



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 2022 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 2022 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
投资组合 - 东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金(未经审计)	12 - 14
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)	15
衍生金融工具详情 - 东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金(未经审计)	16 - 17
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)	18

附注:

子基金的未经审计中期报告已依据截至 2021 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

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
香港中环太子大厦 22 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 2022 年 6 月 30 日

	于 2022 年 6 月 30 日 美元	于 2021 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	87,331,596	148,761,930
衍生金融工具	88,059	521,055
应收经纪款项	18,756	2,331,840
应收基金份额持有人款项	22,527	14,114
应收银行利息	55	47
应收股息	71,334	82,492
经纪存款	1,085,066	763,356
现金和现金等价物	1,657,791	5,197,679
资产总计	90,275,184	157,672,513
负债		
衍生金融工具	299,570	202,419
应付经纪款项	18,683	2,513,930
应付基金份额持有人款项	331,483	518,182
其他应付款项	173,859	283,436
负债合计(不含归属基金份额持有人的资产净值)	823,595	3,517,967
归属基金份额持有人的资产净值	89,451,589	154,154,546

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 2022 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 2022 年 6 月 30 日	于 2021 年 12 月 31 日	于 2022 年 6 月 30 日	于 2021 年 12 月 31 日
- 普通美元累算	359,540.261	368,651.406	美元 15.94	美元 24.80
- 普通美元分派	2,818,320.061	3,370,851.315	美元 11.96	美元 18.70
- 普通港元分派	14,338,098.542	15,346,342.651	港元 12.02	港元 18.68
- 普通人民币分派	242,042.541	231,317.226	离岸人民币 11.75	离岸人民币 17.44
- 普通澳元 (对冲)分派	810,482.053	769,398.206	澳元 11.30	澳元 17.92
- 普通加元 (对冲)分派	188,163.990	184,555.979	加元 16.75	加元 26.47
- 普通欧元 (对冲)分派	89,871.520	133,799.513	欧元 10.39	欧元 16.42
- 普通英镑 (对冲)分派	275,954.663	283,961.638	英镑 10.32	英镑 16.30
- 普通新西兰元 (对冲)分派	42,468.044	41,720.880	新西兰元 12.32	新西兰元 19.48
- 普通人民币 (对冲)分派	3,659,178.842	2,373,508.896	离岸人民币 11.59	离岸人民币 18.24
- M 人民币 (对冲)累算	47,323,165.420	54,459,098.270	离岸人民币 0.8816	离岸人民币 1.3622
- M 人民币 (对冲)分派	4,470,159.260	5,146,594.950	离岸人民币 0.8277	离岸人民币 1.3018
- 机构 III 美元累算	57,477.886	67,155.886	美元 17.25	美元 26.62

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 2022 年 6 月 30 日期间

	由 2022 年 1 月 1 日 至 2022 年 6 月 30 日 美元	由 2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 6 月 30 日 美元
(亏损)/收入		
股息收入	420,918	865,409
利息收入	369	358
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(亏损)/收益	(54,469,497)	6,191,698
汇兑亏损净额	(16,764)	(137,454)
其他收入	75	-
净(亏损)/收益合计	(54,064,899)	6,920,011
费用		
管理费	953,434	2,383,773
受托人费用	64,265	159,235
基金登记机构费用	22,154	69,624
律师和专业咨询费	6,876	31,219
估值费用	74,927	75,477
银行和次保管人费用	6,160	15,580
交易成本	18,249	158,022
交易手续费	8,187	25,671
审计费	11,538	8,562
其他经营费用	15,283	11,142
经营费用合计	1,181,073	2,938,305
经营(亏损)/利润净额	(55,245,972)	3,981,706
融资成本		
分派予基金份额持有人	(614,763)	(1,382,162)
分派后及除税前净(亏损)/收益	(55,860,735)	2,599,544
海外预扣税	(78,981)	(197,573)
源自期间经营活动的归属基金份额持有人的 资产净值(减少)/增加	(55,939,716)	2,401,971

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 2022 年 6 月 30 日期间

	由 2022 年 1 月 1 日 至 2022 年 6 月 30 日 美元	由 2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 6 月 30 日 美元
期初归属基金份额持有人的资产净值	154,154,546	157,193,032
基金份额申购	20,806,655	336,072,484
基金份额赎回	(29,569,896)	(202,098,099)
净申购金额	(8,763,241)	133,974,385
源自期间经营活动的归属基金份额持有人的 资产净值(减少)/增加	(55,939,716)	2,401,971
期末归属基金份额持有人的资产净值	89,451,589	293,569,388

