

# 大成恒生综合中小型股指数证券投资基金 (QDII-LOF) 2019 年半年度报告

2019 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：2019 年 8 月 27 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 2019 年 8 月 26 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 2019 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人 .....	6
2.5 信息披露方式 .....	6
2.6 其他相关资料 .....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	8
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.....	10
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 .....	10
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	12
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.....	13
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.....	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	15
6.4 报表附注 .....	17
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>33</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	33
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 .....	34
7.3 期末按行业分类的权益投资组合 .....	34
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	34
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	91

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 .....	94
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 .....	94
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	94
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细.....	94
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.....	94
7.11 投资组合报告附注.....	94
<b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>95</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	95
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	95
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	96
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	96
<b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>96</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>96</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	96
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 .....	96
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	97
10.4 基金投资策略的改变 .....	97
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	97
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.....	97
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	97
10.8 其他重大事件.....	99
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>101</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	101
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	101
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>101</b>
12.1 备查文件目录.....	101
12.2 存放地点.....	101
12.3 查阅方式.....	101

## § 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	17,127,744.46 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	北京市东城区建国门内大街 69

	商银行大厦 32 层	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	中文	摩根大通银行
	英文	JPMorgan Chase & Co.

## 2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.dcfund.com.cn">http://www.dcfund.com.cn</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.6 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019 年 1 月 1 日-2019 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	99,618.97
本期利润	1,604,775.46
加权平均基金份额本期利润	0.0844
本期加权平均净值利润率	8.37%
本期基金份额净值增长率	6.79%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	109,712.41
期末可供分配基金份额利润	0.0064
期末基金资产净值	17,237,456.87
期末基金份额净值	1.006
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	0.60%

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	3.71%	1.00%	3.40%	0.99%	0.31%	0.01%
过去三个月	-4.01%	1.14%	-6.73%	1.10%	2.72%	0.04%
过去六个月	6.79%	1.09%	8.79%	1.08%	-2.00%	0.01%
过去一年	-7.45%	1.27%	-9.41%	1.30%	1.96%	-0.03%
自基金合同生效起至今	0.60%	1.07%	2.95%	1.11%	-2.35%	-0.04%

### 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

大成恒生综合中小型股指数累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10号文批准，于1999年4月12日正式成立，是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一，注册资本为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。

经过二十年的稳健发展，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2019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68只开放式证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----



		任职日期	离任日期		
冉凌浩	本基金基金经理	2016年12月2日	-	16年	金融学硕士。2003年4月至2004年6月就职于国信证券研究部，任研究员。2004年6月至2005年9月就职于华西证券研究部，任高级研究员。2005年9月加入大成基金管理有限公司，曾担任金融工程师、境外市场研究员及基金经理助理。2011年8月26日起任大成标普500等权重指数型证券投资基金基金经理。2014年11月13日起任大成纳斯达克100指数证券投资基金基金经理。2016年12月2日起任大成恒生综合中小型股指数基金（QDII-LOF）基金经理。2016年12月29日起任大成海外中国机会混合型证券投资基金（LOF）基金经理。2017年8月10日起任大成恒生指数证券投资基金（LOF）基金经理。2019年3月20日起任大成中华沪深港300指数证券投资基金（LOF）基金经理。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

无。

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

### 4.4.2 异常交易行为的专项说明

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

2019 年，虽然海外股市有所动荡，但是各种宏观经济数据显示，以美国为首的发达经济体仍然保持较好的增长势头，并不会陷入经济衰退，因此美股也于近期创出了历史新高。

在 1 季度，中国为了扭转经济下滑的不利局面实施了多项经济政策：首先，中央政府实施了宽信用、宽货币的货币政策，货币政策是经济的领先指标，较为宽松的货币政策有利于后几个月的经济增长；其次，政府实施了广泛的减税政策，其中企业减税降负促进经济活力，个人所得税

降低有望促进消费。因此，港股市场在 1 季度及 2 季度初期都出现了较好的涨幅。

但是五一过后市场出现了若干不利信号，首先是中美贸易谈判一度出现重大倒退，中美双方重新面临互加关税的风险；其次是中国 5 月份之后的宏观经济数据有大幅放缓的迹象，这也意味着宏观经济面临着极为不利的局面。在这些因素的影响下，港股市场出现了大幅回撤。

值得欣慰的是，在六月中下旬以来，中美双方开始重启贸易谈判，宏观经济数据也出现了走稳的迹象，因此港股市场开始出现了反弹。

#### 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 1.006 元；本报告期基金份额净值增长率为 6.79%，业绩比较基准收益率为 8.79%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，今年下半年全球经济增长或逐步放慢，中国也不例外，当前普遍预测中国 2019 年的 GDP 增速在 6.2% 左右。在这种宏观环境下，本基金的标的指数的盈利增长预计也将会大幅放缓。

因为经济增速放缓，经济下行压力尚未得到缓解，所以预计中国下半年政策宽松力度有望加强。在相对宽松的经济政策作用下，辅之中美贸易谈判重启而减弱外部不确定性，中国经济在下半年或实现逐步企稳。根据历史数据回溯，政策宽松加景气下行但逐步企稳的经济场景中，股票市场大多表现为由熊转牛。

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、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、交易管理部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员中包括五名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益总部、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；交易管理部负责关注相关投资品种的流动性状况，协助反馈其市场交易信息；基金运营部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策，并负责与托管行沟通估值调整事项；监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项的信息披露工作。

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

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金在本报告期内，曾出现了连续 60 个工作日资产净值低于五千万元的情形。我公司已根据法律法规及基金合同要求拟定相关应对方案上报中国证券监督管理委员会。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《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 2019 年 1 月 1 日至 2019 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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

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

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

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）

报告截止日：2019年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.3.1	1,198,266.63	1,335,350.56
结算备付金		222,117.09	-
存出保证金		88,401.56	-
交易性金融资产	6.4.3.2	15,986,121.89	19,717,301.51
其中：股票投资		15,986,121.89	19,717,301.51
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		-	85,006.09
应收利息	6.4.3.5	204.14	297.58
应收股利		159,292.28	12,192.20
应收申购款		2,340.78	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-

资产总计		17,656,744.37	21,150,147.94
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
<b>负 债:</b>			
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		173,036.99	3.92
应付赎回款		131,703.85	472.27
应付管理人报酬		13,913.74	18,204.56
应付托管费		3,478.43	4,551.12
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	1,458.49	287.70
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	95,696.00	260,033.04
负债合计		419,287.50	283,552.61
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.3.9	17,127,744.46	22,147,908.51
未分配利润	6.4.3.10	109,712.41	-1,281,313.18
所有者权益合计		17,237,456.87	20,866,595.33
负债和所有者权益总计		17,656,744.37	21,150,147.94

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.006 元，基金份额总额 17,127,744.46 份。

## 6.2 利润表

会计主体：大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		1,857,301.32	-791,659.67
1. 利息收入		4,546.81	13,165.48
其中：存款利息收入	6.4.3.11	4,546.81	13,165.48
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		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		343,757.23	6,565,530.76
其中：股票投资收益	6.4.3.12	76,533.18	6,127,054.46
基金投资收益	6.4.3.13	-	-
债券投资收益	6.4.3.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.3.15	-	-
衍生工具收益	6.4.3.16	-	-
股利收益	6.4.3.17	267,224.05	438,476.30
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.18	1,505,156.49	-7,364,397.57
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		2,549.37	-38,195.93
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.19	1,291.42	32,237.59
减：二、费用		252,525.86	655,117.01
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	95,336.75	255,295.69
2. 托管费	6.4.6.2.2	23,834.22	63,823.89
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.20	17,409.40	95,913.84
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.3.21	115,945.49	240,083.59
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,604,775.46	-1,446,776.68
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,604,775.46	-1,446,776.68

### 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：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019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）	22,147,908.51	-1,281,313.18	20,866,595.33
二、本期经营活	-	1,604,775.46	1,604,775.46

动产生的基金净值变动数 (本期净利润)			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-5,020,164.05	-213,749.87	-5,233,913.92
其中: 1. 基金申购款	1,247,648.19	11,669.28	1,259,317.47
2. 基金赎回款	-6,267,812.24	-225,419.15	-6,493,231.39
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)	17,127,744.46	109,712.41	17,237,456.87
项目	上年度可比期间 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
---------------------	---------------	--------------	---------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

谭晓冈

周立新

刘亚林

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致

### 6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关境内外财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

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

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

### 6.4.3 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	1,198,266.63
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	1,198,266.63

#### 6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	16,572,114.00	15,986,121.89	-585,992.11
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	16,572,114.00	15,986,121.89	-585,992.11

## 6.4.3.3 衍生金融资产/负债

无。

## 6.4.3.4 买入返售金融资产

无。

## 6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	174.14
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	30.00
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	204.14

