

易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金 (LOF)

2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：二〇二〇年八月二十八日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	5
2.4	境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5	信息披露方式	6
2.6	其他相关资料	6
3	主要财务指标和基金净值表现	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	7
4	管理人报告	10
4.1	基金管理人及基金经理情况	10
4.2	境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介	13
4.3	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.4	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
4.5	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.6	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
5	托管人报告	16
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
6	半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1	资产负债表	16
6.2	利润表	18
6.3	所有者权益（基金净值）变动表	19
6.4	报表附注	20
7	投资组合报告	41
7.1	期末基金资产组合情况	41
7.2	期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	42
7.3	期末按行业分类的权益投资组合	42
7.4	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	42
7.5	报告期内权益投资组合的重大变动	59
7.6	期末按债券信用等级分类的债券投资组合	62
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	62
7.8	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	62
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	62

7.10	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	62
7.11	投资组合报告附注	62
8	基金份额持有人信息	63
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
8.2	期末上市基金前十名持有人	63
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	64
9	开放式基金份额变动	64
10	重大事件揭示	65
10.1	基金份额持有人大会决议	65
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	65
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	65
10.4	基金投资策略的改变	65
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	65
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	65
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	65
10.8	其他重大事件	69
11	备查文件目录	71
11.1	备查文件目录	71
11.2	存放地点	72
11.3	查阅方式	72

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）	
基金简称	易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）	
场内简称	香港小盘	
基金主代码	161124	
基金运作方式	契约型、上市开放式（LOF）	
基金合同生效日	2016 年 11 月 2 日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	20,214,499.63 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2016 年 11 月 10 日	
下属分级基金的基金简称	易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）A	易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）C
下属分级基金的场内简称	香港小盘	-
下属分级基金的交易代码	161124	006263
报告期末下属分级基金的份额总额	18,028,938.68 份	2,185,560.95 份

注：自 2018 年 8 月 13 日起,本基金增设 C 类份额类别,份额首次确认日为 2018 年 8 月 14 日。

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	易方达恒生综合小型股指数基金（香港小盘 LOF）属于被动跟踪指数的证券投资基金。本基金主要采取完全复制指数的投资方案，剔除基金管理人认定不合适投资的成份股后，完全复制剩余成份股的指数权重进行投资。报告期内，跟随指数的成份股变化进行日常调整操作，控制基金组合与指数权重基本一致。
业绩比较基准	恒生综合小型股指数收益率（使用估值汇率折算）×95%+活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属股票指数基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金主要采用组合复制策略和适当的替代性策略实现对标的指数的紧密跟踪，具有与标的指数相似的风险收益特征。 本基金主要投资香港证券市场，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露	姓名	张南	张燕

负责人	联系电话	020-85102688	0755-83199084
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400 881 8088	95555
传真		020-85104666	0755-83195201
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-42891（集中办公区）	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		510620	518040
法定代表人		刘晓艳	李建红

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	无	The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited
	中文	无	香港上海汇丰银行有限公司
注册地址		无	香港皇后大道中一号
办公地址		无	香港九龙深旺道1号汇丰中心1座6楼
邮政编码		无	无

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
基金中期报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦43楼

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

注：本基金 A 类基金份额的登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司，C 类基金份额的登记结算机构为易方达基金管理有限公司。

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2020年1月1日至2020年6月30日）	
	易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）A	易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）C
本期已实现收益	-1,544,649.94	-198,254.94
本期利润	96,165.09	43,259.79
加权平均基金份额本期利润	0.0044	0.0164
本期加权平均净值利润率	0.40%	1.50%
本期基金份额净值增长率	2.00%	2.09%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)	
	易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）A	易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）C
期末可供分配利润	2,901,508.67	282,723.83
期末可供分配基金份额利润	0.1609	0.1294
期末基金资产净值	20,930,447.35	2,530,222.45
期末基金份额净值	1.1609	1.1577
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)	
	易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）A	易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）C
基金份额累计净值增长率	16.09%	1.28%

注：1.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

3.期末可供分配利润,为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④

过去一个月	7.85%	1.06%	6.97%	1.02%	0.88%	0.04%
过去三个月	13.45%	1.27%	13.01%	1.23%	0.44%	0.04%
过去六个月	2.00%	1.74%	0.81%	1.74%	1.19%	0.00%
过去一年	5.49%	1.34%	0.72%	1.34%	4.77%	0.00%
过去三年	11.29%	1.25%	-2.05%	1.23%	13.34%	0.02%
自基金合同生效起至今	16.09%	1.17%	0.48%	1.16%	15.61%	0.01%

易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	7.83%	1.06%	6.97%	1.02%	0.86%	0.04%
过去三个月	13.39%	1.27%	13.01%	1.23%	0.38%	0.04%
过去六个月	2.09%	1.73%	0.81%	1.74%	1.28%	-0.01%
过去一年	5.45%	1.33%	0.72%	1.34%	4.73%	-0.01%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	1.28%	1.29%	-8.36%	1.28%	9.64%	0.01%

注：自 2018 年 8 月 13 日起,本基金增设 C 类份额类别,份额首次确认日为 2018 年 8 月 14 日,增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

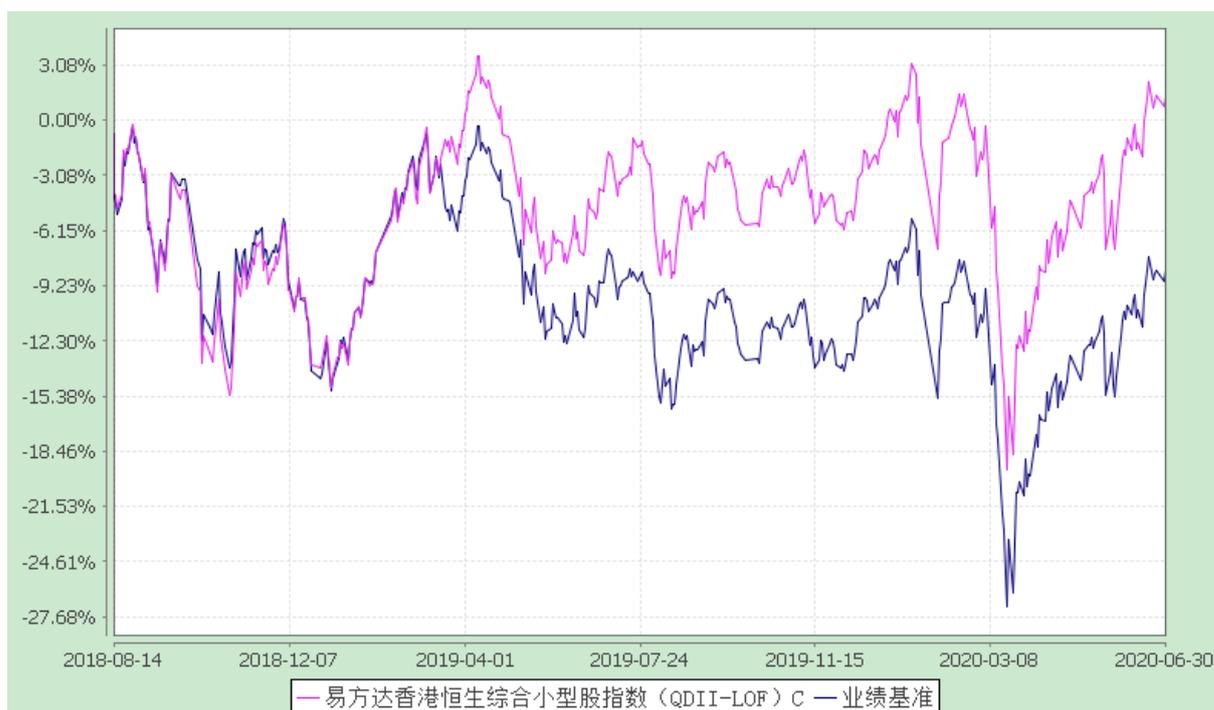
易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）A

