

易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金 (LOF)

2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：二〇二一年八月二十八日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

| | | |
|-----|-------------------------------------|----|
| 1 | 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 | 重要提示 | 2 |
| 1.2 | 目录 | 3 |
| 2 | 基金简介 | 5 |
| 2.1 | 基金基本情况 | 5 |
| 2.2 | 基金产品说明 | 5 |
| 2.3 | 基金管理人和基金托管人 | 5 |
| 2.4 | 境外投资顾问和境外资产托管人 | 6 |
| 2.5 | 信息披露方式 | 6 |
| 2.6 | 其他相关资料 | 6 |
| 3 | 主要财务指标和基金净值表现 | 7 |
| 3.1 | 主要会计数据和财务指标 | 7 |
| 3.2 | 基金净值表现 | 7 |
| 4 | 管理人报告 | 9 |
| 4.1 | 基金管理人及基金经理情况 | 9 |
| 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 | 12 |
| 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 | 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 14 |
| 4.8 | 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 14 |
| 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 | 14 |
| 5 | 托管人报告 | 14 |
| 5.1 | 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 14 |
| 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 | 15 |
| 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 | 15 |
| 6 | 半年度财务会计报告（未经审计） | 15 |
| 6.1 | 资产负债表 | 15 |
| 6.2 | 利润表 | 16 |
| 6.3 | 所有者权益（基金净值）变动表 | 17 |
| 6.4 | 报表附注 | 18 |
| 7 | 投资组合报告 | 39 |
| 7.1 | 期末基金资产组合情况 | 39 |
| 7.2 | 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 | 40 |
| 7.3 | 期末按行业分类的权益投资组合 | 40 |
| 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 | 41 |
| 7.5 | 报告期内权益投资组合的重大变动 | 59 |
| 7.6 | 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 | 61 |
| 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 | 61 |
| 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 | 61 |
| 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 | 61 |

| | | |
|------|--------------------------------------|----|
| 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 | 61 |
| 7.11 | 投资组合报告附注 | 61 |
| 8 | 基金份额持有人信息 | 62 |
| 8.1 | 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 62 |
| 8.2 | 期末上市基金前十名持有人 | 63 |
| 8.3 | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 63 |
| 8.4 | 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 | 64 |
| 9 | 开放式基金份额变动 | 64 |
| 10 | 重大事件揭示 | 64 |
| 10.1 | 基金份额持有人大会决议 | 64 |
| 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 | 64 |
| 10.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 65 |
| 10.4 | 基金投资策略的改变 | 65 |
| 10.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 65 |
| 10.6 | 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 | 65 |
| 10.7 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 65 |
| 10.8 | 其他重大事件 | 70 |
| 11 | 备查文件目录 | 71 |
| 11.1 | 备查文件目录 | 71 |
| 11.2 | 存放地点 | 71 |
| 11.3 | 查阅方式 | 71 |

2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|---------------------------|---------------------------|
| 基金名称 | 易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF） | |
| 基金简称 | 易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF） | |
| 场内简称 | 港股小盘 LOF | |
| 基金主代码 | 161124 | |
| 基金运作方式 | 契约型、上市开放式（LOF） | |
| 基金合同生效日 | 2016 年 11 月 2 日 | |
| 基金管理人 | 易方达基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 31,741,368.18 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所 | |
| 上市日期 | 2016 年 11 月 10 日 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）A | 易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）C |
| 下属分级基金的场内简称 | 香港小盘 | - |
| 下属分级基金的交易代码 | 161124 | 006263 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 24,930,171.47 份 | 6,811,196.71 份 |

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

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。 |
| 投资策略 | 本基金主要采取完全复制法进行投资，即参考标的指数的成份股组成及权重构建股票投资组合，并根据标的指数的成份股组成及权重变动对股票投资组合进行相应调整，力争将年化跟踪误差控制在 4% 以内，日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在 0.35% 以内，主要投资策略包括资产配置策略、权益类品种投资策略、金融衍生品投资策略等。 |
| 业绩比较基准 | 恒生综合小型股指数收益率（使用估值汇率折算）×95%+活期存款利率（税后）×5% |
| 风险收益特征 | 本基金属股票指数基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金主要采用组合复制策略和适当的替代性策略实现对标的指数的紧密跟踪，具有与标的指数相似的风险收益特征。 本基金主要投资香港证券市场，需承担汇率风险以及境外市场的风险。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

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

| | | | |
|--------|------|----------------------------------|------------------------|
| 负责人 | 联系电话 | 020-85102688 | 0755-83199084 |
| | 电子邮箱 | service@efunds.com.cn | yan_zhang@cmbchina.com |
| 客户服务电话 | | 400 881 8088 | 95555 |
| 传真 | | 020-38798812 | 0755-83195201 |
| 注册地址 | | 广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-42891（集中办公区） | 深圳市深南大道7088号招商银行大厦 |
| 办公地址 | | 广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼 | 深圳市深南大道7088号招商银行大厦 |
| 邮政编码 | | 510620 | 518040 |
| 法定代表人 | | 刘晓艳 | 缪建民 |

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

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

2.5 信息披露方式

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

2.6 其他相关资料

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

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

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期（2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日） | |
|---------------|--------------------------------------|---------------------------|
| | 易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）A | 易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）C |
| 本期已实现收益 | 387,671.70 | 103,871.55 |
| 本期利润 | 2,530,017.31 | 187,174.58 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0960 | 0.0257 |
| 本期加权平均净值利润率 | 6.94% | 1.86% |
| 本期基金份额净值增长率 | 13.98% | 13.94% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2021 年 6 月 30 日) | |
| | 易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）A | 易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）C |
| 期末可供分配利润 | 9,357,903.23 | 1,435,392.81 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.3754 | 0.2107 |
| 期末基金资产净值 | 35,752,866.20 | 9,726,194.78 |
| 期末基金份额净值 | 1.4341 | 1.4280 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2021 年 6 月 30 日) | |
| | 易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）A | 易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）C |
| 基金份额累计净值增长率 | 43.41% | 24.92% |

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）A

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

| | | | | | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 过去一个月 | 2.64% | 0.86% | 1.75% | 0.87% | 0.89% | -0.01% |
| 过去三个月 | 6.54% | 0.94% | 5.50% | 0.98% | 1.04% | -0.04% |
| 过去六个月 | 13.98% | 1.67% | 14.47% | 1.71% | -0.49% | -0.04% |
| 过去一年 | 23.53% | 1.48% | 25.99% | 1.50% | -2.46% | -0.02% |
| 过去三年 | 23.13% | 1.37% | 12.52% | 1.36% | 10.61% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 43.41% | 1.24% | 26.59% | 1.24% | 16.82% | 0.00% |

易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）C

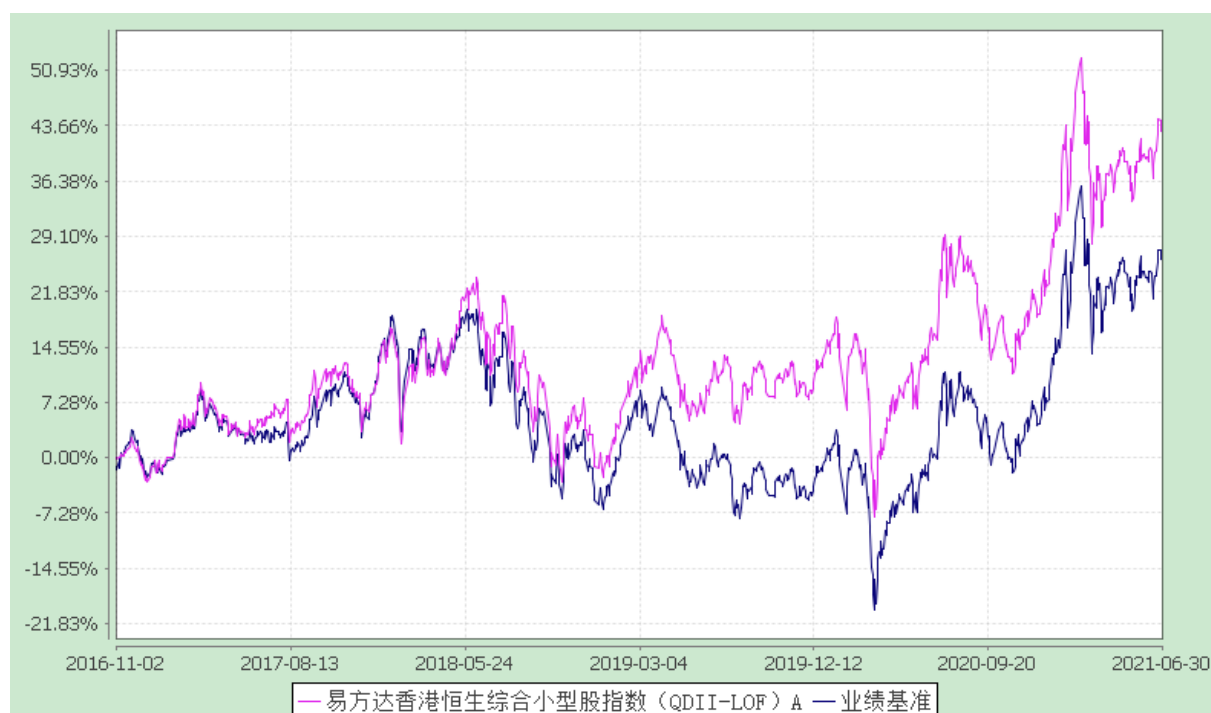
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月 | 2.63% | 0.86% | 1.75% | 0.87% | 0.88% | -0.01% |
| 过去三个月 | 6.49% | 0.94% | 5.50% | 0.98% | 0.99% | -0.04% |
| 过去六个月 | 13.94% | 1.67% | 14.47% | 1.71% | -0.53% | -0.04% |
| 过去一年 | 23.35% | 1.48% | 25.99% | 1.50% | -2.64% | -0.02% |
| 过去三年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | 24.92% | 1.36% | 15.45% | 1.36% | 9.47% | 0.00% |

