

大成恒生综合中小型股指数证券投资基金
(QDII-LOF)
2017 年年度报告

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 2018 年 3 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 其他相关资料.....	7
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	12
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	16
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	17
§ 6 审计报告	18
§ 7 年度财务报表	21
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	24
7.4 报表附注.....	26
§ 8 投资组合报告	55
8.1 期末基金资产组合情况.....	55
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	56
8.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	56
8.4 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.....	57
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	96
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	99
8.7 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.....	99

8.8 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	99
8.9 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	100
8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	100
8.11 投资组合报告附注	100
§9 基金份额持有人信息.....	102
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	102
9.2 期末上市基金前十名持有人	102
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	102
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	103
§10 开放式基金份额变动.....	104
§11 重大事件揭示.....	105
11.1 基金份额持有人大会决议	105
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	105
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	105
11.4 基金投资策略的改变	105
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	106
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	106
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	106
11.8 其他重大事件	107
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	113
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	113
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	113
§13 备查文件目录.....	114
13.1 备查文件目录	114
13.2 存放地点	114
13.3 查阅方式	114

§ 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
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	59,767,249.34 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	赵冰	贺倩
	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 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	JPMorgan Chase & Co.
	中文	摩根大通银行

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网	http://www.dcfund.com.cn

址	
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年	2016 年 12 月 2 日(基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日
本期已实现收益	9,576,185.89	1,155,790.37
本期利润	18,151,212.76	754,418.68
加权平均基金份额本期利润	0.1588	0.0020
本期加权平均净值利润率	15.02%	0.20%
本期基金份额净值增长率	15.67%	0.20%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末
期末可供分配利润	7,320,956.25	521,068.63
期末可供分配基金份额利润	0.1225	0.0023
期末基金资产净值	69,264,036.82	230,490,130.27
期末基金份额净值	1.159	1.002
3.1.3 累计期末指标	2017 年末	2016 年末
基金份额累计净值增长率	15.90%	0.20%

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	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益率标	①—③	②—④
----	----------	----------	----------	------------	-----	-----

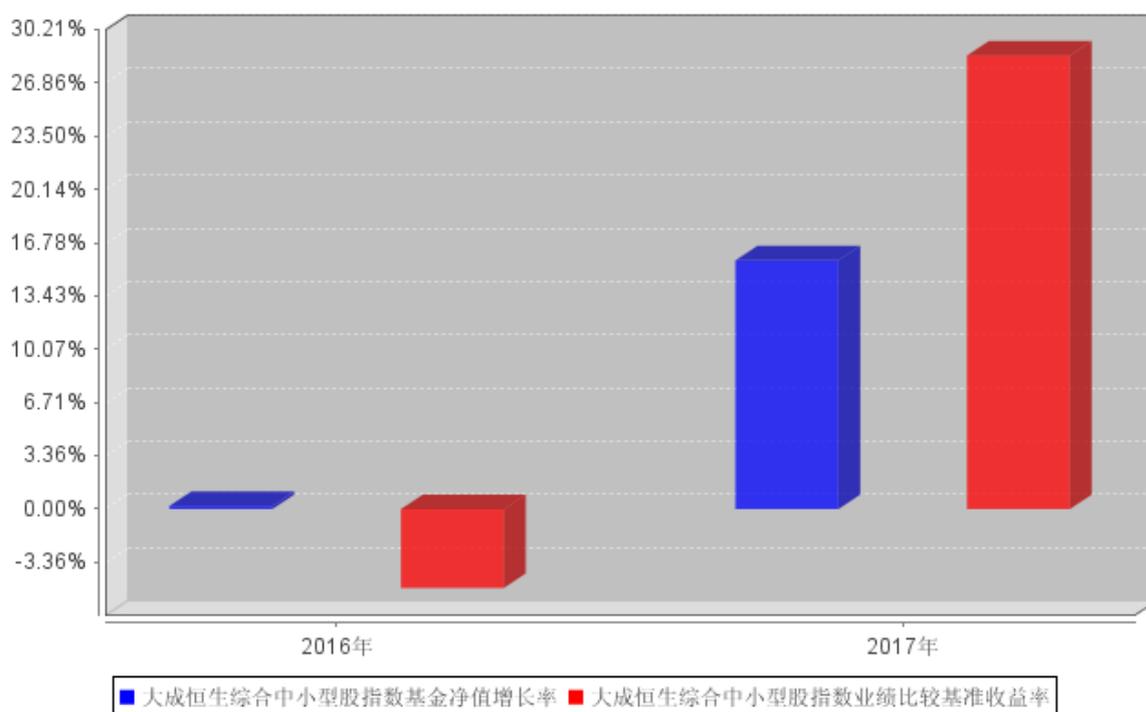
		准差②	率③	准差④		
过去三 个月	2.75%	0.92%	4.64%	0.92%	-1.89%	0.00%
过去六 个月	11.66%	0.89%	14.82%	0.87%	-3.16%	0.02%
过去一 年	15.67%	0.75%	28.59%	0.78%	-12.92%	-0.03%
自基金 合同生 效起至 今	15.90%	0.72%	22.19%	0.78%	-6.29%	-0.06%

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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10号文批准，于1999年4月12日正式成立，是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一，注册资本为2亿元人民币，注册地为深圳。目前公司由三家股东组成，分别为中泰信托有限责任公司(50%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)。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12月31日，本基金管理人共管理5只ETF及1只ETF联接基金，5只QDII基金及76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 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

					<p>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。2017年8月10日起担任大成恒生指数证券投资基金（LOF）基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国</p>
--	--	--	--	--	---

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 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。公司旗下投资组合

严格按照制度的规定，参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资活动相关的各个环节。研究部负责提供投资研究支持，投资部门负责投资决策，交易管理部负责实施交易并实时监控，监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核，风险管理部负责对交易情况进行合理性分析，通过多部门的协作互控，保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

4.4.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。基金管理人运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合连续 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。

4.4.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易存在 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 14 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，国际宏观经济状况运行较为平稳。从全球经济来看，美国仍然处于较好的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。香港股票市场走势由基本面及企业盈利推动。由于以中国业务为主的上市公司占港股七成以上的市值，因此中国宏观经济对港股走势产生决定性的影响。2017 年，中国的宏观经济在新的平衡区间内实现较快速增长，全年 GDP 增速达到 6.9%，扭转了连续 6 年 GDP 增速下降的趋势。在中国宏观经济持续走强的背景下，以中国业务为主的香港上市公司的企业盈利也在持续两年的下跌之后迎来

新的正增长，这对港股而言是发生了根本性的基本面转变，因此港股走势在 2017 年节节走高。在利润增长的背景下，港股的估值水平也得到了一定程度上的提升，这使得港股市场出现了戴维斯双击的良好局面，投资者的信心也得到了加强。2017 年，港股与 A 股的互联互通机制持续深化，资金持续南下进入港股市场，对港股市场走势有较好的促进作用。另外，在 2017 年，由于美国等海外主要股票市场持续创出新高，对港股也有正面提振作用。但是，2017 年美元汇率走软，港币由于联系汇率制的因素，对人民币也随之走软，这也在一定程度上影响了本基金的表现。

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 1.159 元；本报告期基金份额净值增长率为 15.67%，业绩比较基准收益率为 28.59%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年，预计中国宏观经济继续稳速增长。消费已经是中国经济增长的重要推动力，随着人均收入的持续提高，预计 2018 年消费也会保持稳定的两位数增长水平。2018 年，投资仍然会是中国经济增长的重要驱动力之一，当前对 2018 年固定资产投资增速的一致预期是 7.3%，与 2017 年增速相仿。由于国际经济形势较好，预计 2018 年中国净出口仍能够取得正增长，能够有效的支持经济增长。在较好的宏观环境下，2018 年港股的上市公司盈利增速也有望保持在两位数的水平。由于港股仍然处于全球主流市场的最低估值水平，因此，我们预计 2018 年港股还会有较好表现。同时，由于港股上市公司的利润增长预期不断得到了实际数据的验证，因此市场也提高了对港股未来的业绩预测。在此环境下，港股市场的戴维斯双击的良好局面有望持续，进一步增强港股的走势。但是，中国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，同时还有房地产风险因素等等，而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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，依据相关的法律法规、基金合同以及内部监察稽核制度，本基金管理人对本基金运作、内部管理、制度执行及遵纪守法情况进行了监察稽核。内部监察稽核的重点是：国家法

律法规及行业监管规则的执行情况；基金合同的遵守情况；内部规章制度的执行情况；资讯管制和保密工作落实情况；员工职业操守规范情况，目的是规范基金财产的运作，防范和控制投资风险，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，维护本基金份额持有人的合法权益。

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

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

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

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

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

4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

工作经历，估值委员会成员中包括三名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益总部、社保基金及机构投资部、数量与指数投资部、大类资产配置部、风险管理部负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量；定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；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。

4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金(QDII-LOF)全体基金份额持有人
审计意见	<p style="text-align: center;">(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了大成恒生综合中小型股指数证券投资基金(QDII-LOF) (以下简称“大成恒生综合中小型股指数”)的财务报表, 包括 2017 年 12 月 31 日和 2016 年 12 月 31 日的资产负债表, 2017 年度和 2016 年 12 月 2 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p style="text-align: center;">(二) 我们的意见</p> <p>我们认为, 后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制, 公允反映了大成恒生综合中小型股指数 2017 年 12 月 31 日和 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度和 2016 年 12 月 2 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信, 我们获取的审计证据是充分、适当的, 为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则, 我们独立于大成恒生综合中小型股指数, 并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>大成恒生综合中小型股指数的基金管理人大成基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表, 使其实现公允反映, 并设计、执行和维护必要的内部控制, 以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时, 基金管理人管理层负责评估大成恒生综合中小型股指数的持续经营能力, 披露与持续经营相关的事项(如适用),</p>

	<p>并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算大成恒生综合中小型股指数、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督大成恒生综合中小型股指数的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对大成恒生综合中小型股</p>

	<p>指数持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致大成恒生综合中小型股指数不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	张振波	俞伟敏
会计师事务所的地址	中国 · 上海市	
审计报告日期	2018年3月30日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	4,927,044.53	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	7.4.7.2	64,992,991.76	39,070,978.56
其中：股票投资		64,992,991.76	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	100,000,000.00
应收证券清算款		-	25,022,891.94
应收利息	7.4.7.5	851.45	27,435.82
应收股利		40,242.84	6,361.50
应收申购款		3,216.68	111,224.27
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		69,964,347.26	245,211,680.92
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日

负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		13.17	8,741,818.08
应付赎回款		183,039.25	5,532,061.25
应付管理人报酬		57,722.55	306,390.78
应付托管费		14,430.65	76,597.68
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	162,882.00	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	7.4.7.8	282,222.82	33,105.05
负债合计		700,310.44	14,721,550.65
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	59,767,249.34	229,969,061.64
未分配利润	7.4.7.10	9,496,787.48	521,068.63
所有者权益合计		69,264,036.82	230,490,130.27
负债和所有者权益总计		69,964,347.26	245,211,680.92

