

大成恒生综合中小型股指数证券投资基金
(QDII-LOF)
2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 28 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 27 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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 01 月 01 日起至 06 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	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
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.....	9
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	9
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	10
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	12
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.....	12
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.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	34
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	34

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	35
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	53
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	55
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	55
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	55
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	55
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	55
7.11 投资组合报告附注	55
§8 基金份额持有人信息	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2 期末上市基金前十名持有人	57
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
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情况	58
§9 开放式基金份额变动	58
§10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
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	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
10.4 基金投资策略的改变	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	59
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	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
10.8 其他重大事件	62
§11 影响投资者决策的其他重要信息	63
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	63
§12 备查文件目录	63
12.1 备查文件目录	63
12.2 存放地点	64
12.3 查阅方式	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）	
基金简称	大成恒生综合中小型股指数	
场内简称	恒生中小	
基金主代码	160922	
交易代码	160922	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 12 月 2 日	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	12,184,083.24 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 12 月 12 日	
下属分级基金的基金简称	恒生中小 A	恒生中小 C
下属分级基金的交易代码	160922	008972
报告期末下属分级基金的份额总额	12,184,083.24 份	-份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金将主要按照标的指数的成份股及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如股票停牌、流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时，基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到跟踪标的指数的目的。
业绩比较基准	恒生综合中小型股指数收益率×95%+人民币活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

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	大成基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	赵冰	贺倩
	联系电话	0755-83183388	010-66060069
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008885558	95599
传真		0755-83199588	010-68121816
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518040	100031
法定代表人		吴庆斌	周慕冰

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	JPMorgan Chase & Co.
	中文	摩根大通银行

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	www.dcfund.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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

§ 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-2020年6月30日)
	恒生中小 A
本期已实现收益	-300,284.25
本期利润	-427,363.87
加权平均基金份额本期利润	-0.0330
本期加权平均净值利润率	-3.41%

本期基金份额净值增长率	-5.08%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	-118,672.45
期末可供分配基金份额利润	-0.0097
期末基金资产净值	12,065,410.79
期末基金份额净值	0.990
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-1.00%

注：1. 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。

2. 期末可供分配利润，采用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（为期末余额，不是当期发生数）。

3. 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。

4. 本基金于 2020 年 3 月 3 日起增设 C 类份额。截止本报告期末，C 类份额无份额持有人。

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

恒生中小 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	6.57%	1.21%	6.87%	1.24%	-0.30%	-0.03%
过去三个月	12.50%	1.36%	11.90%	1.37%	0.60%	-0.01%
过去六个月	-5.08%	1.89%	-5.72%	1.99%	0.64%	-0.10%
过去一年	-1.59%	1.42%	-3.04%	1.50%	1.45%	-0.08%
过去三年	-4.62%	1.25%	-6.20%	1.29%	1.58%	-0.04%
自基金合同生效起至	-1.00%	1.16%	-0.19%	1.21%	-0.81%	-0.05%

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



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

§ 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

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10 号文批准，于 1999 年 4 月 12 日正式成立，是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一，注册资本为 2 亿元人民币，注册地为深圳。目前公司由三家股东组成，分别为中泰信托有限责任公司(50%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)。主要业务是公募基金的募集、销售和管理，还具有全国社保基金投资管理、基本养老保险投资管理、受托管理保险资金、保险保障基金投资管理、特定客户资产管理和 QDII 业务资格。

经过二十年的稳健发展，公司形成了强大稳固的综合实力。公司旗下基金产品齐全、风格多样，构建了涵盖股票型基金、混合型基金、指数型基金、债券型基金和货币市场基金的完备产品线。截至 2020 年 6 月 30 日，公司管理公募基金产品数量共 103 只。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		

冉凌浩	本基金基金经理	2016 年 12 月 2 日	-	17 年	金融学硕士。2003 年 4 月至 2004 年 6 月就职于国信证券研究部，任研究员。2004 年 6 月至 2005 年 9 月就职于华西证券研究部，任高级研究员。2005 年 9 月加入大成基金管理有限公司，曾担任金融工程师、境外市场研究员及基金经理助理。2011 年 8 月 26 日起任大成标普 500 等权重指数型证券投资基金基金经理。2014 年 11 月 13 日起任大成纳斯达克 100 指数证券投资基金基金经理。2016 年 12 月 2 日起任大成恒生综合中小型股指数基金(QDII-LOF)基金经理。2016 年 12 月 29 日至 2020 年 7 月 7 日任大成海外中国机会混合型证券投资基金（LOF）基金经理。2017 年 8 月 10 日起任大成恒生指数证券投资基金（LOF）基金经理。2019 年 3 月 20 日起任大成中华沪深港 300 指数证券投资基金（LOF）基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
-----	---------	-----------------	---	------	--

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

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

无。

4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《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，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，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

报告期内，基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。基金管理人运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合间连续 4 个季度的日内、3 日内及 5 日内股票及债券交易同向交易价

差进行分析。分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；部分股票同向交易溢价率较大主要来源于市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，即投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别些组合间的成交价格差异较大，但结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易存在 1 笔同日反向交易，原因为组合流动性需要。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易，但不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量 5% 的情形；主动投资组合间债券交易存在 1 笔同日反向交易，原因为组合流动性需要。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

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

2020 年上半年，全球主要国家都经历了较大的一次黑天鹅事件，即新型冠状病毒肺炎在全球蔓延。为了减缓疫情的扩散，各国政府采取了较为严格的管控手段，这些管控手段阻止了疫情的快速传播，但同时也极大减少了社会经济活动，对短期的宏观经济造成了较大影响。

疫情引发了对投资者全球经济衰退的担忧，全球主要股票市场都出现了较大的跌幅，港股市场也不例外，同时全球市场的暴跌也间接引发了 A 股的下跌。

面对疫情，中国政府采取了较为严格的人流管控手段，这些手段较为有效的阻止了疫情的快速传播，但同时也极大减少了短期的社会经济活动，对短期的宏观经济造成了较大影响，致使 1 季度的 GDP 同比下跌 6.8%。

受益于中国政府的高效疫情管控措施，在 1 季度末期，中国的疫情已经得到了有效控制，并且各行业开始逐步推进复工复产活动，因此，中国 2 季度的宏观经济得到较好的恢复。

正因为中国率先从疫情中走出，因此港股市场也对此有了较好的回应，港股在 2 季度出现了明显的反弹。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末恒生中小 A 的基金份额净值为 0.990 元，本报告期基金份额净值增长率为 -5.08%，同期业绩比较基准收益率为 -5.72%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

根据历史经验，由于一次性疫情引发的宏观经济衰退一般都是短期现象，当疫情逐步得到控制时，宏观经济和股票市场都会得以恢复。我们预计本次疫情也不例外，一旦疫情能逐步得到控制，中国的宏观经济可能会快速反转。

中国是最早控制住疫情的国家，因此宏观经济也最早呈现明显的复苏迹象。各种宏观数据，包括工业产出、投资、消费及企业利润方面更是证明了经济正在复苏，而 2 季度的 GDP 增速已经恢复到 3.2%。我们预计，按照正常的经济逻辑，这种经济复苏的势头会保持下去。

虽然经过了小幅反弹，港股市场仍然处于较低估值区间。过往十年间，恒指的平均静态市盈率是 11.5 倍，而当前恒指的静态市盈率为 10.75 倍，依然位于较低估值区间。

与估值对应，在经济复苏的预期下，港股主要公司盈利也会出现较好的变化。根据彭博的一致预期，恒生指数成份股公司的综合加权盈利水平，虽然在 2020 年会由于疫情而减少，但是在 2021 年及 2022 年会大幅提高，其同比增速提高到双位数的水平。这种较好的预期盈利增速及较低的估值的情景下，港股有较好的长期前景。

本基金为被动型指数基金，其投资目标就是要复制指数的收益率。本基金将坚持被动型的指数化投资理念，持续实施高效的组合管理策略、交易策略及风险控制方法，以期更好地跟踪指数，力争将跟踪误差控制在较低的水平。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会，公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由股票投资部、研究部、固定收益总部、数量与指数投资部、大类资产配置部、交易管理部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员中包括五名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益总部、数量与指数投资部、大类资产配置部、风险管理部负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量；定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；交易管理部负责关注相关投资品种的流动性状况，协助反馈其市场交易信息；基金运营部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策，并负责与托管行沟通估值调整事项；监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项

的信息披露工作。

本基金的日常估值程序由基金运营部基金估值核算人员执行，并与托管银行的估值结果核对一致。基金估值政策的议定和修改采用集体讨论机制，投资组合经理作为估值小组成员，对持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。对需采用特别估值程序的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行沟通后由基金运营部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任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

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。本报告期内本基金无收益分配事项。

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

本基金在本报告期内，曾出现了连续 60 个工作日资产净值低于五千万元的情形。我公司已根据法律法规及基金合同要求拟定相关应对方案上报中国证券监督管理委员会。

§ 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人一大成基金管理有限公司 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，大成基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，大成基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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：大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-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	6.4.3.1	1,321,579.04	984,183.23
结算备付金		-	527,262.06
存出保证金		-	64,163.91
交易性金融资产	6.4.3.2	10,950,513.64	14,303,489.32
其中：股票投资		10,950,513.64	14,303,489.32
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	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.3.5	288.03	301.38
应收股利		137,895.86	10,848.82
应收申购款		41,490.70	4,371.83
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		12,451,767.27	15,894,620.55
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	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付证券清算款		141,262.19	318,299.23
应付赎回款		108,133.12	201,614.37
应付管理人报酬		10,007.65	12,878.19
应付托管费		2,501.92	3,219.53
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	1,575.81	3,712.31
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	122,875.79	110,563.67
负债合计		386,356.48	650,287.30
所有者权益：			
实收基金	6.4.3.9	12,184,083.24	14,617,901.20
未分配利润	6.4.3.10	-118,672.45	626,432.05
所有者权益合计		12,065,410.79	15,244,333.25
负债和所有者权益总计		12,451,767.27	15,894,620.55