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

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

易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）A

（2016 年 11 月 2 日至 2021 年 6 月 30 日）



易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）C

（2018 年 8 月 14 日至 2021 年 6 月 30 日）



注：1.本基金的业绩比较基准已经转换为以人民币计价。

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

3.自基金合同生效至报告期末,A 类基金份额净值增长率为 43.41%,同期业绩比较基准收益率为 26.59%。C 类基金份额净值增长率为 24.92%,同期业绩比较基准收益率为 15.45%。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2001]4 号文批准,本基金管理人成立于 2001 年 4 月 17 日,注册资本 13,244.2 万元人民币。本基金管理人拥有公募、社保、年金、特定客户资产管理、QDII、基本养老保险基金投资等业务资格,在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、多资产投资、海外投资、FOF 投资等领域全面布局,为境内外客户提供资产管理解决方案。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助 | 证券从业 | 说明 |
|----|----|-------------|------|----|
|----|----|-------------|------|----|

| | | 理) 期限 | | 年限 | |
|-----|--|------------|------|------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 刘树荣 | 本基金的基金经理、易方达中证银行交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证银行指数证券投资基金（LOF）的基金经理、易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理、易方达中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理、易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的基 | 2018-08-11 | - | 14 年 | 硕士研究生，具有基金从业资格。曾任招商银行资产托管部基金会计，易方达基金管理有限公司核算部基金核算专员、指数与量化投资部运作支持专员、基金经理助理、易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金基金经理、易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、易方达标普医疗保健指数证券投资基金（LOF）基金经理、易方达标普生物科技指数证券投资基金（LOF）基金经理、易方达标普信息科技指数证券投资基金（LOF）基金经理、易方达银行指数分级证券投资基金基金经理、易方达生物科技指数分级证券投资基金基金经理。 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | <p>金经理、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）的基金经理（自 2018 年 08 月 11 日至 2021 年 04 月 14 日）、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中小企业 100 指数证券投资基金（LOF）的基金经理、易方达中证万得并购重组指数证券投资基金</p> | | | | |
|--|--|--|--|--|--|

| | | | | | |
|--|----------------|--|--|--|--|
| | (LOF)的基金 经理 | | | | |
|--|----------------|--|--|--|--|

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

2.证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3.为加强基金流动性管理，本基金安排了相关人员协助基金经理进行现金头寸与流动性管理。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金未聘请境外投资顾问。

4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

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

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共 15 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为恒生综合小型股指数，恒生综合小型股指数涵盖恒生综合指数成份股总市值的后 5%，成份股市值偏小，成份股基本面情况与股价走势同时受国内外经济形势影响。2021 年上半年，国内股票市场分化显著。春节前，以大盘蓝筹为代表的机构重仓股涨幅较大，而以中证 1000 为代表的小市值股票却持续走低。春节后，大宗商品价格显著走强，通胀预期带来的名义利率上行对全球股票估值都构成了显著压力，市场风险偏好显著下降，国内股票市场出现大幅回调，前期剧烈的市场分化有所收敛。股票市场的整体下跌趋势直到一季度末才有所缓解，步入震荡区间。二季度，市场风险偏好有所修复，指数震荡上行，但结构分化依然明显。季初流动性宽松推动前期调整幅度较大的机构重仓股走出了一轮估值修复行情。5 月初开始，市场关注点逐步从流动性切换到企业盈利，市场风格从周期向成长切换。港股市场同样波动较大，春节前，投资者对港股关注度较高，资金大幅流入，恒生综合小型股指数大幅上涨；春节后，受通胀预期、港股上调印花税、A 股大幅调整等因素影响，恒生综合小型股指数震荡下跌。

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

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 1.4341 元，本报告期份额净值增长率为 13.98%，同期业绩比较基准收益率为 14.47%；C 类基金份额净值为 1.4280 元，本报告期份额净值增长率为 13.94%，同期业绩比较基准收益率为 14.47%，年化跟踪误差 1.68%，各项指标均在合同规定的目标控制范围之内。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场对国内经济高位回落的预期已有较长时间，但二季度 GDP 环比增速和复合增速均较一季度明显提升，6 月多数经济指标也偏强，指向当前经济总体仍偏强、总体不差。展望下半年经济增长虽然会放缓，但更多是回到疫情前正常的水平，实质性下行的迹象尚不明显，宏观经济仍将保持平稳运行。近年来，证券市场分化已成为一种常态，但市场上没有不变的热点，不变的只有风格切换和行业轮动。港股市场在经历了年初资金大幅流入后，开始回归理性。作为被动投资的基金，本基金将坚持既定的指数化投资策略，以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为投资目标，致力于为投资者提供分享经济增长的优质指数产品。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

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

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

自本报告期初至 2021 年 2 月 10 日，2021 年 6 月 3 日至本报告期末，本基金均存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

自本报告期初至 2021 年 2 月 10 日，本基金均存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。基金资产净值的下滑主要受市场环境的影响，基金管理人已按照法律法规及《基金合同》的有关规定向中国证监会报送《关于易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）终止基金合同并召开基金份额持有人大会的请示》，拟召开基金份额持有人大会审议终止本基金《基金合同》等事项。请投资者关注相关风险。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

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

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资产： | | - | - |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 3,555,216.96 | 1,471,669.68 |
| 结算备付金 | | - | - |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 42,492,633.78 | 20,930,949.92 |
| 其中：股票投资 | | 42,492,633.78 | 20,930,949.92 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | 388,350.81 | 295,393.69 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 108.20 | 55.08 |
| 应收股利 | | 391,368.81 | 9,056.55 |
| 应收申购款 | | 317,108.45 | 17,496.77 |
| 递延所得税资产 | | - | - |

| | | | |
|-------------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 47,144,787.01 | 22,724,621.69 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | - | - |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 1,429,995.05 | 388,737.26 |
| 应付管理人报酬 | | 30,360.13 | 14,846.79 |
| 应付托管费 | | 9,487.51 | 4,639.61 |
| 应付销售服务费 | | 1,657.73 | 438.40 |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | - | - |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 194,225.61 | 122,124.56 |
| 负债合计 | | 1,665,726.03 | 530,786.62 |
| 所有者权益： | | - | - |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 31,741,368.18 | 17,646,337.32 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 13,737,692.80 | 4,547,497.75 |
| 所有者权益合计 | | 45,479,060.98 | 22,193,835.07 |
| 负债和所有者权益总计 | | 47,144,787.01 | 22,724,621.69 |

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.4341 元，C 类基金份额净值 1.4280 元；基金份额总额 31,741,368.18 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 24,930,171.47 份，C 类基金份额总额 6,811,196.71 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|-------------|----------|--|---|
| 一、收入 | | 3,194,098.76 | 440,235.29 |
| 1.利息收入 | | 4,218.21 | 2,775.92 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 4,218.21 | 2,775.92 |
| 债券利息收入 | | - | - |

| | | | |
|----------------------------|----------|---------------------|-------------------|
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 1,047,248.67 | -1,490,525.46 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 338,878.63 | -1,959,731.09 |
| 基金投资收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.16 | 708,370.04 | 469,205.63 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 2,225,648.64 | 1,882,329.76 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | -127,590.58 | 34,794.04 |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18 | 44,573.82 | 10,861.03 |
| 减：二、费用 | | 476,906.87 | 300,810.41 |
| 1. 管理人报酬 | | 184,764.68 | 106,776.62 |
| 2. 托管费 | | 57,739.03 | 33,367.70 |
| 3. 销售服务费 | | 9,935.52 | 2,838.99 |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 128,951.68 | 36,005.85 |
| 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 | 6.4.7.20 | 95,515.96 | 121,821.25 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 2,717,191.89 | 139,424.88 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 2,717,191.89 | 139,424.88 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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） | 17,646,337.32 | 4,547,497.75 | 22,193,835.07 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 2,717,191.89 | 2,717,191.89 |
| 三、本期基金份额交易产生 | 14,095,030.86 | 6,473,003.16 | 20,568,034.02 |

| | | | |
|--|---------------------------------|----------------|----------------|
| 的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | | | |
| 其中：1.基金申购款 | 45,162,529.81 | 18,325,511.48 | 63,488,041.29 |
| 2.基金赎回款 | -31,067,498.95 | -11,852,508.32 | -42,920,007.27 |
| 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） | 31,741,368.18 | 13,737,692.80 | 45,479,060.98 |
| 项目 | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 28,771,235.52 | 3,962,668.74 | 32,733,904.26 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 139,424.88 | 139,424.88 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | -8,556,735.89 | -855,923.45 | -9,412,659.34 |
| 其中：1.基金申购款 | 8,302,222.67 | 941,061.78 | 9,243,284.45 |
| 2.基金赎回款 | -16,858,958.56 | -1,796,985.23 | -18,655,943.79 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | - | - |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 20,214,499.63 | 3,246,170.17 | 23,460,669.80 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：邱毅华

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]2434号《关于准予易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金(LOF)注册的批复》和证券基金机构监管部函[2016]2193号《关于易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金(LOF)延期募集备案的回函》进行募集，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金(LOF)基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金(LOF)基金合同》

