

大成恒生综合中小型股指数证券投资基金 （QDII-LOF） 2018 年半年度报告

2018 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：2018 年 8 月 29 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 2018 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
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
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	11
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
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
§5 托管人报告	15
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的真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
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
§7 投资组合报告.....	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	36
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	37
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细.....	37
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	63
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	65
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.....	66
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.....	66
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.....	66
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.....	66
7.11 投资组合报告附注.....	66
§8 基金份额持有人信息.....	68
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	68
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	68
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	68
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.....	68
§9 开放式基金份额变动.....	70
§10 重大事件揭示.....	71
10.1 基金份额持有人大会决议.....	71
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.....	71
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	71
10.4 基金投资策略的改变.....	71
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	71
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.....	71
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	71
10.8 其他重大事件.....	72

§11 影响投资者决策的其他重要信息	75
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.....	75
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	75
§12 备查文件目录	76
12.1 备查文件目录.....	76
12.2 存放地点.....	76
12.3 查阅方式.....	76

§ 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	23,194,020.52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	http://www.dcfund.com.cn
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(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	5,917,620.89
本期利润	-1,446,776.68
加权平均基金份额本期利润	-0.0326
本期加权平均净值利润率	-2.83%
本期基金份额净值增长率	-6.21%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配利润	2,019,086.79
期末可供分配基金份额利润	0.0871
期末基金资产净值	25,213,107.31
期末基金份额净值	1.087
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)
基金份额累计净值增长率	8.70%

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	-5.89%	1.38%	-9.21%	1.39%	3.32%	-0.01%
过去三个月	-1.54%	1.14%	-6.62%	1.13%	5.08%	0.01%
过去六个月	-6.21%	1.24%	-6.99%	1.27%	0.78%	-0.03%
过去一	4.72%	1.08%	6.79%	1.08%	-2.07%	0.00%

年						
自基金合同生效起至今	8.70%	0.91%	13.64%	0.96%	-4.94%	-0.05%

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



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2018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，5只QDII基金及75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	-	15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。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
--	--	--	--	--	--

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遵规守信情况的说明

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变动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变动导致个别组合间的成交价格存在一定差异，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 1 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 2 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

2018 年上半年，全球主要发达经济体的宏观经济保持了稳定增长，美国宏观经济也保持了稳定增长的势头，美国股票市场也保持了在震荡中略微上涨的趋势。

在 2018 年 1 季度，作为新兴市场最重要的国家，中国宏观经济仍然能维持稳定增长。但是，中国的宏观经济在 2 季度发出了相对消极的信号。

首先，由于中国整体杠杆率较高，监管层采取措施逐步降低社会杠杆水平。去杠杆政策虽然利好经济的长期健康发展，但是却通过银根紧缩等途径对经济的短期增长造成了一定压力。

其次，中美贸易争端逐步升级，导致中国净出口金额与去年同期相比已经有了一定幅度的下滑，这也是对宏观经济的拖累。

另外，在 2 季度，中国三四线城市的棚改货币化进程有所减速，这也负面影响了宏观经济。

同时，这些负面因素也影响到了居民消费支出，最近月份的消费数据也因此走弱。

在这些不利于宏观经济的因素的影响下，A 股及港股市场在 2 季度出现了快速下跌，而本基金的基准指数也同样出现了快速下跌的情形。

从汇率方面来看，在 1 季度，港元汇率出现了小幅下跌，而在 2 季度，港元汇率又出现了明显上升，从而使得在今年上半年期间，港元也取得了微小升值，这利好于本基金净值表现。

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 1.087 元；本报告期基金份额净值增长率为-6.21%，业绩

比较基准收益率为-6.99%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 下半年年，预计中国宏观经济仍然会保持增长，但是经济增长速度可能会有所降低。

从不利的方面来看，首先，中国整体杠杆率较高是客观事实，监管层也会持续加强对金融行业的监管；其次，中美贸易冲突在下半年还有持续升级的可能性，这会切实影响中国的出口；另外，居民消费增速也有可能持续放缓。

当然，与 2 季度相比，宏观经济在下半年也有改善的方面。首先，香港中资上市公司上半年整体增速依然维持强劲，海外中资股样本盈利同比增速有望达到 25%，较 2017 年的 18% 进一步提升，这展示了经济仍然有增长的韧性。其次，近期召开的国务院常务会议提出更积极的财政政策、松紧适度的货币政策、清理僵尸企业和鼓励中小企业贷款等多项促进经济增长的政策，而这些经济增持有望改善宏观经济表现。

综合上述各方面，我们预计港股市场今年盈利增长依然具有相当的韧性，但不利因素与压力也边际上有所增加，包括持续去杠杆化导致融资成本上升、贸易摩擦的潜在负面影响、以及人民币持续走弱的影响等。

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

本基金在本报告期内，曾出现了连续 20 个工作日资产净值低于五千万元的情形。

§ 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—大成基金管理有限公司 2018 年 1 月 1 日至 2018 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，未发现有关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：2018年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	2,515,534.13	4,927,044.53
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.3.2	23,124,125.03	64,992,991.76
其中：股票投资		23,124,125.03	64,992,991.76
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.3.5	634.68	851.45
应收股利		203,789.02	40,242.84
应收申购款		39,315.98	3,216.68
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		25,883,398.84	69,964,347.26
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		4.59	13.17
应付赎回款		237,805.19	183,039.25
应付管理人报酬		22,164.66	57,722.55
应付托管费		5,541.18	14,430.65
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	144,186.52	162,882.00

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	260,589.39	282,222.82
负债合计		670,291.53	700,310.44
所有者权益：			
实收基金	6.4.3.9	23,194,020.52	59,767,249.34
未分配利润	6.4.3.10	2,019,086.79	9,496,787.48
所有者权益合计		25,213,107.31	69,264,036.82
负债和所有者权益总计		25,883,398.84	69,964,347.26

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值为人民币 1.087 元，基金份额总额 23194020.52 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-791,659.67	8,851,309.14
1. 利息收入		13,165.48	547,321.84
其中：存款利息收入	6.4.3.11	13,165.48	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）		6,565,530.76	2,323,023.46
其中：股票投资收益	6.4.3.12	6,127,054.46	812,370.54
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.3.14	-	-
衍生工具收益	6.4.3.15	-	-
股利收益	6.4.3.16	438,476.30	1,510,652.92
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	-7,364,397.57	5,879,455.39
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-38,195.93	-86,064.57
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.18	32,237.59	187,573.02

减：二、费用		655,117.01	1,431,892.30
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	255,295.69	775,795.43
2. 托管费	6.4.6.2.2	63,823.89	193,948.88
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.19	95,913.84	228,930.06
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.3.20	240,083.59	233,217.93
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,446,776.68	7,419,416.84
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,446,776.68	7,419,416.84

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：2018年1月1日至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018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）	59,767,249.34	9,496,787.48	69,264,036.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-1,446,776.68	-1,446,776.68
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）	-36,573,228.82	-6,030,924.01	-42,604,152.83
其中：1.基金申购款	3,846,474.17	597,226.83	4,443,701.00
2.基金赎回款	-40,419,702.99	-6,628,150.84	-47,047,853.83
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）	23,194,020.52	2,019,086.79	25,213,107.31

项目	上年度可比期间 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

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：

<u> </u> 罗登攀	<u> </u> 周立新	<u> </u> 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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.2 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》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》、深地税告[2011]6号《深圳市地方税务局关于代征地方教育附加的通告》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) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 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。

(4) 基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税

法规定缴纳印花税。

(5) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%和 2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
活期存款	2,515,534.13
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计：	2,515,534.13

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	22,314,867.42	23,124,125.03	809,257.61
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	22,314,867.42	23,124,125.03	809,257.61

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融工具。

6.4.3.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应收活期存款利息	498.30
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	136.38
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	634.68

6.4.3.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	144,186.52
银行间市场应付交易费用	-
合计	144,186.52

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	480.05
预提费用	198,356.09
应付指数授权费	61,753.25
合计	260,589.39

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	59,767,249.34	59,767,249.34
本期申购	3,846,474.17	3,846,474.17
本期赎回(以“-”号填列)	-40,419,702.99	-40,419,702.99
- 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	23,194,020.52	23,194,020.52

注：截至2018年06月30日止，本基金于深交所上市的基金份额为1,548,715.00份，托管在场外未上市交易的基金份额为21,645,305.52份。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。

