

# 易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）

## 2023 年中期报告

2023 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：二〇二三年八月三十日

## § 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 2023 年 8 月 28 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 2023 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	11
4.3	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	14
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	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	15
6.3	净资产（基金净值）变动表	17
6.4	报表附注	18
§ 7	投资组合报告	40
7.1	期末基金资产组合情况	40
7.2	期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	41
7.3	期末按行业分类的权益投资组合	41
7.4	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	42
7.5	报告期内权益投资组合的重大变动	62
7.6	期末按债券信用等级分类的债券投资组合	63
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	63
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	64
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	64

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 .....	64
7.11	投资组合报告附注 .....	64
§ 8	基金份额持有人信息 .....	65
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	65
8.2	期末上市基金前十名持有人 .....	65
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	66
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 .....	66
§ 9	开放式基金份额变动 .....	66
§ 10	重大事件揭示 .....	67
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	67
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 .....	67
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	67
10.4	基金投资策略的改变 .....	67
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	67
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 .....	67
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	68
10.8	其他重大事件 .....	73
§ 11	备查文件目录 .....	74
11.1	备查文件目录 .....	74
11.2	存放地点 .....	74
11.3	查阅方式 .....	74

## § 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	25,593,647.87 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
下属分级基金的交易代码	161124	006263
报告期末下属分级基金的份额总额	20,601,024.16 份	4,992,623.71 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	王玉	张姗

负责人	联系电话	020-85102688	0755-83077987
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	zhangshan_1027@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荣粤道 188号6层	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	香港中环皇后大道中一号汇丰总行大厦
办公地址		无	香港九龙深旺道一号，汇丰中心一座六楼
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	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 40-43 楼

#### 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
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：本基金 A 类基金份额的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，C 类基金份额的注册登记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（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日）	
	易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）A	易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）C
本期已实现收益	-1,163,281.10	-275,347.65
本期利润	-1,951,944.12	-457,686.50
加权平均基金份额本期利润	-0.0922	-0.0919
本期加权平均净值利润率	-8.64%	-8.67%
本期基金份额净值增长率	-8.71%	-8.79%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 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	-192,331.62	-85,981.68
期末可供分配基金份额利润	-0.0093	-0.0172
期末基金资产净值	20,408,692.54	4,906,642.03
期末基金份额净值	0.9907	0.9828
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 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	-0.93%	-14.02%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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	2.51%	1.14%	1.88%	1.18%	0.63%	-0.04%
过去三个月	-5.05%	1.06%	-6.63%	1.08%	1.58%	-0.02%
过去六个月	-8.71%	1.14%	-10.33%	1.16%	1.62%	-0.02%
过去一年	-10.25%	1.31%	-13.07%	1.33%	2.82%	-0.02%
过去三年	-14.66%	1.47%	-23.60%	1.50%	8.94%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-0.93%	1.32%	-23.24%	1.32%	22.31%	0.00%

易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）C

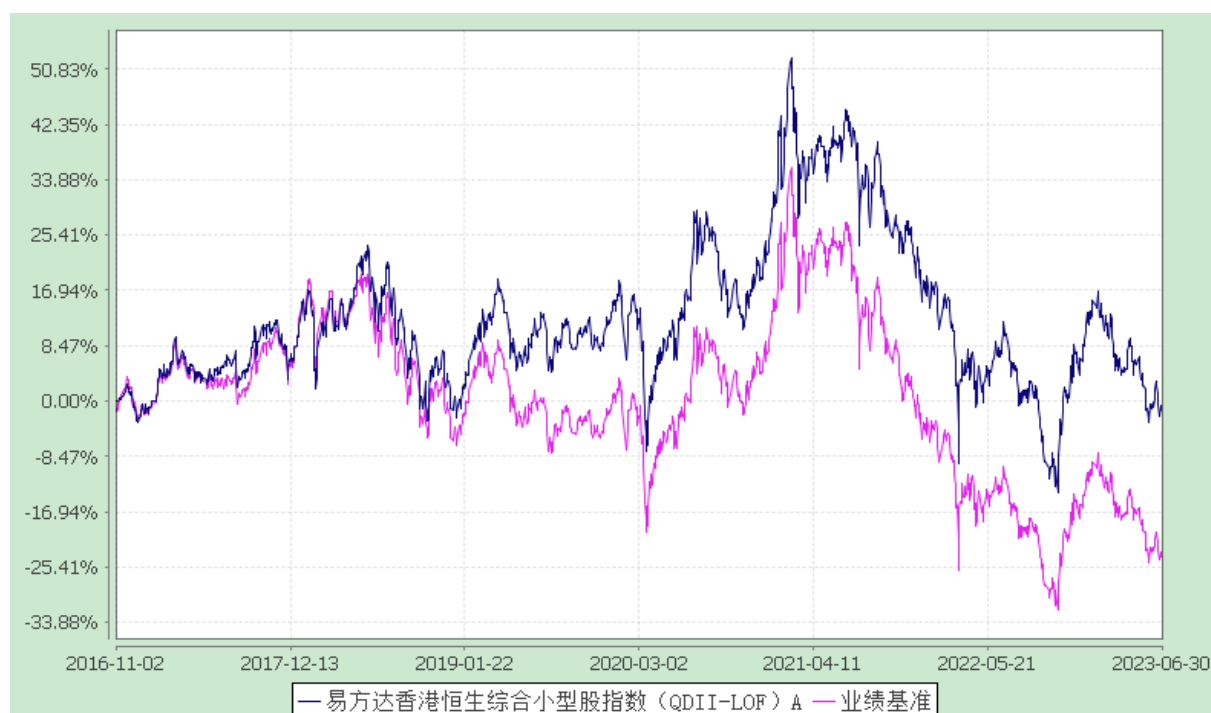
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.51%	1.14%	1.88%	1.18%	0.63%	-0.04%
过去三个月	-5.09%	1.06%	-6.63%	1.08%	1.54%	-0.02%
过去六个月	-8.79%	1.14%	-10.33%	1.16%	1.54%	-0.02%
过去一年	-10.41%	1.31%	-13.07%	1.33%	2.66%	-0.02%
过去三年	-15.11%	1.47%	-23.60%	1.50%	8.49%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-14.02%	1.41%	-29.99%	1.42%	15.97%	-0.01%