于 2016 年 11 月 2 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 399,318,394.11 份基金份额，其中认购资金利息折合 86,452.09 份基金份额。本基金为契约型、上市开放式型基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司，境外资产托管人为香港上海汇丰银行有限公司。自 2018 年 8 月 13 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2018 年 8 月 14 日。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2

号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关境内外财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 |
|------|------------------------|
| 活期存款 | 3,555,216.96 |

| | |
|----------------|--------------|
| 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 | 3,555,216.96 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | | |
|---------------|------------------------|---------------|--------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 38,975,091.48 | 42,492,633.78 | 3,517,542.30 |
| 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 | 38,975,091.48 | 42,492,633.78 | 3,517,542.30 |

注：“股票”包括普通股、存托凭证和优先股等。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 |
|----|-----|
|----|-----|

| | 2021 年 6 月 30 日 |
|------------|-----------------|
| 应收活期存款利息 | 108.20 |
| 应收定期存款利息 | - |
| 应收其他存款利息 | - |
| 应收结算备付金利息 | - |
| 应收债券利息 | - |
| 应收资产支持证券利息 | - |
| 应收买入返售证券利息 | - |
| 应收申购款利息 | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 其他 | - |
| 合计 | 108.20 |

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末无应付交易费用。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 2,627.24 |
| 预提费用 | 89,669.77 |
| 其他应付款 | 101,928.60 |
| 合计 | 194,225.61 |

6.4.7.9 实收基金

易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）A

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 | |
|------|----------------------------|---------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 15,719,544.86 | 15,719,544.86 |
| 本期申购 | 28,537,531.34 | 28,537,531.34 |

| | | |
|---------------|----------------|----------------|
| 本期赎回（以“-”号填列） | -19,326,904.73 | -19,326,904.73 |
| 本期末 | 24,930,171.47 | 24,930,171.47 |

易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）C

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 1,926,792.46 | 1,926,792.46 |
| 本期申购 | 16,624,998.47 | 16,624,998.47 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -11,740,594.22 | -11,740,594.22 |
| 本期末 | 6,811,196.71 | 6,811,196.71 |

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）A | | | |
|---------------------------|---------------|---------------|---------------|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 上年度末 | 5,657,447.91 | -1,598,029.21 | 4,059,418.70 |
| 本期利润 | 387,671.70 | 2,142,345.61 | 2,530,017.31 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 3,312,783.62 | 920,475.10 | 4,233,258.72 |
| 其中：基金申购款 | 10,192,387.91 | 1,528,932.50 | 11,721,320.41 |
| 基金赎回款 | -6,879,604.29 | -608,457.40 | -7,488,061.69 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 9,357,903.23 | 1,464,791.50 | 10,822,694.73 |

单位：人民币元

| 易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）C | | | |
|---------------------------|---------------|---------------|---------------|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 上年度末 | 378,997.09 | 109,081.96 | 488,079.05 |
| 本期利润 | 103,871.55 | 83,303.03 | 187,174.58 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 952,524.17 | 1,287,220.27 | 2,239,744.44 |
| 其中：基金申购款 | 3,206,871.76 | 3,397,319.31 | 6,604,191.07 |
| 基金赎回款 | -2,254,347.59 | -2,110,099.04 | -4,364,446.63 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 1,435,392.81 | 1,479,605.26 | 2,914,998.07 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入 | 3,850.15 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | - |
| 其他 | 368.06 |
| 合计 | 4,218.21 |

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 27,035,454.78 |
| 减：卖出股票成本总额 | 26,696,576.15 |
| 买卖股票差价收入 | 338,878.63 |

6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 708,370.04 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 708,370.04 |

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 1.交易性金融资产 | 2,225,648.64 |

| | |
|----------------------------|--------------|
| ——股票投资 | 2,225,648.64 |
| ——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 | 2,225,648.64 |

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 44,573.82 |
| 其他 | - |
| 合计 | 44,573.82 |

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 128,951.68 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 其他 | - |
| 合计 | 128,951.68 |

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-------|----------------------------|
| 审计费用 | 9,916.99 |
| 信息披露费 | - |
| 银行汇划费 | 3,840.33 |
| 上市费 | 29,752.78 |
| 指数使用费 | 50,317.80 |

| | |
|----|-----------|
| 其他 | 1,688.06 |
| 合计 | 95,515.96 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|--------------|---------------------|
| 易方达基金管理有限公司 | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 招商银行股份有限公司 | 基金托管人、基金销售机构 |
| 香港上海汇丰银行有限公司 | 境外资产托管人 |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----------------|----------------------|----------------------|
| | 2021年1月1日至2021年6月30日 | 2020年1月1日至2020年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 184,764.68 | 106,776.62 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 43,900.42 | 24,842.32 |

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|----------------------|----------------------|
| | 2021年1月1日至2021年6月30日 | 2020年1月1日至2020年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 57,739.03 | 33,367.70 |

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 | | |
|----------------|---------------------------|---------------------------|----------|
| | 2021年1月1日至2021年6月30日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）A | 易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）C | 合计 |
| 易方达基金管理有限公司 | - | 4,026.11 | 4,026.11 |
| 合计 | - | 4,026.11 | 4,026.11 |

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

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

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）A

无。

易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）C

无。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 | | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日 | |
|-----------|----------------------------|----------|---------------------------------|----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 招商银行-活期存款 | 1,567,487.33 | 3,839.86 | 655,609.00 | 2,653.05 |
| 汇丰银行-活 | 1,987,729.63 | 10.29 | 1,190,053.72 | 7.39 |

| | | | | |
|-----|--|--|--|--|
| 期存款 | | | | |
|-----|--|--|--|--|

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

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）A

本报告期内未发生利润分配。

易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）C

本报告期内未发生利润分配。

6.4.12 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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 (单位：股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|---------|------------------------------|------------|--------|--------|------|--------|--------------|--------------|--------------|----|
| 3800 HK | GCL-Poly Energy Holdings Ltd | 2021-04-01 | 重大事项停牌 | 1.65 | - | - | 1,060,000 | 1,650,083.79 | 1,746,369.50 | - |

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部门总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察合规管理部门、集中交易室、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

本基金属股票指数基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金主要采用组合复制策略和适当的替代性策略实现对标的指数的紧密跟踪，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金主要投资香港证券市场，需承担汇率风险以及境外市场的风险。日常经营活动中本基金面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险，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。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金在境内交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险；在境外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，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。于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00%(2020 年 12 月 31 日：0.00%)。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2021年6月30日 | 上年度末 2020年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1 | 0.00 | 0.00 |
| A-1 以下 | 0.00 | 0.00 |
| 未评级 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 0.00 | 0.00 |

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2021年6月30日 | 上年度末 2020年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1 | 0.00 | 0.00 |
| A-1 以下 | 0.00 | 0.00 |
| 未评级 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 0.00 | 0.00 |

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2021年6月30日 | 上年度末 2020年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1 | 0.00 | 0.00 |
| A-1 以下 | 0.00 | 0.00 |
| 未评级 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 0.00 | 0.00 |

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2021年6月30日 | 上年度末 2020年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA | 0.00 | 0.00 |
| AAA 以下 | 0.00 | 0.00 |
| 未评级 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 0.00 | 0.00 |

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2021年6月30日 | 上年度末 2020年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA | 0.00 | 0.00 |
| AAA 以下 | 0.00 | 0.00 |
| 未评级 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 0.00 | 0.00 |

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2021年6月30日 | 上年度末 2020年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA | 0.00 | 0.00 |
| AAA 以下 | 0.00 | 0.00 |
| 未评级 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 0.00 | 0.00 |

6.4.13.3 流动性风险

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

于 2021 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2021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 | 3,555,216.96 | - | - | - | 3,555,216.96 |
| 结算备付金 | - | - | - | - | - |
| 存出保证金 | - | - | - | - | - |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 42,492,633.78 | 42,492,633.78 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 388,350.81 | 388,350.81 |
| 应收利息 | - | - | - | 108.20 | 108.20 |
| 应收股利 | - | - | - | 391,368.81 | 391,368.81 |
| 应收申购款 | 120,751.27 | - | - | 196,357.18 | 317,108.45 |
| 递延所得税资产 | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 3,675,968.23 | - | - | 43,468,818.78 | 47,144,787.01 |
| 负债 | | | | | |
| 短期借款 | - | - | - | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - | - | - | - |
| 衍生金融负债 | - | - | - | - | - |
| 卖出回购金融资 | - | - | - | - | - |

| | | | | | |
|-----------------------------|--------------|-------|-------|---------------|---------------|
| 产款 | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | - | - | - | 1,429,995.05 | 1,429,995.05 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 30,360.13 | 30,360.13 |
| 应付托管费 | - | - | - | 9,487.51 | 9,487.51 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 1,657.73 | 1,657.73 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - | - | - |
| 应付利息 | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 194,225.61 | 194,225.61 |
| 负债总计 | - | - | - | 1,665,726.03 | 1,665,726.03 |
| 利率敏感度缺口 | 3,675,968.23 | - | - | 41,803,092.75 | 45,479,060.98 |
| 上年度末 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 | 1,471,669.68 | - | - | - | 1,471,669.68 |
| 结算备付金 | - | - | - | - | - |
| 存出保证金 | - | - | - | - | - |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 20,930,949.92 | 20,930,949.92 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 295,393.69 | 295,393.69 |
| 应收利息 | - | - | - | 55.08 | 55.08 |
| 应收股利 | - | - | - | 9,056.55 | 9,056.55 |
| 应收申购款 | 3,353.00 | - | - | 14,143.77 | 17,496.77 |
| 递延所得税资产 | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 1,475,022.68 | - | - | 21,249,599.01 | 22,724,621.69 |
| 负债 | | | | | |
| 短期借款 | - | - | - | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - | - | - | - |
| 衍生金融负债 | - | - | - | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - | - | - | - |

| | | | | | |
|---------|--------------|---|---|---------------|---------------|
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | - | - | - | 388,737.26 | 388,737.26 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 14,846.79 | 14,846.79 |
| 应付托管费 | - | - | - | 4,639.61 | 4,639.61 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 438.40 | 438.40 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - | - | - |
| 应付利息 | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 122,124.56 | 122,124.56 |
| 负债总计 | - | - | - | 530,786.62 | 530,786.62 |
| 利率敏感度缺口 | 1,475,022.68 | - | - | 20,718,812.39 | 22,193,835.07 |

