

东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金*

东方汇理香港组合 - 灵活配置均衡基金*

东方汇理香港组合 - 灵活配置增长基金

东方汇理香港组合 - 亚太新动力股息基金

东方汇理香港组合 - 环球银发动力基金*

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金

东方汇理香港组合 - 环球多元主题股票基金*

东方汇理香港组合 - 环球教育股票基金*

东方汇理香港组合 - **2023** 到期亚洲债券基金*

东方汇理香港组合 - 美元货币市场基金*

(东方汇理香港组合之子基金)

截至 **2020** 年 **12** 月 **31** 日止期间/年度之
报告和财务报表

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

*该基金未获得中国证监会认可，不可向内地投资者进行销售。

东方汇理香港组合

目录	页
管理层和行政管理	1
基金管理人报告	2
受托人致基金份额持有人的报告	3
基金管理人及受托人的责任	4
独立审计师报告	5-7
财务状况表 - 东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金	8
综合收益表 - 东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金	9
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	10-12
现金流量表 - 东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金	13
财务报表附注	14-50
投资组合 - 东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金 (未经审计)	51-53
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)	54
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)	55
业绩表现表 - 东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金 (未经审计)	56-58

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

Christianus Pellis
Gilles Guerrier de Dumast
Jean Yves Glain
Vincent Mortier
Zhong Xiao Feng 钟小锋

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

基金管理人报告

2020 年回顾

2020 年是现代历史上空前的一年，新冠肺炎疫情导致的环球衰退，是最多国家同时受到影响的一次经济衰退。然而，快速疫苗分发、货币和财政刺激以及减轻地缘政治紧张局势的希望，推动了今年下半年的强劲复苏。结果，尽管全球经济出现衰退，惟大多数市场在年底都取得了有利的业绩表现。

新冠肺炎疫情危机重创了美国经济。由新冠肺炎疫情以及由当局实施限制措施所带来的影响，我们看到 2020 年第一季度和第二季度的国内生产总值 (“GDP”) 按年计分别急跌 5.0% 和 31.4%。然而，受惠于美国联储局 (“联储局”) 实施的庞大货币宽松政策和财政刺激措施，2020 年第三季度的 GDP 强劲反弹 (+33.4%)。相关救助计划相当于 14% GDP 左右。尽管，服务业比制造业受到的影响大，但复苏是针对整个经济的。工作职位在年初大规模减少后，失业率开始从 2020 年 4 月时最高峰的 14.7% 回落至 2020 年 12 月的 6.7%。通胀于年中放缓，虽然随后再次回升，仍与 2% 的目标相距甚远。拜登在 2020 年 11 月当选美国总统，将美国股市推向新高。

在欧元区方面，在 2020 年第一季度末疫情升温并打击许多行业时，GDP 增长已经处于减速趋势。受到封锁隔离措施和新冠肺炎限制的影响，经济活动在 2020 年第一季度收缩了 3.7%，在第二季度收缩扩大至 11.7%，随后在 2020 年第三季度反弹 12.5%。这是由于政府采取了大规模的财政措施，和紧急状态下减轻失业风险援助 (“SURE”) 计划和 “下一代欧盟” 计划 (“Next Generation EU”) 的支持。欧洲央行亦通过扩张性措施的帮助，如新一轮资产购买计划，令通胀率逐渐下降，在下半年进入负值区间。

疫情损害了新兴市场经济，许多经济体在 2020 年第一季度和/或 2020 年第二季度的 GDP 均录得双位数跌幅、货币急剧贬值和历史性资本外流。为了对抗病毒并尽可能减少防疫限制对经济的负面影响，各国政府已大幅加大了开支。中央银行也提供支持，并通过降息和/或量化宽松政策从而大大放松了货币政策。尽管一些新兴市场国家仍然面对着几波疫情，新兴市场经济，尤其以中国为首的亚洲市场 (4.9%)，在 2020 年第三季度仍然有所改善。即使各国政府和中央银行对于经济发展策略上的空间明显减少，但仍然决心支持。

经过 3 月其中一个重大跌幅 (31.8%) 之后，MSCI AC 世界指数最终在 2020 年以 16.3% 涨幅收盘，其中中国涨 29.5%、MSCI AC 亚太(日本除外)指数涨 22.5%、美国涨 20.0%、日本涨 14.5% 和欧洲涨 5.4%。市场在 3 月底开始反弹，然后在 11 月宣布首批疫苗后再次起飞。

在固定收益方面，美国和德国的 10 年期债券收益率分别从 1.92% 下降至 0.91%，以及从 -0.23% 下降至 -0.57%。全球经济衰退以及中央银行和政府采取的行动可以解释利率的急跌的原因。

东方汇理香港组合

受托人致基金份额持有人的报告

我们谨此确认，我们认为，东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金*、东方汇理香港组合 - 灵活配置均衡基金*、东方汇理香港组合 - 灵活配置增长基金、东方汇理香港组合 - 亚太新动力股息基金、东方汇理香港组合 - 环球银发动力基金*、东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金、东方汇理香港组合 - 环球多元主题股票基金*、东方汇理香港组合 - 环球教育股票基金*、东方汇理香港组合 - 2023 到期亚洲债券基金*和东方汇理香港组合 - 美元货币市场基金* (东方汇理香港组合“子基金”) 的管理人在所有重要方面均按照 2009 年 10 月 21 日签订的信托契约规定，以及 2009 年 12 月 31 日、2010 年 3 月 1 日、2013 年 5 月 28 日、2013 年 8 月 16 日、2014 年 11 月 10 日、2014 年 12 月 30 日、2015 年 6 月 30 日、2016 年 3 月 10 日、2016 年 5 月 17 日、2016 年 12 月 21 日、2017 年 8 月 1 日、2017 年 12 月 18 日、2018 年 5 月 16 日、2018 年 10 月 8 日、2019 年 12 月 31 日和 2020 年 3 月 17 日签订的补充契约，在截至 2020 年 12 月 31 日的期间/年度对子基金进行管理。

代表

汇丰机构信托服务(亚洲)有限公司
作为东方汇理香港组合受托人

香港

2021 年 4 月 29 日

*该基金未获得中国证监会认可，不可向内地投资者进行销售。

东方汇理香港组合

基金管理人及受托人责任

基金管理人的责任

按照香港证券及期货事务监察委员会订立的单位信托及互惠基金守则(“守则”)以及信托契约之规定，子基金管理人应就每个会计年度编制财务报表，该等财务报表须对子基金于期末的财务状况及截至期末期间的交易提供真实和公允的反映。在编制这些报表时，基金管理人须：

- 选择及贯彻采用适当的会计政策；
- 作出谨慎及合理的判断和估计；及
- 以子基金将持续运营为基准(除非此假设不适用)编制财务报表。

基金管理人还应根据信托契约管理子基金，并采取合理之步骤，防止和侦测欺诈及其他不当行为出现。

受托人的责任

守则及信托契约要求子基金受托人须：

- 确保子基金在所有重大方面均按照信托契约进行管理，而有关之投资和借贷权亦遵守有关规定；
- 信纳已维持充足之会计和其他记录；
- 保障子基金之产权及该等财产所附有之权利；及
- 在每个会计年度，如果基金管理人未有按信托契约管理子基金，应就此向基金份额持有人作出报告。

独立审计师报告
致东方汇理香港组合
基金份额持有人的报告

就财务报表审计作出的报告

意见

我们已审计的内容

东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金*、东方汇理香港组合 - 灵活配置均衡基金*、东方汇理香港组合 - 灵活配置增长基金、东方汇理香港组合 - 亚太新动力股息基金、东方汇理香港组合 - 环球银发动力基金*、东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金、东方汇理香港组合 - 环球多元主题股票基金*、东方汇理香港组合 - 环球教育股票基金*和东方汇理香港组合 - 美元货币市场基金*截至 2020 年 12 月 31 日和东方汇理香港组合 - 2023 到期亚洲债券基金*由至 2020 年 4 月 29 日(开始营运日期)至 2020 年 12 月 31 日止 (“相关期间”)和于 2020 年 12 月 31 日 (每个基金均为东方汇理香港组合投资组合的一个独立子基金, 个别及共同称为“子基金”)列载于第 8 至 238 页的财务报表, 包括:

- 各子基金截至 2020 年 12 月 31 日的财务状况表;
- 各子基金截至该日止相关期间的综合收益表;
- 东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金*、东方汇理香港组合 - 灵活配置均衡基金*、东方汇理香港组合 - 灵活配置增长基金、东方汇理香港组合 - 亚太新动力股息基金、东方汇理香港组合 - 环球银发动力基金*、东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金、东方汇理香港组合 - 环球多元主题股票基金*、东方汇理香港组合 - 环球教育股票基金*和东方汇理香港组合 - 2023 到期亚洲债券基金*截至该日止相关期间的归属基金份额持有人资产净值变动表;
- 东方汇理香港组合 - 美元货币市场基金*截至该日止相关期间的权益变动表;
- 各子基金截至该日止相关期间的现金流量表; 及
- 财务报表附注, 包括重要会计政策要点。

我们的意见

我们认为, 该等财务报表已根据国际财务报告准则真实而中肯地反映了各子基金截至 2020 年 12 月 31 日的财务状况及其截至该日止相关期间的财务交易和现金流量。

意见的基础

我们已根据国际审计准则进行审计。我们在该等准则下承担的责任已在本报告“审计师就审计财务报表承担的责任”部份中作进一步阐述。

我们认为, 我们所获得的审计凭证能充足及适当地为我们的审计意见提供基础。

独立性

根据国际会计师职业道德准则理事会的职业会计师道德守则, 我们独立于子基金, 并已履行守则中的其他专业道德责任。

*该基金未获得中国证监会认可, 不可向内地投资者进行销售。

独立审计师报告
致东方汇理香港组合
基金份额持有人的报告(续)

其他信息

子基金的受托人和管理人(“管理层”)须对其他信息负责。其他信息包括年度报告内的所有信息,但不包括财务报表及我们的审计师报告。

我们对财务报表的意见并不涵盖其他信息。我们亦不对该等其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中所了解的情况存在重大抵触或者似乎存在重大错误陈述的情况。

基于我们已执行的工作,如果我们认为其他信息存在重大错误陈述,我们需要报告该事实。在这方面,我们没有任何报告。

管理层就财务报表须承担的责任

子基金的管理层须负责根据国际财务报告准则拟备真实而中肯的财务报表,并对其认为为使财务报表的拟备不存在由于欺诈或错误而导致的重大错误陈述所需的内部控制负责。

在拟备财务报表时,子基金的管理层负责评估子基金持续经营的能力,并在适用情况下披露与持续经营有关的事项,以及使用持续经营为会计基础,除非管理层有意将子基金清盘或停止经营,或别无其他实际的替代方案。

此外,基金的管理层须确保财务报表已根据 2009 年 10 月 21 日的信托契约(经修订)(“信托契约”)的相关披露条文以及香港证券及期货事务监察委员会颁布的单位信托及互惠基金守则(“证监会守则”)附录 E 的有关披露规定适当地拟备。

审计师就审计财务报表承担的责任

我们的目标,是对财务报表总体是否不存在由于欺诈或错误而导致的重大错误陈述取得合理保证,并出具包括我们意见的审计师报告。我们仅向阁下(作为整体)报告我们的意见,除此之外本报告别无其他目的。我们不会就本报告的内容向任何其他人士负上或承担任何责任。合理保证是高水平的保证,但不能保证按照国际审计准则进行的审计,在某一重大错误陈述存在时总能发现。错误陈述可以由欺诈或错误引起,如果合理预期它们单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依赖财务报表所作出的经济决定,则有关的错误陈述可被视作重大。此外,我们需要评估子基金的财务报表在各重大方面是否已按照信托契约的相关披露条文和证监会守则的有关披露规定适当地拟备。

独立审计师报告
致东方汇理香港组合
基金份额持有人的报告(续)

审计师就审计财务报表承担的责任(续)

在根据国际审计准则进行审计的过程中，我们运用了专业判断，保持了专业怀疑态度。我们亦：

- 识别和评估由于欺诈或错误而导致财务报表存在重大错误陈述的风险，设计及执行审计程序以应对这些风险，以及获取充足和适当的审计凭证，作为我们意见的基础。由于欺诈可能涉及串谋、伪造、蓄意遗漏、虚假陈述，或凌驾于内部控制之上，因此未能发现因欺诈而导致的重大错误陈述的风险高于未能发现因错误而导致的重大错误陈述的风险。
- 了解与审计相关的内部控制，以设计适应的审计程序，但目的并非对子基金内部控制的有效性发表意见。
- 评估管理层所采用会计政策的恰当性以及作出会计估计和相关披露的合理性。
- 对管理层采用持续经营会计基础的恰当性作出结论。根据所获取的审计凭证，确定是否存在与事项或情况有关的重大不确定性，从而可能导致对子基金的持续经营能力产生重大疑虑。如果我们认为存在重大不确定性，则有必要在审计师报告中提请使用者注意财务报表中的相关披露。假若有关的披露不足，则我们应当发表非无保留意见。我们结论是基于审计师报告日止所取得的审计凭证。然而，未来事项或情况可能导致子基金不能持续经营。
- 评价财务报表的整体列报方式、结构和内容，包括披露，以及财务报表是否中肯反映交易和事项。

除其他事项外，我们与管理层沟通了计划的审计范围、时间安排、重大审计发现等，包括我们在审计中识别出内部控制的任何重大缺陷。

就信托契约和证监会守则附录 E 的相关披露规定之事项作出的报告

我们认为，该等财务报表在各重大方面已根据信托契约和证监会守则附录 E 的相关披露规定适当地拟备。

罗兵咸永道会计师事务所
执业会计师

香港

2021 年 4 月 29 日

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金

财务状况表
于 2020 年 12 月 31 日

	附注	2020 年 美元	2019 年 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	6	134,273,526	40,913,143
衍生金融工具	7	911,000	142,439
应收经纪款项		1,804,720	14,417
应收基金份额持有人款项		18,968,638	54,058
应收银行利息		3	-
应收股息		69,635	13,579
经纪存款		699,131	156,353
现金和现金等价物	11(k)	6,951,031	1,734,246
资产总计		163,677,684	43,028,235
负债			
衍生金融工具	7	83,579	20,529
应付经纪款项		1,791,724	14,556
应付基金份额持有人款项		4,234,688	1,436,627
其他应付款项	8	374,661	89,720
负债合计(不含归属基金份额持有人的资产净值)		6,484,652	1,561,432
归属基金份额持有人的资产净值(交易价值)	13	157,193,032	41,466,803