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

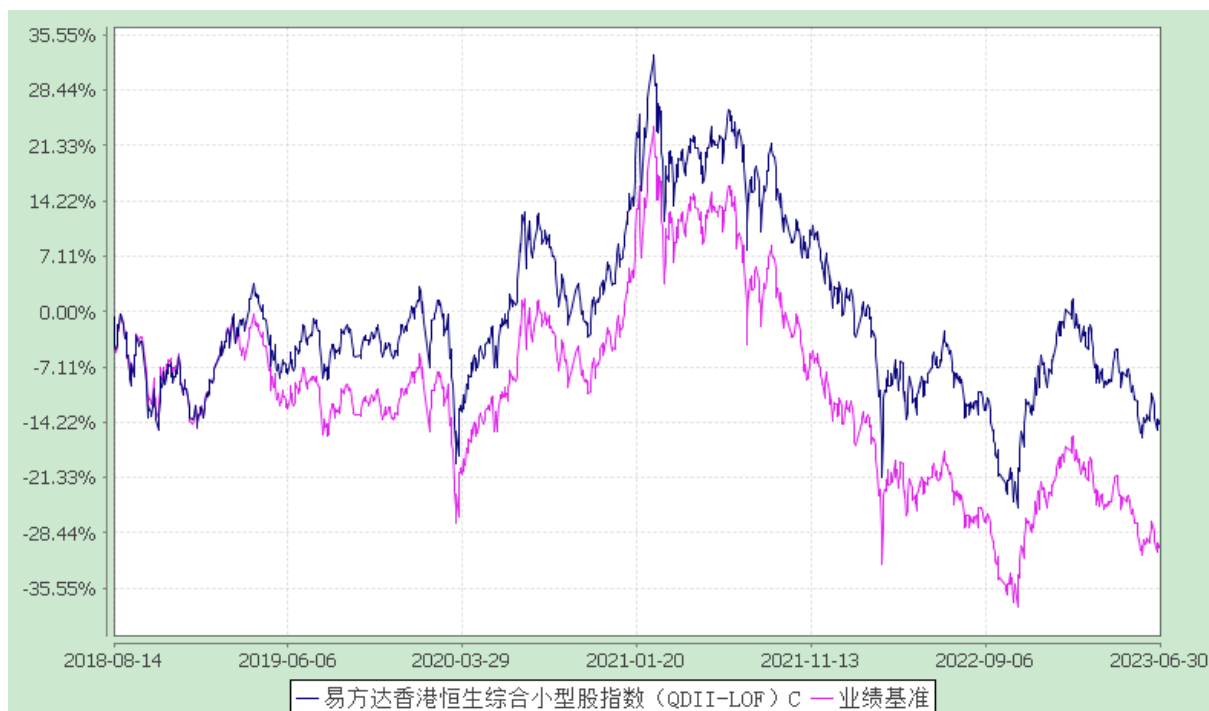
（2016 年 11 月 2 日至 2023 年 6 月 30 日）





## 易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）C

（2018 年 8 月 14 日至 2023 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-0.93%, 同期业绩比较基准收益率为-23.24%; C 类基金份额净值增长率为-14.02%, 同期业绩比较基准收益率为-29.99%。

## § 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、另类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，易方达深证 100ETF 联接、易方达创业板 ETF 联接、易方达深证 100ETF、易方达创业板 ETF、易方达中小企业 100 指数（LOF）、易方达中证万得并购重组指数（LOF）、易方达上证中盘 ETF 联接、易方达上证中盘 ETF、易方达中证 800ETF、易方达中证 800ETF 联接发起式、易方达中证国企一带一路 ETF 联接发起式、易方达中证国企一带一路 ETF、易方达中证银行指数（LOF）、易方达中证银行 ETF、易方达中证长江保护主题 ETF、易方达中证 1000ETF、易方达中证 1000ETF 联接、易方达中证港股通消费主题 ETF 联接发起式、易方达中证长江保护主	2018-08-11	-	16 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，易方达深证成指 ETF 联接、易方达深证成指 ETF、易方达银行分级、易方达生物分级、易方达标普 500 指数（QDII-LOF）、易方达标普医疗保健指数（QDII-LOF）、易方达标普生物科技指数（QDII-LOF）、易方达标普信息技术指数（QDII-LOF）、易方达中证浙江新动能 ETF 联接（QDII）、易方达中证浙江新动能 ETF（QDII）的基金经理。

	题 ETF 联接发起式的基金经理，易方达中证港股通消费主题 ETF 的基金经理助理				
--	---	--	--	--	--

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行业协会相关规定。

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、决策流程和交易流程，以及强化事后监控分析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 23 次，其中 20 次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，3 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交

易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

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

本基金跟踪恒生综合小型股指数，该指数涵盖了恒生综合指数成份股总市值后 5% 的上市公司。报告期内，本基金主要采取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。

恒生综合小型股指数是反映在香港上市的小市值风格股票走势的宽基指数，主要的权重行业有医疗保健、工业、原材料，二级市场走势主要受香港股票市场整体走势的影响。年初，在国内经济复苏以及海外流动性缓解的预期推动下，港股市场整体延续了 2022 年 11 月份以来的反弹趋势，恒生综合小型股指数走势震荡向上。春节假期之后，部分高频数据偏弱指向国内经济恢复的基础仍不牢固，市场对经济复苏的预期出现降温，叠加全球地缘局势与中美关系不确定性、海外主要国家增长预期及货币政策调整等因素影响，投资者风险偏好下降，港股市场震荡下跌。在上述背景下，港币计价的恒生综合小型股指数本报告期下跌 13.67%。

本报告期为本基金的正常运作期，本基金在投资运作过程中严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差，力求跟踪误差最小化。

##### 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 0.9907 元，本报告期份额净值增长率为-8.71%，同期业绩比较基准收益率为-10.33%；C 类基金份额净值为 0.9828 元，本报告期份额净值增长率为-8.79%，同期业绩比较基准收益率为-10.33%，年化跟踪误差 1.65%，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

展望下一阶段，尽管外部环境更趋复杂严峻，国内经济发展也面临压力，但我国经济长期向好基本面没有改变，韧性强、潜力大、活力足的特点也没有改变，支撑高质量发展的条件也没有改变。随着促进发展的积极因素累积增多，经济有望继续恢复向好。下半年影响股票市场走势的因素仍较为综合，内部因素主要包括增长预期边际调整及相应稳增长政策；外部因素主要关注全球地缘局势、海外主要国家增长预期及货币政策调整等，其中国内经济表现及政策应对较为关键。中长期而言，随着内地与香港市场的互联互通机制不断完善，以及香港市场在全球新经济企业的融资业务中扮演

越来越关键的角色，海外资金和港股通南向资金有望不断加大对于港股优质上市公司的配置力度，港股市场整体的交易活跃度也有望持续提升。

作为被动型投资基金，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，追求跟踪误差的最小化，为投资者提供质地优良的指数投资工具。

#### 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

本报告期，本基金均存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

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合规守信、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：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,676,871.95	1,806,298.85
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	23,872,880.60	27,623,446.91
其中：股票投资		23,872,880.60	27,623,446.91
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-

其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	692.28
应收股利		180,468.34	17,561.53
应收申购款		17,307.12	17,501.35
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		25,747,528.01	29,465,500.92
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		233,273.03	-
应付赎回款		62,023.77	66,873.93
应付管理人报酬		16,868.73	19,590.00
应付托管费		5,271.50	6,121.82
应付销售服务费		806.70	970.22
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	113,949.71	124,021.51
负债合计		432,193.44	217,577.48
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	25,593,647.87	26,988,834.68
未分配利润	6.4.7.8	-278,313.30	2,259,088.76
净资产合计		25,315,334.57	29,247,923.44
负债和净资产总计		25,747,528.01	29,465,500.92

