

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

2019 年 12 月 31 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2020 年 4 月 29 日

重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 4 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。

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

本报告期自 2019 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§ 4 管理人报告	8
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合规守信情况的说明	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	11
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 审计报告	14
§ 7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
7.4 报表附注	19
§ 8 投资组合报告	41
8.1 期末基金资产组合情况	41

8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	42
8.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	42
8.4 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.....	43
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	62
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	64
8.7 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.....	64
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	64
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细.....	64
8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	65
8.11 投资组合报告附注.....	65
§ 9 基金份额持有人信息.....	66
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	66
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	66
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	66
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	66
§ 10 开放式基金份额变动.....	67
§ 11 重大事件揭示.....	67
11.1 基金份额持有人大会决议.....	67
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	67
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	68
11.4 基金投资策略的改变.....	68
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	68
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	68
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	68
11.8 其他重大事件.....	70
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	73
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	73
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	73
§ 13 备查文件目录.....	73
13.1 备查文件目录.....	73
13.2 存放地点.....	73
13.3 查阅方式.....	73

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	14,617,901.20 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 $\times$ 95%+人民币活期存款利率（税后） $\times$ 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	吴庆斌	周慕冰

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

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

2.5 信息披露方式

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

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座 普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2019 年	2018 年	2017 年
本期已实现收益	520,204.36	5,560,858.25	9,576,185.89
本期利润	2,074,429.76	-4,703,945.53	18,151,212.76
加权平均基金份额本期利润	0.1179	-0.1401	0.1588
本期加权平均净值利润率	11.81%	-12.66%	15.02%
本期基金份额净值增长率	10.72%	-18.72%	15.67%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
期末可供分配利润	626,432.05	-1,281,313.18	7,320,956.25
期末可供分配基金份额利润	0.0429	-0.0579	0.1225
期末基金资产净值	15,244,333.25	20,866,595.33	69,264,036.82
期末基金份额净值	1.043	0.942	1.159
3.1.3 累计期末指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
基金份额累计净值增长率	4.30%	-5.80%	15.90%

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
过去三个月	8.31%	0.70%	9.85%	0.75%	-1.54%	-0.05%
过去六个月	3.68%	0.86%	2.84%	0.91%	0.84%	-0.05%
过去一年	10.72%	0.98%	11.88%	1.00%	-1.16%	-0.02%
过去三年	4.09%	1.05%	11.42%	1.08%	-7.33%	-0.03%
自基金合同生效起至今	4.30%	1.04%	5.87%	1.08%	-1.57%	-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

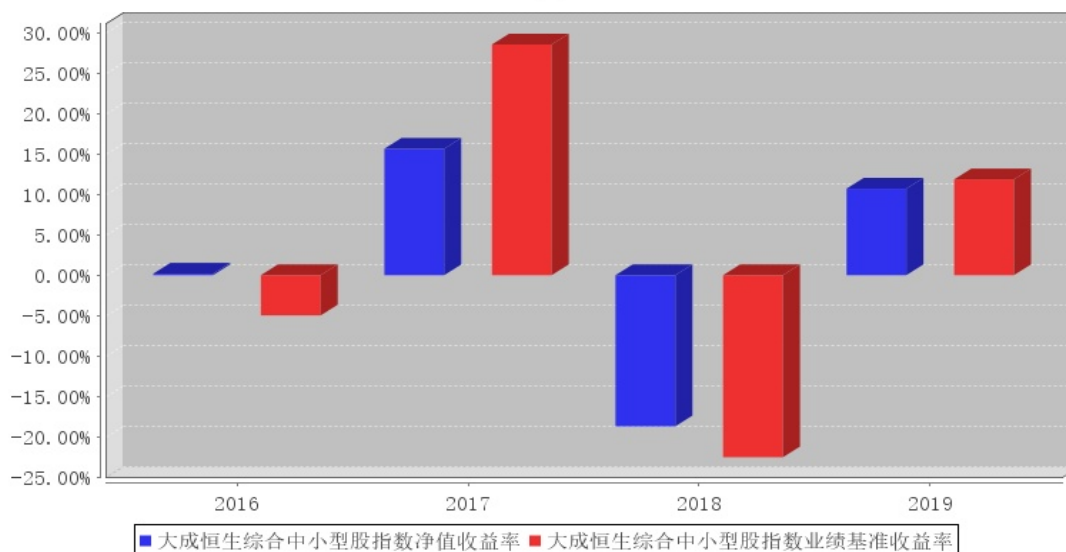
大成恒生综合中小型股指数累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期。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。

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

大成恒生综合中小型股指数基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10号文批准，于1999年4月12日正式成立，是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一，注册资本为2亿元人民币，注册地为深圳。目前公司由三家股东组成，分别为中泰信托有限责任公司(50%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)。公司业务资质齐全，是全国同时具有境内、境外社保基金管理人资格和基本养老保险基金管理人资格的四家基金公司之一，全面涵盖公募基金、机构投资、海外投资、财富管理、养老金管理、私募股权投资等业务，旗下大成国际资产管理公司具备QFII、RQFII以及QFLP等资格。

历经二十年的磨砺和沉淀，大成基金形成了以长期投资能力为核心竞争优势，打造了一支具有良好职业素养和丰富经验的资产管理队伍。目前已形成权益、固定收益、量化投资、商品期货、境外投资、大类资产配置等六大投资团队，全面覆盖各类投资领域。截至2019年12月31日，公司管理公募基金产品数量共91只。

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合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。公司旗下投资组合严格按照制度的规定，参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资管理活动相关的各个环节。研究部负责提供投资研究支持，投资部门负责投资决策，交易管理部负责实施交易并实时监控，监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核，风险管理部负责对交易情况进行合理性分析，通过多部门的协作互控，保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

4.4.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。基金管理人运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合间连续4个季度的日内、3日内及5日内股票及债券交易同向交易价差进行分析。分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；股票同向交易溢价率较大主要来源于市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，即投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别组合间的成交价格差异较大，但结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.4.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易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。

2019 年，从全年来看，港股市场经历了上涨、下跌、上涨的历程。

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，A 股及港股市场在 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。

在 2019 年 4 季度，又出现了一些宏观经济的积极信号，一定程度上影响了市场的预期，使得股票市场走好。这些积极的信号主要有：

首先，宏观数据边际走稳。12 月份公布的多项宏观经济数据表明，宏观经济增速下滑的现象已经暂时得以遏制，尤其是工业利润同比增速由负转正，使得市场对明年的宏观经济预期有所增强，股票市场也因而走强。

其次，中美贸易谈判初见曙光。在 12 月份，中美贸易谈判达成首阶段协议，美国承诺降低部分商品的关税。中美贸易摩擦是近两年世界经济中的最大事件之一，两国之间的一系列谈判和贸易举措对彼此的经济计划产生了重大影响。而中美达成首阶段协议，使得市场对中美经贸磋商前景的乐观情绪得以增强。

此外，香港的治安逐步恢复，这也逐步缓解了对港股的担忧。阿里巴巴集团在香港的成功上市，也更加增强了港股投资者的信心。

在上述因素的影响下，本基金标的指数出现了反弹，并使得指数全年获得了小幅的正收益。

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 1.043 元；本报告期基金份额净值增长率为 10.72%，业绩比较基准收益率为 11.88%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020 年初的新型冠状病毒肺炎疫情，严重影响了一季度甚至上半年的中国宏观经济，因此也短期的影响了资本市场。虽然疫情的演进具有诸多不确定性，但疫情对经济活动的影响是暂时性的，疫情对长期的宏观经济及资本市场影响较小。这主要是因为资本市场反应的是宏观经济的长期的增长前景，而疫情对宏观经济的冲击只是非常短期的一次性事件，因此疫情不会影响资本市场的长期走势。

展望 2020 年下半年，中国下半年政策宽松力度有望加强，中国经济预期会快速复苏，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，因此港股市场的长期展望依然较好。

本基金为被动型指数基金，其投资目标就是要复制指数的收益率。本基金将坚持被动型的指数化投资理念，持续实施高效的组合管理策略、交易策略及风险控制方法，以期更好地跟踪指数，力争将跟踪误差控制在较低的水平。

4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，依据相关的法律法规、基金合同以及内部监察稽核制度，本基金管理人对本基金运作、内部管理、制度执行及遵纪守法情况进行了监察稽核。内部监察稽核的重点是：国家法律法规及行业监管规则的执行情况；基金合同的遵守情况；内部规章制度的执行情况；资讯管制和保密工作落实情况；员工职业操守规范情况，目的是规范基金财产的运作，防范和控制投资风险，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，维护本基金份额持有人的合法权益。

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

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

（三）日常监察和专项监察相结合，确保监察稽核的有效性和深入性。本年度，公司继续对本基金销售、宣传等方面的材料、协议及其他法律资料等进行了严格审查，对本基金各项投资比例、投资权限、基金交易、股票投资限制、股票库维护等方面进行实时监控，同时，还专门针对基金投资交易（包括公平交易、转债投资、投资权限、投资比例、流动性风险、基金重仓股等）、基

金运营（基金头寸、基金结算、登记清算等）、网上交易、基金销售等进行专项监察。通过日常监察，保证了公司监察的全面性、实时性，通过专项监察，及时发现并纠正了业务中的潜在风险，加强了业务部门和人员的风险意识，从而较好地预防了风险的发生。

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

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

4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会，公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由股票投资部、研究部、固定收益总部、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、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。

4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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——大成基金管理有限公司 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）全体基金份额持有人

审计意见	(一)我们审计的内容 我们审计了大成恒生综合中小型股指数证券投资基金(QDII-LOF)(以下简称“大成恒生综合中小型股指数基金”)的财务报表,包括2019年12月31日的资产负债表,2019年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。 (二)我们的意见 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了大成恒生综合中小型股指数基金2019年12月31日的财务状况以及2019年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。 按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于大成恒生综合中小型股指数基金,并履行了职业道德方面的其他责任。
管理层和治理层对财务报表的责任	大成恒生综合中小型股指数基金的基金管理人大成基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估大成恒生综合中小型股指数基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算大成恒生综合中小型股指数基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督大成恒生综合中小型股指数基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作: (一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (二)了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

	（三）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 （四）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对大成恒生综合中小型股指数基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致大成恒生综合中小型股指数基金不能持续经营。 （五）评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	张振波	陈薇瑶
会计师事务所的地址	中国 上海市	
审计报告日期	2020 年 4 月 28 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）

