

大成恒生综合中小型股指数证券投资基金 (QDII-LOF) 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	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
§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.....	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	11
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	11
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
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	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	37
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	37

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	38
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	63
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
8.2 期末上市基金前十名持有人	63
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	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情况	64
§9 开放式基金份额变动	64
§10 重大事件揭示	65
10.1 基金份额持有人大会决议	65
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	65
10.4 基金投资策略的改变	65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	65
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	65
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	65
10.8 其他重大事件	68
§11 影响投资者决策的其他重要信息	69
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	69
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	69
§12 备查文件目录	69
12.1 备查文件目录	69
12.2 存放地点	69
12.3 查阅方式	69

§ 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 LOF	
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	8,190,595.82 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	7,766,154.65 份	424,441.17 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	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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.dcfund.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日-2021年6月30日)	
	恒生中小 A	恒生中小 C
本期已实现收益	736,381.02	17,828.47
本期利润	849,701.97	17,602.98
加权平均基金份额本期利润	0.0947	0.0509
本期加权平均净值利润率	7.96%	4.26%
本期基金份额净值增长率	9.08%	9.10%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)	
期末可供分配利润	1,749,336.94	94,682.42
期末可供分配基金份额利润	0.2253	0.2231
期末基金资产净值	9,515,491.59	519,123.59
期末基金份额净值	1.225	1.223
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	22.50%	23.54%

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
过去一个月	0.25%	0.77%	-1.08%	0.81%	1.33%	-0.04%
过去三个月	4.88%	0.89%	5.68%	0.95%	-0.80%	-0.06%
过去六个月	9.08%	1.45%	10.31%	1.51%	-1.23%	-0.06%
过去一年	23.74%	1.37%	40.67%	1.42%	-16.93%	-0.05%
过去三年	12.70%	1.36%	23.55%	1.39%	-10.85%	-0.03%
自基金合同生效起至今	22.50%	1.22%	40.40%	1.26%	-17.90%	-0.04%

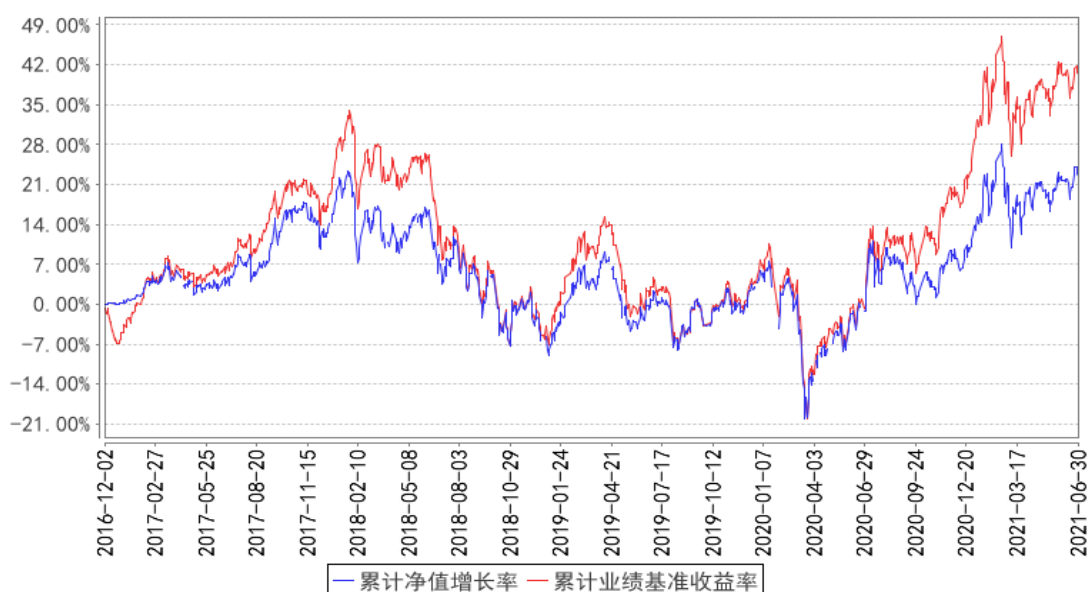
恒生中小 C

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
过去一个月	0.25%	0.77%	-1.08%	0.81%	1.33%	-0.04%
过去三个月	4.89%	0.89%	5.68%	0.95%	-0.79%	-0.06%

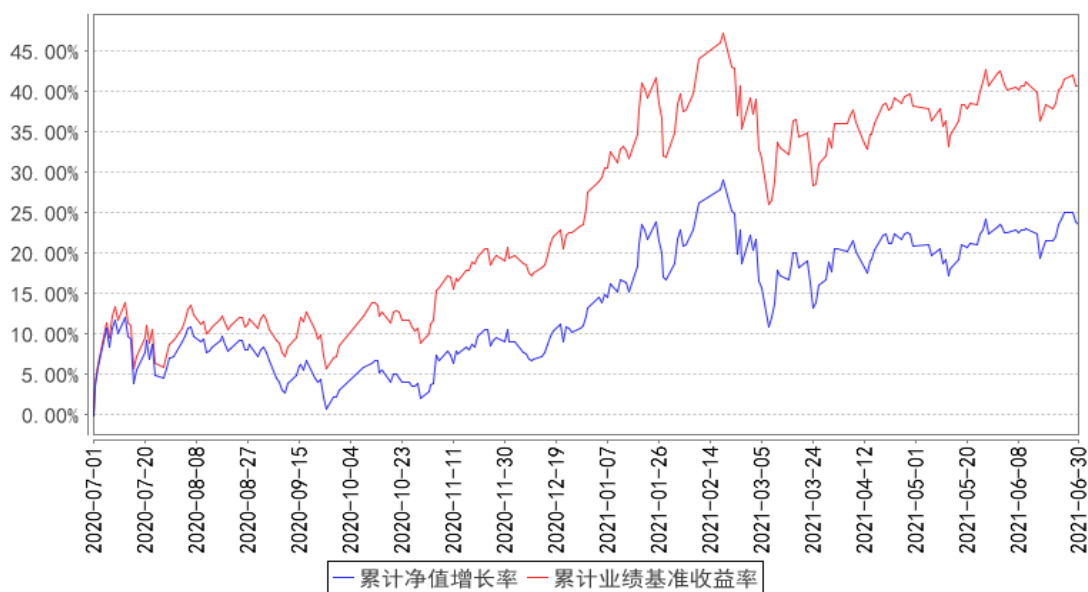
过去六个月	9.10%	1.44%	10.31%	1.51%	-1.21%	-0.07%
过去一年	23.54%	1.37%	40.67%	1.42%	-17.13%	-0.05%
自基金合同生效起至今	23.54%	1.37%	40.67%	1.42%	-17.13%	-0.05%

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

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。

§ 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2亿元人民币，注册地广东省深圳市。目前公司由三家股东组成，分别为中泰信托有限责任公司(50%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)。主要业务是公募基金的募集、销售和管理，还具有全国社保基金投资管理、基本养老保险投资管理、受托管理保险资金、保险保障基金投资管理、特定客户资产管理和QDII业务资格。

经过二十二年的稳健发展，公司形成了强大稳固的综合实力。公司旗下基金产品齐全、风格多样，构建了涵盖股票型基金、混合型基金、指数型基金、债券型基金和货币市场基金的完备产品线。截至2021年6月30日，本基金管理人共管理9只ETF及3只ETF联接基金，8只QDII基金及107只开放式证券投资基金。

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	-	18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。2021年5月18日起任大成恒生

					科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理。具有基金从业资格。 国籍：中国
--	--	--	--	--	---

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

无。

4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。基金管理人运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合间连续 4 个季度的日内、3 日内及 5 日内股票及债券交易同向交易价差进行分析。分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；部分股票同向交易溢价率较大主要来源于市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，即投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别些组合间的成交价格差异较大，但结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易不存在同日反向交易。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 2 笔同日反向交易，原因为流动性需要。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年上半年，多种新冠疫苗在发达国家推广接种，这使市场认为 2021 年发达国家的新冠疫情会逐步消除，未来疫情将不再是经济增长的显著拖累。因此，2021 年全球经济预计会加速成长。

港股市场上，大部分上市公司的主营业务收入都来自中国，代表着中国经济的发展状况，因此，中国经济增长将支撑港股的走势。

在 2021 年上半年，中国的疫情控制较佳，宏观经济也保持稳定增长。较好的宏观经济环境将会使得传统行业的企业盈利止跌回升，这将支持传统经济股票的上涨。

从新兴行业股票来看，中国科技巨头公司继续登陆港股市场，持续改变着港股的市场结构，使得港股市场的金融行业权重下降且科技行业权重大幅上升，有了更好的长期增长前景。

今年年初，港股的估值洼地被各类投资者发掘，各类资金也持续流入港股，这使得港股今年以来表现较佳，这也体现了宏观经济的稳健增长趋势，因此在 1 季度，恒生综合中小指数取得了明显的正增长。但是在 2 季度，恒生综合中小指数呈现区间震荡的格局，这也是市场在消化 1 季度涨幅的表现。