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 0.9907 元，C 类基金份额净值 0.9828 元；基金份额总额 25,593,647.87 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 20,601,024.16 份，C 类基金份额总额 4,992,623.71 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年1月1日至 2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至 2022年6月30日
<b>一、营业总收入</b>		-2,192,620.79	-2,212,488.93
1.利息收入		5,673.30	2,183.45
其中：存款利息收入	6.4.7.9	5,673.30	2,183.45
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）		-1,287,534.59	-901,512.13
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-1,671,097.31	-1,528,624.52
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	242.95	-
股利收益	6.4.7.15	383,319.77	627,112.39
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-971,001.87	-1,388,203.27
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		59,044.85	72,000.66
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,197.52	3,042.36
<b>减：二、营业总支出</b>		217,009.83	247,664.77
1. 管理人报酬		110,974.13	118,040.48
2. 托管费		34,679.46	36,887.68
3. 销售服务费		5,255.38	6,059.89
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.19	66,100.86	86,676.72
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-2,409,630.62</b>	<b>-2,460,153.70</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-2,409,630.62</b>	<b>-2,460,153.70</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-2,409,630.62</b>	<b>-2,460,153.70</b>



## 6.3 净资产（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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	26,988,834.68	2,259,088.76	29,247,923.44
二、本期期初净资产(基金净值)	26,988,834.68	2,259,088.76	29,247,923.44
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-1,395,186.81	-2,537,402.06	-3,932,588.87
（一）、综合收益总额	-	-2,409,630.62	-2,409,630.62
（二）、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）	-1,395,186.81	-127,771.44	-1,522,958.25
其中：1.基金申购款	1,550,774.44	99,610.16	1,650,384.60
2.基金赎回款	-2,945,961.25	-227,381.60	-3,173,342.85
（三）、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）	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	25,593,647.87	-278,313.30	25,315,334.57
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	27,495,279.45	5,226,084.42	32,721,363.87
二、本期期初净资产(基金净值)	27,495,279.45	5,226,084.42	32,721,363.87
三、本期增减变	-210,084.99	-2,431,039.01	-2,641,124.00

动额(减少以“-”号填列)			
(一)、综合收益总额	-	-2,460,153.70	-2,460,153.70
(二)、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)	-210,084.99	29,114.69	-180,970.30
其中：1.基金申购款	4,056,759.70	346,533.82	4,403,293.52
2.基金赎回款	-4,266,844.69	-317,419.13	-4,584,263.82
(三)、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)	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	27,285,194.46	2,795,045.41	30,080,239.87

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

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：王永铿

## 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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(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净资产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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	1,676,871.95
等于：本金	1,675,788.90
加：应计利息	1,083.05
定期存款	-

等于：本金	-
加：应计利息	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	1,676,871.95

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	30,271,904.75	-	23,872,880.60	-6,399,024.15
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	30,271,904.75	-	23,872,880.60	-6,399,024.15

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

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

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 其他资产**

本基金本报告期末无其他资产。

**6.4.7.6 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	111.02
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	59,916.99
其他应付款	53,921.70
合计	113,949.71

**6.4.7.7 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 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	21,677,291.72	21,677,291.72
本期申购	976,507.76	976,507.76
本期赎回（以“-”号填列）	-2,052,775.32	-2,052,775.32
本期末	20,601,024.16	20,601,024.16

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
----	----

	2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,311,542.96	5,311,542.96
本期申购	574,266.68	574,266.68
本期赎回（以“-”号填列）	-893,185.93	-893,185.93
本期末	4,992,623.71	4,992,623.71

#### 6.4.7.8 未分配利润

易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,444,070.30	-5,596,430.04	1,847,640.26
本期利润	-1,163,281.10	-788,663.02	-1,951,944.12
本期基金份额交易产生的变动数	-331,835.54	243,807.78	-88,027.76
其中：基金申购款	297,599.92	-233,900.79	63,699.13
基金赎回款	-629,435.46	477,708.57	-151,726.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,948,953.66	-6,141,285.28	-192,331.62

易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	933,277.56	-521,829.06	411,448.50
本期利润	-275,347.65	-182,338.85	-457,686.50
本期基金份额交易产生的变动数	-56,785.79	17,042.11	-39,743.68
其中：基金申购款	79,766.78	-43,855.75	35,911.03
基金赎回款	-136,552.57	60,897.86	-75,654.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	601,144.12	-687,125.80	-85,981.68

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	5,667.67
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	5.63
合计	5,673.30

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,671,097.31
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-1,671,097.31

##### 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	6,671,324.61
减：卖出股票成本总额	8,315,809.38
减：交易费用	26,612.54
买卖股票差价收入	-1,671,097.31

#### 6.4.7.11 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

#### 6.4.7.12 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

#### 6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

##### 6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出权证成交总额	244.01



减：卖出权证成本总额	-
减：交易费用	1.06
减：买卖权证差价收入应缴纳增值税额	-
买卖权证差价收入	242.95

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	383,319.77
基金投资产生的股利收益	-
合计	383,319.77

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	-971,001.87
——股票投资	-971,001.87
——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	-971,001.87

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	1,197.52
合计	1,197.52

#### 6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	9,916.99
信息披露费	-
证券出借违约金	-
指数使用费	53,921.70
银行汇划费	1,435.00
其他	827.17
合计	66,100.86

#### 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 债券交易

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债券交易。

### 6.4.10.1.4 债券回购交易

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债券回购交易。

### 6.4.10.1.5 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 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	110,974.13	118,040.48
其中：支付销售机构的客户维护费	28,033.21	30,771.15

注：1.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。

2.客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用按照基金销售机构所销售基金的保有量作为基数进行计算，从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	34,679.46	36,887.68

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 2023年1月1日至2023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	-	2,087.47	2,087.47
合计	-	2,087.47	2,087.47
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	-	2,215.12	2,215.12
合计	-	2,215.12	2,215.12

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 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

##### 6.4.10.4.1 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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

##### 6.4.10.4.2 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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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。

##### 6.4.10.5.2 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

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。

#### 6.4.10.6 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		上年度可比期间	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 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
汇丰银行-活期存款	1,499,063.82	5,319.22	792,717.00	6.13
招商银行-活期存款	177,808.13	348.45	1,149,416.05	2,157.71

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。

#### 6.4.10.7 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。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 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（2023 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
1387 HK	China Dili Group	2022-10 -28	重大事项停牌	0.61	-	-	144,000	275,297.10	87,624.98	-
1622 HK	Redco Propert ies Group Ltd	2023-03 -29	重大事项停牌	1.23	-	-	34,742	85,522.13	42,601.80	-
2103 HK	Sinic Holdin gs Group Co Ltd	2021-09 -20	重大事项停牌	0.00	-	-	36,000	130,260.06	0.00	-

注：根据香港联合交易所有限公司于 2023 年 4 月 6 日发布的《关于新力控股（集团）有限公司取消上市地位》的通告，由 2023 年 4 月 13 日上午 9 时起，新力控股（集团）有限公司的上市地位将根据除牌程序予以取消。

##### 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 2023 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 2023 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。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 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、集中交易部门、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

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。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 2023 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%(2022 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 2023年6月30日	上年度末 2022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 2023年6月30日	上年度末 2022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 2023年6月30日	上年度末 2022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 2023年6月30日	上年度末 2022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 2023年6月30日	上年度末 2022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 2023年6月30日	上年度末 2022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

流动性风险是指包括因市场交易量不足，导致基金管理人不能以合理价格及时进行证券交易的风险，或投资组合无法应付客户赎回要求所引起的违约风险。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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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 2023 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(净资产)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。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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，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

市场风险是指因受各种因素影响而引起的基金所持证券及其衍生品市场价格不利波动，使基金资产面临损失的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。本基金可投资境外市场，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。此外，境外证券市场的每日证券交易价格无涨跌幅限制或涨跌幅空间大于国内市场，这一因素可能会带来市场的急剧下跌，从而导致投资风险增加。