注：报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额总额 12,184,083.24 份，其中恒生中小 A 基金份额总额为 12,184,083.24 份，基金份额净值 0.990 元。

6.2 利润表

会计主体：大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-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		-234,882.25	1,857,301.32
1. 利息收入		3,756.01	4,546.81
其中：存款利息收入	6.4.3.11	3,756.01	4,546.81
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-104,414.00	343,757.23
其中：股票投资收益	6.4.3.12	-298,218.93	76,533.18
基金投资收益	6.4.3.13	-	-
债券投资收益	6.4.3.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.3.15	-	-
衍生工具收益	6.4.3.16	-	-

股利收益	6.4.3.17	193,804.93	267,224.05
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.18	-127,079.62	1,505,156.49
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-11,864.75	2,549.37
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.19	4,720.11	1,291.42
减：二、费用		192,481.62	252,525.86
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	62,281.09	95,336.75
2. 托管费	6.4.6.2.2	15,570.24	23,834.22
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.20	14,364.19	17,409.40
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.3.21	100,266.10	115,945.49
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-427,363.87	1,604,775.46
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-427,363.87	1,604,775.46

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-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）	14,617,901.20	626,432.05	15,244,333.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-427,363.87	-427,363.87
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）	-2,433,817.96	-317,740.63	-2,751,558.59
其中：1. 基金申购款	4,709,763.11	-446,164.82	4,263,598.29
2. 基金赎回款	-7,143,581.07	128,424.19	-7,015,156.88
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）	12,184,083.24	-118,672.45	12,065,410.79

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）	22,147,908.51	-1,281,313.18	20,866,595.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	1,604,775.46	1,604,775.46
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）	-5,020,164.05	-213,749.87	-5,233,913.92
其中：1. 基金申购款	1,247,648.19	11,669.28	1,259,317.47
2. 基金赎回款	-6,267,812.24	-225,419.15	-6,493,231.39
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）	17,127,744.46	109,712.41	17,237,456.87

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：

谭晓冈

周立新

刘亚林

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 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。

6.4.2 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。

(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。

对基金通过港股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。基金通过港股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) 基金通过港股通买卖、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。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 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	1,321,579.04
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	1,321,579.04

注：于本期末，活期存款中包括的外币余额为港币活期存款 269,200.13 元，折合人民币 245,898.17

元(上年度末, 活期存款中包括的外币余额为港币活期存款 451, 776. 54 元, 折合人民币 404, 692. 39 元)。

6. 4. 3. 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	11, 614, 516. 46	10, 950, 513. 64	-664, 002. 82
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	11, 614, 516. 46	10, 950, 513. 64	-664, 002. 82

6. 4. 3. 3 衍生金融资产/负债

无。

6. 4. 3. 4 买入返售金融资产

6. 4. 3. 4. 1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6. 4. 3. 4. 2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6. 4. 3. 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	134. 13
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	153. 90

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	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	288.03

6.4.3.6 其他资产

无。

6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,575.81
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,575.81

6.4.3.8 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	313.75
应付证券出借违约金	-
预提费用	99,726.04
应付指数使用费	22,836.00
合计	122,875.79

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

恒生中小 A

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	14,617,901.20	14,617,901.20
本期申购	4,709,763.11	4,709,763.11
本期赎回（以“-”号填列）	-7,143,581.07	-7,143,581.07
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-

本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	12,184,083.24	12,184,083.24

注: 1. 申购含红利再投份额(如有)、转换入份额(如有); 赎回含转换出份额(如有)。

2. 截至 2020 年 06 月 30 日止, 本基金于深交所上市的基金份额为 1,366,723.00 份, 托管在场外未上市交易的基金份额为 10,817,360.24 份。上市的基金份额登记在证券登记结算系统, 可按市价流通或按基金份额净值申购或赎回; 未上市的基金份额登记在注册登记系统, 按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

6.4.3.10 未分配利润

单位: 人民币元

恒生中小 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,982,378.18	-4,355,946.13	626,432.05
本期利润	-300,284.25	-127,079.62	-427,363.87
本期基金份额交易产生的变动数	-822,804.54	505,063.91	-317,740.63
其中: 基金申购款	1,539,814.02	-1,985,978.84	-446,164.82
基金赎回款	-2,362,618.56	2,491,042.75	128,424.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,859,289.39	-3,977,961.84	-118,672.45

6.4.3.11 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	3,203.87
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	523.22
其他	28.92
合计	3,756.01

注: 本基金的银行存款由基金托管人和境外资产托管人保管, 存放于基金托管人的银行存款按银行同业利率计息, 存放于境外资产托管人的银行存款不计息。

6.4.3.12 股票投资收益

单位: 人民币元

项目	本期
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	4,631,037.64

减：卖出股票成本总额	4,929,256.57
买卖股票差价收入	-298,218.93

6.4.3.13 基金投资收益

无。

6.4.3.14 债券投资收益

无。

6.4.3.15 贵金属投资收益

无。

6.4.3.16 衍生工具收益

无。

6.4.3.17 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	193,804.93
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	193,804.93

6.4.3.18 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	-127,079.62
股票投资	-127,079.62
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	-

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	-127,079.62

6.4.3.19 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	4,720.11
合计	4,720.11

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

6.4.3.20 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	14,364.19
银行间市场交易费用	-
合计	14,364.19

6.4.3.21 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	19,890.78
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行划款手续费	430.99
指数使用费	42,867.25
上市费	29,835.26
其他	7,241.82
合计	100,266.10

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.04% 的年费率计提，逐日累计，按季支付。标的指数许可使用费的收取下限为每季港币 25,000.00 元。

6.4.3.22 分部报告

无。

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

无。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.5 关联方关系

6.4.5.1 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

本基金本报告期存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 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
大成基金管理有限公司（“大成基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
摩根大通银行（“摩根大通银行”）	境外资产托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

无。

6.4.6.1.2 债券交易

无。

6.4.6.1.3 债券回购交易

无。

6.4.6.1.4 基金交易

无。

6.4.6.1.5 权证交易

无。

6.4.6.1.6 应支付关联方的佣金

无。

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 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	62,281.09	95,336.75
其中：支付销售机构的客户维护费	26,332.39	42,210.85

注：支付基金管理人大成基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 1.00% / 当年天数。

6.4.6.2.2 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	15,570.24	23,834.22

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.6.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.6.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.6.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.5.2 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

无。

6.4.6.6 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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
摩根大通银行	245,895.07	-	369,876.60	-
中国农业银行	1,075,683.97	3,203.87	828,390.03	4,169.97

注：本基金的银行存款由基金托管人和境外资产托管人保管，存放于基金托管人的银行存款按银行同业利率计息，存放于境外资产托管人的银行存款不计息。

6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.7 利润分配情况

无。

6.4.8 期末(2020年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
3886 HK	康健国际医疗	2017年11月27日	重大事项	0.63	未知	未知	110,000	122,662.27	69,129.14	-
1019 HK	康宏环球	2017年12月08日	重大事项	0.17	未知	未知	270,000	50,157.33	41,187.01	-
198 HK	星美控股	2018年09月03日	重大事项	2.14	未知	未知	8,800	27,579.69	18,809.56	-
1363 HK	中滔环保	2019年04月01日	重大事项	0.31	未知	未知	16,000	12,153.81	4,969.11	-
1219 HK	天喔国际	2018年08月13日	重大事项	0.35	未知	未知	8,000	5,097.17	2,776.86	-
521 HK	海航实业股份	2019年04月10日	重大事项	0.12	未知	未知	20,000	11,395.92	2,411.48	-
2662 HK	承兴国际控股	2019年07月19日	重大事项	1.06	未知	未知	2,000	538,969.89	2,119.18	-
6863 HK	辉山乳业	2017年03月27日	已退市	0.01	不适用	不适用	212,000	71,262.08	1,936.49	1
1236 HK	国农控股	2017年03月28日	已退市	0.02	不适用	不适用	46,000	23,658.22	1,086.17	2
1886 HK	汇源果汁	2018年04月03日	重大事项	0.0001	未知	未知	10,000	22,603.95	0.91	-

注：1. 根据香港联合交易所有限公司于2019年12月18日发布的《关于中国辉山乳业控股有限公司取消上市地位》的通告，由2019年12月23日上午9时起，中国辉山乳业控股有限公司的上市地位将根据除牌程序予以取消。

2. 根据香港联合交易所有限公司于2019年11月20日发布的《关于国农控股有限公司取消上市地位》的通告，由2019年11月22日上午9时起，国农控股有限公司的上市地位将根据除牌程序予以取消。

3. 除上述股票外，本基金截至本期末止持有因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金，跟踪标的指数市场表现，目标为获取市场平均收益，属于中高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金基金资产将投资于香港市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以由高层监控（合规与风险管理委员会、公司投资风险控制委员会）、专业监控（监察稽核部、风险管理部）、部门互控、岗位自控构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会，对公司整体运营风险进行监督，监督风险控制措施的执行；在管理层层面设立投资风险控制委员会，通过定期会议讨论涉及投资风险的重大议题，形成正式决议提交投委会；在业务操作层面，监察稽核部履行合规控制职责，通过定期、不定期检查内控制度的执行情况、对重大风险点以专项稽核的方式确保公司内控制度、流程得到贯彻执行。风险管理部履行风险量化评估分析职责。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特