报告截止日：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	984,183.23	1,335,350.56
结算备付金		527,262.06	—
存出保证金		64,163.91	—
交易性金融资产	7.4.7.2	14,303,489.32	19,717,301.51
其中：股票投资		14,303,489.32	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	7.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	—	—
应收证券清算款		—	85,006.09
应收利息	7.4.7.5	301.38	297.58
应收股利		10,848.82	12,192.20

应收申购款		4,371.83	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		15,894,620.55	21,150,147.94
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		318,299.23	3.92
应付赎回款		201,614.37	472.27
应付管理人报酬		12,878.19	18,204.56
应付托管费		3,219.53	4,551.12
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	3,712.31	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	7.4.7.8	110,563.67	260,033.04
负债合计		650,287.30	283,552.61
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	14,617,901.20	22,147,908.51
未分配利润	7.4.7.10	626,432.05	-1,281,313.18
所有者权益合计		15,244,333.25	20,866,595.33
负债和所有者权益总计		15,894,620.55	21,150,147.94

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.043 元，基金份额总额 14,617,901.20 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
一、收入		2,594,654.16	-3,649,400.13
1. 利息收入		7,998.14	19,733.03
其中：存款利息收入	7.4.7.11	7,998.14	19,733.03
债券利息收入		-	-

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,028,351.06	6,593,450.34
其中：股票投资收益	7.4.7.12	596,984.78	5,923,119.06
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	431,366.28	670,331.28
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	1,554,225.40	-10,264,803.78
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		1,098.22	-32,180.90
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	2,981.34	34,401.18
减：二、费用		520,224.40	1,054,545.40
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	176,004.10	371,321.46
2. 托管费	7.4.10.2.2	44,001.00	92,830.31
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.20	30,479.59	107,768.63
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	7.4.7.21	269,739.71	482,625.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,074,429.76	-4,703,945.53
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,074,429.76	-4,703,945.53

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	22,147,908.51	-1,281,313.18	20,866,595.33

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,074,429.76	2,074,429.76
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-7,530,007.31	-166,684.53	-7,696,691.84
其中：1. 基金申购款	2,516,201.75	-17,213.84	2,498,987.91
2. 基金赎回款	-10,046,209.06	-149,470.69	-10,195,679.75
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）	14,617,901.20	626,432.05	15,244,333.25
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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（本期利润）	-	-4,703,945.53	-4,703,945.53
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）	-37,619,340.83	-6,074,155.13	-43,693,495.96
其中：1. 基金申购款	5,055,668.61	626,033.23	5,681,701.84
2. 基金赎回款	-42,675,009.44	-6,700,188.36	-49,375,197.80
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）	22,147,908.51	-1,281,313.18	20,866,595.33

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

大成恒生综合中小型股指数证券投资基金(QDII-LOF) (以下简称“本基金”) 经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”) 证监许可[2015]第 2047 号《关于准予大成恒生综合中小

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

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

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

本财务报表由本基金的基金管理人大成基金管理有限公司于 2020 年 4 月 28 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券

投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2019 年 12 月 31 日，本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告计划继续长期运作本基金，故本财务报表仍以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

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

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

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基

金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认

金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

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

7.4.4.13 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的市净率法、市盈率法等估值技术进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通

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

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对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) 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附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
活期存款	984,183.23	1,335,350.56
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	984,183.23	1,335,350.56

注：于本期末，活期存款中包括的外币余额为港币活期存款 451,776.54 元，折合人民币

404,692.39 元(上年度末：活期存款中包括的外币余额为港币活期存款 50,895.95 元，折合人民币 44,595.03 元)。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	14,840,412.52	14,303,489.32	-536,923.20
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	14,840,412.52	14,303,489.32	-536,923.20
项目	上年度末 2018 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	21,808,450.11	19,717,301.51	-2,091,148.60
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	21,808,450.11	19,717,301.51	-2,091,148.60

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	253.92	297.58
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	47.46	-
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	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	-	-
合计	301.38	297.58

7.4.7.6 其他资产

无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	3,712.31	287.70
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	3,712.31	287.70

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应付赎回费	532.42	1.79

预提费用	90,000.00	240,000.00
应付指数使用费	20,031.25	20,031.25
合计	110,563.67	260,033.04

7.4.7.9 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 12 月 31 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	2,516,201.75	2,516,201.75
本期赎回（以“-”号填列）	-10,046,209.06	-10,046,209.06
本期末	14,617,901.20	14,617,901.20

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. 截至本期末，本基金于深交所上市的基金份额为 1,313,857.00 份(上年度末：1,439,500.00 份)，托管在场外未上市交易的基金份额为 13,304,044.20 份(上年度末：20,708,408.51 份)。

上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

7.4.7.10 未分配利润

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	520,204.36	1,554,225.40	2,074,429.76
本期基金份额交易产生的变动数	-2,355,655.53	2,188,971.00	-166,684.53
其中：基金申购款	795,163.36	-812,377.20	-17,213.84
基金赎回款	-3,150,818.89	3,001,348.20	-149,470.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,982,378.18	-4,355,946.13	626,432.05

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	7,320.34	16,565.81
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	651.37	2,858.70
其他	26.43	308.52
合计	7,998.14	19,733.03

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。

7.4.7.12 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	10,599,444.37	45,329,686.93
减：卖出股票成本总额	10,002,459.59	39,406,567.87
买卖股票差价收入	596,984.78	5,923,119.06

7.4.7.13 债券投资收益

无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

无。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	431,366.28	670,331.28
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	431,366.28	670,331.28

7.4.7.17 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	1,554,225.40	-10,264,803.78
股票投资	1,554,225.40	-10,264,803.78
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	1,554,225.40	-10,264,803.78

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月 31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018 年12月31日
基金赎回费收入	2,981.34	34,401.18
合计	2,981.34	34,401.18

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

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12 月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
交易所市场交易费用	30,479.59	107,768.63
银行间市场交易费用	-	-
合计	30,479.59	107,768.63

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12 月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
审计费用	40,000.00	40,000.00
信息披露费	50,000.00	300,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	116,838.50	80,125.00
上市费	60,000.00	60,000.00
银行费用	2,901.21	2,500.00
合计	269,739.71	482,625.00

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。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**7.4.8.1 或有事项**

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据本基金的基金管理人大成基金管理有限公司于 2020 年 2 月 29 日发布的《关于大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）增设 C 类基金份额并相应修订基金合同和托管协议的公告》以及更新的《大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）基金合同》的有关规定，自 2020 年 3 月 3 日起，本基金增设 C 类基金份额，原有基金份额全部自动转换为 A 类基金份额。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司(大成基金)	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(中国农业银行)	基金托管人、基金销售机构
摩根大通银行(摩根大通银行)	境外资产托管人
中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东
中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东
光大证券股份有限公司(光大证券)	基金管理人的股东、基金销售机构
大成国际资产管理有限公司(大成国际)	基金管理人的子公司
大成创新资本管理有限公司(大成创新资本)	基金管理人的合营企业

注：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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**

无。

7.4.10.2 关联方报酬**7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	176,004.10	371,321.46
其中：支付销售机构的客户维护费	77,623.38	118,235.76

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

日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 1.00% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	44,001.00	92,830.31

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：

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	579,493.88	7,320.34	1,290,758.50	16,565.81
摩根大通银行	404,689.35	-	44,592.06	-

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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末(2019 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
3886.HK	康健国际医疗	2017-11-27	重大事项	0.62	未知	未知	110,000	122,662.27	67,792.63	-
1019.HK	康宏环球	2017-12-08	重大事项	0.15	未知	未知	270,000	50,157.33	40,390.72	-
0198.HK	星美控股	2018-09-03	重大事项	2.10	未知	未知	8,800	27,579.69	18,445.90	-
1886.HK	汇源果汁	2018-04-03	重大事项	1.81	未知	未知	10,000	23,658.22	18,094.76	1
1828.HK	大昌行集团	2019-12-24	重大事项	3.30	不适用	不适用	4,000	10,955.86	13,185.88	2
1363.HK	中滔环保	2019-04-01	重大事项	0.30	未知	未知	16,000	22,603.95	4,873.04	-
1219.HK	天喔国际	2018-08-13	重大事项	0.34	未知	未知	8,000	12,153.81	2,723.17	-
2662.HK	承兴国际控股	2019-07-19	重大事项	1.04	未知	未知	2,000	11,395.92	2,078.21	-
6863.HK	辉山	2017-03-27	已退市	0.01	不适用	不适用	212,000	538,969.89	1,899.05	3

	乳业									
1236. HK	国农控股	2017-03-28	已退市	0.02	不适用	不适用	46,000	71,262.08	1,065.17	4
0279. HK	民众金融科技	2019-12-02	重大事项	0.09	2020-01-13	0.08	4,000	17,417.47	369.06	-
0612. HK	中国鼎益丰	2019-03-08	重大事项	0.00	2020-01-23	6.67	8,000	117,816.39	0.72	-

注:1. 根据中国汇源果汁集团有限公司(1886. HK, 以下简称“公司”)于2020年2月14日发布的《上市委员会取消上市地位的决定》的通告, 由于公司证券于香港联合交易所(以下简称“联交所”)的买卖已自2018年4月3日起暂停, 且公司无法于2020年1月31日前履行复牌条件及于联交所恢复证券买卖, 联交所上市委员会决定取消公司的上市地位。如公司决定不根据上市规则申请将除牌决定提呈至联交所上市覆核委员会覆核, 公司股份的最后上市日期为2020年2月28日, 公司股份的上市地位将自2020年3月2日上午9时起取消。

2. 根据大昌行集团有限公司(1828. HK)于2020年1月9日发布的撤回上市地位通告, 大昌行集团有限公司的上市地位将于2020年1月9日办公时间结束后撤回。

3. 根据香港联合交易所有限公司于2019年12月18日发布的《关于中国辉山乳业控股有限公司取消上市地位》的通告, 由2019年12月23日上午9时起, 中国辉山乳业控股有限公司的上市地位将根据除牌程序予以取消。

4. 根据香港联合交易所有限公司于2019年11月20日发布的《关于国农控股有限公司取消上市地位》的通告, 由2019年11月22日上午9时起, 国农控股有限公司的上市地位将根据除牌程序予以取消。

