
大成中証中國內地消費ETF*（此基金為一隻合成交易所買賣基金）

大成中証香港中資民企ETF

大成中証香港中資央企ETF

（大成ETF信託基金子基金）

中期報告

截至二零一四年六月三十日止期間



大成ETF信託基金

截至二零一四年六月三十日止期間

中期報告

目錄	頁數
基金管理和基金行政	1
基金經理致基金單位持有人報告	2-8
財務狀況報表（未經審計）	9-11
全面收入報表（未經審計）	12-14
基金單位持有人應佔資產淨值變動報表（未經審計）	15-17
大成中証中國內地消費ETF*（*此基金為一隻合成交易所買賣基金）	18-26
- 投資組合（未經審計）	
- 投資組合變動報表（未經審計）	
- 表現紀錄（未經審計）	
大成中証香港中資民企ETF	27-31
- 投資組合（未經審計）	
- 投資組合變動報表（未經審計）	
- 表現紀錄（未經審計）	
大成中証香港中資央企ETF	32-36
- 投資組合（未經審計）	
- 投資組合變動報表（未經審計）	
- 表現紀錄（未經審計）	

大成ETF信託基金

截至二零一四年六月三十日止期間

基金管理和基金行政

基金經理董事

曹雄飛
陳尚前
鄧韶勇
杜鵬
劉彩暉
尚冰
楊春明

服務代理人

香港證券兌換代理服務有限公司
香港
德輔道中199號
維德廣場2樓

基金經理

大成國際資產管理有限公司
香港中環
金融街8號
國際金融中心二期
5811室

股份登記處

香港中央證券登記有限公司
香港灣仔
皇后大道東183號合和中心46樓

受託人

中銀國際英國保誠信託有限公司
香港銅鑼灣
威菲路道18號
萬國寶通中心
12及25字樓

核數師

羅兵咸永道會計師事務所
香港皇后大道中10號
公爵大廈21樓

上市代理人

招商證券（香港）有限公司
香港中環
交易廣場一期
48樓

基金經理法律顧問

西盟斯律師行
香港金鐘道中88號
太古廣場一期
13樓

基金經理致基金單位持有人報告

大成中証中國內地消費ETF* (*此基金為一隻合成交易所買賣基金) (大成ETF信託基金子基金)

基金表現

大成中証中國內地消費ETF* (*此基金為一隻合成交易所買賣基金) (「大成中國消費ETF」) 旨在追蹤中証內地消費主題指數表現的投資成果 (扣除費用及開支前)。為了達成投資目標，基金經理將使用一套合成複製策略，通過投資於衍生金融工具來實現子基金的投資目標。大成中國消費ETF並不直接投資於指數成份股的證券，然而會通過投資於與A股掛鈎的產品 (「A股掛鈎產品」或「ALP」) 進入指數。ALP是指某項衍生投資工具，而其與 (a) 某隻在相關時期或於可預見的未來將成為該指數成份股的中國公司A股，或 (b) 該指數掛鈎。截至二零一四年六月三十日，大成中國消費ETF的每單位資產淨值為7.99港元，合計共發行1,500,000個單位，累計總資產規模約1,198萬港元。

以下載列大成中國消費ETF¹的表現概要 (截至二零一四年六月三十日)：

	年初至今	二零一三年	二零一二年	二零一一年	二零一零年 ²	自成立以來 ³
中証內地消費主題指數 ⁴	-7.755%	7.392%	0.752%	-19.065%	24.817%	0.828%
中証內地消費總收益指數 ⁵	-6.078%	10.106%	2.537%	-18.241%	25.083%	8.442%
大成消費ETF資產淨值對資產淨值 ⁶	-13.058%	5.506%	-4.075%	-17.379%	24.041%	-9.819%
大成消費ETF市值對市值 ⁷	-10.971%	-3.101%	2.847%	-21.607%	18.896%	-17.304%

資料來源：大成國際資產管理有限公司、彭博。

大成中國消費ETF和中証內地消費主題指數的表現差異主要源於基金承擔的費用、開支及基金估值和指數計算所使用匯率的不同。

¹基金的往績資料並不表示將來亦會有類似的業績。

²二零一零年的表現涵蓋自基金成立之日 (二零一零年七月十五日) 起至二零一零年十二月三十一日止期間。

³基金成立日期為二零一零年七月十五日。

⁴以人民幣記值的價格指數。投資者不能直接投資於一個指數，且指數的回報表現並不反映管理費用、交易成本或其他開支，該等因素會降低回報的表現。

⁵以人民幣記值的總收益指數。總回報指假設把所有股息和分派再投資，投資者就一項投資所賺取 (或虧損) 的比率。

⁶以港幣記值的單位資產淨值。基金單位按資產淨值發行及贖回，且基金的回報已按資產淨值計算。

⁷以港幣記值的市場收市價。市場回報按歷史收市價計算，但不代表閣下於其他時間買賣單位將會收取的回報。

基金經理致基金單位持有人報告（續）

大成中證內地消費ETF*（*此基金為一隻合成交易所買賣基金）（續） （大成ETF信託基金子基金）

基金活動

從二零一零年七月十五日成立起，大成中國消費ETF吸引投資者對A股市場持續產生興趣。截至二零一四年六月三十日，共計發行1,500,000個單位。

抵押品安排

根據借股安排，ALP發行人已同意就已發行的ALP向大成中國消費ETF提供股份或現金抵押品。大成中國消費ETF向ALP發行人借出ALP以換取股份或現金抵押品。(a)大成中國消費ETF持有的抵押品必須超過基金交易對手總風險總合的100%，並每日按市值基準計算以確保沒有無擔保的交易對手風險暴露。若抵押品為證券的形式，則該抵押品會受到一個額外的要求，這種證券抵押品的市值需最少代表相關的交易對手總風險的120%。(b) 抵押品必須符合單位信託及互惠基金守則第8.8(e)條的要求，並符合證監會不時補充的其它指引的要求。基金經理，作為受託人，以應有的謹慎和技能，應根據持有的抵押品相關係數（包括但不限於信貸質素、流動性、存續期和其他相關係數）對子基金持有的非證券式的抵押品採取謹慎的扣減政策。(c) 基金經理，作為受託人，以應有的謹慎和技能，應從投資者的利益出發，不時根據市場情況動態管理抵押品。不時更改的抵押品管理政策在基金網站公佈。

截至二零一四年六月三十日，共計兩項借股協議：（1）大成中國消費ETF和Merrill Lynch International & Co. C.V.之間的借股安排，據此，受託人向Merrill Lynch International & Co. C.V.借出價值約3,101,362港元的ALP，並就此收取價值約3,825,729港元的股份抵押品。（2）大成中國消費ETF和Citigroup Global Markets Holdings Inc.之間的借股安排，據此，受託人向Citigroup Global Markets Holdings Inc.借出價值約8,073,028港元的ALP，並就此收取價值約8,301,021港元的現金抵押品。