## 6.4.3.6 其他资产

无。

## 6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,458.49
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,458.49

## 6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	276.76

预提费用	75,387.99
应付指数使用费	20,031.25
合计	95,696.00

#### 6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	22,147,908.51	22,147,908.51
本期申购	1,247,648.19	1,247,648.19
本期赎回(以“-”号填列)	-6,267,812.24	-6,267,812.24
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	17,127,744.46	17,127,744.46

注：1. 申购含红利再投份额(如有)、转换入份额(如有)；赎回含转换出份额(如有)。

2. 截至2019年06月30日止，本基金于深交所上市的基金份额为1,343,868.00份，托管在场外未上市交易的基金份额为15,783,876.46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

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	6,817,829.35	-8,099,142.53	-1,281,313.18
本期利润	99,618.97	1,505,156.49	1,604,775.46
本期基金份额交易产生的变动数	-1,538,286.88	1,324,537.01	-213,749.87
其中：基金申购款	385,245.64	-373,576.36	11,669.28
基金赎回款	-1,923,532.52	1,698,113.37	-225,419.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,379,161.44	-5,269,449.03	109,712.41

#### 6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
	活期存款利息收入
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	347.42
其他	29.42
合计	4,546.81

#### 6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	6,432,618.46
减：卖出股票成本总额	6,356,085.28
买卖股票差价收入	76,533.18

#### 6.4.3.13 基金投资收益

无。

#### 6.4.3.14 债券投资收益

无。

#### 6.4.3.15 贵金属投资收益

无。

#### 6.4.3.16 衍生工具收益

无。

#### 6.4.3.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	267,224.05
基金投资产生的股利收益	-
合计	267,224.05

#### 6.4.3.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
------	----

	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	1,505,156.49
股票投资	1,505,156.49
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	1,505,156.49

#### 6.4.3.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,291.42
合计	1,291.42

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

#### 6.4.3.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	17,409.40
银行间市场交易费用	-
合计	17,409.40

#### 6.4.3.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	25,799.42
指数使用费	40,062.50
银行费用	495.00
上市费	29,752.78
合计	115,945.49

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

#### 6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.4.1 或有事项

无。

##### 6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.5 关联方关系

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

无。

##### 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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.6.1.1 股票交易

无。

###### 6.4.6.1.2 债券交易

无。

###### 6.4.6.1.3 债券回购交易

无。

###### 6.4.6.1.4 基金交易

无。

#### 6.4.6.1.5 权证交易

无。

#### 6.4.6.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019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	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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	-	-	110,860.77	76.89

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。

#### 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 2019年1月1日至2019年6 月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	95,336.75
其中：支付销售机构的客户维护费	42,210.85	66,865.99

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.00% / 当年天数。

##### 6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元



项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	23,834.22	63,823.89

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

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.6.4 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

无。

##### 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

无。

#### 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	
	2019年1月1日至2019年6月30日		2018年1月1日至2018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	828,390.03	4,169.97	2,194,051.26	10,086.48
摩根大通银行	369,876.60	-	321,482.87	-

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

#### 6.4.6.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

## 6.4.6.7 其他关联交易事项的说明

无。

## 6.4.7 利润分配情况

无。

## 6.4.8 期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券

## 6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

## 6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单 价	复牌 日期	复牌 开盘单 价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
1019 HK	康宏环球	2017年 12月8日	重大事 项	0.15	-	-	270,000	50,157.33	39,663.87	-
1219 HK	天喔国际	2018年 08月13 日	重大事 项	0.33	-	-	8,000	12,153.81	2,674.17	-
521 HK	CWT INT'L	2019年 04月10 日	重大事 项	0.12	-	-	20,000	5,097.17	2,322.30	-
2369 HK	酷派集团	2017年 03月31 日	重大事 项	0.63	2019 年07 月19 日	0.34	164,000	116,550.43	103,870.25	-
6863 HK	辉山乳业	2017年 03月27 日	重大事 项	0.01	-	-	212,000	538,969.89	1,864.88	-
3886 HK	康健国际医 疗	2017年 11月27 日	重大事 项	0.61	-	-	110,000	122,662.27	66,766.19	-
1236 HK	国农控股	2017年 03月28 日	重大事 项	1.05	-	-	46,000	71,262.08	48,152.59	-
198 HK	星美控股	2018年 09月03 日	重大事 项	2.06	-	-	8,800	27,579.69	18,113.96	-

1886 HK	汇源果汁	2018年 04月03 日	重大事 项	1.78	-	-	10,000	23,658.22	17,769.13	-
---------	------	---------------------	----------	------	---	---	--------	-----------	-----------	---

#### 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

#### 6.4.9 金融工具风险及管理

##### 6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

##### 6.4.9.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行

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

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

于本期末，本基金无债券投资(上年度末：同)。

### 6.4.9.3 流动性风险

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

#### 6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金主要投资于交易所及银行间市场内交易的证券，除在附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制外(如有)，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”中列示的卖出回购金融资产款余额(如有)将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩

余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.9.4 市场风险

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

##### 6.4.9.4.1 利率风险

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

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

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

##### 6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	1,198,266.63	-	-	-	1,198,266.63
结算备付金	222,117.09	-	-	-	222,117.09
交易性金融资产	-	-	-	15,986,121.89	15,986,121.89
应收利息	-	-	-	204.14	204.14
应收股利	-	-	-	159,292.28	159,292.28
应收申购款	-	-	-	2,340.78	2,340.78
其他资产	-	-	-	88,401.56	88,401.56
<b>资产总计</b>	<b>1,420,383.72</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>16,236,360.65</b>	<b>17,656,744.37</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	131,703.85	131,703.85
应付管理人报酬	-	-	-	13,913.74	13,913.74
应付托管费	-	-	-	3,478.43	3,478.43
应付证券清算款	-	-	-	173,036.99	173,036.99
应付交易费用	-	-	-	1,458.49	1,458.49
其他负债	-	-	-	95,696.00	95,696.00
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>419,287.50</b>	<b>419,287.50</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>1,420,383.72</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>15,817,073.15</b>	<b>17,237,456.87</b>

上年度末 2018年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,290,758.50	-	-	44,592.06	1,335,350.56
交易性金融资产	-	-	-	19,717,301.51	19,717,301.51
应收利息	-	-	-	297.58	297.58
应收股利	-	-	-	12,192.20	12,192.20
应收证券清算款	-	-	-	85,006.09	85,006.09
资产总计	1,290,758.50	-	-	19,859,389.44	21,150,147.94
负债					
应付赎回款	-	-	-	472.27	472.27
应付管理人报酬	-	-	-	18,204.56	18,204.56
应付托管费	-	-	-	4,551.12	4,551.12
应付证券清算款	-	-	-	3.92	3.92
应付交易费用	-	-	-	287.70	287.70
其他负债	-	-	-	260,033.04	260,033.04
负债总计	-	-	-	283,552.61	283,552.61
利率敏感度缺口	1,290,758.50	-	-	19,575,836.83	20,866,595.33

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

#### 6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 6.4.9.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.9.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2019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	-	369,879.58	-	369,879.58

交易性金融资产	-	15,986,121.89	-	15,986,121.89
应收股利	-	6,923.87	-	6,923.87
资产合计	-	16,362,925.34	-	16,362,925.34
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	-	16,362,925.34	-	16,362,925.34
项目	上年度末 2018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	-	44,595.03	-	44,595.03
交易性金融资产	-	19,717,301.51	-	19,717,301.51
应收股利	-	801.29	-	801.29
应收证券清算款	-	85,006.09	-	85,006.09
资产合计	-	19,847,703.92	-	19,847,703.92
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	-	19,847,703.92	-	19,847,703.92

#### 6.4.9.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
	本期末（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）	
分析	港币相对人民币升值5%	861,870.00	990,000.00
	港币相对人民币贬值5%	-861,870.00	-990,000.00

### 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(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		上年度末 2018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	15,986,121.89	92.74	19,717,301.51	94.49
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	15,986,121.89	92.74	19,717,301.51	94.49



## 6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）
分析	绩比较基准上升 5%	780,000.00	1,000,000.00
	业绩比较基准下降 5%	-780,000.00	-1,000,000.00

## 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	15,986,121.89	90.54
	其中：普通股	15,986,121.89	90.54
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,420,383.72	8.04
8	其他各项资产	250,238.76	1.42
9	合计	17,656,744.37	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 15,047,198.31 元，占期末基金资产净值的比例为 87.29%。

## 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
中国香港	15,986,121.89	92.74
合计	15,986,121.89	92.74

## 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（%）
能源	279,995.78	1.62
原材料	1,275,535.16	7.40
工业	2,811,818.44	16.31
非日常生活消费品	2,378,949.87	13.80
日常消费品	623,085.16	3.61
医疗保健	1,312,845.05	7.62
金融	1,757,692.61	10.20
信息技术	1,312,299.68	7.61
通信服务	905,778.85	5.25
公用事业	673,495.83	3.91
房地产	2,337,565.39	13.56
合计	15,669,061.82	90.90