5. 除上述股票外, 本基金截至本期末止持有因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票, 该类股票将在所公布事项的重大影响消除后, 经交易所批准复牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国农业银行及境外次托管人摩根大通银行，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)。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 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	579,493.88	-	-	404,689.35	984,183.23
结算备付金	527,262.06	-	-	-	527,262.06
存出保证金	64,163.91	-	-	-	64,163.91
交易性金融资产	-	-	-	14,303,489.32	14,303,489.32
应收利息	-	-	-	301.38	301.38
应收股利	-	-	-	10,848.82	10,848.82
应收申购款	-	-	-	4,371.83	4,371.83
资产总计	1,170,919.85	-	-	14,723,700.70	15,894,620.55
负债					
应付赎回款	-	-	-	201,614.37	201,614.37
应付管理人报酬	-	-	-	12,878.19	12,878.19
应付托管费	-	-	-	3,219.53	3,219.53
应付证券清算款	-	-	-	318,299.23	318,299.23
应付交易费用	-	-	-	3,712.31	3,712.31
其他负债	-	-	-	110,563.67	110,563.67
负债总计	-	-	-	650,287.30	650,287.30
利率敏感度缺口	1,170,919.85	-	-	14,073,413.40	15,244,333.25
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。

7.4.13.4.1.2 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）。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	404,692.39	-	404,692.39
交易性金融资产	-	14,303,489.32	-	14,303,489.32
应收股利	-	696.56	-	696.56
资产合计	-	14,708,878.27	-	14,708,878.27
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	-	14,708,878.27	-	14,708,878.27
项目	上年度末			

	2018 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	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

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除港币以外的其他市场变量保持不变		
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 12 月 31 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）	
分析	港币相对人民币升值 5%	740,000.00	990,000.00
	港币相对人民币贬值 5%	-740,000.00	-990,000.00

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%，投资于以标的指数为跟踪标的的公募基金、上市交易型基金、结构性产品的比例不超过基金资产净值的 10%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳

的交易保证金后，保持现金(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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 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	14,303,489.32	93.83	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	14,303,489.32	93.83	19,717,301.51	94.49

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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 12 月 31 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准上升 5%	670,000.00	1,000,000.00
	业绩比较基准下降 5%	-670,000.00	-1,000,000.00

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 14,132,571.01 元，属于第二层次的余额为 13,554.04 元，属于第三层次的余额为 157,363.37 元(上年度末：第一层次 19,343,442.73 元，第二层次 373,858.78 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

上述第三层次资产变动如下：

	交易性金融资产
	股票投资
2019 年 1 月 1 日	-
购买	-
出售	-
转入第三层次	157,288.97
转出第三层次	-
当期利得或损失总额	74.40
计入损益的利得或损失	74.40
2019 年 12 月 31 日	157,363.37
2019 年 12 月 31 日仍持有的资产计入 2019 年度损益的未实现利得或损失的变动(从转入第三层次起算)	
——公允价值变动损益	74.40

计入损益的利得或损失计入利润表中的公允价值变动损益项目。

使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的相关信息如下：

	2019 年 12 月 31 日公允 价值	估值技术	名称	不可观察输入值	
				范围/加权 平均值	与公允价值 之间的关系
交易性金融资产——					
股票投资	1,065.17	市场法	市净率	0.1	正相关

于 2019 年 12 月 31 日，除上述使用重要不可观察输入值的第三层次资产以外，本基金其余第三层次交易性金融资产使用净资产法和最新一轮价格法确定。

于上年度可比期间，本基金无第三层次资产变动。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	14,303,489.32	89.99
	其中：普通股	14,303,489.32	89.99
	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	1,511,445.29	9.51
8	其他各项资产	79,685.94	0.50
9	合计	15,894,620.55	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 12,237,439.06 元，占期末基金资产净值的比例为 80.28%。

8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
中国香港	14,303,489.32	93.83
合计	14,303,489.32	93.83

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

8.3.1 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（%）
原材料	1,555,762.04	10.21
医疗保健	357,858.76	2.35
信息技术	2,182,876.08	14.32
通信服务	290,877.66	1.91
日常消费品	534,398.17	3.51
能源	2,296,898.20	15.07
金融	2,472,020.47	16.22
公用事业	554,205.66	3.64
工业	1,341,458.30	8.8
非日常生活消费品	1,212,728.91	7.96
房地产	1,311,714.83	8.6
合计	14,110,799.08	92.56

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

8.3.2 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（%）
原材料	40,760.50	0.27
医疗保健	18,445.90	0.12
信息技术	19,407.07	0.13
通信服务	0.00	0.00
日常消费品	0.00	0.00
能源	13,185.88	0.09
金融	7,237.90	0.05
公用事业	22,716.98	0.15

工业	3,143.38	0.02
非日常生活消费品	67,792.63	0.44
房地产	0.00	0.00
合计	192,690.24	1.26

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

8.4 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

8.4.1 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	香港联合交易所	中国香港	6,000	305,281.82	2.00
2	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	海螺创业	586 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	243,652.16	1.60
3	CHINA VANKE CO LTD-H	万科	2202 HK	香港联合交易所	中国香港	7,100	211,471.26	1.39
4	LI NING CO LTD	李宁	2331 HK	香港联合交易所	中国香港	10,000	209,164.63	1.37
5	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	中芯国际	981 HK	深港通联合市场	中国香港	16,000	171,129.81	1.12
6	CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	中国金茂	817 HK	香港联合交易所	中国香港	30,000	163,121.54	1.07
7	CITIC SECURITIES CO LTD-H	中信证券	6030 HK	深港通联合市场	中国香港	9,500	151,306.20	0.99
8	SINOPHARM GROUP CO-H	国药控股	1099 HK	深港通联合市场	中国香港	5,600	142,715.67	0.94
9	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	碧桂园服务	6098 HK	深港通联合市场	中国香港	6,000	141,085.35	0.93
10	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	中国建材	3323 HK	深港通联合市场	中国香港	18,000	140,279.15	0.92
11	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	ASM PACIFIC	522 HK	香港联合交易所	中国香港	1,400	135,567.35	0.89
12	WEICHAI POWER CO LTD-H	潍柴动力	2338 HK	深港通联合市场	中国香港	9,000	132,539.61	0.87
13	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	信义光能	968 HK	深港通联合市场	中国香港	26,000	128,795.25	0.84
14	HAITONG SECURITIES CO LTD-H	海通证券	6837 HK	深港通联合市场	中国香港	15,200	125,402.03	0.82

15	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	中国交通建设	1800 HK	深港通联合市场	中国香港	22,000	125,140.47	0.82
16	NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	新华保险	1336 HK	深港通联合市场	中国香港	4,100	123,035.38	0.81
17	YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	颐海国际	1579 HK	深港通联合市场	中国香港	3,000	122,811.44	0.81
18	PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	中国人民保险集团	1339 HK	深港通联合市场	中国香港	41,000	118,995.42	0.78
19	SAMSONITE INTERNATIONAL SA	新秀丽	1910 HK	香港联合交易所	中国香港	7,000	117,257.60	0.77
20	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	广汽集团	2238 HK	深港通联合市场	中国香港	13,200	114,695.67	0.75
21	CRRC CORP LTD - H	中国中车	1766 HK	深港通联合市场	中国香港	21,000	106,848.64	0.70
22	CHINA RESOURCES CEMENT	华润水泥控股	1313 HK	深港通联合市场	中国香港	12,000	106,633.65	0.70
23	CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	旭辉控股集团	884 HK	深港通联合市场	中国香港	18,000	106,257.42	0.70
24	BYD CO LTD-H	比亚迪股份	1211 HK	深港通联合市场	中国香港	3,000	104,403.16	0.68
25	VITASOY INTL HOLDINGS LTD	VITASOY INTL	345 HK	深港通联合市场	中国香港	4,000	101,223.14	0.66
26	SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	威高股份	1066 HK	深港通联合市场	中国香港	12,000	100,399.02	0.66
27	HUATAI SECURITIES CO LTD-H	HTSC	6886 HK	深港通联合市场	中国香港	8,000	98,750.79	0.65
28	MINTH GROUP LTD	敏实集团	425 HK	深港通联合市场	中国香港	4,000	98,535.80	0.65
29	NAGACORP LTD	金界控股	3918 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	97,460.86	0.64
30	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	紫金矿业	2899 HK	深港通联合市场	中国香港	28,000	97,317.54	0.64
31	CGN POWER CO LTD-H	中广核电力	1816 HK	深港通联合市场	中国香港	52,000	96,887.56	0.64
32	CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	中金公司	3908 HK	深港通联合市场	中国香港	7,200	96,873.23	0.64
33	TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	青岛啤酒股份	168 HK	深港通联合市场	中国香港	2,000	93,788.17	0.62

34	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	信义玻璃	868 HK	深港通联合市场	中国香港	10,000	92,444.50	0.61
35	DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	东风集团股份	489 HK	深港通联合市场	中国香港	14,000	91,924.94	0.60
36	PING AN HEALTHCARE AND TECHN	银泰商业	1833 HK	深港通联合市场	中国香港	1,800	91,665.17	0.60
37	FAR EAST HORIZON LTD	远东宏信	3360 HK	深港通联合市场	中国香港	14,000	91,548.72	0.60
38	CHINA OILFIELD SERVICES-H	中海油田服务	2883 HK	深港通联合市场	中国香港	8,000	87,571.45	0.57
39	PCCW LTD	电讯盈科	8 HK	深港通联合市场	中国香港	21,000	86,720.46	0.57
40	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	中国中铁	390 HK	深港通联合市场	中国香港	20,000	86,174.04	0.57
41	AGILE GROUP HOLDINGS LTD	雅居乐集团	3383 HK	深港通联合市场	中国香港	8,000	83,988.33	0.55
42	HYSAN DEVELOPMENT CO	希慎兴业	14 HK	深港通联合市场	中国香港	3,000	82,098.24	0.54
43	ZTE CORP-H	中兴通讯	763 HK	深港通联合市场	中国香港	3,800	81,184.54	0.53
44	CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	中国光大银行	6818 HK	深港通联合市场	中国香港	25,000	81,068.09	0.53
45	KINGBOARD HOLDINGS LTD	建滔化工	148 HK	深港通联合市场	中国香港	3,500	77,440.18	0.51
46	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	长城汽车	2333 HK	深港通联合市场	中国香港	15,000	77,395.39	0.51
47	KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	金蝶国际	268 HK	深港通联合市场	中国香港	11,000	76,759.39	0.50
48	SHENZHEN INTL HOLDINGS	深圳国际	152 HK	深港通联合市场	中国香港	5,000	76,678.77	0.50
49	JINXIN FERTILITY GROUP LTD	锦欣生殖	01951 HS	深港通联合市场	中国香港	8,000	74,672.22	0.49
50	ALIBABA PICTURES GROUP LTD	阿里影业	1060 HK	深港通联合市场	中国香港	60,000	73,633.12	0.48
51	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	中国铁建	1186 HK	深港通联合市场	中国香港	9,500	72,589.53	0.48
52	KINGSOFT CORP LTD	金山软件	3888 HK	深港通联合市场	中国香港	4,000	72,379.02	0.47
53	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	裕元集团	551 HK	深港通联合市场	中国香港	3,500	72,110.29	0.47
54	ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	中升控股	881 HK	深港通联合市场	中国香港	2,500	71,438.46	0.47