（2016 年 11 月 2 日至 2020 年 6 月 30 日）



易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）C

（2018 年 8 月 14 日至 2020 年 6 月 30 日）



注：1.本基金的业绩比较基准已经转换为以人民币计价。

2.自 2018 年 8 月 13 日起,本基金增设 C 类份额类别,份额首次确认日为 2018 年 8 月 14 日,增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.自基金合同生效至报告期末,A 类基金份额净值增长率为 16.09%,同期业绩比较基准收益率为 0.48%。C 类基金份额净值增长率为 1.28%,同期业绩比较基准收益率为-8.36%。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2001]4 号文批准，本基金管理人成立于 2001 年 4 月 17 日，总部设在广州，在北京、上海、香港等地设有分公司或子公司。本基金管理人拥有公募、社保、年金、特定客户资产管理、QDII、基本养老保险基金投资等业务资格，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、混合资产投资、海外投资、多资产投资等领域全面布局，为境内外客户提供包括标准化公募基金与定制化私募产品在内的资产管理解决方案。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张胜记	本基金的基金经理、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理（自 2012 年 08 月 09 日至 2020 年 03 月 17 日）、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理（自 2012 年 08 月 21 日至 2020 年 03 月 17 日）、易方达 50 指数证券投资基金的基金经理、易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基	2016-11-02	2020-03-18	15 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任易方达基金管理有限公司投资经理助理、基金经理助理、行业研究员、指数与量化投资部总经理助理、指数与量化投资部副总经理、指数及增强投资部副总经理、指数投资部总经理、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金（原易方达沪深 300 指数证券投资基金）基金经理、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金基金经理、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、易方达标普医疗保健指数证券投资基金（LOF）基金经理、易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）基金经理、易方达标普生物科技指数证券投资基金（LOF）基金经理、

	金的基金经理、易方达原油证券投资基金（QDII）的基金经理（自2016年12月19日至2020年03月17日）、指数增强投资部联席总经理				易方达标普信息科技指数证券投资基金（LOF）基金经理。
刘树荣	本基金的基金经理、易方达生物科技指数分级证券投资基金的基金经理、易方达并购重组指数分级证券投资基金的基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达银行指数分级证券投资基金的基金经理、易方达中小板指数证券投资基金（LOF）的基金经理、易方达深证100交易型开放式指数基金的基金经理、易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、	2018-08-11	-	13年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任招商银行资产托管部基金会计，易方达基金管理有限公司核算部基金核算专员、指数与量化投资部运作支持专员、基金经理助理、易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金基金经理、易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。

	<p>易方达标普信息科技指数证券投资基金（LOF）的基金经理（自 2018 年 08 月 11 日至 2020 年 04 月 22 日）、易方达标普生物科技指数证券投资基金（LOF）的基金经理（自 2018 年 08 月 11 日至 2020 年 04 月 22 日）、易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）的基金经理、易方达标普医疗保健指数证券投资基金（LOF）的基金经理（自 2018 年 08 月 11 日至 2020 年 04 月 22 日）、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证 800 交易型开放式指数证券</p>				
--	--	--	--	--	--

	<p>投资基金发起式联接基金的基金经理、易方达中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理、易方达中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金的基金经理</p>				
--	--	--	--	--	--

注：1.对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理/基金经理助理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金未聘请境外投资顾问。

4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人努力通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人制定了相应的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，通过投资交易系统内的公平交易模块，同时依据境外市场的交易特点规范交易委托方式，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 59 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为恒生综合小型股指数，恒生综合小型股指数涵盖恒生综合指数成份股总市值的后 5%，成份股市值偏小，企业基本面情况与股价走势同时受国内外经济形势影响。2020 年上半年，受新冠疫情的影响，全球股票市场大幅波动，尤其是 3 月份新冠疫情在海外蔓延后，美国标普 500 指数多次触发熔断，上证指数一度跌至 2647 点。二季度，随着各国陆续出台经济刺激政策对冲疫情的影响，投资者的恐慌情绪得到缓解，全球证券市场开始低位大幅反弹，纳斯达克指数更是突破了疫情前的高点创出新高。国内市场上，随着新冠疫情得到有效的控制和缓解，各行业陆续复工、复产，国内经济在系列政策的刺激和支持下逐步走向复苏，A 股市场开始大幅上扬。行业上，医药、TMT、消费等行业表现较好，大幅战胜市场；而金融、采掘等周期行业仍然受疫情影响较大，涨幅靠后。港股市场二季度也跟随全球市场反弹。今年以来南下资金持续流入港股市场，总额合计约 2700 亿人民币，反映出市场对港股的认可。本报告期，恒生综合小型股指数下跌 1.2%（港币计价），受汇率影响人民币计价收益率上涨 0.7%。

易方达恒生综合小型股指数基金（香港小盘 LOF）属于被动跟踪指数的证券投资基金。报告期内，除基金管理人认为不适合投资的成份股外，本基金跟随指数的成份股变化进行日常调整操作，控制基金组合与指数权重基本一致。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 1.1609 元，本报告期份额净值增长率为 2.00%，同期业绩比较基准收益率为 0.81%；C 类基金份额净值为 1.1577 元，本报告期份额净值增长率为 2.09%，同期业绩比较基准收益率为 0.81%。年化跟踪误差 1.43%，在合同规定的目标控制范围之内。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，稳增长、保就业仍是国内各项政策的出发点，宽财政、松货币等经济刺激政策有望延续。随着生产生活逐步恢复正常，前期政策逐步落地将支持下半年经济逐渐修复，预计下半年 GDP 增速将回归正常区间。

下半年证券市场走势可能难以延续 7 月初的快速上涨行情，波动难免。一方面，国内各种经济刺激政策短时间内退出的概率较低，经济持续修复的大背景下有利于股市向好；另一方面，全球疫情依然严重，疫情爆发以来中美之间的冲突加剧，外部不确定性对证券市场走势仍是一大影响。香港市场上，虽然南下资金持续流入，但港股受外围不确定性影响更大。作为被动投资的基金，本基金将坚持既定的指数化投资策略，以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为投资目标，致力于为投资者提供分享中国经济增长的优质指数产品。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）A:本报告期内未实施利润分配。

易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）C:本报告期内未实施利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期，本基金均存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

本报告期，本基金均存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。基金资产净值的下滑主要受市场环境的影响，基金管理人已按照法律法规及《基金合同》的有关规定向中国证监会报送《关于易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）终止基金合同并召开基金份额持有人大会的请示》，拟召开基金份额持有人大会审议终止本基金《基金合同》等事项。请投资者关注相关风险。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	1,845,662.72	2,126,316.97
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	21,826,559.71	30,896,286.47
其中：股票投资		21,826,559.71	30,896,286.47
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	80.47	111.45
应收股利		194,185.82	30,602.72
应收申购款		85,404.50	78,319.71
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		23,951,893.22	33,131,637.32
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		300,758.96	244,413.20
应付管理人报酬		15,462.92	21,928.14
应付托管费		4,832.15	6,852.55
应付销售服务费		423.74	459.96
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	169,745.65	124,079.21
负债合计		491,223.42	397,733.06
所有者权益：		-	-

实收基金	6.4.7.9	20,214,499.63	28,771,235.52
未分配利润	6.4.7.10	3,246,170.17	3,962,668.74
所有者权益合计		23,460,669.80	32,733,904.26
负债和所有者权益总计		23,951,893.22	33,131,637.32