代表以下机构签署:

.....
汇丰机构信托服务(亚洲)有限公司
作为基金受托人

.....
东方汇理资产管理香港有限公司
作为基金管理人

14-50 页的附注为财务报表的组成部分。

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金

综合收益表

截至 2020 年 12 月 31 日年度

	附注	2020 年 美元	2019 年 美元
收入/(亏损)			
股息收入		398,148	300,510
利息收入	11(j)	2,333	29,263
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	14	51,532,997	18,173,361
汇兑亏损净额		(59,330)	(61,522)
净收益合计		51,874,148	18,441,612
费用			
管理费	3, 11(b)	1,430,672	840,725
受托人费用	4(a), 11(c)	95,772	57,067
基金登记机构费用	4(b), 11(d)	88,145	30,375
律师和专业咨询费		18,640	35,513
估值费用	4(c), 11(e)	134,780	126,541
银行和次保管人费用	11(f)	9,509	5,522
交易成本		121,695	44,632
核数师费用		14,409	9,923
其他经营费用		153,435	160,684
经营费用合计		2,067,057	1,310,982
经营利润净额		49,807,091	17,130,630
融资成本			
分派予基金份额持有人	16	(742,909)	(540,761)
分派后及除税前净收益		49,064,182	16,589,869
海外预扣税	10(d)	(77,225)	(52,407)
税后净收益		48,986,957	16,537,462
未摊销开办费用调整变动	13	-	(9,023)
源自年度经营活动的归属基金份额持有人的资产净值 增加		48,986,957	16,528,439

14-50 页的附注为财务报表的组成部分。

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
截至 2020 年 12 月 31 日年度

	附注	2020 年 美元	2019 年 美元
年初归属基金份额持有人的资产净值		41,466,803	62,845,457
基金份额申购	9	370,779,237	79,698,193
基金份额赎回	9	(304,039,965)	(117,605,286)
净申购/(赎回)金额		66,739,272	(37,907,093)
税后净收益		48,986,957	16,537,462
未摊销开办费用调整变动	13	-	(9,023)
源自年度经营活动的归属基金份额持有人的资产 净值增加		48,986,957	16,528,439
年末归属基金份额持有人的资产净值		157,193,032	41,466,803

14-50 页的附注为财务报表的组成部分。

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(续)
截至 2020 年 12 月 31 日年度

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金

	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	
	2020 年 基金份额 数量	2019 年 基金份额 数量	2020 年 基金份额 数量	2019 年 基金份额 数量	2020 年 基金份额 数量	2019 年 基金份额 数量	2020 年 基金份额 数量	2019 年 基金份额 数量
年初	19,576.096	621,663.894	630,718.740	1,631,408.760	968,472.958	1,349,322.534	7,367,524.857	11,098,389.321
已申购基金份额	9,610.000	-	594,420.755	148,002.555	10,261,326.789	3,764,234.892	36,741,334.656	16,373,536.507
已赎回基金份额	(4,391.000)	(602,087.798)	(814,673.597)	(1,148,692.575)	(7,303,552.111)	(4,145,084.468)	(31,701,656.810)	(20,104,400.971)
年末	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

	普通人民币分派		普通澳元 (对冲)分派		普通新西兰元 (对冲)分派		普通人民币 (对冲)分派	
	2020 年 基金份额 数量	2019 年 基金份额 数量	2020 年 基金份额 数量	2019 年 基金份额 数量	2020 年 基金份额 数量	2019 年 基金份额 数量	2020 年 基金份额 数量	2019 年 基金份额 数量
年初	196,483.301	221,920.025	273,160.850	758,414.309	13,996.335	147.102	2,668,206.141	4,253,200.769
已申购基金份额	233,673.607	70,337.477	6,453,927.383	849,148.463	355,616.250	49,899.980	6,466,692.307	1,824,349.059
已赎回基金份额	(264,800.387)	(95,774.201)	(5,727,144.205)	(1,334,401.922)	(246,665.610)	(36,050.747)	(7,223,356.697)	(3,409,343.687)
年末	165,356.521	196,483.301	999,944.028	273,160.850	122,946.975	13,996.335	1,911,541.751	2,668,206.141

14-50 页的附注为财务报表的组成部分。

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(续)
截至 2020 年 12 月 31 日年度

	东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金 (续)					
	普通加元(对冲)分派		普通欧元 (对冲)分派		普通英镑 (对冲)分派	
	2020 年 基金份额 数量	2019 年 基金份额 数量	2020 年 基金份额 数量	2019 年 基金份额 数量	2020 年 基金份额 数量	2019 年 基金份额 数量
年初	13,293.975	34,102.520	45,731.038	85.547	24,927.135	309.133
已申购基金份额	825,479.101	74,581.116	201,957.816	65,904.477	842,827.872	76,467.509
已赎回基金份额	(700,991.919)	(95,389.661)	(100,140.283)	(20,258.986)	(645,951.536)	(51,849.507)
年末	137,781.157	13,293.975	147,548.571	45,731.038	221,803.471	24,927.135
	M 人民币(对冲) 分派 ⁽¹⁾		M 人民币(对冲) 累算 ⁽¹⁾			
	2020 年 基金份额 数量		2020 年 基金份额 数量			
年初	-		-			
已申购基金份额	11,001,937.970		170,544,131.280			
已赎回基金份额	(6,978,851.540)		(123,241,848.590)			
年末	4,023,086.430		47,302,282.690			

(1) 于 2020 年 7 月 8 日发行。

14-50 页的附注为财务报表的组成部分。

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金

现金流量表

截至 2020 年 12 月 31 日年度

	2020 年 美元	2019 年 美元
营运活动产生的现金流		
源自经营的归属基金份额持有人的资产净值增加	48,986,957	16,528,439
调整:		
未摊销开办费用调整变动	-	9,023
利息收入	(2,333)	(29,263)
股息收入	(398,148)	(300,510)
汇兑亏损净额	59,330	61,522
分派予基金份额持有人	742,909	540,761
海外预扣税	77,225	52,407
营运资金变动前经营收益	49,465,940	16,862,379
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产(增加)/减少净额	(93,360,383)	19,114,697
衍生金融工具变化净额	(705,511)	(56,236)
应收经纪人款项增加净额	(1,790,303)	(5,643)
经纪存款增加净额	(542,778)	(156,353)
应付经纪人款项增加净额	1,777,168	5,847
其他应付款项增加/(减少)净额	284,941	(25,495)
营运(使用)/产生的现金	(44,870,926)	35,739,196
已收利息	2,330	29,263
已收股息	264,867	266,054
营运活动(使用)/产生的现金净额	(44,603,729)	36,034,513
融资活动的现金流		
基金份额申购收入	351,864,657	79,661,401
基金份额赎回支出	(301,241,904)	(116,293,388)
已付分派予基金份额持有人	(742,909)	(540,761)
融资活动产生/(使用)的现金净额	49,879,844	(37,172,748)
现金和现金等价物增加/(减少)净额	5,276,115	(1,138,235)
年初现金和现金等价物	1,734,246	2,934,003
现金和现金等价物汇兑亏损净额	(59,330)	(61,522)
年末现金和现金等价物	6,951,031	1,734,246

东方汇理香港组合

财务报表附注

1 一般信息

东方汇理香港组合(“本基金”)为一份额信托基金, 含十个子基金, 是由东方汇理资产管理香港有限公司作为基金管理人与汇丰机构信托服务(亚洲)有限公司作为基金受托人于 2009 年 10 月 21 日签订的信托契约下成立以及经 2009 年 12 月 31 日、2010 年 3 月 1 日、2013 年 5 月 28 日、2013 年 8 月 16 日、2014 年 11 月 10 日、2014 年 12 月 30 日、2015 年 6 月 30 日、2016 年 3 月 10 日、2016 年 5 月 17 日、2016 年 12 月 21 日、2017 年 8 月 1 日、2017 年 12 月 18 日、2018 年 5 月 16 日、2018 年 10 月 8 日、2019 年 12 月 31 日和 2020 年 3 月 17 日签订的补充契据下修订。本基金由香港证券及期货事务监察委员会(“香港证监会”)根据香港证券及期货条例第 104(1)条规定认可, 并受香港证监会颁布的单位信托及互惠基金守则规管。

每个子基金均可发行多种份额类别, 基金管理人亦可以酌情决定在今后为任何子基金发行新份额类别。

每个子基金的资产将与其他子基金的资产分开投资和管理。

截至 2020 年 12 月 31 日, 基金由十个(2019 年为十个)子基金组成。

子基金名称	成立日期
东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金*	2010年1月29日
东方汇理香港组合 - 灵活配置均衡基金*	2010年1月29日
东方汇理香港组合 - 灵活配置增长基金	2010年1月29日
东方汇理香港组合 - 美元货币市场基金*	2010年1月29日
东方汇理香港组合 - 亚太新动力股息基金	2013年7月3日
东方汇理香港组合 - 环球银发动力基金*	2014年11月19日
东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金	2016年12月29日
东方汇理香港组合 - 环球多元主题股票基金*	2018年4月13日
东方汇理香港组合 - 环球教育动力股票基金*	2018年12月3日
东方汇理香港组合 - 2023到期亚洲债券基金*	2020年4月29日

这份财务报表为以上首十个子基金的报表。

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金的投资目标是透过投资于根据破格性创新商业模式设立或全部或部分受惠于破格性创新商业模式的公司的股份, 于长线而言达至超越环球股票市场的表现。

基金管理人的目标, 是藉以不少于其资产净值的 75%作为证券组合, 分散投资于创建新市场(例如透过新产品、服务、解决方案或经销渠道)的公司, 而该等公司是基金管理人认为能够挑战并有机会最终超越现有营业模式的(称为“破格性创新公司”)。这些公司是基于不同的商业模式发展而成, 而非建基于在相关行业中既定和常用的商业模式。基金管理人认为该等破格性创新公司可藉由创新而受惠于上述结构性改变, 并可从不同的经济行业界别识别出来, 例如健康护理、互联网经济、科技、工业、环保、非核心消费品、金融等。破格性创新公司被视为具有革新行业的潜力及重大的社会影响, 可突破其行业的传统经营方式。子基金最多可投资其资产净值的 100%于股票和等同股票的证券(如美国存托证券、环球存托证券)。视乎市场情况, 子基金可将其资产净值最高 20%投资于现金和货币市场工具。

*该基金未获得中国证监会认可, 不可向内地投资者进行销售。

东方汇理香港组合

财务报表附注

1 一般信息 (续)

子基金将有限度地持有以人民币计值的相关投资。

子基金可能投资到衍生金融工具以达致对冲或投资用途。

对于分派类别而言，基金管理人可酌情决定每月/季度支付股息。股息可从子基金的收入和/或资本中支付，或在将子基金的全部或部分费用和开支自子基金的资本中扣除的同时，从总收入中支付股息，以致子基金中用作支付股息的可分派收入增加，在此情况下，子基金实际上是从资本中支付股息。从资本中支付股息或实际上从资本中支付股息，均可导致分派类的每基金份额资产净值立即减少。

2 重要会计政策要点

以下说明编制财务报表所采用的主要会计政策。除非另行说明，这些政策贯彻地应用于所有列报年度。

(a) 编制基础

财务报表依据国际财务报告准则编制。财务报表按照历史成本常规编制，并通过以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和负债(包括衍生金融工具)的重估进行修正。

编制符合国际财务报告准则的财务报表要求采用一些重要的会计估计，同时也要求基金受托人和基金管理人(“管理层”)就子基金采用会计政策的过程中行使其判断力。有关需行及较高判断力或复杂性的内容，或者所采用的假设和估算对于财务报表有重要影响的内容，已在附注 2(1)中予以披露。

在 2020 年 1 月 1 日起生效的准则、对现行准则的修订和诠释

在2020年1月1日起生效的准则、对现行准则的修订和诠释并未对子基金的财务报表产生重大影响。

在 2020 年 1 月 1 日之后生效且未有提前采用的新准则、修订和诠释

一些在2020年1月1日之后开始的年度期间生效的新准则、现行准则的诠释或修订，并未在准备这些财务报表时及早采用。预计这些都不会对子基金的财务报表产生重大影响。

(b) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

(i) 分类

子基金将其对基金、股票、浮动利率债券和国库券的投资归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或负债。购入或发生的交易性金融资产主要是为了在短期内出售或购回。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和负债，指按照子基金的投资策略在公允价值基础上管理和评估其业绩表现的金融资产和负债。子基金的政策是由基金管理人和受托人以公允价值为基础并结合其他相关财务信息，对这些金融资产的信息进行评估。子基金持有的所有资产和负债均以交易为目的或预计在一年内套现。

2 重要会计政策要点 (续)

(b) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

(ii) 确认/销账

常规购买和出售投资在交易日(子基金承诺购买或出售投资的日期)确认。当从投资获得现金流的权利已届满或子基金已将所有权的绝大部分风险和利益转让时，金融资产即予销账。

(iii) 计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和负债最初以公允价值确认。交易成本于产生时列示于综合收益表中作为费用。在最初确认后，所有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产均以公允价值计量。“以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产”类别的公允价值变动中产生的收益或亏损都被列示于其发生年份的综合收益表中。

(iv) 公允价值估计

公允价值指在计量日期，市场参与者之间通过有序交易出售资产所得款项或转移负债所付款项的数额。在活跃市场交易的金融资产(如公开交易的衍生工具和交易证券)的公允价值以报告日市场收盘价为基础。如果最后交易价格不在买卖价差范围之内，管理层将在买卖价差范围内决定最能代表公允价值的数额。

