

# 大成恒生综合中小型股指数证券投资 基金（QDII-LOF） 2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 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：2021 年 3 月 30 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。本年度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 2021 年 03 月 29 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。

本报告财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2020 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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	6
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
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
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	12
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.10 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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>16</b>
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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>16</b>
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>18</b>
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	22
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>46</b>

8.1 期末基金资产组合情况 .....	46
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 .....	46
8.3 期末按行业分类的权益投资组合 .....	47
8.4 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 .....	47
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动 .....	74
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 .....	76
8.7 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 .....	77
8.8 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 .....	77
8.9 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 .....	77
8.10 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 .....	77
8.11 投资组合报告附注 .....	77
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>78</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	78
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	79
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	79
9.4 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 .....	79
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	79
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>80</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>80</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	80
11.2 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 .....	80
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	80
11.4 基金投资策略的改变 .....	81
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	81
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	81
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	81
11.8 其他重大事件 .....	83
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>86</b>
12.1 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 .....	86
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	86
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>86</b>
13.1 备查文件目录 .....	86
13.2 存放地点 .....	87
13.3 查阅方式 .....	87

## § 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	12,514,572.14 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	12,441,541.43 份	73,030.71 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	秦一楠
	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

注：中国农业银行股份有限公司法定代表人已于 2021 年 2 月 9 日变更为谷澍。

## 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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.dcfund.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座 11 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

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2020 年		2019 年		2018 年	
	恒生中小 A	恒生中小	恒生中小 A	恒生中	恒生中小 A	恒生中

		C		小 C		小 C
本期已实现收益	57,889.89	2,794.05	520,204.36	-	5,560,858.25	-
本期利润	1,075,490.99	6,738.05	2,074,429.76	-	-4,703,945.53	-
加权平均基金份额本期利润	0.0911	0.1006	0.1179	-	-0.1401	-
本期加权平均净值利润率	9.02%	9.51%	11.81%	-	-12.66%	-
本期基金份额净值增长率	7.67%	13.23%	10.72%	-	-18.72%	-
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末		2019 年末		2018 年末	
期末可供分配利润	1,527,380.18	8,861.21	626,432.05	-	-1,281,313.18	-
期末可供分配基金份额利润	0.1228	0.1213	0.0429	0.0000	-0.0579	0.0000
期末基金资产净值	13,968,921.61	81,891.92	15,244,333.25	-	20,866,595.33	-
期末基金份额净值	1.123	1.121	1.043	-	0.942	-
3.1.3 累计期末指标	2020 年末		2019 年末		2018 年末	
基金份额累计净值增长率	12.30%	13.23%	4.30%	-	-5.80%	-

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、根据我公司 2020 年 2 月 29 日《关于大成恒生综合中小型股指数证券投资基金 (QDII-LOF) 增设 C 类基金份额并相应修订基金合同和托管协议的公告》，自 2020 年 3 月 3 日起，大成恒生综

合中小型股指数证券投资基金增设 C 类份额。本报告关于 C 类份额的指标计算起始日为 C 类份额的初始申购确认日。

### 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
过去三个月	9.88%	0.99%	17.52%	1.03%	-7.64%	-0.04%
过去六个月	13.43%	1.31%	27.52%	1.34%	-14.09%	-0.03%
过去一年	7.67%	1.60%	20.23%	1.63%	-12.56%	-0.03%
过去三年	-3.11%	1.32%	4.17%	1.35%	-7.28%	-0.03%
自基金合同生效起至今	12.30%	1.19%	27.29%	1.23%	-14.99%	-0.04%

恒生中小 C

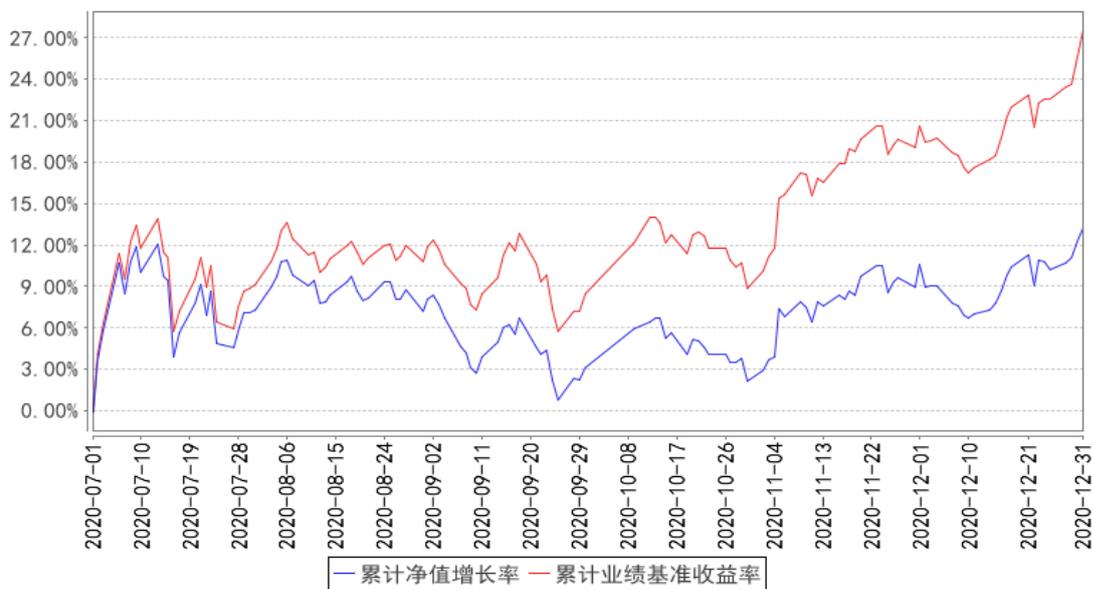
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	9.79%	0.98%	17.52%	1.03%	-7.73%	-0.05%
过去六个月	13.23%	1.31%	27.52%	1.34%	-14.29%	-0.03%
自基金合同生效起至今	13.23%	1.31%	27.52%	1.34%	-14.29%	-0.03%

### 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

恒生中小A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



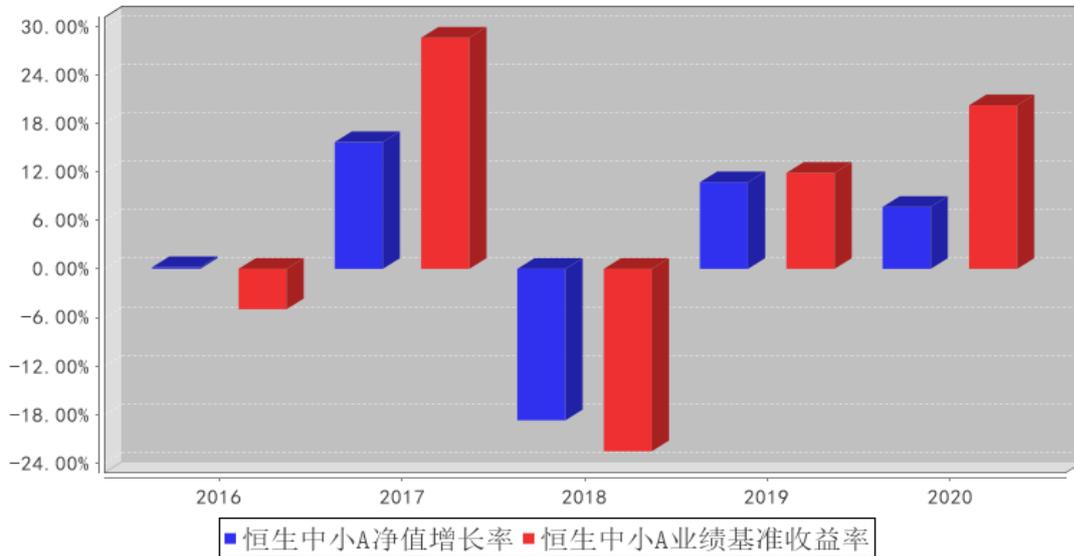
恒生中小C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



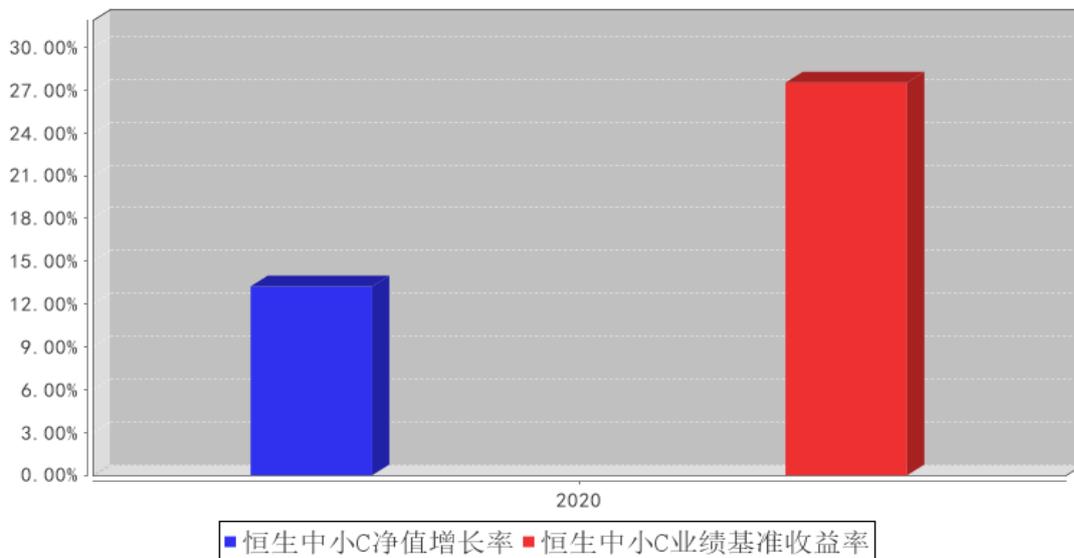
注：本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年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基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



恒生中小C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

## § 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%)。公司业务资质齐全，是全国同时具有境内、境外社保基金管理人资格和基本养老保险基金管理人资格的四家基金公司之一，全面涵盖公募基金、机构投资、海外投资、财富管理、养老金管理、私募股权投资等业务，旗下大成国际资产管理公司具备 QFII、RQFII 以及 QFLP 等资格。

历经 21 年的发展，大成基金形成了以长期投资能力为核心竞争优势，打造了一支具有良好职业素养和丰富经验的资产管理队伍。目前已形成权益、固定收益、量化投资、商品期货、境外投资、大类资产配置等六大投资团队，全面覆盖各类投资领域。截至 2020 年 12 月 31 日，公司管理公募基金产品数量共 115 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

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

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 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。公司旗下投资组合严格按照制度的规定，参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资活动相关的各个环节。研究部负责提供投资研究支持，投资部门负责投资决策，交易管理部负责实施交易并实时监控，监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核，风险管理部负责对交易情况进行合理性分析，通过多部门的协作互控，保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