6.4.3.10 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	7,320,956.25	2,175,831.23	9,496,787.48
本期利润	5,917,620.89	-7,364,397.57	-1,446,776.68
本期基金份额交易产生的变动数	-5,730,800.92	-300,123.09	-6,030,924.01
其中：基金申购款	702,304.19	-105,077.36	597,226.83
基金赎回款	-6,433,105.11	-195,045.73	-6,628,150.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,507,776.22	-5,488,689.43	2,019,086.79

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
活期存款利息收入	10,165.30
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	2,670.04
其他	330.14
合计	13,165.48

6.4.3.12 股票投资收益

6.4.3.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
卖出股票成交总额	42,586,932.64
减：卖出股票成本总额	36,459,878.18
买卖股票差价收入	6,127,054.46

6.4.3.13 债券投资收益

本报告期内本基金无债券投资收益。

6.4.3.14 贵金属投资收益

本报告期内本基金无贵金属投资收益。

6.4.3.15 衍生工具收益

本报告期内本基金无衍生工具收益。

6.4.3.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日

股票投资产生的股利收益	438,476.30
基金投资产生的股利收益	-
合计	438,476.30

6.4.3.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
1. 交易性金融资产	-7,364,397.57
——股票投资	-7,364,397.57
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-7,364,397.57

6.4.3.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	32,237.59
合计	32,237.59

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。

6.4.3.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
交易所市场交易费用	95,913.84
银行间市场交易费用	-
合计	95,913.84

6.4.3.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018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	1,665.00
上市费	29,752.78
指数授权费	40,062.50
其他	-
合计	240,083.59

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.4.2 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。

6.4.5 关联方关系

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

本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。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司（“大成基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“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
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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 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	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
光大证券	-	0.00%	99,103,714.74	91.10%

6.4.6.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018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	-	0.00%	110,860.77	76.89%
关联方名称	上年度可比期间 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%

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 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	255,295.69	775,795.43
其中：支付销售机构的客户维护费	66,865.99	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。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年6月30日	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	63,823.89	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。

6.4.6.3 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。

6.4.6.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.4.1 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。

6.4.6.4.2 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。

6.4.6.5 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	
	2018年1月1日至2018年6月30日		2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	2,194,051.26	10,086.48	6,985,558.67	95,024.34
摩根大通银行	321,482.87	-	1,846,755.37	-

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。。

6.4.6.6 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。

6.4.6.7 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。

6.4.7 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

6.4.8 期末（2018年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于本报告期末，本基金未持有临时停牌等流通受限股票。

6.4.8.3 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。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金，跟踪标的指数市场表现，目标为获取市场平均收益，属于中高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、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。

6.4.9.2 信用风险

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

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)。

6.4.9.3 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发行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同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。

6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注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。

6.4.9.4 市场风险

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

6.4.9.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018年06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	2,515,534.13			-	2,515,534.13
交易性金融资产				23,124,125.03	23,124,125.03
应收股利				203,789.02	203,789.02
应收利息				634.68	634.68
应收申购款				39,315.98	39,315.98
资产总计	2,515,534.13	-	-	23,367,864.71	25,883,398.84
负债					-
应付证券清算款				4.59	4.59
应付赎回款				237,805.19	237,805.19
应付管理人报酬				22,164.66	22,164.66
应付托管费				5,541.18	5,541.18
应付交易费用				144,186.52	144,186.52
其他负债				260,589.39	260,589.39
负债总计	-	-	-	670,291.53	670,291.53
利率敏感度缺口	2,515,534.13	-	-	-22,697,573.18	25,213,107.31
上年度末 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

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

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，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）。

6.4.9.4.2 外汇风险

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

6.4.9.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2018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	-	321,485.73	-	321,485.73

交易性金融资产	-	23,124,125.03	-	23,124,125.03
应收股利	-	203,789.02	-	203,789.02
资产合计	-	23,649,399.78	-	23,649,399.78
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	-	23,649,399.78	-	23,649,399.78
项目	上年度末 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				
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

6.4.9.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除港币以外的其他市场变量保持不变		
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（2018年6月30日）	上年度末（2017年12月31日）
	港币相对人民币升值 5	1,260,660.00	3,310,000.00
	港币相对人民币贬值 5	-1,260,660.00	-3,310,000.00

6.4.9.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市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。

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日		上年度末 2017年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	23,124,125.03	91.71	64,992,991.76	93.83
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	23,124,125.03	91.71	64,992,991.76	93.83

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	23,124,125.03	89.34
	其中：普通股票	23,124,125.03	89.34
	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	2,515,534.13	9.72
...	-	-	0.00
8	其他各项资产	243,739.68	0.94
9	合计	25,883,398.84	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 21,843,290.01 元，占期末基金资产净值的比例为 86.63%。

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	23,124,125.03	91.71
合计	23,124,125.03	91.71

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	3,856,261.82	15.29
消费者非必需品	3,788,883.02	15.03
房地产	3,060,700.04	12.14
信息技术	2,542,197.76	10.08
金融	2,456,392.11	9.74
基础材料	2,131,365.24	8.45
医疗保健	2,545,539.46	10.10
公用事业	1,010,130.77	4.01
消费者常用品	904,924.52	3.59
能源	474,218.47	1.88
电信服务	353,511.82	1.40
合计	23,124,125.03	91.71

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	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	海螺水泥	914 HK	港交所	中国香港	10,500	398,364.75	1.58
2	CHINA CONCH VENTURE	海螺创业	586	港	中国	15,500	375,053.04	1.49

	HOLDINGS		HK	交所	香港			
3	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	药明生物	2269 HK	港交所	中国香港	4,000	294,579.14	1.17
4	SINOPHARM GROUP CO-H	国药控股	1099 HK	港交所	中国香港	10,400	276,637.97	1.10
5	CHINA VANKE CO LTD-H	万科	2202 HK	港交所	中国香港	11,300	261,516.97	1.04
6	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	中芯国际	981 HK	港交所	中国香港	29,500	253,688.79	1.01
7	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	中国建材	3323 HK	港交所	中国香港	34,000	222,730.16	0.88
8	BYD CO LTD-H	比亚迪	1211 HK	港交所	中国香港	5,500	220,491.73	0.87
9	CITIC SECURITIES CO LTD-H	中信证券	6030 HK	港交所	中国香港	16,500	218,126.83	0.87
10	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	ASM PACIFIC	522 HK	港交所	中国香港	2,400	200,725.25	0.80
11	PEOPLES INSURANCE CO GROU-H	中国人民 保险集团	1339 HK	港交所	中国香港	64,000	199,106.50	0.79
12	NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	新华保险	1336 HK	港交所	中国香港	7,100	195,443.23	0.78
13	CRRC CORP LTD - H	中国中车	1766 HK	港交所	中国香港	38,000	195,110.20	0.77
14	HYSAN DEVELOPMENT CO	希慎兴业	14 HK	港交所	中国香港	5,000	184,638.90	0.73
15	CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	康哲药业	867 HK	港交所	中国香港	13,000	171,857.50	0.68
16	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	中国中铁	390 HK	港交所	中国香港	34,000	169,699.17	0.67

17	VITASOY INTL HOLDINGS LTD	VITASOY INTL	345 HK	港交所	中国香港	8,000	169,294.48	0.67
18	DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	东风集团股份	489 HK	港交所	中国香港	24,000	167,945.52	0.67
19	MINTH GROUP LTD	敏实集团	425 HK	港交所	中国香港	6,000	167,692.59	0.67
20	ALIBABA HEALTH INFORMATION T	阿里健康	241 HK	港交所	中国香港	26,000	165,938.94	0.66
21	3SBIO INC	三生制药	1530 HK	港交所	中国香港	11,000	165,264.46	0.66
22	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	广汽集团	2238 HK	港交所	中国香港	25,200	162,957.74	0.65
23	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	信义玻璃	868 HK	港交所	中国香港	20,000	161,706.58	0.64
24	CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	中国中药	570 HK	港交所	中国香港	28,000	160,290.17	0.64
25	AGILE GROUP HOLDINGS LTD	雅居乐集团	3383 HK	港交所	中国香港	14,000	157,693.42	0.63
26	CGN POWER CO LTD-H	中广核电力	1816 HK	港交所	中国香港	91,000	155,745.86	0.62
27	WEICHAI POWER CO LTD-H	潍柴动力	2338 HK	港交所	中国香港	17,000	155,079.81	0.62
28	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	中国民航信息网络	696 HK	港交所	中国香港	8,000	154,118.68	0.61
29	HUANENG POWER INTL INC-H	华能国际	902 HK	港交所	中国香港	34,000	149,060.08	0.59
30	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	中车时代电气	3898 HK	港交所	中国香港	4,700	147,803.86	0.59
31	HUATAI SECURITIES CO LTD-H	华泰证券	6886 HK	港交所	中国香港	14,000	147,306.43	0.58