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) (续)

截至 2022 年 6 月 30 日期间

	普通美元累算		普通美元分派		普通港元分派		普通人民币分派	
	由 2022 年 1 月 1 日 至 2022 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 2022 年 1 月 1 日 至 2022 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 2022 年 1 月 1 日 至 2022 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 2022 年 1 月 1 日 至 2022 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
期初	368,651.406	410,465.898	3,370,851.315	3,926,247.636	15,346,342.651	12,407,202.703	231,317.226	165,356.521
已申购基金份额	27,599.581	299,965.638	319,973.086	6,422,372.253	2,063,109.990	38,861,746.202	23,016.065	241,574.820
已赎回基金份额	(36,710.726)	(197,208.409)	(872,504.340)	(3,962,686.086)	(3,071,354.099)	(22,793,627.016)	(12,290.750)	(42,475.986)
期末	<u>359,540.261</u>	<u>513,223.127</u>	<u>2,818,320.061</u>	<u>6,385,933.803</u>	<u>14,338,098.542</u>	<u>28,475,321.889</u>	<u>242,042.541</u>	<u>364,455.355</u>
	普通澳元 (对冲)分派		普通加元 (对冲)分派		普通欧元 (对冲)分派		普通英镑 (对冲)分派	
	由 2022 年 1 月 1 日 至 2022 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 2022 年 1 月 1 日 至 2022 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 2022 年 1 月 1 日 至 2022 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 2022 年 1 月 1 日 至 2022 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
期初	769,398.206	999,944.028	184,555.979	137,781.157	133,799.513	147,548.571	283,961.638	221,803.471
已申购基金份额	452,454.768	3,272,801.595	42,356.679	279,261.923	3,668.826	174,801.966	34,354.148	479,410.940
已赎回基金份额	(411,370.921)	(2,178,588.296)	(38,748.668)	(161,594.965)	(47,596.819)	(144,317.959)	(42,361.123)	(218,768.664)
期末	<u>810,482.053</u>	<u>2,094,157.327</u>	<u>188,163.990</u>	<u>255,448.115</u>	<u>89,871.520</u>	<u>178,032.578</u>	<u>275,954.663</u>	<u>482,445.747</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) (续)

截至 2022 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		M 人民币 (对冲)累算		M 人民币 (对冲)分派	
	由 2022 年 1 月 1 日 至 2022 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 2022 年 1 月 1 日 至 2022 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 2022 年 1 月 1 日 至 2022 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 2022 年 1 月 1 日 至 2022 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
期初	41,720.880	122,946.975	2,373,508.896	1,911,541.751	54,459,098.270	47,302,282.690	5,146,594.950	4,023,086.430
已申购基金份额	24,172.580	130,113.215	1,811,850.469	7,654,579.016	1,764,918.310	102,203,586.690	53,527.120	9,543,991.890
已赎回基金份额	(23,425.416)	(182,386.523)	(526,180.523)	(3,236,560.436)	(8,900,851.160)	(66,036,953.330)	(729,962.810)	(3,181,130.470)
期末	<u>42,468.044</u>	<u>70,673.667</u>	<u>3,659,178.842</u>	<u>6,329,560.331</u>	<u>47,323,165.420</u>	<u>83,468,916.050</u>	<u>4,470,159.260</u>	<u>10,385,947.850</u>
	机构 III 美元累算							
	由 2022 年 1 月 1 日 至 2022 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						
期初	67,155.886	24,795.096						
已申购基金份额	-	-						
已赎回基金份额	(9,678.000)	(7,201.000)						
期末	<u>57,477.886</u>	<u>17,594.096</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 2022 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 2022 和 2021 年 6 月 30 日期间进行了如下分派:

由 2022 年 1 月 1 日
至 2022 年 6 月 30 日

普通美元分派

	美元
- 美元 0.01543/基金份额, 计 3,370,851.320 基金份额, 于除息日 2022 年 1 月 3 日	52,012
- 美元 0.01328/基金份额, 计 3,275,321.190 基金份额, 于除息日 2022 年 2 月 4 日	43,496
- 美元 0.01279/基金份额, 计 3,198,091.340 基金份额, 于除息日 2022 年 3 月 1 日	40,904
- 美元 0.01316/基金份额, 计 3,089,320.250 基金份额, 于除息日 2022 年 4 月 1 日	40,655
- 美元 0.01190/基金份额, 计 3,007,285.040 基金份额, 于除息日 2022 年 5 月 3 日	35,787
- 美元 0.01059/基金份额, 计 2,888,533.830 基金份额, 于除息日 2022 年 6 月 1 日	30,590