##### 4.4.2 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。

#### 4.4.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

无。

#### 4.4.3 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 7 笔同日反向交易，原因为流动性需要或合规比例调整。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 5 笔同日反向交易，原因为流动性需要或合规比例调整。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，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波动，港股市场也不例外。

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%。

中国是最早控制疫情的国家，也是最早进入经济复苏状态的国家。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 季度的宏观经济已经开始恢复，至 4 季度，中国的宏观经济基本恢复到了正常的增长状态中。

港股市场走势也反映了中国宏观经济的变化。港股在 1、2 季度出现了明显的下滑，而在 3、4 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 1.123 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.67%，同期业绩比较基准收益率为 20.23%；截至本报告期末恒生中小 C 的基金份额净值为 1.121 元，本报告期基金份额净值增长率为 13.23%，同期业绩比较基准收益率为 27.52%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020 年，港股表现明显不如美股及 A 股，但港股前期的滞胀正是为将来的补涨提供了充足的空间，未来也将会有多重动能驱动港股上涨，原因主要有以下三个方面。

一方面，从传统行业股票来看，在中报之后，市场所担心的企业盈利下行将尘埃落定。随着中国经济的逐步恢复，上市公司利润也会同时修复，这将支持传统经济股票的上涨。

另一方面，近年来，中国科技巨头公司纷纷登陆港股市场，改变了港股的市场结构，使得港股市场的金融行业权重大幅下降且科技行业权重大幅上升，这将有力提升港股的长期增长前景。

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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，依据相关的法律法规、基金合同以及内部监察稽核制度，本基金管理人对本基金运作、内部管理、制度执行及遵规守法情况进行了监察稽核。内部监察稽核的重点是：国家法律法规及行业监管规则的执行情况；基金合同的遵守情况；内部规章制度的执行情况；资讯管制和保密工作落实情况；员工职业操守规范情况，目的是规范基金财产的运作，防范和控制投资风险，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，维护本基金份额持有人的合法权益。

（一）根据最新的法律法规、规章、规范性文件，本基金管理人及时制定了相应的公司制度，并对现有制度进行不断修订和完善，确保本基金管理人内控制度的适时性、全面性和合法合规性。同时，为保障制度的适时性，避免部分内控制度、业务规则与业务发展不相适应，报告期内本基金管理人组织各部门对内部管理制度作了进一步梳理和完善。

（二）全面加强风险监控，不断提高基金业务风险管理水平。为督促各部门完善并落实各项内控措施，公司严格执行风险控制管理员制度，健全内控工作协调机制及监督机制，并进一步加强投资风险量化评价能力及事前风险防范能力，有效防范相关业务风险。同时，公司严格执行投资报备制度，建立了基金从业人员证券投资管理监控信息系统，将投资报备工作纳入常态。

（三）日常监察和专项监察相结合，确保监察稽核的有效性和深入性。本年度，公司继续对本基金销售、宣传等方面的材料、协议及其他法律资料等进行了严格审查，对本基金各项投资比例、投资权限、基金交易、股票投资限制、股票库维护等方面进行实时监控，同时，还专门针对基金投资交易（包括公平交易、转债投资、投资权限、投资比例、流动性风险、基金重仓股等）、基金运营（基金头寸、基金结算、登记清算等）、网上交易、基金销售等进行专项监察。通过日常监察，保证了公司监察的全面性、实时性，通过专项监察，及时发现并纠正了业务中的潜在风险，加强了业务部门和人员的风险意识，从而较好地预防了风险的发生。

（四）加强了对投资管理人员通讯工具在交易时间的集中管理，定期或不定期对投资管理人员的网络即时通讯记录、电话录音等进行抽查，有效的防范了各种形式的利益输送行为。

（五）以多种方式加强合规教育与培训，提高全公司的合规守法意识。及时向全公司传达与基金相关的法律法规，并要求公司各部门贯彻到日常工作中。公司监察稽核部通过解答各业务部门提出的法律问题，提供法律依据，对于较为重大疑难法律事项及时咨询公司外部律师或监管部门，避免了业务发展中的盲目性，及时防范风险，维护了基金份额持有人的利益。

#### 4.8 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。

#### 4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人将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。

#### 4.10 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《中华人民共和国证券投资基金法》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—大成基金管理有限公司 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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《中华人民共和国证券投资基金法》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 托管人对本年度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年度报告中的财务指标、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，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

## § 6 审计报告

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金(QDII-LOF)全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了大成恒生综合中小型股指数证券投资基金(QDII-LOF) (以下简称“大成恒生综合中小型股指数基金”)的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附</p>

	注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了大成恒生综合中小型股指数基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于大成恒生综合中小型股指数基金,并履行了职业道德方面的其他责任。
管理层和治理层对财务报表的责任	大成恒生综合中小型股指数基金的基金管理人大成基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估大成恒生综合中小型股指数基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算大成恒生综合中小型股指数基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督大成恒生综合中小型股指数基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作: (一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对大成恒生综合中小型股指数基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导

	致大成恒生综合中小型股指数基金不能持续经营。 (五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	张振波	陈薇瑶
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座 11 楼	
审计报告日期	2021 年 3 月 29 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	4,425,841.05	984,183.23
结算备付金		-	527,262.06
存出保证金		274,706.89	64,163.91
交易性金融资产	7.4.7.2	12,734,610.93	14,303,489.32
其中：股票投资		12,734,610.93	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	314.72	301.38
应收股利		10,841.36	10,848.82
应收申购款		6,046.75	4,371.83
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		17,452,361.70	15,894,620.55
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2019 年 12 月 31 日</b>

<b>负债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		2,914,582.86	318,299.23
应付赎回款		386,653.33	201,614.37
应付管理人报酬		8,839.33	12,878.19
应付托管费		2,209.84	3,219.53
应付销售服务费		8.46	-
应付交易费用	7.4.7.7	3,318.94	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	7.4.7.8	85,935.41	110,563.67
负债合计		3,401,548.17	650,287.30
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	12,514,572.14	14,617,901.20
未分配利润	7.4.7.10	1,536,241.39	626,432.05
所有者权益合计		14,050,813.53	15,244,333.25
负债和所有者权益总计		17,452,361.70	15,894,620.55

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，大成恒生综合中小型股指数证券投资基金 (QDII-LOF) A 类基金份额净值 1.123 元，大成恒生综合中小型股指数证券投资基金 (QDII-LOF) C 类基金份额净值 1.121 元。大成恒生综合中小型股指数证券投资基金 (QDII-LOF) 基金份额总额 12,514,572.14 份，其中 A 类基金份额 12,441,541.43 份，C 类基金份额 73,030.71 份。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		1,468,716.11	2,594,654.16
1. 利息收入		7,194.30	7,998.14
其中：存款利息收入	7.4.7.11	7,194.30	7,998.14
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）		456,925.88	1,028,351.06
其中：股票投资收益	7.4.7.12	158,881.99	596,984.78
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	-	-
资产支持证券投资		-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	298,043.89	431,366.28
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	1,021,545.10	1,554,225.40
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-27,510.13	1,098.22
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	10,560.96	2,981.34
减：二、费用		386,487.07	520,224.40
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	119,704.51	176,004.10
2. 托管费	7.4.10.2.2	29,926.06	44,001.00
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	36.41	-
4. 交易费用	7.4.7.20	31,239.18	30,479.59
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	7.4.7.21	205,580.91	269,739.71
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,082,229.04	2,074,429.76
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,082,229.04	2,074,429.76

### 7.3 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12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31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)	-	1,082,229.04	1,082,229.04
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)	-2,103,329.06	-172,419.70	-2,275,748.76
其中：1. 基金申购款	11,840,176.70	143,635.83	11,983,812.53
2. 基金赎回款	-13,943,505.76	-316,055.53	-14,259,561.29
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)	12,514,572.14	1,536,241.39	14,050,813.53
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31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)	-	2,074,429.76	2,074,429.76
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)	-7,530,007.31	-166,684.53	-7,696,691.84
其中：1. 基金申购款	2,516,201.75	-17,213.84	2,498,987.91
2. 基金赎回款	-10,046,209.06	-149,470.69	-10,195,679.75
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)	14,617,901.20	626,432.05	15,244,333.25

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

大成恒生综合中小型股指数证券投资基金(QDII-LOF)(以下简称“本基金”)经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]第 2047 号《关于准予大成恒生综合中小型股指数证券投资基金(QDII-LOF)注册的批复》和机构部函[2016]第 1651 号《关于大成恒生综合中小型股指数证券投资基金(QDII-LOF)延期募集备案的回函》核准,由大成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《大成恒生综合中小型股指数证券投资基金(QDII-LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 788,161,803.26 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 1578 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《大成恒生综合中小型股指数证券投资基金(QDII-LOF)基金合同》于 2016 年 12 月 2 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 788,370,205.40 份基金份额,其中认购资金利息折合 208,402.14 份基金份额。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司,境外资产托管人为摩根大通银行。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2016]878 号文审核同意,本基金 8,438,415.00 份基金份额(截至 2016 年 12 月 5 日止)于 2016 年 12 月 12 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人将其转托管至深交所场内后即可上市流通。

根据本基金的基金管理人大成基金管理有限公司于 2020 年 2 月 29 日发布的《关于大成恒生综合中小型股指数证券投资基金(QDII-LOF)增设 C 类基金份额并相应修订基金合同和托管协议的公告》以及更新的《大成恒生综合中小型股指数证券投资基金(QDII-LOF)基金合同》的有关规定,自 2020 年 3 月 3 日起,本基金增设 C 类基金份额,原有基金份额转为 A 类基金份额。其中,在

投资者申购时收取申购费用, 不从本类别资产中计提销售服务费的基金份额, 称为 A 类基金份额; 投资者申购时不收取申购费用, 而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额, 称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置基金代码并分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《大成恒生综合中小型股指数证券投资基金(QDII-LOF) 基金合同》的有关规定, 本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股, 也可以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、结构性产品等。本基金可通过沪港股票市场交易互联互通机制(以下简称“沪港通”)投资于沪港通允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票。本基金还可投资于全球证券市场中具有良好流动性的其他金融工具, 包括在证券交易市场挂牌的普通股、优先股、存托凭证, 固定收益类证券(含中期票据)、银行存款、现金等货币市场工具、权证、股指期货以及中国证监会允许本基金投资的其他产品或金融工具。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%。本基金的业绩比较基准为: 恒生综合中小型股指数收益率 $\times$ 95%+人民币活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人大成基金管理有限公司于 2021 年 3 月 29 日批准报出。