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 1.225 元，本报告期基金份额净值增长率为 9.08%，同期业绩比较基准收益率为 10.31%；截至本报告期末恒生中小 C 的基金份额净值为 1.223 元，本报告期基金份额净值增长率为 9.10%，同期业绩比较基准收益率为 10.31%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前港股估值合理，因此未来港股市场的走势主要由上市公司盈利水平决定。港股中以传统行业为代表的指数权重板块有望受益于企业盈利上行和估值修复，亦有望在一定程度上能够支撑指数表现。

此外，由于全球主要国家的货币当局都实行较为宽松的货币政策，致使全球的通货膨胀水平有所提高。较高的通货膨胀水平促使市场预期未来的货币政策有缩紧的可能性，而这种预期也有可能加大新兴市场股票的波动性。

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金在本报告期内，曾出现了连续 60 个工作日资产净值低于五千万元的情形。我公司

已根据法律法规及基金合同要求拟定相关应对方案上报中国证券监督管理委员会。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，大成基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）

报告截止日：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	6.4.3.1	695,216.60	4,425,841.05
结算备付金		-	-
存出保证金		-	274,706.89
交易性金融资产	6.4.3.2	9,341,649.45	12,734,610.93

其中：股票投资		9,341,649.45	12,734,610.93
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	464.88	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		72,091.00	-
应收利息	6.4.3.5	119.10	314.72
应收股利		82,652.90	10,841.36
应收申购款		6,523.69	6,046.75
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		10,198,717.62	17,452,361.70
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	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1.92	2,914,582.86
应付赎回款		74,078.65	386,653.33
应付管理人报酬		8,310.77	8,839.33
应付托管费		2,077.71	2,209.84
应付销售服务费		41.70	8.46
应付交易费用	6.4.3.7	1,105.56	3,318.94
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	78,486.13	85,935.41
负债合计		164,102.44	3,401,548.17
所有者权益：			
实收基金	6.4.3.9	8,190,595.82	12,514,572.14
未分配利润	6.4.3.10	1,844,019.36	1,536,241.39
所有者权益合计		10,034,615.18	14,050,813.53
负债和所有者权益总计		10,198,717.62	17,452,361.70

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 8,190,595.82 份，其中恒生中小 A 基金份额总额为 7,766,154.65 份，基金份额净值 1.225 元。恒生中小 C 基金份额总额为 424,441.17 份，基金份额净值 1.223 元。

6.2 利润表

会计主体：大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）

本报告期：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	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
一、收入		1,061,565.84	-234,882.25
1. 利息收入		4,724.41	3,756.01
其中：存款利息收入	6.4.3.11	4,724.41	3,756.01
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）		932,357.26	-104,414.00
其中：股票投资收益	6.4.3.12	806,526.08	-298,218.93
基金投资收益	6.4.3.13	-	-
债券投资收益	6.4.3.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.3.15	-	-
衍生工具收益	6.4.3.16	-	-
股利收益	6.4.3.17	125,831.18	193,804.93
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.18	113,095.46	-127,079.62
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-750.88	-11,864.75
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.19	12,139.59	4,720.11
减：二、费用		194,260.89	192,481.62
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	55,477.70	62,281.09
2. 托管费	6.4.6.2.2	13,869.39	15,570.24
3. 销售服务费		204.95	-
4. 交易费用	6.4.3.20	18,285.62	14,364.19
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.3.21	106,423.23	100,266.10

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		867,304.95	-427,363.87
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		867,304.95	-427,363.87

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）

本报告期：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）	12,514,572.14	1,536,241.39	14,050,813.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	867,304.95	867,304.95
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）	-4,323,976.32	-559,526.98	-4,883,503.30
其中：1. 基金申购款	4,584,943.66	918,462.16	5,503,405.82
2. 基金赎回款	-8,908,919.98	-1,477,989.14	-10,386,909.12
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）	8,190,595.82	1,844,019.36	10,034,615.18
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）	14,617,901.20	626,432.05	15,244,333.25
二、本期经营活	-	-427,363.87	-427,363.87

动产生的基金净值变动数（本期净利润）			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-2,433,817.96	-317,740.63	-2,751,558.59
其中：1. 基金申购款	4,709,763.11	-446,164.82	4,263,598.29
2. 基金赎回款	-7,143,581.07	128,424.19	-7,015,156.88
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	12,184,083.24	-118,672.45	12,065,410.79

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

谭晓冈

周立新

刘亚林

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号

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

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

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

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

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

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	695,216.60
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	695,216.60
----	------------

注：于本期末，活期存款中包括的外币余额为港币活期存款 138,889.10 元，折合人民币 115,566.84 元。

6.4.3.2 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	8,744,396.97	9,341,649.45	597,252.48
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	8,744,396.97	9,341,649.45	597,252.48

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	464.88	-	-
合计	-	464.88	-	-

6.4.3.4 买入返售金融资产

6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	119.10
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	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	119.10

6.4.3.6 其他资产

无。

6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,105.56
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,105.56

6.4.3.8 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	165.56
应付证券出借违约金	-
预提费用	49,588.57
应付指数使用费	28,732.00

合计	78,486.13
----	-----------

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

恒生中小 A

项目	本期 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	12,441,541.43	12,441,541.43
本期申购	3,746,196.99	3,746,196.99
本期赎回(以“-”号填列)	-8,421,583.77	-8,421,583.77
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	7,766,154.65	7,766,154.65

恒生中小 C

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	73,030.71	73,030.71
本期申购	838,746.67	838,746.67
本期赎回(以“-”号填列)	-487,336.21	-487,336.21
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	424,441.17	424,441.17

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

6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

恒生中小 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,379,516.52	-2,852,136.34	1,527,380.18
本期利润	736,381.02	113,320.95	849,701.97
本期基金份额交易产生的变动数	-1,772,085.10	1,144,339.89	-627,745.21
其中：基金申购款	1,475,098.46	-716,326.62	758,771.84
基金赎回	-3,247,183.56	1,860,666.51	-1,386,517.05

回款			
本期已分配利润			
本期末	3,343,812.44	-1,594,475.50	1,749,336.94

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	568,391.66	-559,530.45	8,861.21
本期利润	17,828.47	-225.49	17,602.98
本期基金份额交易产生的变动数	2,749,920.54	-2,681,702.31	68,218.23
其中：基金申购款	6,570,819.07	-6,411,128.75	159,690.32
基金赎回款	-3,820,898.53	3,729,426.44	-91,472.09
本期已分配利润			
本期末	3,336,140.67	-3,241,458.25	94,682.42

6.4.3.11 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	4,147.77
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	458.53
其他	118.11
合计	4,724.41

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

6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	6,445,903.03
减：卖出股票成本总额	5,639,376.95
买卖股票差价收入	806,526.08

6.4.3.13 基金投资收益

无。

6.4.3.14 债券投资收益

无。

6.4.3.15 贵金属投资收益

无。

6.4.3.16 衍生工具收益**6.4.3.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无。

6.4.3.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.3.17 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	125,831.18
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	125,831.18

6.4.3.18 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	112,630.58
股票投资	112,630.58
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	464.88

权证投资	464.88
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	113,095.46

6.4.3.19 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	12,139.59
合计	12,139.59

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

6.4.3.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	18,285.62
银行间市场交易费用	-
合计	18,285.62

6.4.3.21 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	19,835.79
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行划款手续费	693.92
指数使用费	45,672.00
上市费	29,752.78
其他	10,468.74
合计	106,423.23

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

6.4.3.22 分部报告

无。

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

无。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.5 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司（“大成基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
摩根大通银行（“摩根大通银行”）	境外资产托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

无。

6.4.6.1.2 债券交易

无。

6.4.6.1.3 债券回购交易

无。

6.4.6.1.4 基金交易

无。

6.4.6.1.5 权证交易

无。

6.4.6.1.6 应支付关联方的佣金

无。

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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
当期发生的基金应支付的管理费	55,477.70	62,281.09
其中：支付销售机构的客户维护费	22,121.57	26,332.39

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.00% / 当年天数。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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
当期发生的基金应支付的托管费	13,869.39	15,570.24

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.6.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.6.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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
摩根大通银行	115,672.55	-	245,895.07	-
中国农业银行	579,544.05	4,093.55	1,075,683.97	3,203.87