投资基金的估值以其基金管理人确定的最新资产净值为基础。

子基金可不时投资于没有在活跃市场交易的金融工具。此类金融工具的公允价值采用估值技术确定。子基金采用多种计算方法并根据每个报告日当时的市场情况作出假设。

(v) 公允价值级别之间的转移

公允价值级别之间的转移被视为在报告期的开始已经发生。

(vi) 结构化实体

结构性主体指设计成表决权或类似权利并非决定谁控制该实体的决定性因素的实体，比如表决权仅涉及行政事务，而有关活动则是通过合同安排方式决定。结构性主体通常具有以下部分或全部特性和特点：**(i)** 活动受到限制、**(ii)** 狭义和明确的目标，比如通过向投资者转移与结构性主体资产相关的风险和利益向投资者提供投资机会、**(iii)** 在没有次级财务支持的情况下，未有足够的权益资本让结构性主体为其活动提供资金，以及**(iv)** 向投资者提供以多个合同性挂钩工具形式的融资，造成信贷或其他风险(部分)的集中。

相关基金公允价值的变动列示在综合收益表中的“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”项目中。

东方汇理香港组合

财务报表附注

2 重要会计政策要点 (续)

(c) 衍生金融工具

衍生工具被归类为交易性资产。公允价值变动在综合收益表中确认。

衍生工具最初按衍生工具合约签署日期的公允价值确认，之后按公允价值重新计量。公允价值从活跃市场中的报价（包括近期的市场交易）以及通过估值技术（如情况合适）取得。当公允价值为正数时，所有衍生工具均作为资产，当公允价值为负数时，所有衍生工具均作为负债。

(d) 金融工具抵销

当子基金目前拥有合法执行权利来抵销确认的数额时以及有意进行净额结算或同时进行资产赎回和债务清偿，金融资产和债务将进行抵销，并将净额于财务状况表内呈报。

(e) 应收经纪以及应付经纪款项

应收经纪以及应付经纪款项分别指已经订立合约但在财务状况表报告日尚未结算或交付的售出投资和购入证券的应收款和应付款。

(f) 现金和现金等价物

现金和现金等价物包括库存现金，以及到期日为三个月或以下之银行通知存款。

(g) 向基金份额持有人的收益分派

向基金份额持有人的拟议收益分派在获得适当授权，及不再由子基金酌情决定后予以确认。对于东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金，向基金份额持有人的收益分派可从这些子基金的收入、资本利得和/或资本或总收入中支付，并在综合收益表中确认为融资成本。

(h) 收入和费用

股息收入于除息日确认，相应的外国预扣税款记为费用。

其他收入包括其他资本收入，其他投资收入和杂项收入，并在确立收取款项的权利时予以确认。

利息收入采用实际利率法按照时间比例确认。其中包括现金和现金等价物的利息收入。

所有费用按照应计制原则处理。

(i) 基金份额

子基金发行基金份额，可根据基金份额持有人的选择而赎回。

每个子基金的资产净值按日计算。申购和赎回价格是根据相关交易日的营业时间结束时的资产净值计算。子基金每基金份额资产净值的计算方法为，归属于每个类别基金份额持有人的资产净值除以该类别已发行基金份额的总数。

东方汇理香港组合

财务报表附注

2 重要会计政策要点 (续)

(i) 基金份额 (续)

发行基金份额所得款项和赎回基金份额所付款项，作为变动项目列示在东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金的归属基金份额持有人资产净值变动表中。

国际会计准则第32号(修改版)「金融工具：呈报」要求，不符合金融负债定义的基金份额如满足某些严格的标准须被归类为权益。

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金发行多于一种附有不同等权利类别的基金份额。因此，基金份额按照修改后的国际会计准则第32号被归类为金融负债。

如果基金份额的条款或条件发生改变，导致其符合修订后的国际会计准则第32号中的严格标准，这些基金份额将从其开始满足标准之日起被重新归类为权益。这些权益证券将按重新归类日金融负债的结存价值进行计量。

在基金份额持有人行使权利将基金份额回售给子基金的情况下，于报告日基金份额的结存额以应付的赎回金额入账。

(j) 外汇汇兑

(i) 功能货币和呈列货币

财务报表中的项目采用子基金在主要经济环境下运营的货币(“功能货币”)计量。

子基金的业绩表现以美元计量并向基金份额持有人报告。基金受托人和基金管理人认为美元是最能真实表达子基金下的交易、事件和情况对相关经济影响的货币。财务报表以美元呈报，而美元为这些子基金的功能货币和呈列货币。

(ii) 交易和结余

外汇交易以交易当日现行汇率换算为功能货币。外汇资产和负债以年终当日的现行汇率换算为功能货币。

换算中发生的汇兑收益和亏损计入综合收益表。

与现金和现金等价物相关的汇兑收益和亏损列示在综合收益表的“汇兑收益/(亏损)净额”项目中。

与以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产相关的汇兑收益和亏损列示于综合收益表的“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)”项目中。

(k) 关联方

如果一方有能力直接或间接控制另一方，或在财务或经营决策上有能力对另一方行使重要影响，则各方被视为关联方。如果各方都受到共同的控制或共同的重要影响，则其也被视为关联方。关联方可以是个人或法人实体。关联方交易详细情况披露于附注 11。

东方汇理香港组合

财务报表附注

2 重要会计政策要点 (续)

(1) 重要判断

管理层就未来做出估计和假设。在这前提下，相对此作出的会计估计很少会与相关实际结果完全相符。有较大风险会造成资产和负债账面价值重大调整的估计和假设概述如下。

衍生金融工具的公允价值

子基金可能不时持有在活跃市场中没有报价的金融工具，例如场外衍生工具。子基金对远期外汇合约的投资的公平值以经纪的报价作依据，并由管理人参考其内部估值模型作评估。

3 管理费

基金管理人有权每月从子基金获得管理费，最高为资产净值的年率 2.5%，在按日应计基础上计算。

就基金管理人委托的管理工作，基金管理人将向副投资经理人支付管理费。

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金

针对普通类、普通 M 类、机构 I 类和机构 II 类基金份额，基金管理人分别按子基金资产净值的 1.65%，1.65%，0.9%和 0.6%收取管理费，对于机构 III 类基金份额则酌情收取。管理费由子基金每月月底支付。

4 受托人费用、基金登记机构费用和估值费用

(a) 受托人费用

受托人 - 汇丰机构信托服务(亚洲)有限公司有权每月从子基金获得受托人费用，最高为资产净值的年率 1%，在每个估值日计算和应计。

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金

受托人可收取资产净值的年率 0.11%或最少每年 40,000 美元作为受托人费用。

(b) 基金登记机构费用

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金

基金登记机构 - 汇丰机构信托服务(亚洲)有限公司有权取得每年 4,000 美元的基金登记机构费用，以维护首 30 个基金份额持有人的单位持有人名册，之后每个额外持有人每年收费 100 美元。基金登记机构有权对于每次申购，赎回和转让分别收取 20 美元，对于每次收益和股息分配，基金登记机构就每位投资人分别收取 5 美元的基金登记机构费用。该费用由子基金每月月底支付。

(c) 估值费用

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金

如果基金份额类别为 8 个或以下，受托人 - 汇丰机构信托服务(亚洲)有限公司有权就每个日估值按每个基金份额类别获得 50 美元的估值费用。如果基金份额类别超过 8 个，受托人有权就每个对冲类别收取 30 美元，及就每个非对冲类别收取 20 美元。费用由子基金每月月底支付。

东方汇理香港组合

财务报表附注

5 赎回费用

根据“基金说明书”条款，基金管理人可收取赎回款最高 2% 的赎回费。赎回费将从应付赎回基金份额持有人的金额中扣除，并保留于或支付给相关子基金或基金管理人。

基金管理人免除了截至 2020 和 2019 年 12 月 31 日年度内子基金的赎回收费。

6 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

	<u>东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金</u>	
	2020 年 美元	2019 年 美元
<u>上市/挂牌投资</u>		
股票	134,273,526	40,913,143
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	134,273,526	40,913,143
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产成本总计	106,940,563	37,802,624

7 衍生金融工具

年末的未结算远期外汇合约如下：

待交付合约	交换对象	结算日	未实现 收益/(亏损) 美元
于 2020 年 12 月 31 日			
持仓合约：			
澳元 1,542,746	美元 1,160,890	2021 年 1 月 29 日	(29,927)
澳元 1,359,175	美元 1,035,154	2021 年 1 月 29 日	(13,968)
澳元 1,020,236	美元 775,249	2021 年 1 月 29 日	(12,251)
澳元 781,847	美元 593,108	2021 年 1 月 29 日	(10,385)
澳元 33,696	美元 27,012	2021 年 1 月 29 日	(541)
澳元 55,494	美元 42,656	2021 年 1 月 29 日	(178)
加元 84,874	美元 66,032	2021 年 1 月 29 日	(595)
加元 679	美元 528	2021 年 1 月 29 日	(5)
离岸人民币 5,587,786	美元 852,357	2021 年 1 月 29 日	(6,189)
离岸人民币 4,186,561	美元 638,614	2021 年 1 月 29 日	(4,639)
离岸人民币 2,436,153	美元 372,160	2021 年 1 月 29 日	(2,147)
离岸人民币 2,206,479	美元 337,922	2021 年 1 月 29 日	(1,097)
离岸人民币 849,114	美元 129,715	2021 年 1 月 29 日	(748)
离岸人民币 222,430	美元 34,065	2021 年 1 月 29 日	(111)
离岸人民币 35,140	美元 5,365	2021 年 1 月 29 日	(35)

东方汇理香港组合

财务报表附注

7 衍生金融工具 (续)

年末的未结算远期外汇合约如下:

待交付合约	交换对象	结算日	未实现 收益/(亏损) 美元
于 2020 年 12 月 31 日 (续)			
持仓合约:			
欧元 47,429	美元 57,981	2021 年 1 月 29 日	(90)
英镑 37,486	美元 50,579	2021 年 1 月 29 日	(673)
美元 3,160	澳元 4,111	2021 年 1 月 29 日	13
美元 2,223	澳元 2,925	2021 年 1 月 29 日	35
美元 9,847	澳元 13,014	2021 年 1 月 29 日	198
美元 8,391	澳元 11,150	2021 年 1 月 29 日	216
美元 243,831	澳元 321,390	2021 年 1 月 29 日	4,244
美元 15,665,253	澳元 20,753,710	2021 年 1 月 29 日	354,141
美元 2,442,821	加元 3,148,627	2021 年 1 月 29 日	28,897
美元 149	离岸人民币 975	2021 年 1 月 29 日	1
美元 149	离岸人民币 975	2021 年 1 月 29 日	1
美元 39,604	离岸人民币 258,000	2021 年 1 月 29 日	37
美元 8,351	离岸人民币 54,696	2021 年 1 月 29 日	53
美元 47,375	离岸人民币 309,548	2021 年 1 月 29 日	186
美元 50,771	离岸人民币 332,321	2021 年 1 月 29 日	289
美元 350,356	离岸人民币 2,282,381	2021 年 1 月 29 日	325
美元 84,693	离岸人民币 554,718	2021 年 1 月 29 日	538
美元 210,311	离岸人民币 1,374,172	2021 年 1 月 29 日	826
美元 964,012	离岸人民币 6,320,356	2021 年 1 月 29 日	7,091
美元 5,876,835	离岸人民币 38,530,301	2021 年 1 月 29 日	43,227
美元 9,550,844	离岸人民币 62,618,208	2021 年 1 月 29 日	70,252
美元 3,009,510	欧元 2,466,947	2021 年 1 月 29 日	10,961
美元 9,176	英镑 6,781	2021 年 1 月 29 日	95
美元 7,647	英镑 5,645	2021 年 1 月 29 日	71
美元 47,901	英镑 35,935	2021 年 1 月 29 日	1,231
美元 4,742,578	英镑 3,537,292	2021 年 1 月 29 日	93,784
美元 557	英镑 414	2021 年 1 月 29 日	9
美元 14,181	新西兰元 20,000	2021 年 1 月 29 日	222
美元 1,499,747	新西兰元 2,126,742	2021 年 1 月 29 日	31,778
美元 1,562,268	加元 2,000,000	2021 年 3 月 12 日	7,894
港元 35,000,000	美元 4,515,383	2021 年 3 月 12 日	598
美元 2,821,830	瑞士法郎 2,500,000	2021 年 3 月 12 日	12,200
美元 3,036,250	欧元 2,500,000	2021 年 3 月 12 日	27,390
美元 4,015,659	英镑 3,000,000	2021 年 3 月 12 日	86,967
美元 2,308,136	日元 240,000,000	2021 年 3 月 12 日	18,193
			718,384

东方汇理香港组合

财务报表附注

7 衍生金融工具 (续)

年底的期货合约如下：

待交付合约	交换对象	结算日	未实现 收益/(亏损) 美元
于 2020 年 12 月 31 日			
持仓合约：			
TOPIX INDEX FUTURES (东证股价指数期货)	日元 140,920,000	2021 年 3 月 11 日	33,319
TOPIX INDEX FUTURES (东证股价指数期货)	日元 159,345,000	2021 年 3 月 11 日	29,638
E-MINI 罗素 2000	美元 1,469,888	2021 年 3 月 19 日	11,213
纳斯达克 100 股票指数	美元 1,259,510	2021 年 3 月 19 日	29,040
纳斯达克 100 股票指数	美元 251,883	2021 年 3 月 19 日	5,827
			109,037
			827,421

于 2019 年 12 月 31 日

持仓合约：			
加元 619,231	美元 470,261	2020 年 1 月 31 日	(7,341)
新西兰元 40,629	美元 26,937	2020 年 1 月 31 日	(486)
美元 1,180	澳元 1,686	2020 年 1 月 31 日	6
美元 2,216,023	澳元 3,209,246	2020 年 1 月 31 日	41,592
美元 627,686	加元 824,125	2020 年 1 月 31 日	7,947
美元 7,408	加元 9,750	2020 年 1 月 31 日	112
美元 9,521	加元 12,521	2020 年 1 月 31 日	137
美元 30,306	离岸人民币 212,609	2020 年 1 月 31 日	201
美元 126	离岸人民币 886	2020 年 1 月 31 日	1
美元 190	离岸人民币 1,326	2020 年 1 月 31 日	1
美元 4,445,827	离岸人民币 31,160,357	2020 年 1 月 31 日	25,340
美元 525,532	欧元 471,363	2020 年 1 月 31 日	4,564
美元 13,058	英镑 9,950	2020 年 1 月 31 日	135
美元 306,019	英镑 234,702	2020 年 1 月 31 日	5,173
美元 144,875	新西兰元 219,116	2020 年 1 月 31 日	3,015
美元 755,764	加元 1,000,000	2020 年 3 月 13 日	15,593
美元 511,513	瑞士法郎 500,000	2020 年 3 月 13 日	7,442
美元 1,116,236	欧元 1,000,000	2020 年 3 月 13 日	11,279
美元 2,634,805	英镑 2,000,000	2020 年 3 月 13 日	19,901
			134,612