注：1. 报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.159 元，基金份额总额 59,767,249.34 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2017 年度和 2016 年 12 月 2 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017年1月1日至 2017年12月31日	上年度可比期间 2016年12月2日(基金 合同生效日)至2016 年12月31日
一、收入		20,541,415.14	1,266,366.40
1. 利息收入		565,689.94	971,345.64
其中：存款利息收入	7.4.7.11	137,653.78	162,658.17
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		428,036.16	808,687.47
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		11,289,317.11	6,356.60
其中：股票投资收益	7.4.7.12	8,919,674.78	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	2,369,642.33	6,356.60
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	8,575,026.87	-401,371.69
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-159,679.97	-9,795.10
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	271,061.19	699,830.95
减：二、费用		2,390,202.38	511,947.72
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,224,005.49	306,390.78
2. 托管费	7.4.10.2.2	306,001.38	76,597.68
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	377,882.69	78,688.60
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	482,312.82	50,270.66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		18,151,212.76	754,418.68
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		18,151,212.76	754,418.68

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）

本报告期：2017年1月1日至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	18,151,212.76	18,151,212.76
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-170,201,812.30	-9,175,493.91	-179,377,306.21
其中：1. 基金申购款	35,866,341.23	2,043,763.59	37,910,104.82
2. 基金赎回款	-206,068,153.53	-11,219,257.50	-217,287,411.03
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）	59,767,249.34	9,496,787.48	69,264,036.82
项目	上年度可比期间 2016年12月2日(基金合同生效日)至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	788,370,205.40	-	788,370,205.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	754,418.68	754,418.68
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）	-558,401,143.76	-233,350.05	-558,634,493.81
其中：1. 基金申购款	1,226,200.87	1,809.05	1,228,009.92
2. 基金赎回款	-559,627,344.63	-235,159.10	-559,862,503.73
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）	229,969,061.64	521,068.63	230,490,130.27

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

大成恒生综合中小型股指数证券投资基金(QDII-LOF)(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]第 2047 号《关于准予大成恒生综合中小型股指数证券投资基金(QDII-LOF)注册的批复》和机构部函[2016]第 1651 号《关于大成恒生综合中小型股指数证券投资基金(QDII-LOF)延期募集备案的回函》核准,由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成恒生综合中小型股指数证券投资基金(QDII-LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 788,161,803.26 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 1578 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《大成恒生综合中小型股指数证券投资基金(QDII-LOF)基金合同》于 2016 年 12 月 2 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 788,370,205.40 份基金份额,其中认购资金利息折合 208,402.14 份基金份额。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司,境外资产托管人为摩根大通银行。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《大成恒生综合中小型股指数证券投资基金(QDII-LOF)基金合同》的有关规定,本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股,也可以投资于以标的指数为跟踪标的的公募基金、上市交易型基金、结构性产品等。本基金可通过沪港股票市场交易互联互通机制(以下简称“沪港通”)投资于沪港通允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票。本基金还可投资于全球证券市场中具有良好流动性的其他金融工具,包括在证券交易市场挂牌的普通股、优先股、存托凭证,固定收益类证券(含中期票据)、银行存款、现金等货币市场工具、权证、股指期货以及中国证监

会允许本基金投资的其他产品或金融工具。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%，投资于以标的指数为跟踪标的的公募基金、上市交易型基金、结构性产品的比例不超过基金资产净值的 10%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：恒生综合中小型股指数收益率 \times 95%+人民币活期存款利率（税后） \times 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人大成基金管理有限公司于 2018 年 3 月 30 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、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 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年度和 2016 年 12 月 2 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间的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 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度和 2016 年 12 月 2 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2017 年度和 2016 年 12 月 2 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

本基金目前以交易目的持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其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、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬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。

7.4.4.11 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。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

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

7.4.4.13 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。

7.4.4.14 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》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) 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，在境内不予征收增值税且暂不征收企业所得税。

(2) 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。目前基金取得的其他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。

(3) 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	4,927,044.53	70,236,952.03
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	4,927,044.53	70,236,952.03

注：于 2017 年 12 月 31 日，活期存款中包括的外币余额为港币活期存款 1,464,388.12 元，折合人民币 1,224,096.67 元(上年度末：活期存款中包括的外币余额为港币活期存款 5,000,000.00 元，折合人民币 4,472,550.00 元)。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	56,819,336.58	64,992,991.76	8,173,655.18
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	56,819,336.58	64,992,991.76	8,173,655.18
项目	上年度末 2016年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	39,472,350.25	39,070,978.56	-401,371.69
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	39,472,350.25	39,070,978.56	-401,371.69

7.4.7.3 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。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所买入返售证券	0.00	-
合计	0.00	-
项目	上年度末 2016年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所买入返售证券	100,000,000.00	-

合计	100,000,000.00	-
----	----------------	---

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
应收活期存款利息	851.45	13,704.60
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	-	787.76
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	12,944.46
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	-	-
合计	851.45	27,435.82

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
交易所市场应付交易费用	162,882.00	31,577.81
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	162,882.00	31,577.81

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	427.32	20,849.39
预提费用	240,000.00	-
应付指数授权费	41,795.50	12,255.66
合计	282,222.82	33,105.05

7.4.7.9 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 12 月 31 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	35,866,341.23	35,866,341.23
本期赎回 (以“-”号填列)	-206,068,153.53	-206,068,153.53
- 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	59,767,249.34	59,767,249.34

注：1. 本基金自 2016 年 11 月 7 日起至 2016 年 11 月 25 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 788,161,803.26 元。根据《大成恒生综合中小型股指数证券投资基金 (QDII-LOF) 招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 208,402.14 元在本基金成立后，折算为 208,402.14 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2. 根据《大成恒生综合中小型股指数证券投资基金 (QDII-LOF) 招募说明书》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》的相关规定,本基金于2016年12月2日(基金合同生效日)至2016年12月7日止期间暂不向投资人开放基金交易,申购、赎回、转换及定投业务自2016年12月8日起开始办理。

3. 截至2017年12月31日止,本基金于深交所上市的基金份额为2,621,768.00份(2016年12月31日:8,212,613.00份),托管在场外未上市交易的基金份额为57,145,481.34份(2016年12月31日:221,756,448.64)。上市的基金份额登记在证券登记结算系统,可按市价流通或按基金份额净值申购或赎回;未上市的基金份额登记在注册登记系统,按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

7.4.7.10 未分配利润

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	9,576,185.89	8,575,026.87	18,151,212.76
本期基金份额交易产生的变动数	-3,104,615.72	-6,070,878.19	-9,175,493.91
其中:基金申购款	367,747.98	1,676,015.61	2,043,763.59
基金赎回款	-3,472,363.70	-7,746,893.80	-11,219,257.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,320,956.25	2,175,831.23	9,496,787.48

7.4.7.11 存款利息收入

单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年12月2日(基金合同生效日)至2016年12月31日
活期存款利息收入	109,978.08	158,832.03
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	23,959.67	3,184.41
其他	3,716.03	641.73
合计	137,653.78	162,658.17

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年 12月31日	2016年12月2日(基金合 同生效日)至2016年12月31日
卖出股票成交总额	85,233,429.64	-
卖出股票成本总额	76,313,754.86	-
买卖股票差价收入	8,919,674.78	-

7.4.7.13 债券投资收益

本报告期内及上年度可比期间本基金无债券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本报告期内及上年度可比期间本基金无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12 月31日	2016年12月2日(基金合同生 效日)至2016年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,369,642.33	6,356.60
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,369,642.33	6,356.60

7.4.7.17 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12月31日	上年度可比期间 2016年12月2日(基金 合同生效日)至2016年12月 31日
1. 交易性金融资产	8,575,026.87	-401,371.69
——股票投资	8,575,026.87	-401,371.69
——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	8,575,026.87	-401,371.69

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年12月2日(基金合 同生效日)至2016年12月31日
基金赎回费收入	271,061.19	699,830.95
合计	271,061.19	699,830.95

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年12月2日(基金合 同生效日)至2016年12月31日
交易所市场交易费用	377,882.69	78,688.60
银行间市场交易费用	-	-
合计	377,882.69	78,688.60

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017 年12月31日	上年度可比期间 2016年12月2日(基金合 同生效日)至2016年12月31 日
审计费用	40,000.00	-
信息披露费	300,000.00	-
银行汇划费	5,186.35	2,465.00
上市费	60,000.00	35,000.00
指数授权费	77,126.47	12,255.66
其他	-	550.00
合计	482,312.82	50,270.66

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

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司（“大成基金”）	基金管理人、基金销售机构
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（“大成创新资本”）	基金管理人的合营企业

注：1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 根据本基金管理人大成基金管理有限公司（以下简称“大成基金”）董事会及股东会的有关决议，大成基金原股东广东证券股份有限公司将所持大成基金 2% 股权以拍卖竞买的方式转让给大成基金股东中泰信托有限责任公司。上述股权变更及修改《大成基金管理有限公司公司章程》的工商变更手续已于 2016 年 4 月 25 日在深圳市市场监督管理局办理完毕。大成基金原股东广东证券股份有限公司自 2016 年 4 月 25 日起不再为本基金关联方。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 12 月 2 日 (基金合同生效日) 至 2016 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例

光大证券	99,103,714.74	55.19%	39,472,350.25	100.00%
------	---------------	--------	---------------	---------

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 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12月31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	60.38%	110,860.77	68.06%
关联方名称	上年度可比期间 2016年12月2日(基金合同生效日)至2016年12月31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	31,577.81	100.00%	31,577.81	100.00%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年12月2日(基金合同生效日) 至2016年12月31日

当期发生的基金应支付的管理费	1,224,005.49	306,390.78
其中：支付销售机构的客户维护费	462,252.12	141,406.36

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

日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 1.00% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年12月2日(基金合同生效日)至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	306,001.38	76,597.68

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

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内及上年度可比期间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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年12月31日		2016年12月2日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
农业银行	3,702,950.69	109,978.08	65,764,402.03	158,832.03
摩根大通银行	1,224,093.84	-	4,472,550.00	-

注：本基金的银行存款由基金托管人 农业银行和境外资产托管人摩根大通银行保管，存放于农业银行的银行存款按银行同业利率计息，存放于摩根大通银行的银行存款不计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

7.4.12 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
02369	酷派集团	2017年3月31日	重大事	0.60	-	-	164,000	116,550.43	98,704.25	-

		日	项							
06863	辉山乳业	2017 年3 月27 日	重 大 事 项	0.35	-	-	212,000	538,969.89	74,429.43	-
03886	康健国际医疗	2017 年11 月27 日	重 大 事 项	0.58	-	-	110,000	122,662.27	63,445.57	-
01236	国农控股	2017 年3 月28 日	重 大 事 项	0.99	-	-	46,000	71,262.08	45,757.71	-
01019	CONVOYGLOBALHOLDINGSLTD	2017 年12 月8 日	重 大 事 项	0.14	-	-	270,000	50,157.33	37,691.18	-