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

6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.7 利润分配情况

无。

6.4.8 期末(2021年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复牌 日期	复牌 开盘 单价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
1019 HK	康宏环球 (已退市)	2017-12-7	已退市	0.01	不适用	不适用	270,000	50,157.33	2,246.62	-
1114 HK	BRILLIANCE CHI	2021-3-30	重大事项	6.07	未知	未知	8,000	43,297.70	48,593.47	-
1131 HK	鸿宝资源	2020-6-30	重大事项	0.07	未知	未知	10,000	5,212.46	690.63	-
1219 HK	天喔国际 (已退市)	2018-8-10	已退市	0.32	不适用	不适用	8,000	12,153.81	2,529.52	-
1236 HK	国农控股 (已退市)	2017-3-27	已退市	0.02	不适用	不适用	46,000	71,262.08	989.43	-
1363 HK	中滔环保	2019-3-29	重大事项	0.28	未知	未知	16,000	22,603.95	4,526.52	-
1573 HK	南方能源	2020-3-31	重大事项	0.57	未知	未知	2,000	1,599.69	1,131.63	-
1886 HK	汇源果汁 (已退市)	2018-3-29	已退市	0.00	不适用	不适用	10,000	23,658.22	0.83	-
198 HK	星美控股 (已退市)	2018-8-31	已退市	0.00	不适用	不适用	8,800	27,579.69	7.32	-
2662 HK	美好发展	2019-7-18	重大事项	0.97	未知	未知	2,000	11,395.92	1,930.43	-
2799 HK	中国华融	2021-3-31	重大事项	0.85	未知	未知	25,000	21,363.66	21,218.04	-
3800 HK	保利协鑫 能源	2021-3-31	重大事项	1.65	未知	未知	43,000	43,953.45	70,843.29	-

6863	HK	辉山乳业 (已退市)	2017-3-24	已退市	0.01	不适用	不适用	212,000	538,969.89	1,764.01	-
699	HK	神州租车	2021-6-23	重大事项	3.31	未知	未知	2,000	4,999.49	6,623.36	1

注：1. 由 2021 年 7 月 8 日上午 9 时起，神州租车有限公司股份（699 HK）的上市地位将根据除牌程序予以取消。

2. 除神州租车（669 HK）及其他上述已退市股票外，本基金截至本期末止持有因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以由高层监控（合规与风险管理委员会、公司投资风险控制委员会）、专业监控（监察稽核部、风险管理部）、部门互控、岗位自控构成

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.9.2 信用风险

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

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

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

于本期末，本基金无债券投资（上年度末：同）。

6.4.9.3 流动性风险

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

6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式

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

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

6.4.9.4 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。

6.4.9.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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

6.4.9.4.1.1 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	579,544.05	-	-	115,672.55	695,216.60
交易性金融资产	-	-	-	9,341,649.45	9,341,649.45
衍生金融资产	-	-	-	464.88	464.88
应收利息	-	-	-	119.10	119.10
应收股利	-	-	-	82,652.90	82,652.90
应收申购款	-	-	-	6,523.69	6,523.69
应收证券清算款	-	-	-	72,091.00	72,091.00
资产总计	579,544.05	-	-	9,619,173.57	10,198,717.62
负债					
应付赎回款	-	-	-	74,078.65	74,078.65
应付管理人报酬	-	-	-	8,310.77	8,310.77
应付托管费	-	-	-	2,077.71	2,077.71
应付证券清算款	-	-	-	1.92	1.92
应付销售服务费	-	-	-	41.70	41.70
应付交易费用	-	-	-	1,105.56	1,105.56
其他负债	-	-	-	78,486.13	78,486.13
负债总计	-	-	-	164,102.44	164,102.44
利率敏感度缺口	579,544.05	-	-	9,455,071.13	10,034,615.18
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	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

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

6.4.9.4.1.2 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)。

6.4.9.4.2 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。

6.4.9.4.2.1 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 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	108.53	115,566.84	-	115,675.37
交易性金融资产	-	9,341,649.45	-	9,341,649.45
衍生金融资产	-	464.88	-	464.88
应收股利	-	2,725.47	-	2,725.47
应收证券清算 款	-	68,284.55	-	68,284.55
资产合计	108.53	9,528,691.19	-	9,528,799.72
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净 额	108.53	9,528,691.19	-	9,528,799.72
项目	上年度末 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

6.4.9.4.2.2 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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	港币相对人民币升值 5%	476,434.54	653,655.77
	港币相对人民币贬值 5%	-476,434.58	-653,655.77

6.4.9.4.3 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量化风险管理手段，实现基金投资组合对标的指数的有效跟踪，追求跟踪误差最小化。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%，投资于以标的指数为跟踪标的的公募基金、上市交易型

基金、结构性产品的比例不超过基金资产净值的 10%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.9.4.3.1 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	9,341,649.45	93.09	12,734,610.93	90.63
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	464.88	0.00	—	—
其他	—	—	—	—
合计	9,342,114.33	93.10	12,734,610.93	90.63

6.4.9.4.3.2 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 (2021 年 6 月 30 日)	上年度末 (2020 年 12 月 31 日)	
分析	业绩比较基准上升 5%	447,523.21	624,804.03
	业绩比较基准下降 5%	-447,523.21	-624,804.03

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	9,341,649.45	91.60
	其中：普通股	9,341,649.45	91.60
	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	464.88	0.00
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	464.88	0.00
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	695,216.60	6.82
8	其他各项资产	161,386.69	1.58
9	合计	10,198,717.62	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 8,736,147.34 元，占期末基金资产净值的比例为 87.06%。

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	9,341,649.45	93.09
合计	9,341,649.45	93.09

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

7.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
金融	819,813.46	8.17
通信服务	345,963.89	3.45
房地产	1,131,481.56	11.28

能源	107,305.04	1.07
公用事业	279,237.72	2.78
非日常生活消费品	1,576,843.19	15.71
工业	1,533,965.01	15.29
日常消费品	300,468.26	2.99
信息技术	932,354.78	9.29
医疗保健	1,664,430.34	16.59
原材料	610,017.83	6.08
合计	9,301,881.08	92.70

注：以上分类采用全球行业分类标准 (GICS)。

7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
金融	2,246.62	0.02
通信服务	7.32	-
房地产	-	-
能源	1,822.26	0.02
公用事业	-	-
非日常生活消费品	17,328.07	0.17
工业	11,149.88	0.11
日常消费品	4,294.36	0.04
信息技术	2,919.86	0.03
医疗保健	-	-
原材料	-	-
合计	39,768.37	0.40

注：以上分类采用全球行业分类标准 (GICS)。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

7.4.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家 (地区)	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	Innovent Biologics Inc	信达生物	1801 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	226,034.53	2.25
2	Xinyi Glass Holdings Ltd	信义玻璃	868 H K	香港联合交易所	中国香港	6,000	158,011.99	1.57
3	Great Wall Motor Co Ltd	长城汽车	2333 HK	香港联合交易所	中国香港	7,500	156,639.06	1.56
4	Tsingtao Brewery	青岛啤酒	168 H	香港联合交易所	中国	2,000	139,123.78	1.39

	Co Ltd	酒	K	交易所	香港			
5	Kingdee International Software Group Co Ltd	金蝶国际	268 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	131,551.85	1.31
6	Haier Smart Home Co Ltd	海尔智家	6690 HK	香港联合交易所	中国香港	5,400	121,766.59	1.21
7	Zijin Mining Group Co Ltd	紫金矿业	2899 HK	香港联合交易所	中国香港	14,000	121,616.81	1.21
8	Shandong Weigao Group Medical Polymer Co Ltd	威高股份	1066 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	120,618.32	1.20
9	Microport Scientific Corp	微创医疗	853 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	115,908.74	1.16
10	WuXi AppTec Co Ltd	药明康德	2359 HK	香港联合交易所	中国香港	768	115,857.49	1.15
11	China Conch Venture Holdings Ltd	海螺创业	586 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	108,836.06	1.08
12	COSCO SHIPPING Holdings Co Ltd	中远海控	1919 HK	香港联合交易所	中国香港	6,500	105,790.65	1.05
13	ESR Cayman Ltd	ESR 开曼有限公司	1821 HK	香港联合交易所	中国香港	4,400	95,922.18	0.96
14	CITIC Securities Co Ltd	中信证券	6030 HK	香港联合交易所	中国香港	5,500	89,149.05	0.89
15	China Longyuan Power Group Corp Ltd	龙源电力	916 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	89,065.84	0.89
16	China Vanke Co Ltd	万科	2202 HK	香港联合交易所	中国香港	4,400	88,965.99	0.89
17	China Literature Ltd	阅文集团	772 HK	香港联合交易所	中国香港	1,200	86,220.13	0.86
18	BYD Electronic International Co Ltd	比亚迪电子	285 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	84,872.16	0.85
19	SITC International Holdings Co Ltd	海丰国际	1308 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	81,002.99	0.81
20	Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co Ltd	复星医药	2196 HK	香港联合交易所	中国香港	1,500	78,257.12	0.78
21	Kingsoft Corp Ltd	金山软件	3888 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	77,466.65	0.77

