

# 大成恒生综合中小型股指数证券投资基金 (QDII-LOF) 2022 年中期报告

2022 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：2022 年 8 月 30 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。本中期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 2022 年 8 月 29 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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2022 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 .....	6
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人 .....	6
2.5 信息披露方式 .....	6
2.6 其他相关资料 .....	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>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	9
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介 .....	11
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	11
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	11
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	11
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	13
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 .....	13
<b>§5 托管人报告 .....</b>	<b>14</b>
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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计） .....</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表 .....	14
6.2 利润表 .....	16
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	17
6.4 报表附注 .....	19
<b>§7 投资组合报告 .....</b>	<b>45</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	45
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 .....	46
7.3 期末按行业分类的权益投资组合 .....	46

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 .....	46
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动 .....	75
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 .....	77
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 .....	77
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 .....	77
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 .....	77
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 .....	77
7.11 投资组合报告附注 .....	77
<b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>79</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	79
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	79
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	79
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 .....	80
<b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>80</b>
<b>§10 重大事件揭示 .....</b>	<b>80</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	80
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 .....	81
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	81
10.4 基金投资策略的改变 .....	81
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	81
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 .....	81
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	81
10.8 其他重大事件 .....	83
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>84</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 .....	84
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	84
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>85</b>
12.1 备查文件目录 .....	85
12.2 存放地点 .....	85
12.3 查阅方式 .....	85

## § 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 LOF	
基金主代码	160922	
交易代码	160922	
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）	
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	10,975,033.48 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	
下属分级基金的基金简称	恒生中小 A	恒生中小 C
下属分级基金的交易代码	160922	008972
报告期末下属分级基金的份额总额	9,703,916.66 份	1,271,116.82 份

### 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	段皓静	秦一楠
	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		广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、 27-33 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、 27-33 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		518054	100031
法定代表人		吴庆斌	谷澍

## 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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.dcfund.com.cn
基金中期报告备置地点	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	北京市西城区太平桥大街 17 号

# § 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(2022 年 01 月 01 日-2022 年 06 月 30 日)	
	恒生中小 A	恒生中小 C
本期已实现收益	-97,103.55	-13,160.58
本期利润	-380,204.52	-59,175.78

加权平均基金份额本期利润	-0.0420	-0.0496
本期加权平均净值利润率	-4.59%	-5.45%
本期基金份额净值增长率	-5.88%	-5.99%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	-537,492.25	-73,459.83
期末可供分配基金份额利润	-0.0554	-0.0578
期末基金资产净值	9,166,424.41	1,197,656.99
期末基金份额净值	0.945	0.942
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	-5.50%	-4.85%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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。

4、根据我公司 2020 年 2 月 29 日《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》，自 2020 年 3 月 3 日起，大成恒生综合中小型股指数证券投资基金增设 C 类份额。本报告关于 C 类份额的指标计算起始日为 C 类份额的初始申购确认日。

## 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

恒生中小 A

阶段	份额净	份额净值	业绩比较基	业绩比较基准	①—③	②—④
----	-----	------	-------	--------	-----	-----

	值增长率①	增长率标准差②	准收益率③	收益率标准差④		
过去一个月	4.30%	1.13%	2.37%	1.28%	1.93%	-0.15%
过去三个月	6.66%	1.52%	-0.45%	1.57%	7.11%	-0.05%
过去六个月	-5.88%	1.88%	-10.89%	2.04%	5.01%	-0.16%
过去一年	-22.86%	1.59%	-28.16%	1.72%	5.30%	-0.13%
过去三年	-6.06%	1.47%	-2.03%	1.54%	-4.03%	-0.07%
自基金合同生效起至今	-5.50%	1.30%	0.86%	1.35%	-6.36%	-0.05%