55	BOC AVIATION LTD	中银航空 租赁	2588 HK	深港通联 合市场	中国 香港	1,000	70,990.57	0.47
56	AIR CHINA LTD-H	中国国航	753 HK	深港通联 合市场	中国 香港	10,000	70,856.20	0.46
57	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	龙源电力	916 HK	深港通联 合市场	中国 香港	16,000	70,659.13	0.46
58	CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	康哲药业	867 HK	深港通联 合市场	中国 香港	7,000	70,354.56	0.46
59	LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO L	龙光地产	3380 HK	深港通联 合市场	中国 香港	6,000	70,300.81	0.46
60	CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	中国银河	6881 HK	深港通联 合市场	中国 香港	17,000	69,897.71	0.46
61	HANG LUNG GROUP LTD	恒隆集团	10 HK	深港通联 合市场	中国 香港	4,000	69,010.89	0.45
62	KWG GROUP HOLDINGS LTD	合景泰富	1813 HK	深港通联 合市场	中国 香港	7,000	68,473.42	0.45
63	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	中车时代 电气	3898 HK	深港通联 合市场	中国 香港	2,700	68,204.69	0.45
64	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	中国民航 信息网络	696 HK	深港通联 合市场	中国 香港	4,000	68,150.94	0.45
65	FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLD	新城发展 控股	1030 HK	深港通联 合市场	中国 香港	8,000	67,935.96	0.45
66	3SBIO INC	三生制药	1530 HK	深港通联 合市场	中国 香港	7,500	67,855.34	0.45
67	CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	中国信达	1359 HK	深港通联 合市场	中国 香港	42,000	66,592.29	0.44
68	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	玖龙纸业	2689 HK	深港通联 合市场	中国 香港	9,000	65,302.36	0.43
69	HUANENG RENEWABLES CORP-H	华能新能 源	958 HK	深港通联 合市场	中国 香港	24,000	65,141.12	0.43
70	GENSCRIPT BIOTECH CORP	金斯瑞生 物科技	1548 HK	深港通联 合市场	中国 香港	4,000	63,421.22	0.42
71	GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	富力地产	2777 HK	深港通联 合市场	中国 香港	4,800	61,830.32	0.41
72	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	中国通信 服务	552 HK	深港通联 合市场	中国 香港	12,000	61,056.36	0.40
73	WUXI APPTec CO LTD-H	药明康德	2359 HK	深港通联 合市场	中国 香港	700	60,604.00	0.40
74	TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	同程艺龙	780 HK	深港通联 合市场	中国 香港	4,800	60,110.42	0.39
75	SHANGHAI PHARMACEUTICALS-	上海医药	2607 HK	深港通联 合市场	中国 香港	4,400	59,752.11	0.39

	H							
76	MELCO INTERNATIONAL DEVELOP.	新濠国际发展	200 HK	深港通联合市场	中国香港	3,000	58,852.75	0.39
77	GF SECURITIES CO LTD-H	广发证券	1776 HK	深港通联合市场	中国香港	6,800	57,806.47	0.38
78	JIANGXI COPPER CO LTD-H	江西铜业股份	358 HK	深港通联合市场	中国香港	6,000	57,616.57	0.38
79	JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	江苏宁沪高速公路	177 HK	深港通联合市场	中国香港	6,000	57,401.58	0.38
80	FORTUNE REIT	置富产业信托	778 HK	香港联合交易所	中国香港	7,000	56,998.48	0.37
81	CHINA AOYUAN GROUP LTD	中国奥园	3883 HK	香港联合交易所	中国香港	5,000	56,882.03	0.37
82	HUANENG POWER INTL INC-H	华能国际电力股份	902 HK	深港通联合市场	中国香港	16,000	56,469.97	0.37
83	CHINA COAL ENERGY CO-H	中煤能源	1898 HK	深港通联合市场	中国香港	20,000	55,359.20	0.36
84	VTECH HOLDINGS LTD	VTECHHOLDINGS	303 HK	深港通联合市场	中国香港	800	55,180.05	0.36
85	YUEXIU PROPERTY CO LTD	越秀地产	123 HK	深港通联合市场	中国香港	34,000	54,821.74	0.36
86	BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	北京首都机场股份	694 HK	深港通联合市场	中国香港	8,000	54,105.11	0.35
87	CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	中国中药	570 HK	深港通联合市场	中国香港	16,000	53,890.12	0.35
88	UNITED ENERGY GROUP LTD	联合能源集团	467 HK	深港通联合市场	中国香港	38,000	53,782.63	0.35
89	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	比亚迪电子	285 HK	深港通联合市场	中国香港	4,000	53,675.14	0.35
90	SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	复星医药	2196 HK	深港通联合市场	中国香港	2,500	52,627.08	0.35
91	SWIRE PACIFIC LTD-CL B	太古股份公司 B	87 HK	深港通联合市场	中国香港	5,000	52,223.97	0.34
92	CHINA EVERBRIGHT LTD	中国光大控股	165 HK	深港通联合市场	中国香港	4,000	52,170.23	0.34
93	SINOTRUK HONG KONG LTD	中国重汽	3808 HK	深港通联合市场	中国香港	3,500	52,107.52	0.34
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	11,000	52,026.90	0.34
95	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	福耀玻璃	3606 HK	深港通联合市场	中国香港	2,400	51,274.45	0.34
96	SITC	海丰国际	1308	深港通联合市场	中国	6,000	51,059.46	0.33

	INTERNATIONAL HOLDINGS		HK	合市场	香港			
97	HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	海天国际	1882 HK	深港通联合市场	中国香港	3,000	50,736.98	0.33
98	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	中国建筑国际	3311 HK	深港通联合市场	中国香港	8,000	50,736.98	0.33
99	LEGEND HOLDINGS CORP-H	联想控股	3396 HK	深港通联合市场	中国香港	3,200	50,679.65	0.33
100	YANZHOU COAL MINING CO-H	兖州煤业股份	1171 HK	深港通联合市场	中国香港	8,000	50,163.68	0.33
101	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	中国铝业	2600 HK	深港通联合市场	中国香港	20,000	47,834.65	0.31
102	SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	远洋集团	3377 HK	深港通联合市场	中国香港	17,000	47,664.45	0.31
103	KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	建滔积层板	1888 HK	深港通联合市场	中国香港	5,500	47,592.79	0.31
104	CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	中国软件国际	354 HK	深港通联合市场	中国香港	12,000	47,297.18	0.31
105	LUYE PHARMA GROUP LTD	绿叶制药	2186 HK	深港通联合市场	中国香港	9,000	47,082.20	0.31
106	GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	国泰君安	2611 HK	深港通联合市场	中国香港	3,800	46,974.70	0.31
107	HKBN LTD	香港宽频	1310 HK	深港通联合市场	中国香港	4,000	46,795.55	0.31
108	CHAMPION REIT	冠君产业信托	2778 HK	香港联合交易所	中国香港	10,000	46,132.67	0.30
109	GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	绿城服务	2869 HK	深港通联合市场	中国香港	6,000	45,738.53	0.30
110	COSCO SHIPPING PORTS LTD	中远海运港口	1199 HK	深港通联合市场	中国香港	8,000	45,720.61	0.30
111	SSY GROUP LTD	石四药集团	2005 HK	深港通联合市场	中国香港	8,000	45,218.97	0.30
112	ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	正荣地产	6158 HK	深港通联合市场	中国香港	9,000	45,147.31	0.30
113	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	洛阳钼业	3993 HK	深港通联合市场	中国香港	15,000	44,878.58	0.29
114	CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	中国联塑	2128 HK	深港通联合市场	中国香港	5,000	44,744.21	0.29
115	CHINA AGRI-	中国粮油	606 HK	深港通联	中国	12,000	44,394.86	0.29

	INDUSTRIES HLDGS	控股		合市场	香港			
116	UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	统一企业 中国	220 HK	深港通联 合市场	中国 香港	6,000	43,964.88	0.29
117	ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	众安在线	6060 HK	深港通联 合市场	中国 香港	1,700	42,791.41	0.28
118	CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	重庆农村 商业银行	3618 HK	深港通联 合市场	中国 香港	12,000	42,782.45	0.28
119	TIMES CHINA HOLDINGS LTD	时代地产	1233 HK	深港通联 合市场	中国 香港	3,000	41,761.26	0.27
120	CHINA YONGDA AUTOMOBILES SER	永达汽车	3669 HK	深港通联 合市场	中国 香港	6,500	41,340.25	0.27
121	ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	中联重科	1157 HK	深港通联 合市场	中国 香港	7,000	40,946.10	0.27
122	CHINA SCE GROUP HOLDINGS LTD	中骏置业	1966 HK	深港通联 合市场	中国 香港	10,000	40,668.41	0.27
123	BOSIDENG INTL HLDGS LTD	波司登	3998 HK	深港通联 合市场	中国 香港	16,000	40,274.27	0.26
124	LUK FOOK HOLDINGS INTL LTD	六福集团	590 HK	深港通联 合市场	中国 香港	2,000	40,220.52	0.26
125	SHENZHEN EXPRESSWAY CO-H	深圳高速 公路股份	548 HK	深港通联 合市场	中国 香港	4,000	40,059.28	0.26
126	KAISA GROUP HOLDINGS LTD	佳兆业集 团	1638 HK	深港通联 合市场	中国 香港	12,000	39,987.62	0.26
127	CHINA OVERSEAS GRAND OCEANS	中国海外 宏洋集团	81 HK	深港通联 合市场	中国 香港	8,000	38,626.03	0.25
128	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	招金矿业	1818 HK	深港通联 合市场	中国 香港	5,000	38,563.33	0.25
129	ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	浙江沪杭 甬	576 HK	深港通联 合市场	中国 香港	6,000	38,160.23	0.25
130	CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	中国再保 险	1508 HK	深港通联 合市场	中国 香港	33,000	37,837.75	0.25
131	MAN WAH HOLDINGS LTD	敏华控股	1999 HK	深港通联 合市场	中国 香港	7,600	37,784.00	0.25
132	AVICHINA INDUSTRY & TECH- H	中航科工	2357 HK	深港通联 合市场	中国 香港	12,000	37,730.25	0.25
133	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	中国南方 航空股份	1055 HK	深港通联 合市场	中国 香港	8,000	37,551.10	0.25
134	L' OCCITANE INTERNATIONAL SA	L' OCCITA NE	973 HK	香港联合 交易所	中国 香港	2,250	37,206.22	0.24
135	COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	中国远洋	1919 HK	深港通联 合市场	中国 香港	13,000	36,798.64	0.24