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年6月30日 | | | |
|----------|-------------------|---------------|---------------|---------------|
| | 美元 折合人民币 | 港币 折合人民币 | 其他币种 折合人民币 | 合计 |
| 以外币计价的资产 | | | | |
| 银行存款 | - | 1,987,872.35 | - | 1,987,872.35 |
| 结算备付金 | - | - | - | - |
| 存出保证金 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产 | - | 42,492,633.78 | - | 42,492,633.78 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - |

| | | | | |
|----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|----------------------|
| 应收证券清算款 | - | 388,350.81 | - | 388,350.81 |
| 应收利息 | - | 1.76 | - | 1.76 |
| 应收股利 | - | 391,368.81 | - | 391,368.81 |
| 应收申购款 | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - |
| 资产合计 | - | 45,260,227.51 | - | 45,260,227.51 |
| 以外币计价的负债 | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | - |
| 负债合计 | - | - | - | - |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | - | 45,260,227.51 | - | 45,260,227.51 |
| 项目 | 上年度末 | | | |
| | 2020年12月31日 | | | |
| | 美元 折合人民币 | 港币 折合人民币 | 其他币种 折合人民币 | 合计 |
| 以外币计价的资产 | | | | |
| 银行存款 | - | 1,110,178.31 | - | 1,110,178.31 |
| 结算备付金 | - | - | - | - |
| 存出保证金 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产 | - | 20,930,949.92 | - | 20,930,949.92 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - |
| 应收证券清算款 | - | 295,393.69 | - | 295,393.69 |
| 应收利息 | - | 1.08 | - | 1.08 |
| 应收股利 | - | 9,056.55 | - | 9,056.55 |
| 应收申购款 | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - |

| | | | | |
|---------------|---|---------------|---|---------------|
| 资产合计 | - | 22,345,579.55 | - | 22,345,579.55 |
| 以外币计价的负债 | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | - |
| 负债合计 | - | - | - | - |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | - | 22,345,579.55 | - | 22,345,579.55 |

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

| 假设 | 除汇率外其他因素保持不变 | | |
|----|-------------------|-----------------------------|---------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末 2021年6月30日 | 上年度末 2020年12月31日 |
| | 假设人民币对一揽子货币平均升值5% | -2,263,011.38 | -1,117,278.98 |
| | 假设人民币对一揽子货币平均贬值5% | 2,263,011.38 | 1,117,278.98 |

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2020 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 | 42,492,633.78 | 93.43 | 20,930,949.92 | 94.31 |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产—权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 42,492,633.78 | 93.43 | 20,930,949.92 | 94.31 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变 | | |
|----|----------------------|---------------------------------|--------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
| | 1.业绩比较基准上升 5% | 2,124,631.67 | 1,046,547.49 |
| | 2.业绩比较基准下降 5% | -2,124,631.67 | -1,046,547.49 |

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于

第一层次的余额为 40,746,264.28 元，属于第二层次的余额为 1,746,369.50 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次 20,930,949.92 元，无属于第二层次的余额，无属于第三层次的余额)。

(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

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020 年 12 月 31 日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

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

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|---------|---------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 42,492,633.78 | 90.13 |
| | 其中：普通股 | 42,313,531.80 | 89.75 |
| | 存托凭证 | - | - |
| | 优先股 | - | - |
| | 房地产信托凭证 | 179,101.98 | 0.38 |
| 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 | 3,555,216.96 | 7.54 |
| 8 | 其他各项资产 | 1,096,936.27 | 2.33 |
| 9 | 合计 | 47,144,787.01 | 100.00 |

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

| 国家（地区） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|--------|---------------|--------------|
| 中国香港 | 42,492,633.78 | 93.43 |
| 合计 | 42,492,633.78 | 93.43 |

注：1.国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定。

2.ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

| 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|--------|---------------|--------------|
| 能源 | 1,025,227.11 | 2.25 |
| 材料 | 4,163,634.05 | 9.16 |
| 工业 | 6,071,016.78 | 13.35 |
| 非必需消费品 | 6,468,729.13 | 14.22 |
| 必需消费品 | 560,125.67 | 1.23 |
| 保健 | 9,111,816.37 | 20.04 |
| 金融 | 3,014,498.79 | 6.63 |
| 信息技术 | 4,063,810.13 | 8.94 |
| 电信服务 | 2,227,701.35 | 4.90 |
| 公用事业 | 888,492.83 | 1.95 |
| 房地产 | 4,897,581.57 | 10.77 |
| 合计 | 42,492,633.78 | 93.43 |

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称 (英文) | 公司名称 (中文) | 证券代码 | 所在证 券市场 | 所属国家 (地区) | 数量 (股) | 公允价值 | 占基金资 产净值比 例 (%) |
|----|--|----------------------------|---------|-----------------|--------------|-----------|--------------|-----------------------|
| 1 | COSCO SHIPPIN G Holdings Co.,Ltd. | 中远海运 控股股份 有限公司 | 1919 HK | 香港证 券交易 所 | 中国香港 | 122,000 | 1,985,609.15 | 4.37 |
| 2 | GCL-Poly Energy Holdings Limited | 保利协鑫 能源控股 有限公司 | 3800 HK | 香港证 券交易 所 | 中国香港 | 1,060,000 | 1,746,369.50 | 3.84 |
| 3 | Chinasoft Internatio nal Ltd. | 中软国际 有限公司 | 354 HK | 香港证 券交易 所 | 中国香港 | 117,466 | 1,384,014.11 | 3.04 |
| 4 | Pharmaro n Beijing Co Ltd | 康龙化成 | 3759 HK | 香港证 券交易 所 | 中国香港 | 6,400 | 1,102,339.58 | 2.42 |
| 5 | Ganfeng Lithium Co., Ltd. | 江西赣锋 锂业股份 有限公司 | 1772 HK | 香港证 券交易 所 | 中国香港 | 10,400 | 1,003,821.31 | 2.21 |
| 6 | Hangzhou Tigermed Consultin g Co Ltd | 杭州泰格 医药科技 股份有限 公司 | 3347 HK | 香港证 券交易 所 | 中国香港 | 5,900 | 893,487.50 | 1.96 |
| 7 | Venus Medtech (Hangzho u) Inc. | 杭州启明 医疗器械 股份有限 公司 | 2500 HK | 香港证 券交易 所 | 中国香港 | 15,500 | 835,096.29 | 1.84 |
| 8 | China Coal Energy Company Limited | 中国中煤 能源股份 有限公司 | 1898 HK | 香港证 券交易 所 | 中国香港 | 195,000 | 751,243.43 | 1.65 |
| 9 | Xtep Internatio nal Holdings Limited | 特步国际 控股有限 公司 | 1368 HK | 香港证 券交易 所 | 中国香港 | 60,250 | 733,944.48 | 1.61 |
| 10 | Aluminu m Corporati | 中国铝业 股份有限 公司 | 2600 HK | 香港证 券交易 所 | 中国香港 | 188,000 | 724,275.72 | 1.59 |

| | | | | | | | | |
|----|--|------------------------------|---------|---------------------|------|---------|------------|------|
| | on of China Limited | | | | | | | |
| 11 | Xd Inc. | 心动有限公司 | 2400 HK | 香港证 券交 易 所 | 中国香港 | 10,800 | 615,572.78 | 1.35 |
| 12 | HengTen Networks Group Limited | 恒腾网络 集团有限 公司 | 136 HK | 香港证 券交 易 所 | 中国香港 | 114,800 | 593,196.49 | 1.30 |
| 13 | Sihuan Pharmace utical Holdings Group Ltd. | 四环医药 控股集团 有限公司 | 460 HK | 香港证 券交 易 所 | 中国香港 | 202,000 | 558,026.13 | 1.23 |
| 14 | RemeGen Co.,Ltd. | 荣昌生物 制药（烟 台）股份 有限公司 | 9995 HK | 香港证 券交 易 所 | 中国香港 | 5,500 | 541,850.50 | 1.19 |
| 15 | Zoomlion Heavy Industry Science and Technolog y Co., Ltd. | 中联重科 股份有限 公司 | 1157 HK | 香港证 券交 易 所 | 中国香港 | 74,800 | 506,007.82 | 1.11 |
| 16 | China Merchants Securities Co., Ltd | 招商证券 股份有限 公司 | 6099 HK | 香港证 券交 易 所 | 中国香港 | 54,200 | 487,066.35 | 1.07 |
| 17 | Alphamab Oncology | 康宁杰瑞 生物制药 | 9966 HK | 香港证 券交 易 所 | 中国香港 | 23,000 | 475,575.32 | 1.05 |
| 18 | Jinke Smart Services Group Co., Ltd. | 金科智慧 服务集团 股份有限 公司 | 9666 HK | 香港证 券交 易 所 | 中国香港 | 7,300 | 442,504.30 | 0.97 |
| 19 | KWG Living Group Holdings Limited | 合景悠活 集团控股 有限公司 | 3913 HK | 香港证 券交 易 所 | 中国香港 | 53,000 | 439,238.39 | 0.97 |