				所				
32	GENSCRIPT BIOTECH CORP	金斯瑞生物科技	1548 HK	港交所	中国香港	8,000	146,362.16	0.58
33	TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	青岛啤酒	168 HK	港交所	中国香港	4,000	145,350.44	0.58
34	SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	复星医药	2196 HK	港交所	中国香港	4,000	145,181.82	0.58
35	KINGBOARD HOLDINGS LTD	建滔化工	148 HK	港交所	中国香港	6,000	145,181.82	0.58
36	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	龙源电力	916 HK	港交所	中国香港	27,000	143,866.58	0.57
37	MELCO INTERNATIONAL DEVELOP.	新濠国际发展	200 HK	港交所	中国香港	7,000	142,526.06	0.57
38	KINGSOFT CORP LTD	金山软件	3888 HK	港交所	中国香港	7,000	140,460.46	0.56
39	YANZHOU COAL MINING CO-H	兖州煤业	1171 HK	港交所	中国香港	16,000	138,403.30	0.55
40	SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	上海医药	2607 HK	港交所	中国香港	7,500	136,898.36	0.54
41	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	玖龙纸业	2689 HK	港交所	中国香港	16,000	134,896.00	0.54
42	CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	旭辉控股集团	884 HK	港交所	中国香港	32,000	134,626.21	0.53
43	PCCW LTD	电讯盈科	8 HK	港交所	中国香港	36,000	134,154.07	0.53
44	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	长城汽车	2333 HK	港交所	中国香港	26,500	134,052.90	0.53
45	LI & FUNG LTD	利丰	494 HK	港交所	中国香港	54,000	131,118.91	0.52
46	ORIENT OVERSEAS	东方海外	316	港	中国	2,000	128,825.68	0.51

	INTL LTD	国际	HK	交所	香港			
47	FAR EAST HORIZON LTD	远东宏信	3360 HK	港交所	中国香港	20,000	128,319.82	0.51
48	GF SECURITIES CO LTD-H	广发证券	1776 HK	港交所	中国香港	13,200	127,314.84	0.50
49	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	紫金矿业	2899 HK	港交所	中国香港	50,000	126,465.00	0.50
50	ZhongAn Online P&C Insurance Co., Ltd.	众安在线	6060 HK	港交所	中国香港	3,000	125,326.82	0.50
51	CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	光大银行	6818 HK	港交所	中国香港	44,000	125,014.87	0.50
52	KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	金蝶国际	268 HK	港交所	中国香港	18,000	121,861.67	0.48
53	CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	中国金茂	817 HK	港交所	中国香港	36,000	119,585.30	0.47
54	GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	富力地产	2777 HK	沪港通	中国香港	8,800	117,521.40	0.47
55	LI NING CO LTD	李宁	2331 HK	港交所	中国香港	16,000	116,685.04	0.46
56	MEITU INC	美图公司	1357 HK	港交所	中国香港	20,000	115,504.70	0.46
57	AIR CHINA LTD-H	中国国航	753 HK	港交所	中国香港	18,000	115,032.56	0.46
58	VTECH HOLDINGS LTD	VTECH HOLDINGS	303 HK	港交所	中国香港	1,500	114,514.06	0.45
59	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	中国铁建	1186 HK	港交所	中国香港	17,000	113,944.97	0.45
60	SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	远洋集团	3377 HK	港交所	中国香港	29,500	113,413.81	0.45

61	CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	中金公司	3908 HK	港交所	中国香港	9,600	113,150.76	0.45
62	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	上海石化	338 HK	港交所	中国香港	28,000	112,840.50	0.45
63	SHENZHEN INTL HOLDINGS	深圳国际	152 HK	港交所	中国香港	8,000	109,535.55	0.43
64	LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO L	龙光地产	3380 HK	港交所	中国香港	12,000	107,444.66	0.43
65	CHINA RESOURCES CEMENT	华润水泥控股	1313 HK	港交所	中国香港	16,000	107,242.32	0.43
66	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	洛阳钼业	3993 HK	港交所	中国香港	33,000	105,724.74	0.42
67	CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	中国银河	6881 HK	港交所	中国香港	30,000	101,930.79	0.40
68	CHINA OILFIELD SERVICES-H	中海油服	2883 HK	港交所	中国香港	16,000	99,957.94	0.40
69	COOLPAD GROUP LTD	酷派集团	2369 HK	港交所	中国香港	164,000	99,553.25	0.39
70	ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	中升控股	881 HK	港交所	中国香港	5,000	99,275.03	0.39
71	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	中国铝业	2600 HK	港交所	中国香港	34,000	99,182.28	0.39
72	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	福耀玻璃	3606 HK	港交所	中国香港	4,400	98,305.46	0.39
73	BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	北京首都机场股份	694 HK	港交所	中国香港	14,000	97,614.12	0.39
74	CHINA EVERBRIGHT LTD	中国光大控股	165 HK	港交所	中国香港	8,000	97,125.12	0.39
75	CHINA COAL ENERGY CO-H	中煤能源	1898 HK	港交所	中国香港	35,000	95,902.63	0.38

				所				
76	FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLD	新城发展控股	1030 HK	港交所	中国香港	16,000	95,776.16	0.38
77	LUYE PHARMA GROUP LTD	绿叶制药	2186 HK	港交所	中国香港	14,000	95,017.37	0.38
78	HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	海天国际	1882 HK	港交所	中国香港	6,000	93,685.27	0.37
79	UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	统一企业中国	220 HK	港交所	中国香港	11,000	93,482.93	0.37
80	FORTUNE REIT	置富产业信托	778 HK	港交所	中国香港	12,000	93,280.58	0.37
81	CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	中国软件国际	354 HK	港交所	中国香港	18,000	92,875.90	0.37
82	JIANGXI COPPER CO LTD-H	江西铜业	358 HK	港交所	中国香港	11,000	92,741.00	0.37
83	MMG LTD	五矿资源	1208 HK	港交所	中国香港	20,000	92,572.38	0.37
84	JIAYUAN INTERNATIONAL GROUP	佳源国际控股	2768 HK	港交所	中国香港	8,000	91,729.28	0.36
85	KWG PROPERTY HOLDING LTD	合景泰富	1813 HK	港交所	中国香港	11,000	91,442.63	0.36
86	BAIC MOTOR CORP LTD-H	北京汽车	1958 HK	港交所	中国香港	14,000	88,525.50	0.35
87	COSCO SHIPPING PORTS LTD	中远海运港口	1199 HK	港交所	中国香港	16,000	88,221.98	0.35
88	SSY GROUP LTD	石四药集团	2005 HK	港交所	中国香港	12,000	88,120.81	0.35
89	ALIBABA PICTURES GROUP LTD	阿里影业	1060 HK	港交所	中国香港	120,000	87,007.92	0.35
90	CHINA	中国通信	552	港	中国	20,000	83,804.14	0.33

	COMMUNICATIONS SERVI-H	服务	HK	交 所	香港			
91	HUANENG RENEWABLES CORP-H	华能新能 源	958 HK	港 交 所	中国 香港	38,000	83,618.66	0.33
92	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	南方航空	1055 HK	港 交 所	中国 香港	16,000	83,230.83	0.33
93	SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	中石化炼 化工程	2386 HK	港 交 所	中国 香港	12,000	82,961.04	0.33
94	CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	重庆农村 商业银行	3618 HK	港 交 所	中国 香港	21,000	82,682.82	0.33
95	LUK FOOK HOLDINGS INTL LTD	六福集团	590 HK	港 交 所	中国 香港	3,000	82,075.79	0.33
96	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	海丰国际	1308 HK	港 交 所	中国 香港	11,000	81,148.38	0.32
97	HOPEWELL HIGHWAY INFRASTRUCT	合和公路 基建-R	737 HK	港 交 所	中国 香港	20,000	80,600.36	0.32
98	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	理文造纸	2314 HK	港 交 所	中国 香港	12,000	80,330.57	0.32
99	CHAMPION REIT	冠君产业 信托	2778 HK	港 交 所	中国 香港	18,000	79,065.92	0.31
100	JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	宁沪高速	177 HK	港 交 所	中国 香港	10,000	78,829.85	0.31
101	NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	耐世特	1316 HK	港 交 所	中国 香港	8,000	78,239.68	0.31
102	KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	建滔积层 板	1888 HK	港 交 所	中国 香港	9,500	77,611.57	0.31
103	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	信义光能	968 HK	港 交 所	中国 香港	38,000	77,211.10	0.31
104	IGG INC	IGG	799 HK	港 交 所	中国 香港	9,000	76,182.52	0.30