征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.9.2 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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行及境外次托管行摩根大通银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于本期末，本基金无债券投资（上年度末：同）。

6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

6.4.9.3.1 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严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例未超过 15%。

本基金主要投资于交易所及银行间市场内交易的证券，除在附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制外(如有)，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”中列示的卖出回购金融资产款余额(如有)将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.9.3.2 市场风险

市场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所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.9.3.3 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款等。

6.4.9.3.3.1 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	1,321,579.04	-	-	-	1,321,579.04
交易性金融资产	-	-	-	10,950,513.64	10,950,513.64
应收利息	-	-	-	288.03	288.03
应收股利	-	-	-	137,895.86	137,895.86
应收申购款	1,000.00	-	-	40,490.70	41,490.70
资产总计	1,322,579.04	-	-	11,129,188.23	12,451,767.27
负债					
应付赎回款	-	-	-	108,133.12	108,133.12
应付管理人报酬	-	-	-	10,007.65	10,007.65
应付托管费	-	-	-	2,501.92	2,501.92

应付证券清算款	-	-	-	141,262.19	141,262.19
应付交易费用	-	-	-	1,575.81	1,575.81
其他负债	-	-	-	122,875.79	122,875.79
负债总计	-	-	-	386,356.48	386,356.48
利率敏感度缺口	1,322,579.04	-	-	10,742,831.75	12,065,410.79
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	579,493.88	-	-	404,689.35	984,183.23
结算备付金	527,262.06	-	-	-	527,262.06
存出保证金	64,163.91	-	-	-	64,163.91
交易性金融资产	-	-	-	14,303,489.32	14,303,489.32
应收利息	-	-	-	301.38	301.38
应收股利	-	-	-	10,848.82	10,848.82
应收申购款	-	-	-	4,371.83	4,371.83
资产总计	1,170,919.85	-	-	14,723,700.70	15,894,620.55
负债					
应付赎回款	-	-	-	201,614.37	201,614.37
应付管理人报酬	-	-	-	12,878.19	12,878.19
应付托管费	-	-	-	3,219.53	3,219.53
应付证券清算款	-	-	-	318,299.23	318,299.23
应付交易费用	-	-	-	3,712.31	3,712.31
其他负债	-	-	-	110,563.67	110,563.67
负债总计	-	-	-	650,287.30	650,287.30
利率敏感度缺口	1,170,919.85	-	-	14,073,413.40	15,244,333.25

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.9.3.3.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金未持有交易性债券投资（上年度末：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

6.4.9.3.4 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.9.3.4.1 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 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	245,898.17	-	245,898.17
交易性金融资产	-	10,950,513.64	-	10,950,513.64
应收股利	-	2,538.50	-	2,538.50
资产合计	-	11,198,950.31	-	11,198,950.31
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	11,198,950.31	-	11,198,950.31
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	404,692.39	-	404,692.39
交易性金融资产	-	14,303,489.32	-	14,303,489.32
应收股利	-	696.56	-	696.56
资产合计	-	14,708,878.27	-	14,708,878.27
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	14,708,878.27	-	14,708,878.27

6.4.9.3.4.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除港币以外的其他市场变量保持不变		
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）	
分析	港币相对人民币升值 5%	603,300.00	740,000.00

	港币相对人民币贬值 5%	-603, 300. 00	-740, 000. 00
--	--------------	---------------	---------------

6. 4. 9. 3. 5 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的股票，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通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，实现基金投资组合对标的指数的有效跟踪，追求跟踪误差最小化。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%，投资于以标的指数为跟踪标的的公募基金、上市交易型基金、结构性产品的比例不超过基金资产净值的 10%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6. 4. 9. 3. 5. 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	10, 950, 513. 64	90. 76	14, 303, 489. 32	93. 83
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	10, 950, 513. 64	90. 76	14, 303, 489. 32	93. 83

6. 4. 9. 3. 5. 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	
	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)
分析	业绩比较基准上升 5%	540,000.00	670,000.00
	业绩比较基准下降 5%	-540,000.00	-670,000.00

6.4.9.3.6 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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	10,950,513.64	87.94
	其中：普通股	10,950,513.64	87.94
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
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	1,321,579.04	10.61
8	其他各项资产	179,674.59	1.44
9	合计	12,451,767.27	100.00

注：本基金通过深港通交易机制投资的港股公允价值为 10,463,717.14 元，占期末基金资产净值的比例为 86.72%。

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	10,950,513.64	90.76
合计	10,950,513.64	90.76

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

7.3.1 期末指数投资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（%）
原材料	875,375.13	7.26
医疗保健	1,183,995.97	9.81
信息技术	1,318,333.24	10.93
通信服务	351,404.94	2.91
日常消费品	551,978.09	4.57
能源	157,851.58	1.31
金融	1,045,104.18	8.66
公用事业	306,367.79	2.54
工业	1,673,266.52	13.87
非日常生活消费品	1,831,114.68	15.18
房地产	1,511,295.61	12.53
合计	10,806,087.73	89.56

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.3.2 期末积极投资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（%）
原材料	-	-
医疗保健	69,129.14	0.57
信息技术	3,205.35	0.03
通信服务	18,809.56	0.16
日常消费品	4,714.26	0.04
能源	-	-
金融	41,187.01	0.34
公用事业	-	-
工业	7,380.59	0.06
非日常生活消费品	-	-
房地产	-	-
合计	144,425.91	1.20

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

7.4.1 期末指数投资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	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	中芯国际	981 HK	香港联合交易所	中国香港	12,500	308,286.00	2.56
2	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	海螺水泥	914 HK	香港联合交易所	中国香港	4,500	214,567.06	1.78
3	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	海螺创业	586 HK	香港联合交易所	中国香港	6,500	194,151.67	1.61
4	LI NING CO LTD	李宁	2331 HK	香港联合交易所	中国香港	7,500	168,529.68	1.4
5	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	碧桂园服务	6098 HK	香港联合交易所	中国香港	5,000	164,419.20	1.36
6	KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	金蝶国际	268 HK	香港联合交易所	中国香港	9,000	148,141.70	1.23
7	YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	颐海国际	1579 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	145,145.62	1.2
8	CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	中国金茂	817 HK	香港联合交易所	中国香港	28,000	139,390.94	1.16
9	BYD CO LTD-H	比亚迪	1211 HK	香港联合交易所	中国香港	2,500	136,673.46	1.13
10	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	信义光能	968 HK	香港联合交易所	中国香港	20,000	134,092.99	1.11
11	PING AN HEALTHCARE AND TECHN	平安好医生	1833 HK	香港联合交易所	中国香港	1,200	129,233.49	1.07
12	SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	威高股份	1066 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	125,981.64	1.04
13	CHINA VANKE CO LTD-H	万科	2202 HK	香港联合交易所	中国香港	5,500	123,086.04	1.02
14	VITASOY INTL HOLDINGS LTD	维他奶国际	345 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	108,333.98	0.9
15	CITIC SECURITIES CO LTD-H	中信证券	6030 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	107,128.24	0.89
16	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	中国建材	3323 HK	香港联合交易所	中国香港	14,000	105,502.32	0.87

17	TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	青岛啤酒	168 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	105,045.60	0.87
18	KINGSOFT CORP LTD	金山软件	3888 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	98,788.54	0.82
19	WEICHAI POWER CO LTD-H	潍柴动力	2338 HK	香港联合交易所	中国香港	7,000	92,330.52	0.77
20	SINOPHARM GROUP CO-H	国药控股	1099 HK	香港联合交易所	中国香港	4,800	86,988.72	0.72
21	CHINA RESOURCES CEMENT	华润水泥控股	1313 HK	香港联合交易所	中国香港	10,000	86,685.46	0.72
22	MICROPORT SCIENTIFIC CORP	微创医疗	853 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	85,497.98	0.71
23	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	ASM PACIFIC 公司	522 HK	香港联合交易所	中国香港	1,100	81,739.18	0.68
24	ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	中升控股	881 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	78,373.15	0.65
25	WUXI APPTec CO LTD-H	药明康德	2359 HK	香港联合交易所	中国香港	840	77,266.06	0.64
26	CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	旭辉控股集团	884 HK	香港联合交易所	中国香港	14,000	77,240.49	0.64
27	CHINA LITERATURE LTD	阅文集团	772 HK	香港联合交易所	中国香港	1,600	76,290.51	0.63
28	NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	新华保险	1336 HK	香港联合交易所	中国香港	3,100	73,481.68	0.61
29	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	紫金矿业	2899 HK	香港联合交易所	中国香港	22,000	72,545.40	0.6
30	CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	中金公司	3908 HK	香港联合交易所	中国香港	5,200	72,293.30	0.6
31	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	信义玻璃	868 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	69,421.44	0.58
32	HUATAI SECURITIES CO LTD-H	华泰证券	6886 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	67,631.10	0.56
33	KWG GROUP HOLDINGS LTD	合景泰富集团	1813 HK	香港联合交易所	中国香港	5,500	65,411.44	0.54
34	PCCW LTD	电讯盈科	8 HK	香港联合交易所	中国香港	16,000	64,598.48	0.54
35	JINXIN FERTILITY GROUP LTD	锦欣生殖	1951 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	64,342.71	0.53
36	HAITONG SECURITIES CO LTD-H	海通证券	6837 HK	香港联合交易所	中国香港	11,200	64,043.11	0.53
37	PEOPLE'S	中国人保	1339	香港联合	中国	31,000	63,995.61	0.53