##### 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 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					

银行存款	1,676,871.95	-	-	-	1,676,871.95
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	23,872,880.60	23,872,880.60
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	180,468.34	180,468.34
应收申购款	2,162.40	-	-	15,144.72	17,307.12
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,679,034.35	-	-	24,068,493.66	25,747,528.01
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	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	233,273.03	233,273.03
应付赎回款	-	-	-	62,023.77	62,023.77
应付管理人报酬	-	-	-	16,868.73	16,868.73
应付托管费	-	-	-	5,271.50	5,271.50
应付销售服务费	-	-	-	806.70	806.70
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	113,949.71	113,949.71
负债总计	-	-	-	432,193.44	432,193.44
利率敏感度缺口	1,679,034.35	-	-	23,636,300.22	25,315,334.57
上年度末 2022 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	1,806,298.85	-	-	-	1,806,298.85
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	27,623,446.91	27,623,446.91
衍生金融资产	-	-	-	-	-

买入返售金融资产	-	-	-	-
应收清算款	-	-	692.28	692.28
应收股利	-	-	17,561.53	17,561.53
应收申购款	2,286.40	-	15,214.95	17,501.35
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产总计	1,808,585.25	-	27,656,915.67	29,465,500.92
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	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	66,873.93	66,873.93
应付管理人报酬	-	-	19,590.00	19,590.00
应付托管费	-	-	6,121.82	6,121.82
应付销售服务费	-	-	970.22	970.22
应付投资顾问费	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-
其他负债	-	-	124,021.51	124,021.51
负债总计	-	-	217,577.48	217,577.48
利率敏感度缺口	1,808,585.25	-	27,439,338.19	29,247,923.44

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
----	-----

	2023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
<b>以外币计价的资产</b>				
银行存款	-	1,517,688.86	-	1,517,688.86
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	23,872,880.60	-	23,872,880.60
衍生金融资产	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收股利	-	180,468.34	-	180,468.34
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
<b>资产合计</b>	-	<b>25,571,037.80</b>	-	<b>25,571,037.80</b>
<b>以外币计价的负债</b>				
应付清算款	-	233,273.03	-	233,273.03
应付赎回款	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
<b>负债合计</b>	-	<b>233,273.03</b>	-	<b>233,273.03</b>
<b>资产负债表 外汇风险敞口净额</b>	-	<b>25,337,764.77</b>	-	<b>25,337,764.77</b>
项目	上年度末 2022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
<b>以外币计价的资产</b>				
银行存款	-	1,502,702.44	-	1,502,702.44
结算备付金	-	-	-	-

存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	27,623,446.91	-	27,623,446.91
衍生金融资产	-	-	-	-
应收清算款	-	692.28	-	692.28
应收股利	-	17,561.53	-	17,561.53
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
<b>资产合计</b>	-	<b>29,144,403.16</b>	-	<b>29,144,403.16</b>
<b>以外币计价的负债</b>				
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
<b>负债合计</b>	-	-	-	-
<b>资产负债表外汇风险敞口净额</b>	-	<b>29,144,403.16</b>	-	<b>29,144,403.16</b>

#### 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	假设人民币对一揽子货币平均升值 5%	-1,266,888.24	-1,457,220.16
	假设人民币对一揽子货币平均贬值 5%	1,266,888.24	1,457,220.16

#### 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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	23,872,880.60	94.30	27,623,446.91	94.45
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	23,872,880.60	94.30	27,623,446.91	94.45

#### 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	1,193,644.02	1,381,172.33
	2.业绩比较基准下降 5%	-1,193,644.02	-1,381,172.33

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 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。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

## 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年6月30日
第一层次	23,742,653.82
第二层次	130,226.78
第三层次	-
合计	23,872,880.60

## 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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、债券和基金公允价值应属第二层次还是第三层次。

## 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

## 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、买入返售金融资产、其他各类应收款项、卖出回购金融资产款和其他各类应付款项，其账面价值与公允价值相差很小。

## 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	23,872,880.60	92.72
	其中：普通股	23,728,148.18	92.16
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	144,732.42	0.56
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-



	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,676,871.95	6.51
8	其他各项资产	197,775.46	0.77
9	合计	25,747,528.01	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	23,872,880.60	94.30
合计	23,872,880.60	94.30

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	1,251,339.48	4.94
材料	2,492,835.69	9.85
工业	3,706,319.76	14.64
非必需消费品	2,415,302.17	9.54
必需消费品	936,693.26	3.70
保健	4,840,904.67	19.12
金融	1,992,171.21	7.87
信息技术	2,345,910.44	9.27
电信服务	1,211,991.44	4.79
公用事业	957,930.86	3.78
房地产	1,721,481.62	6.80
合计	23,872,880.60	94.30

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	China Oilfield Services Limited	中海油田 服务股份 有限公司	2883 HK	香港证 券交易 所	中国香港	70,975	529,389.62	2.09
2	Aluminu m Corporati on of China Limited	中国铝业 股份有限 公司	2600 HK	香港证 券交易 所	中国香港	152,000	472,275.04	1.87
3	Flat Glass Group Co., Ltd	福莱特玻 璃集团股 份有限公 司	6865 HK	香港证 券交易 所	中国香港	17,621	434,586.11	1.72
4	China Railway Constructi on Corporati on Limited	中国铁建 股份有限 公司	1186 HK	香港证 券交易 所	中国香港	80,500	427,503.69	1.69
5	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	28,317	372,818.07	1.47
6	COSCO SHIPPIN G Energy Transport ation Co., Ltd.	中远海运 能源运输 股份有限 公司	1138 HK	香港证 券交易 所	中国香港	50,000	362,338.14	1.43
7	New Horizon Health Limited	诺辉健康	6606 HK	香港证 券交易 所	中国香港	13,500	340,418.07	1.34
8	Beijing	北京首都	694 HK	香港证	中国香港	71,724	335,269.43	1.32

	Capital International Airport Company Limited	国际机场股份有限公司		券交易所				
9	China Communications Services Corporation Limited	中国通信服务股份有限公司	552 HK	香港证券交易所	中国香港	92,000	327,413.54	1.29
10	Jiangsu Expressway Company Limited	江苏宁沪高速公路股份有限公司	177 HK	香港证券交易所	中国香港	47,237	314,442.33	1.24
11	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	63,096	313,553.82	1.24
12	Gushengtang Holdings Limited	固生堂控股有限公司	2273 HK	香港证券交易所	中国香港	6,100	279,516.68	1.10
13	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	36,526	272,104.03	1.07
14	Keymed Biosciences Inc.	康诺亚生物医药科技有限公司	2162 HK	香港证券交易所	中国香港	7,000	263,962.87	1.04
15	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	47,773	262,072.22	1.04
16	China Gold International Resources Corp. Ltd.	中国黄金国际资源有限公司	2099 HK	香港证券交易所	中国香港	9,200	252,770.04	1.00
17	Tianqi	天齐锂业	9696 HK	香港证	中国香港	5,000	251,470.05	0.99