136	CHINA EAST EDUCATION HOLDINGS LTD	中国东方 教育	00667 HS	深港通联 合市场	中国 香港	2,500	36,547.82	0.24
137	FU SHOU YUAN INTERNATIONAL	福寿园	1448 HK	深港通联 合市场	中国 香港	6,000	35,472.89	0.23
138	YUZHOU PROPERTIES CO	禹洲地产	1628 HK	深港通联 合市场	中国 香港	9,000	34,586.07	0.23
139	PACIFIC BASIN SHIPPING LTD	太平洋航 运	2343 HK	香港联合 交易所	中国 香港	23,000	33,788.82	0.22
140	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	上海石油 化工股份	338 HK	深港通联 合市场	中国 香港	16,000	33,681.33	0.22
141	SHENZHEN INVESTMENT LTD	深圳控股	604 HK	深港通联 合市场	中国 香港	12,000	33,538.00	0.22
142	XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	金风科技	2208 HK	深港通联 合市场	中国 香港	4,080	33,075.78	0.22
143	CAFE DE CORAL HOLDINGS LTD	大家乐集 团	341 HK	深港通联 合市场	中国 香港	2,000	33,072.20	0.22
144	MICROPORT SCIENTIFIC CORP	微创医疗	853 HK	深港通联 合市场	中国 香港	4,000	33,072.20	0.22
145	CHINA POWER INTERNATIONAL	中国电力	2380 HK	深港通联 合市场	中国 香港	22,000	32,910.96	0.22
146	POWERLONG REAL ESTATE HOLDIN	宝龙地产	1238 HK	深港通联 合市场	中国 香港	7,000	32,606.39	0.21
147	SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	上海电气	2727 HK	深港通联 合市场	中国 香港	14,000	32,104.76	0.21
148	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	华虹半导 体	1347 HK	深港通联 合市场	中国 香港	2,000	31,746.44	0.21
149	JOHNSON ELECTRIC HOLDINGS	德昌电机 控股	179 HK	深港通联 合市场	中国 香港	2,000	31,746.44	0.21
150	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	理文造纸	2314 HK	深港通联 合市场	中国 香港	6,000	31,710.61	0.21
151	BAIC MOTOR CORP LTD-H	北京汽车	1958 HK	深港通联 合市场	中国 香港	8,000	31,674.78	0.21
152	GOME RETAIL HOLDINGS LTD	国美电器	493 HK	深港通联 合市场	中国 香港	49,000	31,603.12	0.21
153	CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	中国东方 航空股份	670 HK	深港通联 合市场	中国 香港	8,000	30,958.16	0.20
154	CHINA GRAND PHARMACEUTICAL A	远大医药	512 HK	深港通联 合市场	中国 香港	8,000	30,384.86	0.20
155	AUSNUTRIA DAIRY CORP LTD	澳优	1717 HK	深港通联 合市场	中国 香港	3,000	30,151.95	0.20

156	KERRY LOGISTICS NETWORK LTD	嘉里物流	636 HK	深港通联合市场	中国香港	2,500	29,963.84	0.20
157	SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	中石化炼化工程	2386 HK	深港通联合市场	中国香港	7,000	29,220.34	0.19
158	GENERTEC UNIVERSAL MEDICAL G	环球医疗	2666 HK	深港通联合市场	中国香港	5,500	29,068.06	0.19
159	RONSHINE CHINA HOLDINGS LTD	融信中国	3301 HK	深港通联合市场	中国香港	3,000	28,969.53	0.19
160	POLY PROPERTY GROUP CO LTD	保利置业集团	119 HK	深港通联合市场	中国香港	10,000	28,933.69	0.19
161	HEALTH AND HAPPINESS H&H INT	合生元	1112 HK	深港通联合市场	中国香港	1,000	28,888.91	0.19
162	FIRST PACIFIC CO	第一太平	142 HK	深港通联合市场	中国香港	12,000	28,485.80	0.19
163	CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	宇华教育	6169 HK	深港通联合市场	中国香港	6,000	28,324.56	0.19
164	HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	合生创展集团	754 HK	深港通联合市场	中国香港	4,000	28,306.65	0.19
165	SOHO CHINA LTD	SOHO 中国	410 HK	深港通联合市场	中国香港	10,500	27,652.73	0.18
166	SHUI ON LAND LTD	瑞安房地产	272 HK	深港通联合市场	中国香港	18,000	27,572.11	0.18
167	XIABUXIABU CATERING MANAGEME	呷哺呷哺	520 HK	深港通联合市场	中国香港	3,000	27,410.87	0.18
168	K WAH INTL HOLDINGS	嘉华国际	173 HK	深港通联合市场	中国香港	7,000	27,276.50	0.18
169	CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	中国通号	3969 HK	深港通联合市场	中国香港	7,000	27,276.50	0.18
170	SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	上海实业控股	363 HK	深港通联合市场	中国香港	2,000	26,873.40	0.18
171	CHINA SOUTH CITY HOLDINGS	华南城	1668 HK	深港通联合市场	中国香港	30,000	26,604.67	0.17
172	SINOTRANS LIMITED-H	中国外运	598 HK	深港通联合市场	中国香港	11,000	26,111.99	0.17
173	GEMDALE PROPERTIES AND INVES	金地商置	535 HK	深港通联合市场	中国香港	28,000	25,834.30	0.17
174	VALUE PARTNERS	惠理集团	806 HK	深港通联	中国	6,000	25,798.46	0.17

	GROUP LTD			合市场	香港			
175	IGG INC	IGG	799 HK	深港通联合市场	中国香港	5,000	25,753.68	0.17
176	GREENTOWN CHINA HOLDINGS	绿城中国	3900 HK	深港通联合市场	中国香港	3,000	25,717.84	0.17
177	NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	耐世特	1316 HK	深港通联合市场	中国香港	4,000	25,296.83	0.17
178	MMG LTD	五矿资源	1208 HK	深港通联合市场	中国香港	12,000	25,153.50	0.17
179	山东黄金	山东黄金	01787 HS	深港通联合市场	中国香港	1,500	24,884.77	0.16
180	YUEXIU TRANSPORT INFRASTRUCT	越秀交通基建	1052 HK	深港通联合市场	中国香港	4,000	24,831.02	0.16
181	ZHONGYU GAS HOLDINGS LTD	中裕燃气	3633 HK	深港通联合市场	中国香港	4,000	24,580.20	0.16
182	FUFENG GROUP LTD	阜丰集团	546 HK	深港通联合市场	中国香港	8,000	24,580.20	0.16
183	LI & FUNG LTD	利丰	494 HK	深港通联合市场	中国香港	32,000	24,365.22	0.16
184	TOWNGAS CHINA CO LTD	港华燃气	1083 HK	深港通联合市场	中国香港	5,000	24,186.06	0.16
185	PACIFIC TEXTILES HOLDINGS	互太纺织	1382 HK	深港通联合市场	中国香港	5,000	23,962.12	0.16
186	YICHANG HEC CHANGJIANG PHA-H	东阳光药	1558 HK	深港通联合市场	中国香港	600	23,782.96	0.16
187	BBMG CORP-H	金隅股份	2009 HK	深港通联合市场	中国香港	11,000	23,550.06	0.15
188	HAITONG INTERNATIONAL SECURI	海通国际（一千）	665 HK	深港通联合市场	中国香港	11,000	23,352.98	0.15
189	DONGYUE GROUP	东岳集团	189 HK	深港通联合市场	中国香港	6,000	23,218.62	0.15
190	Q TECHNOLOGY GROUP CO LTD	丘钛科技	1478 HK	深港通联合市场	中国香港	2,000	23,111.12	0.15
191	CHINA MAPLE LEAF EDUCATIONAL	枫叶教育	1317 HK	深港通联合市场	中国香港	8,000	22,788.64	0.15
192	RAZER INC	雷蛇	1337 HK	香港联合交易所	中国香港	20,000	22,752.81	0.15
193	MAANSHAN IRON & STEEL-H	马鞍山钢铁股份	323 HK	深港通联合市场	中国香港	8,000	22,645.32	0.15
194	ANGANG STEEL CO LTD-H	鞍钢股份	347 HK	深港通联合市场	中国香港	7,800	22,638.15	0.15
195	CHINA ZHONGWANG	中国忠旺	1333	深港通联合市场	中国	8,000	22,287.01	0.15

	HOLDINGS LTD		HK	合市场	香港			
196	XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	特步国际	1368 HK	深港通联合市场	中国香港	6,000	22,251.18	0.15
197	DAH SING FINANCIAL HOLDINGS	大新金融	440 HK	深港通联合市场	中国香港	800	22,000.36	0.14
198	METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	中国中冶	1618 HK	深港通联合市场	中国香港	14,000	21,946.61	0.14
199	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	中海物业	2669 HK	香港联合交易所	中国香港	5,000	21,946.61	0.14
200	FIH MOBILE LTD	富智康集团	2038 HK	深港通联合市场	中国香港	16,000	21,642.04	0.14
201	DATANG INTL POWER GEN CO-H	大唐发电	991 HK	深港通联合市场	中国香港	16,000	21,355.40	0.14
202	微盟集团	微盟集团	02013 HS	深港通联合市场	中国香港	7,000	21,256.86	0.14
203	TIANNENG POWER INTL LTD	天能动力	819 HK	深港通联合市场	中国香港	4,000	21,247.90	0.14
204	HUADIAN POWER INTL CORP-H	华电国际电力股份	1071 HK	深港通联合市场	中国香港	8,000	21,212.07	0.14
205	CSC FINANCIAL CO LTD-H	中信建投证券	6066 HK	深港通联合市场	中国香港	3,500	21,068.75	0.14
206	LONKING HOLDINGS LTD	中国龙工	3339 HK	深港通联合市场	中国香港	10,000	20,961.25	0.14
207	CHINA WATER AFFAIRS GROUP	中国水务	855 HK	深港通联合市场	中国香港	4,000	20,889.59	0.14
208	ASIA CEMENT CHINA HOLDINGS	亚洲水泥（中国）	743 HK	深港通联合市场	中国香港	2,000	20,853.76	0.14
209	TONG REN TANG TECHNOLOGIES-H	同仁堂科技	1666 HK	深港通联合市场	中国香港	3,000	20,585.02	0.14
210	REDCO GROUP	力高地产	1622 HK	深港通联合市场	中国香港	6,000	20,423.78	0.13
211	CITIC TELECOM INTERNATIONAL	中信国际电讯	1883 HK	深港通联合市场	中国香港	8,000	20,352.12	0.13
212	THE UNITED LABORATORIES INTE	联邦制药	3933 HK	深港通联合市场	中国香港	4,000	20,352.12	0.13
213	SKYWORTH DIGITAL HLDGS LTD	创维数码	751 HK	深港通联合市场	中国香港	10,000	20,155.05	0.13
214	SHUN TAK HOLDINGS LTD	信德集团	242 HK	深港通联合市场	中国香港	6,000	19,993.81	0.13
215	ZHOU HEI YA INTERNATIONAL HO	周黑鸭	1458 HK	深港通联合市场	中国香港	4,000	19,922.15	0.13