	INSURANCE CO GROU-H		HK	交易所	香港			
38	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	中国交建	1800 HK	香港联合 交易所	中国 香港	16,000	63,867.72	0.53
39	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	华晨中国	1114 HK	香港联合 交易所	中国 香港	10,000	63,392.74	0.53
40	ZTE CORP-H	中兴通讯	763 HK	香港联合 交易所	中国 香港	2,800	60,615.88	0.5
41	GENSCRIPT BIOTECH CORP	金斯瑞生 物科技	1548 HK	香港联合 交易所	中国 香港	4,000	58,240.93	0.48
42	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	广汽集团	2238 HK	香港联合 交易所	中国 香港	11,200	57,188.65	0.47
43	CGN POWER CO LTD-H	中国广核	1816 HK	香港联合 交易所	中国 香港	39,000	56,998.66	0.47
44	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	中国中铁	390 HK	香港联合 交易所	中国 香港	15,000	54,532.37	0.45
45	FAR EAST HORIZON LTD	远东宏信	3360 HK	香港联合 交易所	中国 香港	9,000	54,093.92	0.45
46	A-LIVING SERVICES CO LTD-H	雅生活服 务	3319 HK	香港联合 交易所	中国 香港	1,500	53,504.75	0.44
47	TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	同程艺龙	780 HK	香港联合 交易所	中国 香港	4,000	51,006.49	0.42
48	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	长城汽车	2333 HK	香港联合 交易所	中国 香港	11,500	50,842.07	0.42
49	SHENZHEN INTL HOLDINGS	深圳国际	152 HK	香港联合 交易所	中国 香港	4,500	50,723.32	0.42
50	CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	光大银行	6818 HK	香港联合 交易所	中国 香港	19,000	50,504.10	0.42
51	GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	绿城服务	2869 HK	香港联合 交易所	中国 香港	6,000	50,038.24	0.41
52	CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	中国银河	6881 HK	香港联合 交易所	中国 香港	13,000	49,755.08	0.41
53	HANG LUNG GROUP LTD	恒隆集团	10 HK	香港联合 交易所	中国 香港	3,000	49,380.57	0.41
54	3SBIO INC	三生制药	1530 HK	香港联合 交易所	中国 香港	5,500	49,334.89	0.41
55	SEAZEN GROUP LTD	新城发展	1030 HK	香港联合 交易所	中国 香港	8,000	49,179.61	0.41
56	NAGACORP LTD	金界控股	3918 HK	香港联合 交易所	中国 香港	6,000	49,161.34	0.41
57	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	华虹半导 体	1347 HK	香港联合 交易所	中国 香港	2,000	49,143.07	0.41

58	ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	众安在线	6060 HK	香港联合 交易所	中国 香港	1,400	49,042.59	0.41
59	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	比亚迪电 子	285 HK	香港联合 交易所	中国 香港	3,000	48,613.28	0.4
60	CRRC CORP LTD - H	中国中车	1766 HK	香港联合 交易所	中国 香港	16,000	47,791.18	0.4
61	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	龙源电力	916 HK	香港联合 交易所	中国 香港	12,000	47,681.57	0.4
62	SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	复星医药	2196 HK	香港联合 交易所	中国 香港	2,000	47,316.19	0.39
63	KINGBOARD HOLDINGS LTD	建滔集团	148 HK	香港联合 交易所	中国 香港	2,500	45,900.36	0.38
64	CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	中国信达	1359 HK	香港联合 交易所	中国 香港	33,000	45,818.15	0.38
65	SINOTRUK HONG KONG LTD	中国重汽	3808 HK	香港联合 交易所	中国 香港	2,500	45,786.18	0.38
66	HYSAN DEVELOPMENT CO	希慎兴业	14 HK	香港联合 交易所	中国 香港	2,000	45,397.97	0.38
67	TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	滔搏	6110 HK	香港联合 交易所	中国 香港	5,000	45,215.28	0.37
68	AK MEDICAL HOLDINGS LTD	爱康医疗	1789 HK	香港联合 交易所	中国 香港	2,000	45,032.59	0.37
69	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	玖龙纸业	2689 HK	香港联合 交易所	中国 香港	7,000	44,822.50	0.37
70	WEIMOB INC	微盟集团	2013 HK	香港联合 交易所	中国 香港	5,000	44,438.86	0.37
71	HKBN LTD	香港宽频	1310 HK	香港联合 交易所	中国 香港	3,500	43,351.86	0.36
72	HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	海天国际	1882 HK	香港联合 交易所	中国 香港	3,000	43,132.64	0.36
73	POLY PROPERTY DEVELOPMENT -H	保利物业	6049 HK	香港联合 交易所	中国 香港	600	42,748.99	0.35
74	KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING	新东方在 线	1797 HK	香港联合 交易所	中国 香港	1,500	42,611.98	0.35
75	CHINA YONGDA AUTOMOBILES SER	永达汽车	3669 HK	香港联合 交易所	中国 香港	5,000	42,520.63	0.35
76	GOME RETAIL HOLDINGS LTD	国美零售	493 HK	香港联合 交易所	中国 香港	36,000	42,420.15	0.35
77	DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	东风集团 股份	489 HK	香港联合 交易所	中国 香港	10,000	42,292.27	0.35
78	CHINA RAILWAY	中国铁建	1186	香港联合	中国	7,500	41,721.37	0.35

	CONSTRUCTION-H		HK	交易所	香港			
79	CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	康哲药业	867 HK	香港联合交易所	中国香港	5,000	41,698.54	0.35
80	MELCO INTERNATIONAL DEVELOP.	新濠国际发展	200 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	41,104.80	0.34
81	CHINA EVERBRIGHT LTD	中国光大控股	165 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	40,995.19	0.34
82	CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	中国中药	570 HK	香港联合交易所	中国香港	12,000	40,995.19	0.34
83	MINTH GROUP LTD	敏实集团	425 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	40,282.70	0.33
84	GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	富力地产	2777 HK	香港联合交易所	中国香港	4,800	39,548.30	0.33
85	TIMES CHINA HOLDINGS LTD	时代中国控股	1233 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	39,241.38	0.33
86	UNITED ENERGY GROUP LTD	联合能源集团	467 HK	香港联合交易所	中国香港	30,000	38,364.48	0.32
87	CHINA OILFIELD SERVICES-H	中海油服	2883 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	38,145.25	0.32
88	SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	上海医药	2607 HK	香港联合交易所	中国香港	3,200	38,057.56	0.32
89	GF SECURITIES CO LTD-H	广发证券	1776 HK	香港联合交易所	中国香港	5,000	37,907.76	0.31
90	MAN WAH HOLDINGS LTD	敏华控股	1999 HK	香港联合交易所	中国香港	5,600	37,904.11	0.31
91	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	海丰国际	1308 HK	香港联合交易所	中国香港	5,000	37,770.74	0.31
92	ALIBABA PICTURES GROUP LTD	阿里影业	1060 HK	香港联合交易所	中国香港	40,000	37,633.73	0.31
93	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	中海物业	2669 HK	香港联合交易所	中国香港	5,000	37,451.04	0.31
94	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	中国民航信息网络	696 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	37,377.96	0.31
95	HUANENG POWER INTL INC-H	华能国际	902 HK	香港联合交易所	中国香港	14,000	37,213.55	0.31
96	SAMSONITE INTERNATIONAL SA	新秀丽	1910 HK	香港联合交易所	中国香港	5,200	37,049.13	0.31
97	CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	中国联塑	2128 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	36,829.90	0.31
98	BOC AVIATION LTD	中银航空租赁	2588 HK	香港联合交易所	中国香港	800	36,172.22	0.3

99	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	中车时代 电气	3898 HK	香港联合 交易所	中国 香港	2,000	35,989.54	0.3
100	GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARM-H	白云山	874 HK	香港联合 交易所	中国 香港	2,000	35,733.77	0.3
101	UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	统一企业 中国	220 HK	香港联合 交易所	中国 香港	5,000	35,258.78	0.29
102	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	中国通信 服务	552 HK	香港联合 交易所	中国 香港	8,000	35,222.25	0.29
103	CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	美东汽车	1268 HK	香港联合 交易所	中国 香港	2,000	34,710.72	0.29
104	CHINA AOYUAN GROUP LTD	中国奥园	3883 HK	香港联合 交易所	中国 香港	4,000	34,235.73	0.28
105	JS GLOBAL LIFESTYLE CO LTD	JS 环球生 活	1691 HK	香港联合 交易所	中国 香港	5,000	33,934.30	0.28
106	AIR CHINA LTD-H	中国国航	753 HK	香港联合 交易所	中国 香港	8,000	33,760.74	0.28
107	SWIRE PACIFIC LTD-CL B	太古股份 公司	87 HK	香港联合 交易所	中国 香港	5,000	33,751.61	0.28
108	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	福耀玻璃	3606 HK	香港联合 交易所	中国 香港	2,000	33,724.20	0.28
109	AGILE GROUP HOLDINGS LTD	雅居乐集 团	3383 HK	香港联合 交易所	中国 香港	4,000	33,322.29	0.28
110	JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	宁沪高速	177 HK	香港联合 交易所	中国 香港	4,000	33,176.14	0.27
111	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	招金矿业	1818 HK	香港联合 交易所	中国 香港	4,000	33,066.53	0.27
112	YUEXIU PROPERTY CO LTD	越秀地产	123 HK	香港联合 交易所	中国 香港	26,000	32,774.23	0.27
113	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	裕元集团	551 HK	香港联合 交易所	中国 香港	3,000	32,280.97	0.27
114	HEALTH AND HAPPINESS H&H INT	H&H 国际控 股	1112 HK	香港联合 交易所	中国 香港	1,000	32,016.07	0.27
115	FORTUNE REIT	置富产业 信托	778 HK	香港联合 交易所	中国 香港	5,000	31,833.38	0.26
116	YANZHOU COAL MINING CO-H	兖州煤业	1171 HK	香港联合 交易所	中国 香港	6,000	31,732.91	0.26
117	AUSNUTRIA DAIRY CORP LTD	澳优	1717 HK	香港联合 交易所	中国 香港	2,000	31,678.10	0.26
118	SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	山东黄金	1787 HK	香港联合 交易所	中国 香港	2,100	31,573.97	0.26
119	CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	中国软件 国际	354 HK	香港联合 交易所	中国 香港	8,000	30,983.88	0.26