截至二零一三年十二月三十一日，共計兩項借股協議：（1）大成中國消費ETF和Merrill Lynch International & Co. C.V. 之間的借股安排，據此，受託人向Merrill Lynch International & Co. C.V.借出價值約4,176,523港元的ALP，並就此收取價值約5,903,403港元的抵押品。（2）大成中國消費ETF與Citigroup Global Markets Holding Inc. 之間的借股安排，據此，受託人向Citigroup Global Markets Holding Inc.借出價值約8,956,412港元的ALP，並就此收取價值約9,661,147港元的證券抵押品。

截至二零一四年六月三十日，證券抵押品及現金抵押品價值佔按公平價值透過損益記帳的金融資產的109%（二零一三年十二月三十一日：119%）

於二零一四年六月三十日ALP發行人及其擔保人（如有）的信用評級如下：

ALP發行人	擔保人	標普評級
Merrill Lynch International & Co. C.V.	Bank of America Corporation	A-
Citigroup Global Markets Holdings Inc.	無	A-

基金經理致基金單位持有人報告（續）

大成中證內地消費ETF*（*此基金為一隻合成交易所買賣基金）（續）
（大成ETF信託基金子基金）

指數活動

中證內地消費主題指數在二零一四年上半年末經歷了一次定期的半年調整。截至二零一四年六月三十日，大成消費ETF間接持有共計48只指數成分股。

市場回顧

2014年上半年，中證中國內地消費指數和大成中證中國內地消費ETF的回報分別為-7.76%和-13.06%，同期中國人民幣兌港元的貨幣回報約為-2.452%。

相對於滬深300指數-7.08%的回報，中證中國內地消費指數轻微跑輸滬深300指數。2014年上半年中證中國內地消費指數的小幅虧損是由於中國內地較差的宏觀經濟格局及中央政府的反腐敗政策造成的。

在未來幾年，中國政府力爭改變中國的經濟增長模式，即消費將逐步成為中國經濟增長的主要推動力，在此過程中，消費類公司有望從中受益。作為中國消費行業在股票市場上的代表，大成中證中國內地消費ETF可能會從中受益。

基金經理致基金單位持有人報告

大成中証香港中資民企ETF (大成ETF信託基金子基金)

基金表現

大成中証香港中資民企ETF（「大成民企ETF」）旨在追蹤中証香港內地民營企業指數表現的投資成果（扣除費用及開支前）。截至二零一四年六月三十日，大成民企ETF的每單位資產淨值為6.15港元，合計共發行500,000個單位，累計總資產規模約為308萬港元。

以下列載大成民企ETF¹的表現概要（截至二零一四年六月三十日）。

	年初至今	二零一三年	二零一二年	二零一一年	二零一零年 ²	成立至今 ³
中証香港內地民營企業指數 ⁴	-3.566%	12.156%	23.329%	-24.361%	0.311%	1.207%
中証香港內地民營企業總收益指數 ⁵	-2.008%	14.412%	26.142%	-22.880%	0.351%	9.449%
大成民企ETF資產淨值對資產淨值 ⁶	-14.106%	-3.477%	9.985%	-28.914%	0.314%	-35.602%
大成民企ETF市值對市值 ⁷	-14.085%	-8.150%	12.029%	-27.975%	0.630%	-35.924%

資料來源：大成國際資產管理有限公司、彭博。

大成民企ETF和中証香港內地民營企業指數的表現差異主要源於基金承擔的費用及開支。

¹ 基金的往績資料並不表示將來亦會有類似的業績。

² 二零一零年的表現涵蓋自基金成立之日（二零一零年十二月二十日）起至二零一零年十二月三十一日止期間。

³ 基金成立日期為二零一零年十二月二十日。

⁴ 以港幣記值的價格指數。投資者不能直接投資於一個指數，且指數的回報表現並不反映管理費用、交易成本或其他開支，該等因素會降低回報的表現。

⁵ 以港幣記值的總收益指數。總回報指假設把所有股息和分派再投資，投資者就一項投資所賺取（或虧損）的比率。

⁶ 以港幣記值的單位資產淨值。基金單位按資產淨值發行及贖回，且基金的回報已按資產淨值計算。

⁷ 以港幣記值的市場收市價。市場回報按歷史收市價計算，但不代表閣下於其他時間買賣單位將會收取的回報。

基金經理致基金單位持有人報告（續）

大成中証香港中資民企ETF（續） （大成ETF信託基金子基金）

基金活動

大成民企ETF在二零一零年十二月二十日成立，截至二零一四年六月三十日，共計發行500,000個單位。

大成民企ETF的基金經理已在二零一四年八月七日公佈，大成民企ETF將在二零一四年九月十七日（「停止交易日」）起停止在香港聯合交易所有限公司（「聯交所」）交易，直到完成終止、除牌和撤回認可地位為止，指數上市基金將繼續維持其上市地位，且將仍為證監會認可。

欲了解更多關於建議終止、停止交易、自願除牌和撤回認可地位，請參閱聯交所網站或基金經理網站(<http://www.dcfund.com.hk/cn/>) 內於二零一四年八月七日發佈的公告和通告及其隨後發佈的公告。

指數活動

中証香港內地民營企業指數在二零一四年上半年末經歷了一次定期的半年調整。截至二零一四年六月三十日，大成民企ETF直接持有共計40只指數成分股。

市場回顧

二零一四年上半年，中証香港內地民營企業指數和大成民企ETF的增長分別為-3.57%和-14.11%。2014年上半年，中証香港內地民營企業指數錄得了輕微跌幅，其原因是由於中國內地宏觀經濟格局依然較弱。

未來中國經濟依然有望避免硬著陸，但經濟增長速度或會小幅降低。在宏觀經濟逐步穩定之後，在香港市場上市的中國股票將逐漸從低谷中恢復，返回到自己的內在價值。

基金經理致基金單位持有人報告

大成中証香港中資央企ETF (大成ETF信託基金子基金)

基金表現

大成中証香港中資央企ETF(「大成央企ETF」)旨在追蹤中証香港內地國有企業指數表現的投資成果(扣除費用及開支前)。截至二零一四年六月三十日,大成央企ETF的每單位資產淨值為7.40港元,合計共發行500,000個單位,累計總資產規模約為370萬港元。