#### 7.4.2 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》、《大成恒生综合中小型股指数证券投资基金(QDII-LOF) 基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定, 开放式基金在基金合同生效后, 连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的, 基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案, 如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等, 并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2020 年 12 月 31 日, 本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形, 本基金的基金管理人已向中国证监会报告计划继续长期运作本基金, 故本财务报表仍以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年度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 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险

和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累

计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，其中场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，场内基金份额持有人只能选择现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的市净率法、市盈率法等估值技术进行估值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	4,425,841.05	984,183.23
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	4,425,841.05	984,183.23

注：于本期末，活期存款中包括的外币余额为港币活期存款 943,706.26 元，折合人民币 794,260.93 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)。

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	12,249,989.03	12,734,610.93	484,621.90
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债   交易所市场	-	-	-

券	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		12,249,989.03	12,734,610.93	484,621.90
项目	上年度末 2019年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票		14,840,412.52	14,303,489.32	-536,923.20
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		14,840,412.52	14,303,489.32	-536,923.20

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

无。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	311.18	253.92
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	3.54	47.46
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	314.72	301.38

## 7.4.7.6 其他资产

无。

## 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	3,318.94	3,712.31
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	3,318.94	3,712.31

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	263.41	532.42
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	40,000.00	90,000.00
应付指数使用费	45,672.00	20,031.25
合计	85,935.41	110,563.67

## 7.4.7.9 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12月31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	11,607,073.14	11,607,073.14
本期赎回(以“-”号填列)	-13,783,432.91	-13,783,432.91
本期末	12,441,541.43	12,441,541.43

## 恒生中小 C

项目	本期 2020年3月3日(基金合同生效日)至2020年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	233,103.56	233,103.56
本期赎回(以“-”号填列)	-160,072.85	-160,072.85
本期末	73,030.71	73,030.71

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

2. 截至2020年12月31日止，本基金于深交所上市的基金份额为4,099,750.00份(2019年12月31日：1,313,857.00份)，托管在场外未上市交易的基金份额为8,414,822.14份(2019年

12月31日：13,304,044.20份)。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择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。

#### 7.4.7.10 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	57,889.89	1,017,601.10	1,075,490.99
本期基金份额交易产生的变动数	-660,751.55	486,208.69	-174,542.86
其中：基金申购款	3,896,750.63	-3,766,735.12	130,015.51
基金赎回款	-4,557,502.18	4,252,943.81	-304,558.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,379,516.52	-2,852,136.34	1,527,380.18

##### 恒生中小 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	2,794.05	3,944.00	6,738.05
本期基金份额交易产生的变动数	565,597.61	-563,474.45	2,123.16
其中：基金申购款	1,810,197.47	-1,796,577.15	13,620.32
基金赎回款	-1,244,599.86	1,233,102.70	-11,497.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	568,391.66	-559,530.45	8,861.21

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
活期存款利息收入	6,431.75	7,320.34
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	733.63	651.37
其他	28.92	26.43
合计	7,194.30	7,998.14

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。

## 7.4.7.12 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12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
卖出股票成交总额	8,443,942.22	10,599,444.37
减：卖出股票成本总额	8,285,060.23	10,002,459.59
买卖股票差价收入	158,881.99	596,984.78

## 7.4.7.13 基金投资收益

无。

## 7.4.7.14 债券投资收益

无。

## 7.4.7.15 贵金属投资收益

无。

## 7.4.7.16 衍生工具收益

无。

## 7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	298,043.89	431,366.28
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	298,043.89	431,366.28

## 7.4.7.18 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12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日

1. 交易性金融资产	1,021,545.10	1,554,225.40
股票投资	1,021,545.10	1,554,225.40
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	1,021,545.10	1,554,225.40

#### 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
基金赎回费收入	10,560.96	2,981.34
合计	10,560.96	2,981.34

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。

#### 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
交易所市场交易费用	31,239.18	30,479.59
银行间市场交易费用	-	-
合计	31,239.18	30,479.59

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
审计费用	40,000.00	40,000.00
信息披露费	-	50,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	2,196.25	2,901.21
指数使用费	88,539.25	116,838.50
上市费	60,000.00	60,000.00
其他	14,845.41	-
合计	205,580.91	269,739.71

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。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 7.4.9 关联方关系

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
大成创新资本管理有限公司（“大成创新资本”）	基金管理人的合营企业
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
中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东
中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东
光大证券股份有限公司（“光大证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
大成国际资产管理有限公司（“大成国际”）	基金管理人的子公司

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	119,704.51	176,004.10
其中：支付销售机构的客户维护费	50,450.37	77,623.38

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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	29,926.06	44,001.00

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。

#### 7.4.10.2.3 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12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	恒生中小 A	恒生中小 C	合计
大成基金	-	2.47	2.47
合计	-	2.47	2.47
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12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	恒生中小 A	恒生中小 C	合计
-	-	-	-
合计	-	-	-

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给大成基金，再由大成基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费=前一日 C 类基金资产净值×0.10%/当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

**7.4.10.4 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**

无。

**7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

无。

**7.4.10.5.2 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。

**7.4.10.6 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12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31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	794,258.08	-	404,689.35	-
中国农业银行	3,631,582.97	6,431.75	579,493.88	7,320.34

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。

**7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

**7.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

无。

**7.4.11 利润分配情况**

无。

**7.4.12 期末(2020年12月31日)本基金持有的流通受限证券****7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

无。

**7.4.12.2 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	2017-11-27	重大事项	0.27	2021-3-1	0.29	110,000	122,662.27	29,625.73	-
1363.HK	中滔环保	2019-04-01	重大事项	0.29	未知	未知	16,000	22,603.95	4,578.52	-
1219.HK	天喔国际	2018-08-13	已退市	0.32	不适用	不适用	8,000	12,153.81	2,558.59	-
1019.HK	康宏环球	2017-12-08	重大事项	0.01	未知	未知	270,000	50,157.33	2,272.43	-
2662.HK	承兴国际控股	2019-07-19	重大事项	0.98	未知	未知	2,000	11,395.92	1,952.60	1
6863.HK	辉山乳业	2017-03-27	已退市	0.01	不适用	不适用	212,000	538,969.89	1,784.28	-
1573.HK	南方能源	2020-04-01	重大事项	0.57	未知	未知	2,000	1,599.69	1,144.63	-
1236.HK	国农控股	2017-03-28	已退市	0.02	不适用	不适用	46,000	71,262.08	1,000.79	-
1131.HK	鸿宝资源	2020-07-02	重大事项	0.07	未知	未知	10,000	5,212.46	698.56	-
0198.HK	星美控股	2018-09-03	已退市	0.00	不适用	不适用	8,800	27,579.69	7.41	-
1886.HK	汇源果汁	2018-04-03	重大事项	0.00	不适用	不适用	10,000	23,658.22	0.84	2

注：1. 承兴国际控股有限公司自 2021 年 1 月 19 日起更名为美好发展集团有限公司。

2. 中国汇源果汁集团有限公司股份自 2021 年 1 月 18 日起退市。

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。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 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。

### 7.4.13.2 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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国农业银行及境外次托管人摩根大通银行，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）。

### 7.4.13.3 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。

#### 7.4.13.3.1 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。

### 7.4.13.4 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。

#### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来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和存出保证金等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020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	3,631,582.97	-	-	794,258.08	4,425,841.05
存出保证金	274,706.89	-	-	-	274,706.89
交易性金融资产	-	-	-	12,734,610.93	12,734,610.93
应收利息	-	-	-	314.72	314.72
应收股利	-	-	-	10,841.36	10,841.36
应收申购款	-	-	-	6,046.75	6,046.75
资产总计	3,906,289.86	-	-	13,546,071.84	17,452,361.70
负债					
应付赎回款	-	-	-	386,653.33	386,653.33
应付管理人报酬	-	-	-	8,839.33	8,839.33
应付托管费	-	-	-	2,209.84	2,209.84
应付证券清算款	-	-	-	2,914,582.86	2,914,582.86
应付销售服务费	-	-	-	8.46	8.46
应付交易费用	-	-	-	3,318.94	3,318.94
其他负债	-	-	-	85,935.41	85,935.41
负债总计	-	-	-	3,401,548.17	3,401,548.17
利率敏感度缺口	3,906,289.86	-	-	10,144,523.67	14,050,813.53
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。

#### 7.4.13.4.1.2 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）。

#### 7.4.13.4.2 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。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2020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	-	794,260.93	-	794,260.93
交易性金融资 产	-	12,734,610.93	-	12,734,610.93
资产合计	-	13,528,871.86	-	13,528,871.86
以外币计价的 负债				

应付证券清算款	-	455,756.51	-	455,756.51
负债合计	-	455,756.51	-	455,756.51
资产负债表外汇风险敞口净额	-	13,073,115.35	-	13,073,115.35
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

#### 7.4.13.4.2.2 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12月31日)	上年度末 (2019年12月31日)
分析	港币相对人民币升值 5%	653,655.77	735,443.91
	港币相对人民币贬值 5%	-653,655.77	-735,443.91

#### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 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	12,734,610.93	90.63	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	12,734,610.93	90.63	14,303,489.32	93.83

#### 7.4.13.4.3.2 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	
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 12 月 31 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）

分析	业绩比较基准上升 5%	624,804.03	674,834.10
	业绩比较基准下降 5%	-624,804.03	-674,834.10

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 7.4.14 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

于本期末，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 12,688,986.55 元，属于第二层次的余额为 8,374.31 元，属于第三层次的余额为 37,250.07 元(上年度末：第一层次 14,132,571.01 元 第二层次 167,953.37 元 第三层次 2,964.94 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

上述第三层次资产变动如下：

交易性金融资产

股票投资

2020 年 1 月 1 日	2,964.94
购买	-
出售	-
转入第三层次	34,539.14
转出第三层次	-0.72
当期利得或损失总额	-253.29
计入损益的利得或损失	-253.29
2020 年 12 月 31 日	37,250.07

2020 年 12 月 31 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(从年初起算)

——公允价值变动损益	-123,652.20
------------	-------------

计入损益的利得或损失计入利润表中的公允价值变动损益项目。

#### 交易性金融资产

##### 股票投资

2019 年 1 月 1 日	-
购买	-
出售	-
转入第三层次	2,964.94
转出第三层次	-
当期利得或损失总额	-
计入损益的利得或损失	-
2019 年 12 月 31 日	2,964.94

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(从年初起算)

——公允价值变动损益	-270,216.70
------------	-------------

使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的相关信息如下:

	2020 年 12 月 31 日 公允价值	估值技术	名称	不可观察输入值	
				范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
交易性金融资产——股票投资	29,625.73	市场法	企业价值乘数、流动性折扣	3.5, 25%	正相关
	7,624.34	市场法	市净率	1	正相关
不可观察输入值					
	2019 年 12 月 31 日 公允价值	估值技术	名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
交易性金融资产——股票投资	2,964.94	市场法	市净率	1	正相关