东方汇理香港组合

财务报表附注

7 衍生金融工具 (续)

年底的期货合约如下：

待交付合约	交换对象	结算日	未实现 收益/(亏损) 美元
于 2019 年 12 月 31 日			
持仓合约：			
欧元斯托克 50	欧元 675,360	2020 年 3 月 20 日	(4,647)
STOXX 50 PRICE EUR			
E-MINI 罗素 2000	美元 248,415	2020 年 3 月 20 日	(2,175)
纳斯达克 100 股票指数	美元 344,210	2020 年 3 月 20 日	(5,880)
			(12,702)
			121,910

8 其他应付款

	东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金	
	2020 年 美元	2019 年 美元
应付管理费	204,799	63,141
应付受托人费用	13,703	4,239
应付核数师费用	4,165	2,911
其他	151,994	19,429
合计	374,661	89,720

东方汇理香港组合

财务报表附注

9 已发行基金份额数量及归属基金份额持有人净资产

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金

	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	
	2020 年 基金份额 数量	2019 年 基金份额 数量	2020 年 基金份额 数量	2019 年 基金份额 数量	2020 年 基金份额 数量	2019 年 基金份额 数量	2020 年 基金份额 数量	2019 年 基金份额 数量
年初	19,576.096	621,663.894	630,718.740	1,631,408.760	968,472.958	1,349,322.534	7,367,524.857	11,098,389.321
已申购基金份额	9,610.000	-	594,420.755	148,002.555	10,261,326.789	3,764,234.892	36,741,334.656	16,373,536.507
已赎回基金份额	(4,391.000)	(602,087.798)	(814,673.597)	(1,148,692.575)	(7,303,552.111)	(4,145,084.468)	(31,701,656.810)	(20,104,400.971)
年末	<u>24,795.096</u>	<u>19,576.096</u>	<u>410,465.898</u>	<u>630,718.740</u>	<u>3,926,247.636</u>	<u>968,472.958</u>	<u>12,407,202.703</u>	<u>7,367,524.857</u>
	美元	美元	美元	美元	美元	美元	美元	美元
归属基金份额持有人 资产净值(市场价 值)(附注 13)	644,894	316,912	10,112,787	9,831,237	73,677,736	11,618,315	29,831,317	11,320,221
每基金份额归属基金 份额持有人资产净值 (美元)	<u>26.00</u>	<u>16.18</u>	<u>24.63</u>	<u>15.58</u>	<u>18.76</u>	<u>11.99</u>	<u>2.40</u>	<u>1.53</u>
	美元	美元	美元	美元	美元	美元	港元	港元
每基金份额归属基金 份额持有人资产净值 (类别货币)	<u>26.00</u>	<u>16.18</u>	<u>24.63</u>	<u>15.58</u>	<u>18.76</u>	<u>11.99</u>	<u>18.64</u>	<u>11.97</u>

东方汇理香港组合

财务报表附注

9 已发行基金份额数量及归属基金份额持有人净资产 (续)

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金 (续)

	普通人民币分派		普通澳元 (对冲)分派		普通新西兰元 (对冲)分派		普通人民币 (对冲)分派	
	2020 年 基金份额 数量	2019 年 基金份额 数量	2020 年 基金份额 数量	2019 年 基金份额 数量	2020 年 基金份额 数量	2019 年 基金份额 数量	2020 年 基金份额 数量	2019 年 基金份额 数量
年初	196,483.301	221,920.025	273,160.850	758,414.309	13,996.335	147.102	2,668,206.141	4,253,200.769
已申购基金份额	233,673.607	70,337.477	6,453,927.383	849,148.463	355,616.250	49,899.980	6,466,692.307	1,824,349.059
已赎回基金份额	(264,800.387)	(95,774.201)	(5,727,144.205)	(1,334,401.922)	(246,665.610)	(36,050.747)	(7,223,356.697)	(3,409,343.687)
	<u>196,483.301</u>	<u>221,920.025</u>	<u>273,160.850</u>	<u>758,414.309</u>	<u>13,996.335</u>	<u>147.102</u>	<u>2,668,206.141</u>	<u>4,253,200.769</u>
年末	<u>165,356.521</u>	<u>196,483.301</u>	<u>999,944.028</u>	<u>273,160.850</u>	<u>122,946.975</u>	<u>13,996.335</u>	<u>1,911,541.751</u>	<u>2,668,206.141</u>
	美元	美元	美元	美元	美元	美元	美元	美元
归属基金份额持有人 资产净值(市场价 值)(附注 13)	455,062	345,537	14,003,742	2,284,177	1,743,433	122,145	5,419,362	4,563,150
每基金份额归属基金 份额持有人资产净值 (美元)	<u>2.75</u>	<u>1.75</u>	<u>14.00</u>	<u>8.36</u>	<u>14.18</u>	<u>8.72</u>	<u>2.83</u>	<u>1.71</u>
	离岸人民币	离岸人民币	澳元	澳元	新西兰元	新西兰元	离岸人民币	离岸人民币
每基金份额归属基金 份额持有人资产净值 (类别货币)	<u>17.87</u>	<u>12.24</u>	<u>18.14</u>	<u>11.89</u>	<u>19.69</u>	<u>12.93</u>	<u>18.41</u>	<u>11.91</u>

东方汇理香港组合

财务报表附注

9 已发行基金份额数量及归属基金份额持有人净资产 (续)

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金 (续)

	普通加元(对冲)分派		普通欧元 (对冲)分派		普通英镑 (对冲)分派	
	2020 年 基金份额 数量	2019 年 基金份额 数量	2020 年 基金份额 数量	2019 年 基金份额 数量	2020 年 基金份额 数量	2019 年 基金份额 数量
年初	13,293.975	34,102.520	45,731.038	85.547	24,927.135	309.133
已申购基金份额	825,479.101	74,581.116	201,957.816	65,904.477	842,827.872	76,467.509
已赎回基金份额	(700,991.919)	(95,389.661)	(100,140.283)	(20,258.986)	(645,951.536)	(51,849.507)
年末	<u>137,781.157</u>	<u>13,293.975</u>	<u>147,548.571</u>	<u>45,731.038</u>	<u>221,803.471</u>	<u>24,927.135</u>
	美元	美元	美元	美元	美元	美元
归属基金份额持有人 资产净值(市场价 值)(附注 13)	2,882,229	176,525	2,987,280	534,993	4,984,972	353,591
每基金份额归属基金 份额持有人资产净值 (美元)	<u>20.91</u>	<u>13.27</u>	<u>20.24</u>	<u>11.69</u>	<u>22.47</u>	<u>14.18</u>
	加元	加元	欧元	欧元	英镑	英镑
每基金份额归属基金 份额持有人资产净值 (类别货币)	<u>26.65</u>	<u>17.21</u>	<u>16.54</u>	<u>10.42</u>	<u>16.44</u>	<u>10.70</u>

东方汇理香港组合

财务报表附注

9 已发行基金份额数量及归属基金份额持有人净资产 (续)

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金 (续)

	M 人民币(对冲) 分派 2020 年 基金份额 数量	M 人民币(对冲) 累算 2020 年 基金份额 数量
年初	-	-
已申购基金份额	11,001,937.970	170,544,131.280
已赎回基金份额	(6,978,851.540)	(123,241,848.590)
年末	<u>4,023,086.430</u>	<u>47,302,282.690</u>
	美元	美元
归属基金份额持有人 资产净值(市场价 值)(附注 13)	812,961	9,637,257
每基金份额归属基金 份额持有人资产净值 (美元)	<u>0.20</u>	<u>0.20</u>
	离岸人民币	离岸人民币
每基金份额归属基金 份额持有人资产净值 (类别货币)	<u>1.3128</u>	<u>1.3236</u>

东方汇理香港组合

财务报表附注

10 税项

(a) 香港

由于基金已根据香港证券和期货条例第 104 节获认可的集合投资计划，因此免于香港税务条例第 26A(1A)节下的利得税，故此未对基金的香港利得税作出拨备。

(b) 中国

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金投资于中华人民共和国（“中国”）企业在海外证券交易所上市的股票，包括在香港联交所上市的 H 股（“H 股”）。根据中国企业所得税法，子基金可能须就 H 股交易中实现的资本收益，支付中国税项。但是本财务报表未有针对上述资本收益产生的税项作出拨备，因为基金管理人认为，根据现有税务规定，子基金可以维持不作出税务申报的状态，并相信中国执行资本增值税的可能性不大。

(c) 澳大利亚

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金投资于在澳大利亚证券交易所上市的证券。在放售澳大利亚投资所产生的收益可能须支付 30% 的澳大利亚税款。在 2012 年 9 月，澳大利亚政府立法豁免于 2011 年 6 月 30 日或之前外国基金获取收益的税负，前提是要符合一定的所有权条件和其他规定。在 2015 年 6 月，澳大利亚政府进一步立法（“法律”），豁免于 2011 年 7 月 1 日或之后外国基金获取收益的税负，前提是要符合一定的所有权条件和其他规定。

至 2020 年 12 月 31 日，基金管理人认为，截至本财务报表批准日止，就各子基金所投资的澳大利亚投资被收取资本增值税的可能性不大。基金管理人认为，子基金应能满足“法律”下的规定，并应符合资格获免除税负。截至 2020 和 2019 年 12 月 31 日，没有就上述税项相应地做出拨备。此评估是基金管理人可作出的最佳估计。

(d) 预扣税款

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金在某些国家赚取的股息和利息收入被征收预扣税款。此等收入在综合收益表中显示为包含预扣税款的总额。

11 与基金管理人以及他们的关联方和受托人及其关联方的交易

除了财务报表其他地方披露的情况外，于年度内子基金、基金管理人及其关连人士，与受托人及其关联方之间进行的交易摘录如下。基金管理人的关连人士定义见香港证券及期货事务监察委员会颁布的单位信托及互惠基金守则。所有此等交易均在日常业务过程中按正常商业条款订立。

(a) 子基金基金份额的申购和赎回

截至 2020 和 2019 年 12 月 31 日止年度，基金管理人或基金管理人的董事或关连人士没有对子基金的基金份额进行申购和赎回。

东方汇理香港组合

财务报表附注

11 与基金管理人以及他们的关联方和受托人及其关联方的交易 (续)

(b) 管理费

基金管理人向子基金收取了管理费。在年度内，子基金支付的管理费如下：

	2020 美元	2019 美元
东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金	1,430,672	840,725

于 2020 和 2019 年 12 月 31 日的应付基金管理费详见附注 8。

(c) 受托人费用

受托人向子基金收取了受托人费用。在年度内，子基金支付的受托人费用如下：

	2020 美元	2019 美元
东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金	95,772	57,067

于 2020 和 2019 年 12 月 31 日的应付受托人费用详见附注 8。

受托人还有权报销涉及子基金的自付费用。请参见附注 11(g)。

(d) 基金登记机构费用

基金登记机构向子基金收取了基金登记机构费用。在年度内，子基金支付的基金登记机构费用如下：

	2020 美元	2019 美元
东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金	88,145	30,375

(e) 估值费用

受托人向子基金收取了估值费用。在年度内，子基金支付的估值费用如下：

	2020 美元	2019 美元
东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金	134,780	126,541

东方汇理香港组合

财务报表附注

11 与基金管理人以及他们的关联方和受托人及其关联方的交易 (续)

(f) 银行和次保管人费用

保管银行 - 香港上海汇丰银行有限公司向子基金收取了银行和次保管人费用。在年度内，子基金支付的银行和次保管人费用如下：

	2020 美元	2019 美元
东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金	9,509	5,522

(g) 自付报销费用

受托人向子基金收取了自付报销费用。在年度内，子基金支付的自付报销费用如下：

	2020 美元	2019 美元
东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金	57,638	86,328

自付报销费用已包含於综合收益表中的其他经营费用内。

(h) 交易手续费

受托人就投资的买卖向子基金收取了交易手续费。在年度内，子基金支付的交易手续费如下：

	2020 美元	2019 美元
东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金	81,135	58,350

交易手续费已包含於综合收益表中的其他经营费用内。

(i) 其他服务费

受托人就美国海外账户税收遵从法（“FATCA”）向子基金收取了其他服务费。在年度内，子基金支付的其他服务费如下：

	2020 美元	2019 美元
东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金	4,747	1,988

其他服务费已包含於综合收益表中的其他经营费用内。

东方汇理香港组合

财务报表附注

11 与基金管理人以及他们的关联方和受托人及其关联方 (续)

(j) 银行存款利息

在年度内，子基金从保管银行 - 香港上海汇丰银行有限公司取得的银行利息收入如下：

	2020 美元	2019 美元
东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金	2,231	28,714

截至 2020 和 2019 年 12 月 31 日止年度，银行利息收入已包含於综合收益表中的利息收入内。东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金的利息收入包括银行存款和经纪存款的利息收入。

截至 2020 和 2019 年 12 月 31 日年度，保管银行 - 香港上海汇丰银行有限公司没有对子基金收取银行利息。

银行利息已包含於综合收益表中的其他经营费用内。

(k) 现金及现金等价物

截至年末子基金在保管银行 - 香港上海汇丰银行有限公司的存款余额如下：

	2020 年 美元	2019 年 美元
东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金	6,951,031	1,734,246

(l) 与基金管理人关联人的投资交易

(i) 与法国东方汇理银行的交易

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金在 2020 和 2019 年度中并未与法国东方汇理银行进行了各投资购买和出售交易。

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金其与法国东方汇理银行进行的衍生金融工具交易的金额如下：

	与法国东方 汇理银行交 易的价值 美元	占子基金 总交易值的 百分比 %	已支付佣金 美元	子基金平均 佣金率 %
截至 2020 年 12 月 31 日年度	-	-	-	-
截至 2019 年 12 月 31 日年度	1,063,392	0.42	-	-