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.1609 元，C 类基金份额净值 1.1577 元；基金份额总额 20,214,499.63 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 18,028,938.68 份，C 类基金份额总额 2,185,560.95 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		440,235.29	3,966,691.32
1.利息收入		2,775.92	4,509.97
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,775.92	4,509.97
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,490,525.46	2,565,804.72
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-1,959,731.09	1,737,197.20
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	13,620.02
股利收益	6.4.7.16	469,205.63	814,987.50
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,882,329.76	1,459,902.03
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		34,794.04	-75,545.12
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	10,861.03	12,019.72
减：二、费用		300,810.41	358,342.48
1. 管理人报酬		106,776.62	142,715.00
2. 托管费		33,367.70	44,598.48
3. 销售服务费		2,838.99	449.56
4. 交易费用	6.4.7.19	36,005.85	44,790.81
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	52.35
7. 其他费用	6.4.7.20	121,821.25	125,736.28
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		139,424.88	3,608,348.84
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		139,424.88	3,608,348.84

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2020年1月1日至2020年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	28,771,235.52	3,962,668.74	32,733,904.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	139,424.88	139,424.88
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-8,556,735.89	-855,923.45	-9,412,659.34
其中：1.基金申购款	8,302,222.67	941,061.78	9,243,284.45
2.基金赎回款	-16,858,958.56	-1,796,985.23	-18,655,943.79
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	20,214,499.63	3,246,170.17	23,460,669.80
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	41,112,371.74	275,959.13	41,388,330.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,608,348.84	3,608,348.84
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-12,506,461.91	-1,010,410.64	-13,516,872.55
其中：1.基金申购款	4,329,893.35	428,021.49	4,757,914.84
2.基金赎回款	-16,836,355.26	-1,438,432.13	-18,274,787.39
四、本期向基金份额持有人	-	-	-

分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	28,605,909.83	2,873,897.33	31,479,807.16

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：邱毅华

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]2434 号《关于准予易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金(LOF)注册的批复》和证券基金机构监管部函[2016]2193 号《关于易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金(LOF)延期募集备案的回函》进行募集，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金(LOF)基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2016 年 11 月 2 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 399,318,394.11 份基金份额，其中认购资金利息折合 86,452.09 份基金份额。本基金为契约型、上市开放式型基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司，境外资产托管人为香港上海汇丰银行有限公司。自 2018 年 8 月 13 日起,本基金增设 C 类份额类别,份额首次确认日为 2018 年 8 月 14 日。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金(LOF)基金合同》和财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及

本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关境内外财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区

税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(4) 基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	1,845,662.72
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	1,845,662.72

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	21,110,387.53	21,826,559.71	716,172.18
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-

其他	-	-	-
合计	21,110,387.53	21,826,559.71	716,172.18

注：“股票”包括普通股、存托凭证和优先股等。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	80.47
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	80.47

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末无应付交易费用。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	288.69
预提费用	114,642.76
其他应付款	54,814.20
合计	169,745.65

6.4.7.9 实收基金

易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）A

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	26,398,272.12	26,398,272.12
本期申购	4,340,709.75	4,340,709.75
本期赎回（以“-”号填列）	-12,710,043.19	-12,710,043.19
本期末	18,028,938.68	18,028,938.68

易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）C

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	2,372,963.40	2,372,963.40
本期申购	3,961,512.92	3,961,512.92
本期赎回（以“-”号填列）	-4,148,915.37	-4,148,915.37
本期末	2,185,560.95	2,185,560.95

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	9,632,445.83	-5,987,690.38	3,644,755.45

本期利润	-1,544,649.94	1,640,815.03	96,165.09
本期基金份额交易产生的变动数	-2,838,485.06	1,999,073.19	-839,411.87
其中：基金申购款	1,517,528.71	-1,029,757.31	487,771.40
基金赎回款	-4,356,013.77	3,028,830.50	-1,327,183.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,249,310.83	-2,347,802.16	2,901,508.67

单位：人民币元

易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	484,000.43	-166,087.14	317,913.29
本期利润	-198,254.94	241,514.73	43,259.79
本期基金份额交易产生的变动数	-3,021.66	-13,489.92	-16,511.58
其中：基金申购款	739,419.03	-286,128.65	453,290.38
基金赎回款	-742,440.69	272,638.73	-469,801.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	282,723.83	61,937.67	344,661.50

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	2,660.44
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	115.48
合计	2,775.92

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	14,537,053.04
减：卖出股票成本总额	16,496,784.13
买卖股票差价收入	-1,959,731.09

6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	469,205.63
基金投资产生的股利收益	-
合计	469,205.63

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1.交易性金融资产	1,882,329.76
——股票投资	1,882,329.76
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
——期货投资	-
——期权投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	1,882,329.76

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	10,861.03
其他	-
合计	10,861.03

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	36,005.85
银行间市场交易费用	-
其他	-
合计	36,005.85

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	9,944.48
信息披露费	24,863.02
银行汇划费	1,694.45
上市费	29,835.26
指数使用费	54,814.20
其他	669.84
合计	121,821.25

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系**6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)	基金托管人、基金销售机构
香港上海汇丰银行有限公司(以下简称“汇丰银行”)	境外资产托管人

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	106,776.62	142,715.00
其中：支付销售机构的客户维护费	24,842.32	32,191.72

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人在次月初 3 个工作日内出具资金划拨指令，基金托管人复核无误后于 2 个工作日内进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6 月30日
----	--------------------------------	-------------------------------------

当期发生的基金应支付的托管费	33,367.70	44,598.48
----------------	-----------	-----------

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人在次月初 3 个工作日内出具资金划拨指令，基金托管人复核无误后于 2 个工作日内进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）A	易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）C	合计
易方达基金管理有限公司	-	1,373.51	1,373.51
合计	-	1,373.51	1,373.51
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）A	易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）C	合计
易方达基金管理有限公司	-	449.56	449.56
合计	-	449.56	449.56

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.20%，按 C 类份额前一日基金资产净值的 0.20% 年费率计提。销售服务费的计算方法如下

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）A**

无。

易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）C

无。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2020年1月1日至2020年6月30日	2019年1月1日至2019年6月30日	2019年1月1日至2019年6月30日	2019年1月1日至2019年6月30日
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行-活期存款	655,609.00	2,653.05	464,791.08	3,526.80
汇丰银行-活期存款	1,190,053.72	7.39	1,520,276.54	946.84

注：本基金的上述银行存款由基金托管人招商银行股份有限公司和香港上海汇丰银行有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明**

无。

6.4.11 利润分配情况**易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）A**

本报告期内未发生利润分配。

易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）C

本报告期内未发生利润分配。

6.4.12 期末（2020年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。

从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、投资部门总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察合规管理部门、集中交易室、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理 and 事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

本基金属股票指数基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金主要采用完全复制法跟踪恒生综合小型股指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金主要投资香港证券市场上市企业，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人通过严格的备选

库制度、对交易对手（包括存款银行）、证券发行人的信用评级进行跟踪，和分散化投资方式防范信用风险。

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00%(2019 年 12 月 31 日：0.00%)。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全覆盖、多维度以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，投资风险管理部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

于 2020 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开

募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，期末除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

6.4.13.4 市场风险

本基金投资于海外市场，面临海外市场波动带来的风险。影响金融市场波动的因素比较复杂，包括经济发展、政策变化、资金供求、公司盈利的变化、利率汇率波动等，都将影响基金净值的升降。此外，本基金主要投资的香港证券市场对每日证券交易价格并无涨跌幅上下限的规定，因此香港证券市场证券的每日涨跌幅空间相对较大。这一因素可能会带来市场的急剧下跌，从而带来投资风险的增加。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。投资管理人通过久期、凸度、VAR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,845,662.72	-	-	-	1,845,662.72
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	21,826,559.71	21,826,559.71
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	80.47	80.47
应收股利	-	-	-	194,185.82	194,185.82

应收申购款	13,261.28	-	-	72,143.22	85,404.50
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,858,924.00	-	-	22,092,969.22	23,951,893.22
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	300,758.96	300,758.96
应付管理人报酬	-	-	-	15,462.92	15,462.92
应付托管费	-	-	-	4,832.15	4,832.15
应付销售服务费	-	-	-	423.74	423.74
应付交易费用	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	169,745.65	169,745.65
负债总计	-	-	-	491,223.42	491,223.42
利率敏感度缺口	1,858,924.00	-	-	21,601,745.80	23,460,669.80
上年度末 2019 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,126,316.97	-	-	-	2,126,316.97
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	30,896,286.47	30,896,286.47
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	111.45	111.45
应收股利	-	-	-	30,602.72	30,602.72
应收申购款	529.00	-	-	77,790.71	78,319.71
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-