## (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：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。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	12,734,610.93	72.97
	其中：普通股	12,734,610.93	72.97
	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	4,425,841.05	25.36
8	其他各项资产	291,909.72	1.67
9	合计	17,452,361.70	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 11,856,594.42 元，占期末基金资产净值的比例为 84.38%。

### 8.2 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	12,734,610.93	90.63

合计	12,734,610.93	90.63
----	---------------	-------

### 8.3 期末按行业分类的权益投资组合

#### 8.3.1 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 (%)
金融	1,097,961.47	7.81
通信服务	345,230.63	2.46
房地产	1,468,881.96	10.45
能源	142,153.00	1.01
公用事业	349,507.84	2.49
非日常生活消费品	2,639,477.27	18.79
工业	1,914,515.89	13.63
日常消费品	566,945.55	4.03
信息技术	1,630,201.12	11.60
医疗保健	1,672,214.38	11.90
原材料	848,641.61	6.04
合计	12,675,730.72	90.21

注：以上分类采用全球行业分类标准 (GICS)。

#### 8.3.2 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 (%)
金融	2,272.43	0.02
通信服务	7.41	-
房地产	13,255.83	0.09
能源	1,843.19	0.01
公用事业	-	-
非日常生活消费品	-	-
工业	4,578.52	0.03
日常消费品	4,343.71	0.03
信息技术	2,953.39	0.02
医疗保健	29,625.73	0.21
原材料	-	-
合计	58,880.21	0.42

注：以上分类采用全球行业分类标准 (GICS)。

### 8.4 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

#### 8.4.1 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	LI NING CO LTD	李宁	2331 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	358,875.30	2.55
2	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	信义光能	968 HK	香港联合交易所	中国香港	20,000	340,864.20	2.43
3	INNOVENT BIOLOGICS INC	信达生物	1801 HK	香港联合交易所	中国香港	4,500	310,754.53	2.21
4	BYD CO LTD-H	比亚迪股份	1211 HK	香港联合交易所	中国香港	1,500	256,531.87	1.83
5	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	长城汽车	2333 HK	香港联合交易所	中国香港	11,000	246,263.86	1.75
6	KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	金蝶国际	268 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	212,766.59	1.51
7	YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	颐海国际	1579 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	193,577.20	1.38
8	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	海螺创业	586 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	190,378.97	1.35
9	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	紫金矿业	2899 HK	香港联合交易所	中国香港	20,000	147,791.98	1.05
10	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	信义玻璃	868 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	145,772.05	1.04
11	CHINA VANKE CO LTD-H	万科企业	2202 HK	香港联合交易所	中国香港	6,300	141,837.38	1.01
12	TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	青岛啤酒股份	168 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	136,682.34	0.97
13	KINGSOFT CORP LTD	金山软件	3888 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	126,246.00	0.90
14	WUXI APPTec CO LTD-H	药明康德	2359 HK	香港联合交易所	中国香港	940	120,095.29	0.85
15	SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	威高股份	1066 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	117,964.26	0.84
16	CITIC	中信证券	6030 HK	香港联合	中国	7,500	110,339.00	0.79

	SECURITIES CO LTD-H			交易所	香港			
17	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	中国建材	3323 HK	香港联合 交易所	中国 香港	14,000	109,817.19	0.78
18	MICROPORT SCIENTIFIC CORP	微创医疗	853 HK	香港联合 交易所	中国 香港	3,000	105,920.39	0.75
19	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	102,511.75	0.73
20	CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	中国金茂	817 HK	香港联合 交易所	中国 香港	32,000	96,148.95	0.68
21	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	ASMPACIFIC	522 HK	香港联合 交易所	中国 香港	1,100	94,709.75	0.67
22	CHINA INTERNATION AL CAPITA-H	中金公司	3908 HK	香港联合 交易所	中国 香港	5,200	91,907.09	0.65
23	WEICHAI POWER CO LTD-H	潍柴动力	2338 HK	香港联合 交易所	中国 香港	7,000	91,671.43	0.65
24	CHINA LITERATURE LTD	阅文集团	772 HK	香港联合 交易所	中国 香港	1,600	81,942.07	0.58
25	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	广汽集团	2238 HK	香港联合 交易所	中国 香港	11,200	81,255.29	0.58
26	MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	明源云	909 HK	香港联合 交易所	中国 香港	2,000	80,460.78	0.57
27	JINXIN FERTILITY GROUP LTD	锦欣生殖	1951 HK	香港联合 交易所	中国 香港	6,000	79,787.47	0.57
28	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	龙源电力	916 HK	香港联合 交易所	中国 香港	12,000	78,474.51	0.56
29	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	77,414.05	0.55
30	SINOPHARM	国药控股	1099 HK	香港联合	中国	4,800	76,191.99	0.54

	GROUP CO-H			交易所	香港			
31	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	76,084.26	0.54
32	HUA HONG SEMICONDUCT OR LTD	华虹半导体	1347 HK	香港联合 交易所	中国 香港	2,000	74,064.32	0.53
33	NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	新华保险	1336 HK	香港联合 交易所	中国 香港	2,900	73,832.87	0.53
34	MAN WAH HOLDINGS LTD	敏华控股	1999 HK	香港联合 交易所	中国 香港	5,200	73,613.20	0.52
35	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	BRILLIANCE CHI	1114 HK	香港联合 交易所	中国 香港	12,000	71,303.74	0.51
36	SITC INTERNATION AL HOLDINGS	海丰国际	1308 HK	香港联合 交易所	中国 香港	5,000	70,445.27	0.50
37	COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	中国远洋	1919 HK	香港联合 交易所	中国 香港	9,000	70,445.27	0.50
38	WEIMOB INC	微盟集团	2013 HK	香港联合 交易所	中国 香港	6,000	70,394.77	0.50
39	MINTH GROUP LTD	敏实集团	425 HK	香港联合 交易所	中国 香港	2,000	68,846.15	0.49
40	KINGBOARD HOLDINGS LTD	建滔化工	148 HK	香港联合 交易所	中国 香港	2,500	68,804.07	0.49
41	HAITIAN INTERNATION AL HLDGS	海天国际	1882 HK	香港联合 交易所	中国 香港	3,000	67,667.86	0.48
42	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	玖龙纸业	2689 HK	香港联合 交易所	中国 香港	7,000	64,806.28	0.46
43	JS GLOBAL LIFESTYLE CO LTD	J S 环球生 活	1691 HK	香港联合 交易所	中国 香港	5,000	63,038.84	0.45
44	HAITONG SECURITIES CO LTD-H	海通证券	6837 HK	香港联合 交易所	中国 香港	10,800	62,991.70	0.45

45	SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI -H	复星医药	2196 HK	香港联合 交易所	中国 香港	2,000	62,365.52	0.44
46	PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	中国人民保 险集团	1339 HK	香港联合 交易所	中国 香港	29,000	60,042.60	0.43
47	HUATAI SECURITIES CO LTD-H	HTSC	6886 HK	香港联合 交易所	中国 香港	5,800	59,554.45	0.42
48	CANSINO BIOLOGICS INC-H	康希诺	6185 HK	香港联合 交易所	中国 香港	400	59,419.78	0.42
49	PCCW LTD	电讯盈科	8 HK	香港联合 交易所	中国 香港	15,000	58,956.88	0.42
50	CHINA RESOURCES CEMENT	华润水泥控 股	1313 HK	香港联合 交易所	中国 香港	8,000	58,308.82	0.42
51	CHINASOFT INTERNATION AL LTD	中国软件国 际	354 HK	香港联合 交易所	中国 香港	8,000	58,241.49	0.41
52	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	福耀玻璃	3606 HK	香港联合 交易所	中国 香港	1,600	57,366.18	0.41
53	SAMSONITE INTERNATION AL SA	新秀丽	1910 HK	香港联合 交易所	中国 香港	4,900	56,664.25	0.40
54	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	中车时代电 气	3898 HK	香港联合 交易所	中国 香港	1,900	54,050.12	0.38
55	CHINA YONGDA AUTOMOBILES SER	永达汽车	3669 HK	香港联合 交易所	中国 香港	5,000	53,949.12	0.38
56	YADEA GROUP HOLDINGS LTD	雅迪控股	1585 HK	香港联合 交易所	中国 香港	4,000	53,932.29	0.38
57	GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	保利协鑫能 源	3800 HK	香港联合 交易所	中国 香港	52,000	53,831.29	0.38
58	FAR EAST HORIZON LTD	远东宏信	3360 HK	香港联合 交易所	中国 香港	8,000	53,797.63	0.38
59	CHINA	美东汽车	1268 HK	香港联合	中国	2,000	53,023.32	0.38

	MEIDONG AUTO HOLDINGS			交易所	香港			
60	CGN POWER CO LTD-H	中广核电力	1816 HK	香港联合 交易所	中国 香港	37,000	52,004.94	0.37
61	NAGACORP LTD	金界控股	3918 HK	香港联合 交易所	中国 香港	6,000	51,306.37	0.37
62	CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	中国银河	6881 HK	香港联合 交易所	中国 香港	12,500	51,129.63	0.36
63	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	洛阳钼业	3993 HK	香港联合 交易所	中国 香港	12,000	51,104.38	0.36
64	VITASOY INTL HOLDINGS LTD	VITASONYIN TL	345 HK	香港联合 交易所	中国 香港	2,000	50,835.06	0.36
65	A-LIVING SMART CITY SERVICES	雅生活服务	3319 HK	香港联合 交易所	中国 香港	1,750	50,666.73	0.36
66	GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	富力地产	2777 HK	香港联合 交易所	中国 香港	6,000	50,346.90	0.36
67	TOPSPORTS INTERNATION AL HOLD	滔搏	6110 HK	香港联合 交易所	中国 香港	5,000	48,815.12	0.35
68	HANG LUNG GROUP LTD	恒隆集团	10 HK	香港联合 交易所	中国 香港	3,000	48,680.46	0.35
69	GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	绿城服务	2869 HK	香港联合 交易所	中国 香港	6,000	48,326.97	0.34
70	CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	招商局港口	144 HK	香港联合 交易所	中国 香港	6,000	47,922.98	0.34
71	HYSAN DEVELOPMENT CO	希慎兴业	14 HK	香港联合 交易所	中国 香港	2,000	47,889.32	0.34
72	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	47,216.00	0.34
73	CHINA BOHAI	渤海银行	9668 HK	香港联合	中国	11,000	46,938.26	0.33

