

大成恒生综合中小型股指数证券投资基金  
(QDII-LOF)

2017 年半年度报告

2017 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：2017 年 8 月 24 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 22 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 2017 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 境外资产托管人.....	7
2.5 信息披露方式.....	7
2.6 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
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.....	11
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.....	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
6.1 资产负债表.....	16

6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>40</b>
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.....	40
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权益投资明细.....	41
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	67
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	69
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	69
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	69
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细.....	69
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.....	69
7.11 投资组合报告附注.....	70
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>71</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	71
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	71
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	71
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.....	71
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>73</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>74</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	74
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.....	74
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	74
10.4 基金投资策略的改变.....	74
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	74
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.....	74
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	75
10.8 其他重大事件.....	76

<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>80</b>
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 .....	80
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	80
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>81</b>
12.1 备查文件目录.....	81
12.2 存放地点.....	81
12.3 查阅方式.....	81

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）
基金简称	大成恒生综合中小型股指数
场内简称	恒生中小
基金主代码	160922
交易代码	160922
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年12月2日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	117,497,386.45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

### 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	罗登攀	林葛
	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		刘卓	周慕冰

## 2.4 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》、《上海证券报》、《中国证券报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.dcfund.com.cn">http://www.dcfund.com.cn</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

## § 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(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	1,539,961.45
本期利润	7,419,416.84
加权平均基金份额本期利润	0.0494
本期加权平均净值利润率	4.79%
本期基金份额净值增长率	3.59%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	1,873,378.28
期末可供分配基金份额利润	0.0159
期末基金资产净值	121,962,631.60
期末基金份额净值	1.038
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	3.80%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

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

## 3.2 基金净值表现

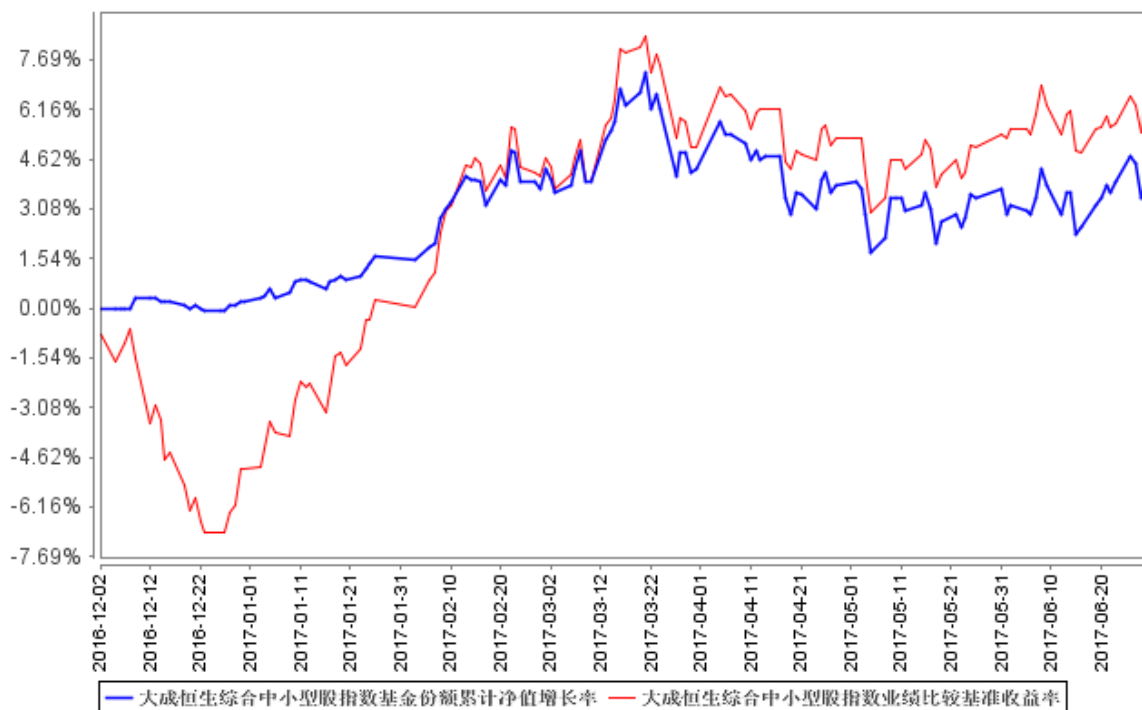
## 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.10%	0.61%	0.96%	0.57%	-0.86%	0.04%
过去三个月	-0.48%	0.59%	1.34%	0.61%	-1.82%	-0.02%
过去六个月	3.59%	0.56%	11.99%	0.67%	-8.40%	-0.11%
自基金	3.80%	0.52%	6.41%	0.69%	-2.61%	-0.17%



合同生效起至今						
---------	--	--	--	--	--	--

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



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内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各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

经过十多年的稳健发展，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2017年6月30日，本基金管理人共管理5只ETF及1只ETF联接基金，4只QDII基金及74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		
冉凌浩先生	本基金基金经理	2016年12月2日	-	14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，历任金融工程师、境外市场研究员及基金经理助理。2011年8月26日起担任大成标普500等权重指数型证券投资基金基金经理。2014年11月13日起担任大成纳斯达克100指数证券投资基金基金经理。2016年12月2日起担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日起担任大成海外中国机会混合型证券投资基金(LOF)基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

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

## 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金本报告期内无境外投资顾问。

## 4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

### 4.4.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易存在 4 笔同日反向交易，原因为投资策略需要。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易，但不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量 5% 的情形；主动投资组合间债券交易存在 6 笔同日反向交易，原因为投资策略需要。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

2017 年上半年，国际宏观经济状况运行较为平稳。从全球经济来看，美国仍然处于经济增长

周期的进程之中，欧洲、日本及主要新兴市场国家的宏观经济也都有正常的正增长。

香港股票市场在上半年出现了显著的上涨，这是因为香港股票市场走势主要是由基本面及企业盈利推动。由于以中国大陆业务为主的上市公司占港股七成以上的市值，且中国大陆宏观经济增长有望在新的平衡区间内实现增长，因此港股企业盈利预计将在持续两年的下跌之后迎来新的增长。而港股的主要投资者都看到了此趋势，新增资金不断涌入港股，使港股出现了显著的上涨。

对于大部分专注中国大陆公司的投资者而言，港股的基本面正在逐步改善，上市公司盈利在稳步反弹，同时配置需求有望持续推动南向资金流入，而港股的风险回报率仍然远好于 A 股。

本基金跟踪恒生综合中小型指数，标的指数能够代表香港中小型股票的整体表现。同时，标的指数的行业分布更为均匀，更侧重于消费（含医药）行业，并对 IT 行业也有较好的覆盖，是新经济的代表。

本基金在一季度逐步择机建仓，在一季度末已经将仓位提升至符合基金合同要求的水平。

#### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.038 元；本报告期基金份额净值增长率为 3.59%，业绩比较基准收益率为 11.99%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在香港股票市场经历了显著上涨及二季度后期出现的小幅盘整后，我们认为港股的投资价值依然显著，主要原因有以下几点：

##### （1）低估值

香港股票市场估值水平位居全球主要市场较低水平，不仅大幅低于 A 股主要指数，也低于美国等成熟市场，还低于亚太地区其他主要股票市场，是价值投资的最佳标的之一。

##### （2）宏观经济平稳增长

香港股票市场的涨跌依赖宏观经济的变动。未来两年全球经济增速预计将稳步增长，同时中国大陆经济转入新常态，未来或还会保持稳健的中高速增长，这将会为港股带来较好的利润增长。

##### （3）企业盈利预期稳健增长

香港股票市场的涨跌严重依赖上市企业的盈利变动。过往两年港股上市公司盈利出现了衰退，所以港股整体没有上涨。但未来两年，全球及中国大陆经济增长会推动港股上市公司盈利增长。来自彭博的一致预期显示，未来两年港股盈利增速由负转正，且年平均增速高达两位数左右的水

平，这有望推动港股出现稳健上涨趋势。

但是，由于以中国大陆业务为主的上市公司占港股七成以上的市值，同时中国大陆还是有一定的经济风险隐患因素，其中最主要的是整体金融杠杆率较高因素以及房地产风险因素等等，因此这些经济风险可能会造成港股市场的波动。

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、风险管理部、基金运营部、监察稽核部、社保基金及机构投资部指定人员组成。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两名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益总部、风险管理部和社保基金及机构投资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；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，基金经理及投资经理作为估值小组成员，对本基金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/中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间

同业市场交易的债券品种/在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）的估值数据。

#### **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**

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人一大成基金管理有限公司 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，大成基金管理有限公司的信息披露事务符合《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半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有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：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	8,832,314.04	70,236,952.03
结算备付金		-	8,741,811.47
存出保证金		-	1,994,025.33
交易性金融资产	6.4.7.2	115,129,542.47	39,070,978.56
其中：股票投资		115,129,542.47	39,070,978.56
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	100,000,000.00
应收证券清算款		1,046,096.99	25,022,891.94
应收利息	6.4.7.5	1,619.89	27,435.82
应收股利		821,769.73	6,361.50
应收申购款		3,595.83	111,224.27
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		125,834,938.95	245,211,680.92
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 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		-	-
应付证券清算款		-	8,741,818.08
应付赎回款		3,375,560.40	5,532,061.25
应付管理人报酬		105,216.85	306,390.78
应付托管费		26,304.22	76,597.68
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	110,860.77	31,577.81



应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	254,365.11	33,105.05
负债合计		3,872,307.35	14,721,550.65
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	117,497,386.45	229,969,061.64
未分配利润	6.4.7.10	4,465,245.15	521,068.63
所有者权益合计		121,962,631.60	230,490,130.27
负债和所有者权益总计		125,834,938.95	245,211,680.92

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0380 元，基金份额总额 117,497,386.45 份。

## 6.2 利润表

公告主体：大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		8,851,309.14
1. 利息收入		547,321.84
其中：存款利息收入	6.4.7.11	119,285.68
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		428,036.16
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,323,023.46
其中：股票投资收益	6.4.7.12	812,370.54
基金投资收益	6.4.7.13	-
债券投资收益	6.4.7.14	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-
股利收益	6.4.7.17	1,510,652.92
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	5,879,455.39
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-86,064.57
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	187,573.02
<b>减：二、费用</b>		1,431,892.30
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	775,795.43