| | | | | | | | | |
|----|---|-----------------|---------|---------|------|--------|------------|------|
| 20 | Fu Shou Yuan International Group Limited | 福寿园国际集团有限公司 | 1448 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 66,480 | 419,300.42 | 0.92 |
| 21 | Tianneng Power International Ltd | 天能动力国际有限公司 | 819 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 34,712 | 392,233.33 | 0.86 |
| 22 | Zhejiang Expressway Co., Ltd. | 浙江沪杭甬高速公路股份有限公司 | 576 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 68,000 | 390,977.75 | 0.86 |
| 23 | Beijing Capital International Airport Company Limited | 北京首都国际机场股份有限公司 | 694 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 90,000 | 385,669.08 | 0.85 |
| 24 | Luk Fook Holdings (International) Ltd. | 六福集团(国际)有限公司 | 590 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 17,000 | 379,095.65 | 0.83 |
| 25 | Shandong Gold Mining Co., Ltd. | 山东黄金矿业股份有限公司 | 1787 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 32,567 | 372,331.32 | 0.82 |
| 26 | Xinjiang Goldwind Science & Technology Co., Ltd | 新疆金风科技股份有限公司 | 2208 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 36,620 | 369,915.14 | 0.81 |
| 27 | IGG Inc | - | 799 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 42,680 | 364,365.17 | 0.80 |
| 28 | Antengene Corporation Limited | 德琪医药有限公司 | 6996 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 22,500 | 358,335.25 | 0.79 |
| 29 | Sany Heavy Equipment | 三一重装国际控股有限公司 | 631 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 52,548 | 344,108.98 | 0.76 |

| | | | | | | | | |
|----|--|------------------|---------|---------|------|--------|------------|------|
| | International Holdings Company Limited | | | | | | | |
| 30 | Zhaojin Mining Industry Company Limited | 招金矿业股份有限公司 | 1818 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 55,634 | 341,634.51 | 0.75 |
| 31 | Shanghai Junshi Biosciences Co.,Ltd. | 上海君实生物医药科技股份有限公司 | 1877 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 6,200 | 332,748.79 | 0.73 |
| 32 | Ascentage Pharma Group International | 亚盛医药集团 | 6855 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 8,400 | 328,505.18 | 0.72 |
| 33 | China Resources Medical Holdings Company Limited | 华润医疗控股有限公司 | 1515 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 40,043 | 314,197.98 | 0.69 |
| 34 | Poly Property Services Co., Ltd. | 保利物业服务股份有限公司 | 6049 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 7,000 | 306,954.31 | 0.67 |
| 35 | CSC Financial Co Ltd | 中信建投证券股份有限公司 | 6066 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 39,096 | 306,116.71 | 0.67 |
| 36 | China Overseas Grand Oceans Group Limited | 中国海外宏洋集团有限公司 | 81 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 81,000 | 304,641.13 | 0.67 |
| 37 | Q Technology (Group) Company Limited | 丘钛科技(集团)有限公司 | 1478 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 22,882 | 303,111.30 | 0.67 |
| 38 | Viva | 维亚生物 | 1873 HK | 香港证 | 中国香港 | 36,430 | 301,307.98 | 0.66 |

| | | | | | | | | |
|----|--|-------------------|---------|---------|------|---------|------------|------|
| | Biotech Holdings | 科技控股集团 | | 券交易所 | | | | |
| 39 | Dongyue Group Limited | 东岳集团有限公司 | 189 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 55,533 | 300,351.34 | 0.66 |
| 40 | Frontage Holdings Corporation | 方达控股公司 | 1521 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 43,626 | 299,477.66 | 0.66 |
| 41 | Jacobio Pharmaceuticals Group Co., Ltd. | 加科思药业集团有限公司 | 1167 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 16,500 | 298,612.71 | 0.66 |
| 42 | S-Enjoy Service Group Co., Limited | 新城悦服务集团有限公司 | 1755 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 15,000 | 294,556.32 | 0.65 |
| 43 | Sinopec Engineering (Group) Co., Ltd. | 中石化炼化工程(集团)股份有限公司 | 2386 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 69,500 | 290,882.69 | 0.64 |
| 44 | First Pacific Co. Ltd. | 第一太平有限公司 | 142 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 124,000 | 273,421.49 | 0.60 |
| 45 | Chongqing Rural Commercial Bank Co., Ltd. | 重庆农村商业银行股份有限公司 | 3618 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 107,000 | 273,329.96 | 0.60 |
| 46 | Ocumension Therapeutics | 欧康维视生物 | 1477 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 12,000 | 272,589.41 | 0.60 |
| 47 | The United Laboratories International Holdings Ltd | 联邦制药国际控股有限公司 | 3933 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 49,797 | 263,941.51 | 0.58 |

| | | | | | | | | |
|----|---|-----------------------------|---------|-----------------|------|--------|------------|------|
| 48 | Genertec Universal Medical Group Company Limited | 通用环球 医疗集团 有限公司 | 2666 HK | 香港证 券交易 所 | 中国香港 | 40,500 | 255,777.23 | 0.56 |
| 49 | Powerlon g Commerci al Managem ent Holdings Limited | 宝龙商业 管理控股 有限公司 | 9909 HK | 香港证 券交易 所 | 中国香港 | 11,000 | 249,873.62 | 0.55 |
| 50 | Stella Internatio nal Holdings Ltd | 九兴控股 有限公司 | 1836 HK | 香港证 券交易 所 | 中国香港 | 24,500 | 244,631.52 | 0.54 |
| 51 | Livzon Pharmace utical Group Inc. | 丽珠医药 集团股份 有限公司 | 1513 HK | 香港证 券交易 所 | 中国香港 | 7,570 | 240,930.84 | 0.53 |
| 52 | Cafe De Coral Holdings Ltd. | 大家乐集 团有限公 司 | 341 HK | 香港证 券交易 所 | 中国香港 | 18,000 | 239,039.94 | 0.53 |
| 53 | Value Partners Group Limited | 惠理集团 有限公司 | 806 HK | 香港证 券交易 所 | 中国香港 | 57,000 | 235,245.66 | 0.52 |
| 54 | CMGE Technolog y Group Limited | 中手游科 技集团有 限公司 | 302 HK | 香港证 券交易 所 | 中国香港 | 73,379 | 232,627.93 | 0.51 |
| 55 | Guangzho u Baiyunsha n Pharmace utical Holdings Company Limited | 广州白云 山医药集 团股份有 限公司 | 874 HK | 香港证 券交易 所 | 中国香港 | 11,328 | 231,403.44 | 0.51 |

| | | | | | | | | |
|----|---|--------------------|---------|---------|------|---------|------------|------|
| 56 | CIMC Enric Holdings Limited | 中集安瑞科控股有限公司 | 3899 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 34,000 | 228,589.02 | 0.50 |
| 57 | Sinopec Shanghai Petrochemical Company Limited | 中国石化上海石油化工股份有限公司 | 338 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 150,000 | 225,909.72 | 0.50 |
| 58 | COFCO Joycome Foods Limited | 中粮家佳康食品有限公司 | 1610 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 83,546 | 216,197.73 | 0.48 |
| 59 | Shanghai Electric Group Company Limited | 上海电气集团股份有限公司 | 2727 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 124,898 | 215,125.01 | 0.47 |
| 60 | China SCE Group Holdings Limited | 中骏集团控股有限公司 | 1966 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 80,584 | 213,896.95 | 0.47 |
| 61 | China Water Affairs Group Limited | 中国水务集团有限公司 | 855 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 42,587 | 211,906.03 | 0.47 |
| 62 | Xiabuxiabu Catering Management (China) Holdings Co., Ltd. | 呷哺呷哺餐饮管理(中国)控股有限公司 | 520 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 30,941 | 209,567.45 | 0.46 |
| 63 | China Reinsurance (Group) Corporation | 中国再保险(集团)股份有限公司 | 1508 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 316,000 | 207,720.45 | 0.46 |
| 64 | Shougang Fushan Resources | 首钢福山资源集团有限公司 | 639 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 107,536 | 204,905.89 | 0.45 |

| | | | | | | | | |
|----|--|------------------|---------|---------|------|--------|------------|------|
| | Group Limited | | | | | | | |
| 65 | JHBP (CY) Holdings Limited | 嘉和生物药业(开曼)控股有限公司 | 6998 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 13,000 | 203,360.35 | 0.45 |
| 66 | Baic Motor Corporation Limited | 北京汽车股份有限公司 | 1958 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 83,500 | 200,793.39 | 0.44 |
| 67 | Chow Sang Sang Holdings International Ltd. | 周生生集团国际有限公司 | 116 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 17,935 | 200,569.89 | 0.44 |
| 68 | China Risun Group Limited | 中国旭阳集团有限公司 | 1907 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 49,087 | 199,320.24 | 0.44 |
| 69 | Shenzhen Expressway Company Limited | 深圳高速公路股份有限公司 | 548 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 31,840 | 198,700.70 | 0.44 |
| 70 | Hbm Holdings Limited | 和铂医药控股有限公司 | 2142 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 24,000 | 197,702.21 | 0.43 |
| 71 | JW (Cayman) Therapeutics Co. Ltd | 药明巨诺(开曼)有限公司 | 2126 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 9,500 | 197,223.76 | 0.43 |
| 72 | C&D International Investment Group Limited | 建发国际投资集团有限公司 | 1908 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 16,839 | 195,599.08 | 0.43 |
| 73 | Pacific textiles holdings Limited | 互太纺织控股有限公司 | 1382 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 50,206 | 195,091.16 | 0.43 |
| 74 | AsiaInfo | 亚信科技 | 1675 HK | 香港证 | 中国香港 | 17,600 | 193,308.83 | 0.43 |