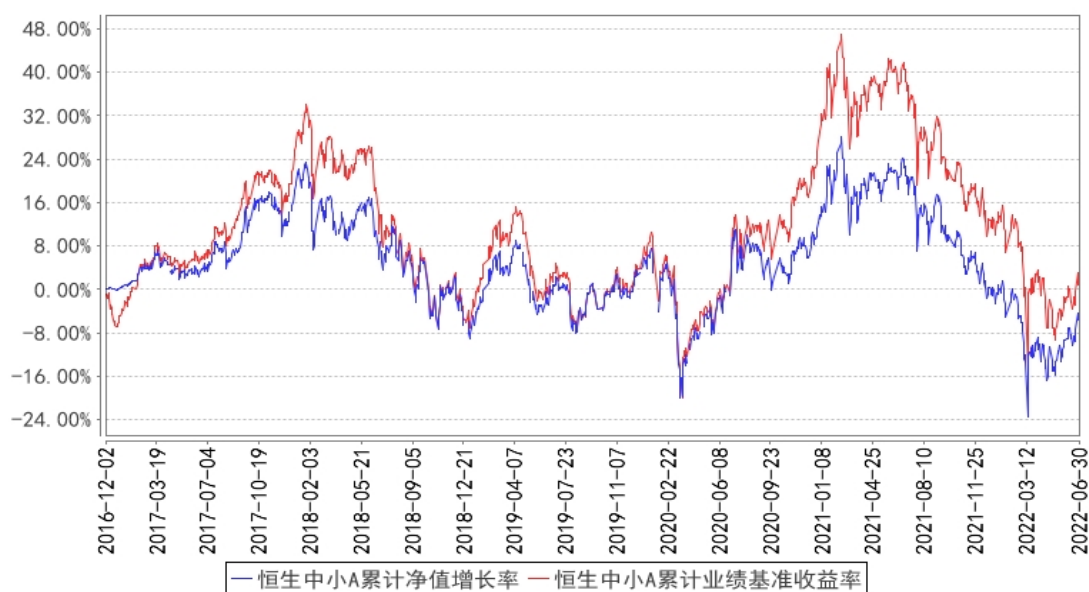
## 恒生中小 C

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	4.20%	1.15%	2.37%	1.28%	1.83%	-0.13%
过去三个月	6.56%	1.54%	-0.45%	1.57%	7.01%	-0.03%
过去六个月	-5.99%	1.89%	-10.89%	2.04%	4.90%	-0.15%
过去一年	-22.98%	1.59%	-28.16%	1.72%	5.18%	-0.13%
自基金合同生效起至今	-4.85%	1.49%	1.05%	1.58%	-5.90%	-0.09%