22	China National Building Material Co Ltd	中国建材	3323 HK	香港联合交易所	中国香港	10,000	75,885.70	0.76
23	Weichai Power Co Ltd	潍柴动力	2338 HK	香港联合交易所	中国香港	5,000	71,808.50	0.72
24	Kingboard Holdings Ltd	建滔集团	148 H K	香港联合交易所	中国香港	2,000	71,725.30	0.71
25	GCL-Poly Energy Holdings Ltd	保利协鑫能源	3800 HK	香港联合交易所	中国香港	43,000	70,843.29	0.71
26	Chinasoft International Ltd	中国软件国际	354 H K	香港联合交易所	中国香港	6,000	70,693.52	0.70
27	China Meidong Auto Holdings Ltd	美东汽车	1268 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	70,477.18	0.70
28	ASM Pacific Technology Ltd	ASM PACIFIC	522 H K	香港联合交易所	中国香港	800	70,027.85	0.70
29	CanSino Biologics Inc	康希诺生物股份公司	6185 HK	香港联合交易所	中国香港	200	68,663.24	0.68
30	China Telecom Corp Ltd	中国电信	728 H K	香港联合交易所	中国香港	28,000	67,797.88	0.68
31	Jinxin Fertility Group Ltd	锦欣生殖	1951 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	65,235.07	0.65
32	JS Global Lifestyle Co Ltd	JS 环球生活	1691 HK	香港联合交易所	中国香港	3,500	63,633.32	0.63
33	China International Capital Corp Ltd	中金公司	3908 HK	香港联合交易所	中国香港	3,600	62,605.70	0.62
34	ZhongAn Online P&C Insurance Co Ltd	众安在线	6060 HK	香港联合交易所	中国香港	1,700	62,168.86	0.62
35	Sinopharm Group Co Ltd	国药控股	1099 HK	香港联合交易所	中国香港	3,200	61,507.35	0.61
36	Minth Group Ltd	敏实集团	425 H K	香港联合交易所	中国香港	2,000	61,407.50	0.61
37	Hopson Development Holdings Ltd	合生创展集团	754 H K	香港联合交易所	中国香港	2,000	59,244.10	0.59
38	Weimob Inc	微盟集团	2013 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	56,980.84	0.57
39	Zai Lab Ltd	再鼎医药	9688 HK	香港联合交易所	中国香港	50	56,747.86	0.57
40	Genscript Biotech Corp	金斯瑞生物科技	1548 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	56,415.02	0.56

41	Man Wah Holdings Ltd	敏华控股	1999 HK	香港联合交易所	中国香港	3,600	55,895.81	0.56
42	Fuyao Glass Industry Group Co Ltd	福耀玻璃	3606 HK	香港联合交易所	中国香港	1,200	54,617.73	0.54
43	Akeso Inc	康方生物	9926 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	52,129.81	0.52
44	Pharmaron Beijing Co Ltd	康龙化成	3759 HK	香港联合交易所	中国香港	300	51,672.17	0.51
45	Hysan Development Co Ltd	希慎兴业	14 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	51,505.75	0.51
46	China Medical System Holdings Ltd	康哲药业	867 H K	香港联合交易所	中国香港	3,000	51,048.11	0.51
47	Hygeia Healthcare Holdings Co Ltd	海吉亚医疗	6078 HK	香港联合交易所	中国香港	600	50,923.30	0.51
48	CIFI Holdings Group Co Ltd	旭辉控股集团	884 H K	香港联合交易所	中国香港	10,000	50,424.05	0.50
49	Zhuzhou CRRC Times Electric Co Ltd	中车时代电气	3898 HK	香港联合交易所	中国香港	1,300	49,650.21	0.49
50	Brilliance China Automotive Holdings Ltd	BRILLIANCE CHI	1114 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	48,593.47	0.48
51	Vitasoy International Holdings Ltd	VITASOY INT'L	345 H K	香港联合交易所	中国香港	2,000	48,011.02	0.48
52	China Lesso Group Holdings Ltd	中国联塑	2128 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	47,827.96	0.48
53	China Jinmao Holdings Group Ltd	中国金茂	817 H K	香港联合交易所	中国香港	22,000	47,594.98	0.47
54	Dongfeng Motor Group Co Ltd	东风集团股份	489 H K	香港联合交易所	中国香港	8,000	46,463.35	0.46
55	China Minsheng Banking Corp Ltd	民生银行	1988 HK	香港联合交易所	中国香港	15,000	46,430.06	0.46
56	Tongcheng-Elong Holdings Ltd	同程艺龙	780 H K	香港联合交易所	中国香港	2,800	45,291.78	0.45
57	Samsonite International SA	新秀丽	1910 HK	香港联合交易所	中国香港	3,400	44,925.66	0.45
58	New China Life Insurance Co L	新华保险	1336 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	44,100.24	0.44

	td							
59	Swire Pacific Ltd	太古股份有限公司	19 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	43,809.01	0.44
60	Haitian International Holdings Ltd	海天国际	1882 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	43,351.37	0.43
61	People's Insurance Co Group of China Ltd/The	中国人保	1339 HK	香港联合交易所	中国香港	20,000	43,101.74	0.43
62	Haitong Securities Co Ltd	海通证券	6837 HK	香港联合交易所	中国香港	7,600	43,001.89	0.43
63	Topsports International Holdings Ltd	滔搏	6110 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	42,336.23	0.42
64	Yum China Holdings Inc	百胜中国	9987 HK	香港联合交易所	中国香港	100	42,144.85	0.42
65	Guangzhou Automobile Group Co Ltd	广汽集团	2238 HK	香港联合交易所	中国香港	7,200	41,757.10	0.42
66	Nine Dragons Paper Holdings Ltd	玖龙纸业	2689 HK	香港联合交易所	中国香港	5,000	41,437.58	0.41
67	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	41,354.38	0.41
68	Far East Horizon Ltd	远东宏信	3360 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	40,538.94	0.40
69	China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd	永达汽车	3669 HK	香港联合交易所	中国香港	3,500	40,480.69	0.40
70	A-Living Smart City Services Co Ltd	雅生活服务	3319 HK	香港联合交易所	中国香港	1,250	40,199.87	0.40
71	Greentown Service Group Co Ltd	绿城服务	2869 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	40,139.54	0.40
72	Jiangxi Copper Co Ltd	江西铜业	358 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	39,690.22	0.40
73	China Coal Energy Co Ltd	中煤能源	1898 HK	香港联合交易所	中国香港	10,000	38,525.30	0.38
74	Aluminum Corp of China Ltd	中国铝业	2600 HK	香港联合交易所	中国香港	10,000	38,525.30	0.38
75	Huatai Securities Co Ltd	华泰证券	6886 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	37,942.85	0.38
76	China Merchants	招商局	144 H	香港联合交易所	中国	4,000	37,743.15	0.38

	Port Holdings Co Ltd	港口	K	交易所	香港			
77	CGN Power Co Ltd	中国广核	1816 HK	香港联合交易所	中国香港	26,000	37,426.96	0.37
78	Bosideng International Holdings Ltd	波司登	3998 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	36,944.35	0.37
79	China Resources Cement Holdings Ltd	华润水泥控股	1313 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	36,844.50	0.37
80	Seazen Group Ltd	新城发展	1030 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	36,744.65	0.37
81	Xtep International Holdings Ltd	特步国际	1368 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	36,544.95	0.36
82	ZTE Corp	中兴通讯	763 HK	香港联合交易所	中国香港	1,800	36,320.29	0.36
83	Kingboard Laminates Holdings Ltd	建滔积层板	1888 HK	香港联合交易所	中国香港	2,500	36,237.08	0.36
84	Hua Hong Semiconductor Ltd	华虹半导体	1347 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	35,696.23	0.36
85	China Traditional Chinese Medicine Holdings Co Ltd	中国中药	570 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	35,413.32	0.35
86	China Hongqiao Group Ltd	中国宏桥	1378 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	35,013.93	0.35
87	Yanzhou Coal Mining Co Ltd	兖州煤业	1171 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	34,747.66	0.35
88	China Overseas Property Holdings Ltd	中海物业	2669 HK	香港联合交易所	中国香港	5,000	34,531.32	0.34
89	China Molybdenum Co Ltd	洛阳钼业	3993 HK	香港联合交易所	中国香港	9,000	34,523.00	0.34
90	China Communications Construction Co Ltd	中国交建	1800 HK	香港联合交易所	中国香港	11,000	34,506.36	0.34
91	Lifetech Scientific Corp	先健科技	1302 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	34,281.70	0.34
92	XD Inc	心动公司	2400 HK	香港联合交易所	中国香港	600	34,198.49	0.34
93	PCCW Ltd	电讯盈科	8 HK	香港联合交易所	中国香港	10,000	33,865.66	0.34
94	China Railway Gr	中国中	390 HK	香港联合	中国	10,000	33,699.24	0.34