120	ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	浙江沪杭甬	576 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	30,033.91	0.25
121	VTECH HOLDINGS LTD	伟易达集团	303 HK	香港联合交易所	中国香港	700	29,764.44	0.25
122	CHAMPION REIT	冠君产业信托	2778 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	29,449.31	0.24
123	CAFE DE CORAL HOLDINGS LTD	大家乐集团	341 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	29,303.16	0.24
124	SSY GROUP LTD	石四药集团	2005 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	28,992.59	0.24
125	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	中航科工	2357 HK	香港联合交易所	中国香港	9,000	28,855.57	0.24
126	JIANGXI COPPER CO LTD-H	江西铜业	358 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	28,535.87	0.24
127	KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	建滔积层板	1888 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	28,462.79	0.24
128	ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	中联重科	1157 HK	香港联合交易所	中国香港	5,200	28,356.83	0.24
129	LUYE PHARMA GROUP LTD	绿叶制药	2186 HK	香港联合交易所	中国香港	6,500	28,143.09	0.23
130	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	洛阳钼业	3993 HK	香港联合交易所	中国香港	12,000	27,732.04	0.23
131	GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	国泰君安	2611 HK	香港联合交易所	中国香港	2,800	27,417.82	0.23
132	LIFETECH SCIENTIFIC CORP	先健科技	1302 HK	香港联合交易所	中国香港	12,000	26,745.52	0.22
133	ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	正荣地产	6158 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	26,581.10	0.22
134	BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	北京首都机场股份	694 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	26,581.10	0.22
135	CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	中国华融	2799 HK	香港联合交易所	中国香港	37,000	26,361.88	0.22
136	BOSIDENG INTL HLDGS LTD	波司登	3998 HK	香港联合交易所	中国香港	12,000	26,307.07	0.22
137	GEMDALE PROPERTIES AND INVES	金地商置	535 HK	香港联合交易所	中国香港	20,000	26,124.38	0.22
138	FU SHOU YUAN INTERNATIONAL	福寿园	1448 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	25,905.16	0.21
139	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	越秀房产信托基金	405 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	25,795.55	0.21
140	CHINA EAST EDUCATION HOLDING	中国东方教育	667 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	25,612.86	0.21

141	VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	维达国际	3331 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	25,302.29	0.21
142	CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	渝农商行	3618 HK	香港联合交易所	中国香港	9,000	25,073.93	0.21
143	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	南方航空	1055 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	25,064.79	0.21
144	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	中国建筑国际	3311 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	24,772.49	0.21
145	SHANGRI-LA ASIA LTD	香格里拉 (亚洲)	69 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	24,334.04	0.2
146	HOPE EDUCATION GROUP CO LTD	希望教育	1765 HK	香港联合交易所	中国香港	10,000	24,206.16	0.2
147	CHINA COAL ENERGY CO-H	中煤能源	1898 HK	香港联合交易所	中国香港	15,000	24,114.82	0.2
148	TIANNENG POWER INTL LTD	天能动力	819 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	24,114.82	0.2
149	CSC FINANCIAL CO LTD-H	中信建投	6066 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	24,032.61	0.2
150	KAISA GROUP HOLDINGS LTD	佳兆业集团	1638 HK	香港联合交易所	中国香港	9,000	24,005.20	0.2
151	CHINA OVERSEAS GRAND OCEANS	中国海外宏洋集团	81 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	23,950.40	0.2
152	CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	宇华教育	6169 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	23,237.91	0.19
153	COSCO SHIPPING PORTS LTD	中远海运港口	1199 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	22,799.46	0.19
154	CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	中教控股	839 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	22,762.92	0.19
155	HUADIAN FUXIN ENERGY CORP -H	华电福新	816 HK	香港联合交易所	中国香港	10,000	22,653.31	0.19
156	SHENZHEN INVESTMENT LTD	深圳控股	604 HK	香港联合交易所	中国香港	10,000	22,379.28	0.19
157	SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	上海实业控股	363 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	21,776.41	0.18
158	YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD	禹洲集团	1628 HK	香港联合交易所	中国香港	7,000	21,420.17	0.18
159	SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	远洋集团	3377 HK	香港联合交易所	中国香港	12,500	21,237.48	0.18
160	CHINA POWER INTERNATIONAL	中国电力	2380 HK	香港联合交易所	中国香港	16,000	20,753.36	0.17
161	L' OCCITANE INTERNATIONAL SA	L' OCCITANE 公司	973 HK	香港联合交易所	中国香港	1,750	20,748.79	0.17

162	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	上海石化	338 HK	香港联合交易所	中国香港	12,000	20,387.98	0.17
163	CHINA WATER AFFAIRS GROUP	中国水务	855 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	20,387.98	0.17
164	LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-H	丽珠集团	1513 HK	香港联合交易所	中国香港	566	20,214.98	0.17
165	SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	上海电气	2727 HK	香港联合交易所	中国香港	10,000	20,095.68	0.17
166	ZHONGYU GAS HOLDINGS LTD	中裕燃气	3633 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	20,031.74	0.17
167	RAZER INC	雷蛇	1337 HK	香港联合交易所	中国香港	15,000	20,004.34	0.17
168	CHINA GRAND PHARMACEUTICAL A	远大医药	512 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	19,876.45	0.16
169	POWERLONG REAL ESTATE HOLDIN	宝龙地产	1238 HK	香港联合交易所	中国香港	5,000	19,821.65	0.16
170	YUEXIU TRANSPORT INFRASTRUCT	越秀交通基建	1052 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	19,766.84	0.16
171	PACIFIC BASIN SHIPPING LTD	太平洋航运	2343 HK	香港联合交易所	中国香港	19,000	19,611.56	0.16
172	CMGE TECHNOLOGY GROUP LTD	中手游	302 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	19,565.88	0.16
173	YADEA GROUP HOLDINGS LTD	雅迪控股	1585 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	19,547.62	0.16
174	MAOYAN ENTERTAINMENT	猫眼娱乐	1896 HK	香港联合交易所	中国香港	1,800	19,434.35	0.16
175	COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	中远海控	1919 HK	香港联合交易所	中国香港	9,500	19,351.23	0.16
176	LEGEND HOLDINGS CORP-H	联想控股	3396 HK	香港联合交易所	中国香港	2,300	19,013.25	0.16
177	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	理文造纸	2314 HK	香港联合交易所	中国香港	5,000	18,999.55	0.16
178	JOHNSON ELECTRIC HOLDINGS	德昌电机控股	179 HK	香港联合交易所	中国香港	1,500	18,826.00	0.16
179	KERRY LOGISTICS NETWORK LTD	嘉里物流	636 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	18,816.86	0.16
180	SOHO CHINA LTD	SOHO 中国	410 HK	香港联合交易所	中国香港	7,500	18,634.18	0.15
181	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	中国铝业	2600 HK	香港联合交易所	中国香港	14,000	18,542.83	0.15
182	CHINA SCE GROUP HOLDINGS LTD	中骏集团控股	1966 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	18,414.95	0.15
183	BAIC MOTOR CORP	北京汽车	1958	香港联合	中国	6,000	18,360.14	0.15

	LTD-H		HK	交易所	香港			
184	CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	中国通号	3969 HK	香港联合 交易所	中国 香港	6,000	18,250.53	0.15
185	ZHOU HEI YA INTERNATIONAL HO	周黑鸭	1458 HK	香港联合 交易所	中国 香港	3,000	18,113.52	0.15
186	GREENTOWN CHINA HOLDINGS	绿城中国	3900 HK	香港联合 交易所	中国 香港	2,500	17,675.06	0.15
187	JIAYUAN INTERNATIONAL GROUP	佳源国际 控股	2768 HK	香港联合 交易所	中国 香港	6,000	17,538.05	0.15
188	XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	金风科技	2208 HK	香港联合 交易所	中国 香港	2,880	17,467.90	0.14
189	XIABUXIABU CATERING MANAGEME	呷哺呷哺	520 HK	香港联合 交易所	中国 香港	2,500	17,446.70	0.14
190	IGG INC	IGG 公司	799 HK	香港联合 交易所	中国 香港	3,000	17,373.63	0.14
191	E-HOUSE CHINA ENTERPRISE HOL	易居企业 控股	2048 HK	香港联合 交易所	中国 香港	2,100	17,340.74	0.14
192	MIDEA REAL ESTATE HOLDING LT	美的置业	3990 HK	香港联合 交易所	中国 香港	1,000	17,318.82	0.14
193	GENERTEC UNIVERSAL MEDICAL G	环球医疗	2666 HK	香港联合 交易所	中国 香港	4,000	17,099.60	0.14
194	SUNEVISION HOLDINGS	新意网集 团	1686 HK	香港联合 交易所	中国 香港	3,000	16,633.74	0.14
195	CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	中国再保 险	1508 HK	香港联合 交易所	中国 香港	23,000	16,597.20	0.14
196	SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	中石化炼 化工程	2386 HK	香港联合 交易所	中国 香港	5,500	16,578.94	0.14
197	FIT HON TENG LTD	鸿腾六零 八八精密 科技	6088 HK	香港联合 交易所	中国 香港	6,000	16,441.92	0.14
198	XD INC	心动公司	2400 HK	香港联合 交易所	中国 香港	600	16,332.31	0.14
199	SHUI ON LAND LTD	瑞安房地 产	272 HK	香港联合 交易所	中国 香港	13,500	16,030.87	0.13
200	CHINA SOUTH CITY HOLDINGS	华南城	1668 HK	香港联合 交易所	中国 香港	22,000	15,875.59	0.13
201	DAH SING FINANCIAL HOLDINGS	大新金融	440 HK	香港联合 交易所	中国 香港	800	15,857.32	0.13
202	VIVA BIOTECH HOLDINGS	维亚生物	1873 HK	香港联合 交易所	中国 香港	2,000	15,857.32	0.13