	Lithium Corp	股份有限公司		券交易所				
18	China Huarong Asset Management Co.,Ltd	中国华融资产管理股份有限公司	2799 HK	香港证券交易所	中国香港	752,000	249,598.43	0.99
19	Meitu, Inc.	美图公司	1357 HK	香港证券交易所	中国香港	90,500	246,980.00	0.98
20	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	13,194	243,900.31	0.96
21	Kingsoft Cloud Holdings Ltd	金山云控股有限公司	3896 HK	香港证券交易所	中国香港	80,000	236,764.46	0.94
22	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	34,600	235,425.75	0.93
23	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	92,000	234,957.38	0.93
24	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	38,785	233,863.82	0.92
25	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	69,000	233,473.00	0.92
26	Zoomlion Heavy Industry	中联重科股份有限公司	1157 HK	香港证券交易所	中国香港	61,200	228,521.96	0.90

	Science and Technology Co., Ltd.							
27	Golden Solar New Energy Technology Holdings Limited	金阳新能源科技控股有限公司	1121 HK	香港证券交易所	中国香港	36,000	225,368.79	0.89
28	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	90,000	224,870.92	0.89
29	China Datang Corporation Renewable Power Co., Limited	中国大唐集团新能源股份有限公司	1798 HK	香港证券交易所	中国香港	92,000	222,234.06	0.88
30	Xinte Energy Co Ltd	新特能源股份有限公司	1799 HK	香港证券交易所	中国香港	14,400	220,390.10	0.87
31	China Energy Engineering Corporation Limited	中国能源建设股份有限公司	3996 HK	香港证券交易所	中国香港	232,000	205,343.39	0.81
32	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	27,493	205,065.29	0.81
33	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	5,669	198,353.44	0.78
34	Fufeng Group Ltd	阜丰集团有限公司	546 HK	香港证券交易所	中国香港	54,000	197,156.20	0.78
35	Hangzhou	杭州泰格	3347 HK	香港证	中国香港	4,761	195,993.26	0.77

	Tigermed Consulting Co., Ltd.	医药科技股份有限公司		券交易所				
36	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	6,201	195,814.03	0.77
37	Shanghai Fudan Microelectronics Group CO.,LTD.	上海复旦微电子集团股份有限公司	1385 HK	香港证券交易所	中国香港	11,000	195,330.68	0.77
38	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	35,123	191,705.60	0.76
39	China Railway Signal & Communication Corporation Limited	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	69,000	188,305.20	0.74
40	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	106,546	184,678.57	0.73
41	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	32,543	180,324.01	0.71
42	China Suntien Green Energy Corporation Limited	新天绿色能源股份有限公司	956 HK	香港证券交易所	中国香港	68,000	176,171.94	0.70
43	Skyworth	创维集团	751 HK	香港证	中国香港	55,128	175,861.12	0.69

	Group Limited	有限公司		券交易所				
44	China Nonferrous Mining Corporation Limited	中国有色金属矿业有限公司	1258 HK	香港证券交易所	中国香港	51,000	173,977.63	0.69
45	Shanghai Industrial Holdings Ltd.	上海实业控股有限公司	363 HK	香港证券交易所	中国香港	16,523	173,056.83	0.68
46	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	102,051	172,182.84	0.68
47	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	61,559	170,268.50	0.67
48	Everest Medicines Limited	云顶新耀有限公司	1952 HK	香港证券交易所	中国香港	7,500	164,573.43	0.65
49	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	119,106	162,523.76	0.64
50	Vobile Group Limited	阜博集团有限公司	3738 HK	香港证券交易所	中国香港	73,740	162,488.46	0.64
51	Ascentage Pharma Group International	亚盛医药集团	6855 HK	香港证券交易所	中国香港	8,300	161,466.36	0.64
52	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	11,727	159,369.76	0.63
53	PAX	百富环球	327 HK	香港证	中国香港	29,000	158,820.27	0.63

	Global Technology Limited	科技有限公司		券交易所				
54	Goldwind Science & Technology Co., Ltd.	金风科技股份有限公司	2208 HK	香港证券交易所	中国香港	30,020	148,630.00	0.59
55	Livzon Pharmaceutical Group Inc.	丽珠医药集团股份有限公司	1513 HK	香港证券交易所	中国香港	5,970	148,338.75	0.59
56	Qingdao Ainnovation Technology Group Co Ltd	青岛创新奇智科技集团股份有限公司	2121 HK	香港证券交易所	中国香港	8,700	147,269.71	0.58
57	Theme International Holdings Ltd.	荣晖国际集团有限公司	990 HK	香港证券交易所	中国香港	180,000	146,041.63	0.58
58	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	36,797	145,882.22	0.58
59	BOE Varitronix Ltd	京东方精电有限公司	710 HK	香港证券交易所	中国香港	14,000	145,599.08	0.58
60	Yuexiu Real Estate Investment Trust	越秀房地产投资信托基金	405 HK	香港证券交易所	中国香港	94,000	144,732.42	0.57
61	AsiaInfo Technologies Ltd	亚信科技控股有限公司	1675 HK	香港证券交易所	中国香港	14,400	144,713.98	0.57
62	Towngas Smart Energy Company Limited	港华智慧能源有限公司	1083 HK	香港证券交易所	中国香港	44,000	141,173.58	0.56



63	ANE (Cayman) Inc.	安能物流 集团有限 公司	9956 HK	香港证 券交易 所	中国香港	27,000	140,150.18	0.55
64	Ak Medical Holdings Limited	爱康医疗 控股有限 公司	1789 HK	香港证 券交易 所	中国香港	22,000	137,928.21	0.54
65	Yuexiu Transport Infrastruct ure Limited	越秀交通 基建有限 公司	1052 HK	香港证 券交易 所	中国香港	38,449	137,542.93	0.54
66	Yidu Tech Inc.	医渡科技 有限公司	2158 HK	香港证 券交易 所	中国香港	25,700	136,245.59	0.54
67	Sinopec Shanghai Petroche mical 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	120,000	136,084.25	0.54
68	Sirnaomic s Ltd	圣诺医药	2257 HK	香港证 券交易 所	中国香港	2,650	135,233.72	0.53
69	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	10,119	133,785.25	0.53
70	Cowell e Holdings Inc.	高伟电子 控股有限 公司	1415 HK	香港证 券交易 所	中国香港	10,000	133,502.70	0.53
71	Greentow n Managem ent Holdings Company Limited	绿城管理 控股有限 公司	9979 HK	香港证 券交易 所	中国香港	23,000	131,898.46	0.52
72	Poly Property Group Co.,Limit	保利置业 集团有限 公司	119 HK	香港证 券交易 所	中国香港	81,000	130,690.67	0.52

	ed							
73	Alphamab Oncology	康宁杰瑞生物制药	9966 HK	香港证券交易所	中国香港	18,854	130,024.92	0.51
74	CMGE Technology Group Limited	中手游科技集团有限公司	302 HK	香港证券交易所	中国香港	80,495	129,875.87	0.51
75	Carsgen Therapeutics Holdings Limited	科济药业控股有限公司	2171 HK	香港证券交易所	中国香港	14,500	129,542.80	0.51
76	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	33,840	126,983.20	0.50
77	SciClone Pharmaceuticals (Holdings) Limited	赛生药业控股有限公司	6600 HK	香港证券交易所	中国香港	13,000	126,329.70	0.50
78	Lepu Biopharma Co Ltd	乐普生物科技股份有限公司	2157 HK	香港证券交易所	中国香港	25,000	125,850.27	0.50
79	Shougang Fushan Resources Group Limited	首钢福山资源集团有限公司	639 HK	香港证券交易所	中国香港	67,536	122,665.68	0.48
80	Bairong Inc.	百融云创	6608 HK	香港证券交易所	中国香港	14,322	122,538.67	0.48
81	China Bohai Bank Co Ltd	渤海银行股份有限公司	9668 HK	香港证券交易所	中国香港	108,000	120,484.35	0.48
82	Peijia Medical Limited	沛嘉医疗有限公司	9996 HK	香港证券交易所	中国香港	21,000	119,267.33	0.47
83	China Travel Internatio	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	82,825	116,835.38	0.46