以下列載大成央企ETF¹的表現概要(截至二零一四年六月三十日)。

	年初至今	二零一三年	二零一二年	二零一一年	二零一零年 ²	成立以來 ³
中証香港內地國有企業指數 ⁴	-2.877%	-6.069%	16.635%	-16.989%	2.164%	-9.760%
中証香港內地國有企業總收益指數 ⁵	-0.289%	-2.078%	21.219%	-14.486%	2.165%	3.403%
大成央企ETF資產淨值對資產淨值 ⁶	-8.529%	-8.854%	11.669%	-19.332%	2.066%	-23.554%
大成央企ETF市值對市值 ⁷	-8.859%	-11.683%	15.47%	-17.970%	1.861%	-22.337%

資料來源：大成國際資產管理有限公司、彭博。

大成央企ETF和中証香港內地國有企業指數的表現差異主要源於基金承擔的費用及開支。

¹ 基金的往績資料並不表示將來亦會有類似的業績。

² 二零一零年的表現涵蓋自基金成立之日(二零一零年十二月二十日)起至二零一零年十二月三十一日止期間。

³ 基金成立日期為二零一零年十二月二十日。

⁴ 以港幣記值的價格指數。投資者不能直接投資於一個指數,且指數的回報表現並不反映管理費用、交易成本或其他開支,該等因素會降低回報的表現。

⁵ 以港幣記值的總收益指數。總回報指假設把所有股息和分派再投資,投資者就一項投資所賺取(或虧損)的比率。

⁶ 以港幣記值的單位資產淨值。基金單位按資產淨值發行及贖回,且基金的回報已按資產淨值計算。

⁷ 以港幣記值的市場收市價。市場回報按歷史收市價計算,但不代表閣下於其他時間買賣單位將會收取的回報。

基金經理致基金單位持有人報告（續）

大成中証香港中資央企ETF（續） （大成ETF信託基金子基金）

基金活動

大成央企ETF在二零一零年十二月二十日成立，截至二零一四年六月三十日，共計發行500,000個單位。

大成央企ETF的基金經理已在二零一四年八月七日公佈，大成民企ETF將在二零一四年九月十七日（「停止交易日」）起停止在香港聯合交易所有限公司（「聯交所」）交易，直到完成終止、除牌和撤回認可地位為止，指數上市基金將繼續維持其上市地位，且將仍為證監會認可。

欲了解更多關於建議終止、停止交易、自願除牌和撤回認可地位，請參閱聯交所網站或基金經理網站(<http://www.dcfund.com.hk/cn/>) 內於二零一四年八月七日發佈的公告和通告及其隨後發佈的公告。

指數活動

中証香港內地國有企業指數在二零一四年上半年末經歷了一次定期的半年調整。截至二零一四年六月三十日，大成央企ETF直接持有共計40只指數成分股。

市場回顧

二零一四年上半年，中証香港內地國有企業指數和大成央企ETF的增長分別為-2.88%和-8.53%。2014年上半年，中証香港內地國有企業指數錄得了輕微跌幅，其原因是由於中國內地宏觀經濟格局依然較弱。

未來中國經濟依然有望避免硬著陸，但經濟增長速度或會小幅降低。在宏觀經濟逐步穩定之後，在香港市場上市的中國股票將逐漸從低谷中恢復，返回到自己的內在價值。

大成國際資產管理有限公司

二零一四年八月二十九日

大成ETF信託基金

大成中証中國內地消費ETF* (*此基金為一隻合成交易所買賣基金)
(大成ETF信託基金子基金)

財務狀況報表(未經審計)
截至二零一四年六月三十日

	大成中証中國內地消費ETF* (*此基金為一隻合成交易所買賣基金)	
	30.06.2014 (未經審計) 港元	31.12.2013 (經審計) 港元
資產		
流動資產		
投資	11,174,390	13,132,935
現金及現金等價物	105,280	146,632
預付款及其他應收款	380,911	229,717
應收管理費用	820,657	757,346
總資產	<u>12,481,238</u>	<u>14,266,630</u>
負債		
流動負債		
應付交易買賣費用	15,200	600
應付維護費用	296,799	273,209
應付借出證券費用	29,234	67,725
其他應付賬款	159,383	140,742
總負債	<u>500,616</u>	<u>482,276</u>
權益		
基金單位持有人應佔資產淨值	<u>11,980,622</u>	<u>13,784,354</u>

大成ETF信託基金

大成中証香港中資民企ETF
(大成ETF信託基金子基金)

財務狀況報表(未經審計)
截至二零一四年六月三十日

	大成中証香港中資民企ETF	
	30.06.2014 (未經審計) 港元	31.12.2013 (經審計) 港元
資產		
流動資產		
投資	3,021,574	3,534,313
現金及現金等價物	132,820	198,511
應收經紀人金額	-	167,921
預付款及其他應收款	121,200	15,662
總資產	<u>3,275,594</u>	<u>3,916,407</u>
負債		
流動負債		
應付管理費用	4,668	5,553
應付信託費用	25,000	25,833
應付交易費	3,400	2,000
應付經紀人金額	-	101,724
其他應付款	166,264	166,526
總負債	<u>199,332</u>	<u>301,636</u>
權益		
基金單位持有人應佔資產淨值	<u>3,076,262</u>	<u>3,614,771</u>

大成ETF信託基金

大成中証香港中資央企ETF
(大成ETF信託基金子基金)

財務狀況報表(未經審計)
截至二零一四年六月三十日

	大成中証香港中資央企ETF	
	30.06.2014 (未經審計) 港元	31.12.2013 (經審計) 港元
資產		
流動資產		
投資	3,595,290	12,003,187
現金及現金等價物	149,340	351,270
應收經紀人金額	-	128,096
預付款及其他應收款	160,254	15,000
總資產	<u>3,904,884</u>	<u>12,497,553</u>
負債		
流動負債		
應付管理費用	6,722	18,753
應付信託費用	25,806	25,833
應付經紀人金額	-	117,020
其他應付款	170,064	167,925
總負債	<u>202,592</u>	<u>329,531</u>
權益		
基金單位持有人應佔資產淨值	<u>3,702,292</u>	<u>12,168,022</u>

大成ETF信託基金

大成中証中國內地消費ETF* (*此基金為一隻合成交易所買賣基金)
(大成ETF信託基金子基金)

全面收入報表(未經審計)
自二零一四年一月一日至二零一四年六月三十日期間

	大成中証中國內地消費ETF* (*此基金為一隻合成交易所買賣基金)	
	01.01.2014 至 30.06.2014 (未經審計) 港元	01.01.2013 至 31.12.2013 (經審計) 港元
收入		
投資淨收益/(虧損)	(1,299,437)	1,339,440
股息收入	176,943	311,120
其他收入/(虧損)	(4,723)	2,721
總淨收入/(虧損)	(1,127,217)	1,653,281
支出		
管理費用	(126,689)	(116,287)
交易買賣費用	(35,000)	(45,600)
運作費用	(23,589)	(45,725)
借出證券費用	(131,319)	(230,779)
律師費用	(135,367)	(33,683)
其他經營支出	(205,893)	(233,997)
總經營支出	(657,857)	(706,071)
除稅前溢利/(虧損)	(1,785,074)	947,210
稅項	(18,658)	(66,439)
總全面收入/(虧損)	(1,803,732)	880,771