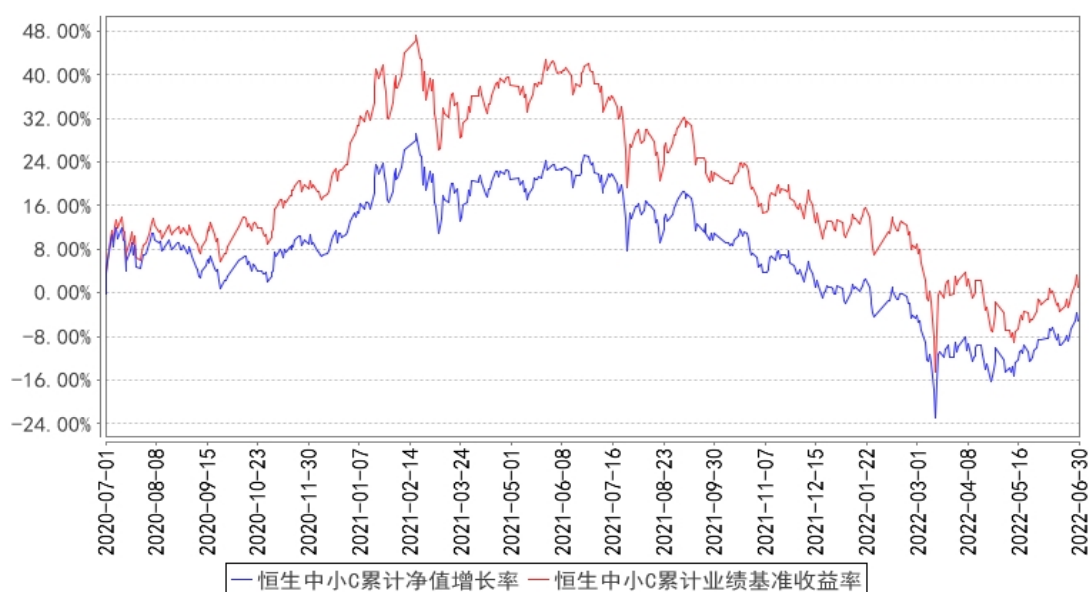


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

恒生中小A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



恒生中小C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%）。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 等资格。

历经 23 年的发展，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。

#### 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	-	19 年	英国曼彻斯特大学商学院金融学硕士。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，现任国际业务部基金经理。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 日至 2020 年 7 月 7 日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。2021 年 5 月 18 日起任大成恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理。2021 年 9 月 9 日起任大成恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。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。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无

#### 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和工具，对旗下所有投资组合连续 4 个季度的日内、3 日内及 5 日内股票及债券交易同向交易价差进行分析，针对同一基金经理管理的多个投资组合及公私募兼任基金经理管理的多个投资组合的投资交易行为加强了公平交易监测与分析，包括对不同时间窗下（同日、3 日、5 日、10 日）反向交易和同向交易价差监控的分析。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投资策略差异、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，同时结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

##### 4.4.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易存在 1 笔同日反向交易，原因为投资策略需要。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易，但不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量 5% 的情形；主动投资组合间债券交易存在 2 笔同日反向交易，原因为流动性需要或合规比例调整。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

2022 年上半年，全球资本市场都出现了较大幅度的波动，港股市场也不例外，也出现了较大

程度的震荡。

在上半年的前几个月，港股基本上呈现单边剧烈下跌的情形，导致港股下跌的因素有很多，主要有以下几个方面。

首先，新冠变种病毒 Omicron 不仅在中国香港大流行，也逐步传播到中国内地。因为 Omicron 传播速度很快，所以在疫情快速升级过程中对经济的需求和供给都造成了较大的瞬时冲击，再加上境内疫情不断反复，各行各业遭遇冲击，导致中国宏观经济短期承压，相关港股下跌。

其次，互联网行业的政策风险增大，加剧了市场的担忧，对互联网平台公司估值形成了较大压力。此外，美国监管当局严格执行关于中概股上市地位的监管要求，引发了中概股的下跌，从而导致港股主要科技权重股下跌。

再次，由于美国的通胀水平居高不下，美联储在上半年采取了包括多次加息及缩表在内的紧缩性货币政策，且预计未来还会持续加息及缩表。高通胀及加息预期引发了全球股市的剧烈波动，港股也未能独善其身。

此外，俄罗斯及乌克兰地缘政治事件导致能源价格进一步上涨，加剧了对通货膨胀的担忧，因此也导致全球股市出现大幅波动。

但是，5 月份以来，导致下跌的这些因素都发生了改变，港股也出现了一定反弹，主要包括：（1）互联网公司的监管环境趋于正常化；（2）中美监管当局对于中概股监管问题正在积极进行协商，以期完美解决问题；（3）境内疫情逐步缓解，社会经济活动逐步恢复，国务院也采取了多项促进经济发展的措施，有助于经济增长。因此，港股也出现了大幅反弹。

#### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末恒生中小 A 的基金份额净值为 0.945 元，本报告期基金份额净值增长率为-5.88%，同期业绩比较基准收益率为-10.89%；截至本报告期末恒生中小 C 的基金份额净值为 0.942 元，本报告期基金份额净值增长率为-5.99%，同期业绩比较基准收益率为-10.89%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从长期来看，港股具有长期成长性及长期投资价值。同时，港股经过 1 年左右的下跌，从技术层面来看，调整已经很充分；从估值方面来看，也是历史最低水平区间；从基本面展望来看，未来互联网公司的监管环境可能会趋松，同时中国宏观经济增长速度也有望逐步恢复，因此，从大概率来看，市场对港股未来的走势较为乐观。