	nal Investmen t Hong Kong Ltd.							
84	Baic Motor Corporati on Limited	北京汽车 股份有限 公司	1958 HK	香港证 券交易 所	中国香港	65,500	114,740.41	0.45
85	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	6,282	113,404.98	0.45
86	Maoyan Entertain ment	猫眼娱乐	1896 HK	香港证 券交易 所	中国香港	17,000	112,380.14	0.44
87	Huitongda Network Co Ltd	汇通达网 络股份有 限公司	9878 HK	香港证 券交易 所	中国香港	3,800	110,886.53	0.44
88	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	134,000	109,955.33	0.43
89	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	31,598	108,956.39	0.43
90	Kangji Medical Holdings Ltd	康基医疗 控股有限 公司	9997 HK	香港证 券交易 所	中国香港	14,000	107,263.15	0.42
91	ClouDr Group Ltd	智云健康 科技集团	9955 HK	香港证 券交易 所	中国香港	14,800	106,296.92	0.42
92	VSTECS Holdings Limited	伟仕佳杰 控股有限 公司	856 HK	香港证 券交易 所	中国香港	28,385	105,466.72	0.42
93	Shanghai Junshi Bioscienc es 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	5,000	105,105.72	0.42
94	China Modern	中国现代 牧业控股	1117 HK	香港证 券交易	中国香港	138,000	104,331.26	0.41

	Dairy Holdings Ltd.	有限公司		所				
95	Canvest Environmental Protection Group Company Limited	粤丰环保电力有限公司	1381 HK	香港证券交易所	中国香港	28,574	103,797.95	0.41
96	Sinopec Kantons Holdings Ltd.	中石化冠德控股有限公司	934 HK	香港证券交易所	中国香港	38,069	103,190.64	0.41
97	Global New Material International Holdings Limited	环球新材国际控股有限公司	6616 HK	香港证券交易所	中国香港	25,000	100,956.81	0.40
98	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	43,585	99,255.71	0.39
99	china conch environment protection holdings limited	中国海螺环保控股有限公司	587 HK	香港证券交易所	中国香港	46,000	97,121.37	0.38
100	361 Degrees International Limited	361 度国际有限公司	1361 HK	香港证券交易所	中国香港	28,000	96,291.59	0.38
101	Hong Kong Technology Venture Company Limited	香港科技探索有限公司	1137 HK	香港证券交易所	中国香港	23,000	94,788.76	0.37
102	Tiangong Internatio	天工国际有限公司	826 HK	香港证券交易所	中国香港	54,000	94,595.15	0.37

	nal Company Limited			所				
103	Arrail Group Ltd	瑞尔集团 有限公司	6639 HK	香港证 券交易 所	中国香港	13,500	93,474.94	0.37
104	Jacobio Pharmace uticals 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	16,988	92,096.07	0.36
105	iDreamSk y Technolog y Holdings Limited	创梦天地 科技控股 有限公司	1119 HK	香港证 券交易 所	中国香港	28,800	91,873.46	0.36
106	EEKA Fashion Holdings Ltd	赢家时尚 控股有限 公司	3709 HK	香港证 券交易 所	中国香港	9,500	90,215.74	0.36
107	MicroPort NeuroTec h Ltd	微创脑科 学有限公 司	2172 HK	香港证 券交易 所	中国香港	7,000	89,708.65	0.35
108	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	87,887.74	0.35
109	China Dili Group	中国地利 集团	1387 HK	香港证 券交易 所	中国香港	144,000	87,624.98	0.35
110	Fit Hon Teng Limited	鸿腾六零 八八精密 科技股份 有限公司	6088 HK	香港证 券交易 所	中国香港	68,000	87,145.55	0.34
111	Xiabuxiab u Catering Managem ent (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	25,241	85,639.85	0.34
112	Lonking Holdings	中国龙工 控股有限	3339 HK	香港证 券交易	中国香港	72,000	85,633.50	0.34

	Limited	公司		所				
113	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	24,478	85,307.90	0.34
114	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	15,792	84,884.26	0.34
115	Tongdao Liepin Group	同道猎聘集团	6100 HK	香港证券交易所	中国香港	10,123	84,652.16	0.33
116	Ocumension Therapeutics	欧康维视生物	1477 HK	香港证券交易所	中国香港	11,963	84,045.91	0.33
117	Microport Cardioflow Medtech Corp	微创心通医疗科技有限公司	2160 HK	香港证券交易所	中国香港	51,000	83,227.13	0.33
118	SOHO China Ltd	SOHO 中国有限公司	410 HK	香港证券交易所	中国香港	77,000	83,061.18	0.33
119	SY Holdings Group Limited	盛业控股集团有限公司	6069 HK	香港证券交易所	中国香港	17,499	82,766.02	0.33
120	Fosun Tourism Group	复星旅游文化集团	1992 HK	香港证券交易所	中国香港	12,000	81,761.19	0.32
121	China Foods Limited	中国食品有限公司	506 HK	香港证券交易所	中国香港	31,812	81,244.18	0.32
122	Productive Technologies Company Limited	普达特科技有限公司	650 HK	香港证券交易所	中国香港	128,000	80,249.14	0.32
123	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	27,706	79,698.46	0.31

124	Health and Happiness (H&H) International Holdings Limited	健合 (H&H) 国际控股有限公司	1112 HK	香港证券交易所	中国香港	8,500	78,995.25	0.31
125	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	170,000	76,800.93	0.30
126	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	108,000	75,676.12	0.30
127	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	11,858	73,250.02	0.29
128	Guangzhou R&F Properties Co.,Ltd.	广州富力地产股份有限公司	2777 HK	香港证券交易所	中国香港	62,800	72,375.43	0.29
129	Haitong International Securities Group Limited	海通国际证券集团有限公司	665 HK	香港证券交易所	中国香港	117,000	72,274.01	0.29
130	Brii Biosciences Limited	腾盛博药生物科技有限公司	2137 HK	香港证券交易所	中国香港	24,500	70,927.92	0.28
131	China Lilang Limited	中国利郎有限公司	1234 HK	香港证券交易所	中国香港	18,300	70,863.38	0.28
132	Tian Lun Gas Holdings Limited	天伦燃气控股有限公司	1600 HK	香港证券交易所	中国香港	13,719	69,567.54	0.27
133	EC Healthcare	医思健康	2138 HK	香港证券交易所	中国香港	18,000	69,203.82	0.27