大成ETF信託基金

大成中証香港中資民企ETF
(大成ETF信託基金子基金)

全面收入報表(未經審計)
自二零一四年一月一日至二零一四年六月三十日期間

	大成中証香港中資民企ETF	
	01.01.2014 至 30.06.2014 (未經審計) 港元	01.01.2013 至31.12.2013 (經審計) 港元
收入		
投資淨收益/(虧損)	(139,171)	359,668
股息收入	50,106	121,421
其他收入/(虧損)	957	(1,018)
總淨收入/(虧損)	<u>(88,108)</u>	<u>480,071</u>
支出		
管理費用	(9,669)	(36,658)
交易買賣費用	(5,600)	(20,811)
信託費用	(150,000)	(300,000)
律師費用	(28,308)	(65,163)
其他經營支出	(255,940)	(414,975)
總經營支出	<u>(449,517)</u>	<u>(837,607)</u>
除稅前溢利/(虧損)	(537,625)	(357,536)
稅項	(884)	(1,800)
總全面收入/(虧損)	<u><u>(538,509)</u></u>	<u><u>(359,336)</u></u>

大成ETF信託基金

大成中証香港中資央企ETF
(大成ETF信託基金子基金)

全面收入報表(未經審計)
自二零一四年一月一日至二零一四年六月三十日期間

大成中証香港中資央企ETF

	01.01.2014 至 30.06.2014 (未經審計) 港元	01.01.2013 至31.12.2013 (經審計) 港元
收入		
投資淨收益/(虧損)	(424,206)	(753,187)
股息收入	90,484	490,767
其他收入/(虧損)	110	(1,132)
總淨收入/(虧損)	(333,612)	(263,552)
支出		
管理費用	(23,035)	(74,241)
交易買賣費用	(6,000)	(13,000)
信託費用	(150,000)	(300,000)
律師費用	(28,308)	(65,163)
其他經營支出	(256,774)	(416,036)
總經營支出	(464,117)	(868,440)
除稅前溢利/(虧損)	(797,729)	(1,131,992)
稅項	(8,001)	(47,094)
總全面收入/(虧損)	(805,730)	(1,179,086)

大成ETF信託基金

大成中証中國內地消費ETF* (*此基金為一隻合成交易所買賣基金)
(大成ETF信託基金子基金)

基金單位持有人應佔資產淨值變動報表(未經審計)
自二零一四年一月一日至二零一四年六月三十日期間

大成中証中國內地消費ETF*
(*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

	01.01.2014 至 30.06.2014 (未經審計) 港元	01.01.2013 至 31.12.2013 (經審計) 港元
期初基金單位持有人應佔資產淨值	13,784,354	4,353,583
發行單位所得款項		
- 以實物方式	-	8,385,397
- 現金成分及現金認購	-	164,603
贖回單位所得款項		
- 以實物方式	-	-
- 現金成分及現金贖回	-	-
股息	-	-
來自單位元元交易的增加/(減少)淨額	-	8,550,000
本期間總全面收入/(虧損)	(1,803,732)	880,771
期末基金單位持有人應佔資產淨值	11,980,622	13,784,354
期初已發行單位	1,500,000	500,000
發行單位	-	1,000,000
贖回單位	-	-
期終已發行單位	1,500,000	1,500,000
單位持有人應佔資產淨值(交易資產淨值)	11,980,622	13,784,354
單位持有人應佔單位資產淨值(交易資產淨值)	7.99	9.19

大成ETF信託基金

大成中証香港中資民企ETF
(大成ETF信託基金子基金)

基金單位持有人應佔資產淨值變動報表(未經審計)
自二零一四年一月一日至二零一四年六月三十日期間

	大成中証香港中資民企ETF	
	01.01.2014 至 30.06.2014 (未經審計)	01.01.2013 至 31.12.2013 (經審計)
	港元	港元
期初基金單位持有人應佔資產淨值	3,614,771	7,474,107
發行單位所得款項		
- 以實物方式	-	-
- 現金成分及現金認購	-	-
贖回單位所得款項		
- 以實物方式	-	(3,430,237)
- 現金成分及現金贖回	-	(69,763)
股息	-	-
來自單位元元交易的增加/(減少)淨額	-	(3,500,000)
本期間總全面收入/(虧損)	(538,509)	(359,336)
期末基金單位持有人應佔資產淨值	3,076,262	3,614,771
期初已發行單位	500,000	1,000,000
發行單位	-	-
贖回單位	-	(500,000)
期終已發行單位	500,000	500,000
基金單位持有人應佔資產淨值(交易資產淨值)	3,076,262	3,614,771
單位持有人應佔單位資產淨值(交易資產淨值)	6.15	7.23

大成ETF信託基金

大成中証香港中資央企ETF
(大成ETF信託基金子基金)

基金單位持有人應佔資產淨值變動報表(未經審計)
自二零一四年一月一日至二零一四年六月三十日期間

大成中証香港中資央企ETF

	01.01.2014 至 30.06.2014 (未經審計)	01.01.2013 至 31.12.2013 (經審計)
	港元	港元
期初基金單位持有人應佔資產淨值	12,168,022	13,347,108
發行單位所得款項		
- 以實物方式	-	-
- 現金成分及現金認購	-	-
贖回單位所得款項		
- 以實物方式	(7,511,168)	-
- 現金成分及現金贖回	(148,832)	-
股息		
來自單位元元交易的增加/(減少)淨額	(7,660,000)	-
本期間總全面收入/(虧損)	(805,730)	(1,179,086)
期末基金單位持有人應佔資產淨值	3,702,292	12,168,022
期初已發行單位	1,500,000	1,500,000
發行單位	-	-
贖回單位	(1,000,000)	-
期終已發行單位	500,000	1,500,000
單位持有人應佔資產淨值(交易資產淨值)	3,702,292	12,168,022
單位持有人應佔單位資產淨值(交易資產淨值)	7.40	8.11

大成ETF信託基金

大成中証中國內地消費ETF* (*此基金為一隻合交易所買賣基金)
(大成ETF信託基金子基金)