(m) 持有基金管理人关联人的股份

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金在 2020 和 2019 年度中并未持有基金管理人控股公司 - 法国农业信贷银行的股份。

东方汇理香港组合

财务报表附注

11 与基金管理人以及他们的关联方和受托人及其关联方的交易 (续)

(n) 持有受托人关联公司的投资交易

与香港上海汇丰银行有限公司的交易 (“汇丰”)

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金于本年度与有受托人控股公司 - 汇丰的股份进行投资购买和出售交易。而截至 2020 和 2019 年 12 月 31 日年度，其与汇丰进行的各投资交易的金额如下：

	与汇丰交易的价值 美元	占子基金 总交易值的 百分比 %	已支付佣金 美元	子基金平均 佣金率 %
截至 2020 年 12 月 31 日年度	1,270,779	0.33	396	0.03
截至 2019 年 12 月 31 日年度	914,163	0.51	218	0.02

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金于本年度与有受托人控股公司 - 汇丰的股份进行衍生金融工具购买和出售交易。而截至 2020 和 2019 年 12 月 31 日年度，其与汇丰进行的各投资交易的金额如下：

	与汇丰交易的价值 美元	占子基金 总交易值的 百分比 %	已支付佣金 美元	子基金平均 佣金率 %
截至 2020 年 12 月 31 日年度	933,753,987	96.26	-	-
截至 2019 年 12 月 31 日年度	237,201,649	91.03	-	-

(o) 持有受托人关联公司的股份

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金在 2020 和 2019 年度中并未持有汇丰的股份。

东方汇理香港组合 - 创新动力股息基金在 2020 和 2019 年度中并未持有汇丰的债券。

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金在 2020 和 2019 年度中并未持有受托人附属公司 - 恒生银行有限公司的股份。

(p) 投资于受托人关联公司

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金在 2020 和 2019 年度中并未持有受托人联营公司 - 交通银行股份有限公司的债券。

东方汇理香港组合

财务报表附注

12 财务风险管理

(a) 投资策略

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金

子基金最高可将其资产净值的 100% 投资于全球各地股票。根据市场情况，也可投资于现金和货币市场工具，比例可达资产额的 20%。

于 2020 和 2019 年 12 月 31 日，整体市场投资比率如下

投资类型	2020 年		2019 年	
	美元	资产净值的%	美元	资产净值的%
股票	134,273,526	85.42	40,913,143	98.66
衍生金融工具	827,421	0.53	121,910	0.30
合计	135,100,947	85.95	41,035,053	98.96

因其对权益和货币市场工具(包括现金)的投资而使该子基金面临的风险包括(但不一定限于)市场风险(货币风险、利率风险、价格风险)、信用和对手风险以及流动性风险。

(b) 市场价格风险

市场风险包含亏损及盈利的可能性，当中包括货币风险、利率风险和价格风险。

子基金的市场价格风险通过分散投资组合进行控制。子基金的整体市场状况由基金管理人进行定期监控。

关于整体市场投资比率，请参见附注 12(a)。

下表归纳了东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金的参考指数的合理可能增加或减少的影响。

所有的变动既可能是正面的，也可能是负面的，并影响东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金的归属基金份额持有人的资产净值。

	2020 年	
	市场指数 变动%(+/-)	影响(+/-) 美元
东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金 (i)	18.76	29,489,413
	2019 年	
	市场指数 变动%(+/-)	影响(+/-) 美元
东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金 (i)	19.89	8,161,257

- (i) 东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金以特定主题进行管理，并没有正式基准。为了符合国际财务报告准则第 7 号 - 金融工具：披露规定的市场价格风险披露要求，参考市场指数为 100% MSCI 世界 NR Close。

东方汇理香港组合

财务报表附注

12 财务风险管理 (续)

(c) 利率风险

利率风险来自现行市场利率水平波动对生息资产和负债的公允价值以及未来现金流的影响。子基金持有固定利息证券，使子基金面临公允价值利率风险。子基金还持有浮动利率债券、现金和现金等价物，使子基金面临现金流利率风险。

现行市场利率水平波动会对子基金现金存款产生影响，因而令子基金面临相关风险。但是，相比子基金的资产净值规模，这风险相对而言并不重大。

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金的金融资产和负债的大部份都不生息。所以，现行市场利率水平波动所产生的风险对子基金影响不大。因此，子基金被视为没有重大利率风险。

(d) 货币风险

下表列出了东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金不同货币的净风险：

	<u>于 2020 年 12 月 31 日</u>		<u>于 2019 年 12 月 31 日</u>	
	美元 货币的	非货币的	美元 货币的	非货币的
澳元	90,546	-	-	-
英镑	82,108	1,793,516	25,700	-
加元	455,709	-	(3,519)	546,686
丹麦克朗	-	2,213,301	-	-
欧元	2,145	10,135,626	106,913	2,320,312
日圆	255,650	6,758,003	-	3,364,692
新西兰元	231,085	-	(486)	-
人民币	409,261	-	-	-

下表概述了由于主要汇率上升/下跌，对子基金的份额持有人应占资产净值的上述影响风险(与美元挂钩的港元除外)，而其他风险则被视为非重大风险。该分析基于假设所有其他变量保持不变的情况下，汇率各自上升/下降的百分比。

	<u>于 2020 年 12 月 31 日</u>		
	变动 +/- %	影响 +/- 美元 货币的	影响 +/- 美元 非货币的
澳元	9.59	8,683	-
英镑	3.12	2,562	55,958
加元	2.08	9,479	-
丹麦克朗	9.37	-	207,386
欧元	8.94	102	906,125
日圆	5.19	13,268	350,740
新西兰元	6.59	15,229	-
人民币	6.68	27,339	-

东方汇理香港组合

财务报表附注

12 财务风险管理 (续)

(d) 货币风险 (续)

于 2019 年 12 月 31 日

	变动 +/- %	影响 +/- 美元 货币的	影响 +/- 美元 非货币的
英镑	3.94	1,013	-
加元	4.98	(175)	27,225
欧元	-2.22	(2,373)	(51,511)
日圆	0.99	-	33,310
新西兰元	0.31	(2)	-

(e) 信用风险

(i) 投资信用风险

信用风险指金融工具对手方不履行其与子基金达成的义务或承诺的风险。

截至年末时最大的信用风险敞口为财务状况表上记录的金融资产的结存金额。

金融资产并无减值，也没有逾期而未减值。

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金

所有衍生金融工具均为未结远期外汇合约，如附注 7 所述。下表列出了这些远期外汇合约的对手方。

	信用评级
于2020年12月31日	
法国巴黎银行	Aa3
法国东方汇理银行	Aa2
香港上海汇丰银行有限公司	Aa1
摩根士丹利	Aa3
高盛集团有限公司	A2
	信用评级
于2019年12月31日	
法国巴黎银行	Aa3
香港上海汇丰银行有限公司	Aa3
摩根士丹利	A3

东方汇理香港组合

财务报表附注

12 财务风险管理 (续)

(e) 信用风险 (续)

(ii) 银行和保管人信用风险

下表为置于银行和保管人的净资产情况：

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金

	金额 美元	信用评级	信用评级来源
于2020年12月31日			
<u>保管人</u>			
汇丰机构信托服务(亚洲)有限公司	134,273,526	Aa1	穆迪
<u>银行</u>			
香港上海汇丰银行有限公司	6,951,031	Aa1	穆迪
<u>经纪人</u>			
高盛集团公司	699,131	A2	穆迪
于2019年12月31日			
<u>保管人</u>			
汇丰机构信托服务(亚洲)有限公司	40,913,413	Aa3	穆迪
<u>银行</u>			
香港上海汇丰银行有限公司	1,734,246	Aa3	穆迪
<u>经纪人</u>			
高盛集团公司	156,353	A1	穆迪

子基金在衡量信用风险和预期信用损失时使用了违约机率，违约风险暴露及违约损失率的模型。在计量预期信用损失时，管理层同时考虑了历史分析和前瞻性信息。于 2020 和 2019 年 12 月 31 日，所有应收经纪款项、应收基金份额持有人款项、应收银行利息、应收股息、应收债券利息、经纪存款及现金和现金等价物交易对手的信用评级为 A2 或以上和所有款项将在短期内到期偿还。考虑到一般情况下交易对手在短期内具有比较强履行义务的能力，管理层认为违约风险暴露的可能性微乎其微。因此，没有任何基于 12 个月的预期信用损失的损失被确认，因为此类减值损失对子基金并不重大。

东方汇理香港组合

财务报表附注

12 财务风险管理 (续)

(f) 投资行业

基金管理人监控与股票投资有关的投资行业风险，各行业股票投资情况如下：

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金

股票投资行业	2020 年		2019 年	
	美元	%	美元	%
非必须消费品	11,809,684	8.80	2,429,094	5.94
金融	4,057,126	3.02	561,456	1.37
保健	30,867,215	22.99	9,480,695	23.17
工业	23,362,117	17.40	7,484,931	18.30
信息技术	56,423,658	42.02	18,010,607	44.02
原材料	-	-	819,678	2.00
房地产	1,793,516	1.34	-	-
电信服务	3,746,908	2.79	2,126,682	5.20
公用事业	2,213,302	1.64	-	-
合计	134,273,526	100.00	40,913,143	100.00

(g) 投资区域

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金

区域配置	2020 年		2019 年	
	美元	%	美元	%
亚洲 (不包括新兴国家)	8,893,411	6.62	3,726,149	9.11
新兴国家	13,606,338	10.13	1,186,208	2.90
欧洲	19,715,784	14.69	2,628,010	6.42
北美	92,057,993	68.56	33,372,776	81.57
合计	134,273,526	100.00	40,913,143	100.00

(h) 流动性风险

流动性风险指子基金在偿还债务,包括赎回申请,或以接近公允价值迅速出售金融资产时面临困难的风险。

子基金面对着基金份额每天现金赎回的风险。为了减轻流动性风险,子基金将其大部分资产投资于在活跃市场上交易并容易出售的投资。

为了保护基金份额持有人的利益,基金管理人有权在书面通知受托人后,酌情决定将任何交易日对子基金份额的赎回数量限制在子基金已发行基金份额总数的 10%。另外,在根据信托契约第 3.3 款规定暂停确定子基金资产净值的时期,基金管理人可暂停基金份额持有人要求赎回基金份额的权力和/或延迟支付赎回款项。

东方汇理香港组合

财务报表附注

12 财务风险管理 (续)

(h) 流动性风险 (续)

下表对各东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金已清偿金融负债净额进行分析，按照财务状况表日期起到合约到期日的所剩时间分为不同相关到期类别。表中的金额为合约未折现现金流。于 12 个月内到期的余额等于其账面余额，因为贴现的影响不显著。

	少于 1 个月 美元	1 - 3 个月 美元	超过 3 个月 美元	合计 美元
于 2020 年 12 月 31 日				
应付经纪款项	1,791,724	-	-	1,791,724
应付基金份额持有人款项	4,234,688	-	-	4,234,688
其他应付款	370,496	-	4,165	374,661
归属基金份额持有人净资产(附注)	157,193,032	-	-	157,193,032
金融负债(不含清偿衍生品总额)	<u>163,589,940</u>	<u>-</u>	<u>4,165</u>	<u>163,594,105</u>
于 2019 年 12 月 31 日				
应付经纪款项	14,556	-	-	14,556
应付基金份额持有人款项	1,436,627	-	-	1,436,627
其他应付款	86,809	-	2,911	89,720
归属基金份额持有人净资产(附注)	41,466,803	-	-	41,466,803
金融负债(不含清偿衍生品总额)	<u>43,004,795</u>	<u>-</u>	<u>2,911</u>	<u>43,007,706</u>

附注：基金份额按照基金份额持有人的选择按通知而赎回。于 2020 年和 2019 年 12 月 31 日，并无个别投资者持有各子基金资产净值的 10% 以上。

东方汇理香港组合

财务报表附注

12 财务风险管理 (续)

(h) 流动性风险 (续)

下表分析了东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金的衍生金融工具净持仓情况，按预计到期日分析而非以合约为基础，这是因为根据子基金的投资策略，此类合约的合约到期日对于了解现金流的时间性来说并非必要。表中所列金额为未贴现现金流。由于贴现的影响并不显著，于 12 个月内到期的余额等于其结存余额。

	少于1个月 美元	合计 美元
于2020年12月31日		
<u>已结算衍生品总额</u>		
流出	(69,412,166)	(69,412,166)
流入	70,130,550	70,130,550
于2019年12月31日		
<u>已结算衍生品总额</u>		
流出	(13,851,091)	(13,851,091)
流入	13,985,703	13,985,703

下表为东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金持有的资产的预期流动性，按预期资产可变现和转换为现金及现金等价物的时间呈列：

	少于 1 个月 美元	1 - 3 个月 美元	超过 3 个月 美元	合计 美元
于2020年12月31日				
资产总计	<u>163,677,684</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>163,677,684</u>
于2019年12月31日				
资产总计	<u>43,028,235</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>43,028,235</u>

于 2020 和 2019 年 12 月 31 日，子基金为流动工具变现和转换为现金及现金等价物的预计不会产生重大的市场影响。

东方汇理香港组合

财务报表附注

12 财务风险管理 (续)

(i) 抵销及并无设有净额结算安排之金额

于 2020 和 2019 年 12 月 31 日，子基金与衍生金融工具的对手方包括法国巴黎银行（“巴黎银行”）、法国东方汇理银行（“东方汇理”）、香港上海汇丰银行有限公司（“汇丰”）、高盛集团公司（“高盛”）和摩根士丹利（“摩根士丹利”）进行净额结算安排。子基金的所有衍生资产及负债均由其衍生交易对手方持有。

下表列出东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金的金融资产及负债，但须受抵销，可强制执行的净额结算安排及类似协议所规限。下表按交易对手列报。