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

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 农业银行及境外次托管行摩根大通银行，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 2017 年 12 月 31 日，本基金未持有债券投资（上年度末：同）。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外(如有)，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额(如有)将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,702,950.69	-	-	1,224,093.84	4,927,044.53
交易性金融资产	-	-	-	64,992,991.76	64,992,991.76
应收利息	-	-	-	851.45	851.45
应收股利	-	-	-	40,242.84	40,242.84
应收申购款	1,370.77	-	-	1,845.91	3,216.68
资产总计	3,704,321.46	-	-	66,260,025.80	69,964,347.26
负债					
应付证券清算款	-	-	-	13.17	13.17
应付赎回款	-	-	-	183,039.25	183,039.25
应付管理人报酬	-	-	-	57,722.55	57,722.55
应付托管费	-	-	-	14,430.65	14,430.65
应付交易费用	-	-	-	162,882.00	162,882.00
其他负债	-	-	-	282,222.82	282,222.82
负债总计	-	-	-	700,310.44	700,310.44
利率敏感度缺口	3,704,321.46	-	-	65,559,715.36	69,264,036.82
上年度末 2016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	65,764,402.03	-	-	4,472,550.00	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
交易性金融资产	-	-	-	39,070,978.56	39,070,978.56
买入返售金融资产	-	-	-	100,000,000.00	100,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	25,022,891.94	25,022,891.94
应收利息	-	-	-	27,435.82	27,435.82

应收股利	-	-	-	6,361.50	6,361.50
应收申购款	-	-	-	111,224.27	111,224.27
资产总计	65,764,402.03	-	-	179,447,278.89	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	65,764,402.03	-	-	-164,725,728.24	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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于2017年12月31日，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(2016年12月31日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有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。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末			
	2017年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	1,224,096.67	-	1,224,096.67
交易性金融资产	-	64,992,991.76	-	64,992,991.76
应收股利	-	40,242.84	-	40,242.84
资产合计	-	66,257,331.27	-	66,257,331.27
以外币计价的负债				

应付证券清算款	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	66,257,331.27	-	66,257,331.27
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
交易性金融资产	-	39,070,978.56	-	39,070,978.56
应收股利	-	6,361.50	-	6,361.50
资产合计	-	43,549,890.06	-	43,549,890.06
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	43,549,890.06	-	43,549,890.06

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除港币以外的其他市场变量保持不变		
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12月31日）	上年度末（2016年12月31日）
	港币相对人民币升值 5%	3,310,000.00	1,740,000.00
	港币相对人民币贬值 5%	-3,310,000.00	-1,740,000.00

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%，投资于以标的指数为跟踪标的的公募基金、上市交易型基金、结构性产品的比例不超过基金资产净值的 10%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 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	64,992,991.76	93.83	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	—	0.00	—	0.00

资				
衍生金融资产—权证投资	-	0.00	-	0.00
其他	-	0.00	-	0.00
合计	64,992,991.76	93.83	39,070,978.56	16.95

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)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12月31日)	上年度末(2016年12月31日)
	1. 业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	3,110,000.00	-
2. 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-3,110,000.00	-	

注:于 2016 年 12 月 31 日,本基金合同生效尚未满一年,无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 64,672,963.62 元，属于第二层次的余额为 320,028.14 元，无属于第三层次的余额（2016 年 12 月 31 日：第一层次 38,921,268.89 元，第二层次 149,709.67 元，无第三层次）。

(ii) 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，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2016 年 12 月 31 日：同）。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 增值税

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，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。

根据财政部、国家税务总局于 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。

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至 2017 年 12 月 31 日止的财务状况和经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	64,992,991.76	92.89
	其中：普通股	64,992,991.76	92.89
	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	4,927,044.53	7.04
...	-	-	0.00
8	其他各项资产	44,310.97	0.06
9	合计	69,964,347.26	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 60,674,834.55 元，占期末基金资产净值的比例为 87.60%。

8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比列 (%)
香港	64,992,991.76	93.83
合计	64,992,991.76	93.83

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

8.3.1 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	占基金资产净值比列 (%)
工业	10,955,980.97	15.82
消费者非必需品	10,448,374.32	15.08
房地产	9,539,961.63	13.77
信息技术	8,219,076.72	11.87
金融	7,884,853.15	11.38
基础材料	5,843,916.20	8.44
医疗保健	5,081,048.86	7.34
公用事业	2,795,776.23	4.04
消费者常用品	2,039,670.55	2.94
能源	1,182,770.85	1.71
电信服务	1,001,562.28	1.45
合计	64,992,991.76	93.83

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

8.3.2 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。

8.4 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	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	融创中国	1918 HK	港交所	中国香港	47,000	1,270,959.36	1.83
2	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	海螺水泥	914 HK	港交所	中国香港	28,500	875,511.24	1.26
3	BYD CO LTD-H	比亚迪	1211 HK	港交所	中国香港	14,500	825,419.33	1.19
4	NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	新华保险	1336 HK	港交所	中国香港	17,800	794,549.17	1.15
5	CHINA VANKE CO LTD-H	万科	2202 HK	港交所	中国香港	30,200	787,627.84	1.14
6	SINOPHARM GROUP CO-H	国药控股	1099 HK	港交所	中国香港	27,600	779,803.72	1.13
7	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	广汽集团	2238 HK	港交所	中国香港	50,000	774,052.66	1.12

8	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	中芯国际	981 HK	港 交 所	中 国 香 港	67,500	762,851.47	1.10
9	MINTH GROUP LTD	敏实集团	425 HK	港 交 所	中 国 香 港	18,000	709,436.82	1.02
10	CRRC CORP LTD - H	中国中车	1766 HK	港 交 所	中 国 香 港	100,000	698,820.76	1.01
11	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	海螺创业	586 HK	港 交 所	中 国 香 港	41,500	627,893.80	0.91
12	KINGSTON FINANCIAL GROUP LTD	金利丰金 融	1031 HK	港 交 所	中 国 香 港	98,000	614,393.85	0.89
13	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	ASM PACIFIC	522 HK	港 交 所	中 国 香 港	6,600	600,801.95	0.87
14	CITIC SECURITIES CO LTD-H	中信证券	6030 HK	港 交 所	中 国 香 港	44,500	599,631.68	0.87
15	KINGBOARD CHEMICAL HOLDINGS	建滔化工	148 HK	港 交 所	中 国 香 港	16,500	582,733.76	0.84
16	PEOPLES INSURANCE CO GROU-H	中国人民 保险集团	1339 HK	港 交 所	中 国 香 港	171,000	550,321.35	0.79
17	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	长城汽车	2333 HK	港 交 所	中 国 香 港	71,500	534,919.71	0.77

18	HYSAN DEVELOPMENT CO	希慎兴业	14 HK	港 交 所	中 国 香 港	15,000	519,727.04	0.75
19	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	中车时代 电气	3898 HK	港 交 所	中 国 香 港	12,000	510,072.28	0.74
20	CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	康哲药业	867 HK	港 交 所	中 国 香 港	33,000	502,599.25	0.73
21	DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	东风集团 股份	489 HK	港 交 所	中 国 香 港	62,000	490,277.93	0.71
22	HUATAI SECURITIES CO LTD-H	华泰证券	6886 HK	港 交 所	中 国 香 港	37,600	489,054.16	0.71
23	SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	复星医药	2196 HK	港 交 所	中 国 香 港	11,500	482,090.19	0.70
24	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	信义玻璃	868 HK	港 交 所	中 国 香 港	56,000	476,535.57	0.69
25	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	玖龙纸业	2689 HK	港 交 所	中 国 香 港	45,000	470,951.69	0.68
26	LANDING INTERNATIONAL DEVELO	蓝鼎国际	582 HK	港 交 所	中 国 香 港	1,800,000	466,437.78	0.67
27	GF SECURITIES CO LTD-H	广发证券	1776 HK	港 交 所	中 国 香 港	35,200	462,545.78	0.67

28	ZTE CORP-H	中兴通讯	763 HK	港 交 所	中 国 香 港	18,200	446,518.04	0.64
29	MEITU INC	美图公司	1357 HK	港 交 所	中 国 香 港	49,000	445,640.34	0.64
30	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	中国中铁	390 HK	港 交 所	中 国 香 港	92,000	444,503.50	0.64
31	CGN POWER CO LTD-H	中广核电力	1816 HK	港 交 所	中 国 香 港	244,000	432,399.52	0.62
32	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	中国铝业	2600 HK	港 交 所	中 国 香 港	90,000	420,546.32	0.61
33	HUANENG POWER INTL INC-H	华能国际	902 HK	港 交 所	中 国 香 港	102,000	417,787.82	0.60
34	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	中国民航信息网络	696 HK	港 交 所	中 国 香 港	21,000	411,643.88	0.59
35	KINGSOFT CORP LTD	金山软件	3888 HK	港 交 所	中 国 香 港	18,000	391,205.88	0.56
36	3SBIO INC	三生制药	1530 HK	港 交 所	中 国 香 港	30,500	391,097.21	0.56
37	CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	中国银河	6881 HK	港 交 所	中 国 香 港	80,500	387,594.75	0.56

38	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	中国建材	3323 HK	港交所	中国香港	66,000	385,638.72	0.56
39	AIR CHINA LTD-H	中国国航	753 HK	港交所	中国香港	48,000	380,372.49	0.55
40	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	洛阳钼业	3993 HK	港交所	中国香港	90,000	377,664.14	0.55
41	PCCW LTD	电讯盈科	8 HK	港交所	中国香港	98,000	371,913.08	0.54
42	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	中国铁建	1186 HK	港交所	中国香港	47,500	359,733.87	0.52
43	GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	富力地产	2777 HK	港交所	中国香港	24,400	359,381.11	0.52
44	AGILE GROUP HOLDINGS LTD	雅居乐集团	3383 HK	港交所	中国香港	36,000	356,900.13	0.52
45	BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	北京首都机场股份	694 HK	港交所	中国香港	36,000	354,492.71	0.51
46	SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	远洋集团	3377 HK	港交所	中国香港	78,000	351,433.28	0.51
47	GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	保利协鑫能源	3800 HK	港交所	中国香港	299,000	349,911.93	0.51

48	MELCO INTERNATIONAL DEVELOP.	新濠国际 发展	200 HK	港 交 所	中 国 香 港	18,000	346,066.74	0.50
49	VTECH HOLDINGS LTD	VTECH HOLDINGS	303 HK	港 交 所	中 国 香 港	4,000	342,388.74	0.49
50	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	紫金矿业	2899 HK	港 交 所	中 国 香 港	138,000	340,298.96	0.49
51	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	龙源电力	916 HK	港 交 所	中 国 香 港	73,000	339,279.15	0.49
52	TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	青岛啤酒	168 HK	港 交 所	中 国 香 港	10,000	336,871.73	0.49
53	YANZHOU COAL MINING CO-H	兖州煤业	1171 HK	港 交 所	中 国 香 港	44,000	336,169.57	0.49
54	HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	海天国际	1882 HK	沪 港 通	中 国 香 港	17,000	333,946.05	0.48
55	NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	耐世特	1316 HK	港 交 所	中 国 香 港	21,000	326,857.53	0.47
56	CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	旭辉控股 集团	884 HK	港 交 所	中 国 香 港	82,000	322,845.16	0.47
57	WEICHAI POWER CO LTD-H	潍柴动力	2338 HK	港 交 所	中 国 香 港	45,000	321,992.53	0.46