2. 托管费	6.4.10.2.2	193,948.88
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.20	228,930.06
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.21	233,217.93
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>7,419,416.84</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>7,419,416.84</b>

注：本基金合同生效日为2016年12月2日，截止报告期末本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

### 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：2017年1月1日至2017年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017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）	229,969,061.64	521,068.63	230,490,130.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	7,419,416.84	7,419,416.84
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）	-112,471,675.19	-3,475,240.32	-115,946,915.51
其中：1.基金申购款	32,469,348.40	1,637,794.30	34,107,142.70
2.基金赎回款	-144,941,023.59	-5,113,034.62	-150,054,058.21
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）	117,497,386.45	4,465,245.15	121,962,631.60
项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016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)	-	-	-
二、本期经营活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)	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	-	-	-

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：

          罗登攀  周立新  崔伟            
 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 基金基本情况

大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]第 2047 号《关于准予大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）注册的批复》以及中国证监会证券基金机构监管部机构部函[2016]1651 号《关于大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）延期募集备案的回函》核准，由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 788,161,803.26 元，业经普华永道

中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字（2016）第 1578 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）基金合同》于 2016 年 12 月 2 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 788,370,205.40 份基金份额，其中认购资金利息折合 208,402.14 份基金份额。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司，境外资产托管人为摩根大通银行。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股，也可以投资于以标的指数为跟踪标的的公募基金、上市交易型基金、结构性产品等。本基金可通过沪港股票市场交易互联互通机制（以下简称“沪港通”）投资于沪港通允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票。本基金还可以投资于全球证券市场中具有良好流动性的其他金融工具，包括在证券交易市场挂牌的普通股、优先股、存托凭证，固定收益类证券（含中期票据）、银行存款、现金等货币市场工具、权证、股指期货以及中国证监会允许本基金投资的其他产品或金融工具。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%，投资于以标的指数为跟踪标的的公募基金、上市交易型基金、结构性产品的比例不超过基金资产净值的 10%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：恒生综合中小型股指数收益率 $\times$ 95%+人民币活期存款利率（税后） $\times$ 5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间 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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30

日止期间 的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **6.4.4 重要会计政策和会计估计**

##### **6.4.4.1 会计年度**

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间。

##### **6.4.4.2 记账本位币**

本基金的记账本位币为人民币。

##### **6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类**

###### **(1) 金融资产的分类**

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

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

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

###### **(2) 金融负债的分类**

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

##### **6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认**

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申

购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 6.4.4.8 损益平准金

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

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### **6.4.4.12 外币交易**

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

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

#### **6.4.4.13 分部报告**

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### **6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计**

本基金在本报告期间无须说明其他重要的会计政策和会计估计。

### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

#### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。



### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[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》及其他相关境内外税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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，在境内不予征收营业税(于 2016 年 5 月 1 日前)或增值税(自 2016 年 5 月 1 日起)且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。

### 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 2017 年 6 月 30 日
活期存款	8,832,314.04
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	8,832,314.04

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	109,651,458.77	115,129,542.47	5,478,083.70

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	109,651,458.77	115,129,542.47	5,478,083.70

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融工具。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	1,619.89
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	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	1,619.89

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	110,860.77
银行间市场应付交易费用	-
合计	110,860.77

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付指数授权费	43,287.41
应付赎回费	12,721.61
预提费用	198,356.09
合计	254,365.11

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	229,969,061.64	229,969,061.64
本期申购	32,469,348.40	32,469,348.40
本期赎回(以“-”号填列)	-144,941,023.59	-144,941,023.59
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	117,497,386.45	117,497,386.45

#### 6.4.7.10 未分配利润

金额单位：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	849,386.08	-328,317.45	521,068.63
本期利润	1,539,961.45	5,879,455.39	7,419,416.84
本期基金份额交易产生的变动数	-515,969.25	-2,959,271.07	-3,475,240.32
其中：基金申购款	92,083.57	1,545,710.73	1,637,794.30

基金赎回款	-608,052.82	-4,504,981.80	-5,113,034.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,873,378.28	2,591,866.87	4,465,245.15

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	95,024.34
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	20,936.99
其他	3,324.35
合计	119,285.68

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	19,375,149.93
减：卖出股票成本总额	18,562,779.39
买卖股票差价收入	812,370.54

#### 6.4.7.13 基金投资收益

本报告期内本基金无基金投资收益。

#### 6.4.7.14 债券投资收益

本报告期内本基金无债券投资收益。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

本报告期内本基金无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

本报告期内本基金无衍生工具收益。

**6.4.7.17 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,510,652.92
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,510,652.92

**6.4.7.18 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	5,879,455.39
——股票投资	5,879,455.39
——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	-
合计	5,879,455.39

**6.4.7.19 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	187,573.02
合计	187,573.02

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

**6.4.7.20 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	228,930.06

银行间市场交易费用	-
合计	228,930.06

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	148,767.52
银行汇划费	3,830.09
上市费	29,752.78
指数授权费	31,031.75
合计	233,217.93

#### 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，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须做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
大成基金管理有限公司（“大成基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
摩根大通银行	境外资产托管人
中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东
光大证券股份有限公司（“光大证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东
大成国际资产管理有限公司（“大成国际”）	基金管理人的子公司
大成创新资本管理有限公司（“大成创新”）	基金管理人的合营企业

资本”)

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。

**6.4.10 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**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
光大证券	99,103,714.74	91.10%

**6.4.10.1.2 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣 金总量的 比例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
光大证券	79,282.96	90.85%	110,860.77	100.00%

**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 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	775,795.43
其中：支付销售机构的客户维护费	322,011.16

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 1.0% 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 X 1.0% / 当年天数。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
当期发生的基金应支付的托管费	193,948.88	

注：支付基金托管人中国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 X 0.25% / 当年天数。

**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**

本报告期内本基金未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

**6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

**6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

**6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	6,985,558.67	95,024.34

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本报告期内本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期内无利润分配。



#### **6.4.12 期末（2017 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**

于本报告期末，本基金未持有因认购新发或增发证券而流通受限的证券。

##### **6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

于本报告期末，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### **6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### **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、债券投资及权证投资等。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。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

为了规避信用风险，本公司在交易前对交易对手的资信状况进行充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行 中国银行及境外次托管行中银香港，与该等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。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种的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。

于本报告期末，本基金未持有债券投资（上年度报告期末：同）。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，均能以合理价格适时变现。

于本报告期末，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 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、应收申购款等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017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	8,832,314.04	-	-	-	8,832,314.04
交易性金融资产	-	-	-	115,129,542.47	115,129,542.47
应收证券清算款	-	-	-	1,046,096.99	1,046,096.99
应收股利	-	-	-	821,769.73	821,769.73
应收利息	-	-	-	1,619.89	1,619.89
应收申购款	8.95	-	-	3,586.88	3,595.83
资产总计	8,832,322.99	-	-	117,002,615.96	125,834,938.95
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,375,560.40	3,375,560.40
应付管理人报酬	-	-	-	105,216.85	105,216.85
应付托管费	-	-	-	26,304.22	26,304.22
应付交易费用	-	-	-	110,860.77	110,860.77
其他负债	-	-	-	254,365.11	254,365.11
负债总计	-	-	-	3,872,307.35	3,872,307.35
利率敏感度缺口	8,832,322.99	-	-	-113,130,308.61	121,962,631.60
上年度末	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

2016年12月31日					
资产					
银行存款	70,236,952.03	-	-	-	70,236,952.03
结算备付金	8,741,811.47	-	-	-	8,741,811.47
存出保证金	1,994,025.33	-	-	-	1,994,025.33
买入返售金融资产	100,000,000.00	-	-	-	100,000,000.00
交易性金融资产	-	-	-	39,070,978.56	39,070,978.56
应收证券清算款	-	-	-	25,022,891.94	25,022,891.94
应收股利	-	-	-	6,361.50	6,361.50
应收利息	-	-	-	27,435.82	27,435.82
应收申购款	-	-	-	111,224.27	111,224.27
资产总计	180,972,788.83	-	-	64,238,892.09	245,211,680.92
负债					
应付证券清算款	-	-	-	8,741,818.08	8,741,818.08
应付赎回款	-	-	-	5,532,061.25	5,532,061.25
应付管理人报酬	-	-	-	306,390.78	306,390.78
应付托管费	-	-	-	76,597.68	76,597.68
应付交易费用	-	-	-	31,577.81	31,577.81
其他负债	-	-	-	33,105.05	33,105.05
负债总计	-	-	-	14,721,550.65	14,721,550.65
利率敏感度缺口	180,972,788.83	-	-	49,517,341.44	230,490,130.27

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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，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。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				

银行存款	-	1,846,755.37	-	1,846,755.37
交易性金融资产	-	6,757,402.94	-	6,757,402.94
应收股利	-	12,838.10	-	12,838.10
应收证券清算款	-	218,057.46	-	218,057.46
资产合计	-	8,835,053.87	-	8,835,053.87
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	8,835,053.87	-	8,835,053.87
项目	上年度末 2016年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	4,472,550.00	-	4,472,550.00
应收股利	-	1,545.71	-	1,545.71
资产合计	-	4,474,095.71	-	4,474,095.71
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	4,474,095.71	-	4,474,095.71

#### 6.4.13.4.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除美元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（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）
	美元相对人民币升值5%	6,098,130.00	11,524,510.00
	美元相对人民币贬值5%	-6,098,130.00	-11,524,510.00

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于标的指数成份股、备选成份

股的比例不低于非现金基金资产的 80%，投资于以标的指数为跟踪标的的公募基金、上市交易型基金、结构性产品的比例不超过基金资产净值的 10%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金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。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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	115,129,542.47	94.40	39,070,978.56	16.95
交易性金融资产-基金投资	-	0.00	-	0.00
交易性金融资产-债券投资	-	0.00	-	0.00
交易性金融资产-贵金属投资	-	0.00	-	0.00
衍生金融资产-权证投资	-	0.00	-	0.00
其他	-	0.00	-	0.00
合计	115,129,542.47	94.40	39,070,978.56	16.95