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

## 7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
工业	2,322.30	0.01
非日常生活消费品	15,862.03	0.09
日常消费品	22,308.18	0.13
医疗保健	66,766.19	0.39
金融	39,664.57	0.23
信息技术	152,022.84	0.88
通信服务	18,113.96	0.11
合计	317,060.07	1.84

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

## 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在	所属国家	数量(股)	公允价值	占基金资
----	----------	----------	------	----	------	-------	------	------

				证 券 市 场	(地 区)			产 净 值 比 例 (%)
1	CHINA TOWER CORP LTD-H	中国铁塔	788 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	254,000	458,038.96	2.66
2	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	安徽海螺水泥股 份	914 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	7,000	301,415.50	1.75
3	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	海螺创业	586 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	10,000	242,786.16	1.41
4	CHINA VANKE CO LTD-H	万科企业	2202 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	7,400	190,727.88	1.11
5	LI NING CO LTD	李宁	2331 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	11,500	186,338.38	1.08
6	SINOPHARM GROUP CO-H	国药控股	1099 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	6,800	164,496.42	0.95

				所				
7	CITIC SECURITIES CO LTD-H	中信证券	6030 HK	香港联合交易所	中国香港	11,000	157,529.51	0.91
8	NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	新华保险	1336 HK	香港联合交易所	中国香港	4,700	157,107.28	0.91
9	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	中国交通建设	1800 HK	香港联合交易所	中国香港	25,000	153,720.59	0.89
10	BYD CO LTD-H	比亚迪股份	1211 HK	香港联合交易所	中国香港	3,500	145,165.89	0.84
11	CRRC CORP LTD - H	中国中车	1766 HK	香港联合交易所	中国香港	25,000	143,604.50	0.83
12	CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	中国金茂	817 HK	香港联合交易所	中国香港	34,000	142,065.09	0.82
13	HYSAN DEVELOPMENT CO	希慎兴业	14 HK	香港	中国香港	4,000	141,977.12	0.82

				联合交易所				
14	HAITONG SECURITIES CO LTD-H	海通证券	6837 HK	香港联合交易所	中国香港	17,600	135,622.46	0.79
15	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	中芯国际	981 HK	香港联合交易所	中国香港	17,500	133,928.24	0.78
16	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	中国建材	3323 HK	香港联合交易所	中国香港	22,000	132,564.76	0.77
17	VITASOY INTL HOLDINGS LTD	维他奶国际集团	345 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	132,124.93	0.77
18	SAMSONITE INTERNATIONAL SA	新秀丽	1910 HK	香港联合交易所	中国香港	8,200	129,260.76	0.75
19	WEICHAI POWER CO LTD-H	潍柴动力	2338 HK	香港联合交	中国香港	11,000	127,726.63	0.74

				易所				
20	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	碧桂园服务	6098 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	127,093.28	0.74
21	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	广汽集团	2238 HK	香港联合交易所	中国香港	17,200	126,185.47	0.73
22	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	中国中铁	390 HK	香港联合交易所	中国香港	23,000	120,179.15	0.70
23	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	ASMPACIFIC	522 HK	香港联合交易所	中国香港	1,700	119,633.76	0.69
24	ALIBABA PICTURES GROUP LTD	阿里影业	1060 HK	香港联合交易所	中国香港	80,000	118,226.30	0.69
25	PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	中国人民保险集团	1339 HK	香港联合交易所	中国香港	44,000	118,050.37	0.68
26	CGN POWER CO LTD-H	中广核电力	1816	香	中国	61,000	115,367.41	0.67

			HK	香港 联合交易所	香港			
27	FAR EAST HORIZON LTD	远东宏信	3360 HK	香港 联合交易所	中国 香港	16,000	112,455.73	0.65
28	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	中车时代电气	3898 HK	香港 联合交易所	中国 香港	3,100	112,213.83	0.65
29	HUATAI SECURITIES CO LTD-H	HTSC	6886 HK	香港 联合交易所	中国 香港	9,400	111,132.73	0.64
30	YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	颐海国际	1579 HK	香港 联合交易所	中国 香港	3,000	107,010.64	0.62
31	GENSCRIPT BIOTECH CORP	金斯瑞生物科技	1548 HK	香港 联合交易所	中国 香港	6,000	103,553.58	0.60
32	3SBIO INC	三生制药	1530 HK	香港 联合交易所	中国 香港	8,500	100,342.82	0.58

				交易所				
33	CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	旭辉控股集团	884 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	22,000	99,665.48	0.58
34	PING AN HEALTHCARE AND TECHN	银泰商业	1833 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	3,400	97,351.97	0.56
35	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	中国铁建	1186 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	11,500	96,912.14	0.56
36	KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	金蝶国际	268 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	13,000	96,630.65	0.56
37	HANG LUNG GROUP LTD	恒隆集团	10 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	5,000	95,223.20	0.55
38	PCCW LTD	电讯盈科	8 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	24,000	95,214.40	0.55



39	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	信义光能	968 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	28,000	94,827.35	0.55
40	CHINA RESOURCES CEMENT	华润水泥控股	1313 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	14,000	93,226.37	0.54
41	CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	中国光大银行	6818 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	29,000	91,326.30	0.53
42	FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLD	新城发展控股	1030 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	10,000	90,429.05	0.52
43	DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	东风集团股份	489 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	16,000	90,077.18	0.52
44	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	紫金矿业	2899 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	32,000	89,232.71	0.52
45	HUANENG POWER INTL INC-H	华能国际电力股份	902 HK	香港 联	中国 香港	22,000	89,021.59	0.52

				合交易所				
46	LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO L	龙光地产	3380 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	88,951.22	0.52
47	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	长城汽车	2333 HK	香港联合交易所	中国香港	18,000	88,511.39	0.51
48	TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	青岛啤酒股份	168 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	87,526.17	0.51
49	ZTE CORP-H	中兴通讯	763 HK	香港联合交易所	中国香港	4,400	87,279.87	0.51
50	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	信义玻璃	868 HK	香港联合交易所	中国香港	12,000	86,558.54	0.50
51	AIR CHINA LTD-H	中国国航	753 HK	香港联合交易所	中国香港	12,000	83,180.65	0.48

				所				
52	CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	中金公司	3908 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	83,180.65	0.48
53	CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	中国银河	6881 HK	香港联合交易所	中国香港	20,000	81,456.52	0.47
54	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	龙源电力	916 HK	香港联合交易所	中国香港	18,000	79,327.74	0.46
55	GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	富力地产	2777 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	79,274.96	0.46
56	JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	江苏宁沪高速公路	177 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	78,254.55	0.45
57	KINGBOARD HOLDINGS LTD	建滔化工	148 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	76,530.42	0.44
58	FORTUNE REIT	置富产业信托	778 HK	香港	中国香港	8,000	75,580.39	0.44

				联合交易所	港			
59	SHENZHEN INTL HOLDINGS	深圳国际	152 HK	香港联合交易所	中国香港	5,500	74,991.02	0.44
60	SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	威高股份	1066 HK	香港联合交易所	中国香港	12,000	74,735.91	0.43
61	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	中国通信服务	552 HK	香港联合交易所	中国香港	14,000	74,630.35	0.43
62	KINGSOFT CORP LTD	金山软件	3888 HK	香港联合交易所	中国香港	5,000	74,331.27	0.43
63	MINTH GROUP LTD	敏实集团	425 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	74,067.37	0.43
64	AGILE GROUP HOLDINGS LTD	雅居乐集团	3383 HK	香港联合交	中国香港	8,000	73,609.95	0.43

				易所				
65	TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	同程艺龙	780 HK	香港联合交易所	中国香港	5,200	70,900.60	0.41
66	BOC AVIATION LTD	中银航空租赁	2588 HK	香港联合交易所	中国香港	1,200	69,246.84	0.40
67	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	中国民航信息网络	696 HK	香港联合交易所	中国香港	5,000	69,053.31	0.40
68	CHAMPION REIT	冠君产业信托	2778 HK	香港联合交易所	中国香港	12,000	68,719.04	0.40
69	GF SECURITIES CO LTD-H	广发证券	1776 HK	香港联合交易所	中国香港	8,400	68,645.15	0.40
70	CHINA COAL ENERGY CO-H	中煤能源	1898 HK	香港联合交易所	中国香港	24,000	68,613.48	0.40
71	CHINA OILFIELD	中海油田服务	2883	香	中国	10,000	67,997.72	0.39