普通港元分派

	港元
- 港元 0.01542/基金份额, 计 15,346,342.680 基金份额, 于除息日 2022 年 1 月 3 日	236,641
- 港元 0.01324/基金份额, 计 14,726,649.840 基金份额, 于除息日 2022 年 2 月 4 日	194,981
- 港元 0.01279/基金份额, 计 14,610,971.390 基金份额, 于除息日 2022 年 3 月 1 日	186,874
- 港元 0.01319/基金份额, 计 14,407,915.750 基金份额, 于除息日 2022 年 4 月 1 日	190,040
- 港元 0.01197/基金份额, 计 15,548,206.450 基金份额, 于除息日 2022 年 5 月 3 日	186,112
- 港元 0.01065/基金份额, 计 15,218,481.590 基金份额, 于除息日 2022 年 6 月 1 日	162,077

普通人民币分派

	离岸人民币
- 离岸人民币 0.01442/基金份额, 计 231,317.230 基金份额, 于除息日 2022 年 1 月 3 日	3,336
- 离岸人民币 0.01233/基金份额, 计 248,305.210 基金份额, 于除息日 2022 年 2 月 4 日	3,062
- 离岸人民币 0.01185/基金份额, 计 250,871.670 基金份额, 于除息日 2022 年 3 月 1 日	2,973
- 离岸人民币 0.01231/基金份额, 计 250,886.710 基金份额, 于除息日 2022 年 4 月 1 日	3,088
- 离岸人民币 0.01150/基金份额, 计 250,886.710 基金份额, 于除息日 2022 年 5 月 3 日	2,885
- 离岸人民币 0.01041/基金份额, 计 251,633.290 基金份额, 于除息日 2022 年 6 月 1 日	2,620

普通澳元 (对冲)分派

	澳元
- 澳元 0.01052/基金份额, 计 769,398.220 基金份额, 于除息日 2022 年 1 月 3 日	8,094
- 澳元 0.01085/基金份额, 计 758,124.330 基金份额, 于除息日 2022 年 2 月 4 日	8,226
- 澳元 0.01033/基金份额, 计 769,855.700 基金份额, 于除息日 2022 年 3 月 1 日	7,953
- 澳元 0.00777/基金份额, 计 754,860.250 基金份额, 于除息日 2022 年 4 月 1 日	5,865
- 澳元 0.00572/基金份额, 计 816,908.480 基金份额, 于除息日 2022 年 5 月 3 日	4,673
- 澳元 0.00414/基金份额, 计 1,060,490.940 基金份额, 于除息日 2022 年 6 月 1 日	4,390

普通加元 (对冲)分派

	加元
- 加元 0.01995/基金份额, 计 184,555.970 基金份额, 于除息日 2022 年 1 月 3 日	3,682
- 加元 0.02024/基金份额, 计 216,511.710 基金份额, 于除息日 2022 年 2 月 4 日	4,382
- 加元 0.02042/基金份额, 计 185,624.910 基金份额, 于除息日 2022 年 3 月 1 日	3,790
- 加元 0.01965/基金份额, 计 185,721.600 基金份额, 于除息日 2022 年 4 月 1 日	3,649
- 加元 0.01981/基金份额, 计 186,374.130 基金份额, 于除息日 2022 年 5 月 3 日	3,692
- 加元 0.01791/基金份额, 计 184,756.010 基金份额, 于除息日 2022 年 6 月 1 日	3,309

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 2022 年 6 月 30 日止六个月 (续)

由 2022 年 1 月 1 日
至 2022 年 6 月 30 日

普通欧元 (对冲)分派

欧元

- 欧元 0.00080/基金份额, 计 136,027.920 基金份额, 于除息日 2022 年 2 月 4 日
- 欧元 0.00259/基金份额, 计 104,530.600 基金份额, 于除息日 2022 年 3 月 1 日