| | | | | | | | | |
|----|---|----------------|---------|---------|------|---------|------------|------|
| | Technologies Limited | 有限公司 | | 券交易所 | | | | |
| 75 | Vesync Co., Ltd | - | 2148 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 20,000 | 192,709.73 | 0.42 |
| 76 | Lonking Holdings Limited | 中国龙工控股有限公司 | 3339 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 92,000 | 192,143.91 | 0.42 |
| 77 | China Dongxiang (Group) Co., Ltd. | 中国动向(集团)有限公司 | 3818 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 167,459 | 190,894.82 | 0.42 |
| 78 | China South City Holdings Limited | 华南城控股有限公司 | 1668 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 268,000 | 189,547.82 | 0.42 |
| 79 | C-Mer Eye Care Holdings Limited | 希玛眼科医疗控股有限公司 | 3309 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 22,478 | 186,660.87 | 0.41 |
| 80 | Dah Sing Financial Holdings Ltd. | 大新金融集团有限公司 | 440 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 8,400 | 185,570.48 | 0.41 |
| 81 | Yuexiu Transport Infrastructure Limited | 越秀交通基建有限公司 | 1052 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 49,357 | 184,810.38 | 0.41 |
| 82 | E-House (China) Enterprise Holdings Limited | 易居(中国)企业控股有限公司 | 2048 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 33,300 | 183,982.87 | 0.40 |
| 83 | Shui On Land Limited | 瑞安房地产有限公司 | 272 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 171,500 | 179,804.17 | 0.40 |
| 84 | China Railway Signal & Communication | 中国铁路通信信号股份有限公司 | 3969 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 75,000 | 179,105.22 | 0.39 |

| | | | | | | | | |
|----|--|---------------|---------|---------|------|---------|------------|------|
| | Corporation Limited | | | | | | | |
| 85 | Sunlight Real Estate Investment Trust | 阳光房地产投资信托基金 | 435 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 47,939 | 179,101.98 | 0.39 |
| 86 | Bank of Chongqing Co., Ltd. | 重庆银行股份有限公司 | 1963 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 41,262 | 177,503.08 | 0.39 |
| 87 | Digital China Holdings Ltd. | 神州数码控股有限公司 | 861 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 40,208 | 171,630.68 | 0.38 |
| 88 | Orient Securities Company Limited | 东方证券股份有限公司 | 3958 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 36,600 | 171,456.74 | 0.38 |
| 89 | Shinsun Holdings (Group) Co., Ltd. | 祥生控股(集团)有限公司 | 2599 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 36,000 | 169,844.17 | 0.37 |
| 90 | China New Higher Education Group Limited | 中国新高教集团有限公司 | 2001 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 38,209 | 169,138.47 | 0.37 |
| 91 | China Modern Dairy Holdings Ltd. | 中国现代牧业控股有限公司 | 1117 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 118,000 | 168,878.96 | 0.37 |
| 92 | Citic Telecom International Holdings Limited | 中信国际电讯集团有限公司 | 1883 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 78,559 | 167,994.15 | 0.37 |
| 93 | CGN New Energy Holdings Co., Ltd. | 中国广核新能源控股有限公司 | 1811 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 62,000 | 165,600.56 | 0.36 |

| | | | | | | | | |
|-----|---|----------------|---------|---------|------|---------|------------|------|
| 94 | VSTECSholdings Limited | 伟仕佳杰控股有限公司 | 856 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 31,640 | 165,070.36 | 0.36 |
| 95 | Fufeng Group Ltd | 阜丰集团有限公司 | 546 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 78,000 | 161,606.58 | 0.36 |
| 96 | Poly Property Group Co., Limited | 保利置业集团有限公司 | 119 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 96,000 | 161,356.95 | 0.35 |
| 97 | COSCO SHIPPING Energy Transportation Co., Ltd. | 中远海运能源运输股份有限公司 | 1138 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 53,188 | 160,209.15 | 0.35 |
| 98 | TCL Electronics Holdings Limited | TCL 电子控股有限公司 | 1070 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 41,525 | 159,976.32 | 0.35 |
| 99 | China Tian Lun Gas Holdings Limited | 中国天伦燃气控股有限公司 | 1600 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 24,000 | 159,959.06 | 0.35 |
| 100 | Datang International Power Generation Co., Ltd. | 大唐国际发电股份有限公司 | 991 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 145,783 | 157,694.05 | 0.35 |
| 101 | China Kepei Education Group Limited | 中国科培教育集团有限公司 | 1890 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 33,454 | 155,883.86 | 0.34 |
| 102 | Comba Telecom Systems Holdings Ltd. | 京信通信系统控股有限公司 | 2342 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 92,000 | 155,399.26 | 0.34 |
| 103 | Tiangong International | 天工国际有限公司 | 826 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 56,000 | 154,234.35 | 0.34 |

| | | | | | | | | |
|-----|---|--------------|---------|---------|------|---------|------------|------|
| | Company Limited | | | | | | | |
| 104 | Zhuguang Holdings Group Company Limited | 珠光控股集团有限公司 | 1176 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 102,617 | 153,694.00 | 0.34 |
| 105 | Sinic Holdings (Group) Company Limited | 新力控股(集团)有限公司 | 2103 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 43,000 | 149,915.85 | 0.33 |
| 106 | Times Neighborhood Holdings Limited | 时代邻里控股有限公司 | 9928 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 26,000 | 144,082.97 | 0.32 |
| 106 | Radiance Holdings (Group) Company Limited | 金辉控股(集团)有限公司 | 9993 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 39,000 | 144,082.97 | 0.32 |
| 108 | Shenwan Hongyuan Group Co.,Ltd. | 申万宏源集团股份有限公司 | 6806 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 83,200 | 143,996.44 | 0.32 |
| 109 | Dah Sing Banking Group Ltd. | 大新银行集团有限公司 | 2356 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 20,000 | 142,618.51 | 0.31 |
| 110 | Guotai Junan International Holdings Limited | 国泰君安国际控股有限公司 | 1788 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 137,000 | 141,353.75 | 0.31 |
| 111 | NetDragon Websoft Holdings Limited | 网龙网络控股有限公司 | 777 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 8,128 | 139,997.13 | 0.31 |
| 112 | Tianli Education International Holdings | 天立教育国际控股有限公司 | 1773 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 57,000 | 139,914.25 | 0.31 |

| | | | | | | | | |
|-----|--|--------------|---------|---------|------|--------|------------|------|
| | Limited | | | | | | | |
| 113 | Texhong Textile Group Limited | 天虹纺织集团有限公司 | 2678 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 13,261 | 138,589.71 | 0.30 |
| 114 | Central China New Life Limited | 建业新生活有限公司 | 9983 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 21,000 | 137,867.34 | 0.30 |
| 115 | Beijing Tong Ren Tang Chinese Medicine Company Limited | 北京同仁堂国药有限公司 | 3613 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 12,845 | 137,021.03 | 0.30 |
| 116 | Shun Tak Holdings Ltd. | 信德集团有限公司 | 242 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 65,305 | 135,847.46 | 0.30 |
| 117 | Sheng Ye Capital Limited | 盛业资本有限公司 | 6069 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 20,311 | 129,963.90 | 0.29 |
| 118 | Skyworth Group Limited | 创维集团有限公司 | 751 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 70,002 | 126,979.04 | 0.28 |
| 119 | Excellence Commercial Property & Facilities Management Group Limited | 卓越商企服务集团有限公司 | 6989 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 18,000 | 126,858.92 | 0.28 |
| 120 | China Maple Leaf Educational Systems Limited | 中国枫叶教育集团有限公司 | 1317 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 72,000 | 125,810.50 | 0.28 |
| 121 | iDreamSky Technology | 创梦天地科技控股有限公司 | 1119 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 30,000 | 124,063.13 | 0.27 |

| | | | | | | | | |
|-----|--|----------------|---------|---------|------|---------|------------|------|
| | y Holdings Limited | | | | | | | |
| 122 | Fosun Tourism Group | 复星旅游文化集团 | 1992 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 11,800 | 121,749.95 | 0.27 |
| 123 | Meitu, Inc. | 美图公司 | 1357 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 82,500 | 120,818.02 | 0.27 |
| 124 | Sinopec Kantons Holdings Ltd. | 中石化冠德控股有限公司 | 934 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 46,988 | 113,774.53 | 0.25 |
| 125 | Asia Cement (China) Holdings Corporation | 亚洲水泥(中国)控股有限公司 | 743 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 22,428 | 113,464.29 | 0.25 |
| 126 | China Oriental Group Co. Ltd. | 中国东方集团控股有限公司 | 581 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 54,000 | 112,780.12 | 0.25 |
| 127 | China Travel International Investment Hong Kong Ltd. | 香港中旅国际投资有限公司 | 308 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 104,825 | 112,517.39 | 0.25 |
| 128 | Joy Spreader Interactive Technology Ltd | 乐享互动有限公司 | 6988 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 42,000 | 110,783.13 | 0.24 |
| 129 | Dexin China Holdings Company Limited | 德信中国控股有限公司 | 2019 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 45,067 | 110,623.08 | 0.24 |
| 130 | Canvest Environmental Protection | 粤丰环保电力有限公司 | 1381 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 28,910 | 108,730.56 | 0.24 |