	SERVICES-H		HK	香港 联合交易所	香港			
72	COSCO SHIPPING PORTS LTD	中远海运港口	1199 HK	香港 联合交易所	中国 香港	10,000	67,821.79	0.39
73	NAGACORP LTD	金界控股	3918 HK	香港 联合交易所	中 国香港	8,000	67,628.26	0.39
74	SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	上海医药	2607 HK	香港 联合交易所	中国 香港	5,000	67,557.89	0.39
75	ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	中升控股	881 HK	香港 联合交易所	中国 香港	3,500	66,964.12	0.39
76	SWIRE PACIFIC LTD-CL B	太古股份公司B	87 HK	香港 联合交易所	中国 香港	5,000	65,094.84	0.38
77	YANZHOU COAL MINING CO-H	兖州煤业股份	1171 HK	香港 联合交易所	中国 香港	10,000	64,215.18	0.37

				交易所				
78	JIANGXI COPPER CO LTD-H	江西铜业股份	358 HK	香港联合交易所	中国香港	7,000	64,039.25	0.37
79	SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	复星医药	2196 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	62,411.88	0.36
80	YUEXIU PROPERTY CO LTD	越秀地产	123 HK	香港联合交易所	中国香港	40,000	62,279.93	0.36
81	GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARM-H	白云山	874 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	62,016.03	0.36
82	UNITED ENERGY GROUP LTD	联合能源集团	467 HK	香港联合交易所	中国香港	46,000	61,910.47	0.36
83	VTECH HOLDINGS LTD	VTECHHOLDINGS	303 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	61,488.23	0.36

84	MELCO INTERNATIONAL DEVELOP.	新濠国际发展	200 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	4,000	60,942.84	0.35
85	CHINA EVERBRIGHT LTD	中国光大控股	165 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	6,000	60,907.66	0.35
86	BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	北京首都机场股 份	694 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	10,000	60,256.71	0.35
87	CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	中国中药	570 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	18,000	60,168.74	0.35
88	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	福耀玻璃	3606 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	2,800	59,728.91	0.35
89	HEALTH AND HAPPINESS H&H INT	合生元	1112 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	1,500	58,519.38	0.34
90	ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	浙江沪杭甬	576 HK	香港 联	中国 香港	8,000	57,916.81	0.34



				合交易所				
91	HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	海天国际	1882 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	57,072.34	0.33
92	SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	远洋集团	3377 HK	香港联合交易所	中国香港	19,500	56,949.19	0.33
93	CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	康哲药业	867 HK	香港联合交易所	中国香港	9,000	56,685.29	0.33
94	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	越秀房产信托基金	405 HK	香港联合交易所	中国香港	12,000	56,368.61	0.33
95	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	海丰国际	1308 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	56,016.75	0.32
96	HKBN LTD	香港宽频	1310 HK	香港联合交易所	中国香港	4,500	55,735.26	0.32

				所				
97	LEGEND HOLDINGS CORP-H	联想控股	3396 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	3,400	54,971.71	0.32
98	AUSNUTRIA DAIRY CORP LTD	澳优	1717 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	4,000	54,750.04	0.32
99	WUXI APPTec CO LTD-H	药明康德	2359 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	900	54,231.04	0.31
100	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	中国铝业	2600 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	22,000	53,606.48	0.31
101	UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	统一企业中国	220 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	7,000	53,571.29	0.31
102	HUANENG RENEWABLES CORP-H	华能新能源	958 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	28,000	52,955.53	0.31
103	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	中航科工	2357 HK	香港	中国 香港	14,000	52,586.07	0.31

				联合交易所				
104	CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	重庆农村商业银行	3618 HK	香港联合交易所	中国香港	14,000	52,339.77	0.30
105	KWG GROUP HOLDINGS LTD	合景泰富	1813 HK	香港联合交易所	中国香港	7,500	52,317.78	0.30
106	LUYE PHARMA GROUP LTD	绿叶制药	2186 HK	香港联合交易所	中国香港	10,500	52,278.19	0.30
107	SSY GROUP LTD	石四药集团	2005 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	49,683.20	0.29
108	SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	中石化炼化工程	2386 HK	香港联合交易所	中国香港	8,500	49,498.47	0.29
109	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	上海石油化工股份	338 HK	香港联合交	中国香港	18,000	49,085.03	0.28

				易所				
110	CHINA AOYUAN GROUP LTD	中国奥园	3883 HK	香港联合交易所	中国香港	5,000	48,293.33	0.28
111	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	中国南方航空股份	1055 HK	香港联合交易所	中国香港	10,000	47,853.50	0.28
112	SINOTRUK HONG KONG LTD	中国重汽	3808 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	47,572.01	0.28
113	KAISA GROUP HOLDINGS LTD	佳兆业集团	1638 HK	香港联合交易所	中国香港	14,000	47,536.83	0.28
114	CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	中国信达	1359 HK	香港联合交易所	中国香港	30,000	47,501.64	0.28
115	CHINA YONGDA AUTOMOBILES SER	永达汽车	3669 HK	香港联合交易所	中国香港	7,500	47,171.77	0.27
116	ZHAOJIN MINING	招金矿业	1818	香	中国	6,000	46,182.15	0.27

	INDUSTRY - H		HK	香港 联合交易所	香港			
117	IGG INC	IGG	799 HK	香港 联合交易所	中国 香港	6,000	45,971.03	0.27
118	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	洛阳钼业	3993 HK	香港 联合交易所	中国 香港	21,000	45,627.96	0.26
119	CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	中国再保险	1508 HK	香港 联合交易所	中国 香港	37,000	45,240.91	0.26
120	GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	绿城服务	2869 HK	香港 联合交易所	中国 香港	8,000	44,405.24	0.26
121	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	比亚迪电子	285 HK	香港 联合交易所	中国 香港	4,500	44,176.53	0.26
122	GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	国泰君安	2611 HK	香港 联合交易所	中国 香港	3,600	44,081.52	0.26

				交易所				
123	LUK FOOK HOLDINGS INTL LTD	六福集团	590 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	2,000	43,103.34	0.25
124	LI & FUNG LTD	利丰	494 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	36,000	43,068.15	0.25
125	NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	耐世特	1316 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	5,000	42,751.48	0.25
126	CHINA POWER INTERNATIONAL	中国电力	2380 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	25,000	42,003.77	0.24
127	GOME RETAIL HOLDINGS LTD	国美电器	493 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	56,000	41,379.21	0.24
128	TIMES CHINA HOLDINGS LTD	时代地产	1233 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	3,000	41,273.65	0.24

129	CHINA FIRST CAPITAL GROUP LT	首控集团	1269 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	20,000	40,992.16	0.24
130	BAIC MOTOR CORP LTD-H	北京汽车	1958 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	9,500	40,948.17	0.24
131	CAFE DE CORAL HOLDINGS LTD	大家乐集团	341 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	2,000	40,904.19	0.24
132	CHINA MERCHANTS SECURITIES-H	招商证券	6099 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	4,800	40,661.40	0.24
133	CHINA WATER AFFAIRS GROUP	中国水务	855 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	6,000	40,587.51	0.24
134	CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	中国东方航空股份	670 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	10,000	40,552.33	0.24
135	SHENZHEN INVESTMENT LTD	深圳控股	604 HK	香港 联	中国 香港	16,000	40,534.73	0.24

				合交易所				
136	CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	中国软件国际	354 HK	香港联合交易所	中国香港	12,000	40,534.73	0.24
137	COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	中国远洋	1919 HK	香港联合交易所	中国香港	15,000	40,244.45	0.23
138	CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	中国通号	3969 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	39,971.75	0.23
139	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	华虹半导体	1347 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	39,901.38	0.23
140	SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	上海电气	2727 HK	香港联合交易所	中国香港	16,000	39,831.00	0.23
141	CHINA SCE GROUP HOLDINGS LTD	中骏置业	1966 HK	香港联合交易所	中国香港	12,000	39,690.26	0.23



				所				
142	FIRST PACIFIC CO	第一太平	142 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	14,000	39,039.31	0.23
143	SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	四环医药	460 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	25,000	38,705.04	0.22
144	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	理文造纸	2314 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	8,000	38,493.92	0.22
145	ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	众安在线	6060 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	2,000	37,737.41	0.22
146	FUFENG GROUP LTD	阜丰集团	546 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	10,000	37,561.48	0.22
147	KERRY LOGISTICS NETWORK LTD	嘉里物流	636 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	3,000	37,104.06	0.22
148	JOHNSON ELECTRIC HOLDINGS	德昌电机控股	179 HK	香港	中国 香港	2,500	36,681.82	0.21