	oup Ltd	铁	K	交易所	香港			
95	HengTen Networks Group Ltd	恒腾网络	136 HK	香港联合交易所	中国香港	6,400	33,070.19	0.33
96	Hang Lung Group Ltd	恒隆集团	10 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	32,950.37	0.33
97	China Galaxy Securities Co Ltd	中国银河	6881 HK	香港联合交易所	中国香港	8,500	32,746.51	0.33
98	CIFI Ever Sunshine Services Group Ltd	永升生活服务	1995 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	32,085.00	0.32
99	Kerry Properties Ltd	嘉里建设	683 HK	香港联合交易所	中国香港	1,500	31,951.87	0.32
100	3SBio Inc	三生制药	1530 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	31,951.87	0.32
101	Yue Yuen Industrial Holdings Ltd	裕元集团	551 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	31,918.59	0.32
102	China Everbright Bank Co Ltd	光大银行	6818 HK	香港联合交易所	中国香港	12,000	31,652.32	0.32
103	CRRC Corp Ltd	中国中车	1766 HK	香港联合交易所	中国香港	11,000	31,394.38	0.31
104	Pacific Basin Shipping Ltd	太平洋航运	2343 HK	香港联合交易所	中国香港	12,000	31,252.92	0.31
105	Huabao International Holdings Ltd	华宝国际	336 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	31,153.08	0.31
106	KWG Group Holdings Ltd	合景泰富集团	1813 HK	香港联合交易所	中国香港	3,500	30,287.71	0.30
107	Peijia Medical Ltd	沛嘉医疗	9996 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	30,079.69	0.30
108	AviChina Industry & Technology Co Ltd	中航科工	2357 HK	香港联合交易所	中国香港	7,000	29,938.24	0.30
109	Guangzhou R&F Properties Co Ltd	富力地产	2777 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	29,488.92	0.29
110	Kerry Logistics Network Ltd	嘉里物流	636 HK	香港联合交易所	中国香港	1,500	29,393.23	0.29
111	Beijing Enterprises Water Group Ltd	北控水务集团有限公司	371 HK	香港联合交易所	中国香港	12,000	29,355.78	0.29
112	China Everbright Environment G	光大环境	257 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	29,289.22	0.29

	roup Ltd							
113	Jiangsu Expressway Co Ltd	宁沪高速	177 H K	香港联合交易所	中国香港	4,000	29,255.93	0.29
114	China Education Group Holdings Ltd	中教控股	839 H K	香港联合交易所	中国香港	2,000	28,823.25	0.29
115	Air China Ltd	中国国航	753 H K	香港联合交易所	中国香港	6,000	28,507.06	0.28
116	Shanghai Pharmaceuticals Holding Co Ltd	上海医药	2607 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	28,224.15	0.28
117	TravelSky Technology Ltd	中国民航信息网络	696 H K	香港联合交易所	中国香港	2,000	27,891.32	0.28
118	Yadea Group Holdings Ltd	雅迪控股	1585 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	27,791.47	0.28
119	Sihuan Pharmaceutical Holdings Group Ltd	四环医药	460 H K	香港联合交易所	中国香港	10,000	27,625.06	0.28
120	NWS Holdings Ltd	新创建集团	659 H K	香港联合交易所	中国香港	4,000	27,491.92	0.27
121	BOC Aviation Ltd	中银航空租赁	2588 HK	香港联合交易所	中国香港	500	27,250.62	0.27
122	VTech Holdings Ltd	VTECH HOLDINGS	303 H K	香港联合交易所	中国香港	400	27,209.02	0.27
123	China Cinda Asset Management Co Ltd	中国信达	1359 HK	香港联合交易所	中国香港	22,000	27,092.52	0.27
124	Alibaba Pictures Group Ltd	阿里影业	1060 HK	香港联合交易所	中国香港	30,000	26,959.39	0.27
125	Venus MedTech Hangzhou Inc	启明医疗	2500 HK	香港联合交易所	中国香港	500	26,938.59	0.27
126	Shenzhen International Holdings Ltd	深圳国际	152 H K	香港联合交易所	中国香港	3,000	26,809.62	0.27
127	GF Securities Co Ltd	广发证券	1776 HK	香港联合交易所	中国香港	3,200	26,786.32	0.27
128	Jiumaojiu International Holdings Ltd	九毛九	9922 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	26,418.54	0.26
129	Sany Heavy Equipment International Holdings Co	三一国际	631 H K	香港联合交易所	中国香港	4,000	26,193.88	0.26

	Ltd							
130	Shangri-La Asia Ltd	香格里拉（亚洲）	69 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	25,295.23	0.25
131	China Merchants Securities Co Ltd	招商证券	6099 HK	香港联合交易所	中国香港	2,800	25,162.10	0.25
132	Razer Inc	雷蛇	1337 HK	香港联合交易所	中国香港	14,000	24,579.64	0.24
133	Yuexiu Property Co Ltd	越秀地产	123 HK	香港联合交易所	中国香港	3,600	24,503.09	0.24
134	China Grand Pharmaceutical and Healthcare Holdings Ltd	远大医药	512 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	24,163.60	0.24
135	Melco International Development Ltd	新濠国际发展	200 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	23,730.92	0.24
136	China Yuhua Education Corp Ltd	宇华教育	6169 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	23,398.09	0.23
137	China Oilfield Services Ltd	中海油服	2883 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	23,165.11	0.23
138	SSY Group Ltd	石四药集团	2005 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	23,098.54	0.23
139	Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co Ltd	中联重科	1157 HK	香港联合交易所	中国香港	3,400	23,000.36	0.23
140	Zhejiang Expressway Co Ltd	浙江沪杭甬	576 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	22,998.69	0.23
141	AK Medical Holdings Ltd	爱康医疗	1789 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	22,798.99	0.23
142	Tianneng Power International Ltd	天能动力	819 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	22,599.29	0.23
143	Luk Fook Holdings International Ltd	六福集团	590 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	22,299.74	0.22
144	Powerlong Real Estate Holdings Ltd	宝龙地产	1238 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	22,199.89	0.22
145	Uni-President China Holdings Ltd	统一企业中国	220 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	21,392.78	0.21

146	China Railway Construction Corp Ltd	中国铁建	1186 HK	香港联合交易所	中国香港	5,000	21,342.85	0.21
147	China Huarong Asset Management Co Ltd	中国华融	2799 HK	香港联合交易所	中国香港	25,000	21,218.04	0.21
148	Sinotruk Hong Kong Ltd	中国重汽	3808 HK	香港联合交易所	中国香港	1,500	20,768.72	0.21
149	Huaneng Power International Inc	华能国际	902 H K	香港联合交易所	中国香港	8,000	20,236.19	0.20
150	COSCO SHIPPING Ports Ltd	中远海运港口有限公司	1199 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	20,169.62	0.20
151	GOME Retail Holdings Ltd	国美零售	493 H K	香港联合交易所	中国香港	24,000	19,969.92	0.20
152	Vinda International Holdings Ltd	维达国际	3331 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	19,886.71	0.20
153	HKBN Ltd	香港宽频	1310 HK	香港联合交易所	中国香港	2,500	19,553.88	0.19
154	Ascentage Pharmaceutical Group International	亚盛医药	6855 HK	香港联合交易所	中国香港	500	19,553.88	0.19
155	China Communications Services Corp Ltd	中国通信服务股份有限公司	552 H K	香港联合交易所	中国香港	6,000	19,370.82	0.19
156	Luye Pharmaceutical Group Ltd	绿叶制药	2186 HK	香港联合交易所	中国香港	4,500	19,133.68	0.19
157	Xinjiang Goldwind Science & Technology Co Ltd	金风科技	2208 HK	香港联合交易所	中国香港	1,880	18,990.73	0.19
158	Realord Group Holdings Ltd	伟禄集团	1196 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	18,938.14	0.19
159	Fu Shou Yuan International Group Ltd	福寿园	1448 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	18,921.50	0.19
160	Zhaojin Mining Industry Co Ltd	招金矿业	1818 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	18,422.25	0.18
161	Shandong Gold Mining Co Ltd	山东黄金	1787 HK	香港联合交易所	中国香港	1,600	18,292.45	0.18