资产总计	2,126,845.97	-	-	31,004,791.35	33,131,637.32
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	244,413.20	244,413.20
应付管理人报酬	-	-	-	21,928.14	21,928.14
应付托管费	-	-	-	6,852.55	6,852.55
应付销售服务费	-	-	-	459.96	459.96
应付交易费用	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	124,079.21	124,079.21
负债总计	-	-	-	397,733.06	397,733.06
利率敏感度缺口	2,126,845.97	-	-	30,607,058.29	32,733,904.26

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末本基金未持有交易性债券投资(不包括可转债)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金投资于海外市场，海外市场金融品种以外币计价，如果所投资市场的货币相对于人民币贬值，将对基金收益产生不利影响；外币对人民币的汇率大幅波动也将加大基金净值波动的幅度。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计

以外币计价的资产				
银行存款	-	1,281,549.57	-	1,281,549.57
结算备付金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	21,826,559.71	-	21,826,559.71
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
应收利息	-	1.04	-	1.04
应收股利	-	194,185.82	-	194,185.82
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	23,302,296.14	-	23,302,296.14
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	23,302,296.14	-	23,302,296.14
项目	上年度末			
	2019年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	1,854,427.10	-	1,854,427.10
结算备付金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	30,896,286.47	-	30,896,286.47
衍生金融资产	-	-	-	-

应收证券清算款	-	-	-	-
应收利息	-	1.72	-	1.72
应收股利	-	30,602.72	-	30,602.72
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	32,781,318.01	-	32,781,318.01
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	32,781,318.01	-	32,781,318.01

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外其他因素保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
	假设人民币对一揽子货币平均升值5%	-1,165,114.81	-1,639,065.90
	假设人民币对一揽子货币平均贬值5%	1,165,114.81	1,639,065.90

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VAR 等指标，监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	21,826,559.71	93.03	30,896,286.47	94.39
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	21,826,559.71	93.03	30,896,286.47	94.39

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	1,091,327.98	1,544,814.31
	2.业绩比较基准下降 5%	-1,091,327.98	-1,544,814.31

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 21,826,559.71 元，无属于第二层次的余额，无属于第三层次的余额(2019 年 12 月 31 日：第一层次 30,629,218.63 元，第二层次 223,801.67 元，第三层次 43,266.17 元)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

于 2020 年 6 月 30 日，本基金无第三层次金融工具 (2019 年 12 月 31 日：43,266.17 元)。

上述第三层次资产变动如下：

	交易性金融资产
	权益工具投资
2020 年 1 月 1 日	43,266.17
购买	-
出售	28,472.66
转入第三层级	53,568.42
转出第三层级	-
当期利得或损失总额	-68,361.93
计入损益的利得或损失	-68,361.93
2020 年 6 月 30 日	-
2020 年 6 月 30 日仍持有的资产计入 2020 年度损益的未实现利得或损失的变动(从年/期初起算/从转入第三层次起算)	
——公允价值变动损益	-

	交易性金融资产
	权益工具投资
2019 年 1 月 1 日	381,217.10
购买	-
出售	538,167.48
转入第三层级	24,971.70
转出第三层级	-

当期利得或损失总额	175,244.86
计入损益的利得或损失	175,244.86
2019 年 12 月 31 日	43,266.17
2019 年 12 月 31 日仍持有的资产计入 2019 年度损益的未实现利得或损失的变动(从年/期初起算/从转入第三层次起算) ——公允价值变动损益	-152,038.81

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

由于上述股票估值相关的公司盈利预期及市盈率是不可观察输入值，故分类为第三层级。如果相关证券的盈利预期及市盈率变动，将导致公允价值的正相关变动。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2019 年 12 月 31 日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	21,826,559.71	91.13
	其中：普通股	21,560,533.29	90.02
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	266,026.42	1.11
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-

5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,845,662.72	7.71
8	其他各项资产	279,670.79	1.17
9	合计	23,951,893.22	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
中国香港	21,826,559.71	93.03
合计	21,826,559.71	93.03

注：1.国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定。

2.ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
能源	242,266.98	1.03
材料	1,992,018.57	8.49
工业	3,036,853.24	12.94
非必需消费品	3,832,911.12	16.34
必需消费品	283,039.26	1.21
保健	4,031,119.20	17.18
金融	971,935.70	4.14
信息技术	1,537,694.94	6.55
电信服务	1,425,893.12	6.08
公用事业	1,055,566.89	4.50
房地产	3,417,260.69	14.57
合计	21,826,559.71	93.03

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证 券市场	所属国家 (地区)	数量（股）	公允价值	占基金资 产净值比
----	--------------	--------------	------	------------	--------------	-------	------	--------------

								例（%）
1	MicroPort Scientific Corporation	微创医疗科学有限公司	853 HK	香港证券交易所	中国香港	32,000	911,978.50	3.89
2	WuXi Apptec Co., Ltd.	无锡药明康德新药开发股份有限公司	2359 HK	香港证券交易所	中国香港	7,823	719,586.20	3.07
3	A-Living Services Co., Ltd.	雅居乐雅生活服务股份有限公司	3319 HK	香港证券交易所	中国香港	14,000	499,377.65	2.13
4	Weimob Inc.	微盟集团	2013 HK	香港证券交易所	中国香港	53,041	471,416.27	2.01
5	Ak Medical Holdings Limited	爱康医疗控股有限公司	1789 HK	香港证券交易所	中国香港	20,000	450,325.92	1.92
6	HKBN Ltd.	香港宽频有限公司	1310 HK	香港证券交易所	中国香港	35,500	439,711.75	1.87
7	China Overseas Property Holdings Limited	中海物业集团有限公司	2669 HK	香港证券交易所	中国香港	51,544	386,075.28	1.65
8	Poly Property Development Co., Ltd.	保利物业发展股份有限公司	6049 HK	香港证券交易所	中国香港	5,400	384,740.93	1.64
9	Koolearn Technology Holding Limited	新东方在线科技控股有限公司	1797 HK	香港证券交易所	中国香港	13,500	383,507.78	1.63
10	Tianneng Power International Ltd	天能动力国际有限公司	819 HK	香港证券交易所	中国香港	28,712	346,192.30	1.48
11	Chinasoft International Ltd.	中软国际有限公司	354 HK	香港证券交易所	中国香港	81,466	315,516.64	1.34

12	Zhaojin Mining Industry Company Limited	招金矿业股份有限公司	1818 HK	香港证券交易所	中国香港	38,134	315,239.74	1.34
13	China Yuhua Education Corporation Limited	中国宇华教育集团有限公司	6169 HK	香港证券交易所	中国香港	52,000	302,092.88	1.29
14	China Grand Pharmaceutical and Healthcare Holding Limited	远大医药健康控股有限公司	512 HK	香港证券交易所	中国香港	60,000	298,146.82	1.27
15	Shandong Gold Mining Co.,Ltd.	山东黄金矿业股份有限公司	1787 HK	香港证券交易所	中国香港	18,817	282,917.78	1.21
16	Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co., Ltd.	中联重科股份有限公司	1157 HK	香港证券交易所	中国香港	49,600	270,480.55	1.15
17	Fu Shou Yuan International Group Limited	福寿园国际集团有限公司	1448 HK	香港证券交易所	中国香港	41,480	268,636.49	1.15
18	Gemdale Properties and Investment Corporation Limited	金地商置集团有限公司	535 HK	香港证券交易所	中国香港	202,000	263,856.28	1.12
19	China Overseas	中国海外宏洋集团	81 HK	香港证券交易所	中国香港	62,000	247,487.43	1.05