58	CHINA EVERBRIGHT LTD	中国光大控股	165 HK	港交所	中国香港	22,000	321,457.55	0.46
59	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	福耀玻璃	3606 HK	港交所	中国香港	11,600	319,501.52	0.46
60	FAR EAST HORIZON LTD	远东宏信	3360 HK	港交所	中国香港	57,000	317,804.62	0.46
61	ORIENT OVERSEAS INTL LTD	东方海外国际	316 HK	港交所	中国香港	5,000	315,138.07	0.45
62	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	上海石化	338 HK	港交所	中国香港	84,000	312,463.16	0.45
63	JIANGXI COPPER CO LTD-H	江西铜业	358 HK	港交所	中国香港	30,000	310,958.52	0.45
64	VITASOY INTL HOLDINGS LTD	VITASOY INTL	345 HK	港交所	中国香港	18,000	300,927.60	0.43
65	GENSCRIPT BIOTECH CORP	金斯瑞生物科技	1548 HK	港交所	中国香港	18,000	300,626.67	0.43
66	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	南方航空	1055 HK	港交所	中国香港	44,000	296,814.92	0.43
67	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	理文造纸	2314 HK	港交所	中国香港	38,000	293,504.72	0.42

68	CHINA COAL ENERGY CO-H	中煤能源	1898 HK	港 交 所	中 国 香 港	99,000	292,125.47	0.42
69	FORTUNE REIT	置富产业 信托	778 HK	港 交 所	中 国 香 港	35,000	282,621.17	0.41
70	JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	宁沪高速	177 HK	港 交 所	中 国 香 港	28,000	278,525.21	0.40
71	SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	上海医药	2607 HK	港 交 所	中 国 香 港	15,700	277,568.10	0.40
72	FIRST PACIFIC CO	第一太平	142 HK	港 交 所	中 国 香 港	62,000	274,680.03	0.40
73	COSCO SHIPPING PORTS LTD	中远海运 港口	1199 HK	港 交 所	中 国 香 港	40,000	271,837.93	0.39
74	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	比亚迪电 子	285 HK	港 交 所	中 国 香 港	19,000	270,316.58	0.39
75	CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	重庆农村 商业银行	3618 HK	港 交 所	中 国 香 港	58,000	267,624.95	0.39
76	CHINA OILFIELD SERVICES-H	中海油服	2883 HK	港 交 所	中 国 香 港	42,000	267,173.55	0.39
77	KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	建滔积层 板	1888 HK	港 交 所	中 国 香 港	26,000	264,715.98	0.38

78	SHENZHEN HOLDINGS	INTL	深圳国际	152 HK	港 交 所	中 国 香 港	21,000	261,205.16	0.38
79	JOHNSON HOLDINGS	ELECTRIC	德昌电机 控股	179 HK	港 交 所	中 国 香 港	9,500	260,072.50	0.38
80	LEGEND CORP-H	HOLDINGS	联想控股	3396 HK	港 交 所	中 国 香 港	8,600	258,078.85	0.37
81	XINYI HOLDINGS LTD	SOLAR	信义光能	968 HK	港 交 所	中 国 香 港	102,000	257,493.72	0.37
82	WUXI CAYMAN INC	BIOLOGICS	药明生物	2269 HK	港 交 所	中 国 香 港	7,000	255,704.87	0.37
83	LUK FOOK INTL LTD	HOLDINGS	六福集团	590 HK	港 交 所	中 国 香 港	9,000	252,403.02	0.36
84	KWG HOLDING LTD	PROPERTY	合景泰富	1813 HK	港 交 所	中 国 香 港	33,000	251,851.32	0.36
85	ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H		浙江沪杭 甬	576 HK	港 交 所	中 国 香 港	34,000	244,135.87	0.35
86	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H		中国通信 服务	552 HK	港 交 所	中 国 香 港	54,000	236,529.09	0.34
87	LI NING CO LTD		李宁	2331 HK	港 交 所	中 国 香 港	44,500	235,463.31	0.34

88	CHAMPION REIT	冠君产业 信托	2778 HK	港 交 所	中 国 香 港	49,000	234,698.45	0.34
89	HUANENG RENEWABLES CORP-H	华能新能 源	958 HK	港 交 所	中 国 香 港	104,000	230,376.80	0.33
90	SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	四环医药	460 HK	港 交 所	中 国 香 港	98,000	230,192.90	0.33
91	CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	中国软件 国际	354 HK	港 交 所	中 国 香 港	52,000	225,595.39	0.33
92	BAIC MOTOR CORP LTD-H	北京汽车	1958 HK	港 交 所	中 国 香 港	26,500	225,503.44	0.33
93	CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	中国金茂	817 HK	港 交 所	中 国 香 港	78,000	224,291.37	0.32
94	MAN WAH HOLDINGS LTD	敏华控股	1999 HK	港 交 所	中 国 香 港	35,200	218,620.56	0.32
95	LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO L	龙光地产	3380 HK	港 交 所	中 国 香 港	32,000	216,132.89	0.31
96	GOME RETAIL HOLDINGS LTD	国美零售	493 HK	港 交 所	中 国 香 港	274,000	215,296.98	0.31
97	KAISA GROUP HOLDINGS LTD	佳兆业集 团	1638 HK	港 交 所	中 国 香 港	57,000	210,122.70	0.30

98	SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	威高股份	1066 HK	港 交 所	中 国 香 港	44,000	209,278.43	0.30
99	LUYE PHARMA GROUP LTD	绿叶制药	2186 HK	港 交 所	中 国 香 港	40,000	206,302.59	0.30
100	SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	上海实业 控股	363 HK	港 交 所	中 国 香 港	11,000	205,968.22	0.30
101	GREAT EAGLE HOLDINGS LTD	鹰君	41 HK	港 交 所	中 国 香 港	6,000	205,383.09	0.30
102	CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	光大银行	6818 HK	港 交 所	中 国 香 港	67,000	204,421.79	0.30
103	ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	中升控股	881 HK	港 交 所	中 国 香 港	13,500	201,320.56	0.29
104	VALUE PARTNERS GROUP LTD	惠理集团	806 HK	港 交 所	中 国 香 港	29,000	201,203.54	0.29
105	GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	国泰君安	2611 HK	港 交 所	中 国 香 港	13,800	200,718.71	0.29
106	COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	中远海控	1919 HK	港 交 所	中 国 香 港	59,500	200,438.68	0.29
107	SHENZHEN INVESTMENT LTD	深圳控股	604 HK	港 交 所	中 国 香 港	74,000	200,417.78	0.29

108	CHINA RESOURCES CEMENT	华润水泥 控股	1313 HK	港 交 所	中 国 香 港	46,000	197,642.56	0.29
109	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	越秀房产 信托基金	405 HK	港 交 所	中 国 香 港	46,000	196,873.52	0.28
110	HEALTH AND HAPPINESS H&H INT	H&H 国际 控股	1112 HK	港 交 所	中 国 香 港	4,500	195,226.78	0.28
111	CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	中国再保 险	1508 HK	港 交 所	中 国 香 港	131,000	194,917.49	0.28
112	CHINA MERCHANTS SECURITIES-H	招商证券	6099 HK	港 交 所	中 国 香 港	19,200	194,519.60	0.28
113	HAITONG INTERNATIONAL SECURI	海通国际	665 HK	港 交 所	中 国 香 港	52,000	193,864.25	0.28
114	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	海丰国际	1308 HK	港 交 所	中 国 香 港	30,000	193,596.76	0.28
115	YUEXIU PROPERTY CO LTD	越秀地产	123 HK	港 交 所	中 国 香 港	156,000	190,386.86	0.27
116	TELEVISION BROADCASTS LTD	电视广播	511 HK	港 交 所	中 国 香 港	7,900	185,563.66	0.27
117	SOHO CHINA LTD	S O H O 中国	410 HK	港 交 所	中 国 香 港	48,000	183,365.22	0.26

118	SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	上海电气	2727 HK	港 交 所	中 国 香 港	68,000	183,030.85	0.26
119	MMG LTD	五矿资源	1208 HK	港 交 所	中 国 香 港	56,000	181,626.52	0.26
120	CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	东方航空	670 HK	港 交 所	中 国 香 港	38,000	180,105.17	0.26
121	SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	中石化炼化工程	2386 HK	港 交 所	中 国 香 港	28,500	176,293.42	0.25
122	BOC AVIATION LTD	中银航空 租赁	2588 HK	港 交 所	中 国 香 港	5,000	174,078.26	0.25
123	CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	中国通号	3969 HK	港 交 所	中 国 香 港	34,000	173,936.15	0.25
124	CHINA POWER INTERNATIONAL	中国电力	2380 HK	港 交 所	中 国 香 港	101,000	173,075.17	0.25
125	UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	统一企业 中国	220 HK	港 交 所	中 国 香 港	31,000	169,472.39	0.24
126	IGG INC	IGG	799 HK	港 交 所	中 国 香 港	24,000	169,321.93	0.24
127	CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	中金公司	3908 HK	港 交 所	中 国 香 港	12,400	168,539.52	0.24

128	DAH SING FINANCIAL HOLDINGS	大新金融	440 HK	港 交 所	中 国 香 港	4,000	167,349.18	0.24
129	TONGDA GROUP HOLDINGS LTD	通达集团	698 HK	港 交 所	中 国 香 港	100,000	167,182.00	0.24
130	CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	中国中药	570 HK	港 交 所	中 国 香 港	48,000	166,914.51	0.24
131	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	中航科工	2357 HK	港 交 所	中 国 香 港	48,000	166,914.51	0.24
132	PACIFIC TEXTILES HOLDINGS	互太纺织	1382 HK	港 交 所	中 国 香 港	24,000	165,510.18	0.24
133	XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	金风科技	2208 HK	港 交 所	中 国 香 港	14,880	165,181.17	0.24
134	HENG TEN NETWORKS GROUP LTD	恒腾网络	136 HK	港 交 所	中 国 香 港	540,000	164,757.86	0.24
135	CHINA SOUTH CITY HOLDINGS	华南城	1668 HK	港 交 所	中 国 香 港	96,000	164,507.09	0.24
136	FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLD	新城发展 控股	1030 HK	港 交 所	中 国 香 港	40,000	163,838.36	0.24
137	CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	中国粮油 控股	606 HK	港 交 所	中 国 香 港	57,000	162,952.30	0.24