105	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	越秀房产信托基金	405 HK	港交所	中国香港	17,000	75,533.33	0.30
106	CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	辉山乳业	6863 HK	港交所	中国香港	212,000	75,069.62	0.30
107	SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	威高股份	1066 HK	港交所	中国香港	16,000	74,867.28	0.30
108	BOC AVIATION LTD	中银航空租赁	2588 HK	港交所	中国香港	1,800	73,982.03	0.29
109	YUEXIU PROPERTY CO LTD	越秀地产	123 HK	港交所	中国香港	58,000	73,349.70	0.29
110	GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	国泰君安	2611 HK	港交所	中国香港	5,200	73,127.12	0.29
111	CHINA MAPLE LEAF EDUCATIONAL	枫叶教育	1317 HK	港交所	中国香港	6,000	71,528.60	0.28
112	CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	中国再保险	1508 HK	港交所	中国香港	49,000	71,056.47	0.28
113	ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	浙江沪杭甬	576 HK	港交所	中国香港	12,000	70,820.40	0.28
114	FIRST PACIFIC CO	第一太平	142 HK	港交所	中国香港	22,000	70,297.68	0.28
115	LIFESTYLE INTL HLDGS LTD	利福国际	1212 HK	港交所	中国香港	5,000	70,145.92	0.28
116	GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	保利协鑫能源	3800 HK	港交所	中国香港	112,000	69,876.13	0.28
117	PACIFIC BASIN SHIPPING LTD	太平洋航运	2343 HK	港交所	中国香港	38,000	68,881.27	0.27
118	GOME RETAIL HOLDINGS LTD	国美零售	493 HK	港交所	中国香港	102,000	68,796.96	0.27
119	MAN WAH HOLDINGS LTD	敏华控股	1999 HK	港交所	中国香港	13,200	68,554.15	0.27

				所				
120	HEALTH AND HAPPINESS H&H INT	H&H 国际控股	1112 HK	港交所	中国香港	1,500	68,417.57	0.27
121	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	华虹半导体	1347 HK	港交所	中国香港	3,000	68,164.64	0.27
122	SHENZHEN INVESTMENT LTD	深圳控股	604 HK	港交所	中国香港	28,000	67,515.45	0.27
123	JOHNSON ELECTRIC HOLDINGS	德昌电机控股	179 HK	港交所	中国香港	3,500	67,426.92	0.27
124	FU SHOU YUAN INTERNATIONAL	福寿园	1448 HK	港交所	中国香港	9,000	67,152.92	0.27
125	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	中航科工	2357 HK	港交所	中国香港	17,000	66,933.71	0.27
126	COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	中远海控	1919 HK	港交所	中国香港	22,000	66,773.52	0.26
127	HKBN LTD	香港宽带	1310 HK	港交所	中国香港	6,500	66,200.21	0.26
128	SINOTRUK HONG KONG LTD	中国重汽	3808 HK	港交所	中国香港	6,000	65,357.11	0.26
129	ZTE CORP-H	中兴通讯	763 HK	港交所	中国香港	6,400	64,318.41	0.26
130	CAFE DE CORAL HOLDINGS LTD	大家乐集团	341 HK	港交所	中国香港	4,000	64,075.60	0.25
131	TOWN HEALTH INTERNATIONAL ME	康健国际医疗	3886 HK	港交所	中国香港	110,000	63,991.29	0.25
132	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	比亚迪电子	285 HK	港交所	中国香港	7,000	63,384.26	0.25
133	SINOTRANS LIMITED-H	中国外运	598 HK	港交所	中国香港	18,000	62,827.81	0.25
134	CHINA EASTERN	东方航空	670	港	中国	14,000	62,676.05	0.25

	AIRLINES CO-H		HK	交所	香港			
135	TIANNENG POWER INTL LTD	天能动力	819 HK	港交所	中国香港	6,000	61,816.09	0.25
136	DAH SING FINANCIAL HOLDINGS	大新金融	440 HK	港交所	中国香港	1,600	61,782.37	0.25
137	SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	上海实业控股	363 HK	港交所	中国香港	4,000	61,647.47	0.24
138	CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	中国通号	3969 HK	港交所	中国香港	13,000	61,048.87	0.24
139	GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	绿城服务	2869 HK	港交所	中国香港	10,000	60,028.72	0.24
140	ANGANG STEEL CO LTD-H	鞍钢股份	347 HK	港交所	中国香港	10,000	59,691.48	0.24
141	UNITED ENERGY GROUP LTD	联合能源集团	467 HK	港交所	中国香港	68,000	59,624.03	0.24
142	KAISA GROUP HOLDINGS LTD	佳兆业集团	1638 HK	港交所	中国香港	21,000	59,312.09	0.24
143	TELEVISION BROADCASTS LTD	电视广播	511 HK	港交所	中国香港	2,800	58,662.90	0.23
144	LEGEND HOLDINGS CORP-H	联想控股	3396 HK	港交所	中国香港	2,900	58,435.26	0.23
145	GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARM-H	白云山	874 HK	港交所	中国香港	2,000	58,342.52	0.23
146	CHINA POWER INTERNATIONAL	中国电力	2380 HK	港交所	中国香港	38,000	57,988.42	0.23
147	HAITONG INTERNATIONAL SECURI	海通国际	665 HK	港交所	中国香港	19,000	57,347.66	0.23
148	CHINA RESOURCES PHOENIX HEAL	华润凤凰医疗	1515 HK	港交所	中国香港	7,000	56,656.32	0.22

149	SOHO CHINA LTD	S O H O 中国	410 HK	港交所	中国香港	18,000	56,605.73	0.22
150	CHINA WATER AFFAIRS GROUP	中国水务	855 HK	港交所	中国香港	8,000	55,239.91	0.22
151	LANDING INTERNATIONAL DEVELO	蓝鼎国际	582 HK	港交所	中国香港	540,000	54,632.88	0.22
152	SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	四环医药	460 HK	港交所	中国香港	37,000	54,590.73	0.22
153	YUZHOU PROPERTIES CO	禹洲地产	1628 HK	港交所	中国香港	14,000	54,413.67	0.22
154	RED STAR MACALLINE GROUP C-H	美凯龙	1528 HK	港交所	中国香港	6,000	53,519.99	0.21
155	SKYWORTH DIGITAL HLDGS LTD	创维数码	751 HK	港交所	中国香港	18,000	53,115.30	0.21
156	DATANG INTL POWER GEN CO-H	大唐发电	991 HK	港交所	中国香港	26,000	52,609.44	0.21
157	TONG REN TANG TECHNOLOGIES-H	同仁堂科技	1666 HK	港交所	中国香港	5,000	52,525.13	0.21
158	VALUE PARTNERS GROUP LTD	惠理集团	806 HK	港交所	中国香港	10,000	52,272.20	0.21
159	SHUI ON LAND LTD	瑞安房地产	272 HK	港交所	中国香港	31,000	52,010.84	0.21
160	LONKING HOLDINGS LTD	中国龙工	3339 HK	港交所	中国香港	17,000	51,741.05	0.21
161	TOWNGAS CHINA CO LTD	港华燃气	1083 HK	港交所	中国香港	8,000	51,327.93	0.20
162	PACIFIC TEXTILES HOLDINGS	互太纺织	1382 HK	港交所	中国香港	9,000	50,611.29	0.20
163	CHINA AGRI-INDUSTRIES	中国粮油控股	606 HK	港交所	中国香港	20,000	50,586.00	0.20

	HLDGS			所				
164	#N/A	#N/A	1579 HK	港 交 所	中 国 香 港	4,000	50,451.10	0.20
165	CHINA SCE PROPERTY HOLDINGS	中骏置业	1966 HK	港 交 所	中 国 香 港	16,000	50,181.31	0.20
166	UNIVERSAL MEDICAL FINANCIAL	环球医疗	2666 HK	港 交 所	中 国 香 港	9,500	50,059.06	0.20
167	POWERLONG REAL ESTATE HOLDIN	宝龙地产	1238 HK	港 交 所	中 国 香 港	14,000	49,928.38	0.20
168	DAH SING BANKING GROUP LTD	大新银行集团	2356 HK	港 交 所	中 国 香 港	3,600	49,898.03	0.20
169	CHINA SOUTH CITY HOLDINGS	华南城	1668 HK	港 交 所	中 国 香 港	38,000	49,017.83	0.19
170	CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	中国忠旺	1333 HK	港 交 所	中 国 香 港	14,000	48,984.11	0.19
171	SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	上海电气	2727 HK	港 交 所	中 国 香 港	22,000	48,967.25	0.19
172	METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	中国中冶	1618 HK	港 交 所	中 国 香 港	25,000	48,899.80	0.19
173	BBMG CORP-H	金隅集团	2009 HK	港 交 所	中 国 香 港	20,000	48,899.80	0.19
174	GREENTOWN CHINA HOLDINGS	绿城中国	3900 HK	港 交 所	中 国 香 港	5,500	48,781.77	0.19
175	MICROPORT SCIENTIFIC CORP	微创医疗	853 HK	港 交 所	中 国 香 港	6,000	47,955.53	0.19
176	CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	宇华教育	6169 HK	港 交 所	中 国 香 港	10,000	47,044.98	0.19
177	CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD	中国东方集团	581 HK	港 交 所	中 国 香 港	10,000	46,623.43	0.18
178	POLY PROPERTY GROUP	保利置业	119	港	中 国	17,000	46,437.95	0.18