	Grand Oceans Group Limited	有限公司		所				
20	CSC Financial Co Ltd	中信建投证券股份有限公司	6066 HK	香港证券交易所	中国香港	29,596	237,089.67	1.01
21	Huadian Fuxin Energy Corporation Limited	华电福新能源股份有限公司	816 HK	香港证券交易所	中国香港	94,765	214,674.11	0.92
22	Livzon Pharmaceutical Group Inc.	丽珠医药集团股份有限公司	1513 HK	香港证券交易所	中国香港	5,770	206,078.46	0.88
23	China SCE Group Holdings Limited	中骏集团控股有限公司	1966 HK	香港证券交易所	中国香港	65,584	201,287.68	0.86
24	IGG Inc	-	799 HK	香港证券交易所	中国香港	34,680	200,839.15	0.86
25	Yadea Group Holdings Ltd.	雅迪集团控股有限公司	1585 HK	香港证券交易所	中国香港	41,096	200,832.21	0.86
26	Shenzhen Expressway Company Limited	深圳高速公路股份有限公司	548 HK	香港证券交易所	中国香港	27,840	199,372.53	0.85
27	Shanghai Electric Group Company Limited	上海电气集团股份有限公司	2727 HK	香港证券交易所	中国香港	98,898	198,742.26	0.85
28	Yuexiu Transport Infrastructure Limited	越秀交通基建有限公司	1052 HK	香港证券交易所	中国香港	39,357	194,490.90	0.83

29	COSCO SHIPPING Holdings Co.,Ltd.	中远海运控股股份有限公司	1919 HK	香港证券交易所	中国香港	91,500	186,382.86	0.79
30	CMGE Technology Group Limited	中手游科技集团有限公司	302 HK	香港证券交易所	中国香港	55,379	180,589.86	0.77
31	China Water Affairs Group Limited	中国水务集团有限公司	855 HK	香港证券交易所	中国香港	34,587	176,289.77	0.75
32	Genertec Universal Medical Group Company Limited	通用环球医疗集团有限公司	2666 HK	香港证券交易所	中国香港	39,500	168,858.52	0.72
33	Xinjiang Goldwind Science & Technology Co., Ltd	新疆金风科技股份有限公司	2208 HK	香港证券交易所	中国香港	27,820	168,735.02	0.72
34	E-House (China) Enterprise Holdings Limited	易居(中国)企业控股有限公司	2048 HK	香港证券交易所	中国香港	20,400	168,452.95	0.72
35	Xiabuxiabu Catering Management (China) Holdings Co., Ltd.	呷哺呷哺餐饮管理(中国)控股有限公司	520 HK	香港证券交易所	中国香港	23,941	167,076.62	0.71
36	Sinopec Engineering (Group) Co., Ltd.	中石化炼化工程(集团)股份有限公司	2386 HK	香港证券交易所	中国香港	52,500	158,253.48	0.67
37	Viva Biotech Holdings	维亚生物科技控股集团	1873 HK	香港证券交易所	中国香港	19,930	158,018.18	0.67

38	Value Partners Group Limited	惠理集团有限公司	806 HK	香港证券交易所	中国香港	44,000	157,952.04	0.67
39	The United Laboratories International Holdings Ltd	联邦制药国际控股有限公司	3933 HK	香港证券交易所	中国香港	25,797	157,878.88	0.67
40	China Kepei Education Group Limited	中国科培教育集团有限公司	1890 HK	香港证券交易所	中国香港	27,454	156,484.11	0.67
41	China South City Holdings Limited	华南城控股有限公司	1668 HK	香港证券交易所	中国香港	216,000	155,869.40	0.66
42	Lonking Holdings Limited	中国龙工控股有限公司	3339 HK	香港证券交易所	中国香港	71,000	152,407.46	0.65
43	C&D International Investment Group Limited	建发国际投资集团有限公司	1908 HK	香港证券交易所	中国香港	13,839	152,198.80	0.65
44	Yichang Hec Changjiang Pharmaceutical Co., Ltd.	宜昌东阳光长江药业股份有限公司	1558 HK	香港证券交易所	中国香港	10,400	150,476.45	0.64
45	Cofco Meat Holdings Limited	中粮肉食控股有限公司	1610 HK	香港证券交易所	中国香港	63,546	148,596.37	0.63
46	Xd Inc.	心动有限公司	2400 HK	香港证券交易所	中国香港	5,400	146,990.76	0.63

47	Q Technology (Group) Company Limited	丘钛科技 (集团)有限 公司	1478 HK	香港证 券交易 所	中国香港	15,882	146,523.27	0.62
48	Skyworth Group Limited	创维集团 有限公司	751 HK	香港证 券交易 所	中国香港	72,002	142,719.83	0.61
49	Shun Tak Holdings Ltd.	信德集团 有限公司	242 HK	香港证 券交易 所	中国香港	53,305	140,229.85	0.60
50	Frontage Holdings Corporati on	方达控股 公司	1521 HK	香港证 券交易 所	中国香港	31,626	138,664.58	0.59
51	Stella Internatio nal Holdings Ltd	九兴控股 有限公司	1836 HK	香港证 券交易 所	中国香港	19,000	137,975.11	0.59
52	Redco Properties Group Limited	力高地产 集团有限 公司	1622 HK	香港证 券交易 所	中国香港	41,772	136,599.25	0.58
53	COSCO SHIPPIN G Energy Transport ation Co., Ltd.	中远海运 能源运输 股份有限 公司	1138 HK	香港证 券交易 所	中国香港	43,188	136,495.78	0.58
54	Pacific textiles holdings Limited	互太纺织 控股有限 公司	1382 HK	香港证 券交易 所	中国香港	39,206	133,938.11	0.57
55	Citic Telecom Internatio nal Holdings Limited	中信国际 电讯集团 有限公司	1883 HK	香港证 券交易 所	中国香港	59,559	133,832.79	0.57
56	Fufeng Group Ltd	阜丰集团 有限公司	546 HK	香港证 券交易 所	中国香港	59,000	133,115.61	0.57
57	Tong Ren	北京同仁	1666 HK	香港证	中国香港	24,648	132,610.22	0.57

	Tang Technologies Co. Limited	堂科技发展股份有限公司		券交易所				
58	China New Higher Education Group Limited	中国新高教集团有限公司	2001 HK	香港证券交易所	中国香港	28,209	131,928.21	0.56
59	NetDragon Websoft Holdings Limited	网龙网络控股有限公司	777 HK	香港证券交易所	中国香港	6,628	131,680.60	0.56
60	Guangzhou Baiyunshan Pharmaceutical Holdings Company Limited	广州白云山医药集团股份有限公司	874 HK	香港证券交易所	中国香港	7,328	130,928.54	0.56
61	Sany Heavy Equipment International Holdings Company Limited	三一重装国际控股有限公司	631 HK	香港证券交易所	中国香港	39,548	129,687.76	0.55
62	Shougang Fushan Resources Group Limited	首钢福山资源集团有限公司	639 HK	香港证券交易所	中国香港	87,536	129,533.39	0.55
63	Huadian Power International Corporation Limited	华电国际电力股份有限公司	1071 HK	香港证券交易所	中国香港	63,324	128,989.16	0.55
64	Sunlight	阳光房地	435 HK	香港证	中国香港	35,939	126,388.26	0.54