162	Swire Pacific Ltd	太古股份公司	87 HK	香港联合交易所	中国香港	2,500	18,160.15	0.18
163	Zhenro Properties Group Ltd	正荣地产	6158 HK	香港联合交易所	中国香港	5,000	18,056.14	0.18
164	Nexteer Automotive Group Ltd	耐世特	1316 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	17,972.93	0.18
165	China State Construction International Holdings Ltd	中国建筑国际	3311 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	17,640.10	0.18
166	Poly Property Services Co Ltd	保利物业服务股份有限公司	6049 HK	香港联合交易所	中国香港	400	17,540.25	0.17
167	SOHO China Ltd	SOHO中国	410 HK	香港联合交易所	中国香港	5,000	17,348.87	0.17
168	Ausnutria Dairy Corp Ltd	澳优	1717 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	17,307.26	0.17
169	Beijing Capital International Airport Co Ltd	北京首都机场股份	694 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	17,140.85	0.17
170	IGG Inc	IGG	799 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	17,074.28	0.17
171	Legend Holdings Corp	联想控股	3396 HK	香港联合交易所	中国香港	1,600	16,987.75	0.17
172	Agile Group Holdings Ltd	雅居乐集团	3383 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	16,741.45	0.17
173	Johnson Electric Holdings Ltd	德昌电机控股	179 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	16,683.20	0.17
174	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	16,608.32	0.17
175	Guotai Junan Securities Co Ltd	国泰君安	2611 HK	香港联合交易所	中国香港	1,800	16,535.09	0.16
176	China Aoyuan Group Ltd	中国奥园	3883 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	16,350.37	0.16
177	Yeahka Ltd	移卡	9923 HK	香港联合交易所	中国香港	400	16,258.84	0.16
178	Dongyue Group Ltd	东岳集团	189 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	16,225.56	0.16
179	China Southern Airlines Co Ltd	南方航空	1055 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	16,042.50	0.16
180	Genertec Universal Medical Group	环球医疗	2666 HK	香港联合交易所	中国香港	2,500	15,788.72	0.16

	p Co Ltd							
181	China Resources Medical Holdings Co Ltd	华润医疗	1515 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	15,693.03	0.16
182	CSC Financial Co Ltd	中信建投	6066 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	15,659.75	0.16
183	Zhou Hei Ya International Holdings Co Ltd	周黑鸭	1458 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	15,493.33	0.15
184	Xinyi Energy Holdings Ltd	信义能源	3868 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	15,410.12	0.15
185	Chongqing Rural Commercial Bank Co Ltd	渝农商行	3618 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	15,326.91	0.15
186	China East Education Holdings Ltd	中国东方教育	667 HK	香港联合交易所	中国香港	1,500	15,227.06	0.15
187	China Everbright Ltd	中国光大控股	165 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	15,210.42	0.15
188	China Overseas Grand Oceans Group Ltd	中国海外宏洋集团	81 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	15,044.01	0.15
189	Greentown China Holdings Ltd	绿城中国	3900 HK	香港联合交易所	中国香港	1,500	14,927.52	0.15
190	Times China Holdings Ltd	时代中国控股	1233 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	14,777.74	0.15
191	Lee & Man Paper Manufacturing Ltd	理文造纸	2314 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	14,752.78	0.15
192	Kaisa Group Holdings Ltd	佳兆业集团	1638 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	14,677.89	0.15
193	Sinopec Engineering Group Co Ltd	中石化炼化工程	2386 HK	香港联合交易所	中国香港	3,500	14,648.77	0.15
194	Towngas China Co Ltd	港华燃气	1083 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	14,328.42	0.14
195	China Power International Development Ltd	中国电力	2380 HK	香港联合交易所	中国香港	10,000	14,145.36	0.14
196	China Tobacco International Co Ltd	中烟香港	6055 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	14,062.15	0.14
197	Frontage Holdings Corp	方达控股	1521 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	13,729.32	0.14

198	China Dongxiang Group Co Ltd	中国动向	3818 HK	香港联合交易所	中国香港	12,000	13,679.40	0.14
199	Health & Happiness H&H International Holdings Ltd	H&H 国际控股	1112 HK	香港联合交易所	中国香港	500	13,542.10	0.13
200	CIMC Enric Holdings Ltd	中集安瑞科	3899 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	13,446.41	0.13
201	China New Higher Education Group Ltd	新高教育集团	2001 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	13,280.00	0.13
202	China SCE Group Holdings Ltd	中骏集团控股	1966 HK	香港联合交易所	中国香港	5,000	13,271.68	0.13
203	Q Technology Group Co Ltd	丘钛科技	1478 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	13,246.71	0.13
204	First Pacific Co Ltd	第一太平	142 H K	香港联合交易所	中国香港	6,000	13,230.07	0.13
205	SUNeVision Holdings Ltd	新意网集团	1686 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	13,230.07	0.13
206	Gemdale Properties & Investment Corp Ltd	金地商置	535 H K	香港联合交易所	中国香港	16,000	13,180.15	0.13
207	CMGE Technology Group Ltd	中手游	302 H K	香港联合交易所	中国香港	4,000	12,680.90	0.13
208	Shenzhen Expressway Co Ltd	深高速	548 H K	香港联合交易所	中国香港	2,000	12,481.20	0.12
209	Viva Biotech Holdings	维亚生物	1873 HK	香港联合交易所	中国香港	1,500	12,406.31	0.12
210	Value Partners Group Ltd	惠理集团	806 H K	香港联合交易所	中国香港	3,000	12,381.35	0.12
211	Maoyan Entertainment	猫眼娱乐	1896 HK	香港联合交易所	中国香港	1,200	12,201.62	0.12
212	China Risun Group Ltd	中国旭阳集团	1907 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	12,181.65	0.12
213	Sinopec Shanghai Petrochemical Co Ltd	上海石化	338 H K	香港联合交易所	中国香港	8,000	12,048.52	0.12
214	Sino-Ocean Group Holding Ltd	远洋集团	3377 HK	香港联合交易所	中国香港	8,500	12,023.56	0.12
215	Shenzhen Investment Ltd	深圳控股	604 H K	香港联合交易所	中国香港	6,000	11,932.03	0.12
216	Pacific Textiles Holdings Ltd	互太纺织	1382 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	11,657.44	0.12

217	Livzon Pharmaceutical Group Inc	丽珠集团	1513 HK	香港联合交易所	中国香港	366	11,648.70	0.12
218	C&D International Investment Group Ltd	建发国际集团	1908 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	11,615.84	0.12
219	Shougang Fushan Resources Group Ltd	首钢资源	639 H K	香港联合交易所	中国香港	6,000	11,432.78	0.11
220	China International Marine Containers Group Co Ltd	中集集团	2039 HK	香港联合交易所	中国香港	800	11,422.79	0.11
221	MMG Ltd	五矿资源	1208 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	11,382.85	0.11
222	Powerlong Commercial Management Holdings Ltd	宝龙商业	9909 HK	香港联合交易所	中国香港	500	11,357.89	0.11
223	Sunlight Real Estate Investment Trust	阳光房地产基金	435 H K	香港联合交易所	中国香港	3,000	11,208.12	0.11
224	Chow Sang Sang Holdings International Ltd	周生生	116 H K	香港联合交易所	中国香港	1,000	11,183.16	0.11
225	Jiayuan International Group Ltd	佳源国际控股	2768 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	10,983.46	0.11
226	China Eastern Airlines Corp Ltd	中国东航	670 H K	香港联合交易所	中国香港	4,000	10,950.17	0.11
227	Cathay Pacific Airways Ltd	国泰航空	293 H K	香港联合交易所	中国香港	2,000	10,916.89	0.11
228	Zhongyu Gas Holdings Ltd	中裕燃气	3633 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	10,866.96	0.11
229	Kangji Medical Holdings Ltd	康基医疗	9997 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	10,750.47	0.11
230	Haitong International Securities Group Ltd	海通国际	665 H K	香港联合交易所	中国香港	6,000	10,683.91	0.11
231	CGN New Energy Holdings Co Ltd	中广核新能源	1811 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	10,683.91	0.11
232	Beijing Tong Ren Tang Chinese Medicine Co Ltd	同仁堂国药	3613 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	10,667.27	0.11

233	United Laboratories International Holdings Ltd/The	联邦制药	3933 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	10,600.70	0.11
234	China Reinsurance Group Corp	中国再保险	1508 HK	香港联合交易所	中国香港	16,000	10,517.49	0.10
235	Lonking Holdings Ltd	中国龙工	3339 HK	香港联合交易所	中国香港	5,000	10,442.60	0.10
236	VSTECs Holdings Ltd	伟仕佳杰	856 H K	香港联合交易所	中国香港	2,000	10,434.28	0.10
237	COFCO Joycome Foods Ltd	中粮家佳康	1610 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	10,351.08	0.10
238	Shanghai Electric Group Co Ltd	上海电气	2727 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	10,334.43	0.10
239	Xiabuxiabu Catering Management China Holdings Co Ltd	呷哺呷哺	520 H K	香港联合交易所	中国香港	1,500	10,159.70	0.10
240	China Water Affairs Group Ltd	中国水务	855 H K	香港联合交易所	中国香港	2,000	9,951.68	0.10
241	E-House China Enterprise Holdings Ltd	易居企业控股	2048 HK	香港联合交易所	中国香港	1,800	9,945.02	0.10
242	China South City Holdings Ltd	华南城	1668 HK	香港联合交易所	中国香港	14,000	9,901.75	0.10
243	BAIC Motor Corp Ltd	北汽汽车	1958 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	9,618.84	0.10
244	China Railway Signal & Communication Corp Ltd	中国通号	3969 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	9,552.28	0.10
245	Shanghai Industrial Holdings Ltd	上海实业控股	363 H K	香港联合交易所	中国香港	1,000	9,535.64	0.10
246	Shui On Land Ltd	瑞安房地产	272 H K	香港联合交易所	中国香港	9,000	9,435.79	0.09
247	K Wah International Holdings Ltd	嘉华国际	173 H K	香港联合交易所	中国香港	3,000	9,410.82	0.09
248	Orient Securities Co Ltd/China	东方证券	3958 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	9,369.22	0.09
249	Hope Education Group Co Ltd	希望教育	1765 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	9,335.94	0.09
250	China Kepei Ed	中国科	1890	香港联合	中国	2,000	9,319.30	0.09