投資組合 (未經審核)
截至二零一四年六月三十日

	持股量	公平價值 港元	佔資產淨值 百分比
投資(93.27%)			
中國(93.27%)			
Merrill Lynch International & Co. C.V.所發行 的A股掛鉤產品 (25.89%)			
大北農	4,401	62,419	0.52%
燕京啤酒	7,834	63,575	0.53%
百視通	4,900	195,948	1.66%
比亞迪	440	26,088	0.22%
海南橡膠	1,522	11,667	0.10%
中國國旅	1,853	76,437	0.64%
中南傳媒	3,738	67,390	0.56%
長安汽車	12,867	197,753	1.65%
一汽轎車	5,611	67,251	0.56%
福耀玻璃	6,859	71,933	0.60%
長城汽車	1,778	56,162	0.47%
格力電器	1,264	46,475	0.39%
廣汽集團	800	7,521	0.06%
海甯皮城	1,928	30,017	0.25%
雙匯發展	2,902	129,672	1.08%
華域汽車	7,132	87,084	0.73%
伊利股份	3,328	137,614	1.15%
鳳凰傳媒	3,044	35,268	0.29%
洋河股份	630	39,918	0.33%
貴州茅臺	159	28,185	0.24%
瀘州老窖	3,519	71,965	0.60%
梅花生物	364	2,331	0.02%
美的集團	9,887	238,485	1.99%
新希望	2,996	42,230	0.35%
青島海爾	8,720	160,691	1.34%
上汽集團	4,596	87,793	0.73%

大成ETF信託基金

大成中証中國內地消費ETF* (*此基金為一隻合成交易所買賣基金)
(大成ETF信託基金子基金)

投資組合(未經審核)(續)
截至二零一四年六月三十日

	持股量	公平價值 港元	佔資產淨值 百分比
投資(續)			
中國(續)			
Merrill Lynch International & Co. C.V.所發行的A股掛鉤產品(續)			
上海家化	1,707	78,108	0.65%
東方明珠	10,932	149,861	1.25%
上海醫藥	2,495	38,720	0.32%
山西汾酒	1,152	19,100	0.16%
華僑城A	16,345	95,708	0.80%
苏宁云商	10,545	86,365	0.72%
TCL集團	39,738	113,117	0.94%
青島啤酒	1,848	92,428	0.77%
威孚高科	3,246	109,299	0.91%
五糧液	6,728	150,610	1.26%
永輝超市	1,072	8,459	0.07%
雅戈爾	5,973	52,425	0.44%
宇通客車	3,240	65,289	0.54%

大成ETF信託基金

大成中証中國內地消費ETF* (*此基金為一隻合成交易所買賣基金)
(大成ETF信託基金子基金)

投資組合(未經審核)(續)
截至二零一四年六月三十日

	持股量	公平價值 港元	佔資產淨值 百分比
投資(93.27 %)			
中國 (93.27 %)			
Citigroup Global Markets Holdings Inc.所發行的A股掛鉤產品 (67.38%)			
大北農	6,976	98,940	0.83%
燕京啤酒	10,978	89,089	0.74%
貝因美	6,400	114,742	0.96%
百視通	1,848	73,900	0.62%
光明乳業	6,400	128,166	1.07%
比亞迪	4,620	273,926	2.29%
海南橡膠	10,266	78,697	0.66%
中國國旅	1,398	57,668	0.48%
中南傳媒	2,390	43,088	0.36%
長安汽車	6,072	93,321	0.78%
一汽轎車	4,690	56,212	0.47%
福耀玻璃	12,206	128,009	1.07%
長城汽車	2,998	94,698	0.79%
格力電器	23,754	873,395	7.29%
奧飛動漫	1,900	87,058	0.73%
廣汽集團	9,646	90,684	0.76%
海甯皮城	3,724	57,978	0.48%
雙匯發展	4,748	212,159	1.77%
华东医药	2,700	182,031	1.52%
华闻传媒	11,500	168,704	1.41%
華域汽車	5,898	72,017	0.60%
电广传媒	7,300	138,807	1.16%
伊利股份	9,634	398,369	3.33%
鳳凰傳媒	6,646	77,001	0.64%
洋河股份	2,722	172,470	1.44%
九州通	3,200	53,496	0.45%
康美药业	16,100	300,507	2.51%
貴州茅臺	4,527	802,467	6.70%
瀘州老窖	5,288	108,142	0.90%
梅花生物	7,078	45,333	0.38%
美的集團	7,830	188,868	1.58%
新希望	4,540	63,994	0.53%
青島海爾	8,184	150,814	1.26%
上汽集團	29,302	559,728	4.65%

大成ETF信託基金

大成中証中國內地消費ETF* (*此基金為一隻合交易所買賣基金)
(大成ETF信託基金子基金)

投資組合(未經審核)(續)
截至二零一四年六月三十日

	持股量	公平價值 港元	佔資產淨值 百分比
投資(續)			
中國(續)			
Citigroup Global Markets Holdings Inc.所發 行的A股掛鉤產品(續)			
上海家化	4,098	187,514	1.57%
東方明珠	8,970	122,965	1.03%
上海醫藥	8,370	129,893	1.08%
山西汾酒	2,262	37,504	0.31%
華僑城A	22,162	129,769	1.08%
苏宁云商	38,572	315,911	2.64%
TCL集團	39,198	111,580	0.93%
青島啤酒	2,430	121,536	1.01%
華數傳媒	400	14,028	0.12%
威孚高科	3,066	103,239	0.86%
五糧液	13,426	300,549	2.51%
永輝超市	13,432	105,985	0.88%
雅戈爾	11,634	102,111	0.85%
宇通客車	7,740	155,967	1.30%
		<u>11,174,390</u>	<u>93.27%</u>
總投資		11,174,390	93.27%
其他淨資產		<u>806,232</u>	<u>6.73%</u>
截至二零一四年六月三十日淨資產		<u>11,980,622</u>	<u>100%</u>
以成本計量的總資產		<u>10,684,488</u>	

大成ETF信託基金

 大成中証中國內地消費ETF* (*此基金為一隻合交易所買賣基金)
 (大成ETF信託基金子基金)

投資組合變動報表 (未經審核)