	Real Estate Investment Trust	产投资信托基金		券交易所				
65	Sinic Holdings (Group) Company Limited	新力控股(集团)有限公司	2103 HK	香港证券交易所	中国香港	33,000	124,794.17	0.53
66	China Resources Medical Holdings Company Limited	华润医疗控股有限公司	1515 HK	香港证券交易所	中国香港	30,543	123,314.45	0.53
67	Dongyue Group Limited	东岳集团有限公司	189 HK	香港证券交易所	中国香港	42,533	122,381.73	0.52
68	Shenwan Hongyuan Group Co.,Ltd.	申万宏源集团股份有限公司	6806 HK	香港证券交易所	中国香港	62,400	121,977.12	0.52
69	Maanshan Iron & Steel Company Limited	马鞍山钢铁股份有限公司	323 HK	香港证券交易所	中国香港	63,939	121,481.24	0.52
70	Asia Cement (China) Holdings Corporation	亚洲水泥(中国)控股公司	743 HK	香港证券交易所	中国香港	17,428	120,987.69	0.52
71	Digital China Holdings Ltd.	神州数码控股有限公司	861 HK	香港证券交易所	中国香港	26,208	119,936.57	0.51
72	Chow Sang Sang Holdings International Ltd.	周生生集团国际有限公司	116 HK	香港证券交易所	中国香港	15,935	119,502.02	0.51
73	Xinyi Energy Holdings	信义能源控股有限公司	3868 HK	香港证券交易所	中国香港	52,946	118,489.34	0.51

	Limited							
74	Metallurgical Corporation of China Ltd.	中国冶金科工股份有限公司	1618 HK	香港证券交易所	中国香港	104,000	116,847.24	0.50
75	China Maple Leaf Educational Systems Limited	中国枫叶教育集团有限公司	1317 HK	香港证券交易所	中国香港	54,000	116,408.79	0.50
76	Sinotrans Limited	中国外运股份有限公司	598 HK	香港证券交易所	中国香港	78,000	111,859.86	0.48
77	Orient Securities Company Limited	东方证券股份有限公司	3958 HK	香港证券交易所	中国香港	28,200	110,248.55	0.47
78	TCL Electronics Holdings Limited	TCL 电子控股有限公司	1070 HK	香港证券交易所	中国香港	31,525	109,137.58	0.47
79	BBMG Corporation	北京金隅集团股份有限公司	2009 HK	香港证券交易所	中国香港	79,106	109,110.46	0.47
80	Xtep International Holdings Limited	特步国际控股有限公司	1368 HK	香港证券交易所	中国香港	45,250	106,639.55	0.45
81	Sinopec Kantons Holdings Ltd.	中石化冠德控股有限公司	934 HK	香港证券交易所	中国香港	38,988	105,771.20	0.45
82	West China Cement Limited	中国西部水泥有限公司	2233 HK	香港证券交易所	中国香港	79,234	102,049.46	0.43
83	Datang Internatio	大唐国际发电股份	991 HK	香港证	中国香港	109,783	101,282.99	0.43

	nal Power Generation Co.,Ltd.	有限公司		所				
84	Dexin China Holdings Company Limited	德信中国控股有限公司	2019 HK	香港证券交易所	中国香港	35,067	100,899.54	0.43
85	Tiangong International Company Limited	天工国际有限公司	826 HK	香港证券交易所	中国香港	44,000	100,478.40	0.43
86	China Harmony Auto Holding Ltd	中国和谐新能源汽车控股有限公司	3836 HK	香港证券交易所	中国香港	28,367	99,759.48	0.43
87	Prosperity REIT	泓富产业信托	808 HK	香港证券交易所	中国香港	47,000	99,172.18	0.42
88	Central China Real Estate Ltd	建业地产股份有限公司	832 HK	香港证券交易所	中国香港	30,000	98,925.55	0.42
89	GCL-Poly Energy Holdings Limited	保利协鑫能源控股有限公司	3800 HK	香港证券交易所	中国香港	494,000	98,821.42	0.42
90	Road King Infrastructure Ltd.	路劲基建有限公司	1098 HK	香港证券交易所	中国香港	10,282	98,428.06	0.42
91	VSTECS Holdings Limited	伟仕佳杰控股有限公司	856 HK	香港证券交易所	中国香港	25,640	97,898.11	0.42
92	China Tian Lun Gas Holdings Limited	中国天伦燃气控股有限公司	1600 HK	香港证券交易所	中国香港	18,000	97,336.17	0.41
93	Vpower Group Internatio	伟能集团国际控股有限公司	1608 HK	香港证券交易所	中国香港	25,000	96,596.28	0.41

	nal Holdings Limited							
94	iDreamSky Technology Holdings Limited	创梦天地科技控股有限公司	1119 HK	香港证券交易所	中国香港	21,200	96,243.69	0.41
95	Beijing Tong Ren Tang Chinese Medicine Company Limited	北京同仁堂国药有限公司	3613 HK	香港证券交易所	中国香港	9,845	93,885.01	0.40
96	Angang Steel Company Limited	鞍钢股份有限公司	347 HK	香港证券交易所	中国香港	53,339	92,084.53	0.39
97	Yangtze Optical Fibre and Cable Joint Stock Limited Company	长飞光纤光缆股份有限公司	6869 HK	香港证券交易所	中国香港	6,891	89,633.89	0.38
98	China Foods Limited	中国食品有限公司	506 HK	香港证券交易所	中国香港	32,899	88,350.71	0.38
99	C-Mer Eye Care Holdings Limited	希玛眼科医疗控股有限公司	3309 HK	香港证券交易所	中国香港	14,478	87,812.57	0.37
100	PAX Global Technology Limited	百富环球科技有限公司	327 HK	香港证券交易所	中国香港	27,847	85,721.22	0.37
101	Redsun Properties Group Limited	弘阳地产集团有限公司	1996 HK	香港证券交易所	中国香港	36,000	83,524.95	0.36
102	Bank of Chongqing	重庆银行股份有限公司	1963 HK	香港证券交易所	中国香港	23,262	82,443.95	0.35

	g Co., Ltd.	公司		所				
103	China Travel International Investment Hong Kong Ltd.	香港中旅国际投资有限公司	308 HK	香港证券交易所	中国香港	80,825	81,211.67	0.35
104	China Dongxian Group Co., Ltd.	中国动向(集团)有限公司	3818 HK	香港证券交易所	中国香港	127,459	80,334.04	0.34
105	Sheng Ye Capital Limited	盛业资本有限公司	6069 HK	香港证券交易所	中国香港	13,811	79,982.40	0.34
106	China High Speed Transmission Equipment Group Co., Ltd.	中国高速传动设备集团有限公司	658 HK	香港证券交易所	中国香港	19,233	79,056.86	0.34
107	Citychamp Watch & Jewellery Group Limited	冠城钟表珠宝集团有限公司	256 HK	香港证券交易所	中国香港	55,715	78,883.08	0.34
108	Zhuguang Holdings Group Company Limited	珠光控股集团有限公司	1176 HK	香港证券交易所	中国香港	78,617	77,556.87	0.33
109	China Everbright Greentech Limited	中国光大绿色环保有限公司	1257 HK	香港证券交易所	中国香港	27,350	76,196.88	0.32
110	Greenland Hong Kong Holdings Limited	绿地香港控股有限公司	337 HK	香港证券交易所	中国香港	30,000	75,084.77	0.32

111	Canvest Environmental Protection Group Company Limited	粤丰环保电力有限公司	1381 HK	香港证券交易所	中国香港	23,910	74,257.19	0.32
112	Haitong UniTrust International Leasing Co.,Ltd.	海通恒信国际租赁股份有限公司	1905 HK	香港证券交易所	中国香港	54,000	73,988.64	0.32
113	Greatview Aseptic Packaging Company Limited	纷美包装有限公司	468 HK	香港证券交易所	中国香港	29,450	73,708.21	0.31
114	China Risun Group Limited	中国旭阳集团有限公司	1907 HK	香港证券交易所	中国香港	37,087	71,818.71	0.31
115	Guangshen Railway Company Limited	广深铁路股份有限公司	525 HK	香港证券交易所	中国香港	54,114	71,673.34	0.31
116	Fantasia Holdings Group Co., Limited	花样年控股集团有限公司	1777 HK	香港证券交易所	中国香港	54,000	71,522.35	0.30
117	China Lilang Limited	中国利郎有限公司	1234 HK	香港证券交易所	中国香港	18,779	71,358.52	0.30
118	Wisdom Education International Holdings Company Limited	睿见教育国际控股有限公司	6068 HK	香港证券交易所	中国香港	24,077	70,157.33	0.30
119	Tongda Group Holdings Ltd.	通达集团控股有限公司	698 HK	香港证券交易所	中国香港	165,119	69,380.10	0.30