134	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	78,910	69,115.77	0.27
135	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	40,646	68,578.88	0.27
136	Hong Kong Aerospace Technology Group Ltd	香港航天科技集团有限公司	1725 HK	香港证券交易所	中国香港	8,400	68,539.99	0.27
137	Shandong Hi-Speed New Energy Group Limited	山高新能源集团有限公司	2954 HK	香港证券交易所	中国香港	20,800	66,928.37	0.26
138	Frontage Holdings Corporation	方达控股公司	1521 HK	香港证券交易所	中国香港	36,161	66,679.44	0.26
139	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	56,000	64,022.29	0.25
140	Asia Cement (China) Holdings Corporation	亚洲水泥(中国)控股公司	743 HK	香港证券交易所	中国香港	17,428	62,184.19	0.25
141	Viva Biotech Holdings	维亚生物科技控股集团	1873 HK	香港证券交易所	中国香港	44,930	62,136.84	0.25
142	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	80,616	58,717.81	0.23
143	China East	中国东方教育控股	667 HK	香港证券交易所	中国香港	21,000	58,278.36	0.23



	Education Holdings Limited	有限公司		所				
144	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	26,420	57,730.15	0.23
145	Truly International Holdings Ltd.	信利国际有限公司	732 HK	香港证券交易所	中国香港	68,000	57,679.07	0.23
146	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	106,000	57,660.63	0.23
147	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	47,447	56,868.74	0.22
148	China Yuhua Education Corporation Limited	中国宇华教育集团有限公司	6169 HK	香港证券交易所	中国香港	70,000	56,793.97	0.22
149	Citychamp Watch & Jewellery Group Limited	冠城钟表珠宝集团有限公司	256 HK	香港证券交易所	中国香港	55,715	56,504.93	0.22
150	Medlive Technology Co Ltd	医脉通科技有限公司	2192 HK	香港证券交易所	中国香港	8,500	54,779.44	0.22
151	Dingdang Health Technology Group Ltd	叮当健康科技集团有限公司	9886 HK	香港证券交易所	中国香港	21,000	54,406.04	0.21

152	Shimao Services Holdings Limited	世茂服务控股有限公司	873 HK	香港证券交易所	中国香港	38,000	54,304.62	0.21
153	Joy Spreader Group Inc.	乐享集团有限公司	6988 HK	香港证券交易所	中国香港	64,000	53,696.12	0.21
154	Sino-Ocean Group Holding Limited	远洋集团控股有限公司	3377 HK	香港证券交易所	中国香港	127,000	51,520.24	0.20
155	Huaxin Cement Co Ltd	华新水泥股份有限公司	6655 HK	香港证券交易所	中国香港	8,200	51,334.00	0.20
156	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	17,882	50,779.49	0.20
157	Texhong International Group Limited	天虹国际集团有限公司	2678 HK	香港证券交易所	中国香港	10,584	50,352.50	0.20
158	Logan Group Company Limited	龙光集团有限公司	3380 HK	香港证券交易所	中国香港	63,000	47,629.49	0.19
159	3D Medicines Inc	-	1244 HK	香港证券交易所	中国香港	500	44,577.73	0.18
160	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	11,298	44,166.09	0.17
161	Yixin Group Limited	易鑫集团有限公司	2858 HK	香港证券交易所	中国香港	60,500	44,066.03	0.17
162	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	34,742	42,601.80	0.17
163	Yonghe	雍禾医疗	2279 HK	香港证	中国香港	6,000	42,595.48	0.17

	Medical Group Co., Ltd.	集团有限公司		券交易所				
164	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	42,997	42,417.34	0.17
165	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	18,767	42,218.83	0.17
166	Powerlong Real Estate Holdings Limited	宝龙地产控股有限公司	1238 HK	香港证券交易所	中国香港	48,000	41,157.19	0.16
167	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	16,844	40,688.16	0.16
168	Kintor Pharmaceutical Limited	开拓药业有限公司	9939 HK	香港证券交易所	中国香港	11,432	37,838.87	0.15
169	Shanghai Chicmax Cosmetic Co Ltd	上海上美化妆品股份有限公司	2145 HK	香港证券交易所	中国香港	1,500	35,957.22	0.14
170	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	41,716	34,615.19	0.14
171	Jinchuan Group International Resources Co. Ltd	金川集团国际资源有限公司	2362 HK	香港证券交易所	中国香港	93,000	34,297.66	0.14
172	Archosaur Games	祖龙娱乐有限公司	9990 HK	香港证券交易所	中国香港	9,000	33,523.19	0.13

	Inc.			所				
173	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	13,777	32,517.42	0.13
174	Linmon Media Ltd	柠萌影视传媒有限公司	9857 HK	香港证券交易所	中国香港	3,500	31,430.30	0.12
175	Clover Biopharmaceuticals, Ltd.	三叶草生物制药有限公司	2197 HK	香港证券交易所	中国香港	30,000	29,042.37	0.11
176	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	62,584	28,273.59	0.11
177	AIM Vaccine Co Ltd	艾美疫苗股份有限公司	6660 HK	香港证券交易所	中国香港	600	24,810.48	0.10
178	Lepu Scientech Medical Technology (Shanghai) Co., Ltd.	乐普心泰医疗科技(上海)股份有限公司	2291 HK	香港证券交易所	中国香港	1,000	24,801.26	0.10
179	Zhihu Inc	知乎	2390 HK	香港证券交易所	中国香港	1,100	18,153.79	0.07
180	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	46,067	16,352.05	0.06
181	Flowing Cloud Technology Ltd	飞天云动科技有限公司	6610 HK	香港证券交易所	中国香港	10,000	15,765.86	0.06

182	Gaush Meditech Ltd	高视医疗科技有限公司	2407 HK	香港证券交易所	中国香港	300	13,262.68	0.05
183	Orbusneic h Medical Group Holdings Ltd	业聚医疗集团控股有限公司	6929 HK	香港证券交易所	中国香港	1,500	12,031.84	0.05
184	Zensun Enterprises Limited	正商实业有限公司	185 HK	香港证券交易所	中国香港	22,000	11,764.46	0.05
185	Zhonglian g Holdings Group Co Ltd	中梁控股集团有限公司	2772 HK	香港证券交易所	中国香港	26,500	11,238.94	0.04
186	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	37,000	9,722.28	0.04
187	Ganglong China Property Group Ltd	港龙中国地产集团有限公司	6968 HK	香港证券交易所	中国香港	28,000	8,906.33	0.04
188	Jenscare Scientific Co Ltd	宁波健世科技股份有限公司	9877 HK	香港证券交易所	中国香港	200	5,845.35	0.02
189	Sipai Health Technology Co Ltd	思派健康科技有限公司	314 HK	香港证券交易所	中国香港	600	4,171.04	0.02
190	Shandong BoAn Biotechnology Co Ltd	山东博安生物技术股份有限公司	6955 HK	香港证券交易所	中国香港	200	3,005.65	0.01
191	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	36,000	0.00	0.00