109
271

普通英镑 (对冲)分派

英镑

- 英镑 0.00945/基金份额, 计 283,961.640 基金份额, 于除息日 2022 年 1 月 3 日
- 英镑 0.01168/基金份额, 计 288,726.470 基金份额, 于除息日 2022 年 2 月 4 日
- 英镑 0.01326/基金份额, 计 278,253.930 基金份额, 于除息日 2022 年 3 月 1 日
- 英镑 0.01314/基金份额, 计 277,927.660 基金份额, 于除息日 2022 年 4 月 1 日
- 英镑 0.01153/基金份额, 计 275,170.040 基金份额, 于除息日 2022 年 5 月 3 日
- 英镑 0.00895/基金份额, 计 273,187.450 基金份额, 于除息日 2022 年 6 月 1 日

2,683
3,372
3,690
3,652
3,173
2,445

普通新西兰元 (对冲)分派

新西兰元

- 新西兰元 0.02314/基金份额, 计 41,720.890 基金份额, 于除息日 2022 年 1 月 3 日
- 新西兰元 0.02039/基金份额, 计 53,178.060 基金份额, 于除息日 2022 年 2 月 4 日
- 新西兰元 0.02109/基金份额, 计 53,189.170 基金份额, 于除息日 2022 年 3 月 1 日
- 新西兰元 0.02063/基金份额, 计 53,196.990 基金份额, 于除息日 2022 年 4 月 1 日
- 新西兰元 0.01816/基金份额, 计 44,107.950 基金份额, 于除息日 2022 年 5 月 3 日
- 新西兰元 0.01674/基金份额, 计 44,121.950 基金份额, 于除息日 2022 年 6 月 1 日

965
1,084
1,122
1,097
801
739

普通人民币 (对冲)分派

离岸人民币

- 离岸人民币 0.05313/基金份额, 计 2,373,508.890 基金份额, 于除息日 2022 年 1 月 3 日
- 离岸人民币 0.04115/基金份额, 计 2,805,420.810 基金份额, 于除息日 2022 年 2 月 4 日
- 离岸人民币 0.04613/基金份额, 计 2,618,987.140 基金份额, 于除息日 2022 年 3 月 1 日
- 离岸人民币 0.04944/基金份额, 计 3,530,918.650 基金份额, 于除息日 2022 年 4 月 1 日
- 离岸人民币 0.04672/基金份额, 计 3,521,082.260 基金份额, 于除息日 2022 年 5 月 3 日
- 离岸人民币 0.03499/基金份额, 计 3,779,521.730 基金份额, 于除息日 2022 年 6 月 1 日

126,105
115,443
120,814
174,569
164,505
132,245

M 人民币 (对冲)分派

离岸人民币

- 离岸人民币 0.01227/基金份额, 计 5,146,594.950 基金份额, 于除息日 2022 年 1 月 3 日
- 离岸人民币 0.00893/基金份额, 计 4,678,065.150 基金份额, 于除息日 2022 年 4 月 1 日

63,149
41,775

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 2022 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 2022 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