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金

	A	B	C=A-B	D 並無在财务状况表內對 銷之金額		E=C-D
	已确认金融 资产/（负 债）总额 美元	已确认金融 资产/（负 债）总额在 资产负债表 內对销 美元	金融资产/ （负债）在资 产负债表內 之净金额 美元	D(i) 金融 工具 美元	D(ii) 现金 抵押品 美元	净金额 美元
于2020年12月31日						
衍生资产:						
巴黎银行	105,160	-	105,160	-	-	105,160
东方汇理	8,492	-	8,492	-	-	8,492
高盛	109,037	-	109,037	-	-	109,037
汇丰	648,721	-	648,721	(83,579)	-	565,142
摩根士丹利	39,590	-	39,590	-	-	39,590
	<u>911,000</u>	<u>-</u>	<u>911,000</u>	<u>(83,579)</u>	<u>-</u>	<u>827,421</u>
衍生负债:						
汇丰	(83,579)	-	(83,579)	83,579	-	-
	<u>(83,579)</u>	<u>-</u>	<u>(83,579)</u>	<u>83,579</u>	<u>-</u>	<u>-</u>
于2019年12月31日						
衍生资产:						
巴黎银行	38,622	-	38,622	-	-	38,622
汇丰	88,224	-	88,224	(7,827)	-	80,397
摩根士丹利	15,593	-	15,593	-	-	15,593
	<u>142,439</u>	<u>-</u>	<u>142,439</u>	<u>(7,827)</u>	<u>-</u>	<u>134,612</u>
衍生负债:						
高盛	(12,702)	-	(12,702)	-	-	(12,702)
汇丰	(7,827)	-	(7,827)	7,827	-	-
	<u>(20,529)</u>	<u>-</u>	<u>(20,529)</u>	<u>7,827</u>	<u>-</u>	<u>(12,702)</u>

东方汇理香港组合

财务报表附注

12 财务风险管理 (续)

(i) 抵销及并无设有净额结算安排之金额 (续)

上述 D(i)和 D(ii)中的金额涉及可对销的金额，但不符合上述 B 项下的对销金额。这包括(i)可抵销 A 中披露的未在财务状况表中对销的资产(或负债)的金额，以及(ii)已收到和质押的任何金融抵押品(包括现金抵押品)。

(j) 公允价值估计

在活跃市场交易的金融资产和负债(如公开交易的衍生品和交易证券)的公允价值依据年末日期市场收盘价。

活跃市场指其资产或负债有充足的交易频率和规模，从而可以提供不间断的价格信息。

子基金采用能够反映在计量中所用输入数据重要性的公允价值等级，将其金融资产公允价值计量归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益。公允价值等级分为以下各级：

- 1 级：在活跃市场中相同资产或负债的报价(未经调整)
- 2 级：在 1 级报价以外对资产或负债的直接(即价格)或间接(即从价格得出)的可观察数据
- 3 级：并非根据可观察市场数据得出的资产或负债的数据(即不可观察输入数据)

在公允价值等级中，对整个公允价值计量分类的具体级别，是根据对整个公允价值计量具有重要影响的最低级别输入数据予以确定。为此，某个输入数据的重要性会按整个公允价值计量进行评估。如果一个公允价值计量采用需要根据不可观察数据进行大幅调整的可观察数据，该计量即为 3 级计量。

评估某个具体输入数据对整个公允价值计量的重要性需要判断力，并须考虑投资的具体因素。

确定什么是“可观察”需要子基金管理人的高度判断力。子基金管理人认为容易获得、定期发布或更新、可靠和可核实、非私有，并由活跃参与相关市场的独立来源所提供的市场数据是可观察数据。

下表分析在公允价值等级中，东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金于 2020 年和 2019 年 12 月 31 日按公允价值计量的投资：

	1 级 美元	2 级 美元	3 级 美元	合计 美元
于 2020 年 12 月 31 日				
资产				
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产				
- 股票	134,273,526	-	-	134,273,526
- 衍生金融工具	109,037	801,963	-	911,000
	<u>134,382,563</u>	<u>801,963</u>	<u>-</u>	<u>135,184,526</u>
负债				
以公允价值计量且其变动计入当期损益金融负债				
- 衍生金融工具	-	(83,579)	-	(83,579)
	<u>-</u>	<u>(83,579)</u>	<u>-</u>	<u>(83,579)</u>

东方汇理香港组合

财务报表附注

12 财务风险管理 (续)

(j) 公允价值估计 (续)

	1 级 美元	2 级 美元	3 级 美元	合计 美元
于 2019 年 12 月 31 日				
资产				
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产				
- 股票	40,913,143	-	-	40,913,143
- 衍生金融工具	-	142,439	-	142,439
	<u>40,913,143</u>	<u>142,439</u>	<u>-</u>	<u>41,055,582</u>
负债				
以公允价值计量且其变动计入当期损益金融负债				
- 衍生金融工具	(12,702)	(7,827)	-	(20,529)
	<u>(12,702)</u>	<u>(7,827)</u>	<u>-</u>	<u>(20,529)</u>

投资价值以活跃市场报价为依据，因此被归为 1 级，并包括活跃的上市/报价股票。子基金不对此类证券调整报价。

在不视为活跃的市场上交易，但依据市场报价、交易商报价或由可观察输入数据支持的其他报价来源确定价值的金融工具被归为 2 级。由于 2 级投资包括不在活跃市场交易并/或受到转让限制的工具，因此估值可能进行调整以反映低流动性和/或非转让性，这一般依据可以获得的市場信息而定。

相关基金并未在活跃市场中进行交易，因此子基金采用了估值技术来计算其公允价值。其价值主要按相关基金的行政管理人提供的最新基金份额的资产净值计算。子基金可在考虑相关基金的流动性、其相关投资、资产净值的估值日期、对赎回的任何限制及会计基础后对其价值作出调整。

若有需要，子基金会调整相关基金的资产净值以取得公允价值的最佳估值。在综合收益表中，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，其公允价值的其他变化净额包括相关基金的公允价值变动。

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金未持有3级投资。3级投资涉及大量不可观察数据，因为这些投资交易不频繁。

东方汇理香港组合

财务报表附注

13 归属基金份额持有人的资产净值

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金

于2020年和2019年12月31日的财务状况表中，该子基金的归属基金份额持有人的资产净值相当于金融负债。为了确定每基金份额的资产净值以便进行申购和赎回，根据子基金的组成文件和国际财务报告准则第13号的规定，投资资产按照最后交易价格确定价值。

根据子基金组成的文件，建立子基金产生的开办费用将分三年摊销。但是，为了符合国际会计准则第38号 - 无形资产以为报告目的，子基金的会计政策将成了子基金的费用在发生期间的综合收益表中入账。因此，根据东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金组成文件中列明的估值方法，归属基金份额持有人资产净值会按基准调整。于2020年12月31日止，东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金未有任何未摊销开办费用（2019年：无）。这导致对东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金的综合收益表无需进行相应调整（2019年：9,023美元）。

资本管理

子基金的资本即为子基金的基金份额，在财务状况表中显示为归属基金份额持有人的资产净值。东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金截至2020和2019年12月31止年度的基金份额的申购和赎回分别列示在相应的归属基金份额持有人净资产表中。

为达成投资目标，子基金竭力按照附注1的投资政策对其资本进行投资，同时保持足够的流动资金以满足赎回要求。该等流动资金亦透过持有流动性投资而增强。

子基金在管理资本时，目标在于保障子基金能够持续经营，以为基金份额持有人提供回报，并为其其他利益持有者提供利益，以及保持雄厚资本以支持开展子基金的投资活动。

为保持或调整资本架构，子基金执行了以下政策：

- 监控申购和赎回相对于流动资产的水平；并
- 根据子基金信托契约赎回及发行基金份额

基金管理人以归属基金份额持有人应占资产净值的价值为基准监控资本。

东方汇理香港组合

财务报表附注

14 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

	<u>东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金</u>	
	2020 年 美元	2019 年 美元
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产实现 收益净额	22,721,096	6,498,182
衍生金融工具实现收益/(亏损)净额	3,883,946	(74,965)
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产未实 现收益变动净额	24,222,444	11,693,908
衍生金融工具未实现收益净变动净额	705,511	56,236
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	51,532,997	18,173,361

15 非金钱佣金安排

在 2020 和 2019 年 12 月 31 日止年度，基金管理人及经纪人并无签订了非金钱佣金安排从而代表子基金处理子基金的资产。

东方汇理香港组合

财务报表附注

16 分派

东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金在 2020 和 2019 年 12 月 31 日年度进行了如下分派：

	2020	
	类别 货币	美元
普通美元分派		
- 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	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	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	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	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	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	19,637
- 美元 0.01150/基金份额，计 2,597,226.291 基金份额，于除息日 2020 年 7 月 2 日	29,868	29,868
- 美元 0.01205/基金份额，计 2,574,504.476 基金份额，于除息日 2020 年 8 月 3 日	31,023	31,023
- 美元 0.01247/基金份额，计 2,967,594.598 基金份额，于除息日 2020 年 9 月 1 日	37,006	37,006
- 美元 0.01221/基金份额，计 2,610,049.168 基金份额，于除息日 2020 年 10 月 5 日	31,869	31,869
- 美元 0.01354/基金份额，计 2,160,260.004 基金份额，于除息日 2020 年 11 月 2 日	29,250	29,250
- 美元 0.01404/基金份额，计 2,987,099.981 基金份额，于除息日 2020 年 12 月 1 日	41,939	41,939
普通港元分派		
- 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	9,411
- 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	12,245
- 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	11,994
- 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	8,962
- 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	10,576
- 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	11,741
- 港元 0.01141/基金份额，计 9,242,759.383 基金份额，于除息日 2020 年 7 月 2 日	105,460	13,607
- 港元 0.01197/基金份额，计 8,996,417.089 基金份额，于除息日 2020 年 8 月 3 日	107,687	13,894
- 港元 0.01238/基金份额，计 10,027,307.118 基金份额，于除息日 2020 年 9 月 1 日	124,138	16,018
- 港元 0.01212/基金份额，计 10,111,449.120 基金份额，于除息日 2020 年 10 月 5 日	122,551	15,813
- 港元 0.01345/基金份额，计 10,011,260.881 基金份额，于除息日 2020 年 11 月 2 日	134,651	17,372
- 港元 0.01394/基金份额，计 14,599,910.342 基金份额，于除息日 2020 年 12 月 1 日	203,523	26,255
普通人民币分派		
- 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	289
- 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	283
- 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	282
- 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	249
- 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	279
- 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	315
- 离岸人民币 0.01189/基金份额，计 216,700.442 基金份额，于除息日 2020 年 7 月 2 日	2,577	364
- 离岸人民币 0.01237/基金份额，计 253,028.004 基金份额，于除息日 2020 年 8 月 3 日	3,130	448
- 离岸人民币 0.01262/基金份额，计 257,500.731 基金份额，于除息日 2020 年 9 月 1 日	3,250	476
- 离岸人民币 0.01224/基金份额，计 269,535.208 基金份额，于除息日 2020 年 10 月 5 日	3,299	491
- 离岸人民币 0.01324/基金份额，计 269,566.785 基金份额，于除息日 2020 年 11 月 2 日	3,569	533
- 离岸人民币 0.01356/基金份额，计 273,343.008 基金份额，于除息日 2020 年 12 月 1 日	3,707	565

东方汇理香港组合

财务报表附注

16 分派 (续)

	2020	
	类别 货币	美元
普通澳元(对冲)分派		
- 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	10
- 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	343
- 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	2,648
- 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	3,565
- 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	4,845
- 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	4,516
- 澳元 0.01006/基金份额, 计 1,237,600.229 基金份额, 于除息日 2020 年 7 月 2 日	12,450	8,603
- 澳元 0.00986/基金份额, 计 1,258,035.444 基金份额, 于除息日 2020 年 8 月 3 日	12,404	8,810
- 澳元 0.01070/基金份额, 计 1,573,468.611 基金份额, 于除息日 2020 年 9 月 1 日	16,836	12,423
- 澳元 0.01027/基金份额, 计 1,199,131.994 基金份额, 于除息日 2020 年 10 月 5 日	12,315	8,855
- 澳元 0.01157/基金份额, 计 1,155,749.295 基金份额, 于除息日 2020 年 11 月 2 日	13,372	9,415
- 澳元 0.01033/基金份额, 计 1,916,584.215 基金份额, 于除息日 2020 年 12 月 1 日	19,798	14,563
普通新西兰元(对冲)分派		
- 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	39
- 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	36
- 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	45
- 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	64
- 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	75
- 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	970
- 新西兰元 0.01325/基金份额, 计 139,261.118 基金份额, 于除息日 2020 年 7 月 2 日	1,845	1,201
- 新西兰元 0.01261/基金份额, 计 157,482.115 基金份额, 于除息日 2020 年 8 月 3 日	1,986	1,308
- 新西兰元 0.01346/基金份额, 计 46,901.894 基金份额, 于除息日 2020 年 9 月 1 日	631	427
- 新西兰元 0.01314/基金份额, 计 70,268.962 基金份额, 于除息日 2020 年 10 月 5 日	923	614
- 新西兰元 0.01394/基金份额, 计 125,948.458 基金份额, 于除息日 2020 年 11 月 2 日	1,756	1,162
- 新西兰元 0.01424/基金份额, 计 125,361.729 基金份额, 于除息日 2020 年 12 月 1 日	1,785	1,259
普通人民币(对冲)分派		
- 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	8,913
- 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	8,383
- 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	6,431
- 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	3,867
- 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	3,463
- 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	9,250
- 离岸人民币 0.03442/基金份额, 计 2,614,998.789 基金份额, 于除息日 2020 年 7 月 2 日	90,008	12,729
- 离岸人民币 0.03932/基金份额, 计 2,858,728.162 基金份额, 于除息日 2020 年 8 月 3 日	112,405	16,092
- 离岸人民币 0.04680/基金份额, 计 3,102,778.693 基金份额, 于除息日 2020 年 9 月 1 日	145,210	21,263
- 离岸人民币 0.04474/基金份额, 计 2,794,161.525 基金份额, 于除息日 2020 年 10 月 5 日	125,011	18,617
- 离岸人民币 0.05034/基金份额, 计 2,009,831.736 基金份额, 于除息日 2020 年 11 月 2 日	101,175	15,119
- 离岸人民币 0.05624/基金份额, 计 1,941,368.000 基金份额, 于除息日 2020 年 12 月 1 日	109,183	16,645

东方汇理香港组合

财务报表附注

16 分派 (续)