138	FUFENG GROUP LTD	阜丰集团	546 HK	港 交 所	中 国 香 港	38,000	161,999.36	0.23
139	KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	金蝶国际	268 HK	港 交 所	中 国 香 港	44,000	161,832.18	0.23
140	BBMG CORP-H	金隅集团	2009 HK	港 交 所	中 国 香 港	54,000	160,243.95	0.23
141	SHUI ON LAND LTD	瑞安房地 产	272 HK	港 交 所	中 国 香 港	87,500	157,986.99	0.23
142	SINOTRANS LIMITED-H	中国外运	598 HK	港 交 所	中 国 香 港	49,000	156,875.23	0.23
143	POLY PROPERTY GROUP CO LTD	保利置业 集团	119 HK	港 交 所	中 国 香 港	46,000	156,499.07	0.23
144	ANGANG STEEL CO LTD-H	鞍钢股份	347 HK	港 交 所	中 国 香 港	26,000	155,395.67	0.22
145	GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	绿城服务	2869 HK	港 交 所	中 国 香 港	30,000	153,473.08	0.22
146	FIH MOBILE LTD	富智康集 团	2038 HK	港 交 所	中 国 香 港	77,000	153,188.87	0.22
147	GUANGSHEN RAILWAY CO LTD-H	广深铁路	525 HK	港 交 所	中 国 香 港	34,000	149,209.94	0.22

148	HKBN LTD	香港宽带	1310 HK	港 交 所	中 国 香 港	18,000	148,658.23	0.21
149	FU SHOU YUAN INTERNATIONAL	福寿园	1448 HK	港 交 所	中 国 香 港	26,000	144,963.51	0.21
150	CAFE DE CORAL HOLDINGS LTD	大家乐集 团	341 HK	港 交 所	中 国 香 港	8,000	143,442.16	0.21
151	RED STAR MACALLINE GROUP C-H	美凯龙	1528 HK	港 交 所	中 国 香 港	13,400	141,807.12	0.20
152	DAH SING BANKING GROUP LTD	大新银行 集团	2356 HK	港 交 所	中 国 香 港	10,000	141,770.34	0.20
153	ESPRIT HOLDINGS LTD	思捷环球	330 HK	港 交 所	中 国 香 港	40,000	139,764.15	0.20
154	DATANG INTL POWER GEN CO-H	大唐发电	991 HK	港 交 所	中 国 香 港	72,000	139,028.55	0.20
155	ZHOU HEI YA INTERNATIONAL HO	周黑鸭	1458 HK	港 交 所	中 国 香 港	20,000	137,089.24	0.20
156	CHINA ZHENG TONG AUTO SERVICE	正通汽车	1728 HK	港 交 所	中 国 香 港	20,500	135,546.99	0.20
157	YANGTZE OPTICAL FIBRE AND-H	长飞光纤 光缆	6869 HK	港 交 所	中 国 香 港	4,500	135,041.26	0.19

158	SKYWORTH DIGITAL HLDGS LTD	创维数码	751 HK	港 交 所	中 国 香 港	48,000	134,815.56	0.19
159	CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	中国忠旺	1333 HK	港 交 所	中 国 香 港	37,600	134,521.32	0.19
160	STELLA INTERNATIONAL	九兴控股	1836 HK	港 交 所	中 国 香 港	13,500	133,160.46	0.19
161	METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	中国中冶	1618 HK	港 交 所	中 国 香 港	69,000	132,658.92	0.19
162	TONG REN TANG TECHNOLOGIES-H	同仁堂科 技	1666 HK	港 交 所	中 国 香 港	14,000	132,240.96	0.19
163	PACIFIC BASIN SHIPPING LTD	太平洋航 运	2343 HK	港 交 所	中 国 香 港	93,000	131,379.97	0.19
164	GUOTAI JUNAN INTERNATIONAL	国泰君安 国际	1788 HK	港 交 所	中 国 香 港	64,000	131,070.69	0.19
165	GREENTOWN CHINA HOLDINGS	绿城中国	3900 HK	港 交 所	中 国 香 港	15,500	130,343.45	0.19
166	CHINA SCE PROPERTY HOLDINGS	中骏置业	1966 HK	港 交 所	中 国 香 港	46,000	129,582.77	0.19
167	TIBET WATER RESOURCES LTD	西藏水资 源	1115 HK	港 交 所	中 国 香 港	43,000	128,679.99	0.19

168	SSY GROUP LTD	石四药集团	2005 HK	港 交 所	中 国 香 港	32,000	128,663.27	0.19
169	CHINA RESOURCES PHOENIX HEAL	华润凤凰 医疗	1515 HK	港 交 所	中 国 香 港	15,500	127,752.13	0.18
170	CHINA TRAVEL INTL INV HK	香港中旅	308 HK	港 交 所	中 国 香 港	52,000	126,489.90	0.18
171	NAN HAI CORP LTD	南海控股	680 HK	港 交 所	中 国 香 港	550,000	124,132.64	0.18
172	CHINA HIGH SPEED TRANSMISSIO	中国高速 传动	658 HK	港 交 所	中 国 香 港	11,000	124,132.64	0.18
173	MAANSHAN IRON & STEEL-H	马钢股份	323 HK	港 交 所	中 国 香 港	40,000	123,380.32	0.18
174	CHINA MAPLE LEAF EDUCATIONAL	枫叶教育	1317 HK	港 交 所	中 国 香 港	16,000	122,510.97	0.18
175	JIAYUAN INTERNATIONAL GROUP	佳源国际 控股	2768 HK	港 交 所	中 国 香 港	20,000	121,374.13	0.18
176	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	招金矿业	1818 HK	港 交 所	中 国 香 港	24,000	121,374.13	0.18
177	SINOTRUK HONG KONG LTD	中国重汽	3808 HK	港 交 所	中 国 香 港	16,500	121,374.13	0.18

178	TOWNGAS CHINA CO LTD	港华燃气	1083 HK	港 交 所	中 国 香 港	23,000	120,738.84	0.17
179	LIVZON PHARMACEUTICAL GROUP-H	丽珠集团	1513 HK	港 交 所	中 国 香 港	2,320	119,655.50	0.17
180	CHINA WATER AFFAIRS GROUP	中国水务	855 HK	港 交 所	中 国 香 港	20,000	118,197.67	0.17
181	LONKING HOLDINGS LTD	中国龙工	3339 HK	港 交 所	中 国 香 港	41,000	117,554.02	0.17
182	CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD	中国东方集团	581 HK	港 交 所	中 国 香 港	24,000	116,960.53	0.17
183	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	阳光房地产基金	435 HK	港 交 所	中 国 香 港	26,000	116,492.42	0.17
184	UNIVERSAL MEDICAL FINANCIAL	环球医疗	2666 HK	港 交 所	中 国 香 港	18,500	116,137.16	0.17
185	GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARM-H	白云山	874 HK	港 交 所	中 国 香 港	6,000	115,606.35	0.17
186	BEIJING ENTERPRISES CLEAN EN	北控清洁能源集团	1250 HK	港 交 所	中 国 香 港	520,000	115,188.40	0.17
187	CMBC CAPITAL HOLDINGS LTD	民银资本	1141 HK	港 交 所	中 国 香 港	260,000	115,188.40	0.17

188	COSCO SHIPPING DEVELOPMENT-H	中远海发	2866 HK	港 交 所	中 国 香 港	86,000	115,021.22	0.17
189	K WAH INTL HOLDINGS	嘉华国际	173 HK	港 交 所	中 国 香 港	32,000	114,218.74	0.16
190	FREEMAN FINTECH CORP LTD	民众金融 科技	279 HK	港 交 所	中 国 香 港	260,000	113,015.03	0.16
191	YUZHOU PROPERTIES CO	禹洲地产	1628 HK	港 交 所	中 国 香 港	32,000	111,543.83	0.16
192	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	华虹半导 体	1347 HK	港 交 所	中 国 香 港	8,000	110,875.10	0.16
193	CHOW SANG SANG HLDG	周生生	116 HK	港 交 所	中 国 香 港	7,000	110,473.87	0.16
194	FAR EAST CONSORTIUM INTERNAT	远东发展	35 HK	港 交 所	中 国 香 港	28,000	110,005.76	0.16
195	CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	中国联塑	2128 HK	港 交 所	中 国 香 港	26,000	109,972.32	0.16
196	DFZQ-H	东方证券	3958 HK	港 交 所	中 国 香 港	17,600	108,721.80	0.16
197	TIANNENG POWER INTL LTD	天能动力	819 HK	港 交 所	中 国 香 港	16,000	108,601.43	0.16

198	HOPEWELL HIGHWAY INFRASTRUCT	合和公路 基建	737 HK	港 交 所	中 国 香 港	26,000	108,233.63	0.16
199	POWERLONG REAL ESTATE HOLDIN	宝龙地产	1238 HK	港 交 所	中 国 香 港	34,000	107,715.36	0.16
200	TRULY INTERNATIONAL HOLDINGS	信利国际	732 HK	港 交 所	中 国 香 港	38,000	107,364.28	0.16
201	KERRY LOGISTICS NETWORK LTD	嘉里物流	636 HK	港 交 所	中 国 香 港	11,500	106,511.65	0.15
202	SHENZHEN EXPRESSWAY CO-H	深高速	548 HK	港 交 所	中 国 香 港	16,000	106,060.26	0.15
203	GIORDANO INTERNATIONAL LTD	佐丹奴国 际	709 HK	港 交 所	中 国 香 港	30,000	104,321.57	0.15
204	CHINA EVERBRIGHT GREENTECH L	中国光大 绿色环保	1257 HK	港 交 所	中 国 香 港	17,000	102,315.38	0.15
205	KUANGCHI SCIENCE LTD	光启科学	439 HK	港 交 所	中 国 香 港	49,000	101,579.78	0.15
206	SINOPEC KANTONS HOLDINGS	中石化冠 德	934 HK	港 交 所	中 国 香 港	24,000	101,312.29	0.15
207	CSC FINANCIAL CO LTD-H	中信建投 证券	6066 HK	港 交 所	中 国 香 港	17,500	101,228.70	0.15

208	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	中远海能	1138 HK	港 交 所	中 国 香 港	28,000	99,941.40	0.14
209	LIFESTYLE INTL HLDGS LTD	利福国际	1212 HK	港 交 所	中 国 香 港	11,500	99,782.58	0.14
210	FDG ELECTRIC VEHICLES LTD	五龙电动车	729 HK	港 交 所	中 国 香 港	360,000	99,306.11	0.14
211	HUADIAN FUXIN ENERGY CORP -H	华电福新	816 HK	港 交 所	中 国 香 港	62,000	98,988.46	0.14
212	COOLPAD GROUP LTD	酷派集团	2369 HK	港 交 所	中 国 香 港	164,000	98,704.25	0.14
213	CHINA DONGXIANG GROUP CO	中国动向	3818 HK	港 交 所	中 国 香 港	80,000	96,965.56	0.14
214	HUADIAN POWER INTL CORP-H	华电国际	1071 HK	港 交 所	中 国 香 港	40,000	94,959.38	0.14
215	MICROPORT SCIENTIFIC CORP	微创医疗	853 HK	港 交 所	中 国 香 港	15,000	94,666.81	0.14
216	ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	中联重科	1157 HK	港 交 所	中 国 香 港	33,600	94,090.03	0.14
217	CHINA AOYUAN PROPERTY GROUP	中国奥园	3883 HK	港 交 所	中 国 香 港	26,000	93,237.40	0.13