	CO LTD	集团	HK	交所	香港			
179	CHINA TRAVEL INTL INV HK	香港中旅	308 HK	港交所	中国香港	18,000	46,437.95	0.18
180	NATIONAL AGRICULTURAL HOLDIN	国农控股	1236 HK	港交所	中国香港	46,000	46,151.29	0.18
181	XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	金风科技	2208 HK	港交所	中国香港	5,680	45,733.12	0.18
182	K WAH INTL HOLDINGS	嘉华国际	173 HK	港交所	中国香港	12,000	45,729.74	0.18
183	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	招金矿业	1818 HK	港交所	中国香港	9,000	45,451.52	0.18
184	HENG TEN NETWORKS GROUP LTD	恒腾网络	136 HK	港交所	中国香港	192,000	45,325.06	0.18
185	GUANGSHEN RAILWAY CO LTD-H	广深铁路	525 HK	港交所	中国香港	12,000	44,718.02	0.18
186	#N/A	#N/A	839 HK	港交所	中国香港	4,000	44,515.68	0.18
187	CHINA AOYUAN PROPERTY GROUP	中国奥园	3883 HK	港交所	中国香港	9,000	43,630.43	0.17
188	FAR EAST CONSORTIUM INTERNAT	远东发展	35 HK	港交所	中国香港	11,000	43,310.05	0.17
189	GUOTAI JUNAN INTERNATIONAL	国泰君安国际	1788 HK	港交所	中国香港	30,000	42,998.10	0.17
190	ZHOU HEI YA INTERNATIONAL HO	周黑鸭	1458 HK	港交所	中国香港	8,000	42,829.48	0.17
191	SA SA INTERNATIONAL HLDGS	莎莎国际	178 HK	港交所	中国香港	10,000	41,986.38	0.17
192	#N/A	#N/A	6088 HK	港交所	中国香港	14,000	41,902.07	0.17

193	CHINA ZHENG TONG AUTO SERVICE	正通汽车	1728 HK	港 交 所	中 国 香 港	9,500	41,889.42	0.17
194	LIFETECH SCIENTIFIC CORP	先健科技	1302 HK	港 交 所	中 国 香 港	20,000	41,817.76	0.17
195	FUFENG GROUP LTD	阜丰集团	546 HK	港 交 所	中 国 香 港	14,000	41,666.00	0.17
196	GIORDANO INTERNATIONAL LTD	佐丹奴国 际	709 HK	港 交 所	中 国 香 港	10,000	41,649.14	0.17
197	KERRY LOGISTICS NETWORK LTD	嘉里物流	636 HK	港 交 所	中 国 香 港	4,500	41,505.81	0.16
198	CHINA EVERBRIGHT GREENTECH L	中国光大 绿色环保	1257 HK	港 交 所	中 国 香 港	6,000	41,480.52	0.16
199	THE UNITED LABORATORIES INTE	联邦制药	3933 HK	港 交 所	中 国 香 港	6,000	41,328.76	0.16
200	MAANSHAN IRON & STEEL-H	马钢股份	323 HK	港 交 所	中 国 香 港	14,000	41,193.87	0.16
201	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	阳光房地 产基金	435 HK	港 交 所	中 国 香 港	9,000	41,126.42	0.16
202	CHINA HIGH SPEED TRANSMISSIO	中国高速 传动	658 HK	港 交 所	中 国 香 港	4,000	40,806.04	0.16
203	YANGTZE OPTICAL FIBRE AND-H	长飞光纤	6869 HK	港 交 所	中 国 香 港	1,500	40,215.87	0.16
204	TONGDA GROUP HOLDINGS LTD	通达集团	698 HK	港 交 所	中 国 香 港	30,000	40,215.87	0.16
205	CAR INC	神州租车	699 HK	港 交 所	中 国 香 港	6,000	39,659.42	0.16
206	SHENZHEN EXPRESSWAY CO-H	深高速	548 HK	港 交 所	中 国 香 港	6,000	38,951.22	0.15
207	CHINA DONGXIANG GROUP CO	中国动向	3818 HK	港 交	中 国 香 港	32,000	38,850.05	0.15

				所				
208	RONSHINE CHINA HOLDINGS LTD	融信中国	3301 HK	港交所	中国香港	4,500	38,546.53	0.15
209	XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	特步国际	1368 HK	港交所	中国香港	8,500	38,483.30	0.15
210	CMBC CAPITAL HOLDINGS LTD	民银资本	1141 HK	港交所	中国香港	100,000	38,361.05	0.15
211	CONVOY GLOBAL HOLDINGS LTD	康宏环球	1019 HK	港交所	中国香港	270,000	38,015.38	0.15
212	CHINA LILANG LTD	中国利郎	1234 HK	港交所	中国香港	4,000	37,973.22	0.15
213	CIMC ENRIC HOLDINGS LTD	中集安瑞科	3899 HK	港交所	中国香港	6,000	37,787.74	0.15
214	CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	中国联塑	2128 HK	港交所	中国香港	9,000	37,787.74	0.15
215	HONGKONG & SHANGHAI HOTELS	大酒店	45 HK	港交所	中国香港	4,000	37,770.88	0.15
216	BEIJING ENTERPRISES CLEAN EN	北控清洁能源集团	1250 HK	港交所	中国香港	220,000	37,652.85	0.15
217	TIBET WATER RESOURCES LTD	西藏水资源	1115 HK	港交所	中国香港	15,000	37,560.11	0.15
218	CHINA GRAND PHARMACEUTICAL A	远大医药	512 HK	港交所	中国香港	8,000	37,231.30	0.15
219	CP POKPHAND CO LTD	卜蜂国际	43 HK	港交所	中国香港	62,000	37,113.26	0.15
220	DFZQ-H	东方证券	3958 HK	港交所	中国香港	7,200	37,089.66	0.15
221	CHINA NEW HIGHER EDUCATION G	新高教集团	2001 HK	港交所	中国香港	6,000	36,674.85	0.15
222	HUADIAN POWER INTL	华电国际	1071	港	中国	14,000	36,590.54	0.15

	CORP-H		HK	交所	香港			
223	CHINA OVERSEAS GRAND OCEANS	中国海外宏洋集团	81 HK	港交所	中国香港	15,000	36,548.39	0.14
224	HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	合生创展集团	754 HK	港交所	中国香港	6,000	35,359.61	0.14
225	COSCO SHIPPING DEVELOPMENT-H	中远海发	2866 HK	港交所	中国香港	32,000	35,342.75	0.14
226	NAN HAI CORP LTD	南海控股	680 HK	港交所	中国香港	200,000	34,904.34	0.14
227	WISDOM EDUCATION INTERNATIONAL	睿见教育	6068 HK	港交所	中国香港	6,000	34,651.41	0.14
228	HUADIAN FUXIN ENERGY CORP -H	华电福新	816 HK	港交所	中国香港	22,000	34,128.69	0.14
229	CHINA BLUECHEMICAL LTD - H	中海石油化学	3983 HK	港交所	中国香港	14,000	34,111.83	0.14
230	ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	中联重科	1157 HK	港交所	中国香港	12,000	33,892.62	0.13
231	LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-H	丽珠集团	1513 HK	港交所	中国香港	1,066	33,792.80	0.13
232	REDCO GROUP	力高集团	1622 HK	港交所	中国香港	10,000	33,724.00	0.13
233	SHUN TAK HOLDINGS LTD	信德集团	242 HK	港交所	中国香港	12,000	32,476.21	0.13
234	GOODBABY INTERNATIONAL HOLDI	好孩子国际	1086 HK	港交所	中国香港	8,000	32,037.80	0.13
235	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	中远海能	1138 HK	港交所	中国香港	10,000	31,869.18	0.13
236	WE SOLUTIONS LTD	力世纪	860 HK	港交所	中国香港	32,000	31,835.46	0.13