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、固定收益总部、研究部、指数与期货投资部、大类资产配置部、权益专户投资部、国际业务部、交易管理部、风险管理部、监察稽核部、基金运营部指定人员组成。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七名投资组合经理。

股票投资部、固定收益总部、研究部、指数与期货投资部、大类资产配置部、权益专户投资部、国际业务部、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交易的债券品种的估值数据，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《中华人民共和国证券投资基金法》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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，大成基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》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 托管人对本中期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中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,166,527.01	834,747.78
结算备付金		0.24	—
存出保证金		—	—
交易性金融资产	6.4.7.2	9,377,674.44	8,232,679.57
其中：股票投资		9,377,674.44	8,232,679.57
基金投资		—	—
债券投资		—	—

资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		136,068.85	7,911.87
应收申购款		28,449.36	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	176.74
资产总计		10,708,719.90	9,075,515.96
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		198,261.38	0.01
应付赎回款		95,755.12	17,157.00
应付管理人报酬		8,086.23	7,511.03
应付托管费		2,021.55	1,877.75
应付销售服务费		99.23	66.32
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	40,414.99	79,298.01
负债合计		344,638.50	105,910.12
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	10,975,033.48	8,936,748.02
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-610,952.08	32,857.82
净资产合计		10,364,081.40	8,969,605.84
负债和净资产总计		10,708,719.90	9,075,515.96

注： 报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 10,975,033.48 份，其中恒生中小 A 基金份额总额为 9,703,916.66 份，基金份额净值 0.945 元。恒生中小 C 基金份额总额为 1,271,116.82 份，

基金份额净值 0.942 元。

## 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-310,528.39	1,061,565.84
1. 利息收入		2,329.10	4,724.41
其中：存款利息收入	6.4.7.13	2,329.10	4,724.41
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）		-16,618.15	932,357.26
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-227,314.24	806,526.08
基金投资收益	6.4.7.15	-	-
债券投资收益	6.4.7.16	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.17	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.18	-	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-	-
股利收益	6.4.7.20	210,696.09	125,831.18
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-329,116.17	113,095.46
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		30,081.40	-750.88
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	2,795.43	12,139.59
<b>减：二、营业总支出</b>		128,851.91	194,260.89
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	46,446.48	55,477.70
2. 托管费	6.4.10.2.2	11,611.67	13,869.39
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	534.12	204.95
4. 投资顾问费		-	-



5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 23	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 24	70,259.64	124,708.85
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-439,380.30	867,304.95
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-439,380.30	867,304.95
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-439,380.30	867,304.95

### 6.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	8,936,748.02	-	32,857.82	8,969,605.84
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	8,936,748.02	-	32,857.82	8,969,605.84
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,038,285.46	-	-643,809.90	1,394,475.56
（一）、综合收益总额	-	-	-439,380.30	-439,380.30
（二）、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）	2,038,285.46	-	-204,429.60	1,833,855.86
其中：1. 基金申购款	4,886,092.83	-	-456,816.03	4,429,276.80
2. 基金赎回款	-2,847,807.37	-	252,386.43	-2,595,420.94
（三）、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)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	10,975,033.48	-	-610,952.08	10,364,081.40
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	12,514,572.14	-	1,536,241.39	14,050,813.53
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	12,514,572.14	-	1,536,241.39	14,050,813.53
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-4,323,976.32	-	307,777.97	-4,016,198.35
(一)、综合收益总额	-	-	867,304.95	867,304.95
(二)、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)	-4,323,976.32	-	-559,526.98	-4,883,503.30
其中：1. 基金申购款	4,584,943.66	-	918,462.16	5,503,405.82
2. 基金赎回款	-8,908,919.98	-	-1,477,989.14	-10,386,909.12
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	8,190,595.82	-	1,844,019.36	10,034,615.18