自二零一四年一月一日至二零一四年六月三十日

持股量

	31.12.2013	添置	公司行動	出售	30.06.2014
投資					
中國					
Merrill Lynch International & Co. C.V. 發行的ALP					
安徽江淮汽車	400	-	-	400	-
大北農	4,401	-	-	-	4,401
燕京啤酒	7,834	-	-	-	7,834
福田汽車	5,546	-	-	5,546	-
百視通新媒體	4,900	-	-	-	4,900
比亞迪	440	-	-	-	440
海南橡膠	1,522	-	-	-	1,522
中國國旅	1,853	-	-	-	1,853
中南傳媒	3,738	-	-	-	3,738
長安汽車	12,867	-	-	-	12,867
一汽轿车	5,611	-	-	-	5,611
福耀玻璃	6,859	-	-	-	6,859
長城汽車	1,778	-	-	-	1,778
格力電器	4,264	-	-	3,000	1,264
廣州汽車集團	800	-	-	-	800
海寧皮城	1,928	-	-	-	1,928
北大荒	4,928	-	-	4,928	-
雙匯發展	2,902	-	-	-	2,902
華域汽車	7,132	-	-	-	7,132
伊利股份	4,028	-	-	700	3,328
鳳凰傳媒	3,044	-	-	-	3,044
洋河股份	630	-	-	-	630
貴州茅臺	745	-	14	600	159
瀘州老窖	3,519	-	-	-	3,519
梅花集團	364	-	-	-	364
美的集團	3,955	-	5,932	-	9,887
新希望	2,996	-	-	-	2,996
龐大集團	2,976	-	-	2,976	-
青島海爾	8,720	-	-	-	8,720
上汽集團	6,896	-	-	2,300	4,596

大成ETF信託基金

大成中証中國內地消費ETF* (*此基金為一隻合交易所買賣基金)
(大成ETF信託基金子基金)

投資組合變動報表 (未經審核) (續)

自二零一四年一月一日至二零一四年六月三十日

	持股量				
	31.12.2013	添置	公司行動	出售	30.06.2014
投資 (續)					
中國 (續)					
Merrill Lynch					
International & Co. C.V.					
發行的ALP (續)					
友誼股份	3,872	-	-	3,872	-
上海家化	1,707	-	-	-	1,707
東方明珠	10,932	-	-	-	10,932
上海醫藥	2,495	-	-	-	2,495
山西汾酒	1,152	-	-	-	1,152
華僑城A	16,345	-	-	-	16,345
蘇寧雲商	15,045	-	-	4,500	10,545
TCL集團	39,738	-	-	-	39,738
青島啤酒	1,848	-	-	-	1,848
威孚高科	3,246	-	-	-	3,246
五糧液	6,728	-	-	-	6,728
張裕A	973	-	-	(973)	-
永輝超市	536	-	536	-	1,072
雅戈爾	5,973	-	-	-	5,973
小商品城	9,330	-	-	9,330	-
鄭州宇通客車	3,240	-	-	-	3,240

大成ETF信託基金

大成中証中國內地消費ETF* (*此基金為一隻合成交易所買賣基金)
 (大成ETF信託基金子基金)

投資組合變動報表 (未經審核)

自二零一四年一月一日至二零一四年六月三十日

持股量

	31.12.2013	添置	公司行動	出售	30.06.2014
投資					
中國					
Citigroup Global Markets Holdings Inc.發行的ALP					
安徽江淮汽車	1,002	-	-	1,002	-
大北農	6,976	-	-	-	6,976
燕京啤酒	10,978	-	-	-	10,978
貝因美	-	6,400	-	-	6,400
福田汽車	12,234	-	-	12,234	-
百視通新媒體	1,848	-	-	-	1,848
光明乳業	-	6,400	-	-	6,400
比亞迪	4,620	-	-	-	4,620
海南橡膠	10,266	-	-	-	10,266
中國國旅	1,398	-	-	-	1,398
中南傳媒	2,390	-	-	-	2,390
長安汽車	12,472	-	-	6,400	6,072
一齊轎車	4,690	-	-	-	4,690
福耀玻璃	12,206	-	-	-	12,206
長城汽車	2,998	-	-	-	2,998
格力電器	21,554	4,000	-	1,800	23,754
奧飛動漫	-	1,900	-	-	1,900
廣州汽車集團	9,646	-	-	-	9,646
海寧皮城	3,724	-	-	-	3,724
北大荒	6,196	-	-	6,196	-
雙匯發展	4,748	-	-	-	4,748
海信電器	10,100	-	-	10,100	-
華東醫藥	2,700	-	-	-	2,700
華聞傳媒	-	11,500	-	-	11,500
華域汽車	5,898	-	-	-	5,898
電廣傳媒	-	7,300	-	-	7,300
伊利股份	10,434	-	-	800	9,634
鳳凰傳媒	6,646	-	-	-	6,646
洋河股份	3,522	-	-	800	2,722

大成ETF信託基金

大成中証中國內地消費ETF* (*此基金為一隻合成交易所買賣基金)
(大成ETF信託基金子基金)

投資組合變動報表(未經審核)(續)

自二零一四年一月一日至二零一四年六月三十日

持股量

	31.12.2013	添置	公司行動	出售	30.06.2014
投資(續)					
中國(續)					
Citigroup Global Markets Holdings Inc.發行的ALP					
(續)					
九州通	-	3,200	-	-	3,200
康美藥業	-	16,100	-	-	16,100
貴州茅台	3,716	700	411	300	4,527
瀘州老窖	5,288	-	-	-	5,288
梅花集團	7,078	-	-	-	7,078
美的集團	5,372	-	8,058	5,600	7,830
新希望	4,540	-	-	-	4,540
龐大集團	4,568	-	-	4,568	-
青島海爾	11,684	-	-	3,500	8,184
上汽集團	32,502	-	-	3,200	29,302
友誼股份	6,714	-	-	6,714	-
上海家化	4,098	-	-	-	4,098
上海美特斯邦威服飾	2,500	-	-	2,500	-
東方明珠	8,970	-	-	-	8,970
上海醫藥	8,370	-	-	-	8,370
山西汾酒	2,262	-	-	-	2,262
華僑城A	31,662	-	-	9,500	22,162
蘇寧雲商	38,572	-	-	-	38,572
TCL集團	73,798	-	-	34,600	39,198
青島啤酒	2,430	-	-	-	2,430
華數傳媒	400	-	-	-	400
威孚高科	5,166	-	-	2,100	3,066
五糧液	17,526	-	-	4,100	13,426
張裕A	684	-	-	684	-
永輝超市	6,716	-	6,716	-	13,432
雅戈爾	11,634	-	-	-	11,634
小商品城	7,946	-	-	7,946	-
鄭州宇通客車	7,740	-	-	-	7,740

大成ETF信託基金

大成中証中國內地消費ETF* (*此基金為一隻合成交易所買賣基金)
(大成ETF信託基金子基金)

表現記錄 (未經審核)
截至二零一四年六月三十日

淨資產淨值 (交易資產淨值)

	每單位 資產淨值 港元	子基金 資產淨值 港元
截至下列日期財務期間結束時		
二零一四年六月三十日	7.99	11,980,622
二零一三年十二月三十一日	9.19	13,784,354