218	UNITED ENERGY GROUP LTD	联合能源集团	467 HK	港 交 所	中 国 香 港	190,000	90,529.05	0.13
219	CP POKPHAND CO LTD	卜蜂国际	43 HK	港 交 所	中 国 香 港	174,000	90,177.97	0.13
220	HUI SHANG BANK CORP LTD-H	徽商银行	3698 HK	港 交 所	中 国 香 港	25,000	89,442.37	0.13
221	HUTCHISON TELECOMM HONG KONG	和记电讯香港	215 HK	港 交 所	中 国 香 港	34,000	89,241.75	0.13
222	CHINA BLUECHEMICAL LTD - H	中海石油化学	3983 HK	港 交 所	中 国 香 港	42,000	86,717.30	0.13
223	SHUN TAK HOLDINGS LTD	信德集团	242 HK	港 交 所	中 国 香 港	34,000	86,683.87	0.13
224	GREATVIEW ASEPTIC PACKAGING	纷美包装	468 HK	港 交 所	中 国 香 港	18,000	85,764.37	0.12
225	CHINA OIL AND GAS GROUP LTD	中油燃气	603 HK	港 交 所	中 国 香 港	120,000	85,262.82	0.12
226	SMI HOLDINGS GROUP LTD	星美控股	198 HK	港 交 所	中 国 香 港	24,800	84,995.33	0.12
227	CHINA MACHINERY ENGINEERING-H	中国机械工程	1829 HK	港 交 所	中 国 香 港	20,000	84,761.27	0.12

228	PROSPERITY REIT	泓富产业 信托	808 HK	港 交 所	中 国 香 港	30,000	83,758.18	0.12
229	CHINA HARMONY NEW ENERGY AUT	和谐汽车	3836 HK	港 交 所	中 国 香 港	17,500	83,382.02	0.12
230	Q TECHNOLOGY GROUP CO LTD	丘钛科技	1478 HK	港 交 所	中 国 香 港	9,000	82,755.09	0.12
231	CT ENVIRONMENTAL GROUP LTD	中滔环保	1363 HK	港 交 所	中 国 香 港	68,000	82,420.73	0.12
232	TIAN GE INTERACTIVE HOLDINGS	天鸽互动	1980 HK	港 交 所	中 国 香 港	16,000	82,387.29	0.12
233	GLOBAL BRANDS GROUP HOLDING	利标品牌	787 HK	港 交 所	中 国 香 港	154,000	82,387.29	0.12
234	LIFETECH SCIENTIFIC CORP	先健科技	1302 HK	港 交 所	中 国 香 港	52,000	81,283.89	0.12
235	CHINA METAL RESOURCES UTILIZ	中国金属 利用	1636 HK	港 交 所	中 国 香 港	20,000	80,748.91	0.12
236	PANDA GREEN ENERGY GROUP LTD	熊猫绿能	686 HK	港 交 所	中 国 香 港	98,000	80,280.80	0.12
237	DIGITAL CHINA HOLDINGS LTD	神州控股	861 HK	港 交 所	中 国 香 港	18,000	79,896.28	0.12

238	GOODBABY INTERNATIONAL HOLDI	好孩子国 际	1086 HK	港 交 所	中 国 香 港	22,000	78,893.19	0.11
239	CHINA OVERSEAS GRAND OCEANS	中国海外 宏洋集团	81 HK	港 交 所	中 国 香 港	22,000	78,709.29	0.11
240	CHINA INTERNATIONAL MARINE-H	中集集团	2039 HK	港 交 所	中 国 香 港	6,200	78,257.89	0.11
241	CARNIVAL GROUP INTERNATIONAL	嘉年华国 际	996 HK	港 交 所	中 国 香 港	210,000	78,115.79	0.11
242	GEMDALE PROPERTIES AND INVES	金地商置	535 HK	港 交 所	中 国 香 港	114,000	77,187.93	0.11
243	CIMC ENRIC HOLDINGS LTD	中集安瑞 科	3899 HK	港 交 所	中 国 香 港	14,000	76,887.00	0.11
244	YUEXIU TRANSPORT INFRASTRUCT	越秀交通 基建	1052 HK	港 交 所	中 国 香 港	16,000	76,769.97	0.11
245	CHINA FOODS LTD	中国食品	506 HK	港 交 所	中 国 香 港	20,000	76,402.17	0.11
246	SHOUGANG FUSHAN RESOURCES GR	首钢资源	639 HK	港 交 所	中 国 香 港	54,000	75,833.76	0.11
247	BANK OF CHONGQING CO LTD-H	重庆银行	1963 HK	港 交 所	中 国 香 港	14,500	75,390.72	0.11

248	SMARTONE TELECOMMUNICATIONS	数码通 电讯	315 HK	港 交 所	中 国 香 港	9,500	74,805.59	0.11
249	GCL NEW ENERGY HOLDINGS LTD	协鑫新 能源	451 HK	港 交 所	中 国 香 港	162,000	74,479.58	0.11
250	CHINA MODERN DAIRY HOLDINGS	现代牧 业	1117 HK	港 交 所	中 国 香 港	59,000	74,471.22	0.11
251	CAR INC	神州租 车	699 HK	港 交 所	中 国 香 港	13,000	74,437.79	0.11
252	CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	辉山乳 业	6863 HK	港 交 所	中 国 香 港	212,000	74,429.43	0.11
253	THE UNITED LABORATORIES INTE	联邦制 药	3933 HK	港 交 所	中 国 香 港	14,000	74,312.40	0.11
254	CENTRAL CHINA SECURITIES C-H	中原证 券	1375 HK	港 交 所	中 国 香 港	27,000	74,253.89	0.11
255	RONSHINE CHINA HOLDINGS LTD	融信中 国	3301 HK	港 交 所	中 国 香 港	10,000	72,724.17	0.10
256	HKR INTERNATIONAL LTD	香港兴 业国 际	480 HK	港 交 所	中 国 香 港	17,600	71,941.76	0.10
257	REDCO PROPERTIES GROUP LTD	力高地 产	1622 HK	港 交 所	中 国 香 港	24,000	71,420.15	0.10

258	SA SA INTERNATIONAL HLDGS	莎莎国际	178 HK	港 交 所	中 国 香 港	28,000	70,450.49	0.10
259	HC INTERNATIONAL INC	慧聪网	2280 HK	港 交 所	中 国 香 港	14,500	69,451.58	0.10
260	CANVEST ENVIRONMENTAL PROTEC	粤丰环保	1381 HK	港 交 所	中 国 香 港	18,000	69,363.81	0.10
261	SHANGHAI JIN JIANG INTL HO-H	锦江酒店	2006 HK	港 交 所	中 国 香 港	30,000	68,210.26	0.10
262	BEIJING CAPITAL LAND LTD-H	首创置业	2868 HK	港 交 所	中 国 香 港	20,000	67,875.89	0.10
263	CHAOWEI POWER HOLDINGS LTD	超威动力	951 HK	港 交 所	中 国 香 港	17,000	67,783.94	0.10
264	ROAD KING INFRASTRUCTURE LTD	路劲	1098 HK	港 交 所	中 国 香 港	6,000	67,608.40	0.10
265	VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	维达国际	3331 HK	港 交 所	中 国 香 港	5,000	65,535.34	0.09
266	TEXWINCA HOLDINGS LTD	德永佳集 团	321 HK	港 交 所	中 国 香 港	18,000	64,699.43	0.09
267	HUABAO INTERNATIONAL HOLDING	华宝国际	336 HK	港 交 所	中 国 香 港	15,000	64,448.66	0.09

268	NETDRAGON WEBSOFT HOLDINGS L	网龙	777 HK	港 交 所	中 国 香 港	3,500	63,487.36	0.09
269	TOWN HEALTH INTERNATIONAL ME	康健国际 医疗	3886 HK	港 交 所	中 国 香 港	110,000	63,445.57	0.09
270	XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	特步国际	1368 HK	港 交 所	中 国 香 港	24,000	61,188.61	0.09
271	CSSC OFFSHORE & MARINE ENG-H	中船防务	317 HK	港 交 所	中 国 香 港	6,000	61,088.30	0.09
272	DAH CHONG HONG	大昌行集 团	1828 HK	港 交 所	中 国 香 港	20,000	60,519.88	0.09
273	CONSUN PHARMACEUTICAL GROUP	康臣药业	1681 HK	港 交 所	中 国 香 港	10,000	59,182.43	0.09
274	CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	宇华教育	6169 HK	港 交 所	中 国 香 港	18,000	58,981.81	0.09
275	DALIAN PORT (PDA) CO LTD-H	大连港	2880 HK	港 交 所	中 国 香 港	50,000	58,931.66	0.09
276	CHINA GOLDJOY GROUP LTD	中国金洋	1282 HK	港 交 所	中 国 香 港	108,000	58,680.88	0.08
277	IMAX CHINA HOLDING INC	IMAX CHINA	1970 HK	港 交 所	中 国 香 港	3,000	58,680.88	0.08

278	CITYCHAMP WATCH & JEWELLERY	冠城钟表 珠宝	256 HK	港 交 所	中 国 香 港	36,000	58,680.88	0.08
279	YADEA GROUP HOLDINGS LTD	雅迪控股	1585 HK	港 交 所	中 国 香 港	26,000	58,246.21	0.08
280	CHINA LILANG LTD	中国利郎	1234 HK	港 交 所	中 国 香 港	11,000	58,020.51	0.08
281	HI SUN TECHNOLOGY CHINA LTD	高阳科技	818 HK	港 交 所	中 国 香 港	45,000	57,552.40	0.08
282	EMPEROR INTL HLDG LTD	英皇国际	163 HK	港 交 所	中 国 香 港	26,000	56,942.19	0.08
283	SINOTRANS SHIPPING LTD	中外运航 运	368 HK	港 交 所	中 国 香 港	34,000	56,557.67	0.08
284	PAX GLOBAL TECHNOLOGY LTD	百富环球	327 HK	港 交 所	中 国 香 港	19,000	55,588.02	0.08
285	GRAND BAOXIN AUTO GROUP LTD	广汇宝信	1293 HK	港 交 所	中 国 香 港	17,000	55,562.94	0.08
286	EVERBRIGHT SECURITIES CO L-H	光大证券	6178 HK	港 交 所	中 国 香 港	6,800	55,420.83	0.08
287	CITIC RESOURCES HOLDINGS LTD	中信资源	1205 HK	港 交 所	中 国 香 港	86,000	55,353.96	0.08

288	WISDOM EDUCATION INTERNATION	睿见教育	6068 HK	港 交 所	中国 香港	14,000	55,119.91	0.08
289	TEXHONG TEXTILE GROUP LTD	天虹纺织	2678 HK	港 交 所	中国 香港	6,500	55,094.83	0.08
290	CENTRAL CHINA REAL ESTATE	建业地产	832 HK	港 交 所	中国 香港	18,000	55,069.75	0.08
291	WEST CHINA CEMENT LTD	西部水泥	2233 HK	港 交 所	中国 香港	56,000	54,768.82	0.08
292	BEIJING GAS BLUE SKY HOLDING	北京燃气 蓝天	6828 HK	港 交 所	中国 香港	128,000	54,568.20	0.08
293	SINOPEC OILFIELD SERVICE -H	石化油服	1033 HK	港 交 所	中国 香港	50,000	54,334.15	0.08
294	SINOFERT HOLDINGS LTD	中化化肥	297 HK	港 交 所	中国 香港	50,000	54,334.15	0.08
295	FAIRWOOD HOLDINGS LTD	FAIRWOOD HOLD	52 HK	港 交 所	中国 香港	2,000	53,498.24	0.08
296	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	中海物业	2669 HK	港 交 所	中国 香港	30,000	53,163.88	0.08
297	SHANGHAI INDUSTRIAL URBAN DE	上实城市 开发	563 HK	港 交 所	中国 香港	34,000	53,147.16	0.08