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

范瑛

孙蕊

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

大成恒生综合中小型股指数证券投资基金(QDII-LOF)(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]第 2047 号《关于准予大成恒生综合中小型股指数证券投资基金(QDII-LOF)注册的批复》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,原有基金份额转为 A 类基金份额。其中,在投资者申购时收取申购费用,不从本类别资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;投资者申购时不收取申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置基金代码并分别计算基金份额净值。

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） $\times 5\%$ 。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、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 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 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

除下文中涉及的变更外，本基金本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

##### 6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

##### 新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

##### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分

类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

#### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

##### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具（主要为股票投资）按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

### （2）金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的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。

### （3）衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 原金融工具准则（截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则）

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

#### （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、债券投资和衍生工具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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，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。

### 6.4.4.2. 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

#### 新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并

未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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。

原金融工具准则（截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则）

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 6.4.4.3 收入/(损失)的确认和计量

##### 新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值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扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

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。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》，本基金的基金管理



人已采用上述准则及通知编制本基金财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

(i) 于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果对比表：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、应收利息和应收股利，金额分别为 834,747.78 元、0.00 元、176.74 元和 7,911.87 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、其他资产-应收利息和应收股利，金额分别为 834,872.89 元、51.63 元、0.00 元和 7,911.87 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 8,232,679.57 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 8,232,679.57 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 0.01 元、17,157.00 元、7,511.03 元、1,877.75 元、66.32 元、5,970.39 元和 33,327.62 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 0.01 元、17,157.00 元、7,511.03 元、1,877.75 元、66.32 元、5,970.39 元和 33,327.62 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 6.4.6 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[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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。

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	1,166,527.01
等于：本金	1,166,400.93
加：应计利息	126.08
减：坏账准备	—
定期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
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	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
合计	1,166,527.01

注：于本期末，活期存款中包括的外币余额为港币活期存款 360,566.10 元，折合人民币 308,352.52 元；美元活期存款 8.40 元，折合人民币 56.38 元。

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	10,617,041.15	—	9,377,674.44	-1,239,366.71
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		10,617,041.15	-	9,377,674.44	-1,239,366.71

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

## 6.4.7.6 其他债权投资

## 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

## 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

## 6.4.7.7 其他权益工具投资

## 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.8 其他资产

无。

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	214.80
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	8.10
其中：交易所市场	8.10
银行间市场	—
应付利息	—
预提费用	17,356.09
应付指数使用费	22,836.00
合计	40,414.99

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

恒生中小 A

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,059,618.30	8,059,618.30
本期申购	3,623,279.42	3,623,279.42
本期赎回（以“-”号填列）	-1,978,981.06	-1,978,981.06
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	9,703,916.66	9,703,916.66

## 恒生中小 C

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	877,129.72	877,129.72
本期申购	1,262,813.41	1,262,813.41
本期赎回（以“-”号填列）	-868,826.31	-868,826.31
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	1,271,116.82	1,271,116.82

注：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)。

## 6.4.7.11 其他综合收益

无。

## 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

## 恒生中小 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	3,193,308.20	-3,161,966.73	31,341.47
本期利润	-97,103.55	-283,100.97	-380,204.52
本期基金份额交易产生的变动数	630,989.57	-819,618.77	-188,629.20
其中：基金申购款	1,373,027.06	-1,756,247.15	-383,220.09
基金赎回款	-742,037.49	936,628.38	194,590.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,727,194.22	-4,264,686.47	-537,492.25

## 恒生中小 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	6,864,494.84	-6,862,978.49	1,516.35
本期利润	-13,160.58	-46,015.20	-59,175.78

本期基金份额交易产生的变动数	3,081,268.04	-3,097,068.44	-15,800.40
其中：基金申购款	9,870,917.65	-9,944,513.59	-73,595.94
基金赎回款	-6,789,649.61	6,847,445.15	57,795.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,932,602.30	-10,006,062.13	-73,459.83

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,320.28
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	0.69
其他	8.13
合计	2,329.10