#### 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(附注 6.4.1)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(2017年6月30日)	上年度末(2016年12月31日)
	1. 业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%	4,600,000.00	520,000.00
2. 业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-4,600,000.00	-520,000.00	

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[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》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 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。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

## § 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	115,129,542.47	91.49
	其中: 普通股票	115,129,542.47	91.49
	存托凭证	-	0.00
	优先股	-	0.00
	房地产信托凭证	-	0.00
2	基金投资	-	0.00
3	固定收益投资	-	0.00
	其中: 债券	-	0.00
	资产支持证券	-	0.00
4	金融衍生品投资	-	0.00
	其中: 远期	-	0.00
	期货	-	0.00
	期权	-	0.00
	权证	-	0.00
5	买入返售金融资产	-	0.00
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
6	货币市场工具	-	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	8,832,314.04	7.02
8	其他各项资产	1,873,082.44	1.49
9	合计	125,834,938.95	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 107,787,459.53 元, 占期末基金资产净值的比例为 88.38%。

## 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 (%)
香港	115,129,542.47	94.40
合计	115,129,542.47	94.40



### 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 (%)
工业	21,178,429.23	17.36
消费者非必需品	18,385,736.92	15.07
信息技术	15,435,018.10	12.66
房地产	14,769,925.47	12.11
金融	14,258,687.93	11.69
基础材料	10,253,269.26	8.41
医疗保健	8,140,707.71	6.67
公用事业	5,463,565.07	4.48
消费者常用品	3,072,567.00	2.52
能源	2,275,043.98	1.87
电信服务	1,896,591.80	1.56
合计	115,129,542.47	94.40

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

### 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

#### 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	SUNNY OPTICAL TECH	舜宇光学科技	2382 HK	港交所	中国香港	34,000	2,065,649.60	1.69
2	SINOPHARM GROUP	国药控股	1099	港	中国	56,000	1,715,704.26	1.41

	CO-H		HK	交 所	香 港			
3	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	海螺水泥	914 HK	港 交 所	中 国 香 港	58,000	1,366,713.62	1.12
4	CITIC SECURITIES CO LTD-H	中信证券	6030 HK	港 交 所	中 国 香 港	96,500	1,351,794.08	1.11
5	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	融创中国	1918 HK	港 交 所	中 国 香 港	91,000	1,288,965.35	1.06
6	NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	新华保险	1336 HK	港 交 所	中 国 香 港	36,500	1,257,659.48	1.03
7	CRRR CORP LTD - H	中国中车	1766 HK	港 交 所	中 国 香 港	206,000	1,255,116.47	1.03
8	BYD CO LTD-H	比亚迪	1211 HK	港 交 所	中 国 香 港	30,000	1,247,201.04	1.02
9	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	长城汽车	2333 HK	港 交 所	中 国 香 港	146,000	1,221,545.32	1.00
10	CHINA VANKE CO LTD-H	万科	2202 HK	港 交 所	中 国 香 港	62,000	1,189,223.98	0.98
11	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	广汽集团	2238 HK	港 交 所	中 国 香 港	98,000	1,165,269.39	0.96
12	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	ASM 太平 洋	522 HK	港 交 所	中 国 香 港	12,500	1,144,569.50	0.94
13	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	海螺创业	586 HK	港 交 所	中 国 香 港	85,000	1,054,956.76	0.86
14	GF SECURITIES CO LTD-H	广发证券	1776 HK	港 交 所	中 国 香 港	76,200	1,037,004.70	0.85
15	DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	东风集团 股份	489 HK	港 交 所	中 国 香 港	128,000	1,025,395.40	0.84
16	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	中国中铁	390 HK	港 交 所	中 国 香 港	188,000	1,003,489.10	0.82

17	HUATAI SECURITIES CO LTD-H	华泰证券	6886 HK	港交所	中国香港	77,000	1,002,447.60	0.82
18	CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	中国银河	6881 HK	港交所	中国香港	165,000	1,002,447.60	0.82
19	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	中芯国际	981 HK	港交所	中国香港	127,000	997,543.85	0.82
20	PEOPLES INSURANCE CO GROU-H	中国人民保险集团	1339 HK	港交所	中国香港	349,000	993,525.38	0.81
21	MINTH GROUP LTD	敏实集团	425 HK	港交所	中国香港	34,000	976,757.17	0.80
22	MEITU INC	美图公司	1357 HK	港交所	中国香港	129,500	955,362.94	0.78
23	CGN POWER CO LTD-H	中广核电力	1816 HK	港交所	中国香港	501,000	947,924.87	0.78
24	HUANENG POWER INTL INC-H	华能国际电力股份有限公司	902 HK	港交所	中国香港	200,000	940,825.28	0.77
25	HYSAN DEVELOPMENT CO	希慎兴业	14 HK	港交所	中国香港	29,000	937,570.58	0.77
26	VTECH HOLDINGS LTD	伟易达集团	303 HK	港交所	中国香港	8,300	891,102.14	0.73
27	KINGBOARD CHEMICAL HOLDINGS	建滔化工	148 HK	港交所	中国香港	32,000	863,753.98	0.71
28	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	中国民航信息网络	696 HK	港交所	中国香港	42,000	838,410.72	0.69
29	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	中国铁建	1186 HK	港交所	中国香港	93,000	821,694.58	0.67
30	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	中车时代电气	3898 HK	港交所	中国香港	24,500	814,412.73	0.67
31	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	玖龙纸业	2689 HK	港交所	中国香港	88,000	794,320.38	0.65

				所				
32	PCCW LTD	电讯盈科	8 HK	港交所	中国香港	200,000	770,712.96	0.63
33	CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	康哲药业	867 HK	港交所	中国香港	64,000	749,882.88	0.61
34	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	信义玻璃	868 HK	港交所	中国香港	110,000	737,992.38	0.61
35	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	龙源电力	916 HK	港交所	中国香港	149,000	734,538.05	0.60
36	FAR EAST HORIZON LTD	远东宏信	3360 HK	港交所	中国香港	121,000	715,174.76	0.59
37	AIR CHINA LTD-H	中国国航	753 HK	港交所	中国香港	96,000	670,728.58	0.55
38	BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	北京首都机场	694 HK	港交所	中国香港	70,000	668,298.40	0.55
39	JIANGXI COPPER CO LTD-H	江西铜业	358 HK	港交所	中国香港	59,000	656,477.33	0.54
40	KINGSOFT CORP LTD	金山软件	3888 HK	港交所	中国香港	37,000	653,500.36	0.54
41	MELCO INTERNATIONAL DEVELOP.	新濠国际发展	200 HK	港交所	中国香港	36,000	653,023.01	0.54
42	CHINA EVERBRIGHT LTD	中国光大控股	165 HK	港交所	中国香港	44,000	649,204.16	0.53
43	HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	海天国际	1882 HK	港交所	中国香港	34,000	646,253.23	0.53
44	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	中国铝业股份有限公司	2600 HK	港交所	中国香港	186,000	645,732.48	0.53
45	CHINA COAL ENERGY CO-H	中煤能源	1898 HK	港交所	中国香港	193,000	633,182.36	0.52
46	FUYAO GLASS	福耀玻璃	3606	港交所	中国	24,000	622,819.39	0.51

	INDUSTRY GROUP-H		HK	交 所	香 港			
47	SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	上海医药	2607 HK	港 交 所	中 国 香 港	30,700	619,499.60	0.51
48	FIRST PACIFIC CO	第一太平	142 HK	港 交 所	中 国 香 港	122,000	609,904.74	0.50
49	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	紫金矿业	2899 HK	港 交 所	中 国 香 港	270,000	604,593.07	0.50
50	COSCO SHIPPING PORTS LTD	中远海运 港口	1199 HK	港 交 所	中 国 香 港	76,000	604,211.19	0.50
51	ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	浙江沪杭 甬	576 HK	港 交 所	中 国 香 港	68,000	601,989.31	0.49
52	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	上海石化	338 HK	港 交 所	中 国 香 港	164,000	594,976.52	0.49
53	ZTE CORP-H	中兴通讯	763 HK	港 交 所	中 国 香 港	36,200	585,644.64	0.48
54	HUI XIAN REIT	#N/A	87001 HK	沪 港 通	中 国 香 港	188,000	584,680.00	0.48
55	SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	四环医药	460 HK	港 交 所	中 国 香 港	201,000	570,457.78	0.47
56	WEICHAI POWER CO LTD-H	潍柴动力	2338 HK	港 交 所	中 国 香 港	96,000	569,910.99	0.47
57	VITASOY INTL HOLDINGS LTD	维他奶国 际	345 HK	港 交 所	中 国 香 港	40,000	557,551.81	0.46
58	FORTUNE REIT	#N/A	778 HK	港 交 所	中 国 香 港	66,000	555,069.56	0.46
59	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	中国建材	3323 HK	港 交 所	中 国 香 港	136,000	547,692.24	0.45
60	TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	青岛啤酒	168 HK	港 交 所	中 国 香 港	18,000	539,759.45	0.44

61	CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	重庆农村商业银行	3618 HK	港交所	中国香港	118,000	539,724.73	0.44
62	JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	宁沪高速	177 HK	港交所	中国香港	56,000	535,610.79	0.44
63	YANZHOU COAL MINING CO-H	兖州煤业	1171 HK	港交所	中国香港	88,000	534,638.72	0.44
64	SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	远洋集团	3377 HK	港交所	中国香港	159,500	528,814.98	0.43
65	SHENZHEN INTL HOLDINGS	深圳国际	152 HK	港交所	中国香港	41,500	515,787.50	0.42
66	ORIENT OVERSEAS INTL LTD	东方海外国际	316 HK	港交所	中国香港	10,500	510,336.96	0.42
67	GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	富力地产	2777 HK	港交所	中国香港	48,000	505,754.34	0.41
68	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	比亚迪电子	285 HK	港交所	中国香港	37,000	497,109.86	0.41
69	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	南方航空	1055 HK	港交所	中国香港	86,000	492,631.39	0.40
70	IGG INC	IGG	799 HK	港交所	中国香港	47,000	491,138.57	0.40
71	3SBIO INC	三生制药	1530 HK	港交所	中国香港	53,500	481,053.34	0.39
72	GOME ELECTRICAL APPLIANCES	国美电器	493 HK	港交所	中国香港	569,000	474,092.62	0.39
73	SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	复星医药	2196 HK	港交所	中国香港	18,000	472,582.44	0.39
74	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	理文造纸	2314 HK	港交所	中国香港	75,000	471,931.50	0.39
75	SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	山东威高	1066 HK	港交所	中国香港	88,000	468,190.76	0.38