237	SHOUGANG FUSHAN RESOURCES GR	首钢资源	639 HK	港交所	中国香港	20,000	31,531.94	0.13
238	CSC FINANCIAL CO LTD-H	中信建投	6066 HK	港交所	中国香港	6,500	30,579.24	0.12
239	ESPRIT HOLDINGS LTD	思捷环球	330 HK	港交所	中国香港	14,600	30,034.59	0.12
240	PROSPERITY REIT	泓富产业信托	808 HK	港交所	中国香港	11,000	29,491.64	0.12
241	NETDRAGON WEBSOFT HOLDINGS L	网龙	777 HK	港交所	中国香港	2,000	29,238.71	0.12
242	YUEXIU TRANSPORT INFRASTRUCT	越秀交通基建	1052 HK	港交所	中国香港	6,000	28,935.19	0.11
243	FIH MOBILE LTD	富智康集团	2038 HK	港交所	中国香港	28,000	28,800.30	0.11
244	GEMDALE PROPERTIES AND INVES	金地商置	535 HK	港交所	中国香港	40,000	28,665.40	0.11
245	HUTCHISON TELECOMM HONG KONG	和记电讯香港	215 HK	港交所	中国香港	12,000	28,024.64	0.11
246	GREATVIEW ASEPTIC PACKAGING	纷美包装	468 HK	港交所	中国香港	7,000	27,619.96	0.11
247	CHINA FOODS LTD	中国食品	506 HK	港交所	中国香港	8,000	27,586.23	0.11
248	SHANGHAI JIN JIANG INTL HO-H	锦江酒店	2006 HK	港交所	中国香港	10,000	26,810.58	0.11
249	MACAU LEGEND DEVELOPMENT LTD	澳门励骏	1680 HK	港交所	中国香港	24,000	26,102.38	0.10
250	HKR INTERNATIONAL LTD	香港兴业国际	480 HK	港交所	中国香港	6,400	25,953.99	0.10
251	CHINA SHINEWAY PHARMACEUTICA	神威药业	2877 HK	港交所	中国香港	2,000	25,866.31	0.10

				所				
252	BOSIDENG INTL HLDGS LTD	波司登	3998 HK	港交所	中国香港	28,000	25,495.34	0.10
253	SINOPEC KANTONS HOLDINGS	中石化冠德	934 HK	港交所	中国香港	8,000	25,023.21	0.10
254	TEXHONG TEXTILE GROUP LTD	天虹纺织	2678 HK	港交所	中国香港	2,500	24,955.76	0.10
255	CONSUN PHARMACEUTICAL GROUP	康臣药业	1681 HK	港交所	中国香港	4,000	24,753.42	0.10
256	CHINA GOLDJOY GROUP LTD	中国金洋	1282 HK	港交所	中国香港	68,000	24,652.24	0.10
257	BEIJING JINGNENG CLEAN ENE-H	京能清洁能源	579 HK	港交所	中国香港	16,000	24,551.07	0.10
258	YADEA GROUP HOLDINGS LTD	雅迪控股	1585 HK	港交所	中国香港	10,000	24,534.21	0.10
259	TIAN GE INTERACTIVE HOLDINGS	天鸽互动	1980 HK	港交所	中国香港	5,000	24,534.21	0.10
260	ZHUGUANG HOLDINGS GROUP CO	珠光控股	1176 HK	港交所	中国香港	20,000	23,606.80	0.09
261	BANK OF CHONGQING CO LTD-H	重庆银行	1963 HK	港交所	中国香港	5,500	23,138.88	0.09
262	ROAD KING INFRASTRUCTURE LTD	路劲	1098 HK	港交所	中国香港	2,000	23,134.66	0.09
263	DAH CHONG HONG	大昌行集团	1828 HK	港交所	中国香港	7,000	23,075.65	0.09
264	Crystal International Group Limited	晶苑国际	2232 HK	港交所	中国香港	5,000	23,058.79	0.09
265	PAX GLOBAL TECHNOLOGY LTD	百富环球	327 HK	港交所	中国香港	7,000	22,839.58	0.09
266	BEIJING CAPITAL	首创置业	2868	港	中国	8,000	22,797.42	0.09

	LAND LTD-H		HK	交所	香港			
267	POU SHENG INTL HOLDINGS LTD	宝胜国际	3813 HK	港交所	中国香港	18,000	22,763.70	0.09
268	C. BANNER INTERNATIONAL HOLDI	千百度	1028 HK	港交所	中国香港	12,000	22,359.01	0.09
269	SUN HUNG KAI & CO LTD	新鸿基公司	86 HK	港交所	中国香港	6,000	22,308.43	0.09
270	Yixin Group Limited	易鑫集团	2858 HK	港交所	中国香港	8,000	22,190.39	0.09
271	GLOBAL BRANDS GROUP HOLDING	利标品牌	787 HK	港交所	中国香港	56,000	22,190.39	0.09
272	IMAX CHINA HOLDING INC	IMAX CHINA	1970 HK	港交所	中国香港	1,100	22,165.10	0.09
273	TCL ELECTRONICS HOLDINGS LTD	T C L 多媒体	1070 HK	港交所	中国香港	7,000	22,072.36	0.09
274	CT ENVIRONMENTAL GROUP LTD	中滔环保	1363 HK	港交所	中国香港	24,000	22,055.50	0.09
275	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	中海物业	2669 HK	港交所	中国香港	10,000	21,920.60	0.09
276	DIGITAL CHINA HOLDINGS LTD	神州控股	861 HK	港交所	中国香港	6,000	21,751.98	0.09
277	CANVEST ENVIRONMENTAL PROTEC	粤丰环保	1381 HK	港交所	中国香港	6,000	21,296.71	0.08
278	HUABAO INTERNATIONAL HOLDING	华宝国际	336 HK	港交所	中国香港	5,000	21,161.81	0.08
279	WEST CHINA CEMENT LTD	西部水泥	2233 HK	港交所	中国香港	20,000	21,077.50	0.08
280	CITIC RESOURCES HOLDINGS LTD	中信资源	1205 HK	港交所	中国香港	30,000	20,993.19	0.08

281	OP FINANCIAL LTD	东英金融	1140 HK	港交所	中国香港	8,000	20,976.33	0.08
282	SINOTRANS SHIPPING LTD	中外运航运	368 HK	港交所	中国香港	12,000	20,942.60	0.08
283	CITIC TELECOM INTERNATIONAL	中信国际电讯	1883 HK	港交所	中国香港	12,000	20,841.43	0.08
284	CHINA OIL AND GAS GROUP LTD	中油燃气	603 HK	港交所	中国香港	40,000	20,571.64	0.08
285	SMARTONE TELECOMMUNICATIONS	数码通电讯	315 HK	港交所	中国香港	3,000	20,487.33	0.08
286	LEYOU TECHNOLOGIES HOLDINGS	乐游科技控股	1089 HK	港交所	中国香港	10,000	20,403.02	0.08
287	TRULY INTERNATIONAL HOLDINGS	信利国际	732 HK	港交所	中国香港	16,000	20,234.40	0.08
288	CHAOWEI POWER HOLDINGS LTD	超威动力	951 HK	港交所	中国香港	6,000	20,234.40	0.08
289	CENTRAL CHINA SECURITIES C-H	中原证券	1375 HK	港交所	中国香港	10,000	20,065.78	0.08
290	CHINA SHENGMU ORGANIC MILK	中国圣牧	1432 HK	港交所	中国香港	35,000	20,065.78	0.08
291	COLOUR LIFE SERVICES GROUP	彩生活	1778 HK	港交所	中国香港	3,000	19,981.47	0.08
292	CHINA MODERN DAIRY HOLDINGS	现代牧业	1117 HK	港交所	中国香港	16,000	19,964.61	0.08
293	LAI SUN DEVELOPMENT	丽新发展	488 HK	港交所	中国香港	1,800	19,880.30	0.08
294	COSMO LADY CHINA HOLDINGS CO	都市丽人	2298 HK	港交所	中国香港	6,000	19,779.13	0.08
295	LVGEM CHINA REAL ESTATE INVE	绿景中国地产	95 HK	港交所	中国香港	8,000	19,627.37	0.08