| | | | | | | | | |
|-----|---|--------------|---------|---------|------|---------|------------|------|
| | Group Company Limited | | | | | | | |
| 131 | Redco Properties Group Limited | 力高地产集团有限公司 | 1622 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 51,772 | 108,557.68 | 0.24 |
| 132 | Cathay Media And Education Group Inc. | 华夏视听教育集团 | 1981 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 24,000 | 107,837.57 | 0.24 |
| 133 | Lifestyle International Holdings Ltd | 利福国际集团有限公司 | 1212 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 21,500 | 106,622.73 | 0.23 |
| 134 | China Harmony Auto Holding Limited | 中国和谐汽车控股有限公司 | 3836 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 37,367 | 106,024.86 | 0.23 |
| 135 | Baozun Inc. | 宝尊电商 | 9991 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 1,300 | 104,330.35 | 0.23 |
| 136 | Redsun Properties Group Limited | 弘阳地产集团有限公司 | 1996 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 48,000 | 103,044.79 | 0.23 |
| 137 | West China Cement Limited | 中国西部水泥有限公司 | 2233 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 103,234 | 102,219.75 | 0.22 |
| 138 | CK Life Sciences Int'l. (Holdings) Inc. | 长江生命科技集团有限公司 | 775 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 138,000 | 102,196.07 | 0.22 |
| 139 | China Foods Limited | 中国食品有限公司 | 506 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 40,899 | 95,968.10 | 0.21 |
| 140 | China Lilang | 中国利郎有限公司 | 1234 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 22,779 | 95,527.91 | 0.21 |

| | | | | | | | | |
|-----|---|-----------------|---------|---------|------|---------|-----------|------|
| | Limited | | | 所 | | | | |
| 141 | China High Speed Transmission Equipment Group Co., Ltd. | 中国高速传动设备集团有限公司 | 658 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 23,233 | 95,305.35 | 0.21 |
| 142 | China Shineway Pharmaceutical Group Ltd | 中国神威药业集团有限公司 | 2877 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 14,347 | 95,025.30 | 0.21 |
| 143 | Citychamp Watch & Jewellery Group Limited | 冠城钟表珠宝集团有限公司 | 256 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 73,715 | 93,231.90 | 0.20 |
| 144 | Sinofert Holdings Limited | 中化化肥控股有限公司 | 297 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 100,000 | 93,192.96 | 0.20 |
| 145 | Tongdao Liepin Group | 同道猎聘集团 | 6100 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 6,200 | 92,550.59 | 0.20 |
| 146 | Road King Infrastructure Ltd. | 路劲基建有限公司 | 1098 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 11,282 | 90,683.51 | 0.20 |
| 147 | Hutchison Telecommunications Hong Kong Holdings Limited | 和记电讯香港控股有限公司 | 215 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 70,000 | 89,115.77 | 0.20 |
| 148 | Yichang Hec Changjiang Pharmaceutical Co., Ltd. | 宜昌东阳光长江药业股份有限公司 | 1558 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 12,400 | 88,423.48 | 0.19 |
| 149 | China | 中国光大 | 1257 HK | 香港证 | 中国香港 | 34,350 | 84,602.57 | 0.19 |

| | | | | | | | | |
|-----|---|------------------|---------|---------|------|---------|-----------|------|
| | Everbright Greentech Limited | 绿色环保有限公司 | | 券交易所 | | | | |
| 150 | Greenland Hong Kong Holdings Limited | 绿地香港控股有限公司 | 337 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 40,000 | 83,208.00 | 0.18 |
| 151 | Central China Real Estate Ltd | 建业地产股份有限公司 | 832 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 49,000 | 82,359.28 | 0.18 |
| 152 | Huijing Holdings Company Limited | 汇景控股有限公司 | 9968 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 50,000 | 81,959.88 | 0.18 |
| 153 | Nissin Foods Company Limited | 日清食品有限公司 | 1475 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 16,000 | 79,080.88 | 0.17 |
| 154 | Mulsanne Group Holding Limited | 慕尚集团控股有限公司 | 1817 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 13,500 | 73,127.35 | 0.16 |
| 155 | CSSC (Hong Kong) Shipping Company Limited | 中国船舶(香港)航运租赁有限公司 | 3877 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 58,113 | 71,564.90 | 0.16 |
| 156 | Yangtze Optical Fibre and Cable Joint Stock Limited Company | 长飞光纤光缆股份有限公司 | 6869 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 8,391 | 68,912.17 | 0.15 |
| 157 | Sun Hung Kai & Co. Ltd. | 新鸿基有限公司 | 86 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 19,474 | 67,570.37 | 0.15 |
| 158 | Glory Sun Financial Group | 宝新金融集团有限公司 | 1282 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 372,000 | 64,692.56 | 0.14 |

| | | | | | | | | |
|-----|---|----------------|---------|---------|------|--------|-----------|------|
| | Limited | | | | | | | |
| 159 | Wisdom Education International Holdings Company Limited | 睿见教育国际控股有限公司 | 6068 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 36,077 | 63,640.17 | 0.14 |
| 160 | China Merchants Land Limited | 招商局置地有限公司 | 978 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 69,693 | 63,209.27 | 0.14 |
| 161 | Colour Life Services Group Co., Limited | 彩生活服务集团有限公司 | 1778 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 24,733 | 62,768.50 | 0.14 |
| 162 | China Aircraft Leasing Group Holdings Limited | 中国飞机租赁集团控股有限公司 | 1848 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 12,293 | 62,088.57 | 0.14 |
| 163 | SmarTone Telecommunications Holdings Ltd. | 数码通电讯集团有限公司 | 315 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 16,192 | 61,975.98 | 0.14 |
| 164 | Fantasia Holdings Group Co., Limited | 花样年控股集团有限公司 | 1777 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 82,500 | 60,409.01 | 0.13 |
| 165 | Minsheng Education Group Co., Ltd. | 民生教育集团有限公司 | 1569 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 51,503 | 57,853.73 | 0.13 |
| 166 | Perennial Energy Holdings Limited | 久泰邦达能源控股有限公司 | 2798 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 35,000 | 53,585.95 | 0.12 |
| 167 | Vpower Group Internatio | 伟能集团国际控股有限公司 | 1608 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 32,000 | 46,596.48 | 0.10 |

| | | | | | | | | |
|-----|---|----------------|---------|---------|------|--------|-----------|------|
| | nal Holdings Limited | | | | | | | |
| 168 | China VAST Industrial Urban Development Company Limited | 中国宏泰产业市镇发展有限公司 | 6166 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 15,947 | 39,807.54 | 0.09 |
| 169 | Scholar Education Group | 思考乐教育集团 | 1769 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 8,000 | 23,631.07 | 0.05 |
| 170 | Guorui Properties Limited | 国瑞置业有限公司 | 2329 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 52,560 | 17,493.65 | 0.04 |

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称（英文） | 证券代码 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|---------------------------------------|---------|--------------|----------------|
| 1 | GCL-Poly Energy Holdings Limited | 3800 HK | 1,734,918.92 | 7.82 |
| 2 | Weimob Inc. | 2013 HK | 1,303,525.39 | 5.87 |
| 3 | Ganfeng Lithium Co., Ltd. | 1772 HK | 1,078,332.01 | 4.86 |
| 4 | Venus Medtech (Hangzhou) Inc. | 2500 HK | 1,039,717.10 | 4.68 |
| 5 | CanSino Biologics Inc. | 6185 HK | 887,466.75 | 4.00 |
| 6 | Hangzhou Tigermed Consulting Co Ltd | 3347 HK | 857,408.15 | 3.86 |
| 7 | COSCO SHIPPING Holdings Co.,Ltd. | 1919 HK | 743,274.21 | 3.35 |
| 8 | China Coal Energy Company Limited | 1898 HK | 711,664.43 | 3.21 |
| 9 | Chinasoft International Ltd. | 354 HK | 698,213.59 | 3.15 |
| 10 | Yadea Group Holdings Ltd. | 1585 HK | 681,426.93 | 3.07 |
| 11 | Pharmaron Beijing Co Ltd | 3759 HK | 632,173.50 | 2.85 |
| 12 | Beijing Capital International Airport | 694 HK | 599,548.59 | 2.70 |

| | Company Limited | | | |
|----|--|---------|------------|------|
| 13 | CIFI Ever Sunshine Services Group Limited | 1995 HK | 574,349.98 | 2.59 |
| 14 | Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co., Ltd. | 1157 HK | 554,092.95 | 2.50 |
| 15 | RemeGen Co.,Ltd. | 9995 HK | 532,043.96 | 2.40 |
| 16 | Jiumaojiu International Holdings Limited | 9922 HK | 526,099.92 | 2.37 |
| 17 | A-Living Smart City Services Co Ltd | 3319 HK | 510,240.33 | 2.30 |
| 18 | Xd Inc. | 2400 HK | 503,991.54 | 2.27 |
| 19 | Jinke Smart Services Group Co., Ltd. | 9666 HK | 503,506.52 | 2.27 |
| 20 | Perennial Energy Holdings Limited | 2798 HK | 501,893.70 | 2.26 |
| 21 | Hygeia Healthcare Holdings Co Ltd | 6078 HK | 495,219.71 | 2.23 |
| 22 | Sihuan Pharmaceutical Holdings Group Ltd. | 460 HK | 487,064.63 | 2.19 |
| 23 | Shanghai Junshi Biosciences Co., Ltd. | 1877 HK | 474,849.21 | 2.14 |