#### 6.4.7.14 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,304,311.02
减：卖出股票成本总额	1,522,085.14
减：交易费用	9,540.12
买卖股票差价收入	-227,314.24

#### 6.4.7.15 基金投资收益

无。

#### 6.4.7.16 债券投资收益

无。

#### 6.4.7.17 资产支持证券投资收益

无。

#### 6.4.7.18 贵金属投资收益

#### 6.4.7.19 衍生工具收益

##### 6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	210,696.09
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	210,696.09

## 6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-329,116.17
股票投资	-329,116.17
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	-329,116.17

## 6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	2,795.43
合计	2,795.43

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。

## 6.4.7.23 信用减值损失

无。

## 6.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----



	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	17,356.09
信息披露费	—
证券出借违约金	—
深港通证券组合费	1.73
银行划款手续费	3,838.67
指数使用费	45,672.00
其他	3,391.15
合计	70,259.64

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。

#### 6.4.7.25 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司（“大成基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
摩根大通银行（“摩根大通银行”）	境外资产托管人
光大证券股份有限公司（“光大证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
-------	---------------------------------------	--

	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
光大证券	13,496.04	100.00	—	—

#### 6.4.10.1.2 债券交易

无。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

#### 6.4.10.1.4 基金交易

无。

#### 6.4.10.1.5 权证交易

无。

#### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022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	8.10	100.00	8.10	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021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 (%)
—	—	—	—	—

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。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	46,446.48	55,477.70
其中：支付销售机构的客户维护费	17,514.13	22,121.57

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  $\times$  1.00% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	11,611.67	13,869.39

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  $\times$  0.25% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	恒生中小 A	恒生中小 C	合计
大成基金	—	6.39	6.39
合计	—	6.39	6.39
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	恒生中小 A	恒生中小 C	合计
合计	—	—	—

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费将专门用于本基金 C 类基金份额的销售与基金份额持有人服务。在通常情况下，销售服务费按前一日基金资产净值的 0.10% 年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$

H 为每日应计提的销售服务费

E 为前一日的基金财产净值

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 6.4.10.5.2 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。

#### 6.4.10.6 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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
摩根大通银行	308,408.90	-	115,672.55	-
中国农业银行	858,118.11	2,320.28	579,544.05	4,093.55

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。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

## 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

## 6.4.11 利润分配情况

无。

## 6.4.12 期末(2022 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

## 6.4.12.2 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
1114 HK	BRILLIANCE CHI	2021 年 03 月 31 日	重大 事项	6.24	未知	未知	8,000	43,297.70	49,943.10	-
1589 HK	中国物流资 产	2022 年 06 月 25 日	重大 事项	3.69	未知	未知	2,000	6,978.63	7,388.84	1
1333 HK	中国忠旺	2021 年 08 月 30 日	重大 事项	1.44	未知	未知	4,000	11,341.12	5,746.88	-
1363 HK	中滔环保	2019 年 04 月 01 日	已退 市	0.29	不适 用	不适用	16,000	22,603.95	4,652.23	-
1219 HK	天喔国际	2018 年 08 月 13 日	已退 市	0.32	不适 用	不适用	8,000	12,153.81	2,599.78	-
1019 HK	康宏环球	2017 年 12 月 08 日	已退 市	0.01	不适 用	不适用	270,000	50,157.33	2,309.01	-
2662 HK	美好发展	2019 年 07 月 19 日	已退 市	0.99	不适 用	不适用	2,000	11,395.92	1,984.04	-
6863 HK	辉山乳业	2017 年 03 月 27 日	已退 市	0.01	不适 用	不适用	212,000	538,969.89	1,813.00	-
1573 HK	南方能源	2020 年 04 月 01 日	已退 市	0.58	不适 用	不适用	2,000	1,599.69	1,163.06	-