最高及最低每單位資產淨值

	最高每單位 資產淨值 港元	最低每單位 資產淨值 港元
截至下列日期止財務期間		
二零一四年六月三十日	9.19	7.68
二零一三年十二月三十一日	9.91	7.96

大成ETF信託基金

大成中証香港中資民企ETF (大成ETF信託基金子基金)

投資組合 (未經審核)
截至二零一四年六月三十日

	持股量	公平價值 港元	佔資產淨值 百分比
投資 (98.22%)			
上市股本 (98.22%)			
香港 (98.22%)			
瑞聲科技	1,889	95,300	3.10%
雅居樂地產控股有限公司	3,788	20,682	0.67%
安踏體育用品有限公司	3,419	42,122	1.37%
寶信汽車集團	2,700	17,658	0.57%
百麗	15,304	131,614	4.28%
合生元	500	21,500	0.70%
比亞迪	1,748	77,873	2.53%
超大現代	30,271	33,298	1.08%
海螺創業	2,400	40,944	1.33%
中國燃氣	6,804	109,408	3.56%
中國宏橋	4,580	25,511	0.83%
輝山乳業	10,000	17,000	0.55%
民生銀行	19,594	137,550	4.47%
碧桂園控股有限公司	20,391	62,804	2.04%
新奧能源	2,526	140,698	4.57%
恒大地產集團有限公司	15,885	47,814	1.55%
復星國際	6,200	63,860	2.08%
保利協鑫能源	27,707	71,761	2.33%
吉利汽車	15,563	42,487	1.38%
金鷹商貿集團	1,509	14,200	0.46%
綠城中國	4,539	35,132	1.14%
海爾電器	3,386	68,567	2.23%
恆安國際	2,298	187,517	6.10%
建滔化工集團	1,963	31,369	1.02%
理文造紙	6,926	28,535	0.93%
龍湖地產	4,499	42,965	1.40%
玖龍紙業	6,551	34,524	1.12%
中國平安	4,691	281,460	9.15%
申洲國際集團	1,783	47,160	1.53%
世茂房地產控股有限公司	3,821	54,411	1.77%
瑞安房地產	14,377	27,173	0.88%
四環醫藥	14,766	69,991	2.28%
中國生物製藥	9,000	56,520	1.84%

大成ETF信託基金

大成中証香港中資民企ETF
(大成ETF信託基金子基金)

投資組合(未經審核)(續)
截至二零一四年六月三十日

	持股量	公平價值 港元	佔資產淨值 百分比
投資(續)			
上市股本(續)			
香港(續)			
SOHO中國	7,105	43,412	1.41%
高鑫零售	6,591	58,462	1.90%
騰訊	2,570	303,774	9.88%
康師傅控股	6,208	134,714	4.38%
統一企業中國	3,894	23,130	0.75%
中國旺旺控股有限公司	19,062	212,351	6.90%
信義玻璃	8,037	36,568	1.19%
中升控股	2,946	29,755	0.97%
		3,021,574	98.22%
總投資		3,021,574	98.22%
其他淨資產		54,688	1.78%
截至二零一三年六月三十日淨資產		3,076,262	100.00%
以成本計量的總資產		2,843,439	

大成ETF信託基金

大成中証香港中資民企ETF (大成ETF信託基金子基金)

投資組合變動報表(未經審核)

自二零一四年一月一日至二零一四年六月三十日

持股量

	31.12.2013	添置	公司行動	出售	30.06.2014
投資(98.22%)					
上市股本(98.22%)					
香港(98.22%)					
瑞聲科技	2,565	-	-	676	1,889
雅居樂地產	5,182	-	-	1,394	3,788
安踏體育用品有限公司	3,419	-	-	-	3,419
寶信汽車集團	2,700	-	-	-	2,700
百麗	17,304	-	-	2,000	15,304
合生元	-	500	-	-	500
波士登	11,607	-	-	11,607	-
比亞迪	1,748	-	-	-	1,748
超大現代	30,271	-	-	-	30,271
海螺創業	-	2,400	-	-	2,400
中國燃氣	9,674	-	-	2,870	6,804
中國宏橋	4,580	-	-	-	4,580
輝山乳業	-	10,000	-	-	10,000
民生銀行	18,329	-	3,265	2,000	19,594
碧桂園控股有限公司	32,178	-	-	11,787	20,391
新奧能源	2,526	-	-	-	2,526
恒大地產集團有限公司	23,375	-	-	7,490	15,885
復星國際	6,200	-	-	-	6,200
保利協鑫能源	27,707	-	-	-	27,707
吉利汽車	17,563	-	-	2,000	15,563
金鷹商貿集團	2,805	-	-	1,296	1,509
綠城中國	4,539	-	-	-	4,539
海爾電器	3,386	-	-	-	3,386
恆安國際	2,898	-	-	600	2,298
銀泰百貨	3,513	-	-	3,513	-
建滔化工集團	2,593	-	-	630	1,963
理文造紙	6,926	-	-	-	6,926
龍湖地產	5,650	-	-	1,151	4,499
玖龍紙業	6,551	-	-	-	6,551
中國平安	3,741	2,600	-	1,650	4,691
申洲國際集團	1,783	-	-	-	1,783
世茂房地產	5,176	-	-	1,355	3,821

大成ETF信託基金

大成中証香港中資民企ETF
(大成ETF信託基金子基金)

投資組合變動報表(未經審核)(續)
自二零一四一月一日至二零一四年六月三十日

	持股量				
	31.12.2013	添置	公司行動	出售	30.06.2014
投資(續)					
上市股本(續)					
香港(續)					
瑞安房地產	14,377	-	-	-	14,377
四環醫藥	7,383	-	7,383	-	14,766
中國生物製藥	9,000	-	-	-	9,000
SOHO中國	7,105	-	-	-	7,105
高鑫零售	6,591	-	-	-	6,591
騰訊	750	2,400	-	580	2,570
康師傅控股	7,798	-	-	1,590	6,208
統一企業中國	3,894	-	-	-	3,894
中國旺旺控股有限公司	23,062	-	-	4,000	19,062
信義玻璃	8,037	-	-	-	8,037
中升控股	2,946	-	-	-	2,946
	<u> </u>	<u> </u>	<u> </u>	<u> </u>	<u> </u>

大成ETF信託基金

大成中証香港中資民企ETF (大成ETF信託基金子基金)

表現記錄 (未經審核)
截至二零一四年六月三十日

淨資產淨值 (交易資產淨值)

	每單位 資產淨值 港元	子基金 資產淨值 港元
截至下列日期財務期間結束時		
二零一四年六月三十日	6.15	3,076,262
二零一三年十二月三十一日	7.23	3,614,771