216	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	中远海能	1138 HK	深港通联合市场	中国香港	6,000	19,778.82	0.13
217	SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	三一国际	631 HK	香港联合交易所	中国香港	5,000	19,080.11	0.13
218	CAR INC	神州租车	699 HK	深港通联合市场	中国香港	4,000	19,062.20	0.13
219	FIT HON TENG LTD	FIT HON TENG	6088 HK	深港通联合市场	中国香港	8,000	18,775.55	0.12
220	LIFETECH SCIENTIFIC CORP	先健科技	1302 HK	深港通联合市场	中国香港	14,000	18,685.97	0.12
221	CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	中教控股	839 HK	深港通联合市场	中国香港	2,000	18,273.91	0.12
222	GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	保利协鑫能源	3800 HK	深港通联合市场	中国香港	69,000	18,233.60	0.12
223	SHOUGANG FUSHAN RESOURCES GR	首钢资源	639 HK	深港通联合市场	中国香港	12,000	18,058.92	0.12
224	GUANGSHEN RAILWAY CO LTD-H	广深铁路股份	525 HK	深港通联合市场	中国香港	8,000	17,915.60	0.12
225	TELEVISION BROADCASTS LTD	电视广播	511 HK	深港通联合市场	中国香港	1,600	17,542.96	0.12
226	DFZQ-H	东方证券	3958 HK	深港通联合市场	中国香港	4,000	17,521.46	0.11
227	SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	四环医药	460 HK	深港通联合市场	中国香港	21,000	17,494.58	0.11
228	TONGDA GROUP HOLDINGS LTD	通达集团	698 HK	深港通联合市场	中国香港	20,000	17,378.13	0.11
229	CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD	中国东方集团	581 HK	深港通联合市场	中国香港	6,000	17,360.22	0.11
230	中烟香港	中烟香港	06055 HS	深港通联合市场	中国香港	1,000	17,181.06	0.11
231	美的置业	美的置业	03990 HS	深港通联合市场	中国香港	800	17,127.31	0.11
232	HUADIAN FUXIN ENERGY CORP -H	华电福新	816 HK	香港联合交易所	中国香港	12,000	17,091.48	0.11
233	希望教育	希望教育	01765 HS	深港通联合市场	中国香港	14,000	16,930.24	0.11
234	申万宏源	申万宏源	06806 HS	深港通联合市场	中国香港	8,000	16,840.66	0.11
235	新东方在线	新东方在线	01797 HS	深港通联合市场	中国香港	1,000	16,661.51	0.11
236	CIMC ENRIC HOLDINGS LTD	中集安瑞科	3899 HK	深港通联合市场	中国香港	4,000	16,661.51	0.11
237	LIVZON	丽珠医药	1513	深港通联	中国	766	16,639.56	0.11

	PHARMACEUTICAL GROU-H		HK	合市场	香港			
238	NETDRAGON WEBSOFT HOLDINGS L	网龙	777 HK	深港通联 合市场	中国 香港	1,000	16,410.69	0.11
239	JIAYUAN INTERNATIONAL GROUP	佳源国际 控股	2768 HK	深港通联 合市场	中国 香港	6,000	16,392.77	0.11
240	PROSPERITY REIT	泓富产业 信托	808 HK	香港联合 交易所	中国 香港	6,000	16,392.77	0.11
241	CENTRAL CHINA REAL ESTATE	建业地产	832 HK	深港通联 合市场	中国 香港	4,000	16,267.36	0.11
242	CHINA RESOURCES MEDICAL HOLD	华润凤凰 医疗	1515 HK	深港通联 合市场	中国 香港	4,000	16,195.70	0.11
243	GUOTAI JUNAN INTERNATIONAL	国泰君安 国际	1788 HK	深港通联 合市场	中国 香港	13,000	16,070.29	0.11
244	LIFESTYLE INTL HLDGS LTD	利福国际	1212 HK	深港通联 合市场	中国 香港	2,000	16,016.55	0.11
245	方达控股	方达控股	01521 HS	深港通联 合市场	中国 香港	4,000	15,837.39	0.10
246	CHINA HARMONY NEW ENERGY AUT	和谐汽车	3836 HK	深港通联 合市场	中国 香港	4,500	15,801.56	0.10
247	CHINA TIAN LUN GAS HOLDINGS	天伦燃气	1600 HK	深港通联 合市场	中国 香港	2,500	15,608.97	0.10
248	MAOYAN ENTERTAINMENT	猫眼娱乐	1896 HK	深港通联 合市场	中国 香港	1,200	15,414.58	0.10
249	CHINA DONGXIANG GROUP CO	中国动向	3818 HK	深港通联 合市场	中国 香港	20,000	15,407.42	0.10
250	CHINA EVERBRIGHT GREENTECH L	中国光大 绿色环保	1257 HK	深港通联 合市场	中国 香港	4,000	15,120.77	0.10
251	COSCO SHIPPING DEVELOPMENT-H	中海集运	2866 HK	深港通联 合市场	中国 香港	18,000	14,834.12	0.10
252	DYNAM JAPAN HOLDINGS CO LTD	DYNAM JAPAN	6889 HK	香港联合 交易所	中国 香港	1,600	14,590.46	0.10
253	VST HOLDINGS LTD	伟仕控股	856 HK	深港通联 合市场	中国 香港	4,000	14,332.48	0.09
254	德信中国	德信中国	02019 HS	深港通联 合市场	中国 香港	5,000	14,242.90	0.09
255	SUN CENTURY GROUP LTD	太阳世纪 集团	1383 HK	深港通联 合市场	中国 香港	10,000	14,242.90	0.09
256	SUNEVISION HOLDINGS	新意网集 团	1686 HK	深港通联 合市场	中国 香港	3,000	14,162.28	0.09
257	YANGTZE OPTICAL FIBRE AND-H	长飞光纤	6869 HK	香港联合 交易所	中国 香港	1,000	13,866.67	0.09

258	COFCO MEAT HOLDINGS LTD	中粮肉食	1610 HK	深港通联合市场	中国香港	7,000	13,857.72	0.09
259	CHINA BLUECHEMICAL LTD - H	中海石油化学	3983 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	13,759.18	0.09
260	CHINA ZHENG TONG AUTO SERVICE	正通汽车	1728 HK	深港通联合市场	中国香港	5,500	13,696.48	0.09
261	ROAD KING INFRASTRUCTURE LTD	路劲	1098 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	13,526.28	0.09
262	TCL ELECTRONICS HOLDINGS LTD	T C L 多媒体	1070 HK	深港通联合市场	中国香港	4,000	13,114.22	0.09
263	PAX GLOBAL TECHNOLOGY LTD	百富环球	327 HK	深港通联合市场	中国香港	4,000	13,078.39	0.09
264	RED STAR MACALLINE GROUP C-H	红星美凯龙	1528 HK	深港通联合市场	中国香港	2,200	12,888.48	0.08
265	HUABAO INTERNATIONAL HOLDING	华宝国际	336 HK	深港通联合市场	中国香港	5,000	12,809.65	0.08
266	GREATVIEW ASEPTIC PACKAGING	纷美包装	468 HK	深港通联合市场	中国香港	4,000	12,791.74	0.08
267	GIORDANO INTERNATIONAL LTD	佐丹奴国际	709 HK	深港通联合市场	中国香港	6,000	12,630.50	0.08
268	BANK OF CHONGQING CO LTD-H	重庆银行	1963 HK	深港通联合市场	中国香港	3,000	12,549.88	0.08
269	YIXIN GROUP LTD	易鑫集团	2858 HK	深港通联合市场	中国香港	8,000	12,397.60	0.08
270	CHINA TRAVEL INTL INV HK	香港中旅	308 HK	深港通联合市场	中国香港	10,000	12,361.76	0.08
271	BEIJING JINGNENG CLEAN ENE-H	京能清洁能源	579 HK	深港通联合市场	中国香港	10,000	12,182.61	0.08
272	GREENLAND HONG KONG HOLDINGS	绿地香港	337 HK	深港通联合市场	中国香港	4,000	12,110.95	0.08
273	CITYCHAMP WATCH & JEWELLERY	冠城钟表珠宝	256 HK	深港通联合市场	中国香港	8,000	11,967.62	0.08
274	WISDOM EDUCATION INTERNATIONAL	睿见教育	6068 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	11,824.30	0.08
275	TEXHONG TEXTILE GROUP LTD	天虹纺织	2678 HK	深港通联合市场	中国香港	1,500	11,783.99	0.08
276	SINOPEC KANTONS	中石化冠	934 HK	深港通联	中国	4,000	11,752.63	0.08