		日								
1236 HK	国农控股	2017 年 03 月 28 日	已退 市	0.02	不适 用	不适用	46,000	71,262.08	1,016.91	-
2103 HK	新力控股集 团	2021 年 09 月 20 日	重大 事项	0.43	未知	未知	2,000	7,739.89	855.19	-
1131 HK	鸿宝资源	2020 年 07 月 02 日	已退 市	0.07	不适 用	不适用	10,000	5,212.46	709.81	-
0198 HK	星美控股	2018 年 09 月 03 日	已退 市	0.00	不适 用	不适用	8,800	27,579.69	7.53	-
1886 HK	汇源果汁	2018 年 04 月 03 日	已退 市	0.00	不适 用	不适用	10,000	23,658.22	0.86	-

注：1. 中国物流资产，股票代码 1589 HK，已于 2022 年 7 月 15 日起退市。

2. 除上述已退市股票外，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。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

#### 6.4.13.2 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)。

#### 6.4.13.3 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。

#### 6.4.13.3.1 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。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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



## 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	858,118.11	-	-	308,408.90	1,166,527.01
结算备付金	0.24	-	-	-	0.24
交易性金融资产	-	-	-	9,377,674.44	9,377,674.44
应收股利	-	-	-	136,068.85	136,068.85
应收申购款	-	-	-	28,449.36	28,449.36
资产总计	858,118.35	-	-	9,850,601.55	10,708,719.90
负债					
应付赎回款	-	-	-	95,755.12	95,755.12
应付管理人报酬	-	-	-	8,086.23	8,086.23
应付托管费	-	-	-	2,021.55	2,021.55
应付清算款	-	-	-	198,261.38	198,261.38
应付销售服务费	-	-	-	99.23	99.23
其他负债	-	-	-	40,414.99	40,414.99
负债总计	-	-	-	344,638.50	344,638.50
利率敏感度缺口	858,118.35	-	-	9,505,963.05	10,364,081.40
上年度末 2021 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	682,931.86	-	-	151,815.92	834,747.78
交易性金融资产	-	-	-	8,232,679.57	8,232,679.57
应收股利	-	-	-	7,911.87	7,911.87
其他资产	-	-	-	176.74	176.74
资产总计	682,931.86	-	-	8,392,584.10	9,075,515.96
负债					
应付赎回款	-	-	-	17,157.00	17,157.00
应付管理人报酬	-	-	-	7,511.03	7,511.03
应付托管费	-	-	-	1,877.75	1,877.75
应付证券清算款	-	-	-	0.01	0.01
应付销售服务费	-	-	-	66.32	66.32
其他负债	-	-	-	79,298.01	79,298.01
负债总计	-	-	-	105,910.12	105,910.12
利率敏感度缺口	682,931.86	-	-	8,286,673.98	8,969,605.84

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

## 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，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）。

#### 6.4.13.4.2 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。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 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	56.38	308,352.52	-	308,408.90
交易性金融资产	-	9,377,674.44	-	9,377,674.44
应收股利	-	132,363.05	-	132,363.05
资产合计	56.38	9,818,390.01	-	9,818,446.39
以外币计价的负债				
应付清算款	-	198,261.38	-	198,261.38
负债合计	-	198,261.38	-	198,261.38
资产负债表外汇风险敞口净额	56.38	9,620,128.63	-	9,620,185.01
项目	上年度末 2021 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	214.22	151,606.98	-	151,821.20
交易性金融资产	-	8,232,679.57	-	8,232,679.57
应收股利	-	2,661.29	-	2,661.29
资产合计	214.22	8,386,947.84	-	8,387,162.06
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	214.22	8,386,947.84	-	8,387,162.06

#### 6.4.13.4.2.2 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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	所有外币相对人民币升值 5%	481,009.30	419,358.10
	所有外币相对人民币贬值 5%	-481,009.21	-419,358.10

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 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	9,377,674.44	90.48	8,232,679.57	91.78
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
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	9,377,674.44	90.48	8,232,679.57	91.78

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	468,103.98	414,865.61
	业绩比较基准下降5%	-468,103.98	-414,865.61

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 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。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
---------------	-------------------	---------------------

第一层次	9,372,527.13	8,142,229.39
第二层次	—	83,043.63
第三层次	5,147.31	7,406.55
合计	9,377,674.44	8,232,679.57

