.02)
摩根士丹利	英镑 4,500,000	美元 6,374,357	2021 年 9 月 10 日	(156,851)	(0.05)
渣打银行(香港) 有限公司 ("渣打")	瑞士法郎 5,000,000	美元 5,591,262	2021 年 9 月 10 日	(171,766)	(0.06)
渣打	欧元 12,000,000	美元 14,643,384	2021 年 9 月 10 日	(391,680)	(0.13)
渣打	美元 10,311,787	港元 80,000,000	2021 年 9 月 10 日	8,793	-
远期外汇合约合计				(889,157)	(0.30)

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金

投资组合 (未经审计)
于 2021 年 6 月 30 日 (续)

衍生金融工具 (续)	公允价值	资产净值的%
期货合约		
DJIA MINI E-CBOT 17/09/2021 (道琼斯工业平均指数微型 E-迷你期货)	88,125	0.03
E-MINI RUSS 2000 17/09/2021 (E-MINI 罗素 2000)	8,245	0.00
期货合约合计	<u>96,370</u>	<u>0.03</u>
衍生金融工具合计	<u>(792,787)</u>	<u>(0.27)</u>
投资合计	279,554,230	95.23
其他净资产	<u>14,015,158</u>	<u>4.77</u>
于 2021 年 6 月 30 日归属基金份额持有人资产净值	<u>293,569,388</u>	<u>100.00</u>
按成本投资总额	<u>253,209,540</u>	

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金

投资组合变动表 (未经审计)
于 2021 年 6 月 30 日

	于2021年6月30日 占资产净值百分比 %	于2020年12月31日 占资产净值百分比 %
上市股票(按来源地)		
股票		
加拿大	1.44	1.05
中国	10.13	8.66
丹麦	-	1.41
法国	-	3.45
德国	1.37	1.82
日本	6.30	4.30
荷兰	-	3.60
瑞士	1.91	-
台湾	1.72	1.36
英国	1.50	2.26
美国	71.13	57.51
上市股票合计	95.50	85.42
衍生金融工具		
远期外汇合约	(0.27)	0.46
期货合约	-	0.07
其他净资产	4.77	14.05
于2021年6月30日归属基金份额持有人的资产净值	100.00	100.00