				所				
76	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	中国宏桥	1378 HK	港交所	中国香港	76,500	468,090.95	0.38
77	CHINA OILFIELD SERVICES-H	中海油服	2883 HK	港交所	中国香港	86,000	467,253.41	0.38
78	SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	上海实业控股	363 HK	港交所	中国香港	23,000	461,125.90	0.38
79	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	洛阳钼业	3993 HK	港交所	中国香港	177,000	459,329.30	0.38
80	AGILE GROUP HOLDINGS LTD	雅居乐集团	3383 HK	港交所	中国香港	74,000	459,216.47	0.38
81	DAH SING FINANCIAL HOLDINGS	大新金融	440 HK	港交所	中国香港	8,000	455,137.25	0.37
82	GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	保利协鑫能源	3800 HK	港交所	中国香港	613,000	452,229.72	0.37
83	MAN WAH HOLDINGS LTD	敏华控股	1999 HK	港交所	中国香港	72,000	438,056.58	0.36
84	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	中国通信服务	552 HK	港交所	中国香港	112,000	437,431.68	0.36
85	SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	上海电气	2727 HK	港交所	中国香港	134,000	436,129.80	0.36
86	NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	耐世特汽车公司	1316 HK	港交所	中国香港	41,000	435,556.97	0.36
87	SHENZHEN INVESTMENT LTD	深圳控股	604 HK	港交所	中国香港	144,000	431,182.66	0.35
88	CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	中国金茂	817 HK	港交所	中国香港	150,000	419,205.36	0.34
89	LUK FOOK HOLDINGS INTL LTD	六福集团	590 HK	港交所	中国香港	18,000	417,122.35	0.34
90	LI NING CO LTD	李宁	2331	港	中国	80,000	412,435.58	0.34

			HK	交 所	香 港			
91	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	信义光能	968 HK	港 交 所	中 国 香 港	212,000	410,317.86	0.34
92	CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	光大银行	6818 HK	港 交 所	中 国 香 港	129,000	408,660.13	0.34
93	CHAMPION REIT	#N/A	2778 HK	港 交 所	中 国 香 港	94,000	405,474.87	0.33
94	HAITONG INTERNATIONAL SECURI	海通国际	665 HK	港 交 所	中 国 香 港	101,000	404,112.23	0.33
95	CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	中国再保 险	1508 HK	港 交 所	中 国 香 港	267,000	400,900.93	0.33
96	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	中航科工	2357 HK	港 交 所	中 国 香 港	100,000	397,507.36	0.33
97	SKYWORTH DIGITAL HLDGS LTD	创维数码	751 HK	港 交 所	中 国 香 港	94,000	395,684.73	0.32
98	TELEVISION BROADCASTS LTD	电视广播	511 HK	港 交 所	中 国 香 港	15,500	395,511.14	0.32
99	CAFE DE CORAL HOLDINGS LTD	大家乐集 团	341 HK	港 交 所	中 国 香 港	18,000	395,250.77	0.32
100	HUANENG RENEWABLES CORP-H	华能新能 源	958 HK	港 交 所	中 国 香 港	188,000	393,237.19	0.32
101	COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	中远海控	1919 HK	港 交 所	中 国 香 港	121,500	389,118.91	0.32
102	JOHNSON ELECTRIC HOLDINGS	德昌电机 控股	179 HK	港 交 所	中 国 香 港	16,500	388,806.46	0.32
103	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	#N/A	405 HK	港 交 所	中 国 香 港	92,000	387,265.90	0.32
104	CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	旭辉控股 集团	884 HK	港 交 所	中 国 香 港	128,000	385,495.35	0.32



105	ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	中升控股	881 HK	港交所	中国香港	30,500	385,425.91	0.32
106	GREAT EAGLE HOLDINGS LTD	鹰君	41 HK	港交所	中国香港	11,000	379,020.66	0.31
107	BBMG CORP-H	金隅股份	2009 HK	港交所	中国香港	110,000	376,156.53	0.31
108	CHINA POWER INTERNATIONAL	中国电力	2380 HK	港交所	中国香港	156,000	375,045.59	0.31
109	YUEXIU PROPERTY CO LTD	越秀地产	123 HK	港交所	中国香港	322,000	371,695.42	0.30
110	PACIFIC TEXTILES HOLDINGS	互太纺织	1382 HK	港交所	中国香港	47,000	367,538.08	0.30
111	CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	中国国际金融股份有限公司	3908 HK	港交所	中国香港	36,000	359,943.78	0.30
112	CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	中国软件国际	354 HK	港交所	中国香港	100,000	359,318.88	0.29
113	BAIC MOTOR CORP LTD-H	北京汽车	1958 HK	港交所	中国香港	54,500	358,073.41	0.29
114	SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	中石化炼化工程	2386 HK	港交所	中国香港	58,500	357,444.17	0.29
115	SINOTRANS LIMITED-H	中国外运	598 HK	港交所	中国香港	102,000	354,111.36	0.29
116	BOC AVIATION LTD	中银航空租赁	2588 HK	港交所	中国香港	9,800	351,281.94	0.29
117	KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	建滔积层板	1888 HK	港交所	中国香港	42,500	347,471.77	0.28
118	TONGDA GROUP HOLDINGS LTD	通达集团	698 HK	港交所	中国香港	170,000	343,783.11	0.28
119	VALUE PARTNERS GROUP LTD	惠理集团	806 HK	港交所	中国香港	55,000	339,400.12	0.28

				所				
120	CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	中国通号	3969 HK	港 交 所	中 国 香 港	64,000	334,392.22	0.27
121	UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	统一企业 中国	220 HK	港 交 所	中 国 香 港	61,000	334,071.09	0.27
122	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	海丰国际	1308 HK	港 交 所	中 国 香 港	62,000	330,399.79	0.27
123	CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	中国中药	570 HK	港 交 所	中 国 香 港	84,000	328,073.76	0.27
124	SOHO CHINA LTD	SOHO 中 国	410 HK	港 交 所	中 国 香 港	98,000	327,466.22	0.27
125	LEGEND HOLDINGS CORP-H	联想控股	3396 HK	港 交 所	中 国 香 港	17,500	325,036.04	0.27
126	CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	东方航空	670 HK	港 交 所	中 国 香 港	76,000	317,936.45	0.26
127	FIH MOBILE LTD	富智康集 团	2038 HK	港 交 所	中 国 香 港	150,000	313,753.08	0.26
128	CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	中国粮油 控股	606 HK	港 交 所	中 国 香 港	111,000	312,138.75	0.26
129	CHINA RESOURCES CEMENT	华润水泥 控股	1313 HK	港 交 所	中 国 香 港	92,000	309,812.72	0.25
130	METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	中国中冶	1618 HK	港 交 所	中 国 香 港	135,000	309,326.69	0.25
131	DATANG INTL POWER GEN CO-H	大唐发电	991 HK	港 交 所	中 国 香 港	140,000	302,556.91	0.25
132	ESPRIT HOLDINGS LTD	思捷环球	330 HK	港 交 所	中 国 香 港	82,400	297,509.09	0.24
133	TONG REN TANG TECHNOLOGIES-H	同仁堂科 技	1666 HK	港 交 所	中 国 香 港	28,000	293,079.23	0.24
134	KWG PROPERTY	合景泰富	1813	港	中 国	64,500	292,779.79	0.24

	HOLDING LTD		HK	交 所	香 港			
135	LUYE PHARMA GROUP LTD	绿叶制药	2186 HK	港 交 所	中 国 香 港	78,000	289,746.41	0.24
136	LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO L	龙光地产	3380 HK	港 交 所	中 国 香 港	64,000	286,066.43	0.23
137	POLY PROPERTY GROUP CO LTD	保利置业集团	119 HK	港 交 所	中 国 香 港	95,000	282,811.73	0.23
138	DAH SING BANKING GROUP LTD	大新银行集团	2356 HK	港 交 所	中 国 香 港	19,600	282,726.68	0.23
139	MMG LTD	五矿资源	1208 HK	港 交 所	中 国 香 港	112,000	279,956.28	0.23
140	SHUI ON LAND LTD	瑞安房地 产	272 HK	港 交 所	中 国 香 港	170,000	278,862.70	0.23
141	HYBRID KINETIC GROUP LTD	正道集团	1188 HK	港 交 所	中 国 香 港	1,642,000	277,899.30	0.23
142	GUOTAI JUNAN INTERNATIONAL	国泰君安 国际	1788 HK	港 交 所	中 国 香 港	131,000	275,148.00	0.23
143	YINGDE GASES GROUP CO LTD	盈德气体	2168 HK	港 交 所	中 国 香 港	52,500	273,850.46	0.22
144	CHINA MERCHANTS SECURITIES-H	招商证券	6099 HK	港 交 所	中 国 香 港	25,400	270,714.66	0.22
145	PACIFIC BASIN SHIPPING LTD	太平洋航 运	2343 HK	港 交 所	中 国 香 港	178,000	265,722.39	0.22
146	CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	中国联塑	2128 HK	港 交 所	中 国 香 港	51,000	265,583.52	0.22
147	COSCO SHIPPING DEVELOPMENT-H	中远海发	2866 HK	港 交 所	中 国 香 港	177,000	264,229.56	0.22
148	BRIGHTOIL PETROLEUM HOLDINGS	光汇石油	933 HK	港 交 所	中 国 香 港	144,000	263,708.81	0.22