120	Glory Sun Financial Group Limited	宝新金融集团有限公司	1282 HK	香港证券交易所	中国香港	272,000	68,325.31	0.29
121	Red Star Macalline Group Corporation Ltd.	红星美凯龙家居集团股份有限公司	1528 HK	香港证券交易所	中国香港	17,193	68,158.72	0.29
122	CGN New Energy Holdings Co., Ltd.	中国广核新能源控股有限公司	1811 HK	香港证券交易所	中国香港	50,000	68,051.28	0.29
123	Jinchuan Group International Resources Co. Ltd	金川集团国际资源有限公司	2362 HK	香港证券交易所	中国香港	112,592	67,878.38	0.29
124	Huifu Payment Limited	汇付天下有限公司	1806 HK	香港证券交易所	中国香港	32,400	67,773.59	0.29
125	Impro Precision Industries Limited	鹰普精密工业有限公司	1286 HK	香港证券交易所	中国香港	27,000	65,849.89	0.28
126	Sun Hung Kai & Co. Ltd.	新鸿基有限公司	86 HK	香港证券交易所	中国香港	23,474	65,183.96	0.28
127	China BlueChemical Ltd.	中海石油化学股份有限公司	3983 HK	香港证券交易所	中国香港	61,960	65,086.25	0.28
128	Texhong Textile Group Limited	天虹纺织集团有限公司	2678 HK	香港证券交易所	中国香港	10,761	60,943.07	0.26
129	China Merchants Land Limited	招商局置地有限公司	978 HK	香港证券交易所	中国香港	53,693	58,363.95	0.25
130	Shanghai Industrial Urban Developm	上海实业城市开发集团有限公司	563 HK	香港证券交易所	中国香港	71,372	58,022.70	0.25

	ent Group Limited							
131	Sa Sa International Holdings Ltd.	莎莎国际控股有限公司	178 HK	香港证券交易所	中国香港	48,664	57,787.14	0.25
132	Jnby Design Limited	江南布衣有限公司	3306 HK	香港证券交易所	中国香港	8,135	57,737.58	0.25
133	Colour Life Services Group Co., Limited	彩生活服务集团有限公司	1778 HK	香港证券交易所	中国香港	16,733	56,552.99	0.24
134	China Aircraft Leasing Group Holdings Limited	中国飞机租赁集团控股有限公司	1848 HK	香港证券交易所	中国香港	9,293	53,393.28	0.23
135	Truly International Holdings Ltd.	信利国际有限公司	732 HK	香港证券交易所	中国香港	72,000	53,271.82	0.23
136	China Shineway Pharmaceutical Group Ltd	中国神威药业集团有限公司	2877 HK	香港证券交易所	中国香港	11,347	52,964.15	0.23
137	Giordano International Ltd.	佐丹奴国际有限公司	709 HK	香港证券交易所	中国香港	49,508	52,910.43	0.23
138	SmarTone Telecommunications Holdings Ltd.	数码通电讯集团有限公司	315 HK	香港证券交易所	中国香港	13,192	50,007.92	0.21
139	CSSC Offshore & Marine Engineering	中船海洋与防务装备股份有限公司	317 HK	香港证券交易所	中国香港	10,445	49,612.58	0.21

	(Group) Company Limited							
140	Consun Pharmace utical Group Limited	康臣药业 集团有限 公司	1681 HK	香港证 券交易 所	中国香港	16,966	49,591.75	0.21
141	Sinofert Holdings Limited	中化化肥 控股有限 公司	297 HK	香港证 券交易 所	中国香港	76,000	47,900.79	0.20
142	China Modern Dairy Holdings Ltd.	中国现代 牧业控股 有限公司	1117 HK	香港证 券交易 所	中国香港	58,000	46,092.18	0.20
143	Imax China Holding, Inc.	-	1970 HK	香港证 券交易 所	中国香港	4,488	45,996.60	0.20
144	CSSC (Hong Kong) Shipping Company Limited	中国船舶 (香港)航 运有限 公司	3877 HK	香港证 券交易 所	中国香港	48,113	43,069.37	0.18
145	Guorui Properties Limited	国瑞置业 有限公司	2329 HK	香港证 券交易 所	中国香港	40,560	42,976.99	0.18
146	Regal Real Estate Investmen t Trust	富豪产业 信托	1881 HK	香港证 券交易 所	中国香港	36,312	40,465.98	0.17
147	China VAST Industrial Urban Developm ent Company Limited	中国宏泰 产业市镇 发展有限 公司	6166 HK	香港证 券交易 所	中国香港	12,947	39,854.66	0.17
148	China ZhengTon g Auto	中国正通 汽车服务 控股有限	1728 HK	香港证 券交易 所	中国香港	39,262	39,808.46	0.17

	Services Holdings Limited	公司						
149	CPMC Holdings Limited	中粮包装控股有限公司	906 HK	香港证券交易所	中国香港	13,543	36,246.20	0.15
150	Tianjin Port Development Holdings Limited	天津港发展控股有限公司	3382 HK	香港证券交易所	中国香港	68,427	33,752.14	0.14
151	HC Group Inc.	慧聪集团有限公司	2280 HK	香港证券交易所	中国香港	26,361	30,821.37	0.13
152	Minsheng Education Group Co., Ltd.	民生教育集团有限公司	1569 HK	香港证券交易所	中国香港	31,503	30,502.67	0.13
153	Regal Hotels International Holdings Limited	富豪酒店国际控股有限公司	78 HK	香港证券交易所	中国香港	10,571	29,547.28	0.13
154	CITIC Resources Holdings Limited	中信资源控股有限公司	1205 HK	香港证券交易所	中国香港	128,000	29,230.08	0.12
155	Grand Baoxin Auto Group Limited	广汇宝信汽车集团有限公司	1293 HK	香港证券交易所	中国香港	26,311	28,119.22	0.12
156	Haichang Ocean Park Holdings Ltd.	海昌海洋公园控股有限公司	2255 HK	香港证券交易所	中国香港	57,728	24,256.29	0.10

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金 资产净值比例 （%）
1	A-Living Services Co., Ltd.	3319 HK	614,768.03	1.88
2	Poly Property Development Co., Ltd.	6049 HK	399,165.90	1.22
3	Ak Medical Holdings Limited	1789 HK	337,803.50	1.03
4	China Grand Pharmaceutical and Healthcare Holding Limited	512 HK	295,064.11	0.90
5	Sinopec Engineering (Group) Co., Ltd.	2386 HK	239,226.86	0.73
6	Pacific textiles holdings Limited	1382 HK	237,739.42	0.73
7	China South City Holdings Limited	1668 HK	234,076.80	0.72
8	Stella International Holdings Ltd	1836 HK	231,145.55	0.71
9	GCL-Poly Energy Holdings Limited	3800 HK	230,008.32	0.70
10	CMGE Technology Group Limited	302 HK	220,717.20	0.67
11	Value Partners Group Limited	806 HK	211,162.32	0.65
12	E-House (China) Enterprise Holdings Limited	2048 HK	190,681.11	0.58
13	Chow Sang Sang Holdings International Ltd.	116 HK	160,203.38	0.49
14	Xd Inc.	2400 HK	153,681.94	0.47
15	Sinic Holdings (Group) Company Limited	2103 HK	153,140.89	0.47
16	Tiangong International Company Limited	826 HK	121,653.57	0.37
17	MicroPort Scientific Corporation	853 HK	119,768.33	0.37
18	China Travel International Investment Hong Kong Ltd.	308 HK	116,961.94	0.36
19	Impro Precision Industries Limited	1286 HK	109,332.09	0.33
20	China Foods Limited	506 HK	105,969.58	0.32