	ucation Group Ltd	培	HK	交易所	香港			
251	Shoucheng Holdings Ltd	首程控股	697 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	9,286.01	0.09
252	Zhuguang Holdings Group Co Ltd	珠光控股	1176 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	8,986.46	0.09
253	Dah Sing Financial Holdings Ltd	大新金融	440 HK	香港联合交易所	中国香港	400	8,836.69	0.09
254	AsiaInfo Technologies Ltd	亚信科技	1675 HK	香港联合交易所	中国香港	800	8,786.76	0.09
255	Datang International Power Generation Co Ltd	大唐发电	991 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	8,653.63	0.09
256	NetDragon Websoft Holdings Ltd	网龙	777 HK	香港联合交易所	中国香港	500	8,612.03	0.09
257	Dah Sing Banking Group Ltd	大新银行集团	2356 HK	香港联合交易所	中国香港	1,200	8,557.11	0.09
258	CITIC Telecom International Holdings Ltd	中信国际电讯	1883 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	8,553.78	0.09
259	Digital China Holdings Ltd	神州控股	861 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	8,537.14	0.09
260	FIH Mobile Ltd	富智康集团	2038 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	8,520.50	0.08
261	Poly Property Group Co Ltd	保利置业集团	119 HK	香港联合交易所	中国香港	5,000	8,404.01	0.08
262	Shun Tak Holdings Ltd	信德集团	242 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	8,320.80	0.08
263	Mobvista Inc	汇量科技	1860 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	8,320.80	0.08
264	Fufeng Group Ltd	阜丰集团	546 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	8,287.52	0.08
265	Yuzhou Group Holdings Co Ltd	禹洲集团	1628 HK	香港联合交易所	中国香港	5,000	8,279.20	0.08
266	Midea Real Estate Holding Ltd	美的置业	3990 HK	香港联合交易所	中国香港	600	8,207.64	0.08
267	Koolearn Technology Holding Ltd	新东方在线	1797 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	8,096.14	0.08
268	Road King Infrastructure Ltd	路劲	1098 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	8,037.89	0.08
269	Zhongliang Holdings Group Co Ltd	中梁控股	2772 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	7,971.33	0.08

270	TCL Electronics Holdings Ltd	T C L 电子	1070 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	7,705.06	0.08
271	Pou Sheng International Holdings Ltd	宝胜国际	3813 HK	香港联合交易所	中国香港	5,000	7,613.53	0.08
272	Canvest Environmental Protection Group Co Ltd	粤丰环保	1381 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	7,522.00	0.07
273	Yuexiu Transport Infrastructure Ltd	越秀交通基建有限公司	1052 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	7,488.72	0.07
274	Tianli Education International Holdings Ltd	天立教育	1773 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	7,363.91	0.07
275	Skyworth Group Ltd	创维集团	751 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	7,255.74	0.07
276	Guotai Junan International Holdings Ltd	国泰君安国际	1788 HK	香港联合交易所	中国香港	7,000	7,222.45	0.07
277	FIT Hon Teng Ltd	鸿腾六零八八精密科技股份有限公司	6088 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	7,089.32	0.07
278	China Maple Leaf Educational Systems Ltd	枫叶教育	1317 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	6,989.47	0.07
279	Sinic Holdings Group Co Ltd	新力控股集团	2103 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	6,972.83	0.07
280	Shenwan Hongyuan Group Co Ltd	申万宏源	6806 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	6,922.91	0.07
281	LVGEM China Real Estate Investment Co Ltd	绿景中国地产	95 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	6,756.49	0.07
282	Comba Telecom Systems Holdings Ltd	京信通信	2342 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	6,756.49	0.07
283	China Tian Lun Gas Holdings Ltd	天伦燃气	1600 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	6,664.96	0.07
284	China Shineway Pharmaceutical Group Ltd	神威药业	2877 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	6,623.36	0.07

285	iDreamSky Technology Holdings Ltd	创梦天地	1119 HK	香港联合交易所	中国香港	1,600	6,616.70	0.07
286	Meitu Inc	美图公司	1357 HK	香港联合交易所	中国香港	4,500	6,590.07	0.07
287	Central China New Life Ltd	建业新生活	9983 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	6,565.11	0.07
288	Bank of Chongqing Co Ltd	重庆银行	1963 HK	香港联合交易所	中国香港	1,500	6,452.78	0.06
289	China Travel International Investment Hong Kong Ltd	香港中旅	308 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	6,440.30	0.06
290	Sheng Ye Capital Ltd	盛业资本	6069 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	6,398.70	0.06
291	COSCO SHIPPING Energy Transportation Co Ltd	中远海能	1138 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	6,024.26	0.06
292	China Zhongwang Holdings Ltd	中国忠旺	1333 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	6,024.26	0.06
293	West China Cement Ltd	西部水泥	2233 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	5,941.05	0.06
294	China Logistics Property Holdings Co Ltd	中国物流资产	1589 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	5,891.13	0.06
295	China Renaissance Holdings Ltd	华兴资本控股	1911 HK	香港联合交易所	中国香港	300	5,866.16	0.06
296	China Modern Dairy Holdings Ltd	现代牧业	1117 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	5,724.71	0.06
297	China Harmony Auto Holding Ltd	和谐汽车	3836 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	5,674.79	0.06
298	Sinofert Holdings Ltd	中化化肥	297 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	5,591.58	0.06
299	Ronshine China Holdings Ltd	融信中国	3301 HK	香港联合交易所	中国香港	1,500	5,591.58	0.06
300	Times Neighborhood Holdings Ltd	时代邻里	9928 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	5,541.65	0.06
301	Tiangong International Co Ltd	天工国际	826 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	5,508.37	0.05
302	Texhong Textile Group Ltd	天虹纺织	2678 HK	香港联合交易所	中国香港	500	5,225.46	0.05
303	Hutchison Telecommunications Hong Kong	和记电讯香港	215 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	5,092.33	0.05

	g Kong Holdings Ltd							
304	Citychamp Watch & Jewellery Group Ltd	冠城钟表珠宝	256 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	5,059.05	0.05
305	Asia Cement China Holdings Corp	亚洲水泥(中国)	743 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	5,059.05	0.05
306	Lifestyle International Holdings Ltd	利福国际	1212 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	4,959.20	0.05
307	Nissin Foods Co Ltd	日清食品	1475 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	4,942.56	0.05
308	China Everbright Greentech Ltd	中国光大绿色环保	1257 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	4,925.91	0.05
309	CSSC Hong Kong Shipping Co Ltd	中国船舶租赁	3877 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	4,925.91	0.05
310	Dexin China Holdings Co Ltd	德信中国	2019 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	4,909.27	0.05
311	Sinopec Kantons Holdings Ltd	中石化冠德	934 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	4,842.71	0.05
312	Skyfame Realty Holdings Ltd	天誉置业	59 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	4,742.86	0.05
313	China Foods Ltd	中国食品	506 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	4,692.93	0.05
314	Yixin Group Ltd	易鑫集团	2858 HK	香港联合交易所	中国香港	2,500	4,430.83	0.04
315	Redsun Properties Group Ltd	弘阳地产	1996 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	4,293.53	0.04
316	YiChang HEC ChangJiang Pharmaceutical Co Ltd	东阳光药	1558 HK	香港联合交易所	中国香港	600	4,278.56	0.04
317	China Lilang Ltd	中国利郎	1234 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	4,193.68	0.04
318	Redco Properties Group Ltd	力高集团	1622 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	4,193.68	0.04
319	China Oriental Group Co Ltd	中国东方集团	581 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	4,177.04	0.04
320	Greenland Hong Kong Holdings Ltd	绿地香港	337 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	4,160.40	0.04
321	CMBC Capital H	民银资	1141	香港联合	中国	50,000	4,118.80	0.04