	BANK CO LTD-H			交易所	香港			
74	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	中航科工	2357 HK	香港联合交易所	中国香港	10,000	45,532.72	0.32
75	TONGCHENG-E LONG HOLDINGS LTD	同程艺龙	780 HK	香港联合交易所	中国香港	3,600	45,448.56	0.32
76	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	中国交通建设	1800 HK	香港联合交易所	中国香港	16,000	45,111.90	0.32
77	LIFETECH SCIENTIFIC CORP	先健科技	1302 HK	香港联合交易所	中国香港	12,000	44,943.58	0.32
78	CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	中国光大银行	6818 HK	香港联合交易所	中国香港	18,000	44,691.08	0.32
79	KWG GROUP HOLDINGS LTD	合景泰富	1813 HK	香港联合交易所	中国香港	5,000	44,522.76	0.32
80	CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT	中国光大国际	257 HK	香港联合交易所	中国香港	12,000	44,236.60	0.31
81	PHARMARON BEIJING CO LTD-H	康龙化成	3759 HK	香港联合交易所	中国香港	400	44,101.94	0.31
82	ZAI LAB LTD	再鼎医药	9688 HK	香港联合交易所	中国香港	50	43,512.79	0.31
83	SEAZEN GROUP LTD	新城发展控股	1030 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	43,428.62	0.31
84	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	中国中铁	390 HK	香港联合交易所	中国香港	15,000	43,176.13	0.31
85	ZTE CORP-H	中兴通讯	763 HK	香港联合交易所	中国香港	2,600	42,671.15	0.30
86	SHENZHEN INTL HOLDINGS	深圳国际	152 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	42,149.33	0.30
87	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	北控水务集团	371 HK	香港联合交易所	中国香港	16,000	42,014.67	0.30
88	SINOTRUK HONG KONG	中国重汽	3808 HK	香港联合交易所	中国香港	2,500	41,661.18	0.30

	LTD							
89	AIR CHINA LTD-H	中国国航	753 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	41,072.03	0.29
90	JIANGXI COPPER CO LTD-H	江西铜业股份	358 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	41,004.70	0.29
91	CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	中国联塑	2128 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	40,870.04	0.29
92	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	裕元集团	551 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	40,752.21	0.29
93	GF SECURITIES CO LTD-H	广发证券	1776 HK	香港联合交易所	中国香港	4,400	40,587.25	0.29
94	BOSIDENG INTL HLDGS LTD	波司登	3998 HK	香港联合交易所	中国香港	12,000	39,893.74	0.28
95	JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	九毛九	9922 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	39,725.41	0.28
96	ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	众安在线	6060 HK	香港联合交易所	中国香港	1,300	39,607.58	0.28
97	BOC AVIATION LTD	中银航空租赁	2588 HK	香港联合交易所	中国香港	700	39,472.92	0.28
98	CHINA MERCHANTS SECURITIES-H	招商证券	6099 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	39,052.10	0.28
99	CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	中国中药	570 HK	香港联合交易所	中国香港	12,000	38,782.77	0.28
100	CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	中国信达	1359 HK	香港联合交易所	中国香港	31,000	38,353.53	0.27
101	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	37,974.80	0.27
102	ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	中联重科	1157 HK	香港联合交易所	中国香港	4,800	37,570.81	0.27
103	YUM CHINA	百胜中国	9987 HK	香港联合	中国	100	37,419.31	0.27

	HOLDINGS INC			交易所	香港			
104	KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	建滔积层板	1888 HK	香港联合 交易所	中国 香港	3,500	37,293.07	0.27
105	XIABUXIABU CATERING MANAGEME	呷哺呷哺	520 HK	香港联合 交易所	中国 香港	2,500	37,200.49	0.26
106	CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	康哲药业	867 HK	香港联合 交易所	中国 香港	5,000	36,443.01	0.26
107	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	中国宏桥	1378 HK	香港联合 交易所	中国 香港	6,000	35,853.86	0.26
108	HKBN LTD	香港宽频	1310 HK	香港联合 交易所	中国 香港	3,500	35,348.88	0.25
109	KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING	新东方在线	1797 HK	香港联合 交易所	中国 香港	1,500	35,222.63	0.25
110	XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	金风科技	2208 HK	香港联合 交易所	中国 香港	2,680	35,142.17	0.25
111	SHANGRI-LA ASIA LTD	香格里拉 (亚洲)	69 HK	香港联合 交易所	中国 香港	6,000	34,894.39	0.25
112	AGILE GROUP HOLDINGS LTD	雅居乐集团	3383 HK	香港联合 交易所	中国 香港	4,000	34,742.90	0.25
113	CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	宇华教育	6169 HK	香港联合 交易所	中国 香港	6,000	34,086.42	0.24
114	CRRG CORP LTD - H	中国中车	1766 HK	香港联合 交易所	中国 香港	15,000	33,707.68	0.24
115	SHANGHAI PHARMACEUTI CALS-H	上海医药	2607 HK	香港联合 交易所	中国 香港	2,900	33,340.73	0.24
116	VENUS MEDTECH HANGZHOU INC-H	启明医疗	2500 HK	香港联合 交易所	中国 香港	500	33,265.82	0.24
117	HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	合生创展集 团	754 HK	香港联合 交易所	中国 香港	2,000	33,261.61	0.24
118	UNI-PRESIDE	统一企业中	220 HK	香港联合	中国	5,000	33,202.70	0.24

	NT CHINA HOLDINGS	国		交易所	香港			
119	CHINA OILFIELD SERVICES-H	中海油田服务	2883 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	33,126.95	0.24
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	33,076.45	0.24
121	KERRY PROPERTIES LTD	嘉里建设	683 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	33,059.62	0.24
122	AUSNUTRIA DAIRY CORP LTD	澳优	1717 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	32,874.46	0.23
123	HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	海吉亚医疗	6078 HK	香港联合交易所	中国香港	800	32,857.63	0.23
124	3SBIO INC	三生制药	1530 HK	香港联合交易所	中国香港	5,500	32,727.17	0.23
125	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	32,672.46	0.23
126	ALIBABA PICTURES GROUP LTD	阿里影业	1060 HK	香港联合交易所	中国香港	40,000	32,318.98	0.23
127	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	32,285.31	0.23
128	AKESO INC	康方生物	9926 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	31,982.32	0.23
129	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	31,637.25	0.23
130	XD INC	心动公司	2400 HK	香港联合交易所	中国香港	800	31,544.67	0.22
131	YUEXIU PROPERTY CO LTD	越秀地产	123 HK	香港联合交易所	中国香港	24,000	31,511.00	0.22
132	TIANNENG POWER INTL LTD	天能动力	819 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	31,477.34	0.22
133	CHINA EAST EDUCATION	中国东方教育	667 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	31,376.34	0.22

	HOLDING							
134	YANZHOU COAL MINING CO-H	兖州煤业股 份	1171 HK	香港联合 交易所	中国 香港	6,000	31,309.01	0.22
135	FORTUNE REIT	置富产业信 托	778 HK	香港联合 交易所	中国 香港	5,000	31,098.60	0.22
136	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	招金矿业	1818 HK	香港联合 交易所	中国 香港	4,000	31,073.35	0.22
137	UNITED ENERGY GROUP LTD	联合能源集 团	467 HK	香港联合 交易所	中国 香港	24,000	30,905.02	0.22
138	POLY PROPERTY SERVICES CO LT	保利物业	6049 HK	香港联合 交易所	中国 香港	600	30,854.52	0.22
139	FU SHOU YUAN INTERNATION AL	福寿园	1448 HK	香港联合 交易所	中国 香港	5,000	30,635.70	0.22
140	VTECH HOLDINGS LTD	VTECHHOLDI NGS	303 HK	香港联合 交易所	中国 香港	600	30,374.79	0.22
141	NWS HOLDINGS LTD	新创建集团	659 HK	香港联合 交易所	中国 香港	5,000	30,256.96	0.22
142	JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	江苏宁沪高 速公路	177 HK	香港联合 交易所	中国 香港	4,000	29,188.08	0.21
143	HUAZHU GROUP LTD	华住集团	1179 HK	香港联合 交易所	中国 香港	100	29,120.74	0.21
144	KAISA GROUP HOLDINGS LTD	佳兆业集团	1638 HK	香港联合 交易所	中国 香港	9,000	29,011.33	0.21
145	EVER SUNSHINE LIFESTYLE SERV	永升生活服 务	1995 HK	香港联合 交易所	中国 香港	2,000	28,649.43	0.20
146	KERRY LOGISTICS NETWORK LTD	嘉里物流	636 HK	香港联合 交易所	中国 香港	2,000	28,615.76	0.20
147	HUANENG POWER INTL INC-H	华能国际电 力股份	902 HK	香港联合 交易所	中国 香港	12,000	28,582.09	0.20
148	CAFE DE	大家乐集团	341 HK	香港联合	中国	2,000	28,110.78	0.20

	CORAL HOLDINGS LTD			交易所	香港			
149	RAZER INC	雷蛇	1337 HK	香港联合交易所	中国香港	14,000	28,043.44	0.20
150	ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	正荣地产	6158 HK	香港联合交易所	中国香港	7,000	27,513.21	0.20
151	TIANLI EDUCATION INTERNATIONAL	天立教育	1773 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	27,471.13	0.20
152	CHINA COAL ENERGY CO-H	中煤能源	1898 HK	香港联合交易所	中国香港	14,000	27,454.30	0.20
153	ALPHAMAB ONCOLOGY	康宁杰瑞生物制药	9966 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	27,403.80	0.20
154	TIMES CHINA HOLDINGS LTD	时代地产	1233 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	27,218.64	0.19
155	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	27,218.64	0.19
156	HUABAO INTERNATIONAL HOLDING	华宝国际	336 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	26,966.15	0.19
157	LEE & MAN PAPER MANUFACTURING	理文造纸	2314 HK	香港联合交易所	中国香港	5,000	26,722.07	0.19
158	CHAMPION REIT	冠君产业信托	2778 HK	香港联合交易所	中国香港	7,000	26,688.40	0.19
159	GOME RETAIL HOLDINGS LTD	国美电器	493 HK	香港联合交易所	中国香港	34,000	26,612.66	0.19
160	XINYI ENERGY HOLDINGS LTD	信义能源	3868 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	26,562.16	0.19
161	CSC FINANCIAL CO LTD-H	中信建投证券	6066 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	26,006.68	0.19
162	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT	越秀房产信托基金	405 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	25,451.19	0.18
163	MELCO	新濠国际发	200 HK	香港联合	中国	2,000	25,383.86	0.18