298	GREENLAND HONG KONG HOLDINGS	绿地香港	337 HK	港 交 所	中 国 香 港	20,000	51,993.60	0.08
299	CITIC TELECOM INTERNATIONAL	中信国际 电讯	1883 HK	港 交 所	中 国 香 港	30,000	51,910.01	0.07
300	CPMC HOLDINGS LTD	中粮包装	906 HK	港 交 所	中 国 香 港	10,000	51,742.83	0.07
301	REGINA MIRACLE INTERNATIONAL	维珍妮	2199 HK	港 交 所	中 国 香 港	8,000	51,492.06	0.07
302	CHINA LNG GROUP LTD	中国天然 气	931 HK	港 交 所	中 国 香 港	48,000	51,358.31	0.07
303	LAI SUN DEVELOPMENT	丽新发展	488 HK	港 交 所	中 国 香 港	4,500	50,029.21	0.07
304	POU SHENG INTL HOLDINGS LTD	宝胜国际	3813 HK	港 交 所	中 国 香 港	52,000	49,118.07	0.07
305	COGOBUY GROUP	科通芯城	400 HK	港 交 所	中 国 香 港	14,000	48,566.37	0.07
306	DIGITAL DOMAIN HOLDINGS LTD	数字王国	547 HK	港 交 所	中 国 香 港	330,000	47,997.95	0.07
307	GROUND INTERNATIONAL DEVELOP	广泽国际 发展	989 HK	港 交 所	中 国 香 港	30,000	47,646.87	0.07

308	HUAYI ENTERTAINMENT	TENCENT 娱乐	华谊腾讯 娱乐	419 HK	港 交 所	中国 香港	160,000	47,479.69	0.07
309	CHINA NEW HIGHER EDUCATION G	新高教集 团	新高教集 团	2001 HK	港 交 所	中国 香港	14,000	47,279.07	0.07
310	AJISEN HOLDINGS LTD	CHINA 味千 (中 国)	味千 (中 国)	538 HK	港 交 所	中国 香港	15,000	46,643.78	0.07
311	REALORD HOLDINGS LTD	GROUP 伟禄集团	伟禄集团	1196 HK	港 交 所	中国 香港	10,000	46,393.01	0.07
312	NATIONAL AGRICULTURAL HOLDIN	国农控股	国农控股	1236 HK	港 交 所	中国 香港	46,000	45,757.71	0.07
313	BEIJING CLEAN ENE-H	JINGNENG 京能清洁 能源	京能清洁 能源	579 HK	港 交 所	中国 香港	26,000	45,640.69	0.07
314	G-RESOURCES LTD	GROUP 国际资源	国际资源	1051 HK	港 交 所	中国 香港	558,000	45,244.46	0.07
315	COMBA SYSTEMS HOLDIN	TELECOM 京信通信	京信通信	2342 HK	港 交 所	中国 香港	36,000	45,139.14	0.07
316	LIU CHONG HING INVESTMENT	廖创兴企 业	廖创兴企 业	194 HK	港 交 所	中国 香港	4,000	45,139.14	0.07
317	MACAU DEVELOPMENT LTD	LEGEND 澳门励骏	澳门励骏	1680 HK	港 交 所	中国 香港	46,000	44,988.68	0.06

318	LEYOU TECHNOLOGIES HOLDINGS	乐游科技控股	1089 HK	港 交 所	中 国 香 港	30,000	44,637.59	0.06
319	CHINA AIRCRAFT LEASING GROUP	中国飞机租赁	1848 HK	港 交 所	中 国 香 港	6,500	44,391.00	0.06
320	BOSIDENG INTL HLDGS LTD	波司登	3998 HK	港 交 所	中 国 香 港	78,000	44,336.67	0.06
321	BOCOM INTERNATIONAL HOLDINGS	交银国际	3329 HK	港 交 所	中 国 香 港	20,000	44,303.23	0.06
322	HAICHANG OCEAN PARK HOLDINGS	海昌海洋公园	2255 HK	港 交 所	中 国 香 港	30,000	43,885.28	0.06
323	CHINA MERCHANTS LAND LTD	招商局置地	978 HK	港 交 所	中 国 香 港	36,000	43,333.57	0.06
324	GUORUI PROPERTIES LTD	国瑞置业	2329 HK	港 交 所	中 国 香 港	22,000	42,848.75	0.06
325	CHINA SHINEWAY PHARMACEUTICA	神威药业	2877 HK	港 交 所	中 国 香 港	7,000	42,656.49	0.06
326	JU TENG INTERNATIONAL HLDGS	巨腾国际	3336 HK	港 交 所	中 国 香 港	20,000	42,631.41	0.06
327	COSMO LADY CHINA HOLDINGS CO	都市丽人	2298 HK	港 交 所	中 国 香 港	18,000	42,581.26	0.06

328	TCL MULTIMEDIA TECHNOLOGY	T C L 多媒体股权	1070 HK	港 交 所	中 国 香 港	13,000	42,380.64	0.06
329	TIANJIN PORT DVLP HLDS LTD	天津港发 展	3382 HK	港 交 所	中 国 香 港	44,000	42,297.05	0.06
330	XINGDA INTL HOLDINGS	兴达国际	1899 HK	港 交 所	中 国 香 港	18,000	41,678.47	0.06
331	GLORIOUS PROPERTY HOLDINGS	恒盛地产	845 HK	港 交 所	中 国 香 港	66,000	41,377.55	0.06
332	NEWOCEAN ENERGY HLDGS LTD	新海能源	342 HK	港 交 所	中 国 香 港	24,000	41,126.77	0.06
333	CONCORD NEW ENERGY GROUP LTD	协合新能 源	182 HK	港 交 所	中 国 香 港	140,000	40,374.45	0.06
334	WELLING HOLDING LTD	威灵控股	382 HK	港 交 所	中 国 香 港	24,000	40,123.68	0.06
335	EMPEROR CAPITAL GROUP LTD	英皇证券	717 HK	港 交 所	中 国 香 港	84,000	40,023.37	0.06
336	LVGEM CHINA REAL ESTATE INVE	绿景中国 地产	95 HK	港 交 所	中 国 香 港	16,000	39,856.19	0.06
337	KONG SUN HOLDINGS LTD	江山控股	295 HK	港 交 所	中 国 香 港	150,000	38,869.82	0.06

338	BEIJING ENTERPRISES MEDICAL	北控医疗 健康	2389 HK	港 交 所	中 国 香 港	120,000	38,619.04	0.06
339	CONVOY GLOBAL HOLDINGS LTD	康宏环球	1019 HK	港 交 所	中 国 香 港	270,000	37,691.18	0.05
340	CHINA SINGYES SOLAR TECH	兴业太阳 能	750 HK	港 交 所	中 国 香 港	13,000	36,838.55	0.05
341	CK LIFE SCIENCES INTL HLDGS	长江生命 科技	775 HK	港 交 所	中 国 香 港	72,000	36,111.31	0.05
342	CHINA GREENLAND BROAD GREENS	中国绿地 博大绿泽	1253 HK	港 交 所	中 国 香 港	28,000	35,108.22	0.05
343	CHINA POWER CLEAN ENERGY DEV	中国电力 清洁能源	735 HK	港 交 所	中 国 香 港	10,000	34,439.49	0.05
344	361 DEGREES INTERNATIONAL	3 6 1 度	1361 HK	港 交 所	中 国 香 港	15,000	33,854.36	0.05
345	TAI UNITED HOLDINGS LTD	太和控股	718 HK	港 交 所	中 国 香 港	40,000	33,770.76	0.05
346	CHIHO ENVIRONMENTAL GROUP LT	齐合环保	976 HK	港 交 所	中 国 香 港	10,000	33,687.17	0.05
347	CHINA SHENGMU ORGANIC MILK	中国圣牧	1432 HK	港 交 所	中 国 香 港	31,000	32,650.64	0.05

348	CWT INTERNATIONAL LTD	CWT INTL	521 HK	港 交 所	中 国 香 港	100,000	32,600.49	0.05
349	BEST PACIFIC INTERNATIONAL H	超盈国际 控股	2111 HK	港 交 所	中 国 香 港	8,000	32,232.69	0.05
350	FANTASIA HOLDINGS GROUP CO	花样年控 股	1777 HK	港 交 所	中 国 香 港	36,000	32,199.25	0.05
351	TENWOW INTERNATIONAL HOLDING	天喔国际	1219 HK	港 交 所	中 国 香 港	21,000	32,124.02	0.05
352	WASION GROUP HOLDINGS LTD	威胜集团	3393 HK	港 交 所	中 国 香 港	10,000	31,931.76	0.05
353	KANGDA INTERNATIONAL ENVIRON	康达环保	6136 HK	港 交 所	中 国 香 港	23,000	31,915.04	0.05
354	LEES PHARMACEUTICAL HLDGS	李氏大药 厂	950 HK	港 交 所	中 国 香 港	5,500	31,492.91	0.05
355	SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	三一国际	631 HK	港 交 所	中 国 香 港	22,000	31,446.93	0.05
356	TIANJIN DEVELOPMENT HLDGS LT	天津发展	882 HK	港 交 所	中 国 香 港	10,000	31,012.26	0.04
357	GUANGZHOU RURAL COMMERCIAL-H	广州农商 银行	1551 HK	港 交 所	中 国 香 港	6,000	30,694.62	0.04

358	COLOUR LIFE SERVICES GROUP	彩生活	1778 HK	港 交 所	中 国 香 港	7,000	30,427.12	0.04
359	YASHILI INTERNATIONAL HOLDING	雅士利国际	1230 HK	港 交 所	中 国 香 港	24,000	30,092.76	0.04
360	CGN NEW ENERGY HOLDINGS CO L	中广核新能源	1811 HK	港 交 所	中 国 香 港	32,000	29,424.03	0.04
361	RENTIAN TECHNOLOGY HOLDING	仁天科技控股	885 HK	港 交 所	中 国 香 港	90,000	28,964.28	0.04
362	APT SATELLITE HOLDINGS LTD	亚太卫星	1045 HK	港 交 所	中 国 香 港	10,000	28,504.53	0.04
363	BRIGHT SMART SECURITIES AND	耀才证券金融	1428 HK	港 交 所	中 国 香 港	14,000	27,969.55	0.04
364	HONG KONG INTERNATIONAL CONS	香港国际建投	687 HK	港 交 所	中 国 香 港	16,000	27,819.08	0.04
365	SOUNDWILL HOLDINGS LTD	金朝阳集团	878 HK	港 交 所	中 国 香 港	2,000	27,350.98	0.04
366	DINGYI GROUP INVESTMENT LTD	鼎亿集团投资	508 HK	港 交 所	中 国 香 港	40,000	27,083.48	0.04
367	MINSHENG EDUCATION GROUP CO	民生教育	1569 HK	港 交 所	中 国 香 港	20,000	26,749.12	0.04