149	ANGANG STEEL CO LTD-H	鞍钢股份	347 HK	港交所	中国香港	52,000	262,667.31	0.22
150	K WAH INTL HOLDINGS	嘉华国际	173 HK	港交所	中国香港	63,000	259,178.27	0.21
151	CHINA RESOURCES PHOENIX HEAL	华润凤凰医疗	1515 HK	港交所	中国香港	30,500	254,391.69	0.21
152	KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	金蝶国际	268 HK	港交所	中国香港	90,000	253,866.60	0.21
153	YUZHOU PROPERTIES CO	禹洲地产	1628 HK	港交所	中国香港	63,000	252,616.80	0.21
154	HKBN LTD	香港宽频网络有限公司	1310 HK	港交所	中国香港	35,500	240,635.16	0.20
155	KERRY LOGISTICS NETWORK LTD	嘉里物流	636 HK	港交所	中国香港	24,000	240,379.12	0.20
156	DFZQ-H	东方证券	3958 HK	港交所	中国香港	36,400	235,678.47	0.19
157	XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	金风科技	2208 HK	港交所	中国香港	23,600	233,505.20	0.19
158	GIORDANO INTERNATIONAL LTD	佐丹奴国际	709 HK	港交所	中国香港	60,000	231,734.64	0.19
159	HUADIAN POWER INTL CORP-H	华电国际	1071 HK	港交所	中国香港	76,000	230,207.10	0.19
160	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	招金矿业	1818 HK	港交所	中国香港	41,500	230,159.37	0.19
161	CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	中国忠旺	1333 HK	港交所	中国香港	77,200	229,821.74	0.19
162	LANDING INTERNATIONAL DEVELO	蓝鼎国际	582 HK	港交所	中国香港	3,420,000	228,558.05	0.19
163	GUANGSHEN RAILWAY CO LTD-H	广深铁路	525 HK	港交所	中国香港	68,000	228,401.83	0.19

				所				
164	GREENTOWN CHINA HOLDINGS	绿城中国	3900 HK	港交所	中国香港	30,500	227,655.42	0.19
165	TOWNGAS CHINA CO LTD	港华燃气	1083 HK	港交所	中国香港	51,000	225,745.99	0.19
166	CHINA ZHENG TONG AUTO SERVICE	正通汽车	1728 HK	港交所	中国香港	41,500	225,116.75	0.18
167	CHINA SCE PROPERTY HOLDINGS	中骏置业	1966 HK	港交所	中国香港	73,000	224,921.47	0.18
168	SHENZHEN EXPRESSWAY CO-H	深高速	548 HK	港交所	中国香港	36,000	222,152.80	0.18
169	MAANSHAN IRON & STEEL-H	马钢股份	323 HK	港交所	中国香港	82,000	222,048.65	0.18
170	CHOW SANG SANG HLDG	周生生集团国际	116 HK	港交所	中国香港	14,000	221,389.03	0.18
171	FAR EAST CONSORTIUM INTERNAT	远东发展	35 HK	港交所	中国香港	58,000	219,479.61	0.18
172	KUANGCHI SCIENCE LTD	光启科学	439 HK	港交所	中国香港	91,000	218,776.59	0.18
173	CHINA SOUTH CITY HOLDINGS	华南城	1668 HK	港交所	中国香港	170,000	213,942.28	0.18
174	TCC INTL HLDGS LTD	台泥国际	1136 HK	港交所	中国香港	70,000	213,855.49	0.18
175	GLOBAL BRANDS GROUP HOLDING	利标品牌	787 HK	港交所	中国香港	300,000	213,508.32	0.18
176	FUFENG GROUP LTD	阜丰集团	546 HK	港交所	中国香港	58,000	211,425.31	0.17
177	GREATVIEW ASEPTIC PACKAGING	纷美包装	468 HK	港交所	中国香港	50,000	211,338.52	0.17
178	FDG ELECTRIC	五龙电动	729	港交所	中国	740,000	208,734.76	0.17

	VEHICLES LTD	车	HK	交 所	香港			
179	FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLD	新城发展 控股	1030 HK	港 交 所	中国 香港	80,000	206,912.13	0.17
180	CAR INC	神州租车	699 HK	港 交 所	中国 香港	33,000	205,358.55	0.17
181	NAN HAI CORP LTD	南海控股	680 HK	港 交 所	中国 香港	950,000	205,306.48	0.17
182	SSY GROUP LTD	石四药集 团	2005 HK	港 交 所	中国 香港	74,000	204,881.20	0.17
183	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	中远海能	1138 HK	港 交 所	中国 香港	54,000	204,343.08	0.17
184	CHINA MACHINERY ENGINEERIN-H	中国机械 工程	1829 HK	港 交 所	中国 香港	42,000	200,854.05	0.16
185	FU SHOU YUAN INTERNATIONAL	福寿园	1448 HK	港 交 所	中国 香港	49,000	200,307.26	0.16
186	CARNIVAL GROUP INTERNATIONAL	嘉年华国 际	996 HK	港 交 所	中国 香港	320,000	199,968.77	0.16
187	SHUN TAK HOLDINGS LTD	信德集团	242 HK	港 交 所	中国 香港	64,000	199,413.30	0.16
188	CHINA TRAVEL INTL INV HK	香港中旅	308 HK	港 交 所	中国 香港	102,000	199,187.64	0.16
189	HOPEWELL HIGHWAY INFRASTRUCT	合和公路 基建	737 HK	港 交 所	中国 香港	51,000	198,745.00	0.16
190	UNIVERSAL MEDICAL FINANCIAL	环球医疗	2666 HK	港 交 所	中国 香港	36,500	197,677.46	0.16
191	CHINA MINSHENG FINANCIAL HOL	中国民生 金融	245 HK	港 交 所	中国 香港	450,000	195,282.00	0.16
192	ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	中联重科	1157 HK	港 交 所	中国 香港	58,800	193,928.04	0.16

193	RED STAR MACALLINE GROUP C-H	红星美凯龙	1528 HK	港交所	中国香港	27,800	193,025.41	0.16
194	POWERLONG REAL ESTATE HOLDIN	宝龙地产	1238 HK	港交所	中国香港	66,000	192,469.94	0.16
195	HUADIAN FUXIN ENERGY CORP -H	华电福新	816 HK	港交所	中国香港	118,000	191,515.23	0.16
196	ZHOU HEI YA INTERNATIONAL HO	周黑鸭国际	1458 HK	港交所	中国香港	28,000	190,768.82	0.16
197	CHINA DONGXIANG GROUP CO	中国动向	3818 HK	港交所	中国香港	157,000	189,406.18	0.16
198	TIANNENG POWER INTL LTD	天能动力	819 HK	港交所	中国香港	34,000	189,154.48	0.16
199	GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARM-H	白云山	874 HK	港交所	中国香港	10,000	186,168.84	0.15
200	GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	绿城服务集团有限公司	2869 HK	港交所	中国香港	50,000	185,734.88	0.15
201	UNITED PHOTOVOLTAICS GROUP L	联合光伏	686 HK	港交所	中国香港	200,000	180,527.36	0.15
202	CSC FINANCIAL CO LTD-H	中信建投证券	6066 HK	港交所	中国香港	30,000	180,440.57	0.15
203	GOLDEN EAGLE RETAIL GROUP	金鹰商贸集团	3308 HK	港交所	中国香港	19,000	178,097.18	0.15
204	TRULY INTERNATIONAL HOLDINGS	信利国际	732 HK	港交所	中国香港	76,000	178,097.18	0.15
205	CHINA MAPLE LEAF EDUCATIONAL	枫叶教育	1317 HK	港交所	中国香港	32,000	177,194.55	0.15
206	CENTRAL CHINA SECURITIES C-H	中原证券	1375 HK	港交所	中国香港	55,000	176,621.72	0.14
207	DIGITAL DOMAIN HOLDINGS LTD	数字王国	547 HK	港交所	中国香港	630,000	172,238.72	0.14

				所				
208	SINOPEC KANTONS HOLDINGS	中石化冠德	934 HK	港交所	中国香港	46,000	172,073.82	0.14
209	SMI HOLDINGS GROUP LTD	星美控股	198 HK	港交所	中国香港	56,800	170,570.58	0.14
210	LONKING HOLDINGS LTD	中国龙工	3339 HK	港交所	中国香港	79,000	167,985.92	0.14
211	PROSPERITY REIT	#N/A	808 HK	港交所	中国香港	57,000	164,245.18	0.13
212	LIFETECH SCIENTIFIC CORP	先健科技	1302 HK	港交所	中国香港	102,000	163,776.50	0.13
213	FREEMAN FINTECH CORP LTD	民众金融科技	279 HK	港交所	中国香港	360,000	162,474.62	0.13
214	BANK OF CHONGQING CO LTD-H	重庆银行	1963 HK	港交所	中国香港	30,000	162,474.62	0.13
215	LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-H	丽珠集团	1513 HK	港交所	中国香港	3,400	162,301.04	0.13
216	HUTCHISON TELECOMM HONG KONG	和记电讯香港	215 HK	港交所	中国香港	68,000	162,301.04	0.13
217	TIBET WATER RESOURCES LTD	西藏水资源	1115 HK	港交所	中国香港	61,000	161,476.52	0.13
218	PAX GLOBAL TECHNOLOGY LTD	百富环球	327 HK	港交所	中国香港	37,000	160,886.33	0.13
219	MICROPORT SCIENTIFIC CORP	微创医疗	853 HK	港交所	中国香港	30,000	160,131.24	0.13
220	SINOTRUK HONG KONG LTD	中国重汽	3808 HK	港交所	中国香港	32,500	159,935.96	0.13
221	SMARTONE TELECOMMUNICATIONS	数码通电讯	315 HK	港交所	中国香港	18,000	159,662.56	0.13
222	CT ENVIRONMENTAL	中滔环保	1363	港	中国	134,000	158,169.74	0.13