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	COSCO SHIPPING Energy Transportation Co., Ltd.	1138 HK	419,598.82	1.43
2	New Horizon Health Limited	6606 HK	383,842.94	1.31
3	Shanghai Fudan Microelectronics Group CO.,LTD.	1385 HK	321,534.81	1.10
4	Tianqi Lithium Corp	9696 HK	242,984.60	0.83
5	Xinte Energy Co Ltd	1799 HK	241,156.02	0.82
6	China Merchants Securities Co., Ltd	6099 HK	237,789.44	0.81
7	BOE Varitronix Ltd	710 HK	202,478.16	0.69
8	Carsgen Therapeutics Holdings Limited	2171 HK	188,948.95	0.65
9	Venus Medtech (Hangzhou) Inc.	2500 HK	167,067.02	0.57
10	Yidu Tech Inc.	2158 HK	165,954.51	0.57
11	Kingsoft Cloud Holdings Ltd	3896 HK	149,645.46	0.51
12	Qingdao Ainnovation Technology Group Co Ltd	2121 HK	148,614.36	0.51
13	Kangji Medical Holdings Ltd	9997 HK	134,883.60	0.46
14	Cowell e Holdings Inc.	1415 HK	134,133.34	0.46
15	Microport Cardioflow Medtech Corp	2160 HK	123,822.44	0.42
16	Brii Biosciences Limited	2137 HK	121,475.32	0.42
17	Lepu Biopharma Co Ltd	2157 HK	119,897.00	0.41
18	Guangzhou R&F Properties Co.,Ltd.	2777 HK	111,141.84	0.38
19	ClouDr Group Ltd	9955 HK	106,888.61	0.37
20	China East Education Holdings Limited	667 HK	100,883.83	0.34

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	East Buy Holding Ltd	1797 HK	664,966.65	2.27
2	Zhaojin Mining Industry Company Limited	1818 HK	430,548.11	1.47
3	Haichang Ocean Park Holdings Ltd.	2255 HK	219,569.43	0.75
4	Cafe De Coral Holdings Ltd.	341 HK	178,509.13	0.61
5	Chow Sang Sang Holdings International Ltd.	116 HK	159,430.09	0.55
6	K. Wah International Holdings Ltd.	173 HK	137,503.68	0.47
7	Shun Tak Holdings Ltd.	242 HK	136,684.40	0.47
8	Prudential PLC	2378 HK	130,280.77	0.45
9	Bank of Chongqing Co., Ltd.	1963 HK	127,877.80	0.44
10	Comba Telecom Systems Holdings Ltd.	2342 HK	111,949.61	0.38
11	China New Higher Education Group Limited	2001 HK	100,963.95	0.35
12	Fufeng Group Ltd	546 HK	86,368.93	0.30
13	IGG Inc	799 HK	84,177.20	0.29
14	Aluminum Corporation of China Limited	2600 HK	83,203.83	0.28
15	China Oilfield Services Limited	2883 HK	76,995.38	0.26
16	Beijing Capital International Airport Company Limited	694 HK	74,577.85	0.25
17	Sun Hung Kai & Co. Ltd.	86 HK	71,112.71	0.24
18	Shanghai Junshi Biosciences Co.,Ltd.	1877 HK	69,017.28	0.24
19	Antengene Corporation Limited	6996 HK	64,264.22	0.22
20	China Railway Construction Corporation Limited	1186 HK	59,589.70	0.20

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

2.此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	5,536,244.94
卖出收入（成交）总额	6,671,324.61

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中，山东黄金矿业股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到山东省烟台市应急管理局的处罚。中国铝业股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到贵州省贵阳市应急管理局、山西省晋中市生态环境局灵石分局、山西省太原市娄烦县自然资源局的处罚。中海油田服务股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中华人民共和国滨州海事局、中华人民共和国东营海事局、中华人民共和国唐山海事局的处罚。中远海运能源运输股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中华人民共和国曹妃甸海事局、中华人民共和国新疆海事局、中华人民共和国宁波海事局、中华人民共和国浦东海事局的处罚。

本基金为指数型基金，上述主体所发行的证券系标的指数成份股，上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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	应收清算款	-
3	应收股利	180,468.34
4	应收利息	-
5	应收申购款	17,307.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-



9	合计	197,775.46
---	----	------------

#### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### § 8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）A	3,357	6,136.74	801,376.19	3.89%	19,799,647.97	96.11%
易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）C	1,652	3,022.17	0.00	0.00%	4,992,623.71	100.00%
合计	5,009	5,109.53	801,376.19	3.13%	24,792,271.68	96.87%

#### 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	35.27%
2	娄钧	284,556.00	13.08%
3	夏桂玉	152,900.00	7.03%

4	邓丹娃	74,286.00	3.41%
5	赵伟	63,200.00	2.91%
6	宋协锦	46,788.00	2.15%
7	魏瑞安	45,704.00	2.10%
8	郑蕾	37,879.00	1.74%
9	潘学文	30,000.00	1.38%
10	鲁成伟	29,884.00	1.37%

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	447.94	0.0022%
	易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）C	3,753.24	0.0752%
	合计	4,201.18	0.0164%

### 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	21,677,291.72	5,311,542.96
本报告期基金总申购份额	976,507.76	574,266.68
减：本报告期基金总赎回份额	2,052,775.32	893,185.93
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	20,601,024.16	4,992,623.71

## § 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 2023 年 4 月 22 日发布公告，自 2023 年 4 月 22 日起聘任王骏先生为副总经理级高级管理人员（首席市场官）。

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

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	易方达基金管理有限公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2023-03-24
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会广东监管局
受到的具体措施类型	出具警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	个别规定及制度未严格执行
管理人采取整改措施的情况（如提	已整改完成

出整改意见)	
其他	/

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
CITIC Securities (HK) Company Limited	1	11,038,944.24	90.43%	8,831.38	94.97%	-
GF Securities (Hong Kong) Brokerage Limited	1	1,168,625.50	9.57%	467.43	5.03%	-
Goldman Sachs	1	-	-	0.13	0.00%	-
China Merchants Securities (HK) Co Ltd	1	-	-	-	-	-
Shenyin Wanguo Securities HK Ltd	1	-	-	-	-	-
Haitong International Securities Company Limited	1	-	-	-	-	-
Everbright Securities (International) Limited	1	-	-	-	-	-
Barclays Capital Securities Limited	1	-	-	-	-	-

JP Morgan Securities Limited	1	-	-	-	-	-
State Street Securities Hong Kong Limited	1	-	-	-	-	-
UBS Securities Asia Limited	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
高盛高华	2	-	-	-	-	-
广发证券	5	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易账户，新增交易账户的证券经营机构为 GF Securities (Hong Kong) Brokerage Limited，新增交易单元的证券公司为开源证券股份有限公司、财通证券股份有限公司。

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 (HK) Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
GF Securities (Hong Kong) Brokerage	-	-	-	-	-	-	-	-

Limit ed									
Gold man Sachs	-	-	-	-	244.01	100.00%	-	-	-
China Merchants Securities (HK) Co Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Shen yin Wang uo Securities 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	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Capit al Secur ities Limit ed								
JP Morg an Secur ities Limit ed	-	-	-	-	-	-	-	-
State Street Secur ities Hong Kong Limit ed	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS Secur ities Asia Limit ed	-	-	-	-	-	-	-	-
东方 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高盛 高华	-	-	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	证券时报	2023-01-20
2	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	证券时报	2023-03-30
3	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	2023-03-31
4	关于旗下部分基金 2023 年 4 月 7 日至 2023	证券时报、基金管理人网	2023-04-03

	年 4 月 10 日因港股通非交易日及境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	站及中国证监会基金电子披露网站	
5	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	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	2023-04-08
6	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	证券时报	2023-04-21
7	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	2023-04-22
8	关于旗下部分基金 2023 年 5 月 26 日因港股通非交易日及境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-23

## § 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

二〇二三年八月三十日