203	SKYWORTH GROUP LTD	创维集团	751 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	15,857.32	0.13
204	SHUN TAK HOLDINGS LTD	信德集团	242 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	15,784.24	0.13
205	LUK FOOK HOLDINGS INTL LTD	六福集团	590 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	15,327.52	0.13
206	K WAH INTL HOLDINGS	嘉华国际	173 HK	香港联合交易所	中国香港	5,000	15,254.45	0.13
207	HAITONG INTERNATIONAL SECURI	海通国际	665 HK	香港联合交易所	中国香港	9,000	15,208.78	0.13
208	CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	东方航空	670 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	15,126.57	0.13
209	LONKING HOLDINGS LTD	中国龙工	3339 HK	香港联合交易所	中国香港	7,000	15,026.09	0.12
210	CHOW SANG SANG HLDG	周生生	116 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	14,998.68	0.12
211	POLY PROPERTY GROUP CO LTD	保利置业集团	119 HK	香港联合交易所	中国香港	7,000	14,898.21	0.12
212	HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	合生创展集团	754 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	14,724.65	0.12
213	NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	耐世特	1316 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	14,578.50	0.12
214	STELLA INTERNATIONAL	九兴控股	1836 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	14,523.70	0.12
215	YICHANG HEC CHANGJIANG PHA-H	东阳光药	1558 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	14,468.89	0.12
216	CHINA TOBACCO INTERNATIONAL	中烟香港	6055 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	14,395.81	0.12
217	VALUE PARTNERS GROUP LTD	惠理集团	806 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	14,359.28	0.12
218	SHENZHEN EXPRESSWAY CO-H	深高速	548 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	14,322.74	0.12
219	CHINA NEW HIGHER EDUCATION G	新高教集团	2001 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	14,030.44	0.12
220	COFCO MEAT HOLDINGS LTD	中粮肉食	1610 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	14,030.44	0.12
221	SHOUCHENG HOLDINGS LTD	首程控股	697 HK	香港联合交易所	中国香港	10,000	13,975.63	0.12
222	PACIFIC TEXTILES HOLDINGS	互太纺织	1382 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	13,665.06	0.11
223	FUFENG GROUP LTD	阜丰集团	546 HK	香港联合交易所	中国	6,000	13,537.18	0.11

				交易所	香港			
224	FIRST PACIFIC CO	第一太平	142 HK	香港联合交易所	中国香港	10,000	13,518.91	0.11
225	CITIC TELECOM INTERNATIONAL	中信国际电讯	1883 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	13,482.37	0.11
226	SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	三一国际	631 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	13,117.00	0.11
227	REDCO PROPERTIES GROUP LTD	力高集团	1622 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	13,080.46	0.11
228	CHINA MAPLE LEAF EDUCATIONAL	枫叶教育	1317 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	12,934.31	0.11
229	LVGEM CHINA REAL ESTATE INVE	绿景中国地产	95 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	12,879.50	0.11
230	TOWNGAS CHINA CO LTD	港华燃气	1083 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	12,788.16	0.11
231	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	中远海能	1138 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	12,642.01	0.1
232	ZHONGLIANG HOLDINGS GROUP CO	中梁控股	2772 HK	香港联合交易所	中国香港	2,500	12,559.80	0.1
233	SHENWAN HONGYUAN GROUP CO -H	申万宏源	6806 HK	香港联合交易所	中国香港	6,400	12,510.47	0.1
234	RONSHINE CHINA HOLDINGS LTD	融信中国	3301 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	12,459.32	0.1
235	METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	中国中冶	1618 HK	香港联合交易所	中国香港	11,000	12,358.84	0.1
236	THE UNITED LABORATORIES INTE	联邦制药	3933 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	12,240.10	0.1
237	HUADIAN POWER INTL CORP-H	华电国际	1071 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	12,221.83	0.1
238	C-MER EYE CARE HOLDINGS LTD	希玛眼科	3309 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	12,130.48	0.1
239	CHINA RESOURCES MEDICAL HOLD	华润医疗	1515 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	12,112.21	0.1
240	SHOUGANG FUSHAN RESOURCES GR	首钢资源	639 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	11,838.18	0.1
241	MMG LTD	五矿资源	1208 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	11,692.03	0.1
242	SUNCITY GROUP HOLDINGS LTD	太阳城集团	1383 HK	香港联合交易所	中国香港	10,000	11,692.03	0.1
243	LEYOU TECHNOLOGIES HOLDINGS	乐游科技控股	1089 HK	香港联合交易所	中国香港	5,000	11,646.36	0.1
244	SHENG YE CAPITAL LTD	盛业资本	6069 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	11,582.42	0.1

245	DONGYUE GROUP	东岳集团	189 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	11,509.34	0.1
246	SINOTRANS LIMITED-H	中国外运	598 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	11,472.81	0.1
247	MAANSHAN IRON & STEEL-H	马钢股份	323 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	11,399.73	0.09
248	CHINA KEPEI EDUCATION GROUP	中国科培	1890 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	11,399.73	0.09
249	SINIC HOLDINGS GROUP CO-H	新力控股集团	2103 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	11,344.92	0.09
250	GUOTAI JUNAN INTERNATIONAL	国泰君安国际	1788 HK	香港联合交易所	中国香港	12,000	11,070.89	0.09
251	DATANG INTL POWER GEN CO-H	大唐发电	991 HK	香港联合交易所	中国香港	12,000	11,070.89	0.09
252	HENG TEN NETWORKS GROUP LTD	恒腾网络	136 HK	香港联合交易所	中国香港	84,000	11,048.97	0.09
253	BBMG CORP-H	金隅集团	2009 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	11,034.36	0.09
254	C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	建发国际集团	1908 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	10,997.82	0.09
255	DFZQ-H	东方证券	3958 HK	香港联合交易所	中国香港	2,800	10,946.66	0.09
256	SINOPEC KANTONS HOLDINGS	中石化冠德	934 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	10,851.67	0.09
257	SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	四环医药	460 HK	香港联合交易所	中国香港	16,000	10,815.13	0.09
258	CHINA TIAN LUN GAS HOLDINGS	天伦燃气	1600 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	10,815.13	0.09
259	TONG REN TANG TECHNOLOGIES-H	同仁堂科技	1666 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	10,760.32	0.09
260	CHINA FOODS LTD	中国食品	506 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	10,742.05	0.09
261	XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	特步国际	1368 HK	香港联合交易所	中国香港	4,500	10,605.04	0.09
262	PROSPERITY REIT	泓富产业信托	808 HK	香港联合交易所	中国香港	5,000	10,550.23	0.09
263	CHINA HARMONY NEW ENERGY AUT	和谐汽车	3836 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	10,550.23	0.09
264	ASIA CEMENT CHINA HOLDINGS	亚洲水泥(中国)	743 HK	香港联合交易所	中国香港	1,500	10,413.22	0.09
265	TCL ELECTRONICS HOLDINGS LTD	TCL 电子	1070 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	10,385.81	0.09

266	WEST CHINA CEMENT LTD	西部水泥	2233 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	10,303.60	0.09
267	GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	保利协鑫能源	3800 HK	香港联合交易所	中国香港	51,000	10,202.21	0.08
268	ANGANG STEEL CO LTD-H	鞍钢股份	347 HK	香港联合交易所	中国香港	5,800	10,013.13	0.08
269	NETDRAGON WEBSOFT HOLDINGS L	网龙	777 HK	香港联合交易所	中国香港	500	9,933.66	0.08
270	CENTRAL CHINA REAL ESTATE	建业地产	832 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	9,892.56	0.08
271	FIH MOBILE LTD	富智康集团	2038 HK	香港联合交易所	中国香港	13,000	9,856.02	0.08
272	ROAD KING INFRASTRUCTURE LTD	路劲	1098 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	9,572.85	0.08
273	BEIJING TONG REN TANG CHINES	同仁堂国药	3613 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	9,536.31	0.08
274	HUABAO INTERNATIONAL HOLDING	华宝国际	336 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	9,317.09	0.08
275	REDSUN PROPERTIES GROUP LTD	弘阳地产	1996 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	9,280.55	0.08
276	PAX GLOBAL TECHNOLOGY LTD	百富环球	327 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	9,234.88	0.08
277	Q TECHNOLOGY GROUP CO LTD	丘钛科技	1478 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	9,225.74	0.08
278	DIGITAL CHINA HOLDINGS LTD	神州控股	861 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	9,152.67	0.08
279	TIANGONG INTL CO LTD	天工国际	826 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	9,134.40	0.08
280	IDREAMSKY TECHNOLOGY HOLDING	创梦天地	1119 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	9,079.59	0.08
281	XINYI ENERGY HOLDINGS LTD	信义能源	3868 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	8,951.71	0.07
282	BANK OF CHONGQING CO LTD-H	重庆银行	1963 HK	香港联合交易所	中国香港	2,500	8,860.37	0.07
283	CHINA DONGXIANG GROUP CO	中国动向	3818 HK	香港联合交易所	中国香港	14,000	8,823.83	0.07
284	FRONTAGE HOLDINGS CORP	方达控股	1521 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	8,769.02	0.07
285	LIFESTYLE INTL HLDGS LTD	利福国际	1212 HK	香港联合交易所	中国香港	1,500	8,727.92	0.07
286	YIXIN GROUP LTD	易鑫集团	2858	香港联合	中国	5,000	8,677.68	0.07