	HOLDINGS	德		合市场	香港			
277	中国旭阳集团	中国旭阳集团	01907 HS	深港通联合市场	中国香港	5,000	11,645.14	0.08
278	WE SOLUTIONS LTD	力世纪	860 HK	深港通联合市场	中国香港	24,000	11,609.31	0.08
279	WEST CHINA CEMENT LTD	西部水泥	2233 HK	深港通联合市场	中国香港	10,000	11,465.98	0.08
280	CHINA LILANG LTD	中国利郎	1234 HK	深港通联合市场	中国香港	2,000	11,394.32	0.07
281	HUTCHISON TELECOMM HONG KONG	和记电讯香港	215 HK	深港通联合市场	中国香港	8,000	11,251.00	0.07
282	CHINA AIRCRAFT LEASING GROUP	中国飞机租赁	1848 HK	深港通联合市场	中国香港	1,500	11,139.02	0.07
283	HENG TEN NETWORKS GROUP LTD	恒腾网络	136 HK	深港通联合市场	中国香港	112,000	11,136.34	0.07
284	SKYFAME REALTY HOLDINGS LTD	天誉置业	59 HK	深港通联合市场	中国香港	12,000	11,071.84	0.07
285	MEITU INC	美图公司	1357 HK	深港通联合市场	中国香港	7,500	11,018.09	0.07
286	YADEA GROUP HOLDINGS LTD	雅迪控股	1585 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	11,018.09	0.07
287	群星纸业	群星纸业	03868 HS	深港通联合市场	中国香港	6,000	10,964.35	0.07
288	WISE TALENT INFORMATION TECH	有才天下猎聘	6100 HK	深港通联合市场	中国香港	800	10,964.35	0.07
289	DIGITAL CHINA HOLDINGS LTD	神州控股	861 HK	深港通联合市场	中国香港	3,000	10,883.73	0.07
290	CHINA FOODS LTD	中国食品	506 HK	深港通联合市场	中国香港	4,000	10,785.19	0.07
291	MACAU LEGEND DEVELOPMENT LTD	澳门励骏	1680 HK	深港通联合市场	中国香港	11,000	10,740.40	0.07
292	TONGRENTANGCM	同仁堂国药	3613 HS	深港通联合市场	中国香港	1,000.00	10,534.37	0.07
293	JINCHUAN GROUP INTERNATIONAL	金川国际	2362 HK	深港通联合市场	中国香港	18,000	10,480.63	0.07
294	LEYOU TECHNOLOGIES HOLDINGS	乐游科技控股	1089 HK	香港联合交易所	中国香港	5,000	10,435.84	0.07
295	CSSC OFFSHORE & MARINE ENG-H	中船防务	317 HK	深港通联合市场	中国香港	2,000	10,426.88	0.07
296	IMAX CHINA HOLDING INC	IMAX CHINA	1970 HK	深港通联合市场	中国香港	700	10,308.64	0.07
297	TRULY	信利国际	732 HK	深港通联合市场	中国	10,000	10,301.47	0.07

	INTERNATIONAL HOLDINGS			合市场	香港			
298	CRYSTAL INTERNATIONAL GROUP	晶苑国际	2232 HK	深港通联合市场	中国香港	3,500	10,064.09	0.07
299	LVGEM CHINA REAL ESTATE INVE	绿景中国地产	95 HK	深港通联合市场	中国香港	4,000	9,996.90	0.07
300	SUN HUNG KAI & CO LTD	新鸿基公司	86 HK	深港通联合市场	中国香港	3,000	9,970.03	0.07
301	CHINA HIGH SPEED TRANSMISSIO	中国高速传动	658 HK	深港通联合市场	中国香港	2,000	9,907.33	0.06
302	KASEN INTERNATIONAL HOLDINGS	卡森国际	496 HK	深港通联合市场	中国香港	3,000	9,808.79	0.06
303	CHINA INTERNATIONAL MARINE-H	中集集团	2039 HK	深港通联合市场	中国香港	1,500	9,768.48	0.06
304	FANTASIA HOLDINGS GROUP CO	花样年控股	1777 HK	深港通联合市场	中国香港	7,500	9,741.61	0.06
305	CANVEST ENVIRONMENTAL PROTEC	粤丰环保	1381 HK	深港通联合市场	中国香港	3,000	9,674.42	0.06
306	CHINA GOLD INTERNATIONAL RES	中国黄金国际	2099 HK	深港通联合市场	中国香港	1,500	9,634.11	0.06
307	创梦天地	创梦天地	01119 HS	深港通联合市场	中国香港	2,400	9,631.43	0.06
308	SA SA INTERNATIONAL HLDGS	莎莎国际	178 HK	深港通联合市场	中国香港	6,000	9,459.44	0.06
309	ZHUGUANG HOLDINGS GROUP CO	珠光控股	1176 HK	深港通联合市场	中国香港	10,000	9,405.69	0.06
310	JIANGXI BANK CO LTD-H	江西银行	1916 HK	深港通联合市场	中国香港	2,500	9,405.69	0.06
311	JNBY DESIGN LTD	江南布衣	3306 HK	深港通联合市场	中国香港	1,000	9,369.86	0.06
312	弘阳地产	弘阳地产	01996 HS	深港通联合市场	中国香港	4,000	9,244.45	0.06
313	海通恒信	海通恒信	01905 HS	深港通联合市场	中国香港	6,000	9,029.46	0.06
314	C-MER EYE CARE HOLDINGS LTD	希玛眼科	3309 HK	深港通联合市场	中国香港	2,000	8,975.72	0.06

315	HUIFU PAYMENT LTD	汇付天下	1806 HK	深港通联合市场	中国香港	4,000	8,921.97	0.06
316	FAIRWOOD HOLDINGS LTD	FAIRWOOD HOLD	52 HK	香港联合交易所	中国香港	500	8,904.05	0.06
317	SHANGHAI INDUSTRIAL URBAN DE	上实城市开发	563 HK	深港通联合市场	中国香港	10,000	8,778.64	0.06
318	CHINA MERCHANTS LAND LTD	招商局置地	978 HK	深港通联合市场	中国香港	8,000	8,742.81	0.06
319	SINOFERT HOLDINGS LTD	中化化肥	297 HK	深港通联合市场	中国香港	12,000	8,706.98	0.06
320	CITIC RESOURCES HOLDINGS LTD	中信资源	1205 HK	深港通联合市场	中国香港	20,000	8,599.49	0.06
321	CONSUN PHARMACEUTICAL GROUP	康臣药业	1681 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	8,312.84	0.05
322	REALORD GROUP HOLDINGS LTD	伟禄集团	1196 HK	深港通联合市场	中国香港	2,000	8,187.43	0.05
323	CHINA LOGISTICS PROPERTY HOL	中国物流资产	1589 HK	深港通联合市场	中国香港	3,000	8,142.64	0.05
324	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	8,142.64	0.05
325	SMARTONE TELECOMMUNICATIONS	数码通电讯	315 HK	深港通联合市场	中国香港	1,500	8,062.02	0.05
326	REGAL HOTELS INTL HLDGS LTD	REGAL INT'L	78 HK	深港通联合市场	中国香港	2,000	7,739.54	0.05
327	COLOUR LIFE SERVICES GROUP	彩生活	1778 HK	深港通联合市场	中国香港	2,000	7,703.71	0.05
328	CHAOWEI POWER HOLDINGS LTD	超威动力	951 HK	深港通联合市场	中国香港	3,000	7,685.79	0.05
329	GUORUI PROPERTIES LTD	国瑞置业	2329 HK	深港通联合市场	中国香港	5,000	7,300.61	0.05
330	CHINA MODERN DAIRY HOLDINGS	现代牧业	1117 HK	深港通联合市场	中国香港	7,000	7,211.03	0.05
331	TIANJIN PORT DVLP HLDS LTD	天津港发展	3382 HK	深港通联合市场	中国香港	10,000	7,076.66	0.05
332	中国船舶租赁	中国船舶租赁	03877 HS	深港通联合市场	中国香港	6,000	7,040.83	0.05
333	TIAN GE INTERACTIVE HOLDINGS	天鸽互动	1980 HK	深港通联合市场	中国香港	4,000	6,951.25	0.05
334	TEXWINCA HOLDINGS LTD	德永佳集团	321 HK	深港通联合市场	中国香港	4,000	6,915.42	0.05

335	VPOWER GROUP INTERNATIONAL H	伟能集团	1608 HK	深港通联合市场	中国香港	3,000	6,772.10	0.04
336	中国科培	中国科培	01890 HS	深港通联合市场	中国香港	2,000	6,736.27	0.04
337	LANDING INTERNATIONAL DEVELO	蓝鼎国际	582 HK	香港联合交易所	中国香港	8,400	6,621.61	0.04
338	CHINA SHINWAY PHARMACEUTICA	神威药业	2877 HK	深港通联合市场	中国香港	1,000	6,610.86	0.04
339	361 DEGREES INTERNATIONAL	3 6 1 度	1361 HK	深港通联合市场	中国香港	5,000	6,360.04	0.04
340	HC GROUP INC	慧聪集团	2280 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	6,234.63	0.04
341	HAICHANG OCEAN PARK HOLDINGS	海昌海洋公园	2255 HK	深港通联合市场	中国香港	7,000	6,207.76	0.04
342	GOODBABY INTERNATIONAL HOLDI	好孩子国际	1086 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	6,198.80	0.04
343	CPMC HOLDINGS LTD	中粮包装	906 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000	6,091.30	0.04
344	CGN NEW ENERGY HOLDINGS CO L	中广核新能源	1811 HK	深港通联合市场	中国香港	6,000	5,965.89	0.04
345	LEE'S PHARMACEUTICAL HLDGS	李氏大药厂	950 HK	香港联合交易所	中国香港	1,500	5,939.02	0.04
346	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	5,933.65	0.04
347	CHINA LNG GROUP LTD	中国天然气	931 HK	深港通联合市场	中国香港	12,000	5,697.16	0.04
348	CHINA VAST INDUSTRIAL URBAN	中国宏泰发展	6166 HK	深港通联合市场	中国香港	2,000	5,535.92	0.04
349	华兴资本控股	华兴资本控股	01911 HS	深港通联合市场	中国香港	400	5,453.51	0.04
350	GRAND BAOXIN AUTO GROUP LTD	宝信汽车	1293 HK	深港通联合市场	中国香港	4,000	5,338.85	0.04
351	鸿宝资源	鸿宝资源	01131 HS	深港通联合市场	中国香港	10,000	5,195.52	0.03
352	BOCOM INTERNATIONAL HOLDINGS	交银国际	3329 HK	深港通联合市场	中国香港	5,000	4,971.58	0.03
353	MINSHENG EDUCATION GROUP CO	民生教育	1569 HK	深港通联合市场	中国香港	4,000	4,944.71	0.03
354	VCREDIT HOLDINGS	维信金科	2003	深港通联	中国	800	4,865.88	0.03

	LTD		HK	合市场	香港			
355	CHINA FIRST CAPITAL GROUP LT	首控集团	1269 HK	深港通联合市场	中国香港	20,000	4,837.21	0.03
356	GCL NEW ENERGY HOLDINGS LTD	协鑫新能源	451 HK	深港通联合市场	中国香港	34,000	4,812.13	0.03
357	COGOBUY GROUP	科通芯城	400 HK	深港通联合市场	中国香港	4,000	4,658.06	0.03
358	KUANGCHI SCIENCE LTD	光启科学	439 HK	深港通联合市场	中国香港	14,000	3,574.16	0.02
359	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	3,144.19	0.02
360	汇量科技	汇量科技	01860 HS	深港通联合市场	中国香港	1,000	3,045.65	0.02
361	PANDA GREEN ENERGY GROUP LTD	熊猫绿能	686 HK	香港联合交易所	中国香港	16,000	2,751.84	0.02
362	5 1 信用卡	5 1 信用卡	02051 HS	深港通联合市场	中国香港	1,500	1,961.76	0.01
363	HONG KONG INTERNATIONAL CONS	香港国际建投	687 HK	深港通联合市场	中国香港	2,000	1,791.56	0.01
364	CHINA UNIENERGY GROUP LTD	中国优质能源	1573 HK	深港通联合市场	中国香港	2,000	1,576.57	0.01