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

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

投资组合 (未经审计)
于 2022 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 (97.63%)			
加拿大 (0.77%)			
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	19,141	690,667	0.77
		<u>690,667</u>	<u>0.77</u>
		-----	-----
中国 (7.02%)			
宁德时代新能源科技股份有限公司	27,600	2,198,383	2.46
恩智浦半导体	8,245	1,220,507	1.36
药明生物技术有限公司	228,500	2,090,787	2.34
小鹏汽车有限公司 - A	47,700	768,360	0.86
		<u>6,278,037</u>	<u>7.02</u>
		-----	-----
日本 (8.16%)			
DAIFUKU CO LTD (大福株式会社)	23,100	1,319,466	1.48
HITACHI LTD (日立制作所)	31,500	1,492,746	1.67
NIDEC CORPORATION (日本电产科宝株式会社)	29,700	1,831,998	2.05
SONY GROUP CORP (索尼)	14,500	1,184,185	1.32
TOKYO ELECTRON LTD (东京威力科创)	4,500	1,467,373	1.64
		<u>7,295,768</u>	<u>8.16</u>
		-----	-----
荷兰 (1.16%)			
ADYEN NV	717	1,040,428	1.16
		<u>1,040,428</u>	<u>1.16</u>
		-----	-----
新加坡 (2.75%)			
STMICROELECTRONICS NV (意法半导体)	78,496	2,461,909	2.75
		<u>2,461,909</u>	<u>2.75</u>
		-----	-----
台湾 (2.31%)			
台湾积体电路制造股份有限公司	25,320	2,069,910	2.31
		<u>2,069,910</u>	<u>2.31</u>
		-----	-----
英国 (1.72%)			
SEGRO PLC	129,590	1,537,293	1.72
		<u>1,537,293</u>	<u>1.72</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 2022 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 (97.63%) (续)			
美国 (73.74%)			
AMAZON COM INC (亚马逊公司)	26,439	2,808,086	3.14
AMERICAN TOWER CORP - A (美国电塔公司 - A)	9,446	2,414,303	2.70
APPLIED MATERIALS INC (应用材料公司)	17,640	1,604,887	1.79
APPROVIN CORP - A	11,098	382,215	0.43
ARISTA NETWORKS INC (ARISTA 网络公司)	6,670	625,246	0.70
ATLASSIAN CORP PLC (艾特莱森软件)	3,669	687,571	0.77
AUTODESK INC (欧特克股份有限公司)	5,348	919,642	1.03
BOOKING HOLDINGS INC	1,049	1,834,691	2.05
BOSTON SCIENTIFIC CORP (波士顿科学有限公司)	25,812	962,013	1.07
BRISTOL MYERS SQUIBB COMPANY (必治妥施贵宝公司)	24,000	1,848,000	2.07
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	7,687	1,295,721	1.45
DARLING INGREDIENTS INC (美国达尔令国际)	25,861	1,546,488	1.73
DATADOG INC - A (数据狗 - A)	6,943	661,251	0.74
EDWARDS LIFESCIENCES CORP (爱德华生命科学)	20,167	1,917,680	2.14
EXACT SCIENCES CORP	23,549	927,595	1.04
GXO LOGISTICS INC	28,827	1,247,344	1.39
HUBSPOT INC	3,961	1,190,875	1.33
IQVIA HOLDINGS INC (昆泰公司)	10,158	2,204,184	2.46
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC (江森自控国际有限公司)	62,039	2,970,427	3.32
MARVELL TECHNOLOGY INC (迈威尔科技有限公司)	58,570	2,549,552	2.85
MASTERCARD INCORPORATED - A (万事达卡公司 - A)	4,787	1,510,203	1.69
MEDTRONIC PLC (美敦力公司)	23,179	2,080,315	2.33
MICRON TECHNOLOGY (美光科技公司)	25,088	1,386,865	1.55
MICROSOFT CORP (微软公司)	10,425	2,677,453	2.99
OKTA INC	14,670	1,326,168	1.48
PALO ALTO NETWORKS INC (帕罗奥图网络公司)	6,750	3,334,095	3.73
RINGCENTRAL INC	8,319	434,751	0.49
S&P GLOBAL INC (标普全球股份有限公司)	5,285	1,781,362	1.99
SALESFORCE INC (赛富时)	11,387	1,879,311	2.10
SCHNEIDER ELECTRIC SE (施耐德电气)	19,814	2,338,672	2.61
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	5,400	1,477,872	1.65
SPLUNK INC	22,555	1,995,215	2.23
SVB FINANCIAL GROUP (硅谷银行)	4,477	1,768,370	1.98
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC (泰莱达科技)	4,617	1,731,883	1.94
TRANSUNION (环联公司)	39,826	3,185,682	3.56
TWILIO INC - A	10,009	838,854	0.94
UPSTART HOLDINGS INC	11,840	374,381	0.42
VEEVA SYSTEMS INC - A (VEEVA 系统 - A)	10,894	2,157,448	2.41
WASTE MANAGEMENT INC (废弃物管理公司)	12,084	1,848,610	2.07
ZENDESK INC	16,637	1,232,303	1.38
		<u>65,957,584</u>	<u>73.74</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 2022 年 6 月 30 日 (续)

	公允价值 美元	资产净值的%
上市股票合计	87,331,596	97.63
	-----	-----
衍生金融工具		
远期外汇合约		
法国巴黎银行	(70,703)	(0.08)
渣打銀行(香港)有限公司	(119,988)	(0.14)
香港上海汇丰银行有限公司	(20,820)	(0.02)
	-----	-----
衍生金融工具合计	(211,511)	(0.24)
	-----	-----
投资合计	87,120,085	97.39
其他净资产	2,331,504	2.61
	-----	-----
于2022年6月30日归属基金份额持有人资产净值	89,451,589	100.00
	=====	=====
按成本投资总额	115,148,391	
	=====	

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 2022 年 6 月 30 日

上市股票(按来源地)	于2022年6月30日 占资产净值百分比 %	于2021年12月31日 占资产净值百分比 %
股票		
加拿大	0.77	2.36
中国	7.02	7.86
德国	-	0.90
日本	8.16	6.43
荷兰	1.16	0.97
新加坡	2.75	2.91
台湾	2.31	3.64
英国	1.72	1.77
美国	73.74	69.66
上市股票合计	97.63	96.50
衍生金融工具		
远期外汇合约	(0.24)	0.31
期货合约	-	(0.10)
其他净资产	2.61	3.29
归属基金份额持有人的资产净值	100.00	100.00