	GROUP LTD		HK	交 所	香 港			
223	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	华虹半导 体	1347 HK	港 交 所	中 国 香 港	17,000	156,399.18	0.13
224	CHINA OVERSEAS GRAND OCEANS	中国海外 宏洋集团	81 HK	港 交 所	中 国 香 港	43,000	155,626.74	0.13
225	YUEXIU TRANSPORT INFRASTRUCT	越秀交通 基建	1052 HK	港 交 所	中 国 香 港	32,000	155,531.26	0.13
226	CHINA WATER AFFAIRS GROUP	中国水务	855 HK	港 交 所	中 国 香 港	38,000	154,680.70	0.13
227	BIOSTIME INTERNATIONAL HOLDI	合生元	1112 HK	港 交 所	中 国 香 港	9,000	154,350.89	0.13
228	CHINA MODERN DAIRY HOLDINGS	现代牧业	1117 HK	港 交 所	中 国 香 港	114,000	153,361.46	0.13
229	VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	维达国际	3331 HK	港 交 所	中 国 香 港	11,000	150,844.50	0.12
230	SA SA INTERNATIONAL HLDGS	莎莎国际	178 HK	港 交 所	中 国 香 港	56,000	149,698.84	0.12
231	TEXWINCA HOLDINGS LTD	德永佳集 团	321 HK	港 交 所	中 国 香 港	36,000	148,414.32	0.12
232	CHINA INTERNATIONAL MARINE-H	中集集团	2039 HK	港 交 所	中 国 香 港	12,100	146,605.57	0.12
233	CSSC OFFSHORE & MARINE ENG-H	中船防务	317 HK	港 交 所	中 国 香 港	12,000	145,393.96	0.12
234	CHINA HIGH SPEED TRANSMISSIO	中国高速 传动	658 HK	港 交 所	中 国 香 港	19,000	140,993.60	0.12
235	SHOUGANG FUSHAN RESOURCES GR	首钢资源	639 HK	港 交 所	中 国 香 港	112,000	140,950.21	0.12
236	DIGITAL CHINA HOLDINGS LTD	神州控股	861 HK	港 交 所	中 国 香 港	27,000	140,837.38	0.12

237	VPOWER GROUP INTERNATIONAL H	伟能集团国际控股有限公司	1608 HK	港交所	中国香港	32,000	137,478.53	0.11
238	HC INTERNATIONAL INC	慧聪网	2280 HK	港交所	中国香港	28,000	136,818.91	0.11
239	TIAN GE INTERACTIVE HOLDINGS	天鸽互动	1980 HK	港交所	中国香港	28,000	135,117.79	0.11
240	THE UNITED LABORATORIES INTE	联邦制药	3933 HK	港交所	中国香港	30,000	134,093.64	0.11
241	CHAOWEI POWER HOLDINGS LTD	超威动力	951 HK	港交所	中国香港	33,000	131,750.26	0.11
242	CHINA BLUECHEMICAL LTD - H	中海石油化学	3983 HK	港交所	中国香港	82,000	131,663.46	0.11
243	SHANGHAI JIN JIANG INTL HO-H	锦江酒店	2006 HK	港交所	中国香港	62,000	131,298.94	0.11
244	VISION FAME INTERNATIONAL HO	允升国际	1315 HK	港交所	中国香港	180,000	131,229.50	0.11
245	WEST CHINA CEMENT LTD	西部水泥	2233 HK	港交所	中国香港	128,000	131,090.64	0.11
246	LAI SUN DEVELOPMENT	丽新发展	488 HK	港交所	中国香港	525,000	129,862.53	0.11
247	HUIZHANG BANK CORP LTD-H	徽商银行	3698 HK	港交所	中国香港	37,000	129,415.55	0.11
248	BEIJING CAPITAL LAND LTD-H	首创置业	2868 HK	港交所	中国香港	40,000	128,799.33	0.11
249	TOWN HEALTH INTERNATIONAL ME	康健国际医疗	3886 HK	港交所	中国香港	216,000	127,480.09	0.10
250	CITIC TELECOM INTERNATIONAL	中信国际电讯	1883 HK	港交所	中国香港	58,000	125,848.40	0.10
251	RONSHINE CHINA HOLDINGS LTD	融信中国	3301 HK	港交所	中国香港	19,000	124,338.22	0.10

				所				
252	RENHE COMMERCIAL HOLDINGS	人和商业	1387 HK	港交所	中国香港	816,000	123,938.98	0.10
253	CITIC RESOURCES HOLDINGS LTD	中信资源	1205 HK	港交所	中国香港	166,000	123,904.26	0.10
254	NETDRAGON WEBSOFT HOLDINGS L	网龙网络	777 HK	港交所	中国香港	7,000	123,635.20	0.10
255	XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	特步国际	1368 HK	港交所	中国香港	47,000	122,784.64	0.10
256	POU SHENG INTL HOLDINGS LTD	宝胜国际	3813 HK	港交所	中国香港	101,000	122,723.89	0.10
257	IMAX CHINA HOLDING INC	IMAX CHINA	1970 HK	港交所	中国香港	5,900	122,641.44	0.10
258	EVERBRIGHT SECURITIES CO L-H	光大证券	6178 HK	港交所	中国香港	13,200	122,355.89	0.10
259	DAH CHONG HONG	大昌行集团	1828 HK	港交所	中国香港	39,000	121,178.99	0.10
260	CHINA HARMONY NEW ENERGY AUT	和谐汽车	3836 HK	港交所	中国香港	37,000	119,781.64	0.10
261	DALIAN PORT (PDA) CO LTD-H	大连港股份有限公司	2880 HK	港交所	中国香港	94,000	118,297.50	0.10
262	HUABAO INTERNATIONAL HOLDING	华宝国际	336 HK	港交所	中国香港	29,000	117,290.71	0.10
263	JU TENG INTERNATIONAL HLDGS	巨腾-DR	3336 HK	港交所	中国香港	42,000	116,648.45	0.10
264	CHINA LNG GROUP LTD	中国天然气	931 HK	港交所	中国香港	920,000	115,780.53	0.09
265	GOODBABY INTERNATIONAL HOLDI	好孩子国际	1086 HK	港交所	中国香港	41,000	115,294.49	0.09
266	YANGTZE OPTICAL	长飞光纤	6869	港	中国	8,000	115,120.91	0.09

	FIBRE AND-H	光缆	HK	交所	香港			
267	EMPEROR INTL HLDG LTD	英皇国际	163 HK	港交所	中国香港	52,000	115,086.19	0.09
268	CHINA FOODS LTD	中国食品	506 HK	港交所	中国香港	40,000	114,912.61	0.09
269	CANVEST ENVIRONMENTAL PROTEC	粤丰环保	1381 HK	港交所	中国香港	32,000	113,593.37	0.09
270	G-RESOURCES GROUP LTD	国际资源	1051 HK	港交所	中国香港	1,146,000	113,388.54	0.09
271	CHINA GOLDJOY GROUP LTD	中国金洋	1282 HK	港交所	中国香港	256,000	113,315.64	0.09
272	SINOTRANS SHIPPING LTD	中外运航运	368 HK	港交所	中国香港	66,000	112,846.96	0.09
273	BEIJING GAS BLUE SKY HOLDING	北京燃气蓝天	6828 HK	港交所	中国香港	248,000	111,926.96	0.09
274	BEIJING JINGNENG CLEAN ENE-H	京能清洁能源	579 HK	港交所	中国香港	56,000	111,788.10	0.09
275	CIMC ENRIC HOLDINGS LTD	中集安瑞科	3899 HK	港交所	中国香港	26,000	110,121.69	0.09
276	JIAYUAN INTERNATIONAL GROUP	佳源国际控股	2768 HK	港交所	中国香港	28,000	110,086.97	0.09
277	MACAU LEGEND DEVELOPMENT LTD	澳门励骏	1680 HK	港交所	中国香港	89,000	109,687.73	0.09
278	TEXHONG TEXTILE GROUP LTD	天虹纺织	2678 HK	港交所	中国香港	13,000	109,557.54	0.09
279	CHINA AOYUAN PROPERTY GROUP	中国奥园	3883 HK	港交所	中国香港	53,000	108,099.44	0.09
280	CHINA AIRCRAFT LEASING GROUP	中国飞机租赁	1848 HK	港交所	中国香港	13,500	106,623.97	0.09

281	HI SUN TECHNOLOGY CHINA LTD	高阳科技	818 HK	港交所	中国香港	90,000	105,452.28	0.09
282	GCL NEW ENERGY HOLDINGS LTD	协鑫新能源	451 HK	港交所	中国香港	314,000	104,922.85	0.09
283	SINOPEC OILFIELD SERVICE -H	石化油服	1033 HK	港交所	中国香港	98,000	104,619.08	0.09
284	CHINA ELECTRONICS OPTICS VAL	中电光谷	798 HK	港交所	中国香港	160,000	104,150.40	0.09
285	SHANGHAI INDUSTRIAL URBAN DE	上实城市开发	563 HK	港交所	中国香港	68,000	103,872.67	0.09
286	COOLPAD GROUP LTD	酷派集团	2369 HK	港交所	中国香港	164,000	102,483.99	0.08
287	FDG KINETIC LTD	五龙动力	378 HK	港交所	中国香港	84,000	102,067.39	0.08
288	CHINA OIL AND GAS GROUP LTD	中油燃气	603 HK	港交所	中国香港	220,000	101,199.47	0.08
289	ROAD KING INFRASTRUCTURE LTD	路劲基建	1098 HK	港交所	中国香港	12,000	100,400.99	0.08
290	FAIRWOOD HOLDINGS LTD	FAIRWOOD HOLD	52 HK	港交所	中国香港	3,500	99,789.10	0.08
291	COGOBUY GROUP	科通芯城	400 HK	港交所	中国香港	28,000	99,637.22	0.08
292	REGINA MIRACLE INTERNATIONAL	维珍妮	2199 HK	港交所	中国香港	17,000	99,593.82	0.08
293	NEWOCEAN ENERGY HLDGS LTD	新海能源	342 HK	港交所	中国香港	48,000	99,567.78	0.08
294	CHINA LILANG LTD	中国利郎	1234 HK	港交所	中国香港	22,000	99,290.05	0.08
295	BEST PACIFIC INTERNATIONAL H	超盈国际控股	2111 HK	港交所	中国香港	16,000	97,207.04	0.08