				所				
296	SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	三一国际	631 HK	港交所	中国香港	8,000	19,492.47	0.08
297	EVERBRIGHT SECURITIES CO L-H	光大证券	6178 HK	港交所	中国香港	2,400	19,344.09	0.08
298	SMI HOLDINGS GROUP LTD	星美控股	198 HK	港交所	中国香港	8,800	19,290.13	0.08
299	EMPEROR INTL HLDG LTD	英皇国际	163 HK	港交所	中国香港	10,000	19,222.68	0.08
300	CARNIVAL GROUP INTERNATIONAL	嘉年华国际	996 HK	港交所	中国香港	70,000	19,180.53	0.08
301	CHINA INTERNATIONAL MARINE-H	中集集团	2039 HK	港交所	中国香港	2,200	19,067.55	0.08
302	CHINA MACHINERY ENGINEERIN-H	中国机械工程	1829 HK	港交所	中国香港	6,000	19,020.34	0.08
303	CITYCHAMP WATCH & JEWELLERY	冠城钟表珠宝	256 HK	港交所	中国香港	14,000	19,003.47	0.08
304	HUAYI TENCENT ENTERTAINMENT	华谊腾讯娱乐	419 HK	港交所	中国香港	60,000	18,969.75	0.08
305	CHINA HARMONY NEW ENERGY AUT	和谐汽车	3836 HK	港交所	中国香港	6,500	18,468.11	0.07
306	HC GROUP INC	慧聪集团	2280 HK	港交所	中国香港	4,500	17,452.17	0.07
307	LEES PHARMACEUTICAL HLDGS	李氏大药厂	950 HK	港交所	中国香港	2,000	17,266.69	0.07
308	CHINA HUIYUAN JUICE GROUP	汇源果汁	1886 HK	港交所	中国香港	10,000	17,030.62	0.07
309	TEXWINCA HOLDINGS LTD	德永佳集团	321 HK	港交所	中国香港	6,000	16,946.31	0.07
310	CHINA AIRCRAFT	中国飞机	1848	港	中国	2,500	16,946.31	0.07

	LEASING GROUP	租赁	HK	交所	香港			
311	BEIJING GAS BLUE SKY HOLDING	北京燃气蓝天	6828 HK	港交所	中国香港	40,000	16,862.00	0.07
312	CHINA METAL RESOURCES UTILIZ	中国金属利用	1636 HK	港交所	中国香港	4,000	16,828.28	0.07
313	CPMC HOLDINGS LTD	中粮包装	906 HK	港交所	中国香港	4,000	16,356.14	0.06
314	HAICHANG OCEAN PARK HOLDINGS	海昌海洋公园	2255 HK	港交所	中国香港	10,000	15,934.59	0.06
315	REALORD GROUP HOLDINGS LTD	伟禄集团	1196 HK	港交所	中国香港	4,000	15,850.28	0.06
316	DALIAN PORT (PDA) CO LTD-H	大连港	2880 HK	港交所	中国香港	16,000	15,782.83	0.06
317	GCL NEW ENERGY HOLDINGS LTD	协鑫新能源	451 HK	港交所	中国香港	58,000	15,647.94	0.06
318	REGINA MIRACLE INTERNATIONAL	维珍妮	2199 HK	港交所	中国香港	3,000	15,428.73	0.06
319	PANDA GREEN ENERGY GROUP LTD	熊猫绿能	686 HK	港交所	中国香港	32,000	15,378.14	0.06
320	CHINA LNG GROUP LTD	中国天然气	931 HK	港交所	中国香港	16,000	15,243.25	0.06
321	GRAND BAOXIN AUTO GROUP LTD	广汇宝信	1293 HK	港交所	中国香港	6,000	15,226.39	0.06
322	Q TECHNOLOGY GROUP CO LTD	丘钛科技	1478 HK	港交所	中国香港	3,000	15,049.34	0.06
323	COGOBUY GROUP	科通芯城	400 HK	港交所	中国香港	5,000	14,838.56	0.06
324	SHANGHAI INDUSTRIAL URBAN DE	上实城市开发	563 HK	港交所	中国香港	12,000	14,568.77	0.06

325	CONCORD NEW ENERGY GROUP LTD	协合新能源	182 HK	港交所	中国香港	50,000	14,543.48	0.06
326	HI SUN TECHNOLOGY CHINA LTD	高阳科技	818 HK	港交所	中国香港	15,000	14,543.48	0.06
327	WASION HOLDINGS LTD	威胜集团	3393 HK	港交所	中国香港	4,000	14,366.42	0.06
328	361 DEGREES INTERNATIONAL	3 6 1 度	1361 HK	港交所	中国香港	7,000	14,223.10	0.06
329	SINOFERT HOLDINGS LTD	中化化肥	297 HK	港交所	中国香港	18,000	14,113.49	0.06
330	CGN NEW ENERGY HOLDINGS CO L	中广核新能源	1811 HK	港交所	中国香港	12,000	14,062.91	0.06
331	CSSC OFFSHORE & MARINE ENG-H	中船防务	317 HK	港交所	中国香港	2,000	13,658.22	0.05
332	FDG ELECTRIC VEHICLES LTD	五龙电动车	729 HK	港交所	中国香港	135,000	13,658.22	0.05
333	CHINA MERCHANTS LAND LTD	招商局置地	978 HK	港交所	中国香港	12,000	13,658.22	0.05
334	XINGDA INTL HOLDINGS	兴达国际	1899 HK	港交所	中国香港	7,000	13,573.91	0.05
335	FANTASIA HOLDINGS GROUP CO	花样年控股	1777 HK	港交所	中国香港	12,000	13,253.53	0.05
336	AJISEN CHINA HOLDINGS LTD	味千(中国)	538 HK	港交所	中国香港	5,000	13,025.90	0.05
337	TIANJIN PORT DVLP HLDS LTD	天津港发展	3382 HK	港交所	中国香港	16,000	12,815.12	0.05
338	KUANGCHI SCIENCE LTD	光启科学	439 HK	港交所	中国香港	19,000	12,654.93	0.05
339	FAIRWOOD HOLDINGS LTD	FAIRWOOD HOLD	52 HK	港交所	中国香港	500	12,646.50	0.05

				所				
340	EMPEROR CAPITAL GROUP LTD	英皇证券	717 HK	港交所	中国香港	30,000	12,646.50	0.05
341	DINGYI GROUP INVESTMENT LTD	鼎亿集团投资	508 HK	港交所	中国香港	20,000	12,477.88	0.05
342	CENTRAL CHINA REAL ESTATE	建业地产	832 HK	港交所	中国香港	4,000	12,342.98	0.05
343	GREENLAND HONG KONG HOLDINGS	绿地香港	337 HK	港交所	中国香港	5,000	12,267.11	0.05
344	YASHILI INTERNATIONAL HOLDIN	雅士利国际	1230 HK	港交所	中国香港	8,000	12,005.74	0.05
345	BRIGHT SMART SECURITIES AND	耀才证券金融	1428 HK	港交所	中国香港	6,000	11,634.78	0.05
346	CHINA FINANCIAL INTERNATIONA	中国金融国际	721 HK	港交所	中国香港	60,000	11,483.02	0.05
347	COMBA TELECOM SYSTEMS HOLDIN	京信通信	2342 HK	港交所	中国香港	12,000	11,331.26	0.04
348	DIGITAL DOMAIN HOLDINGS LTD	数字王国	547 HK	港交所	中国香港	110,000	11,314.40	0.04
349	CHINA POWER CLEAN ENERGY DEV	中国电力清洁能源	735 HK	港交所	中国香港	3,500	11,301.76	0.04
350	TIANJIN DEVELOPMENT HLDGS LT	天津发展	882 HK	港交所	中国香港	4,000	11,027.75	0.04
351	CK LIFE SCIENCES INTL HLDGS	长江生命科技	775 HK	港交所	中国香港	24,000	10,926.58	0.04
352	NEWOCEAN ENERGY HLDGS LTD	新海能源	342 HK	港交所	中国香港	8,000	10,791.68	0.04
353	BOCOM INTERNATIONAL HOLDINGS	交银国际	3329 HK	港交所	中国香港	7,000	10,623.06	0.04
354	COSCO SHIPPING	中远海运	517	港	中国	4,000	10,049.75	0.04