	INTERNATIONAL DEVELOP.	展		交易所	香港			
164	CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	中国华融	2799 HK	香港联合交易所	中国香港	35,000	25,333.36	0.18
165	YEAHKA LTD	移卡	9923 HK	香港联合交易所	中国香港	800	25,316.53	0.18
166	CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	中教控股	839 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	25,148.20	0.18
167	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	中国铁建	1186 HK	香港联合交易所	中国香港	7,000	24,979.88	0.18
168	GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	国泰君安	2611 HK	香港联合交易所	中国香港	2,600	24,727.38	0.18
169	L' OCCITANE INTERNATIONAL SA	L' OCCITANE	973 HK	香港联合交易所	中国香港	1,500	24,390.73	0.17
170	JOHNSON ELECTRIC HOLDINGS	德昌电机控股	179 HK	香港联合交易所	中国香港	1,500	24,239.23	0.17
171	HEALTH AND HAPPINESS H&H INT	合生元	1112 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	24,155.07	0.17
172	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	国泰航空	293 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	24,138.24	0.17
173	PEIJIA MEDICAL LTD	沛嘉医疗	9996 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	23,734.25	0.17
174	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	中国南方航空股份	1055 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	23,330.26	0.17
175	CHINA GRAND PHARMACEUTICAL A	远大医药	512 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	23,161.93	0.16
176	CHINA COMMUNICATIONS SERVICES SERV-H	中国通信服务	552 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	23,027.27	0.16

177	MMG LTD	五矿资源	1208 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	22,690.61	0.16
178	AK MEDICAL HOLDINGS LTD	爱康医疗	1789 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	22,656.95	0.16
179	POWERLONG REAL ESTATE HOLDIN	宝龙地产	1238 HK	香港联合交易所	中国香港	5,000	22,513.87	0.16
180	GEMDALE PROPERTIES AND INVES	金地商置	535 HK	香港联合交易所	中国香港	24,000	22,421.29	0.16
181	SHENZHEN INVESTMENT LTD	深圳控股	604 HK	香港联合交易所	中国香港	10,000	22,387.62	0.16
182	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	22,320.29	0.16
183	SSY GROUP LTD	石四药集团	2005 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	22,219.30	0.16
184	Q TECHNOLOGY GROUP CO LTD	丘钛科技	1478 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	22,118.30	0.16
185	CHINA SOUTH CITY HOLDINGS	华南城	1668 HK	香港联合交易所	中国香港	22,000	21,293.49	0.15
186	CHONGQING RURAL COMMERCIAL-BANK	重庆农村商业银行	3618 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	21,276.66	0.15
187	NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	耐世特	1316 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	21,032.58	0.15
188	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	21,007.33	0.15
189	PACIFIC BASIN SHIPPING LTD	太平洋航运	2343 HK	香港联合交易所	中国香港	17,000	20,889.50	0.15
190	ZHOU HEI YA INTERNATIONAL HO	周黑鸭	1458 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	20,805.34	0.15
191	FIRST	第一太平	142 HK	香港联合交易所	中国	10,000	20,788.51	0.15

	PACIFIC CO			交易所	香港			
192	DONGYUE GROUP	东岳集团	189 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	20,704.34	0.15
193	IGG INC	IGG	799 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	20,502.35	0.15
194	CHINA WATER AFFAIRS GROUP	中国水务	855 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	20,401.35	0.15
195	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	20,031.03	0.14
196	LUYE PHARMA GROUP LTD	绿叶制药	2186 HK	香港联合交易所	中国香港	6,500	19,749.08	0.14
197	CHINA POWER INTERNATIONAL	中国电力	2380 HK	香港联合交易所	中国香港	14,000	19,559.71	0.14
198	SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	三一国际	631 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	19,526.05	0.14
199	GENERTEC UNIVERSAL MEDICAL G	环球医疗	2666 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	19,492.38	0.14
200	VIVA BIOTECH HOLDINGS	维亚生物	1873 HK	香港联合交易所	中国香港	2,500	19,231.47	0.14
201	GREENTOWN CHINA HOLDINGS	绿城中国	3900 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	19,088.40	0.14
202	CHINA AOYUAN GROUP LTD	中国奥园	3883 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	19,037.90	0.14
203	KANGJI MEDICAL HOLDINGS LTD	康基医疗	9997 HK	香港联合交易所	中国香港	1,500	18,962.15	0.14
204	CHINA SCE GROUP HOLDINGS LTD	中骏置业	1966 HK	香港联合交易所	中国香港	7,000	18,852.74	0.13
205	LEGEND HOLDINGS CORP-H	联想控股	3396 HK	香港联合交易所	中国香港	2,200	18,849.37	0.13
206	THE UNITED LABORATORIE	联邦制药	3933 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	18,516.08	0.13

	S INTE							
207	SHOUCHENG HOLDINGS LTD	首程控股	697 HK	香港联合交易所	中国香港	10,000	18,516.08	0.13
208	GREAT EAGLE HOLDINGS LTD	鹰君	41 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	17,926.93	0.13
209	HENGTEN NETWORKS GROUP LTD	恒腾网络	136 HK	香港联合交易所	中国香港	80,000	17,842.77	0.13
210	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	17,842.77	0.13
211	ZHONGYU GAS HOLDINGS LTD	中裕燃气	3633 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	17,825.94	0.13
212	VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	维达国际	3331 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	17,800.69	0.13
213	YUEXIU TRANSPORT INFRASTRUCT	越秀交通基建	1052 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	17,775.44	0.13
214	ARCHOSAUR GAMES INC	祖龙娱乐	9990 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	17,674.44	0.13
215	CHINA EVERBRIGHT LTD	中国光大控股	165 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	17,472.45	0.12
216	PACIFIC TEXTILES HOLDINGS	互太纺织	1382 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	17,135.79	0.12
217	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	中海物业	2669 HK	香港联合交易所	中国香港	5,000	17,001.13	0.12
218	CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	中国东方航空股份	670 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	16,916.96	0.12
219	CHINA RESOURCES MEDICAL HOLD	华润凤凰医疗	1515 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	16,815.97	0.12
220	SINOPEC SHANGHAI	上海石油化工股份	338 HK	香港联合交易所	中国香港	12,000	16,664.47	0.12

	PETROCHEM-H							
221	SINOTRANS LIMITED-H	中国外运	598 HK	香港联合交易所	中国香港	7,000	16,613.97	0.12
222	YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD	禹洲地产	1628 HK	香港联合交易所	中国香港	7,000	16,496.14	0.12
223	MAOYAN ENTERTAINMENT	猫眼娱乐	1896 HK	香港联合交易所	中国香港	1,600	16,482.68	0.12
224	ASCENTAGE PHARMA GROUP INTER	亚盛医药	6855 HK	香港联合交易所	中国香港	500	16,201.57	0.12
225	DIGITAL CHINA HOLDINGS LTD	神州控股	861 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	16,058.49	0.11
226	LUK FOOK HOLDINGS INTL LTD	六福集团	590 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	15,738.67	0.11
227	K WAH INTL HOLDINGS	嘉华国际	173 HK	香港联合交易所	中国香港	5,000	15,696.59	0.11
228	SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	远洋集团	3377 HK	香港联合交易所	中国香港	12,000	15,654.50	0.11
229	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	15,486.18	0.11
230	ANGANG STEEL CO LTD-H	鞍钢股份	347 HK	香港联合交易所	中国香港	5,800	15,425.58	0.11
231	SWIRE PACIFIC LTD-CL B	太古股份公司B	87 HK	香港联合交易所	中国香港	2,500	15,254.73	0.11
232	STELLA INTERNATIONAL	九兴控股	1836 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	15,166.35	0.11
233	DAH SING FINANCIAL HOLDINGS	大新金融	440 HK	香港联合交易所	中国香港	800	14,711.87	0.10
234	TCL ELECTRONICS HOLDINGS LTD	T C L 多媒体	1070 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	14,669.79	0.10

235	XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	特步国际	1368 HK	香港联合交易所	中国香港	4,500	14,657.16	0.10
236	FUFENG GROUP LTD	阜丰集团	546 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	14,644.54	0.10
237	SOHO CHINA LTD	S O H O 中国	410 HK	香港联合交易所	中国香港	7,500	14,581.41	0.10
238	HOPE EDUCATION GROUP CO LTD	希望教育	1765 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	14,543.54	0.10
239	BAIC MOTOR CORP LTD-H	北京汽车	1958 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	14,493.04	0.10
240	E-HOUSE CHINA ENTERPRISE HOL	易居企业控股	2048 HK	香港联合交易所	中国香港	2,400	14,361.74	0.10
241	LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-H	丽珠医药	1513 HK	香港联合交易所	中国香港	566	14,314.87	0.10
242	LONKING HOLDINGS LTD	中国龙工	3339 HK	香港联合交易所	中国香港	7,000	14,139.55	0.10
243	SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	中石化炼化工程	2386 HK	香港联合交易所	中国香港	5,000	14,055.39	0.10
244	CMGE TECHNOLOGY GROUP LTD	中手游	302 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	13,937.56	0.10
245	VALUE PARTNERS GROUP LTD	惠理集团	806 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	13,769.23	0.10
246	FIT HON TENG LTD	FITHONTENG	6088 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	13,584.07	0.10
247	COFCO JOYCOME FOODS LTD	中粮肉食	1610 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	13,584.07	0.10
248	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	13,373.66	0.10
249	BEIGENE LTD	百济神州	6160 HK	香港联合交易所	中国香港	100	13,213.75	0.09
250	CHINA RAILWAY SIGNAL &	中国通号	3969 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	13,129.58	0.09

	COM-H							
251	ZHONGLIANG HOLDINGS GROUP CO	中梁控股	2772 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	13,079.09	0.09
252	DFZQ-H	东方证券	3958 HK	香港联合交易所	中国香港	2,800	12,866.99	0.09
253	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	12,792.93	0.09
254	HAITONG INTERNATIONAL SECURI	海通国际	665 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	12,590.93	0.09
255	CHINA TIAN LUN GAS HOLDINGS	天伦燃气	1600 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	12,574.10	0.09
256	CHINA TOBACCO INTERNATIONAL	中烟香港	6055 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	12,506.77	0.09
257	POU SHENG INTL HOLDINGS LTD	宝胜国际	3813 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	12,388.94	0.09
258	CITIC TELECOM INTERNATIONAL	中信国际电讯	1883 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	12,321.61	0.09
259	SHENZHEN EXPRESSWAY CO-H	深圳高速公路股份	548 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	12,287.94	0.09
260	SHOUGANG FUSHAN RESOURCES GR	首钢资源	639 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	12,254.28	0.09
261	TIMES NEIGHBORHOOD HOLDINGS	时代邻里	9928 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	12,220.61	0.09
262	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	12,170.11	0.09
263	FAR EAST CONSORTIUM INTERNAT	远东发展	35 HK	香港联合交易所	中国香港	5,000	12,119.62	0.09
264	SHENWAN	申万宏源	6806 HK	香港联合	中国	6,400	11,958.02	0.09