				所				
296	TIANJIN PORT DVLP HLDS LTD	天津港发 展	3382 HK	港 交 所	中 国 香 港	86,000	97,033.46	0.08
297	CHINA MERCHANTS LAND LTD	招商局置 地	978 HK	港 交 所	中 国 香 港	70,000	96,599.50	0.08
298	BEIJING ENTERPRISES MEDICAL	北控医疗 健康	2389 HK	港 交 所	中 国 香 港	228,000	95,974.59	0.08
299	EMPEROR CAPITAL GROUP LTD	英皇证券	717 HK	港 交 所	中 国 香 港	156,000	94,776.86	0.08
300	CHINA METAL RESOURCES UTILIZ	中国金属 资源利用	1636 HK	港 交 所	中 国 香 港	36,000	94,047.81	0.08
301	CHINA POWER NEW ENERGY DEVEL	中国电力 新能源	735 HK	港 交 所	中 国 香 港	21,500	92,928.19	0.08
302	OZNER WATER INTERNATIONAL HO	浩泽净水	2014 HK	港 交 所	中 国 香 港	66,000	92,798.01	0.08
303	GREENLAND HONG KONG HOLDINGS	绿地香港	337 HK	港 交 所	中 国 香 港	39,000	90,715.00	0.07
304	CONSUN PHARMACEUTICAL GROUP	康臣药业	1681 HK	港 交 所	中 国 香 港	17,000	89,413.12	0.07
305	CHINA SHINEWAY PHARMACEUTICA	神威药业	2877 HK	港 交 所	中 国 香 港	13,000	89,135.38	0.07
306	HUAYI TENCENT ENTERTAINMENT	华谊腾讯 娱乐	419 HK	港 交 所	中 国 香 港	310,000	88,788.22	0.07
307	DAWRAYS PHARMACEUTICAL HOLD	东瑞制药	2348 HK	港 交 所	中 国 香 港	20,000	88,180.67	0.07
308	CITYCHAMP WATCH & JEWELLERY	冠城钟表 珠宝	256 HK	港 交 所	中 国 香 港	60,000	88,007.09	0.07
309	BOSIDENG INTL HLDGS LTD	波司登	3998 HK	港 交 所	中 国 香 港	148,000	86,062.95	0.07
310	CHINA OVERSEAS	中海物业	2669	港	中 国	65,000	85,750.50	0.07

	PROPERTY HOLD		HK	交 所	香 港			
311	YADEA GROUP HOLDINGS LTD	雅迪控股	1585 HK	港 交 所	中 国 香 港	52,000	85,299.18	0.07
312	CHINA SHENGMU ORGANIC MILK	中国圣牧	1432 HK	港 交 所	中 国 香 港	63,000	85,299.18	0.07
313	SINOFERT HOLDINGS LTD	中化化肥	297 HK	港 交 所	中 国 香 港	98,000	84,205.60	0.07
314	GUORUI PROPERTIES LTD	国瑞置业	2329 HK	港 交 所	中 国 香 港	41,000	83,624.09	0.07
315	TIANJIN DEVELOPMENT HLDGS LT	天津發展 控股有限 公司	882 HK	港 交 所	中 国 香 港	22,000	83,250.89	0.07
316	COSMO LADY CHINA HOLDINGS CO	都市丽人	2298 HK	港 交 所	中 国 香 港	30,000	82,539.19	0.07
317	TCL MULTIMEDIA TECHNOLOGY	TCL 多媒 体	1070 HK	港 交 所	中 国 香 港	26,000	82,365.61	0.07
318	AJISEN CHINA HOLDINGS LTD	味千(中 国)	538 HK	港 交 所	中 国 香 港	30,000	82,278.82	0.07
319	LEES PHARMACEUTICAL HLDGS	李氏大药 厂	950 HK	港 交 所	中 国 香 港	14,500	82,053.16	0.07
320	HOSA INTERNATIONAL LTD	浩沙国际	2200 HK	港 交 所	中 国 香 港	38,000	80,473.54	0.07
321	361 DEGREES INTERNATIONAL	361 度国 际	1361 HK	港 交 所	中 国 香 港	32,000	79,709.77	0.07
322	CONCORD NEW ENERGY GROUP LTD	协合新能 源	182 HK	港 交 所	中 国 香 港	280,000	78,980.72	0.06
323	LVGEM CHINA REAL ESTATE INVE	绿景中国 地产	95 HK	港 交 所	中 国 香 港	36,000	77,800.35	0.06
324	CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	辉山乳业	6863 HK	港 交 所	中 国 香 港	212,000	77,279.60	0.06

325	WELLING HOLDING LTD	威灵控股有限公司	382 HK	港交所	中国香港	50,000	77,244.88	0.06
326	CK LIFE SCIENCES INTL HLDGS	长江生命科技	775 HK	港交所	中国香港	134,000	76,758.84	0.06
327	CHINA SINGYES SOLAR TECH	兴业太阳能	750 HK	港交所	中国香港	27,000	76,628.66	0.06
328	BAOXIN AUTO GROUP LTD	宝信汽车	1293 HK	港交所	中国香港	23,500	76,485.45	0.06
329	REALORD GROUP HOLDINGS LTD	伟禄集团	1196 HK	港交所	中国香港	20,000	75,856.21	0.06
330	CHINA FINANCIAL INTERNATIONAL	中国金融国际投资	721 HK	港交所	中国香港	280,000	72,905.28	0.06
331	SUMMIT ASCENT HOLDINGS LTD	凯升控股	102 HK	港交所	中国香港	48,000	71,655.48	0.06
332	CHINA GREENLAND BROAD GREENS	中国绿地博大绿泽	1253 HK	港交所	中国香港	44,000	70,266.80	0.06
333	COMBA TELECOM SYSTEMS HOLDIN	京信通信	2342 HK	港交所	中国香港	74,000	67,437.38	0.06
334	CPMC HOLDINGS LTD	中粮包装	906 HK	港交所	中国香港	20,000	66,829.84	0.05
335	FANTASIA HOLDINGS GROUP CO	花样年控股	1777 HK	港交所	中国香港	67,500	66,200.60	0.05
336	HENGDELI HOLDINGS LTD	亨得利	3389 HK	港交所	中国香港	108,000	65,614.75	0.05
337	YASHILI INTERNATIONAL HOLDIN	雅士利国际	1230 HK	港交所	中国香港	49,000	64,217.40	0.05
338	COLOUR LIFE SERVICES GROUP	彩生活	1778 HK	港交所	中国香港	16,000	64,156.65	0.05
339	CGN NEW ENERGY HOLDINGS CO L	中广核新能源	1811 HK	港交所	中国香港	68,000	63,149.86	0.05



				所				
340	KANGDA INTERNATIONAL ENVIRON	康达环保	6136 HK	港交所	中国香港	46,000	62,681.18	0.05
341	WASION GROUP HOLDINGS LTD	威胜集团	3393 HK	港交所	中国香港	20,000	62,316.66	0.05
342	BRIGHT SMART SECURITIES AND	耀才证券金融集团有限公司	1428 HK	港交所	中国香港	30,000	59,886.48	0.05
343	SINOSOFT TECHNOLOGY GROUP LT	中国擎天软件	1297 HK	港交所	中国香港	28,000	58,810.26	0.05
344	CENTRAL CHINA REAL ESTATE	建业地产	832 HK	港交所	中国香港	37,000	56,840.08	0.05
345	HNA HOLDING GROUP CO LTD	海航实业股份	521 HK	港交所	中国香港	200,000	56,414.80	0.05
346	CHIHO-TIANDE GROUP LTD	齐合天地	976 HK	港交所	中国香港	18,000	56,241.22	0.05
347	AVIC INTERNATIONAL HLDGS HK	中国航空工业国际	232 HK	港交所	中国香港	166,000	56,189.14	0.05
348	CONVOY GLOBAL HOLDINGS LTD	康宏金融	1019 HK	港交所	中国香港	558,000	55,694.43	0.05
349	NVC LIGHTING HOLDINGS LTD	雷士照明	2222 HK	港交所	中国香港	72,000	53,116.70	0.04
350	SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	三一国际	631 HK	港交所	中国香港	45,000	51,554.45	0.04
351	CHINA PIONEER PHARMA HOLDING	中国先锋医药	1345 HK	港交所	中国香港	23,000	51,103.13	0.04
352	RENTIAN TECHNOLOGY HOLDING	仁天科技控股	885 HK	港交所	中国香港	150,000	50,773.32	0.04
353	COFCO MEAT HOLDINGS LTD	中粮肉食控股有限公司	1610 HK	港交所	中国香港	37,000	50,096.34	0.04
354	CHINA ELECTRONICS	中国电子	85 HK	港交所	中国	46,000	49,506.16	0.04

	CORP HOLDI			交	香港			
355	CROWN INTERNATIONAL CORP LTD	皇冠环球 集团	727 HK	港 交 所	中 国 香 港	42,000	48,846.54	0.04
356	SRE GROUP LTD	上置集团	1207 HK	港 交 所	中 国 香 港	308,000	48,117.48	0.04
357	NATIONAL AGRICULTURAL HOLDIN	国农控股	1236 HK	港 交 所	中 国 香 港	46,000	47,509.94	0.04
358	CHINA LOTSYNERGY HLDG LTD	华彩控股	1371 HK	港 交 所	中 国 香 港	380,000	45,183.92	0.04
359	HARMONICARE MEDICAL HOLDINGS	和美医疗	1509 HK	港 交 所	中 国 香 港	13,000	44,793.35	0.04
360	CHINA HUIYUAN JUICE GROUP	汇源果汁	1886 HK	港 交 所	中 国 香 港	21,000	44,654.48	0.04
361	GOOD RESOURCES HOLDINGS LTD	天成国际	109 HK	港 交 所	中 国 香 港	140,000	41,920.53	0.03
362	CHINA DEVELOPMENT BANK FIN-H	国银租赁	1606 HK	港 交 所	中 国 香 港	26,000	41,069.97	0.03
363	WISDOM SPORTS GROUP	智美体育	1661 HK	港 交 所	中 国 香 港	34,000	40,132.62	0.03
364	PW MEDTECH GROUP LTD	普华和顺	1358 HK	港 交 所	中 国 香 港	28,000	40,097.90	0.03
365	MAOYE INTERNATIONAL HLDGS	茂业国际	848 HK	港 交 所	中 国 香 港	51,000	36,296.41	0.03
366	DIFFER GROUP HOLDING CO LTD	鼎丰集团 控股	6878 HK	港 交 所	中 国 香 港	64,000	36,105.47	0.03
367	BOER POWER HOLDINGS LTD	博耳电力	1685 HK	港 交 所	中 国 香 港	15,000	32,807.38	0.03
368	TECH PRO TECHNOLOGY DEVELOPM	德普科技	3823 HK	港 交 所	中 国 香 港	340,000	31,574.93	0.03