				联合交易所				
149	CHINA SOUTH CITY HOLDINGS	华南城	1668 HK	香港联合交易所	中国香港	36,000	36,417.92	0.21
150	FU SHOU YUAN INTERNATIONAL	福寿园	1448 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	36,154.03	0.21
151	ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	中联重科	1157 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	36,101.25	0.21
152	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	中海物业	2669 HK	香港联合交易所	中国香港	10,000	35,802.16	0.21
153	GENERTEC UNIVERSAL MEDICAL G	环球医疗	2666 HK	香港联合交易所	中国香港	6,500	35,736.19	0.21
154	ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	正荣地产	6158 HK	香港联合交	中国香港	8,000	35,116.03	0.20

				易所				
155	XIABUXIABU CATERING MANAGEME	呷哺呷哺	520 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	3,500	34,975.28	0.20
156	KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	建滔积层板	1888 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	5,500	34,641.01	0.20
157	BOSIDENG INTL HLDGS LTD	波司登	3998 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	18,000	34,359.52	0.20
158	SHUI ON LAND LTD	瑞安房地产	272 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	21,500	34,231.97	0.20
159	RAZER INC	雷蛇	1337 HK	香港 联合 交易所	中 国 香 港	23,000	33,990.06	0.20
160	PACIFIC BASIN SHIPPING LTD	太平洋航运	2343 HK	香港 联合 交易所	中 国 香 港	27,000	33,963.67	0.20
161	L' OCCITANE	L' OCCITANE	973	香	中		33,954.88	0.20

	INTERNATIONAL SA		HK	香港联合交易所	中国香港	2,500		
162	YUEXIU TRANSPORT INFRASTRUCT	越秀交通基建	1052 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	33,673.38	0.20
163	CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	中国忠旺	1333 HK	香港联合交易所	中国香港	9,600	33,272.26	0.19
164	CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	中国联塑	2128 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	33,145.59	0.19
165	SHENZHEN EXPRESSWAY CO-H	深圳高速公路股份	548 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	33,040.03	0.19
166	PACIFIC TEXTILES HOLDINGS	互太纺织	1382 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	32,617.79	0.19
167	YUZHOU PROPERTIES CO	禹洲地产	1628 HK	香港联合交易所	中国香港	10,000	32,283.52	0.19

				交易所				
168	CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	中教控股	839 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	32,195.56	0.19
169	K WAH INTL HOLDINGS	嘉华国际	173 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	32,090.00	0.19
170	VALUE PARTNERS GROUP LTD	惠理集团	806 HK	香港联合交易所	中国香港	7,000	32,081.20	0.19
171	CHINA GRAND PHARMACEUTICAL A	远大医药	512 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	31,878.88	0.18
172	METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	中国中冶	1618 HK	香港联合交易所	中国香港	17,000	31,254.32	0.18
173	DATANG INTL POWER GEN CO-H	大唐发电	991 HK	香港联合交易所	中国香港	18,000	31,034.40	0.18

174	CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	中国粮油控股	606 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	14,000	30,911.25	0.18
175	XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	金风科技	2208 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	4,080	30,650.17	0.18
176	CHINA OVERSEAS GRAND OCEANS	中国海外宏洋集团	81 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	10,000	30,260.30	0.18
177	POLY PROPERTY GROUP CO LTD	保利置业集团	119 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	12,000	30,189.93	0.18
178	SINOTRANS LIMITED-H	中国外运	598 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	12,000	29,978.81	0.17
179	SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	上海实业控股	363 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	2,000	29,802.88	0.17
180	DAH SING BANKING GROUP LTD	大新银行集团	2356 HK	香港 联	中国 香港	2,400	29,767.69	0.17

				合交易所				
181	HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	合生创展集团	754 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	29,732.51	0.17
182	TOWNGAS CHINA CO LTD	港华燃气	1083 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	29,714.91	0.17
183	RONSHINE CHINA HOLDINGS LTD	融信中国	3301 HK	香港联合交易所	中国香港	3,500	29,648.94	0.17
184	DONGYUE GROUP	东岳集团	189 HK	香港联合交易所	中国香港	7,000	29,556.58	0.17
185	HAITONG INTERNATIONAL SECURI	海通国际(一千)	665 HK	香港联合交易所	中国香港	13,000	29,160.73	0.17
186	SOHO CHINA LTD	S O H O 中国	410 HK	香港联合交易所	中国香港	12,000	29,134.34	0.17

				所				
187	MMG LTD	五矿资源	1208 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	12,000	28,817.66	0.17
188	GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	保利协鑫能源	3800 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	76,000	28,747.29	0.17
189	BBMG CORP-H	金隅股份	2009 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	13,000	28,703.31	0.17
190	ROAD KING INFRASTRUCTURE LTD	路劲	1098 HK	香港 联合 交易所	中 国 香 港	2,000	28,360.24	0.16
191	ZHONGYU GAS HOLDINGS LTD	中裕燃气	3633 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	4,000	28,289.87	0.16
192	FIT HON TENG LTD	FIT HON TENG	6088 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	10,000	27,797.26	0.16
193	YICHANG HEC CHANGJIANG PHA-H	东阳光药	1558 HK	香 港	中国 香港	800	27,480.58	0.16



				联合交易所				
194	POWERLONG REAL ESTATE HOLDIN	宝龙地产	1238 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	27,445.39	0.16
195	MAANSHAN IRON & STEEL-H	马鞍山钢铁股份	323 HK	香港联合交易所	中国香港	10,000	27,269.46	0.16
196	HUADIAN POWER INTL CORP-H	华电国际电力股份	1071 HK	香港联合交易所	中国香港	10,000	27,181.49	0.16
197	HONGKONG & SHANGHAI HOTELS	大酒店	45 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	26,864.82	0.16
198	MAN WAH HOLDINGS LTD	敏华控股	1999 HK	香港联合交易所	中国香港	8,800	26,629.07	0.15
199	DAH SING FINANCIAL HOLDINGS	大新金融	440 HK	香港联合交	中国香港	800	25,686.07	0.15

				易所				
200	LIFESTYLE INTL HLDGS LTD	利福国际	1212 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	2,500	25,114.29	0.15
201	CHINA RESOURCES MEDICAL HOLD	华润凤凰医疗	1515 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	5,000	25,070.31	0.15
202	XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	特步国际	1368 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	6,000	24,859.19	0.14
203	TONG REN TANG TECHNOLOGIES-H	同仁堂科技	1666 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	3,000	24,568.90	0.14
204	CITIC TELECOM INTERNATIONAL	中信国际电讯	1883 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	9,000	24,542.51	0.14
205	ANGANG STEEL CO LTD-H	鞍钢股份	347 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	7,800	24,426.40	0.14
206	COSCO SHIPPING	中远海能	1138	香	中国	6,000	24,384.18	0.14

	ENERGY TRAN-H		HK	香港 联合交易所	香港			
207	CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD	中国东方集团	581 HK	香港 联合交易所	中国 香港	6,000	24,120.28	0.14
208	GIORDANO INTERNATIONAL LTD	佐丹奴国际	709 HK	香港 联合交易所	中国 香港	8,000	24,067.50	0.14
209	SUNEVISION HOLDINGS	新意网集团	1686 HK	香港 联合交易所	中国 香港	4,000	23,926.75	0.14
210	CHINA TIAN LUN GAS HOLDINGS	天伦燃气	1600 HK	香港 联合交易所	中国 香港	3,000	23,671.65	0.14
211	VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	维达国际	3331 HK	香港 联合交易所	中国 香港	2,000	23,363.77	0.14
212	CSC FINANCIAL CO LTD-H	中信建投证券	6066 HK	香港 联合交易所	中国 香港	4,500	22,998.71	0.13

				交易所				
213	GEMDALE PROPERTIES AND INVES	金地商置	535 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	28,000	22,906.35	0.13
214	SKYWORTH DIGITAL HLDGS LTD	创维数码	751 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	12,000	22,167.43	0.13
215	CIMC ENRIC HOLDINGS LTD	中集安瑞科	3899 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	4,000	22,167.43	0.13
216	TIANNENG POWER INTL LTD	天能动力	819 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	4,000	22,132.25	0.13
217	SHUN TAK HOLDINGS LTD	信德集团	242 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	8,000	22,026.69	0.13
218	TELEVISION BROADCASTS LTD	电视广播	511 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	1,900	21,827.88	0.13

219	CHINA MAPLE LEAF EDUCATIONAL	枫叶教育	1317 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	8,000	21,745.20	0.13
220	CAR INC	神州租车	699 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	4,000	21,745.20	0.13
221	CHINESE ESTATES HOLDINGS LTD	华人置业	127 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	3,500	21,736.40	0.13
222	HENG TEN NETWORKS GROUP LTD	恒腾网络	136 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	132,000	21,597.41	0.13
223	DFZQ-H	东方证券	3958 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	4,800	21,534.08	0.12
224	PROSPERITY REIT	泓富产业信托	808 HK	香港 联合 交易所	中 国 香 港	7,000	20,997.48	0.12
225	SHOUGANG FUSHAN RESOURCES GR	首钢资源	639 HK	香 港 联	中 国 香 港	14,000	20,935.91	0.12