	HONGYUAN GROUP CO -H			交易所	香港			
265	SUNEVISION HOLDINGS	新意网集团	1686 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	11,867.12	0.08
266	TOWNGAS CHINA CO LTD	港华燃气	1083 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	11,782.96	0.08
267	MIDEA REAL ESTATE HOLDING LT	美的置业	3990 HK	香港联合交易所	中国香港	800	11,661.76	0.08
268	TIANGONG INTL CO LTD	天工国际	826 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	11,648.30	0.08
269	PAX GLOBAL TECHNOLOGY LTD	百富环球	327 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	11,580.97	0.08
270	METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	中国中冶	1618 HK	香港联合交易所	中国香港	10,000	11,530.47	0.08
271	GREATVIEW ASEPTIC PACKAGING	纷美包装	468 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	11,437.89	0.08
272	COMBA TELECOM SYSTEMS HOLDIN	京信通信	2342 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	11,412.64	0.08
273	ASIAINFO TECHNOLOGIES LTD	亚信科技	1675 HK	香港联合交易所	中国香港	1,200	11,251.04	0.08
274	CENTRAL CHINA NEW LIFE LTD	建业新生活	9983 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	11,109.65	0.08
275	SKYWORTH GROUP LTD	创维数码	751 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	10,907.65	0.08
276	MAANSHAN IRON & STEEL-H	马鞍山钢铁股份	323 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	10,806.66	0.08
277	DAH SING BANKING GROUP LTD	大新银行集团	2356 HK	香港联合交易所	中国香港	1,600	10,719.13	0.08
278	VSTEC HOLDINGS LTD	伟仕控股	856 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	10,705.66	0.08
279	CHINA INTERNATIONAL MARINE-H	中集集团	2039 HK	香港联合交易所	中国香港	1,100	10,461.59	0.07

280	SHUI ON LAND LTD	瑞安房地产	272 HK	香港联合交易所	中国香港	11,500	10,453.17	0.07
281	POWERLONG COMMERCIAL MANAGEM	宝龙商业	9909 HK	香港联合交易所	中国香港	500	10,436.34	0.07
282	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	10,352.17	0.07
283	SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	四环医药	460 HK	香港联合交易所	中国香港	15,000	10,352.17	0.07
284	JIAYUAN INTERNATIONAL GROUP	佳源国际控股	2768 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	10,335.34	0.07
285	CHINA MAPLE LEAF EDUCATIONAL	枫叶教育	1317 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	10,301.67	0.07
286	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	中远海能	1138 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	10,268.01	0.07
287	BBMG CORP-H	金隅股份	2009 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	10,099.68	0.07
288	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	10,099.68	0.07
289	HUADIAN POWER INTL CORP-H	华电国际电力股份	1071 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	9,847.19	0.07
290	REDCO PROPERTIES GROUP LTD	力高地产	1622 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	9,763.02	0.07
291	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	9,662.03	0.07
292	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	阳光房地产基金	435 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	9,518.95	0.07
293	CAR INC	神州租车	699 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	9,443.20	0.07
294	CHINA MODERN	现代牧业	1117 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	9,392.70	0.07

	DAIRY HOLDINGS							
295	CHINA HARMONY AUTO HOLDING L	和谐汽车	3836 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	9,316.95	0.07
296	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	9,291.71	0.07
297	YIXIN GROUP LTD	易鑫集团	2858 HK	香港联合交易所	中国香港	3,500	9,131.79	0.07
298	RONSHINE CHINA HOLDINGS LTD	融信中国	3301 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	9,123.38	0.06
299	CENTRAL CHINA REAL ESTATE	建业地产	832 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	9,089.71	0.06
300	SINOPEC KANTONS HOLDINGS	中石化冠德	934 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	9,089.71	0.06
301	CHINA KEPEI EDUCATION GROUP	中国科培	1890 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	9,089.71	0.06
302	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	8,925.59	0.06
303	CHINA LILANG LTD	中国利郎	1234 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	8,904.55	0.06
304	FIH MOBILE LTD	富智康集团	2038 HK	香港联合交易所	中国香港	11,000	8,795.14	0.06
305	GUOTAI JUNAN INTERNATIONAL	国泰君安国际	1788 HK	香港联合交易所	中国香港	10,000	8,753.06	0.06
306	CITYCHAMP WATCH & JEWELLERY	冠城钟表珠宝	256 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	8,635.23	0.06
307	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	8,635.23	0.06
308	DATANG INTL POWER GEN CO-H	大唐发电	991 HK	香港联合交易所	中国香港	10,000	8,416.40	0.06
309	ROAD KING	路劲	1098 HK	香港联合交易所	中国	1,000	8,332.24	0.06

	INFRASTRUCTURE LTD			交易所	香港			
310	IDREAMSKY TECHNOLOGY HOLDING	创梦天地	1119 HK	香港联合交易所	中国香港	2,400	8,281.74	0.06
311	CHINA DONGXIANG GROUP CO	中国动向	3818 HK	香港联合交易所	中国香港	12,000	8,180.74	0.06
312	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	8,163.91	0.06
313	BANK OF CHONGQING CO LTD-H	重庆银行	1963 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	8,163.91	0.06
314	PROSPERITY REIT	泓富产业信托	808 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	8,147.08	0.06
315	SHUN TAK HOLDINGS LTD	信德集团	242 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	7,978.75	0.06
316	CMBC CAPITAL HOLDINGS LTD	天顺证券	1141 HK	香港联合交易所	中国香港	70,000	7,894.58	0.06
317	LVGEM CHINA REAL ESTATE INVE	绿景中国地产	95 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	7,844.08	0.06
318	CIMC ENRIC HOLDINGS LTD	中集安瑞科	3899 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	7,810.42	0.06
319	LIFESTYLE INTL HLDGS LTD	利福国际	1212 HK	香港联合交易所	中国香港	1,500	7,764.13	0.06
320	WEST CHINA CEMENT LTD	西部水泥	2233 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	7,743.09	0.06
321	COSMOPOLITAN INTL HLDGS	COSMOPOL INT'L	120 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	7,726.26	0.06
322	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	7,642.09	0.05
323	SHENG YE CAPITAL LTD	盛业资本	6069 HK	香港联合交易所	中国香港	1,500	7,637.88	0.05
324	REALORD	伟禄集团	1196 HK	香港联合	中国	2,000	7,524.26	0.05

	GROUP HOLDINGS LTD			交易所	香港			
325	DEXIN CHINA HOLDINGS CO LTD	德信中国	2019 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	7,473.76	0.05
326	YICHANG HEC CHANGJIANG PHA-H	东阳光药	1558 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	7,431.68	0.05
327	CHOW SANG SANG HLDG	周生生	116 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	7,406.43	0.05
328	NETDRAGON WEBSOFT HOLDINGS L	网龙	777 HK	香港联合交易所	中国香港	500	7,313.85	0.05
329	MEITU INC	美图公司	1357 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	7,271.77	0.05
330	ZHUGUANG HOLDINGS GROUP CO	珠光控股	1176 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	7,271.77	0.05
331	FRONTAGE HOLDINGS CORP	方达控股	1521 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	7,170.77	0.05
332	CHINA TRAVEL INTL INV HK	香港中旅	308 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	7,137.11	0.05
333	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	6,935.11	0.05
334	CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	中国忠旺	1333 HK	香港联合交易所	中国香港	5,600	6,881.25	0.05
335	HUIJING HOLDINGS CO LTD	汇景控股	9968 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	6,867.78	0.05
336	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	6,859.37	0.05
337	REDSUN PROPERTIES GROUP LTD	弘阳地产	1996 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	6,817.28	0.05
338	CHINA RENAISSANCE HOLDINGS L	华兴资本控股	1911 HK	香港联合交易所	中国香港	500	6,674.21	0.05

339	GLORY SUN FINANCIAL GROUP LT	中国金洋	1282 HK	香港联合 交易所	中国 香港	24,000	6,665.79	0.05
340	SKYFAME REALTY HOLDINGS LTD	天誉置业	59 HK	香港联合 交易所	中国 香港	8,000	6,665.79	0.05
341	WISDOM EDUCATION INTERNATION	睿见教育	6068 HK	香港联合 交易所	中国 香港	2,000	6,362.80	0.05
342	RED STAR MACALLINE GROUP C-H	红星美凯龙	1528 HK	香港联合 交易所	中国 香港	1,560	6,184.03	0.04
343	GREENLAND HONG KONG HOLDINGS	绿地香港	337 HK	香港联合 交易所	中国 香港	3,000	5,883.06	0.04
344	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	5,857.81	0.04
345	COLOUR LIFE SERVICES GROUP	彩生活	1778 HK	香港联合 交易所	中国 香港	2,000	5,857.81	0.04
346	SUNCITY GROUP HOLDINGS LTD	太阳世纪集 团	1383 HK	香港联合 交易所	中国 香港	10,000	5,807.32	0.04
347	CHINA MERCHANTS LAND LTD	招商局置地	978 HK	香港联合 交易所	中国 香港	6,000	5,756.82	0.04
348	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	5,638.99	0.04
349	TEXHONG TEXTILE GROUP LTD	天虹纺织	2678 HK	香港联合 交易所	中国 香港	1,000	5,596.91	0.04
350	CANVEST ENVIRONMENT AL PROTEC	粤丰环保	1381 HK	香港联合 交易所	中国 香港	2,000	5,588.49	0.04
351	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	5,504.33	0.04
352	NISSIN FOODS CO LTD	日清食品	1475 HK	香港联合 交易所	中国 香港	1,000	5,369.66	0.04
353	SINOFERT	中化化肥	297 HK	香港联合	中国	8,000	5,117.17	0.04

	HOLDINGS LTD			交易所	香港			
354	FANTASIA HOLDINGS GROUP CO	花样年控股	1777 HK	香港联合交易所	中国香港	4,500	5,112.96	0.04
355	TONGDA GROUP HOLDINGS LTD	通达集团	698 HK	香港联合交易所	中国香港	10,000	4,797.35	0.03
356	VPOWER GROUP INTERNATIONAL H	伟能集团	1608 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	4,511.19	0.03
357	CHINA SHINEWAY PHARMACEUTICAL	神威药业	2877 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	4,469.11	0.03
358	IMAX CHINA HOLDING INC	IMAXCHINA	1970 HK	香港联合交易所	中国香港	400	4,416.93	0.03
359	YANGTZE OPTICAL FIBRE AND-H	长飞光纤	6869 HK	香港联合交易所	中国香港	500	4,359.70	0.03
360	SHANGHAI INDUSTRIAL URBAN DE	上实城市开发	563 HK	香港联合交易所	中国香港	6,200	4,278.90	0.03
361	CHINA FOODS LTD	中国食品	506 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	4,275.53	0.03
362	MULSANNE GROUP HOLDING LTD	慕尚集团控股	1817 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	4,157.70	0.03
363	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	4,107.20	0.03
364	SA SA INTERNATIONAL HLDGS	莎莎国际	178 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	4,073.54	0.03
365	MOBIVISTA INC	汇量科技	1860 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	4,056.70	0.03
366	MINSHENG EDUCATION GROUP CO	民生教育	1569 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	3,804.21	0.03
367	JNBY DESIGN LTD	江南布衣	3306 HK	香港联合交易所	中国香港	500	3,787.38	0.03