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

2.此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称（英文） | 证券代码 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|---|---------|--------------|----------------|
| 1 | Weimob Inc. | 2013 HK | 1,802,532.03 | 8.12 |
| 2 | CanSino Biologics Inc. | 6185 HK | 1,604,397.46 | 7.23 |
| 3 | Yadea Group Holdings Ltd. | 1585 HK | 1,090,166.24 | 4.91 |
| 4 | Jiumaojiu International Holdings Limited | 9922 HK | 860,325.53 | 3.88 |
| 5 | CIFI Ever Sunshine Services Group Limited | 1995 HK | 797,580.85 | 3.59 |
| 6 | A-Living Smart City Services Co Ltd | 3319 HK | 745,631.59 | 3.36 |
| 7 | Hygeia Healthcare Holdings Co Ltd | 6078 HK | 629,207.56 | 2.84 |
| 8 | China Grand Pharmaceutical and Healthcare Holding Limited | 512 HK | 588,266.77 | 2.65 |
| 9 | COSCO SHIPPING Holdings Co.,Ltd. | 1919 HK | 470,007.25 | 2.12 |
| 10 | Huabao International Holdings Ltd. | 336 HK | 396,231.98 | 1.79 |
| 11 | Xinyi Energy Holdings Limited | 3868 HK | 391,241.35 | 1.76 |

| | | | | |
|----|---|---------|------------|------|
| 12 | Ak Medical Holdings Limited | 1789 HK | 367,141.49 | 1.65 |
| 13 | Sinotrans Limited | 598 HK | 347,682.96 | 1.57 |
| 14 | Angang Steel Company Limited | 347 HK | 328,097.02 | 1.48 |
| 15 | PAX Global Technology Limited | 327 HK | 304,335.42 | 1.37 |
| 16 | Chinasoft International Ltd. | 354 HK | 300,742.14 | 1.36 |
| 17 | Metallurgical Corporation of China Ltd. | 1618 HK | 300,041.21 | 1.35 |
| 18 | Venus Medtech (Hangzhou) Inc. | 2500 HK | 276,519.43 | 1.25 |
| 19 | Pharmaron Beijing Co Ltd | 3759 HK | 276,361.22 | 1.25 |
| 20 | Maanshan Iron & Steel Company Limited | 323 HK | 275,067.63 | 1.24 |

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

2.此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

| | |
|------------|---------------|
| 买入成本（成交）总额 | 46,031,344.69 |
| 卖出收入（成交）总额 | 27,035,454.78 |

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

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前

一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | 388,350.81 |
| 3 | 应收股利 | 391,368.81 |
| 4 | 应收利息 | 108.20 |
| 5 | 应收申购款 | 317,108.45 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,096,936.27 |

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 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 | 3800 HK | GCL-Poly Energy Holdings Limited | 1,746,369.50 | 3.84 | 重大事项停牌 |

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 | 持有份额 | 占总份 | |
| | | | | | | | |

| | | | | 额比例 | | 额比例 |
|---------------------------|-------|----------|------------|-------|---------------|---------|
| 易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）A | 4,186 | 5,955.61 | 832,632.87 | 3.34% | 24,097,538.60 | 96.66% |
| 易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）C | 2,092 | 3,255.83 | 0.00 | 0.00% | 6,811,196.71 | 100.00% |
| 合计 | 6,278 | 5,055.97 | 832,632.87 | 2.62% | 30,908,735.31 | 97.38% |

8.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额（份） | 占上市总份额比例 |
|----|--------------|------------|----------|
| 1 | 株洲结谷实业有限责任公司 | 767,235.00 | 38.61% |
| 2 | 赵伟 | 219,700.00 | 11.05% |
| 3 | 夏桂玉 | 152,900.00 | 7.69% |
| 4 | 贺雪芬 | 97,188.00 | 4.89% |
| 5 | 潘学文 | 68,500.00 | 3.45% |
| 6 | 邓丹娃 | 60,300.00 | 3.03% |
| 7 | 何华 | 60,000.00 | 3.02% |
| 8 | 宋协锦 | 48,188.00 | 2.42% |
| 9 | 魏瑞安 | 45,704.00 | 2.30% |
| 10 | 邵常红 | 44,400.00 | 2.23% |

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|---------------------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）A | 547.88 | 0.0022% |
| | 易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）C | 97.14 | 0.0014% |
| | 合计 | 645.02 | 0.0020% |

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）A | 易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）C |
|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
| 基金合同生效日（2016年11月2日）基金份额总额 | 399,318,394.11 | - |
| 本报告期期初基金份额总额 | 15,719,544.86 | 1,926,792.46 |
| 本报告期基金总申购份额 | 28,537,531.34 | 16,624,998.47 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 19,326,904.73 | 11,740,594.22 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 24,930,171.47 | 6,811,196.71 |

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于2021年1月23日发布公告，自2021年1月23日起聘任娄利舟女士担任公司副总经理级高级管理人员。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

报告期内，公司收到中国证券监督管理委员会广东监管局对公司及相关人员的监管措施。公司已及时按要求改正并报告。

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 | |
| CITIC Securities Brokerage (HK) Limited | 1 | 20,282,373.31 | 27.89% | 16,225.64 | 33.47% | - |
| China Merchants Securities (HK) Co Ltd | 1 | 5,324,415.05 | 7.32% | 4,259.35 | 8.78% | - |
| GF Securities (Hong Kong) Brokerage Limited | 1 | 13,047,011.36 | 17.94% | 6,523.61 | 13.45% | - |
| Shenyin Wanguo Securities HK Ltd | 1 | 508,883.68 | 0.70% | 407.11 | 0.84% | - |
| Haitong International | 1 | 14,311,332.24 | 19.68% | 11,448.97 | 23.61% | - |

| | | | | | | |
|---|---|---------------|--------|----------|--------|---|
| Securities Company Limited | | | | | | |
| Everbright Securities (International) Limited | 1 | 19,238,973.89 | 26.46% | 9,620.67 | 19.84% | - |
| Barclays Capital Securities Limited | 1 | - | - | - | - | - |
| Goldman Sachs | 1 | - | - | - | - | - |
| JP Morgan Securities Limited | 1 | - | - | - | - | - |
| State Street Securities Hong Kong Limited | 1 | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 高华证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 4 | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | 1 | - | - | - | - | - |
| 新时代证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 野村东方 | 1 | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 粤开证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 摩根大通 | 1 | - | - | - | - | - |

注：a) 本报告期内本基金无减少交易账户,新增交易单元的证券公司为摩根大通证券（中国）有限公司、太平洋证券股份有限公司、粤开证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司。

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

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

量的成交结果；

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

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

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

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

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

c) 基金交易账户的选择程序如下：

1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易账户的证券经营机构。

2) 基金管理人与所选定的证券经营机构办理开立交易账户事宜。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

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

| | | | | | | | | |
|--|---|---|---|---|---|---|---|---|
| (HK) Co Ltd | | | | | | | | |
| GF Secur ities (Hon g Kong) Brok erage Limit ed | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Shen yin Wang uo Secur ities HK Ltd | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Haito ng Inter natio nal Secur ities Com pany Limit ed | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Ever brigh t Secur ities (Inter natio nal) Limit ed | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Barcl ays | - | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Capital Securities Limited | | | | | | | | |
| Goldman Sachs | - | - | - | - | - | - | - | - |
| JP Morgan Securities Limited | - | - | - | - | - | - | - | - |
| State Street Securities Hong Kong Limited | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 高华证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 新时代证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 野村 | - | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | | | |
|----|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 东方 | | | | | | | | | |
| 银河 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 证券 | | | | | | | | | |
| 招商 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 证券 | | | | | | | | | |
| 浙商 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 证券 | | | | | | | | | |
| 中金 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 公司 | | | | | | | | | |
| 粤开 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 证券 | | | | | | | | | |
| 太平 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 洋证 | | | | | | | | | |
| 券 | | | | | | | | | |
| 摩根 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 大通 | | | | | | | | | |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|---|----------------------------|------------|
| 1 | 易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）恢复大额申购业务的公告 | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-01-05 |
| 2 | 易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加东方财富证券为销售机构的公告 | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-01-11 |
| 3 | 易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告 | 证券时报 | 2021-01-21 |
| 4 | 易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告 | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-01-23 |
| 5 | 易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加诺亚正行为销售机构的公告 | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-03-09 |
| 6 | 易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加中欧财富为销售机构的公告 | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-03-16 |
| 7 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改基金合同部分条款的公告 | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-03-30 |
| 8 | 易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年年度报告提示性公告 | 证券时报 | 2021-03-30 |

| | | | |
|----|--|----------------------------|------------|
| 9 | 易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）2021 年 4 月 2 日至 2021 年 4 月 6 日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告 | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-03-30 |
| 10 | 易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告 | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-04-02 |
| 11 | 易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告 | 证券时报 | 2021-04-19 |
| 12 | 易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）2021 年 5 月 19 日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告 | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-05-14 |
| 13 | 易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）暂停大额申购业务的公告 | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-05-27 |
| 14 | 易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）恢复大额申购业务的公告 | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-06-04 |
| 15 | 易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）2021 年 7 月 1 日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告 | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-06-28 |

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

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

11.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二一年八月二十八日