	oldings Ltd	本	HK	交易所	香港			
322	Yangtze Optical Fibre and Cable Joint Stock Ltd Co	长飞光纤	6869 HK	香港联合交易所	中国香港	500	4,106.31	0.04
323	China High Speed Transmission Equipment Group Co Ltd	中国高速传动	658 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	4,102.15	0.04
324	SmarTone Telecommunications Holdings Ltd	数码通电讯	315 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	3,827.57	0.04
325	China Merchants Land Ltd	招商局置地	978 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	3,627.87	0.04
326	Wisdom Education International Holdings Co Ltd	睿见教育	6068 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	3,528.02	0.04
327	Sun Hung Kai & Co Ltd	新鸿基有限公司	86 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	3,469.77	0.03
328	Central China Real Estate Ltd	建业地产	832 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	3,361.60	0.03
329	Huijing Holdings Co Ltd	汇景控股	9968 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	3,278.40	0.03
330	VPower Group International Holdings Ltd	伟能集团	1608 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	2,912.28	0.03
331	Glory Sun Financial Group Ltd	宝新金融	1282 HK	香港联合交易所	中国香港	16,000	2,782.48	0.03
332	Mulsanne Group Holding Ltd	慕尚集团控股	1817 HK	香港联合交易所	中国香港	500	2,708.42	0.03
333	Colour Life Services Group Co Ltd	彩生活	1778 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	2,537.84	0.03
334	China Aircraft Leasing Group Holdings Ltd	中国飞机租赁	1848 HK	香港联合交易所	中国香港	500	2,525.36	0.03
335	China Vast Industrial Urban Development Co Ltd	中国宏泰发展	6166 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	2,496.24	0.02
336	Minsheng Education Group Co Ltd	民生教育	1569 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	2,246.62	0.02

337	Fantasia Holdings Group Co Ltd	花样年控股	1777 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	2,196.69	0.02
338	Guorui Properties Ltd	国瑞置业	2329 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	998.50	0.01

7.4.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	Huazhu Group Ltd	华住集团	1179 HK	香港联合交易所	中国香港	50	17,328.07	0.17
2	CAR Inc	神州租车	699 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	6,623.36	0.07
3	CT Environmental Group Ltd	中滔环保	1363 HK	香港联合交易所	中国香港	16,000	4,526.52	0.05
4	Tenwow International Holdings Ltd	天喔国际(退市)	1219 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	2,529.52	0.03
5	Convoy Global Holdings Ltd	康宏环球(退市)	1019 HK	香港联合交易所	中国香港	270,000	2,246.62	0.02
6	MH Development Ltd	美好发展	2662 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	1,930.43	0.02
7	China Huishan Dairy HLD. LTD	辉山乳业(退市)	6863 HK	香港联合交易所	中国香港	212,000	1,764.01	0.02
8	Southern Energy Holdings Group Ltd	南方能源	1573 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	1,131.63	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	989.43	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	690.63	0.01
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	7.32	0.00

1 2	China Hu iyuan Juic e Group L td	汇源果 汁 (退 市)	1886 HK	香港联合 交易所	中国香 港	10,000	0.83	0.00
--------	---	-------------------	---------	-------------	----------	--------	------	------

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	HAIER SMART HOME CO LTD-H	6690 HK	154,714.26	1.10
2	YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	1579 HK	106,944.47	0.76
3	BYD CO LTD-H	1211 HK	101,776.46	0.72
4	ESR	1821 HK	97,579.75	0.69
5	Innovent Biolog ics Inc	1801 HK	73,227.36	0.52
6	CHINA TELECOM CORP LTD-H	728 HK	62,914.79	0.45
7	LI NING CO LTD	2331 HK	62,641.28	0.45
8	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	968 HK	58,548.55	0.42
9	CHINA MINSHENG BANKING COR-H	1988 HK	54,002.15	0.38
10	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	19 HK	52,707.43	0.38
11	KINGSOFT CORP LTD	3888 HK	52,513.64	0.37
12	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	2333 HK	50,429.76	0.36
13	ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	6060 HK	48,812.68	0.35
14	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	586 HK	46,949.70	0.33
15	MICROPORT SCIENTIFIC CORP	853 HK	46,262.02	0.33
16	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	868 HK	32,608.48	0.23
17	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	2899 HK	32,441.75	0.23
18	WUXIAPPTECCOLTD-H	2359 HK	32,175.03	0.23
19	CHINA VANKE CO LTD-H	2202 HK	30,395.40	0.22

20	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	916 HK	29,707.72	0.21
----	---------------------------------	--------	-----------	------

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

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	LI NING CO LTD	2331 HK	452,844.63	3.22
2	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	968 HK	305,423.74	2.17
3	BYD CO LTD-H	1211 HK	305,377.31	2.17
4	YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	1579 HK	246,320.30	1.75
5	Innovent Biolog ics Inc	1801 HK	173,580.11	1.24
6	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	2333 HK	124,912.07	0.89
7	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	586 HK	108,016.48	0.77
8	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	2899 HK	89,013.35	0.63
9	KINGSOFT CORP LTD	3888 HK	87,615.21	0.62
10	MICROPORT SCIENTIFIC CORP	853 HK	82,013.58	0.58
11	CHINA VANKE CO LTD-H	2202 HK	78,586.14	0.56
12	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	868 HK	71,626.52	0.51
13	KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	268 HK	70,424.66	0.50
14	WUXIAPPTTECCOLT-H	2359 HK	66,894.11	0.48
15	ZHONGDAINTERNATION ALHOLDIN	909 HK	65,567.90	0.47
16	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	916 HK	59,913.48	0.43
17	CAFE DE CORAL HOLDINGS LTD	341 HK	56,794.28	0.40
18	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	285 HK	50,378.91	0.36
19	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	1308 HK	49,969.65	0.36

20	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	3323 HK	49,676.45	0.35
----	------------------------------	---------	-----------	------

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

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	2,133,784.89
卖出收入（成交）总额	6,445,903.03

注：上述金额均指成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

无。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

金额单位：人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	权证品种_权证	中骏集团控股权证	464.88	-

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

无。

7.11 投资组合报告附注

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

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

7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	72,091.00
3	应收股利	82,652.90
4	应收利息	119.10
5	应收申购款	6,523.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	161,386.69

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	公司名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	1363 HK	中滔环保	4,526.52	0.05	重大事项停牌
2	1219 HK	天喔国际（退市）	2,529.52	0.03	已退市
3	1019 HK	康宏环球（退市）	2,246.62	0.02	已退市

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
恒生中小 A	1,323	5,870.11	123,788.25	1.59	7,642,366.40	98.41
恒生中小 C	381	1,114.02	-	-	424,441.17	100.00
合计	1,704	4,806.69	123,788.25	1.51	8,066,807.57	98.49

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

2、持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

8.2 期末上市基金前十名持有人

恒生中小 A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	杨凯	230,124.00	26.80
2	赵何鉴	86,500.00	10.07
3	钱中明	77,887.00	9.07
4	朱树桥	66,448.00	7.74
5	范东启	62,996.00	7.34
6	李小晶	50,002.00	5.82
7	游建忠	21,700.00	2.53
8	尹绍波	20,023.00	2.33
9	刘禹林	20,000.00	2.33
10	王洪武	14,400.00	1.68

注：数据由中国证券登记结算有限公司提供，持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
----	------	-----------	-------------

基金管理人所有从业人员持有本基金	恒生中小 A	11,483.53	0.1479
	恒生中小 C	0.00	0.0000
	合计	11,483.53	0.1402

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	恒生中小 A	0
	恒生中小 C	0
	合计	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 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	12,441,541.43	73,030.71
本报告期基金总申购份额	3,746,196.99	838,746.67
减：本报告期基金总赎回份额	8,421,583.77	487,336.21
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	7,766,154.65	424,441.17

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

无。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、基金管理人的重大人事变动

基金管理人报告期内无重大人事变动。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

2021 年 5 月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
瑞银证券	3	7,183,964.90	83.89%	5,429.88	83.08%	-
招商证券	2	1,379,678.67	16.11%	1,105.56	16.92%	-

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	-	-	-	-	-
东财证券	1	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
申万宏源西 部	1	-	-	-	-	-

世纪证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
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。

本报告期内本基金租用证券公司交易单元的变更情况如下：

本报告期内本基金新增交易单元：无，退租交易单元：无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于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	2021年6月30日
2	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	2021年6月29日
3	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	2021年5月14日
4	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加招商银行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	2021年5月12日
5	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海中正达广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	2021年5月12日
6	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	2021年4月29日
7	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）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	2021年4月22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	2021年3月31日
9	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）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	2021年3月30日
10	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	2021年3月30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	2021年3月30日
12	大成恒生综合中小型股指数证券投资	中国证监会基金电子披	2021年3月30日

	基金（QDII-LOF）2020 年年度报告	露网站、规定报刊及本公司网站	
13	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）基金合同	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 3 月 30 日
14	大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 3 月 23 日
15	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	2021 年 2 月 6 日
16	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）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	2021 年 1 月 22 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

阅。

大成基金管理有限公司

2021 年 8 月 31 日