			HK	交易所	香港			
287	DEXIN CHINA HOLDINGS CO LTD	德信中国	2019 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	8,632.01	0.07
288	CITYCHAMP WATCH & JEWELLERY	冠城钟表珠宝	256 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	8,494.99	0.07
289	TONGDA GROUP HOLDINGS LTD	通达集团	698 HK	香港联合交易所	中国香港	20,000	8,403.65	0.07
290	CHINA EVERBRIGHT GREENTECH L	中国光大绿色环保	1257 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	8,357.98	0.07
291	MEITU INC	美图公司	1357 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	8,330.57	0.07
292	HAITONG UNITRUST INTERNATI-H	海通恒信	1905 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	8,220.96	0.07
293	CHINA HIGH SPEED TRANSMISSIO	中国高速传动	658 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	8,220.96	0.07
294	MOBVISTA INC	汇量科技	1860 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	8,129.62	0.07
295	GLORY SUN FINANCIAL GROUP LT	宝新金融	1282 HK	香港联合交易所	中国香港	32,000	8,038.27	0.07
296	CHINA TRAVEL INTL INV HK	香港中旅	308 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	8,038.27	0.07
297	CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	中国忠旺	1333 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	8,001.73	0.07
298	FANTASIA HOLDINGS GROUP CO	花样年控股	1777 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	7,946.93	0.07
299	GUANGSHEN RAILWAY CO LTD-H	广深铁路	525 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	7,946.93	0.07
300	ZHUGUANG HOLDINGS GROUP CO	珠光控股	1176 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	7,892.12	0.07
301	REALORD GROUP HOLDINGS LTD	伟禄集团	1196 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	7,855.58	0.07
302	CHINA RISUN GROUP LTD	中国旭阳集团	1907 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	7,745.97	0.06
303	VPOWER GROUP INTERNATIONAL H	伟能集团	1608 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	7,727.70	0.06
304	CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD	中国东方集团	581 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	7,709.43	0.06
305	VSTECS HOLDINGS LTD	伟仕佳杰	856 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	7,636.36	0.06
306	CHINA LILANG LTD	中国利郎	1234 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	7,599.82	0.06
307	GREATVIEW ASEPTIC PACKAGING	纷美包装	468 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	7,508.48	0.06

308	GREENLAND HONG KONG HOLDINGS	绿地香港	337 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	7,508.48	0.06
309	IMPRO PRECISION INDUSTRIES L	鹰普精密	1286 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	7,316.65	0.06
310	SKYFAME REALTY HOLDINGS LTD	天誉置业	59 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	7,307.52	0.06
311	JINCHUAN GROUP INTERNATIONAL	金川国际	2362 HK	香港联合交易所	中国香港	12,000	7,234.44	0.06
312	COSMOPOLITAN INTL HLDGS	四海国际	120 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	7,179.64	0.06
313	JNBY DESIGN LTD	江南布衣	3306 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	7,097.43	0.06
314	RED STAR MACALLINE GROUP C-H	美凯龙	1528 HK	香港联合交易所	中国香港	1,760	6,977.22	0.06
315	COLOUR LIFE SERVICES GROUP	彩生活	1778 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	6,759.46	0.06
316	HUTCHISON TELECOMM HONG KONG	和记电讯香港	215 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	6,741.19	0.06
317	HUIFU PAYMENT LTD	汇付天下	1806 HK	香港联合交易所	中国香港	3,200	6,693.69	0.06
318	CHINA MERCHANTS LAND LTD	招商局置地	978 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	6,521.96	0.05
319	SHANGHAI INDUSTRIAL URBAN DE	上实城市开发	563 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	6,503.69	0.05
320	YANGTZE OPTICAL FIBRE AND-H	长飞光纤	6869 HK	香港联合交易所	中国香港	500	6,503.69	0.05
321	CHINA INTERNATIONAL MARINE-H	中集集团	2039 HK	香港联合交易所	中国香港	1,100	6,330.14	0.05
322	CHINA BLUECHEMICAL LTD - H	中海石油化学	3983 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	6,302.74	0.05
323	CANVEST ENVIRONMENTAL PROTEC	粤丰环保	1381 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	6,211.39	0.05
324	CHINA LOGISTICS PROPERTY HOL	中国物流资产	1589 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	6,065.24	0.05
325	TRULY INTERNATIONAL HOLDINGS	信利国际	732 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	5,919.09	0.05
326	CONSUN	康臣药业	1681	香港联合	中国	2,000	5,846.02	0.05

	PHARMACEUTICAL GROUP		HK	交易所	香港			
327	WISDOM EDUCATION INTERNATION	睿见教育	6068 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	5,827.75	0.05
328	CHINA AIRCRAFT LEASING GROUP	中国飞机租赁	1848 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	5,745.54	0.05
329	TEXHONG TEXTILE GROUP LTD	天虹纺织	2678 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	5,663.33	0.05
330	CIMC ENRIC HOLDINGS LTD	中集安瑞科	3899 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	5,608.52	0.05
331	CHINA MODERN DAIRY HOLDINGS	现代牧业	1117 HK	香港联合交易所	中国香港	7,000	5,562.85	0.05
332	SUN HUNG KAI & CO LTD	新鸿基公司	86 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	5,553.72	0.05
333	CGN NEW ENERGY HOLDINGS CO L	中广核新能源	1811 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	5,444.10	0.05
334	CHINA RENAISSANCE HOLDINGS L	华兴资本控股	1911 HK	香港联合交易所	中国香港	500	5,352.76	0.04
335	IMAX CHINA HOLDING INC	IMAX CHINA 公司	1970 HK	香港联合交易所	中国香港	500	5,124.40	0.04
336	SINOFERT HOLDINGS LTD	中化化肥	297 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	5,042.19	0.04
337	SA SA INTERNATIONAL HLDGS	莎莎国际	178 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	4,749.89	0.04
338	CHINA SHINWAY PHARMACEUTICA	神威药业	2877 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	4,667.68	0.04
339	GIORDANO INTERNATIONAL LTD	佐丹奴国际	709 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	4,274.90	0.04
340	GUORUI PROPERTIES LTD	国瑞置业	2329 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	4,238.36	0.04
341	FULLSHARE HOLDINGS LTD	丰盛控股	607 HK	香港联合交易所	中国香港	32,500	4,185.84	0.03
342	CHINA ZHENG TONG AUTO SERVICE	正通汽车	1728 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	4,055.67	0.03
343	SMARTONE TELECOMMUNICATIONS	数码通电讯	315 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	3,790.78	0.03
344	CITIC RESOURCES HOLDINGS LTD	中信资源	1205 HK	香港联合交易所	中国香港	16,000	3,653.76	0.03
345	CSSC HONG KONG SHIPPING CO L	中国船舶租赁	3877 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	3,580.68	0.03
346	CHINA FIRST CAPITAL GROUP LT	首控集团	1269 HK	香港联合交易所	中国香港	14,000	3,452.80	0.03

347	GRAND BAOXIN AUTO GROUP LTD	广汇宝信	1293 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	3,206.17	0.03
348	CHINA VAST INDUSTRIAL URBAN	中国宏泰发展	6166 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	3,078.29	0.03
349	TIANJIN PORT DVLPHLDS LTD	天津港发展	3382 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	2,959.55	0.02
350	VCREDIT HOLDINGS LTD	维信金科	2003 HK	香港联合交易所	中国香港	800	2,944.93	0.02
351	HAICHANG OCEAN PARK HOLDINGS	海昌海洋公园	2255 HK	香港联合交易所	中国香港	7,000	2,941.28	0.02
352	HC GROUP INC	慧聪集团	2280 HK	香港联合交易所	中国香港	2,500	2,923.01	0.02
353	GCL NEW ENERGY HOLDINGS LTD	协鑫新能源	451 HK	香港联合交易所	中国香港	28,000	2,813.40	0.02
354	CPMC HOLDINGS LTD	中粮包装	906 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	2,676.38	0.02
355	KASEN INTERNATIONAL HOLDINGS	卡森国际	496 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	2,658.11	0.02
356	PANDA GREEN ENERGY GROUP LTD	熊猫绿能	686 HK	香港联合交易所	中国香港	16,000	1,973.03	0.02
357	MINSHENG EDUCATION GROUP CO	民生教育	1569 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	1,936.49	0.02
358	LANDING INTERNATIONAL DEVELO	蓝鼎国际	582 HK	香港联合交易所	中国香港	8,400	1,910.55	0.02
359	SOUTHERN ENERGY HOLDINGS GRO	南方能源	1573 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	1,242.28	0.01
360	AGRITRADE RESOURCES LTD	鸿宝资源	1131 HK	香港联合交易所	中国香港	10,000	758.16	0.01
361	TYSAN HOLDINGS LTD	泰升集团	687 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	758.16	0.01
362	51 CREDIT CARD INC	51 信用卡	2051 HK	香港联合交易所	中国香港	1,500	685.08	0.01