8.4.2 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	TOWN HEALTH INTERNATIONAL ME	康健国际医疗	3886 HK	深港通联合市场	中国香港	110,000	67,792.63	0.44
2	CONVOY GLOBAL HOLDINGS LTD	康宏环球	1019 HK	香港联合交易所	中国香港	270,000	40,390.72	0.26
3	ZHONGLIANG HOLDING S COMPANY GROUP LTD	中梁控股	02772 HS	深港通联合市场	中国香港	3,500	19,407.07	0.13
4	SMI HOLDINGS GROUP LTD	星美控股	198 HK	香港联合交易所	中国香港	8,800	18,445.90	0.12
5	CHINA HUIYUAN JUICE GROUP	汇源果汁	1886 HK	香港联合交易所	中国香港	10,000	18,094.76	0.12
6	Dah Chong Hong Holdings Ltd	大昌行集团	1828 HS	深港通联合市场	中国香港	4,000	13,185.88	0.09
7	CT Environmental	中滔环保	1363	深港通联合市场	中国	16,000	4,873.04	0.03

	Group Ltd		HS	合市场	香港			
8	TENWOW INTERNATIONAL HOLDING	天喔国际	1219 HK	香港联合交易所	中国香港	8,000	2,723.17	0.02
9	CWT International Ltd	CWT INT'L	521 HS	深港通联合市场	中国香港	20,000	2,364.86	0.02
10	CAMSING INTL	承兴国际控股	2662 HS	深港通联合市场	中国香港	2,000	2,078.21	0.01
11	CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	辉山乳业	6863 HK	深港通联合市场	中国香港	212,000	1,899.05	0.01
12	国农控股(退市)	国农控股(退市)	44390 HS	深港通联合市场	中国香港	46,000	1,065.17	0.01
13	Freeman FinTech Corp Ltd	民众金融科技	279 HS	深港通联合市场	中国香港	4,000	369.06	0.00
14	CHINA DYF	中国鼎益丰	612 HS	深港通联合市场	中国香港	8,000	0.72	0.00

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	CHINA TOWER CORP LTD-H	788 HK	447,318.69	2.14
2	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	914 HK	274,425.38	1.32
3	LI NING CO LTD	2331 HK	227,372.04	1.09
4	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	586 HK	219,590.14	1.05
5	CHINA VANKE CO LTD-H	2202 HK	189,479.11	0.91
6	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	1800 HK	159,632.96	0.77
7	CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	817 HK	153,296.66	0.73
8	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	522 HK	134,167.57	0.64
9	JINXIN FERTILITY GROUP LTD	01951 HS	78,366.64	0.38
10	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	551 HK	73,131.72	0.35
11	TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	780 HK	70,993.48	0.34
12	CHINA CINDA ASSET MANAGEM-H	1359 HK	66,396.50	0.32
13	NINE DRAGONS PAPER	2689 HK	65,838.76	0.32

	HOLDINGS			
14	NAGACORP LTD	3918 HK	63,347.76	0.30
15	E- HOUSE(CHINA) ENTERPRISE HOLDINGS LTD	02048 HS	57,727.18	0.28
16	WUXI APPTec CO LTD-H	2359 HK	52,903.76	0.25
17	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	3311 HK	50,470.98	0.24
18	HYSAN DEVELOPMENT CO	14 HK	35,642.83	0.17
19	CHINA EAST EDUCATION HOLDINGS LTD	00667 HS	35,273.98	0.17
20	ZHONGYU GAS HOLDINGS LTD	3633 HK	28,232.64	0.14

注：本期累计买入金额指买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	CHINA TOWER CORP LTD-H	788 HK	534,159.17	2.56
2	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	914 HK	425,425.70	2.04
3	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	586 HK	347,584.73	1.67
4	LI NING CO LTD	2331 HK	303,908.18	1.46
5	CHINA VANKE CO LTD-H	2202 HK	276,161.98	1.32
6	ALIBABA HEALTH INFORMATION T	241 HK	195,429.49	0.94
7	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	522 HK	193,673.93	0.93
8	HOPEWELL HOLDINGS LTD	54 HK	177,265.51	0.85
9	CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	817 HK	167,805.24	0.80
10	PING AN HEALTHCARE AND TECHN	1833 HK	121,863.43	0.58
11	HYSAN DEVELOPMENT CO	14 HK	98,582.36	0.47
12	SINOPHARM GROUP CO-H	1099 HK	96,845.10	0.46
13	HAITONG SECURITIES CO LTD-H	6837 HK	81,700.51	0.39

14	CITIC SECURITIES CO LTD-H	6030 HK	81,641.68	0.39
15	BYD CO LTD-H	1211 HK	80,420.70	0.39
16	CRRC CORP LTD - H	1766 HK	79,755.22	0.38
17	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	2238 HK	77,665.30	0.37
18	NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	1336 HK	74,099.90	0.36
19	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	3323 HK	70,686.83	0.34
20	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	981 HK	67,635.55	0.32

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

8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	3,034,422.00
卖出收入（成交）总额	10,599,444.37

注:上述金额均指成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

无。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

无。

8.11 投资组合报告附注**8.11.1 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**

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

8.11.2 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。

8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	64,163.91
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	10,848.82
4	应收利息	301.38
5	应收申购款	4,371.83
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	79,685.94

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**8.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

无。

8.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	3886 HK	TOWN HEALTH INTERNATIONAL ME	67,792.63	0.44	重大事项停牌
2	1019 HK	CONVOY GLOBAL HOLDINGS LTD	40,390.72	0.26	重大事项停牌
3	198 HK	SMI HOLDINGS GROUP LTD	18,445.90	0.12	重大事项停牌

4	1886 HK	CHINA HUIYUAN JUICE GROUP	18,094.76	0.12	重大事项 停牌
---	---------	---------------------------	-----------	------	------------

8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
1,263	11,573.95	123,788.25	0.85	14,494,112.95	99.15

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户数。

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	张明	448,302.00	34.12
2	赵何鉴	249,998.00	19.03
3	尹绍波	150,023.00	11.42
4	苟晟	90,000.00	6.85
5	丁志松	50,900.00	3.87
6	李小晶	50,002.00	3.81
7	钱中明	47,670.00	3.63
8	戚艳妮	23,100.00	1.76
9	游建忠	21,000.00	1.60
10	金爱华	20,300.00	1.55

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。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	5,823.22	0.0398

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016 年 12 月 2 日）基金份额总额	788,370,205.40
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	2,516,201.75
减：本报告期基金总赎回份额	10,046,209.06
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	14,617,901.20

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

无。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、基金管理人的重大人事变动

1. 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。
2. 经大成基金管理有限公司第六届董事会第三十五次会议审议通过，自 2019 年 9 月 12 日起，陈翔凯先生不再担任公司副总经理职务。
3. 经大成基金管理有限公司第七届董事会第一次会议审议通过，自 2019 年 11 月 3 日起吴庆斌先生担任公司董事长职务，刘卓先生因任期届满不再担任公司董事长。
4. 经大成基金管理有限公司 2019 年第三次临时股东会审议通过，选举吴庆斌、翟斌、谭晓冈、李超、郭向东、胡维翊、杨晓帆、金李、黄隽担任公司第七届董事会董事，其中胡维翊、杨晓帆、金李、黄隽为独立董事。原第六届董事会成员刘卓、靳天鹏、孙学林、叶林、吉敏不再担任公司董事。

上述变更详见公司相关公告。

二、基金托管人的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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
瑞银证券	3	13,177,085.08	100.00%	9,461.94	100.00%	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	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	-	-	-	-	-
高华证券	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	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-

浙商证券	1	-	-	-	-	-
中国银河证券	4	-	-	-	-	-
中金公司	3	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中银国际证券	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、中泰证券、南京证券。本报告期内本基金退租席位：中银国际。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	大成基金管理有限公司关于网上直销	中国证监会基金电子披	2019-12-31

	系统开展平安银行支付渠道费率优惠活动的公告	露网站、指定报刊及本公司网站	
2	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	中国证监会基金电子披露网站、指定报刊及本公司网站	2019-12-30
3	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	中国证监会基金电子披露网站、指定报刊及本公司网站	2019-12-21
4	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	中国证监会基金电子披露网站、指定报刊及本公司网站	2019-12-17
5	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金基金合同	中国证监会基金电子披露网站、指定报刊及本公司网站	2019-12-17
6	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金托管协议	中国证监会基金电子披露网站、指定报刊及本公司网站	2019-12-17
7	大成基金管理有限公司关于修订公司旗下部分基金基金合同有关条款的公告	中国证监会基金电子披露网站、指定报刊及本公司网站	2019-12-17
8	大成基金管理有限公司澄清公告	中国证监会基金电子披露网站、指定报刊及本公司网站	2019-12-13
9	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加玄元保险代理有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、指定报刊及本公司网站	2019-11-08
10	大成基金管理有限公司高级管理人员变更公告（董事长）	中国证监会基金电子披露网站、指定报刊及本公司网站	2019-11-04
11	大成基金管理有限公司关于董事会成员换届变更的公告	中国证监会基金电子披露网站、指定报刊及本公司网站	2019-11-04
12	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）2019 年第 3 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、指定报刊及本公司网站	2019-10-23
13	关于修订公司旗下证券投资基金基金合同相关条款的公告	中国证监会基金电子披露网站、指定报刊及本公司网站	2019-10-23
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	中国证监会基金电子披露网站、指定报刊及本公司网站	2019-09-25
15	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华瑞保险销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、指定报刊及本公司网站	2019-09-16

16	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会基金电子披露网站、指定报刊及本公司网站	2019-09-12
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	中国证监会基金电子披露网站、指定报刊及本公司网站	2019-09-10
18	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）2019 年半年度报告及摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2019-08-27
19	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）2019 年第 2 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2019-07-18
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(2019 年 1 期)	中国证监会指定报刊及本公司网站	2019-07-17
21	大成基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2019-07-08
22	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京新浪仓石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	2019-07-05
23	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
24	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	2019-06-27
25	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
26	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
27	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
28	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
29	大成基金管理有限公司关于通过网上直销系统适用渠道的大成钱柜交易实施费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2019-04-25
30	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
31	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	2019-04-17

	定投业务的公告		
32	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
33	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
34	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
35	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
36	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）2018 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2019-01-19
37	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
38	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

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

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

13.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

13.3 查阅方式

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

大成基金管理有限公司

2020 年 4 月 29 日