368	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	3,669.55	0.03
369	SMARTONE TELECOMMUNICATIONS	数码通电讯	315 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	3,484.39	0.02
370	BEIJING ENERGY INTERNATIONAL	北京能源国际	686 HK	香港联合交易所	中国香港	12,000	3,130.90	0.02
371	CHINA ZHENG TONG AUTO SERVICE	正通汽车	1728 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	2,895.24	0.02
372	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	2,668.00	0.02
373	GUORUI PROPERTIES LTD	国瑞置业	2329 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	2,592.25	0.02
374	GRAND BAOXIN AUTO GROUP LTD	宝信汽车	1293 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	2,095.68	0.01
375	KASEN INTERNATIONAL HOLDINGS	卡森国际	496 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	1,843.19	0.01
376	CHINA FIRST CAPITAL GROUP LT	首控集团	1269 HK	香港联合交易所	中国香港	12,000	1,181.66	0.01

#### 8.4.2 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	29,625.73	0.21
2	KWG LIVING GROUP HOLDINGS LT	合景悠活股份	3913 HK	香港联合交易所	中国香港	2,500	13,255.83	0.09

3	CT ENVIRONMENTAL GROUP LTD	中滔环保	1363 HK	香港联合交易所	中国香港	16,000	4,578.52	0.03
4	TENWOW INTERNATIONAL HOLDING	天喔国际 (退市)	1219 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	2,558.59	0.02
5	CONVOY GLOBAL HOLDINGS LTD	康宏环球	1019 HK	香港联合交易所	中国香港	270,000	2,272.43	0.02
6	CAMSING INTERNATIONAL HOLDING	CAMSING INTERNATIONAL HOLDING	2662 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	1,952.60	0.01
7	CHINA HUISHAN DAIRY HOLDINGS COMPANY LTD	辉山乳业 (退市)	6863 HK	香港联合交易所	中国香港	212,000	1,784.28	0.01
8	SOUTHERN ENERGY HOLDINGS GROUP	南方能源	1573 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	1,144.63	0.01
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	1,000.79	0.01
10	AGRITRADE RESOURCES LTD	鸿宝资源	1131 HK	香港联合交易所	中国香港	10,000	698.56	0.00
11	SMI HOLDINGS GROUP LTD	星美控股 (退市)	198 HK	香港联合交易所	中国香港	8,800	7.41	0.00
12	CHINA HUIYUAN JUICE GROUP	汇源果汁 (退市)	1886 HK	香港联合交易所	中国香港	10,000	0.84	0.00

## 8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 8.5.1 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	INNOVENT BIOLOGICS INC	1801 HK	323,109.51	2.12
2	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	586 HK	262,919.85	1.72
3	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	914 HK	262,246.94	1.72
4	LI NING CO LTD	2331 HK	227,055.66	1.49
5	CHINA VANKE CO LTD-H	2202 HK	201,005.94	1.32

6	CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	817 HK	167,389.16	1.10
7	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	522 HK	104,023.62	0.68
8	YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	1579 HK	97,939.22	0.64
9	A-LIVING SMART CITY SERVICES	3319 HK	79,751.61	0.52
10	MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	909 HK	79,198.32	0.52
11	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	1114 HK	78,008.67	0.51
12	CHINA LITERATURE LTD	772 HK	76,703.12	0.50
13	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	968 HK	65,169.52	0.43
14	TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	6110 HK	62,445.58	0.41
15	CANSINO BIOLOGICS INC-H	6185 HK	58,510.81	0.38
16	CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT	257 HK	55,010.41	0.36
17	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	2333 HK	53,173.01	0.35
18	JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	9922 HK	51,097.87	0.34
19	KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	268 HK	49,431.98	0.32
20	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	371 HK	48,568.76	0.32

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。

#### 8.5.2 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	576,165.99	3.78
2	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	586 HK	341,865.00	2.24
3	LI NING CO LTD	2331 HK	325,704.27	2.14

4	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	981 HK	293,545.53	1.93
5	CHINA VANKE CO LTD-H	2202 HK	262,976.37	1.73
6	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	6098 HK	252,446.93	1.66
7	CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	817 HK	194,891.76	1.28
8	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	522 HK	174,362.83	1.14
9	PING AN HEALTHCARE AND TECHN	1833 HK	161,474.13	1.06
10	BYD CO LTD-H	1211 HK	130,450.07	0.86
11	YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	1579 HK	118,827.85	0.78
12	ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	881 HK	107,035.95	0.70
13	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	3323 HK	85,132.46	0.56
14	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	968 HK	75,142.33	0.49
15	KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	268 HK	73,774.02	0.48
16	CHINA RESOURCES CEMENT	1313 HK	69,247.65	0.45
17	HUANENG RENEWABLES CORP-H	958 HK	68,352.37	0.45
18	KINGSOFT CORP LTD	3888 HK	60,901.49	0.40
19	SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	1066 HK	58,588.16	0.38
20	LOGAN GROUP CO LTD	3380 HK	56,635.39	0.37

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。

### 8.5.3 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	5,694,636.74
卖出收入（成交）总额	8,443,942.22

注：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

### 8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

无。

**8.7 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。

**8.8 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。

**8.9 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。

**8.10 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。

**8.11 投资组合报告附注****8.11.1 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**

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。

**8.11.2 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。

**8.11.3 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	274,706.89
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	10,841.36
4	应收利息	314.72
5	应收申购款	6,046.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	291,909.72

**8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

无。

## 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

## 8.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

## 8.11.5.2 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	29,625.73	0.21	重大事项停牌
2	1363 HK	中滔环保	4,578.52	0.03	重大事项停牌
3	1219 HK	天喔国际	2,558.59	0.02	已退市
4	1019 HK	康宏环球	2,272.43	0.02	重大事项停牌

## 8.11.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

## 9.1 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	1,489	8,355.64	123,788.25	0.99	12,317,753.18	99.01
恒生中小C	121	603.56	-	-	73,030.71	100.00
合计	1,610	7,773.03	123,788.25	0.99	12,390,783.89	99.01

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。

## 9.2 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	舒仁村	903,518.00	22.04
2	钱中明	850,673.00	20.75
3	顾玲	203,487.00	4.96
4	张啸然	154,665.00	3.77
5	庚秀凤	85,000.00	2.07
6	赵何鉴	75,000.00	1.83
7	范东启	62,996.00	1.54
8	黄钧铨	58,880.00	1.44
9	胡优成	50,100.00	1.22
10	李小晶	50,002.00	1.22

注：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。

## 9.3 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	恒生中小 A	12,083.96	0.0971
	恒生中小 C	0.00	0.0000
	合计	12,083.96	0.0966

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）。

## 9.4 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	0
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	0

## 9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品的情况

无。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	恒生中小 A	恒生中小 C
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	11,607,073.14	233,103.56
减：本报告期基金总 赎回份额	13,783,432.91	160,072.85
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	12,441,541.43	73,030.71

## § 11 重大事件揭示

## 11.1 基金份额持有人大会决议

无。

## 11.2 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

1. 2020 年 12 月 28 日, 经大成基金管理有限公司 2020 年第一次临时股东会审议通过, 选举林昌先生担任公司股东董事, 翟斌先生不再担任公司股东董事。

2. 2020 年 12 月 28 日, 经大成基金管理有限公司第七届董事会第八次会议审议通过, 选举林昌先生担任公司第七届董事会副董事长, 同时, 选举其担任第七届董事会合规与风险管理委员会委员, 第七届董事会审计委员会委员。翟斌先生不再担任公司第七届董事会副董事长、第七届董事会合规与风险管理委员会委员、第七届董事会审计委员会委员。

上述变更详见公司相关公告。

## 二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

2020 年 8 月, 中国农业银行总行决定刘琳任托管业务部副总裁。

## 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

#### 11.4 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。

#### 11.5 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)，本年度支付的审计费用为 4 万元整。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。

#### 11.6 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。

#### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 11.7.1 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	13,069,485.76	100.00%	9,586.11	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	-	-	-	-	-
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	2	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
信达证券	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：信达证券。本报告期内本基金退租席位：长城证券。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

### 11.8 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	关于再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年12月31日
2	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）2021年境外主要市场节假日暂停申购赎回安排的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年12月30日
3	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年12月26日
4	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年12月24日
5	大成基金管理有限公司关于提示泰诚	中国证监会基金电子披	2020年12月17日

	财富基金销售（大连）有限公司代销客户及时办理转托管业务的公告	露网站、规定报刊及本公司网站	
6	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）第三季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年10月28日
7	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年10月23日
8	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年10月14日
9	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）暂停申购、赎回及定投业务的公告？	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年9月26日
10	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年9月22日
11	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年8月27日
12	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年8月27日
13	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）中期报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年8月28日
14	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年8月4日
15	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）第二季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年7月21日
16	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海基煜基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年7月9日
17	关于再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年7月1日
18	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年6月29日
19	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	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年6月22日

20	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 6 月 19 日
21	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	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 6 月 5 日
22	大成基金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	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 5 月 6 日
23	大成恒生综合中小型股指数 2019 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 4 月 29 日
24	大成基金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	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 4 月 25 日
25	大成恒生综合中小型股指数基金（QDII-LOF）暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 4 月 24 日
26	大成恒生综合中小型股指数 2020 年第一季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 4 月 21 日
27	大成恒生综合中小型股指数基金暂停（大额）申购（转换转入、赎回、转换转出、定期定额投资）公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 4 月 9 日
28	大成恒生综合中小型股指数基金（QDII-LOF）暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 4 月 1 日
29	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	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 3 月 25 日
30	大成基金管理有限公司关于注销南京分公司的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 3 月 21 日
31	大成基金管理有限公司关于注销青岛分公司的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 2 月 29 日
32	大成恒生综合中小型股指数增设 C 类基金份额并相应修订基金合同和托管协议的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 2 月 29 日
33	大成恒生综合中小型股指数托管协议更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 2 月 29 日
34	大成恒生综合中小型股指数基金合同更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本	2020 年 2 月 29 日

		公司网站	
35	大成恒生综合中小型股指数招募说明书摘要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 2 月 29 日
36	大成恒生综合中小型股指数招募说明书更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 2 月 29 日
37	大成基金关于 APP 交易平台汇款交易费率优惠的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 2 月 26 日
38	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	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 1 月 30 日
39	大成恒生综合中小型股指数 2019 年第四季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 1 月 17 日
40	大成恒生综合中小型股指数基金暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 1 月 17 日
41	大成恒生综合中小型股指数 2020 年境外主要市场节假日暂停申购赎回安排的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 1 月 4 日
42	大成恒生综合中小型股指数 2020 年境外主要市场节假日暂停申购赎回安排的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020-01-04

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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。

### 13.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

### 13.3 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

2021 年 3 月 30 日