	2020	
	类别 货币	美元
普通加元(对冲)分派		
- 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	98
- 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	841
- 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	771
- 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	578
- 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	444
- 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	1,552
- 加元 0.01694/基金份额, 计 243,299.939 基金份额, 于除息日 2020 年 7 月 2 日	4,122	3,029
- 加元 0.01552/基金份额, 计 162,205.956 基金份额, 于除息日 2020 年 8 月 3 日	2,517	1,875
- 加元 0.01672/基金份额, 计 121,201.866 基金份额, 于除息日 2020 年 9 月 1 日	2,026	1,553
- 加元 0.01586/基金份额, 计 123,525.708 基金份额, 于除息日 2020 年 10 月 5 日	1,959	1,477
- 加元 0.01768/基金份额, 计 80,161.533 基金份额, 于除息日 2020 年 11 月 2 日	1,417	1,068
- 加元 0.01779/基金份额, 计 111,517.492 基金份额, 于除息日 2020 年 12 月 1 日	1,984	1,531
普通英镑(对冲)分派		
- 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	20
- 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	254
- 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	698
- 英镑 0.00740/基金份额, 计 175,772.737 基金份额, 于除息日 2020 年 7 月 2 日	1,301	1,621
- 英镑 0.00738/基金份额, 计 239,446.363 基金份额, 于除息日 2020 年 8 月 3 日	1,767	2,303
- 英镑 0.00866/基金份额, 计 276,590.944 基金份额, 于除息日 2020 年 9 月 1 日	2,395	3,221
- 英镑 0.00830/基金份额, 计 299,776.081 基金份额, 于除息日 2020 年 10 月 5 日	2,488	3,229
- 英镑 0.00960/基金份额, 计 171,250.230 基金份额, 于除息日 2020 年 11 月 2 日	1,644	2,122
- 英镑 0.00959/基金份额, 计 287,220.037 基金份额, 于除息日 2020 年 12 月 1 日	2,754	3,681
普通欧元(对冲)分派		
- 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	9
- 欧元 0.00155/基金份额, 计 30,632.156 基金份额, 于除息日 2020 年 7 月 2 日	47	53
- 欧元 0.00088/基金份额, 计 39,756.735 基金份额, 于除息日 2020 年 8 月 3 日	35	41
- 欧元 0.00185/基金份额, 计 88,599.434 基金份额, 于除息日 2020 年 9 月 1 日	164	196
- 欧元 0.00195/基金份额, 计 97,956.490 基金份额, 于除息日 2020 年 10 月 5 日	191	225
- 欧元 0.00263/基金份额, 计 97,594.399 基金份额, 于除息日 2020 年 11 月 2 日	257	299
- 欧元 0.00218/基金份额, 计 110,715.030 基金份额, 于除息日 2020 年 12 月 1 日	241	290
M 人民币 (对冲)分派		
- 离岸人民币 0.00878/基金份额, 计 5,258,326.760 基金份额, 于除息日 2020 年 10 月 5 日	46,168	6,875
		742,909

该分派在子基金综合收益表中列示为融资成本。

东方汇理香港组合

财务报表附注

16 分派 (续)

	2019	
	类别 货币	美元
普通美元分派		
- 美元 0.02148 / 基金份额, 计 1,349,322.534 基金份额, 于除息日 2019 年 1 月 2 日	28,983	28,983
- 美元 0.01255 / 基金份额, 计 1,401,664.954 基金份额, 于除息日 2019 年 2 月 1 日	17,591	17,591
- 美元 0.01353 / 基金份额, 计 1,885,635.528 基金份额, 于除息日 2019 年 3 月 1 日	25,513	25,513
- 美元 0.01357 / 基金份额, 计 1,553,992.190 基金份额, 于除息日 2019 年 4 月 1 日	21,087	21,087
- 美元 0.01418 / 基金份额, 计 1,259,731.988 基金份额, 于除息日 2019 年 5 月 2 日	17,863	17,863
- 美元 0.01358 / 基金份额, 计 1,350,662.160 基金份额, 于除息日 2019 年 6 月 3 日	18,342	18,342
- 美元 0.01404 / 基金份额, 计 1,095,980.744 基金份额, 于除息日 2019 年 7 月 2 日	15,388	15,388
- 美元 0.01465 / 基金份额, 计 990,475.633 基金份额, 于除息日 2019 年 8 月 1 日	14,510	14,510
- 美元 0.01372 / 基金份额, 计 1,002,542.626 基金份额, 于除息日 2019 年 9 月 2 日	13,755	13,755
- 美元 0.01410 / 基金份额, 计 1,595,147.386 基金份额, 于除息日 2019 年 10 月 2 日	22,492	22,492
- 美元 0.00943 / 基金份额, 计 1,584,137.197 基金份额, 于除息日 2019 年 11 月 1 日	14,938	14,938
- 美元 0.00978 / 基金份额, 计 1,238,182.959 基金份额, 于除息日 2019 年 12 月 2 日	12,109	12,109
普通港元分派		
- 港元 0.02153 / 基金份额, 计 11,098,389.321 基金份额, 于除息日 2019 年 1 月 2 日	238,948	30,503
- 港元 0.01260 / 基金份额, 计 11,900,976.789 基金份额, 于除息日 2019 年 2 月 1 日	149,952	19,110
- 港元 0.01359 / 基金份额, 计 10,029,928.441 基金份额, 于除息日 2019 年 3 月 1 日	136,307	17,368
- 港元 0.01363 / 基金份额, 计 10,083,749.038 基金份额, 于除息日 2019 年 4 月 1 日	137,441	17,509
- 港元 0.01424 / 基金份额, 计 10,416,756.097 基金份额, 于除息日 2019 年 5 月 2 日	148,335	18,912
- 港元 0.01366 / 基金份额, 计 8,674,081.157 基金份额, 于除息日 2019 年 6 月 3 日	118,488	15,122
- 港元 0.01404 / 基金份额, 计 9,080,776.442 基金份额, 于除息日 2019 年 7 月 2 日	127,494	16,343
- 港元 0.01466 / 基金份额, 计 9,694,923.664 基金份额, 于除息日 2019 年 8 月 1 日	142,128	18,158
- 港元 0.01378 / 基金份额, 计 9,135,048.758 基金份额, 于除息日 2019 年 9 月 2 日	125,881	16,052
- 港元 0.01415 / 基金份额, 计 8,863,795.257 基金份额, 于除息日 2019 年 10 月 2 日	125,423	15,993
- 港元 0.00946 / 基金份额, 计 9,157,683.792 基金份额, 于除息日 2019 年 11 月 1 日	86,632	11,055
- 港元 0.00980 / 基金份额, 计 8,613,504.609 基金份额, 于除息日 2019 年 12 月 2 日	84,412	10,782
普通人民币分派		
- 离岸人民币 0.02175 / 基金份额, 计 221,920.025 基金份额, 于除息日 2019 年 1 月 2 日	4,827	702
- 离岸人民币 0.01243 / 基金份额, 计 221,920.025 基金份额, 于除息日 2019 年 2 月 1 日	2,758	409
- 离岸人民币 0.01331 / 基金份额, 计 221,920.025 基金份额, 于除息日 2019 年 3 月 1 日	2,954	440
- 离岸人民币 0.01336 / 基金份额, 计 205,070.515 基金份额, 于除息日 2019 年 4 月 1 日	2,740	408
- 离岸人民币 0.01398 / 基金份额, 计 274,744.337 基金份额, 于除息日 2019 年 5 月 2 日	3,841	569
- 离岸人民币 0.01376 / 基金份额, 计 266,820.778 基金份额, 于除息日 2019 年 6 月 3 日	3,671	530
- 离岸人民币 0.01415 / 基金份额, 计 196,483.301 基金份额, 于除息日 2019 年 7 月 2 日	2,780	404
- 离岸人民币 0.01475 / 基金份额, 计 196,483.301 基金份额, 于除息日 2019 年 8 月 1 日	2,898	419
- 离岸人民币 0.01441 / 基金份额, 计 196,483.301 基金份额, 于除息日 2019 年 9 月 2 日	2,831	395
- 离岸人民币 0.01470 / 基金份额, 计 196,483.301 基金份额, 于除息日 2019 年 10 月 2 日	2,888	404
- 离岸人民币 0.00976 / 基金份额, 计 196,483.301 基金份额, 于除息日 2019 年 11 月 1 日	1,918	272
- 离岸人民币 0.01008 / 基金份额, 计 196,483.301 基金份额, 于除息日 2019 年 12 月 2 日	1,981	281

东方汇理香港组合

财务报表附注

16 分派 (续)

	2019	
	类别 货币	美元
普通澳元(对冲)分派		
- 澳元 0.01706 / 基金份额, 计 758,414.309 基金份额, 于除息日 2019 年 1 月 2 日	12,939	9,056
- 澳元 0.00750 / 基金份额, 计 716,832.554 基金份额, 于除息日 2019 年 2 月 1 日	5,376	3,902
- 澳元 0.00811 / 基金份额, 计 624,638.243 基金份额, 于除息日 2019 年 3 月 1 日	5,066	3,594
- 澳元 0.00782 / 基金份额, 计 510,418.807 基金份额, 于除息日 2019 年 4 月 1 日	3,991	2,842
- 澳元 0.00659 / 基金份额, 计 541,137.283 基金份额, 于除息日 2019 年 5 月 2 日	3,566	2,497
- 澳元 0.00533 / 基金份额, 计 328,678.664 基金份额, 于除息日 2019 年 6 月 3 日	1,752	1,218
- 澳元 0.00400 / 基金份额, 计 300,864.033 基金份额, 于除息日 2019 年 7 月 2 日	1,203	842
- 澳元 0.00230 / 基金份额, 计 237,699.415 基金份额, 于除息日 2019 年 8 月 1 日	547	374
- 澳元 0.00239 / 基金份额, 计 442,864.700 基金份额, 于除息日 2019 年 9 月 2 日	1,058	712
- 澳元 0.00197 / 基金份额, 计 432,932.909 基金份额, 于除息日 2019 年 10 月 2 日	853	571
- 澳元 0.00032 / 基金份额, 计 314,061.868 基金份额, 于除息日 2019 年 12 月 2 日	100	68
普通新西兰元(对冲)分派		
- 新西兰元 0.01611 / 基金份额, 计 147.102 基金份额, 于除息日 2019 年 1 月 2 日	2	2
- 新西兰元 0.00631 / 基金份额, 计 25,856.002 基金份额, 于除息日 2019 年 2 月 1 日	163	113
- 新西兰元 0.00825 / 基金份额, 计 2,764.903 基金份额, 于除息日 2019 年 3 月 1 日	23	16
- 新西兰元 0.00823 / 基金份额, 计 1,799.572 基金份额, 于除息日 2019 年 4 月 1 日	15	10
- 新西兰元 0.00827 / 基金份额, 计 2,468.775 基金份额, 于除息日 2019 年 5 月 2 日	20	14
- 新西兰元 0.00677 / 基金份额, 计 2,718.566 基金份额, 于除息日 2019 年 6 月 3 日	18	12
- 新西兰元 0.00708 / 基金份额, 计 2,839.413 基金份额, 于除息日 2019 年 7 月 2 日	20	13
- 新西兰元 0.00715 / 基金份额, 计 7,035.519 基金份额, 于除息日 2019 年 8 月 1 日	50	33
- 新西兰元 0.00464 / 基金份额, 计 9,583.940 基金份额, 于除息日 2019 年 9 月 2 日	44	28
- 新西兰元 0.00484 / 基金份额, 计 9,583.940 基金份额, 于除息日 2019 年 10 月 2 日	46	29
- 新西兰元 0.00115 / 基金份额, 计 9,583.940 基金份额, 于除息日 2019 年 11 月 1 日	11	7
- 新西兰元 0.00297 / 基金份额, 计 12,728.594 基金份额, 于除息日 2019 年 12 月 2 日	38	25
普通人民币(对冲)分派		
- 离岸人民币 0.02735 / 基金份额, 计 4,253,200.769 基金份额, 于除息日 2019 年 1 月 2 日	116,325	16,913
- 离岸人民币 0.01475 / 基金份额, 计 3,839,432.553 基金份额, 于除息日 2019 年 2 月 1 日	56,632	8,387
- 离岸人民币 0.01129 / 基金份额, 计 3,761,568.227 基金份额, 于除息日 2019 年 3 月 1 日	42,468	6,329
- 离岸人民币 0.01342 / 基金份额, 计 2,526,615.245 基金份额, 于除息日 2019 年 4 月 1 日	33,907	5,049
- 离岸人民币 0.01392 / 基金份额, 计 2,354,217.980 基金份额, 于除息日 2019 年 5 月 2 日	32,771	4,858
- 离岸人民币 0.01661 / 基金份额, 计 2,206,725.424 基金份额, 于除息日 2019 年 6 月 3 日	36,654	5,296
- 离岸人民币 0.01769 / 基金份额, 计 2,173,533.807 基金份额, 于除息日 2019 年 7 月 2 日	38,450	5,592
- 离岸人民币 0.01584 / 基金份额, 计 1,830,569.167 基金份额, 于除息日 2019 年 8 月 1 日	28,996	4,197
- 离岸人民币 0.02371 / 基金份额, 计 1,617,775.804 基金份额, 于除息日 2019 年 9 月 2 日	38,357	5,346
- 离岸人民币 0.02545 / 基金份额, 计 1,544,199.783 基金份额, 于除息日 2019 年 10 月 2 日	39,300	5,496
- 离岸人民币 0.01732 / 基金份额, 计 1,558,481.311 基金份额, 于除息日 2019 年 11 月 1 日	26,993	3,836
- 离岸人民币 0.02125 / 基金份额, 计 2,426,230.120 基金份额, 于除息日 2019 年 12 月 2 日	51,557	7,320

东方汇理香港组合

财务报表附注

16 分派 (续)