最高及最低每單位資產淨值

	最高每單位 資產淨值 港元	最低每單位 資產淨值 港元
截至下列日期財務期間結束時		
二零一四年六月三十日	7.19	5.89
二零一三年十二月三十一日	7.92	6.35

大成ETF信託基金

大成中証香港中資央企ETF
(大成ETF信託基金子基金)

投資組合(未經審核)
截至二零一四年六月三十日

	持股量	公平價值 港元	佔資產淨值 百分比
投資(97.11%)			
上市股本(97.11%)			
香港(97.11%)			
農業銀行	29,248	100,028	2.70%
海螺水泥	1,927	51,258	1.38%
中國銀行	83,455	289,589	7.82%
交通銀行	10,758	57,555	1.55%
北京控股	524	38,435	1.04%
華晨中國汽車	4,087	59,425	1.61%
中國信達	7,216	27,782	0.75%
中信銀行	6,070	28,529	0.77%
中國交建	6,329	32,911	0.89%
中國建設銀行	53,301	312,345	8.44%
中國人壽	7,551	153,285	4.14%
蒙牛乳業	1,491	53,452	1.44%
招商銀行	4,628	70,716	1.91%
招商局國際	1,807	43,729	1.18%
中國移動	4,689	352,613	9.51%
中國海外發展	4,095	76,986	2.08%
中國太保	1,985	54,290	1.47%
中國石化	26,135	193,138	5.22%
華潤水泥控股	2,871	13,953	0.38%
華潤創業	1,742	37,453	1.01%
華潤燃氣	1,443	35,209	0.95%
華潤置地	3,618	51,303	1.39%
華潤電力	2,651	58,322	1.58%
中國神華能源	3,498	78,355	2.12%
中國建築國際	2,835	38,556	1.04%
中國電信	14,252	54,015	1.46%
中國聯通	1,254	15,023	0.41%
中信泰富	2,734	37,128	1.00%
中國海洋石油	17,906	249,252	6.73%
東風集團股份	4,299	59,670	1.61%

大成ETF信託基金

大成中証香港中資央企ETF
(大成ETF信託基金子基金)

投資組合(未經審核)(續)
截至二零一四年六月三十日

	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
投資(續)			
上市股本(續)			
香港(續)			
長城汽車	1,065	30,672	0.83%
粵海投資	3,580	32,005	0.86%
工商銀行	68,664	336,454	9.09%
昆侖能源	3,294	42,097	1.14%
聯想集團	8,916	94,331	2.55%
中國人民保險集團公司	11,303	34,587	0.93%
中國石油	22,640	221,646	5.99%
中國財險	3,048	35,784	0.97%
上海實業控股	802	18,927	0.51%
青島啤酒	404	24,482	0.66%
		3,595,290	97.11%
總投資		3,595,290	97.11%
其他淨資產		107,002	2.89%
截至二零一四年六月三十日淨資產		3,702,292	100.00%
以成本計量的總資產		3,832,312	

大成ETF信託基金

大成中証香港中資央企ETF
(大成ETF信託基金子基金)

投資組合變動報表(未經審核)
自二零一四年一月一日至二零一四年六月三十日

持股量

	31.12.2013	添置	公司行動	出售	30.06.2014
投資(97.11%)					
上市股本(97.11%)					
香港(97.11%)					
農業銀行	84,026	-	-	54,778	29,248
中國國航	8,691	-	-	8,691	-
海螺水泥	4,821	-	-	2,894	1,927
中國銀行	287,711	-	-	204,256	83,455
交通銀行	39,245	-	-	28,487	10,758
北京控股	2,262	-	-	1,738	524
華晨中國汽車	10,805	-	-	6,718	4,087
中國信達	-	7,216	-	-	7,216
中信銀行	33,369	-	-	27,299	6,070
中煤能源	15,281	-	-	15,281	-
中國交建	16,187	-	-	9,858	6,329
中國建設銀行	200,629	-	-	147,328	53,301
中國人壽	25,852	-	-	18,301	7,551
蒙牛乳業	4,979	-	-	3,488	1,491
招商銀行	17,121	-	-	12,493	4,628
招商局國際	4,621	-	-	2,814	1,807
中國移動	13,732	1,551	-	10,594	4,689
中國建材	10,983	-	-	10,983	-
中國海外發展	15,322	-	-	11,227	4,095
中國太保	8,167	-	-	6,182	1,985
中國石化	87,743	-	-	61,608	26,135
華潤水泥控股	7,235	-	-	4,364	2,871
華潤創業	4,418	-	-	2,676	1,742
華潤燃氣	3,423	-	-	1,980	1,443
華潤置地	8,810	-	-	5,192	3,618
華潤電力	6,913	-	-	4,262	2,651
中國神華能源	12,537	-	-	9,039	3,498
中國建築國際	7,167	-	-	4,332	2,835
中國電信	50,575	-	-	36,323	14,252
中國聯通	17,094	-	-	15,840	1,254
中信泰富	6,800	-	-	4,066	2,734
中國海洋石油	61,682	-	-	43,776	17,906

大成ETF信託基金

大成中証香港中資央企ETF
(大成ETF信託基金子基金)

投資組合變動報表(未經審核)(續)
自二零一四年一月一日至二零一四年六月三十日

	持股量				
	31.12.2013	添置	公司行動	出售	30.06.2014
投資(續)					
上市股本(續)					
香港(續)					
東風集團股份	10,663	-	-	6,364	4,299
長城汽車	-	1,065	-	-	1,065
粵海投資	9,136	-	-	5,556	3,580
工商銀行	206,989	20,127	-	158,452	68,664
昆侖能源	12,427	-	-	9,133	3,294
聯想集團	22,802	-	-	13,886	8,916
中國人民保險集團公司	28,203	-	-	16,900	11,303
中國石油	72,632	-	-	49,992	22,640
中國財險	12,315	-	-	9,267	3,048
上海實業控股	2,004	-	-	1,202	802
青島啤酒	-	404	-	-	404
	=====	=====	=====	=====	=====
					=

大成ETF信託基金

大成中証香港中資央企ETF
(大成ETF信託基金子基金)

表現記錄 (未經審核)
截至二零一四年六月三十日

淨資產淨值 (交易資產淨值)

截至下列日期財務期間結束時	每單位 資產淨值 港元	子基金 資產淨值 港元
二零一四年六月三十日	7.40	3,702,292
二零一三年十二月三十一日	8.11	12,168,022

最高及最低每單位資產淨值

截至下列日期財務期間結束時	最高每單位 資產淨值 港元	最低每單位 資產淨值 港元
二零一四年六月三十日	8.03	6.81
二零一三年十二月三十一日	9.29	7.03