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金

衍生金融工具详情 (未经审计)

于 2022 年 6 月 30 日

子基金期末的远期外汇合约如下:

待交付合约	交换对象	结算日	交易方	公允价值 美元
于2022年6月30日				
金融资产:				
澳元4,637	美元3,207	2022年7月29日	香港上海汇丰银行有限公司 (“汇丰”)	18
澳元30,055	美元20,873	2022年7月29日	汇丰	201
澳元80,611	美元55,969	2022年7月29日	汇丰	525
加元94,581	美元73,377	2022年7月29日	汇丰	58
离岸人民币1,267	美元189	2022年7月29日	汇丰	0
离岸人民币109,700	美元16,360	2022年7月29日	汇丰	3
离岸人民币128,662	美元19,200	2022年7月29日	汇丰	17
离岸人民币1,237,179	美元184,505	2022年7月29日	汇丰	37
离岸人民币1,261,904	美元188,192	2022年7月29日	汇丰	38
欧元28,399	美元29,894	2022年7月29日	汇丰	150
英镑86,442	美元105,125	2022年7月29日	汇丰	96
美元145	离岸人民币975	2022年7月29日	汇丰	0
美元754	加元975	2022年7月29日	汇丰	2
美元550,226	离岸人民币3,698,687	2022年7月29日	汇丰	1,260
美元2,424,159	加元3,143,175	2022年7月29日	汇丰	12,416
美元6,222,877	离岸人民币41,830,976	2022年7月29日	汇丰	14,253
美元6,329,415	离岸人民币42,547,137	2022年7月29日	汇丰	14,497
美元2,580,093	瑞士法郎2,500,000	2022年9月9日	渣打銀行(香港)有限公司 (“渣打”)	44,488
				88,059

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金

衍生金融工具详情 (未经审计)

于 2022 年 6 月 30 日

子基金期末的远期外汇合约如下:

待交付合约	交换对象	结算日	交易方	公允价值 美元
于2022年6月30日				
金融负债:				
澳元273,853	美元187,958	2022年7月29日	汇丰	(396)
离岸人民币112,736	美元16,804	2022年7月29日	汇丰	(5)
新西兰元15,791	美元9,800	2022年7月29日	汇丰	(16)
美元3,491,009	英镑2,851,114	2022年7月29日	汇丰	(26,818)
美元6,400,115	澳元9,279,240	2022年7月29日	汇丰	(17,928)
美元979,178	欧元925,491	2022年7月29日	汇丰	(9,844)
美元341,696	澳元493,184	2022年7月29日	汇丰	(2,488)
美元186,670	英镑151,905	2022年7月29日	汇丰	(2,100)
美元327,495	新西兰元523,545	2022年7月29日	汇丰	(2,051)
美元338,473	离岸人民币2,264,520	2022年7月29日	汇丰	(826)
美元332,091	离岸人民币2,221,821	2022年7月29日	汇丰	(811)
美元52,180	欧元49,262	2022年7月29日	汇丰	(584)
美元17,703	新西兰元28,041	2022年7月29日	汇丰	(272)
美元129,870	加元167,396	2022年7月29日	汇丰	(105)
美元29,427	离岸人民币196,881	2022年7月29日	汇丰	(72)
美元10,267	欧元9,750	2022年7月29日	汇丰	(56)
美元7,569	加元9,750	2022年7月29日	汇丰	(11)
美元1,596	离岸人民币10,670	2022年7月29日	汇丰	(5)
美元789	英镑647	2022年7月29日	汇丰	(3)
美元3,189,219	加元4,000,000	2022年9月9日	渣打	(87,900)
美元2,265,547	英镑1,800,000	2022年9月9日	渣打	(76,576)
美元3,223,178	欧元3,000,000	2022年9月9日	法国巴黎银行	(70,703)
				<hr/>
				(299,570)
				<hr/>
				(211,511)
				<hr/> <hr/>

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 2022 年 6 月 30 日

于 2022 年 6 月 30 日，东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金并未持有包含现金、现金等价物、货币市场工具、政府或企业发行的债务担保(无论投资级别/非投资级别)，或是其他资产类型的抵押品。