				合交易所				
226	MICROPORT SCIENTIFIC CORP	微创医疗	853 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	4,000	20,408.11	0.12
227	LONKING HOLDINGS LTD	中国龙工	3339 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	11,000	20,126.62	0.12
228	LIFETECH SCIENTIFIC CORP	先健科技	1302 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	16,000	19,985.88	0.12
229	GREATVIEW ASEPTIC PACKAGING	纷美包装	468 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	5,000	19,616.42	0.11
230	GREENTOWN CHINA HOLDINGS	绿城中国	3900 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	4,000	19,563.64	0.11
231	POU SHENG INTL HOLDINGS LTD	宝胜国际	3813 HK	香港 联合 交易	中国 香港	12,000	19,106.22	0.11

				所				
232	GUOTAI JUNAN INTERNATIONAL	国泰君安国际	1788 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	16,000	19,000.66	0.11
233	COSCO SHIPPING DEVELOPMENT-H	中海集运	2866 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	22,000	18,965.47	0.11
234	GUANGSHEN RAILWAY CO LTD-H	广深铁路股份	525 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	8,000	18,789.54	0.11
235	CHINA BLUECHEMICAL LTD - H	中海石油化学	3983 HK	香港 联合 交易所	中 国 香 港	10,000	18,736.76	0.11
236	CHINA ZHENGTONG AUTO SERVICE	正通汽车	1728 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	6,500	18,525.64	0.11
237	ZHOU HEI YA INTERNATIONAL HO	周黑鸭	1458 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	5,000	18,516.84	0.11
238	JIAYUAN INTERNATIONAL	佳源国际控股	2768 HK	香 港	中国 香港	6,000	18,156.18	0.11

	GROUP			联合交易所				
239	HUIFU PAYMENT LTD	汇付天下	1806 HK	香港联合交易所	中国香港	4,800	18,071.74	0.10
240	CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	宇华教育	6169 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	17,945.06	0.10
241	CHINA EVERBRIGHT GREENTECH L	中国光大绿色环保	1257 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	17,874.69	0.10
242	REDCO GROUP	力高地产	1622 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	17,839.50	0.10
243	HUADIAN FUXIN ENERGY CORP -H	华电福新	816 HK	香港联合交易所	中国香港	14,000	17,610.79	0.10
244	SINOPEC KANTONS HOLDINGS	中石化冠德	934 HK	香港联合交	中国香港	6,000	17,258.93	0.10



				易所				
245	CHINA TRAVEL INTL INV HK	香港中旅	308 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	12,000	17,100.59	0.10
246	NETDRAGON WEBSOFT HOLDINGS L	网龙	777 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	1,000	16,959.84	0.10
247	CHINA DONGXIANG GROUP CO	中国动向	3818 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	20,000	16,889.47	0.10
248	MEITU INC	美图公司	1357 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	7,500	16,625.57	0.10
249	TCL ELECTRONICS HOLDINGS LTD	T C L 多媒体	1070 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	5,000	16,581.59	0.10
250	DYNAM JAPAN HOLDINGS CO LTD	DYNAM JAPAN	6889 HK	香港 联合 交易 所	中 国 香 港	1,800	16,403.90	0.10
251	CMBC CAPITAL	天顺证券	1141	香	中国	90,000	15,754.71	0.09

	HOLDINGS LTD		HK	香港 联合交易所	香港			
252	RED STAR MACALLINE GROUP C-H	红星美凯龙	1528 HK	香港 联合交易所	中国 香港	2,600	15,643.87	0.09
253	CHINA MACHINERY ENGINEERIN-H	中国机械工程	1829 HK	香港 联合交易所	中 国香港	5,000	15,482.02	0.09
254	DIGITAL CHINA HOLDINGS LTD	神州控股	861 HK	香港 联合交易所	中国 香港	4,000	15,446.83	0.09
255	JIANGXI BANK CO LTD-H	江西银行	1916 HK	香港 联合交易所	中国 香港	3,500	15,363.26	0.09
256	LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-H	丽珠医药	1513 HK	香港 联合交易所	中国 香港	666	15,232.19	0.09
257	CENTRAL CHINA REAL ESTATE	建业地产	832 HK	香港 联合交易所	中国 香港	5,000	15,174.14	0.09

				交易所				
258	SKYFAME REALTY HOLDINGS LTD	天誉置业	59 HK	香港联合交易所	中国香港	14,000	15,147.75	0.09
259	WEST CHINA CEMENT LTD	西部水泥	2233 HK	香港联合交易所	中国香港	14,000	14,778.29	0.09
260	THE UNITED LABORATORIES INTE	联邦制药	3933 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	14,743.10	0.09
261	BEIJING CAPITAL LAND LTD-H	首创置业	2868 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	14,725.51	0.09
262	WISDOM EDUCATION INTERNATION	睿见教育	6068 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	14,602.36	0.08
263	WISE TALENT INFORMATION TECH	有才天下猎聘	6100 HK	香港联合交易所	中国香港	800	14,567.17	0.08

264	FIH MOBILE LTD	富智康集团	2038 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	19,000	14,540.78	0.08
265	LVGEM CHINA REAL ESTATE INVE	绿景中国地产	95 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	6,000	14,514.39	0.08
266	HUABAO INTERNATIONAL HOLDING	华宝国际	336 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	5,000	14,514.39	0.08
267	BEIJING JINGNENG CLEAN ENE-H	京能清洁能源	579 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	12,000	14,250.49	0.08
268	BANK OF CHONGQING CO LTD-H	重庆银行	1963 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	3,500	14,193.31	0.08
269	CONSUN PHARMACEUTICAL GROUP	康臣药业	1681 HK	香港 联合 交易所	中 国 香 港	3,000	14,118.54	0.08
270	YANGTZE OPTICAL FIBRE AND-H	长飞光纤	6869 HK	香港 联	中 国 香 港	1,000	14,021.78	0.08

				合交易所				
271	CHINA HIGH SPEED TRANSMISSIO	中国高速传动	658 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	13,458.80	0.08
272	BEIJING ENTERPRISES CLEAN EN	北控清洁能源集团	1250 HK	香港联合交易所	中国香港	140,000	13,423.61	0.08
273	ESPRIT HOLDINGS LTD	思捷环球	330 HK	香港联合交易所	中国香港	10,200	13,369.07	0.08
274	CHINA GOLD INTERNATIONAL RES	中国黄金国际	2099 HK	香港联合交易所	中国香港	1,500	13,274.07	0.08
275	YADEA GROUP HOLDINGS LTD	雅迪控股	1585 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	13,142.12	0.08
276	SMARTONE TELECOMMUNICATIONS	数码通电讯	315 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	13,089.34	0.08

				所				
277	HUTCHISON TELECOMM HONG KONG	和记电讯香港	215 HK	香港 联合 交易 所	中 国 香 港	8,000	12,948.60	0.08
278	CANVEST ENVIRONMENTAL PROTEC	粤丰环保	1381 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	4,000	12,878.22	0.07
279	CAMSING INTERNATIONAL HOLDIN	奕达	2662 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	2,000	12,631.92	0.07
280	CHINA LILANG LTD	中国利郎	1234 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	2,000	12,631.92	0.07
281	JNBY DESIGN LTD	江南布衣	3306 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	1,000	12,596.73	0.07
282	CHINA SHINEWAY PHARMACEUTICA	神威药业	2877 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	2,000	12,455.99	0.07
283	SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	三一国际	631 HK	香 港	中 国 香 港	5,000	12,403.21	0.07

				联合交易所	港			
284	CITYCHAMP WATCH & JEWELLERY	冠城钟表珠宝	256 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	12,385.61	0.07
285	BEIJING TONG REN TANG CHINES	同仁堂国药	8138 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	12,332.83	0.07
286	ZHUGUANG HOLDINGS GROUP CO	珠光控股	1176 HK	香港联合交易所	中国香港	12,000	12,139.31	0.07
287	CSSC OFFSHORE & MARINE ENG-H	中船防务	317 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	11,980.97	0.07
288	CHINA POWER CLEAN ENERGY DEV	中国电力新能源	735 HK	香港联合交易所	中国香港	2,500	11,831.43	0.07
289	FAIRWOOD HOLDINGS LTD	大快活	52 HK	香港联合交	中国香港	500	11,831.43	0.07