注：1.买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

2. 此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	China Grand Pharmaceutical and Healthcare Holding Limited	512 HK	457,386.75	1.40
2	Powerlong Real Estate Holdings Limited	1238 HK	389,598.45	1.19
3	WuXi Apptec Co.,Ltd.	2359 HK	348,297.11	1.06
4	HKBN Ltd.	1310 HK	258,980.60	0.79
5	Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co., Ltd.	1157 HK	234,403.24	0.72
6	MicroPort Scientific Corporation	853 HK	229,599.12	0.70
7	Weimob Inc.	2013 HK	224,414.19	0.69
8	China SCE Group Holdings Limited	1966 HK	219,535.46	0.67
9	China Overseas Grand Oceans Group Limited	81 HK	212,737.89	0.65
10	Zhaojin Mining Industry Company Limited	1818 HK	211,532.01	0.65
11	Television Broadcasts Ltd.	511 HK	204,920.08	0.63
12	Cosco Shipping Development Company Limited	2866 HK	197,300.58	0.60
13	Chinasoft International Ltd.	354 HK	192,669.46	0.59
14	China Overseas Property Holdings Limited	2669 HK	187,702.28	0.57
15	Shandong Gold Mining Co.,Ltd.	1787 HK	174,641.22	0.53
16	A-Living Services Co., Ltd.	3319 HK	172,015.54	0.53
17	Dah Chong Hong Holdings Limited	1828 HK	171,828.59	0.52
18	Fu Shou Yuan International Group Limited	1448 HK	170,721.64	0.52
19	COSCO SHIPPING Holdings Co.,Ltd.	1919 HK	165,848.33	0.51
20	Dynam Japan Holdings Co.,Ltd.	6889 HK	161,833.76	0.49

注：1. 卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

2. 此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	5,544,727.61
卖出收入（成交）总额	14,537,053.04

注：“买入成本”或“卖出收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	194,185.82
4	应收利息	80.47
5	应收申购款	85,404.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	279,670.79

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）A	1,963	9,184.38	752,071.00	4.17%	17,276,867.68	95.83%
易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）C	844	2,589.53	0.00	0.00%	2,185,560.95	100.00%
合计	2,807	7,201.46	752,071.00	3.72%	19,462,428.63	96.28%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	株洲结谷实业有限责任公司	744,071.00	24.51%
2	李志君	446,064.00	14.69%
3	缙岳松	350,000.00	11.53%
4	黄建颂	289,135.00	9.52%
5	赵伟	255,200.00	8.41%
6	夏桂玉	152,900.00	5.04%
7	余迎广	70,000.00	2.31%
8	潘学文	68,500.00	2.26%

9	何华	60,000.00	1.98%
10	钱中明	49,297.00	1.62%

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）A	5,106.22	0.0283%
	易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）C	18,310.42	0.8378%
	合计	23,416.64	0.1158%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）A	0
	易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）A	0
	易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）C	0
	合计	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）A	易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）C
基金合同生效日（2016年11月2日）基金份额总额	399,318,394.11	-
本报告期期初基金份额总额	26,398,272.12	2,372,963.40
本报告期基金总申购份额	4,340,709.75	3,961,512.92
减：本报告期基金总赎回份额	12,710,043.19	4,148,915.37
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	18,028,938.68	2,185,560.95

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2020 年 6 月 22 日发布公告，自 2020 年 6 月 22 日起聘任张坤先生、陈丽园女士担任公司副总经理级高级管理人员。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
Barclays Capital Securities Limited	1	8,849.21	0.04%	0.00	0.00%	-
China Merchants Securities (HK)	1	9,793,924.62	49.19%	7,835.05	59.32%	-

Co Ltd						
Haitong International Securities Company Limited	1	1,048,254.05	5.26%	838.60	6.35%	-
Goldman Sachs	1	19,623.44	0.10%	14.39	0.11%	-
Everbright Securities (International) Limited	1	9,039,301.05	45.40%	4,520.80	34.23%	-
GF Securities (Hong Kong) Brokerage Limited	1	-	-	-	-	-
JP Morgan Securities Limited	1	-	-	-	-	-
Shenyin Wanguo Securities HK Ltd	1	-	-	-	-	-
State Street Securities Hong Kong Limited	1	-	-	-	-	-
CITIC Securities Brokerage (HK) Limited	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	4	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易账户,新增招商证券股份有限公司一个交易单元; 于如下证券经营机构 Barclays Capital Securities Limited 新增一个交易账户。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构, 并在该机构开立交易账户。基金交易账户的开立标准如下:

1) 交易执行能力。主要指证券经营机构能否对投资指令进行有效地执行, 以及能否取得较高质

量的成交结果；

2) 研究报告质量。主要指证券经营机构能否提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专题研究报告等；

3) 提供研究服务的质量。主要包括协助安排上市公司调研、研究资料共享、路演服务、日常沟通交流、接受委托研究的服务质量等方面；

4) 法规监管资讯服务。主要包括境外投资法律规定、交易监管规则、信息披露、个人利益冲突、税收等资讯的提供与培训；

5) 价值贡献。主要是指证券经营机构对公司研究团队、投资团队在业务能力提升上所做的培训服务、对公司投资提升所作出的贡献；

6) 其他因素。主要是证券经营机构的财务状况、经营行为规范、风险管理机制、近年内有无重大违规行为等。

c) 基金交易账户的选择程序如下：

1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易账户的证券经营机构。

2) 基金管理人与所选定的证券经营机构办理开立交易账户事宜。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
Barclays Capital Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
China Merchants Securities (HK)	-	-	-	-	-	-	-	-

Co Ltd								
Haitong International Securities Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs	-	-	-	-	-	-	-	-
Everbright Securities (International) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
GF Securities (Hong Kong) Brokerage Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
JP Morgan Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Shen	-	-	-	-	-	-	-	-

yin Wang uo Secur ities HK Ltd								
State Street Secur ities Hong Kong Limit ed	-	-	-	-	-	-	-	-
CITI C Secur ities Brok erage (HK) Limit ed	-	-	-	-	-	-	-	-
新时 代证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
高华 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万 宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
东方 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商 证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期

1	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加中国农业银行费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-01-06
2	易方达基金管理有限公司旗下基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告	证券时报	2020-01-18
3	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加泉州银行费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-01-23
4	易方达基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年 1 月 31 日不开放申购、赎回、转换、定期定额投资等业务的提示性公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-01-30
5	易方达基金管理有限公司及全资子公司投资旗下基金相关事宜的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-02-04
6	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加好买基金为销售机构的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-02
7	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加中金公司费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-05
8	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加百度百盈费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-10
9	易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）暂停大额申购业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-10
10	易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）暂停申购及定期定额投资业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-11
11	易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）基金经理变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-18
12	易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）恢复申购、定期定额投资业务并暂停大额申购业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-19
13	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加华瑞保险销售为销售机构、参加华瑞保险销售费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-23
14	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加弘业期货为销售机构的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-24
15	易方达基金管理有限公司旗下基金 2019 年年度报告提示性公告	证券时报	2020-03-31
16	易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基	证券时报、基金管理人网	2020-04-07

	金（LOF）2020 年 4 月 10 日、4 月 13 日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	站及中国证监会基金电子披露网站	
17	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-04-10
18	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加诺亚正行费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-04-17
19	易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	证券时报	2020-04-21
20	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加国联证券费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-04-22
21	易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）2020 年 4 月 30 日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-04-27
22	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加中金公司申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-14
23	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加华夏财富费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-23
24	易方达基金管理有限公司关于暂停上海朝阳永续基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-03
25	易方达基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金在招商银行最低定期定额投资金额限制的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-04
26	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-22
27	易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）2020 年 7 月 1 日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-24

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）注册的文件；
2. 《易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）基金合同》；
3. 《易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）托管协议》；
4. 基金管理人业务资格批件和营业执照。

11.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二〇年八月二十八日