	INTERNATIONAL	国际	HK	交所	香港			
355	MINSHENG EDUCATION GROUP CO	民生教育	1569 HK	港交所	中国香港	6,000	9,914.86	0.04
356	JU TENG INTERNATIONAL HLDGS	巨腾国际	3336 HK	港交所	中国香港	8,000	8,768.24	0.03
357	BEST PACIFIC INTERNATIONAL H	超盈国际控股	2111 HK	港交所	中国香港	4,000	8,532.17	0.03
358	KANGDA INTERNATIONAL ENVIRON	康达环保	6136 HK	港交所	中国香港	8,000	8,228.66	0.03
359	REGAL HOTELS INTL HLDGS LTD	REGAL INTL	78 HK	港交所	中国香港	2,000	8,228.66	0.03
360	GLORIOUS PROPERTY HOLDINGS	恒盛地产	845 HK	港交所	中国香港	23,000	8,144.35	0.03
361	NVC LIGHTING HOLDINGS LTD	雷士照明	2222 HK	港交所	中国香港	14,000	7,790.24	0.03
362	CHINA PIONEER PHARMA HOLDING	中国先锋医药	1345 HK	港交所	中国香港	4,000	7,419.28	0.03
363	FREEMAN FINTECH CORP LTD	民众金融科技	279 HK	港交所	中国香港	100,000	7,419.28	0.03
364	COFCO MEAT HOLDINGS LTD	中粮肉食	1610 HK	港交所	中国香港	7,000	6,786.96	0.03
365	MAOYE INTERNATIONAL HLDGS	茂业国际	848 HK	港交所	中国香港	9,000	6,070.32	0.02
366	HENGDELI HOLDINGS LTD	亨得利	3389 HK	港交所	中国香港	20,000	5,986.01	0.02
367	RENTIAN TECHNOLOGY HOLDING	仁天科技控股	885 HK	港交所	中国香港	20,000	5,648.77	0.02
368	CGN MINING CO LTD	中广核矿业	1164 HK	港交所	中国香港	15,000	5,501.23	0.02

369	SOUNDWILL HOLDINGS LTD	金朝阳集团	878 HK	港交所	中国香港	500	5,463.29	0.02
370	CHIHO ENVIRONMENTAL GROUP LT	齐合环保	976 HK	港交所	中国香港	2,000	5,311.53	0.02
371	SRE GROUP LTD	上置集团	1207 HK	港交所	中国香港	36,000	5,220.48	0.02
372	CWT INTERNATIONAL LTD	CWT INTL	521 HK	港交所	中国香港	20,000	4,552.74	0.02
373	VISION FAME INTERNATIONAL HO	允升国际	1315 HK	港交所	中国香港	34,000	4,070.49	0.02
374	HONG KONG INTERNATIONAL CONS	香港国际建投	687 HK	港交所	中国香港	2,000	3,186.92	0.01
375	TENWOW INTERNATIONAL HOLDING	天喔国际	1219 HK	港交所	中国香港	8,000	3,136.33	0.01
376	FDG KINETIC LTD	五龙动力	378 HK	港交所	中国香港	12,000	1,527.70	0.01

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	ZhongAn Online P&C Insurance Co., Ltd.	6060 HK	315,796.22	0.46
2	LI & FUNG LTD	494 HK	166,682.26	0.24

3	ALIBABA HEALTH INFORMATION T	241 HK	126,869.54	0.18
4	ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1060 HK	98,496.94	0.14
5	CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	6818 HK	88,003.49	0.13
6	CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	3908 HK	70,584.56	0.10
7	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	2269 HK	70,416.67	0.10
8	China Education Group Holdings Limited	839 HK	60,172.10	0.09
9	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	3323 HK	60,139.49	0.09
10	CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	570 HK	58,949.08	0.09
11	Yihai International Holding Ltd.	1579 HK	58,133.75	0.08
12	JIAYUAN INTERNATIONAL GROUP	2768 HK	48,789.93	0.07
13	HONGKONG & SHANGHAI HOTELS	45 HK	47,640.34	0.07
14	Fit Hon Teng Limited	6088 HK	44,003.91	0.06
15	HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	754 HK	39,576.61	0.06
16	CHINA GRAND PHARMACEUTICAL A	512 HK	39,397.23	0.06
17	WE SOLUTIONS LTD	860 HK	39,071.11	0.06
18	CAR INC	699 HK	34,692.71	0.05
19	SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	2607 HK	31,531.69	0.05
20	Crystal International Group Limited	2232 HK	30,126.81	0.04

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	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	1918 HK	1,333,576.22	1.93

2	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	914 HK	687,914.04	0.99
3	CHINA VANKE CO LTD-H	2202 HK	507,076.26	0.73
4	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	586 HK	499,998.43	0.72
5	SINOPHARM GROUP CO-H	1099 HK	475,732.59	0.69
6	CITIC SECURITIES CO LTD-H	6030 HK	450,240.94	0.65
7	BYD CO LTD-H	1211 HK	429,421.16	0.62
8	MINTH GROUP LTD	425 HK	398,333.06	0.58
9	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	2238 HK	395,475.51	0.57
10	KINGSTON FINANCIAL GROUP LTD	1031 HK	381,073.57	0.55
11	CRRC CORP LTD - H	1766 HK	370,062.21	0.53
12	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	522 HK	369,926.65	0.53
13	NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	1336 HK	368,056.31	0.53
14	HYSAN DEVELOPMENT CO	14 HK	366,221.78	0.53
15	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	981 HK	356,506.57	0.51
16	PEOPLES INSURANCE CO GROU-H	1339 HK	344,595.21	0.50
17	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	868 HK	331,464.37	0.48
18	HUATAI SECURITIES CO LTD-H	6886 HK	311,141.76	0.45
19	KINGBOARD HOLDINGS LTD	148 HK	306,742.29	0.44
20	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	2689 HK	304,759.07	0.44

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	1,955,409.67
卖出收入（成交）总额	42,586,932.64

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	-
3	应收股利	203,789.02
4	应收利息	634.68
5	应收申购款	39,315.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	243,739.68

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
1,432	16,196.94	1,118,049.04	4.82%	22,075,971.48	95.18%

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户数。

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	张明	454,909.00	29.37%
2	尹绍波	150,023.00	9.69%
3	王鹏	145,014.00	9.36%
4	邓荣	143,386.00	9.26%
5	苟晟	90,001.00	5.81%
6	丁志松	79,000.00	5.10%
7	赵何鉴	57,878.00	3.74%
8	胡荣华	54,900.00	3.54%
9	李小晶	50,002.00	3.23%
10	李文树	40,002.00	2.58%

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	1,518.23	0.0065%

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	59,767,249.34
本报告期基金总申购份额	3,846,474.17
减：本报告期基金总赎回份额	40,419,702.99
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	23,194,020.52

§ 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

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
瑞银证券	-	41,657,320.91	93.52%	33,325.75	94.12%	-
UBS	-	2,489,889.64	5.59%	1,965.32	5.55%	-
摩根士丹利	-	395,131.76	0.89%	118.52	0.33%	-

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：：无 本报告期内退出交易单元：英大证券

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

无。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于基金管理人再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018年6月30日
2	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018年6月28日
3	大成基金管理有限公司关于提请直销非自然人客户及时登记受益所有人信息的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018年6月22日
4	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海华夏财富投资	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018年6月16日

	管理有限公司为销售机构的公告		
5	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海挖财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	2018年6月9日
6	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金(QDII-LOF)暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018年5月19日
7	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加四川天府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	2018年5月17日
8	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东海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	2018年5月4日
9	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	2018年4月24日
10	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金(QDII-LOF)2018年第1季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018年4月20日
11	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	2018年4月19日
12	关于大成基金管理有限公司南京分公司办公地址变更的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018年4月3日
13	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金(QDII-LOF)2017年度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018年3月31日
14	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	2018年3月28日
15	《大成恒生综合中小型股指数证券投资基金(QDII-LOF)基金合同》修订前后对照表	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018年3月27日
16	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金基金合同	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018年3月27日
17	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金托管协议	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018年3月27日
18	关于调整公司旗下证券投资基金赎回费的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018年3月27日
19	关于修订公司旗下证券投资基金基金合同有关条款的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018年3月27日
20	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金开通直销平台基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018年3月10日
21	大成恒生综合中小型股指数证券	中国证监会指定报	2018年2月9日

	投资基金（QDII-LOF）暂停申购、赎回及定投业务的公告	刊及本公司网站	
22	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）2017年第4季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018年1月20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年2期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018年1月17日
24	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-摘要（2017年2期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018年1月17日
25	关于再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018年1月5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	20180101-20180520	23,718,216.32	-	23,718,216.32	0	0.00%
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

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》的要求，本基金管理人经与基金托管人协商一致，对本基金基金合同的有关条款进行了修改，主要在前言、释义、投资交易限制、申购与赎回管理、基金估值管理、信息披露等方面对流动性风险管控措施进行明确，具体内容详见 2018 年 3 月 27 日基金管理人网站披露的相关公告和修订更新后的法律文件。

§ 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

2018年8月29日