				易所				
290	TRULY INTERNATIONAL HOLDINGS	信利国际	732 HK	香港联合交易所	中国香港	12,000	11,822.63	0.07
291	SA SA INTERNATIONAL HLDGS	莎莎国际	178 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	11,822.63	0.07
292	IMAX CHINA HOLDING INC	IMAX CHINA	1970 HK	香港联合交易所	中国香港	700	11,785.68	0.07
293	XINGDA INT'L HOLDINGS	兴达国际	1899 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	11,611.51	0.07
294	TEXHONG TEXTILE GROUP LTD	天虹纺织	2678 HK	香港联合交易所	中国香港	1,500	11,545.54	0.07
295	DAH CHONG HONG	大昌行集团	1828 HK	香港联合交易所	中国香港	5,000	11,479.56	0.07
296	COFCO MEAT HOLDINGS	中粮肉食	1610	香	中国	5,000	11,435.58	0.07



	LTD		HK	香港 联合交易所	香港			
297	CHINA FOODS LTD	中国食品	506 HK	香港 联合交易所	中国 香港	4,000	11,400.39	0.07
298	GRAND BAOXIN AUTO GROUP LTD	宝信汽车	1293 HK	香港 联合交易所	中国 香港	4,000	11,330.02	0.07
299	FANTASIA HOLDINGS GROUP CO	花样年控股	1777 HK	香港 联合交易所	中国 香港	9,000	11,321.22	0.07
300	SHANGHAI JIN JIANG INTL HO-H	锦江酒店	2006 HK	香港 联合交易所	中国 香港	8,000	11,189.28	0.06
301	PAX GLOBAL TECHNOLOGY LTD	百富环球	327 HK	香港 联合交易所	中国 香港	4,000	11,189.28	0.06
302	GREENLAND HONG KONG HOLDINGS	绿地香港	337 HK	香港 联合交易所	中国 香港	4,000	10,942.97	0.06

				交易所				
303	CITIC RESOURCES HOLDINGS LTD	中信资源	1205 HK	香港联合交易所	中国香港	20,000	10,907.78	0.06
304	CHINA AIRCRAFT LEASING GROUP	中国飞机租赁	1848 HK	香港联合交易所	中国香港	1,500	10,885.79	0.06
305	YIXIN GROUP LTD	易鑫集团	2858 HK	香港联合交易所	中国香港	6,500	10,692.27	0.06
306	CRYSTAL INTERNATIONAL GROUP	晶苑国际	2232 HK	香港联合交易所	中国香港	3,500	10,683.47	0.06
307	JINCHUAN GROUP INTERNATIONAL	金川国际	2362 HK	香港联合交易所	中国香港	18,000	10,608.70	0.06
308	TONGDA GROUP HOLDINGS LTD	通达集团	698 HK	香港联合交易所	中国香港	20,000	10,555.92	0.06

309	SHANGHAI INDUSTRIAL URBAN DE	上实城市开发	563 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	10,555.92	0.06
310	Q TECHNOLOGY GROUP CO LTD	丘钛科技	1478 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	10,467.95	0.06
311	CHINA HARMONY NEW ENERGY AUT	和谐汽车	3836 HK	香港联合交易所	中国香港	4,500	10,450.36	0.06
312	CHINA INTERNATIONAL MARINE-H	中集集团	2039 HK	香港联合交易所	中国香港	1,500	10,371.19	0.06
313	LEYOU TECHNOLOGIES HOLDINGS	乐游科技控股	1089 HK	香港联合交易所	中国香港	5,000	10,292.02	0.06
314	VPOWER GROUP INTERNATIONAL H	伟能集团	1608 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	9,852.19	0.06
315	GCL NEW ENERGY HOLDINGS LTD	协鑫新能源	451 HK	香港联	中国香港	34,000	8,972.53	0.05

				合交易所				
316	WE SOLUTIONS LTD	力世纪	860 HK	香港联合交易所	中国香港	24,000	8,972.53	0.05
317	SINOFERT HOLDINGS LTD	中化化肥	297 HK	香港联合交易所	中国香港	12,000	8,972.53	0.05
318	REGAL HOTELS INTL HLDGS LTD	REGAL INT'L	78 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	8,620.67	0.05
319	HC GROUP INC	慧聪集团	2280 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	8,418.35	0.05
320	TEXWINCA HOLDINGS LTD	德永佳集团	321 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	8,409.55	0.05
321	CHINA MERCHANTS LAND LTD	招商局置地	978 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	8,022.50	0.05

				所				
322	CHINA NEW HIGHER EDUCATION G	新高教集团	2001 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	8,022.50	0.05
323	REALORD GROUP HOLDINGS LTD	伟禄集团	1196 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	7,987.31	0.05
324	LANDING INTERNATIONAL DEVELO	蓝鼎国际	582 HK	香港联合交易所	中国香港	8,400	7,980.28	0.05
325	HAICHANG OCEAN PARK HOLDINGS	海昌海洋公园	2255 HK	香港联合交易所	中国香港	7,000	7,943.33	0.05
326	GOODBABY INTERNATIONAL HOLDI	好孩子国际	1086 HK	香港联合交易所	中国香港	5,000	7,784.99	0.05
327	CHAOWEI POWER HOLDINGS LTD	超威动力	951 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	7,705.82	0.04
328	C-MER EYE CARE HOLDINGS LTD	希玛眼科	3309 HK	香港	中国香港	2,000	7,688.23	0.04

				联合交易所				
329	COGOBUY GROUP	科通芯城	400 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	7,424.33	0.04
330	CGN NEW ENERGY HOLDINGS CO L	中广核新能源	1811 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	7,248.40	0.04
331	TIANJIN PORT DVLP HLDS LTD	天津港发展	3382 HK	香港联合交易所	中国香港	10,000	7,213.21	0.04
332	LEE'S PHARMACEUTICAL HLDGS	李氏大药厂	950 HK	香港联合交易所	中国香港	1,500	6,927.32	0.04
333	OP FINANCIAL LTD	东英金融投资	1140 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	6,896.53	0.04
334	361 DEGREES INTERNATIONAL	3 6 1 度	1361 HK	香港联合交	中国香港	5,000	6,817.37	0.04

				易所				
335	BEIJING GAS BLUE SKY HOLDING	北京燃气蓝天	6828 HK	香港联合交易所	中国香港	32,000	6,671.34	0.04
336	TIAN GE INTERACTIVE HOLDINGS	天鸽互动	1980 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	6,579.86	0.04
337	CHINA LNG GROUP LTD	中国天然气	931 HK	香港联合交易所	中国香港	12,000	6,333.55	0.04
338	VCREDIT HOLDINGS LTD	维信金科	2003 HK	香港联合交易所	中国香港	800	6,312.44	0.04
339	KUANGCHI SCIENCE LTD	光启科学	439 HK	香港联合交易所	中国香港	14,000	5,911.32	0.03
340	BOCOM INTERNATIONAL HOLDINGS	交银国际	3329 HK	香港联合交易所	中国香港	5,000	5,805.76	0.03
341	CHINA VAST	中国宏泰发展	6166	香	中国	2,000	5,717.79	0.03

	INDUSTRIAL URBAN		HK	香港 联合交易所	香港			
342	BRIGHT SMART SECURITIES AND	耀才证券金融	1428 HK	香港 联合交易所	中国香港	4,000	5,559.45	0.03
343	HUAYI TENCENT ENTERTAINMENT	华谊腾讯娱乐	419 HK	香港 联合交易所	中国香港	40,000	5,524.26	0.03
344	CPMC HOLDINGS LTD	中粮包装	906 HK	香港 联合交易所	中国香港	2,000	5,348.33	0.03
345	MINSHENG EDUCATION GROUP CO	民生教育	1569 HK	香港 联合交易所	中国香港	4,000	5,207.59	0.03
346	WASION HOLDINGS LTD	威胜集团	3393 HK	香港 联合交易所	中国香港	2,000	5,031.66	0.03
347	DINGYI GROUP INVESTMENT LTD	鼎亿集团投资	508 HK	香港 联合交易所	中国香港	15,000	4,882.11	0.03



				交易所				
348	CT ENVIRONMENTAL GROUP LTD	中滔环保	1363 HK	香港联合交易所	中国香港	16,000	4,785.35	0.03
349	COLOUR LIFE SERVICES GROUP	彩生活	1778 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	4,583.03	0.03
350	PANDA GREEN ENERGY GROUP LTD	熊猫绿能	686 HK	香港联合交易所	中国香港	18,000	3,578.46	0.02
351	GLOBAL BRANDS GROUP HOLDING	利标品牌	787 HK	香港联合交易所	中国香港	4,200	2,586.20	0.02
352	HONG KONG INTERNATIONAL CONS	香港国际建投	687 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	2,392.68	0.01
353	FDG ELECTRIC VEHICLES LTD	五龙电动车	729 HK	香港联合交易所	中国香港	80,000	2,111.18	0.01