368	CHINA FINANCIAL INTERNATIONAL	中国金融 国际	721 HK	港 交 所	中 国 香 港	130,000	25,211.05	0.04
369	CHINA ELECTRONICS HUADA TECH	中电华大 科技	85 HK	港 交 所	中 国 香 港	22,000	25,194.33	0.04
370	NVC LIGHTING HOLDINGS LTD	雷士照明	2222 HK	港 交 所	中 国 香 港	39,000	25,102.38	0.04
371	COFCO MEAT HOLDINGS LTD	中粮肉食	1610 HK	港 交 所	中 国 香 港	19,000	25,094.02	0.04
372	VISION FAME INTERNATIONAL HO	允升国际	1315 HK	港 交 所	中 国 香 港	98,000	24,985.35	0.04
373	SRE GROUP LTD	上置集团	1207 HK	港 交 所	中 国 香 港	150,000	24,951.91	0.04
374	GOOD RESOURCES HOLDINGS LTD	天成国际	109 HK	港 交 所	中 国 香 港	80,000	24,408.57	0.04
375	SINOSOFT TECHNOLOGY GROUP LT	中国擎天 软件	1297 HK	港 交 所	中 国 香 港	13,000	23,907.03	0.03
376	CHINA HUIYUAN JUICE GROUP	汇源果汁	1886 HK	港 交 所	中 国 香 港	13,000	23,472.35	0.03
377	CHINA PIONEER PHARMA HOLDING	中国先锋 医药	1345 HK	港 交 所	中 国 香 港	11,000	22,159.97	0.03

378	CGN MINING CO LTD	中广核矿业	1164 HK	港 交 所	中 国 香 港	40,000	21,064.93	0.03
379	FDG KINETIC LTD	五龙动力	378 HK	港 交 所	中 国 香 港	32,000	20,061.84	0.03
380	SUMMIT ASCENT HOLDINGS LTD	凯升控股	102 HK	港 交 所	中 国 香 港	26,000	19,342.96	0.03
381	PW MEDTECH GROUP LTD	普华和顺	1358 HK	港 交 所	中 国 香 港	15,000	17,804.88	0.03
382	HENGDELI HOLDINGS LTD	亨得利	3389 HK	港 交 所	中 国 香 港	56,000	17,554.11	0.03
383	MAOYE INTERNATIONAL HLDGS	茂业国际	848 HK	港 交 所	中 国 香 港	25,000	16,718.20	0.02
384	HARMONICARE MEDICAL HOLDINGS	和美医疗	1509 HK	港 交 所	中 国 香 港	6,000	15,698.39	0.02
385	DIFFER GROUP HOLDING CO LTD	鼎丰集团控股	6878 HK	港 交 所	中 国 香 港	30,000	15,297.15	0.02
386	WISDOM SPORTS GROUP	智美体育	1661 HK	港 交 所	中 国 香 港	20,000	13,207.38	0.02
387	GOLDEN THROAT HOLDINGS GROUP	金嗓子	6896 HK	港 交 所	中 国 香 港	7,000	11,351.66	0.02

388	MAJOR HOLDINGS LTD	美捷汇控 股	1389 HK	港 交 所	中 国 香 港	24,000	2,908.97	0.00
-----	--------------------	-----------	------------	-------------	------------------	--------	----------	------

8.4.1 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

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

8.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金 资产净值比 例(%)
1	MEITU INC	01357 HKCS	1,393,810.47	0.60
2	SINOPHARM GROUP CO-H	01099 HKCS	1,234,728.37	0.54
3	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	00981 HKCS	1,088,990.25	0.47
4	CITIC SECURITIES CO LTD-H	06030 HKCS	943,354.05	0.41
5	CRRC CORP LTD - H	01766 HKCS	931,792.30	0.40
6	SUNNY OPTICAL TECH	02382 HKCS	920,645.67	0.40
7	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	00914 HKCS	863,244.30	0.37
8	NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	01336 HKCS	855,192.33	0.37
9	BYD CO LTD-H	01211 HKCS	810,270.57	0.35

10	GF SECURITIES CO LTD-H	01776 HKCS	793,964.18	0.34
11	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	00586 HKCS	768,479.57	0.33
12	CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	06881 HKCS	747,765.25	0.32
13	CHINA VANKE CO LTD-H	02202 HKCS	744,075.99	0.32
14	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	02333 HKCS	738,210.96	0.32
15	MELCO INTERNATIONAL DEVELOP.	00200 HKCS	700,887.50	0.30
16	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	3323 HK	689,288.27	0.30
17	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	00522 HKCS	685,752.86	0.30
18	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	02238 HKCS	672,875.02	0.29
19	PEOPLES INSURANCE CO GROU-H	01339 HKCS	672,589.15	0.29
20	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	03898 HKCS	665,216.37	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。

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金 资产净值比 例 (%)
1	SUNNY OPTICAL TECH	2382 HK	3,735,233.75	1.62
2	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	175 HK	1,568,596.77	0.68
3	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	1918 HK	1,228,467.81	0.53
4	SINOPHARM GROUP CO-H	1099 HK	1,037,399.78	0.45
5	FULLSHARE HOLDINGS LTD	607 HK	1,002,561.08	0.43
6	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	914 HK	913,383.41	0.40
7	NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	1336 HK	908,428.29	0.39
8	CITIC SECURITIES CO LTD-H	6030 HK	901,895.62	0.39
9	BYD CO LTD-H	1211 HK	901,644.93	0.39
10	MEITU INC	1357 HK	871,199.04	0.38
11	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	2238 HK	829,843.18	0.36
12	CHINA VANKE CO LTD-H	2202 HK	822,747.96	0.36
13	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	1378 HK	811,636.30	0.35
14	MELCO	200 HK	796,313.91	0.35

	INTERNATIONAL DEVELOP.			
15	CRRC CORP LTD - H	1766 HK	781,771.32	0.34
16	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	2333 HK	777,006.51	0.34
17	GF SECURITIES CO LTD-H	1776 HK	707,559.99	0.31
18	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	586 HK	690,113.95	0.30
19	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	522 HK	689,692.99	0.30
20	PEOPLES INSURANCE CO GROU-H	1339 HK	671,779.65	0.29

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

8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	94,327,556.53
卖出收入（成交）总额	85,233,429.64

注：上述金额均指成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	40,242.84
4	应收利息	851.45
5	应收申购款	3,216.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	44,310.97

8.11.4 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。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
1,690	35,365.24	24,836,265.36	41.56%	34,930,983.98	58.44%

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	张志山	374,043.00	14.27%
2	李金	340,000.00	12.97%
3	尹绍波	300,023.00	11.44%
4	赵何鉴	218,697.00	8.34%
5	宋庆利	200,015.00	7.63%
6	王鹏	150,014.00	5.72%
7	张秀涛	150,002.00	5.72%
8	王玺梅	148,321.00	5.66%
9	邓荣	95,993.00	3.66%
10	苟晟	90,001.00	3.43%

9.3 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	1,519.18	0.0025%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 10 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	35,866,341.23
减:本报告期基金总赎回份额	206,068,153.53
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	59,767,249.34

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、基金管理人的重大人事变动

1、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，杜鹏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。

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。

3、基金管理人于 2017 年 8 月 12 日发布了《大成基金管理有限公司督察长任职公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第二十七次会议审议通过，赵冰女士自 2017 年 8 月 11 日担任公司督察长，总经理罗登攀不再代为履行督察长职务。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：

本基金托管人于 2016 年 8 月 29 日任命史静欣女士为中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心副总经理，负责管理证券投资基金托管业务。因工作需要，余晓晨先生于 2017 年 3 月 8 日不再担任中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心副总经理职务。

11.3 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、基金托管业务的重大诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，本年度支付的审计费用为 4 万元整。该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

1、报告期内公司收到中国证券监督管理委员会深圳监管局（以下简称“深圳证监局”）《关于对大成基金管理有限公司采取责令整改行政监管措施的决定》，责令公司在三个月内对货币基金单一持有人持有比例过高的情况进行整改，并对相关责任人采取行政监管措施。截止目前，公司已经制定并落实相关整改措施，并向深圳证监局提交整改报告。

2、本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
光大证券		199,103,714.74	55.19%	79,282.96	55.22%	-
瑞银证券		165,416,558.34	36.43%	52,021.23	36.23%	-
UBS		115,040,713.09	8.38%	12,270.59	8.55%	-
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。

本报告期内本基金新增席位：西藏东财、天风证券、瑞银证券。本报告期内本基金退租席位：长城证券、南京证券。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

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
光大证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
瑞银证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
UBS	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
招商证券	-	0.00%	480,000,000.00	100.00%	-	0.00%	-	0.00%

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于大成基金管理有限公司旗下证券投资基金及专户等资管产品实施增值税政策的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年12月30日
2	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）2018年境外主要市场节假日暂停申购赎回安排的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年12月28日
3	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12月21日

4	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加南京苏宁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12月12日
5	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加和耕传承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12月8日
6	关于大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）增加深圳市新兰德证券投资咨询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11月29日
7	大成基金管理有限公司关于旗下基金调整流通受限股票估值方法的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年11月27日
8	关于大成基金网上直销端建设银行进行系统维护暂停服务的通知	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年11月3日
9	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）2017年第3季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年10月27日
10	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10月12日
11	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年9月26日
12	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海中正达广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9月13日
13	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加深圳众禄金融控股	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年9月4日

	股份有限公司为销售机构的公告		
14	大成基金管理有限公司关于通过网上直销系统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9月1日
15	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年8月24日
16	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）2017年半年度报告及摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年8月24日
17	关于大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）2017年8月23日暂停申购赎回等业务的说明	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年8月23日
18	大成基金管理有限公司关于网上直销货币基金快速赎回业务调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年8月15日
19	大成基金管理有限公司督察长任职公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年8月12日
20	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加中原银行为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年8月4日
21	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金 2017年第2季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年7月19日
22	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金更新招募说明书（2017年1期）摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年7月17日
23	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金更新招募说明书（2017	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年7月17日

	年1期)		
24	关于大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）修改基金合同、新增风险揭示内容的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年7月13日
25	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）基金合同	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年7月13日
26	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7月7日
27	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加上海长量基金销售投资顾问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7月7日
28	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
29	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
30	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
31	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
32	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

33	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
34	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
35	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
36	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
37	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）2017年第一季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年4月21日
38	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
39	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
40	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
41	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

42	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
43	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
44	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
45	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告（杜鹃）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年2月18日
46	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
47	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
48	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
49	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
50	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

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	20170627-20171231	0.00	23,718,216.32	0.00	23,718,216.32	39.68%
个人	1	20170804-20170917	20,488,029.77	0.00	20,488,029.77	0.00	0.00%
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。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

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

13.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

13.3 查阅方式

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

大成基金管理有限公司

2018年3月31日