7.4.2 期末积极投资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	TOWN HEALTH INTERNATIONAL ME	康健国际医疗	3886 HK	香港联合交易所	中国香港	110,000	69,129.14	0.57
2	CONVOY GLOBAL	康宏环	1019 HK	香港联合交易所	中国	270,000	41,187.01	0.34

	HOLDINGS LTD	球		交易所	香港			
3	SMI HOLDINGS GROUP LTD	星美控股	198 HK	香港联合交易所	中国香港	8,800	18,809.56	0.16
4	CT ENVIRONMENTAL GROUP LTD	中滔环保	1363 HK	香港联合交易所	中国香港	16,000	4,969.11	0.04
5	TENWOW INTERNATIONAL HOLDING	天喔国际	1219 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	2,776.86	0.02
6	CWT INTERNATIONAL LTD	海航实业股份	521 HK	香港联合交易所	中国香港	20,000	2,411.48	0.02
7	CAMSING INTERNATIONAL HOLDIN	承兴国际控股	2662 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	2,119.18	0.018
8	CHINA HUIZHAN DAIRY HLD. LTD	辉山乳业(退市)	6863 HK	香港联合交易所	中国香港	212,000	1,936.49	0.02
9	NATIONAL AGRICULTURAL HOLDINGS LTD	国农控股(退市)	1236 HK	香港联合交易所	中国香港	46,000	1,086.17	0.01
10	CHINA HUIYUAN JUICE GROUP	汇源果汁	1886 HK	香港联合交易所	中国香港	10,000	0.91	0

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	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	914 HK	262,246.94	1.72
2	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	586 HK	231,394.36	1.52
3	LI NING CO LTD	2331 HK	161,545.67	1.06
4	CHINA VANKE CO LTD-H	2202 HK	157,463.11	1.03
5	CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	817 HK	138,217.56	0.91
6	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	522 HK	87,941.41	0.58
7	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	1114 HK	67,180.71	0.44
8	CHINA LITERATURE LTD	772 HK	57,081.65	0.37
9	A-LIVING SERVICES CO LTD-H	3319 HK	56,589.95	0.37
10	TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	6110 HK	44,018.42	0.29
11	CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	2799 HK	40,029.24	0.26
12	GUANGZHOU BAIYUNSHAN	874 HK	36,224.25	0.24

	PHARM-H			
13	POLY PROPERTY DEVELOPMENT -H	6049 HK	34,664.49	0.23
14	VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	3331 HK	33,343.93	0.22
15	SHANGRI-LA ASIA LTD	69 HK	30,097.59	0.20
16	JS GLOBAL LIFESTYLE CO LTD	1691 HK	29,960.03	0.20
17	AK MEDICAL HOLDINGS LTD	1789 HK	29,345.59	0.19
18	CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	1268 HK	21,238.88	0.14
19	C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	1908 HK	18,817.86	0.12
20	STELLA INTERNATIONAL	1836 HK	18,524.40	0.12

注：本期累计买入金额指买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

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	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	914 HK	354,103.35	2.32
2	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	586 HK	294,720.22	1.93
3	LI NING CO LTD	2331 HK	288,374.61	1.89
4	CHINA VANKE CO LTD-H	2202 HK	234,669.62	1.54
5	CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	817 HK	171,030.07	1.12
6	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	522 HK	160,266.90	1.05
7	HUANENG RENEWABLES CORP-H	958 HK	68,352.37	0.45
8	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	981 HK	61,289.79	0.40
9	SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	1066 HK	58,588.16	0.38
10	LOGAN GROUP CO LTD	3380 HK	56,635.39	0.37
11	AGILE GROUP HOLDINGS LTD	3383 HK	52,440.04	0.34
12	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	3323 HK	48,847.66	0.32
13	CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	606 HK	46,428.83	0.30
14	PING AN HEALTHCARE AND TECHN	1833 HK	45,596.97	0.30
15	MINTH GROUP LTD	425 HK	43,117.22	0.28
16	YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	1579 HK	42,890.05	0.28
17	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	968 HK	34,841.94	0.23
18	LI & FUNG LTD	494 HK	34,761.55	0.23
19	CHINA RESOURCES CEMENT	1313 HK	34,132.88	0.22
20	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	6098 HK	33,367.79	0.22

注：本期累计卖出金额指卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

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	1,808,843.32
------------	--------------

卖出收入（成交）总额	4,631,037.64
------------	--------------

注：上述金额均指成交金额（成交单价乘以成交数量），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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

基金投资的前十名证券的发行主体本期未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 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未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	137,895.86
4	应收利息	288.03
5	应收申购款	41,490.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	179,674.59

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**7.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

无。

7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	公司名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	3886 HK	康健国际医疗	69,129.14	0.57	重大事项停牌
2	1019 HK	康宏环球	41,187.01	0.34	重大事项停牌
3	198 HK	星美控股	18,809.56	0.16	重大事项停牌
4	1363 HK	中滔环保	4,969.11	0.04	重大事项停牌
5	1219 HK	天喔国际	2,776.86	0.02	重大事项停牌

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 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（%）
恒生中小 A	1,463	8,328.15	123,788.25	1.02	12,060,294.99	98.98
恒生中小 C	-	-	-	-	-	-
合计	1,463	8,328.15	123,788.25	1.02	12,060,294.99	98.98

注：1、上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2、持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

8.2 期末上市基金前十名持有人

恒生中小 A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	赵何鉴	439,943.00	32.19
2	张明	278,245.00	20.36
3	苟晟	90,000.00	6.59
4	邓荣	86,719.00	6.35
5	顾玲	58,300.00	4.27
6	钱中明	51,061.00	3.74
7	丁志松	50,900.00	3.72
8	李小晶	50,002.00	3.66
9	游建忠	21,000.00	1.54
10	拾井芳	20,500.00	1.50

以上数据由中国证券登记结算有限公司提供，持有人为场内持有人。

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	恒生中小 A	9,374.33	0.0769

员持有本基金	恒生中小 C	0.00	0.0000
	合计	9,374.33	0.0769

注：上述占基金总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	恒生中小 A	0
	恒生中小 C	0
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	恒生中小 A	0
	恒生中小 C	0
	合计	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	恒生中小 A
基金合同生效日（2016 年 12 月 2 日）基金份额总额	788,370,205.40
本报告期期初基金份额总额	14,617,901.20
本报告期基金总申购份额	4,709,763.11
减：本报告期基金总赎回份额	7,143,581.07
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	12,184,083.24

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

无。

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

一、基金管理人的重大人事变动

无。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

无

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

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，基金管理人、托管人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
瑞银证券	3	5,518,275.85	100.00%	3,939.72	100.00%	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-

川财证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	3	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-

西部证券	1	-	-	-	-	-
西藏东财	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中国银河证 券	4	-	-	-	-	-
中金公司	3	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证 券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中银国际证 券	2	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-

注：根据中国证监会颁布的《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序。

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

- （一）财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- （二）经营行为规范，内控制度健全，能满足各投资组合运作的保密性要求；
- （三）研究实力较强，能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务；
- （四）具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，有足够的交易和清算能力，满足各投资组合证券交易需要；
- （五）能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；
- （六）相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金交易单元。

本报告期内本基金新增席位：无。本报告期内本基金退租席位：长城证券。

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

无。

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	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDIILOF）暂停申购、赎回及定投业务的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020年6月29日
2	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京肯特瑞基金销售有限公司为销售机构的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020年6月22日
3	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDIILOF）暂停申购、赎回及定投业务的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020年6月19日
4	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加泛华普益基金销售有限公司为销售机构的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020年6月5日
5	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中信证券华南股份有限公司为销售机构的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020年5月6日
6	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDIILOF）2019年年度报告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020年4月29日
7	大成基金管理有限公司关于终止泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理相关销售业务的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020年4月25日
8	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDIILOF）暂停申购、赎回及定投业务的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020年4月24日
9	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDIILOF）2020年第1季度报告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020年4月22日
10	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDIILOF）暂停申购、赎回及定投业务的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020年4月9日
11	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDIILOF）暂停申购、赎回及定投业务的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020年4月1日
12	大成基金管理有限公司关于延迟披露旗下公募基金2019年年度报告的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020年3月25日
13	大成基金管理有限公司关于注销南京分公司的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020年3月21日
14	关于大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDIILOF）增设C类基金份额并相应修订	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020年2月29日

	基金合同和托管协议的公告		
15	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDIILOF）托管协议	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020年2月29日
16	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDIILOF）更新招募说明书及摘要	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020年2月29日
17	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDIILOF）基金合同	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020年2月29日
18	大成基金管理有限公司关于注销青岛分公司的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020年2月29日
19	大成基金管理有限公司关于 APP 交易平台汇款交易费率优惠的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020年2月26日
20	关于公司旗下部分基金估值调整的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020年2月18日
21	大成基金管理有限公司关于 2020 年春节假期延长期间调整公司公募基金开放时间等相关事宜的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020年1月30日
22	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDIILOF）2019 年第 4 季度报告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020年1月17日
23	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDIILOF）暂停申购、赎回及定投业务的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020年1月17日
24	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDIILOF）2020 年境外主要市场节假日暂停申购赎回安排的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020年1月4日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）的文件；

- 2、《大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）基金合同》；
- 3、《大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）托管协议》；
- 4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 5、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

12.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，或登录本基金管理人网站 <http://www.dcfund.com.cn> 进行查阅。

大成基金管理有限公司

2020 年 8 月 28 日