369	GOLDEN THROAT HOLDINGS GROUP	金嗓子	6896 HK	港交所	中国香港	13,000	23,355.73	0.02
370	MAJOR HOLDINGS LTD	美捷滙控股	1389 HK	港交所	中国香港	36,000	5,311.67	0.00

#### 7.4.2 积极投资期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权益投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

### 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	MEITU INC	1357 HK	1,393,810.47	0.60
2	SINOPHARM GROUP CO-H	1099 HK	1,234,728.37	0.54
3	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	981 HK	1,088,990.25	0.47
4	CITIC SECURITIES CO LTD-H	6030 HK	943,354.05	0.41
5	CRRC CORP LTD - H	1766 HK	931,792.30	0.40
6	SUNNY OPTICAL TECH	2382 HK	920,645.67	0.40
7	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	914 HK	863,244.30	0.37
8	NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	1336 HK	855,192.33	0.37
9	BYD CO LTD-H	1211 HK	810,270.57	0.35
10	GF SECURITIES CO LTD-H	1776 HK	793,964.18	0.34
11	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	586 HK	768,479.57	0.33
12	CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	6881 HK	747,765.25	0.32
13	CHINA VANKE CO LTD-H	2202 HK	744,075.99	0.32
14	GREAT WALL MOTOR	2333 HK	738,210.96	0.32

	COMPANY-H			
15	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	3323 HK	689,288.27	0.30
16	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	522 HK	685,752.86	0.30
17	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	2238 HK	672,875.02	0.29
18	PEOPLES INSURANCE CO GROU-H	1339 HK	672,589.15	0.29
19	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	3898 HK	665,216.37	0.29
20	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	390 HK	664,779.74	0.29

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	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	175 HK	1,568,596.77	0.68
2	FULLSHARE HOLDINGS LTD	607 HK	1,002,561.08	0.43
3	BEP INTERNATIONAL HOLDINGS L	2326 HK	462,561.94	0.20
4	COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	1919 HK	322,999.61	0.14
5	CHINA METAL RESOURCES UTILIZ	1636 HK	284,225.62	0.12
6	CHINA HIGH SPEED TRANSMISSIO	658 HK	257,172.77	0.11
7	HUABAO INTERNATIONAL HOLDING	336 HK	252,899.36	0.11
8	SUNNY OPTICAL TECH	2382 HK	227,579.09	0.10
9	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	3323 HK	225,712.16	0.10
10	CHINA GOLDJOY GROUP LTD	1282 HK	223,479.71	0.10
11	SHENGJING BANK CO LTD-H	2066 HK	200,172.69	0.09
12	SINOPHARM GROUP CO-H	1099 HK	195,355.18	0.08
13	SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	460 HK	174,831.12	0.08
14	INTIME RETAIL GROUP CO	1833 HK	165,796.13	0.07

	LTD			
15	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	3898 HK	158,540.41	0.07
16	KINGSOFT CORP LTD	3888 HK	157,477.56	0.07
17	CRRC CORP LTD - H	1766 HK	153,918.01	0.07
18	CHINA OCEANWIDE HOLDINGS LTD	715 HK	152,509.14	0.07
19	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	914 HK	150,638.64	0.07
20	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	2333 HK	149,226.03	0.06

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	89,408,703.61
卖出收入（成交）总额	19,375,149.93

### 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序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序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序的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

### 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

**7.11 投资组合报告附注**

**7.11.1** 本基金投资的前十名证券的发行主体本期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** 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

**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	1,046,096.99
3	应收股利	821,769.73
4	应收利息	1,619.89
5	应收申购款	3,595.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,873,082.44

**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****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**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

**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**

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

**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

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
2,503	46,942.62	24,836,365.36	21.14%	92,661,021.09	78.86%

注：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

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	聂然	786,233.00	15.76%
2	赵俊英	397,009.00	7.96%
3	曹建平	374,701.00	7.51%
4	张志山	374,043.00	7.50%
5	李金	350,021.00	7.01%
6	王玺梅	313,700.00	6.29%
7	尹绍波	300,023.00	6.01%
8	宋庆利	200,015.00	4.01%
9	王鹏	150,014.00	3.01%
10	张秀涛	150,002.00	3.01%

注：持有人为场内份额持有人。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	40,109.74	0.0341%

### 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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0





## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016 年 12 月 2 日）基金份额总额	229,969,061.64
本报告期期初基金份额总额	229,969,061.64
本报告期基金总申购份额	32,469,348.40
减：本报告期基金总赎回份额	144,941,023.59
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	117,497,386.45

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 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

1、基金管理人于 2017 年 2 月 18 日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第二十四次会议（以下简称“董事会”）审议通过，杜鹃女士不再担任公司督察长。董事会同时决议，同意在公司新督察长任职前，由公司总经理罗登攀先生代为履行督察长职务，代为履职时间不超过 90 日。基金管理人于 2017 年 5 月 17 日发布了《大成基金管理有限公司关于总经理继续代为履行督察长职务的公告》，经公司第六届董事会第二十六次会议审议通过，决定继续由总经理罗登攀先生代为履行督察长职务。代为履行职务的时间自董事会决议通过之日起不超过 90 日。

2、基金管理人于 2017 年 2 月 18 日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第二十四次会议审议通过，陈翔凯先生、谭晓冈先生和姚余栋先生担任公司副总经理。

#### 二、基金托管人基金托管部门的重大人事变动

本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内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

本报告期内没有涉及本基金管理人、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

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，本基金管理人、托管人及高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

## 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	
光大证券	1	99,103,714.74	91.10%	79,282.96	90.85%	-
UBS	1	8,847,507.86	8.13%	7,077.92	8.11%	-
HK	1	832,630.94	0.77%	904.24	1.04%	-
招商证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

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。

本报告期内新增交易单元：西藏东财、天风证券、瑞银证券 本报告期内退出交易单元：长城证券

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

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	成交金额	占当期债券	成交金额	占当期权	成交金额	占当期基

	额	债券成交总额的比例		回购成交总额的比例		证成交总额的比例		金成交总额的比例
光大证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
UBS	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
HK	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
招商证券	-	0.00%	480,000,000.00	100.00%	-	0.00%	-	0.00%

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）境外主要市场节假日暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年5月23日
2	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）境外主要市场节假日暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年4月28日
3	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）2017年第1季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年4月21日
4	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）境外主要市场节假日暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年4月12日
5	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）境外主要市场节假日暂停申购、赎回及定投业务的公告。	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年3月28日
6	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）境外主要市场节假日暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年1月23日
7	关于增加北京恒天明泽基金销售有限公司为开放式基金销售机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年3月25日
8	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加郑州银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年1月11日
9	关于大成基金管理有限公司旗下	中国证监会指定报	2017年3月7日

	部分基金增加长沙银行股份有限公司为销售机构的公告	刊及本公司网站	
10	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加上海银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 5 月 12 日
11	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加上海基煜基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 31 日
12	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加上海基煜基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 6 月 28 日
13	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加汉口银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 2 月 15 日
14	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加方正证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 11 日
15	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加北京植信基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 6 月 14 日
16	关于大成基金管理有限公司撤销西安分公司的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 6 日
17	大成基金管理有限公司关于总经理继续代为履行督察长职务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 5 月 17 日
18	大成基金管理有限公司关于通过网上直销系统适用渠道大成钱柜交易实施费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 11 日
19	大成基金管理有限公司关于调整网上直销系统招行直联渠道基金交易费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 8 日
20	大成基金管理有限公司关于调整网上直销系统建行直联渠道基金交易费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 5 月 4 日
21	大成基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 19 日
22	大成基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 1 日
23	大成基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 28 日
24	大成基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 5 月 27 日
25	大成基金管理有限公司关于旗下基金实行网上直销申购费率优惠	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 3 日

	的公告		
26	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“中文在线”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年6月2日
27	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“三诺生物”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年6月2日
28	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“乐视网”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年6月2日
29	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加万联证券有限责任公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年1月17日
30	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海利得基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年6月27日
31	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年1月17日
32	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年2月11日
33	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年3月17日
34	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年4月18日
35	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年4月22日
36	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年5月12日
37	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年5月24日
38	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告（姚余栋）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年2月18日
39	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告（谭晓冈）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年2月18日
40	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告（杜鹏）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年2月18日
41	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告（陈翔凯）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年2月18日
42	大成基金管理有限公司关于撤销北京理财中心的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年4月14日
43	大成基金管理有限公司关于《上海证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年4月26日
44	大成基金管理有限公司关于《上海	中国证监会指定报	2017年4月27日

	证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告	刊及本公司网站	
45	大成基金管理有限公司关于《上海证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 28 日
46	大成基金管理有限公司关于《上海证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 29 日
47	大成基金管理有限公司更正公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 29 日
48	大成基金关于旗下部分基金增加平安证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 6 月 16 日
49	大成基金关于旗下部分基金增加北京肯特瑞财富投资管理有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 6 月 21 日
50	大成基金关于旗下部分基金增加北京虹点基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 5 月 6 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170627-20170630	-	23,718,216.32	-	23,718,216.32	20.18%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险，甚至有可能引起基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。
----



## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 12.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

### 12.3 查阅方式

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

大成基金管理有限公司

2017 年 8 月 24 日