	2019	
	类别 货币	美元
普通加元(对冲)分派		
- 加元 0.01338 / 基金份额, 计 34,102.520 基金份额, 于除息日 2019 年 1 月 2 日	456	335
- 加元 0.00428 / 基金份额, 计 44,216.868 基金份额, 于除息日 2019 年 2 月 1 日	189	144
- 加元 0.00905 / 基金份额, 计 130.025 基金份额, 于除息日 2019 年 3 月 1 日	1	1
- 加元 0.00804 / 基金份额, 计 12,189.873 基金份额, 于除息日 2019 年 4 月 1 日	98	73
- 加元 0.00762 / 基金份额, 计 8,339.735 基金份额, 于除息日 2019 年 5 月 2 日	64	47
- 加元 0.00810 / 基金份额, 计 8,339.735 基金份额, 于除息日 2019 年 6 月 3 日	68	50
- 加元 0.00845 / 基金份额, 计 796.878 基金份额, 于除息日 2019 年 7 月 2 日	7	5
- 加元 0.09310 / 基金份额, 计 9,445.514 基金份额, 于除息日 2019 年 8 月 1 日	88	67
- 加元 0.01119 / 基金份额, 计 10,188.169 基金份额, 于除息日 2019 年 9 月 2 日	114	86
- 加元 0.01245 / 基金份额, 计 11,358.637 基金份额, 于除息日 2019 年 10 月 2 日	141	106
- 加元 0.00847 / 基金份额, 计 11,493.601 基金份额, 于除息日 2019 年 11 月 1 日	97	74
- 加元 0.01279 / 基金份额, 计 48,133.199 基金份额, 于除息日 2019 年 12 月 2 日	616	463
普通英镑(对冲)分派		
- 英镑 0.00554 / 基金份额, 计 309.133 基金份额, 于除息日 2019 年 1 月 2 日	2	2
		<u>540,761</u>

该分派在子基金综合收益表中列示为融资成本。

17 后续事项

在 2021 年 1 月 4 日除息日, 东方汇理香港组合 - 创新动力股基金宣布酌情分派, 金额为美元 119,968。截至 2020 年 12 月 31 日止年度的财务报表并没有反映这些分派, 而将列示在截至 2021 年 12 月 31 日止年度的子基金综合收益表中。

18 财务报表批准

财务报表于 2021 年 4 月 29 日由基金受托人和基金管理人批准发布。

东方汇理香港组合

投资组合 - 东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金 (未经审计)
于 2020 年 12 月 31 日

	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)			
股票 (85.42%)			
加拿大 (1.05%)			
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG COM	27,300	1,644,279	1.05
		<u>1,644,279</u>	<u>1.05</u>
		-----	-----
中国 (8.66%)			
杭州泰格医药科技股份有限公司	59,000	1,365,838	0.87
京东集团股份有限公司	15,050	663,812	0.42
京东集团股份有限公司 ADR	29,550	2,597,445	1.65
KE HOLDINGS INC ADR (贝壳)	17,346	1,067,473	0.68
LUFAX HOLDING LTD ADR (陆金所控股有限公司)	79,907	1,134,679	0.72
平安健康医疗科技有限公司	121,200	1,469,309	0.94
好未来教育集团	39,740	2,841,807	1.81
药明生物技术有限公司	186,000	2,465,975	1.57
		<u>13,606,338</u>	<u>8.66</u>
		-----	-----
丹麦 (1.41%)			
ORSTED A/S (沃旭能源)	10,828	2,213,301	1.41
		<u>2,213,301</u>	<u>1.41</u>
		-----	-----
法国 (3.45%)			
SCHNEIDER ELECTRIC SE (施耐德电气)	22,429	3,246,507	2.06
WORLDLINE SA-W/I	22,582	2,185,550	1.39
		<u>5,432,057</u>	<u>3.45</u>
		-----	-----
德国 (1.82%)			
BIONTECH SE ADR(拜恩泰科)	12,454	1,015,250	0.65
TEAMVIEWER AG	34,307	1,839,822	1.17
		<u>2,855,072</u>	<u>1.82</u>
		-----	-----
日本 (4.30%)			
DAIFUKU CO LTD (大福株式会社)	26,300	3,250,404	2.07
NIDEC CORPORATION (日本电产科宝株式会社)	27,900	3,507,599	2.23
		<u>6,758,003</u>	<u>4.30</u>
		-----	-----
荷兰 (3.60%)			
NXP SEMICONDUCTORS (恩智浦半导体)	17,600	2,798,576	1.78
STMICROELECTRONICS N V (意法半导体)	77,296	2,863,747	1.82
		<u>5,662,323</u>	<u>3.60</u>
		-----	-----

东方汇理香港组合

投资组合 - 东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金 (未经审计)
于 2020 年 12 月 31 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 (85.42%)			
台湾 (1.36%)			
SEA LTD	10,728	2,135,408	1.36
		2,135,408	1.36
		-----	-----
英国 (2.26%)			
CLARIVATE ANALYTICS PLC	59,223	1,759,515	1.12
SEGRO PLC REIT	138,461	1,793,516	1.14
		3,553,031	2.26
		-----	-----
美国 (57.51%)			
ADVANCED MICRO DEVICES INC (美国超威半导体公司)	21,921	2,010,375	1.28
ALEXION PHARMACEUTICALS INC (亚力兄制药)	20,545	3,209,951	2.04
AMERICAN WELL CORP-CLASS A	34,961	885,562	0.56
BRISTOL MYERS SQUIBB COMPANY (必治妥施贵宝)	47,647	2,955,543	1.88
C3.AI INC-A	3,857	535,159	0.34
COSTAR GROUP INC (中光学集团)	2,960	2,735,869	1.74
COUPA SOFTWARE INC	2,655	899,806	0.57
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	6,844	1,449,696	0.92
DRAFTKINGS INC - CL A	18,619	866,901	0.55
EDWARDS LIFESCIENCES CORP (爱德华生命科学)	36,902	3,366,569	2.14
ELASTIC NV	19,655	2,872,185	1.83
EXACT SCIENCES CORP	23,120	3,063,169	1.95
GLAUKOS CORP	9,762	734,688	0.47
HUBSPOT INC	2,015	798,827	0.51
INSULET CORP	4,979	1,272,782	0.81
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC (美国江森自控有限公司)	66,046	3,077,083	1.96
LEMONADE INC	13,819	1,692,827	1.08
LUMENTUM HOLDINGS INC(鲁门特姆控股公司)	31,135	2,951,598	1.88
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LIMITED (美满电子科技公司)	89,256	4,243,230	2.70
MASTERCARD INCORPORATED (万事达卡公司)	6,005	2,143,425	1.36
MERCK & CO INC (默克药厂股份有限公司)	40,522	3,314,700	2.11
MICRON TECHNOLOGY(美光科技公司)	18,812	1,414,286	0.90
OKTA INC	6,338	1,611,500	1.02
PALO ALTO NETWORKS INC (帕罗奥图网路)	10,763	3,825,063	2.43
PALOMAR HOLDINGS INC	26,613	2,364,299	1.51
PAYPAL HOLDINGS INC (贝宝支付公司)	7,595	1,778,749	1.13
PLUG POWER INC (普拉格能源)	28,871	979,016	0.62
RINGCENTRAL INC	7,809	2,959,377	1.88
ROYALTY PHARMA PLC	44,602	2,232,330	1.42
SCHRODINGER INC (薛定谔公司)	8,205	649,672	0.41
SNOWFLAKE INC-CLASS A	3,372	948,881	0.61
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	7,646	2,439,991	1.55

东方汇理香港组合

投资组合 - 东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金 (未经审计)
于 2020 年 12 月 31 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 (85.42%) (续)			
美国 (57.51%) (续)			
STRYKER CORPORATION (史塞克公司)	10,274	2,517,541	1.60
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC(泰莱达科技)	4,459	1,747,839	1.11
TENABLE HOLDINGS INC	58,763	3,070,954	1.96
TRANSUNION (环联)	34,791	3,451,963	2.20
TWILIO INC - A SHRS	6,748	2,284,198	1.45
UBER TECHNOLOGIES INC (优步科技公司)	51,717	2,637,567	1.68
VERTEX PHARMACEUTICALS INC (福泰制药公司)	7,253	1,714,174	1.09
WEX INC	10,051	2,045,680	1.30
ZENDESK INC	22,436	3,211,040	2.04
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	30,057	1,449,649	0.92
		90,413,714	57.51
上市投资合计		134,273,526	85.42
衍生金融工具			
远期外汇合约			
法国巴黎银行		105,160	0.07
法国东方汇理银行		8,492	0.01
摩根士丹利		39,590	0.02
香港上海汇丰银行有限公司		565,142	0.36
远期外汇合约合计		718,384	0.46
期货合约			
E-MINI 罗素 2000 19/03/2021		11,213	0.01
纳斯达克 100 股票指数 19/03/2021		34,867	0.02
TOPIX INDX FUTR 11/03/2021 (东证股价指数期货)		62,957	0.04
		109,037	0.07
衍生金融工具合计		827,421	0.53
投资合计		135,100,947	85.95
其他净资产		22,092,085	14.05
于 2020 年 12 月 31 日归属基金份额持有人资产净值		157,193,032	100.00
按成本投资总额		106,940,563	

注：投资按交易日处理。

东方汇理香港组合

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)
于 2020 年 12 月 31 日

	2020年 占资产净值百 分比 %	2019年 占资产净值百 分比 %
上市投资 (按来源地)		
股票		
比利时	-	1.98
巴西	-	1.51
加拿大	1.05	1.32
中国	8.66	1.35
丹麦	1.41	-
法国	3.45	1.51
德国	1.82	1.92
日本	4.30	8.11
荷兰	3.60	0.93
台湾	1.36	0.87
英国	2.26	-
美国	57.51	79.16
上市/报价投资合计	85.42	98.66
衍生金融工具		
远期外汇合约	0.46	0.33
期货合约	0.07	(0.03)
其他净资产	14.05	1.04
于2020年12月31日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

持有抵押品 (未经审计) 于 2020 年 12 月 31 日

2020 年 12 月 31 日，东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金并未持有任何包含现金、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。

东方汇理香港组合

业绩表现表 (未经审计)

于 2020 年 12 月 31 日

资产净值 (市场价值)

年末	东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金									
	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		普通人民币分派	
	资产净值 美元	每份额 资产净值 美元	资产净值 美元	每份额 资产净值 美元	资产净值 美元	每份额资产 净值 美元	资产净值 美元	每份额 资产净值 港元	资产净值 美元	每份额 资产净值 人民币
2020	644,894	26.00	10,112,787	24.63	73,677,736	18.76	29,831,317	18.64	455,062	17.87
2019	316,912	16.18	9,831,237	15.58	11,618,315	11.99	11,320,221	11.97	345,537	12.24
2018	7,418,910	11.93	19,075,737	11.69	12,337,051	9.14	12,988,889	9.16	297,340	9.21

业绩表现记录

年末	每份额 最高发行价 美元	每份额 最低赎回价 美元	每份额 最高发行价 美元	每份额 最低赎回价 美元	每份额 最高发行价 美元	每份额 最低赎回价 美元	每份额 最高发行价 港元	每份额 最低赎回价 港元	每份额 最高发行价 人民币	每份额 最低赎回价 人民币
2020	26.12	11.96	24.75	11.47	18.85	8.80	18.73	8.76	18.07	9.12
2019	16.22	11.60	15.63	11.36	12.03	8.86	12.00	8.88	12.35	8.73
2018	15.03	11.23	14.81	11.00	11.69	8.60	11.75	8.62	11.67	8.70
2017 ¹	13.37	10.04	13.35	10.04	10.73	9.98	10.74	9.98	10.21	9.88

¹ 自 2016 年 12 月 29 日成立开始

东方汇理香港组合

业绩表现表 (未经审计)
于 2020 年 12 月 31 日 (续)

资产净值 (市场价值)

年末	东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金 (续)									
	普通澳元 (对冲)分派		普通新西兰元 (对冲)分派		普通人民币 (对冲)分派		普通加元 (对冲)分派		普通欧元 (对冲)分派	
	资产净值 美元	每份额 资产净值 澳元	资产净值 美元	每份额 资产净值 新西兰元	资产净值 美元	每份额 资产净值 人民币	资产净值 美元	每份额 资产净值 加元	资产净值 美元	每份额 资产净值 欧元
2020	14,003,742	18.14	1,743,433	19.69	5,419,362	18.41	2,882,229	26.65	2,987,280	16.54
2019	2,284,177	11.89	122,145	12.93	4,563,150	11.91	176,525	17.21	534,993	10.42
2018	4,861,445	9.10	868	8.80	5,655,516	9.13	205,666	8.23	790	8.07

业绩表现记录

年末	每份额 最高发行价 澳元	每份额 最低赎回价 澳元	每份额 最高发行价 新西兰元	每份额 最低赎回价 新西兰元	每份额 最高发行价 人民币	每份额 最低赎回价 人民币	每份额 最高发行价 加元	每份额 最低赎回价 加元	每份额 最高发行价 欧元	每份额 最低赎回价 欧元
2020	18.24	8.67	19.79	9.45	18.50	8.72	26.79	12.59	16.64	7.83
2019	11.93	8.83	12.97	8.54	11.94	8.85	17.26	7.99	10.46	7.84
2018	11.66	8.56	11.25	8.28	11.73	8.59	10.54	7.75	10.13	7.60
2017 ²	10.73	9.98	10.21	9.85	10.78	9.99	-	-	-	-

² 自 2016 年 12 月 29 日成立开始

东方汇理香港组合

业绩表现表 (未经审计)
于 2020 年 12 月 31 日 (续)

资产净值 (市场价值)

年末	东方汇理香港组合 - 创新动力股票基金 (续)					
	普通英镑 (对冲)分派		M人民币 (对冲)分派		M人民币 (对冲)累算	
	资产净值 美元	每份额 资产净值 英镑	资产净值 美元	每份额 资产净值 离岸人民币	资产净值 美元	每份额 资产净值 离岸人民币
2020	4,984,972	16.44	812,961	1.3128	9,637,257	1.3236
2019	353,591	10.70	-	-	-	-
2018	3,245	8.24	-	-	-	-

业绩表现记录

年末	每份额 最高发行价 英镑	每份额 最低赎回价 英镑	每份额 最高发行价 离岸人民币	每份额 最低赎回价 离岸人民币	每份额 最高发行价 离岸人民币	每份额 最低赎回价 离岸人民币
2020	16.53	7.83	1.3185	0.9693	1.3295	0.9694
2019	10.74	8.00	-	-	-	-
2018	10.54	7.76	-	-	-	-
2017 ³	-	-	-	-	-	-

³ 自 2016 年 12 月 29 日成立开始