354	FREEMAN FINTECH CORP LTD	民众金融科技	279 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	10,000	1,653.76	0.01
355	GROUND INTERNATIONAL DEVELOP	广泽国际发展	989 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	10,000	1,565.79	0.01
356	CHIHO ENVIRONMENTAL GROUP LT	齐合天地	976 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	2,000	1,548.20	0.01
357	CARNIVAL GROUP INTERNATIONAL	嘉年华国际	996 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	50,000	1,055.59	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称 (中文)	证券 代码	所在 证券 市场	所属 国家 (地区)	数量 (股)	公允价值	占基金资 产净值比 例(%)
1	COOLPAD GROUP LTD	酷派集团	2369 HK	香港 联合 交易所	中 国 香 港	164,000	103,870.25	0.60
2	TOWN HEALTH INTERNATIONAL ME	康健国际医 疗	3886 HK	香港 联合 交易所	中 国 香 港	110,000	66,766.19	0.39
3	NATIONAL AGRICULTURAL	国农控股	1236 HK	香港 联合 交易所	中 国 香 港	46,000	48,152.59	0.28

	HOLDIN			交易所	港			
4	CONVOY GLOBAL HOLDINGS LTD	康宏环球	1019 HK	香港联合交易所	中国香港	270,000	39,663.87	0.23
5	SMI HOLDINGS GROUP LTD	星美控股	198 HK	香港联合交易所	中国香港	8,800	18,113.96	0.11
6	CHINA HUIYUAN JUICE GROUP	汇源果汁	1886 HK	香港联合交易所	中国香港	10,000	17,769.13	0.10
7	MAOYAN ENTERTAINMENT	猫眼娱乐	1896 HK	香港联合交易所	中国香港	1,400	15,862.03	0.09
8	TENWOW INTERNATIONAL HOLDING	天喔国际	1219 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	2,674.17	0.02
9	CWT INTERNATIONAL LTD	CWT INT'L	521 HK	香港联合交易所	中国香港	20,000	2,322.30	0.01
10	CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	辉山乳业	6863 HK	香港联合交易所	中国香港	212,000	1,864.88	0.01
11	CHINA DING YI FENG HOLDINGS	中国鼎益丰	612 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	0.70	0.00

## 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	CHINA TOWER CORP LTD-H	788 HK	447,318.69	2.14
2	CHINA COMMUNICATIONS	1800 HK	159,632.96	0.77

	CONST-H			
3	TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	780 HK	70,993.48	0.34
4	NAGACORP LTD	3918 HK	63,347.76	0.30
5	E-HOUSE CHINA ENTERPRISE HOL	2048 HK	57,727.18	0.28
6	WUXI APPTec CO LTD-H	2359 HK	52,903.76	0.25
7	CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	1359 HK	47,523.79	0.23
8	HYSAN DEVELOPMENT CO	14 HK	35,642.83	0.17
9	ZHONGYU GAS HOLDINGS LTD	3633 HK	28,232.64	0.14
10	CHINA GRAND PHARMACEUTICAL A	512 HK	26,629.98	0.13
11	CHINA TIAN LUN GAS HOLDINGS	1600 HK	23,946.74	0.11
12	VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	3331 HK	23,726.69	0.11
13	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	6098 HK	15,700.46	0.08
14	MAOYAN ENTERTAINMENT	1896 HK	15,606.99	0.07
15	CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	817 HK	12,625.10	0.06
16	CIMC ENRIC HOLDINGS LTD	3899 HK	10,555.42	0.05
17	AUSNUTRIA DAIRY CORP LTD	1717 HK	7,390.52	0.04
18	FAR EAST HORIZON LTD	3360 HK	6,614.38	0.03
19	CMBC CAPITAL HOLDINGS LTD	1141 HK	5,174.23	0.02
20	HONG KONG INTERNATIONAL CONS	687 HK	3,949.66	0.02

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	ALIBABA HEALTH INFORMATION T	241 HK	195,429.49	0.94

2	HOPEWELL HOLDINGS LTD	54 HK	177,265.51	0.85
3	CHINA TOWER CORP LTD-H	788 HK	130,024.22	0.62
4	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	914 HK	100,510.46	0.48
5	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	586 HK	78,464.51	0.38
6	CHINA VANKE CO LTD-H	2202 HK	74,424.68	0.36
7	HYSAN DEVELOPMENT CO	14 HK	71,254.49	0.34
8	SINOPHARM GROUP CO-H	1099 HK	67,876.79	0.33
9	ORIENT OVERSEAS INTL LTD	316 HK	66,327.38	0.32
10	HAITONG SECURITIES CO LTD-H	6837 HK	63,842.91	0.31
11	VITASOY INTL HOLDINGS LTD	345 HK	63,581.38	0.30
12	BYD CO LTD-H	1211 HK	63,265.40	0.30
13	CITIC SECURITIES CO LTD-H	6030 HK	61,178.38	0.29
14	CRRC CORP LTD - H	1766 HK	59,994.73	0.29
15	TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	168 HK	59,724.81	0.29
16	NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	1336 HK	56,806.97	0.27
17	MINTH GROUP LTD	425 HK	53,004.84	0.25
18	E-HOUSE CHINA ENTERPRISE HOL	2048 HK	51,424.24	0.25
19	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	981 HK	50,589.45	0.24
20	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	390 HK	50,500.63	0.24

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	1,119,749.17
卖出收入（成交）总额	6,432,618.46

注：上述金额均指成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

## 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

无。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

无。

## 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

无。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

无。

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

无。

## 7.11 投资组合报告附注

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

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

### 7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	88,401.56
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	159,292.28
4	应收利息	204.14
5	应收申购款	2,340.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	250,238.76

#### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

#### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

##### 7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	公司名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	2369 HK	酷派集团	103,870.25	0.60	重大事项
2	3886 HK	康健国际医疗	66,766.19	0.39	重大事项
3	1236 HK	国农控股	48,152.59	0.28	重大事项
4	1019 HK	康宏环球	39,663.87	0.23	重大事项
5	198 HK	星美控股	18,113.96	0.11	重大事项

#### 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 (%)
1,224	13,993.26	1,118,049.04	6.53	16,009,695.42	93.47

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	455,702.00	33.91

2	赵何鉴	213,000.00	15.85
3	尹绍波	150,023.00	11.16
4	邓荣	107,775.00	8.02
5	苟晟	92,201.00	6.86
6	丁志松	50,900.00	3.79
7	李小晶	50,002.00	3.72
8	胡臻	29,000.00	2.16
9	游建忠	21,000.00	1.56
10	金爱华	20,300.00	1.51

注：以上数据由中国证券登记结算有限公司提供，持有人为场内持有人。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	0.0089

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发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	22,147,908.51
本报告期基金总申购份额	1,247,648.19
减：本报告期基金总赎回份额	6,267,812.24
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	17,127,744.46

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

无。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 一、基金管理人的重大人事变动

经大成基金管理有限公司第六届董事会第三十三次会议审议通过，自2019年7月6日起，公司总经理由罗登攀变更为谭晓冈。



## 二、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2019 年 1 月，中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。

2019 年 4 月，中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

### 10.4 基金投资策略的改变

无。

### 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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
瑞银证券	2	7,118,378.67	94.25%	5,709.17	94.82%	-
UBS	1	433,988.96	5.75%	312.20	5.18%	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-

东北证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	3	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西藏东财	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-

兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	4	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	3	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-

注：根据中国证监会颁布的《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序。

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

- （一）财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- （二）经营行为规范，内控制度健全，能满足各投资组合运作的保密性要求；
- （三）研究实力较强，能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务；
- （四）具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，有足够的交易和清算能力，满足各投资组合证券交易需要；
- （五）能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；
- （六）相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金交易单元。

本报告期内本基金新增席位：国泰君安。本报告期内本基金退租席位：无。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于提请投资者及时更新已过期身份证件及其他身份基本信息的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2019-06-28
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	中国证监会指定报刊及本公司网站	2019-06-27

	定投业务的公告		
3	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资于科创板股票及相关风险揭示的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2019-06-22
4	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海万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	2019-06-14
5	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加联储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	2019-05-21
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	2019-05-09
7	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	2019-04-26
8	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2019-04-25
9	大成基金管理有限公司关于通过大成钱柜交易实施费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2019-04-25
10	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）2019 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2019-04-19
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	2019-04-17
12	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加江苏江南农村商业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	2019-04-04
13	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）2018 年年度报告及摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2019-03-29
14	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加晋城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	2019-03-28
15	关于提请投资者及时更新已过期身份证件及其他身份基本信息的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2019-03-19
16	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	2019-03-13
17	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	2019-01-29
18	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）2018 年第 4 季度报	中国证监会指定报刊及本公司网站	2019-01-19

	告		
19	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加奕丰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	2019-01-19
20	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及摘要(2018 年 2 期)	中国证监会指定报刊及本公司网站	2019-01-17

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据我司发布的《大成基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第三十三次会议审议通过，自 2019 年 7 月 6 日起，公司总经理由罗登攀变更为谭晓冈。具体详见公司相关公告。

## § 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

2019 年 8 月 27 日