#### 6.4.14.2.2 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和债券，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和债券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、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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）

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

#### 6.4.15 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	9,377,674.44	87.57
	其中：普通股	9,377,674.44	87.57
	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	1,166,527.25	10.89
8	其他各项资产	164,518.21	1.54
9	合计	10,708,719.90	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 67,913.13 元，占期末基金资产净值的比例为 0.66%。

## 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	9,377,674.44	90.48
合计	9,377,674.44	90.48

## 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（%）
金融	1,026,424.70	9.90
通信服务	521,691.56	5.03
房地产	1,008,221.64	9.73
能源	423,276.30	4.08
公用事业	541,040.21	5.22
非日常生活消费品	1,306,266.78	12.60
工业	1,301,675.29	12.56
日常消费品	361,505.90	3.49
信息技术	779,220.06	7.52
医疗保健	1,265,233.08	12.21
原材料	762,908.16	7.36
合计	9,297,463.68	89.71

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

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（%）
金融	2,309.01	0.02
通信服务	7.53	—
房地产	8,244.03	0.08

能源	1,872.87	0.02
公用事业	-	-
非日常生活消费品	49,943.10	0.48
工业	4,672.75	0.05
日常消费品	4,413.64	0.04
信息技术	3,000.95	0.03
医疗保健	-	-
原材料	5,746.88	0.06
合计	80,210.76	0.77

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	GCL Technology Holdings Ltd	协鑫科技	03800	香港联合交易所	中国香港	64,000	207,434.89	2.00
2	China Shenhua Energy Co Ltd	中国神华	01088	香港联合交易所	中国香港	10,000	192,417.75	1.86
3	PICC Property & Casualty Co Ltd	中国财险	02328	香港联合交易所	中国香港	22,000	153,523.71	1.48
4	Tsingtao Brewery Co Ltd	青岛啤酒	00168	香港联合交易所	中国香港	2,000	139,567.01	1.35
5	Zijin Mining Group Co Ltd	紫金矿业	02899	香港联合交易所	中国香港	16,000	131,494.01	1.27
6	China Longyuan Power Group Corp Ltd	龙源电力	00916	香港联合交易所	中国香港	10,000	129,646.80	1.25
7	China Tower Corp Ltd	中国铁塔	00788	香港联合交易所	中国香港	130,000	112,286.45	1.08
8	China National Building Material Co Ltd	中国建材	03323	香港联合交易所	中国香港	14,000	100,330.89	0.97
9	WuXi AppTec Co Ltd	药明康德	02359	香港联合交易所	中国香港	1,100	98,304.09	0.95

				所				
10	CITIC Securities Co Ltd	中信证券	06030	香港联合交易所	中国香港	6,500	97,500.21	0.94
11	Ganfeng Lithium Co Ltd	赣锋锂业	01772	香港联合交易所	中国香港	1,320	97,476.27	0.94
12	Genscript Biotech Corp	金斯瑞生物科技	01548	香港联合交易所	中国香港	4,000	97,320.62	0.94
13	COSCO SHIPPING Holdings Co Ltd	中远海控	01919	香港联合交易所	中国香港	9,500	89,042.38	0.86
14	China Telecom Corp Ltd	中国电信	00728	香港联合交易所	中国香港	38,000	86,767.58	0.84
15	China Vanke Co Ltd	万科	02202	香港联合交易所	中国香港	5,000	84,321.73	0.81
16	Yankuang Energy Group Co Ltd	兖矿能源	01171	香港联合交易所	中国香港	4,000	84,150.70	0.81
17	China Resources Power Holdings Co Ltd	华润电力	00836	香港联合交易所	中国香港	6,000	83,124.47	0.80
18	China Conch Venture Holdings Ltd	海螺创业	00586	香港联合交易所	中国香港	5,500	80,430.62	0.78
19	China Coal Energy Co Ltd	中煤能源	01898	香港联合交易所	中国香港	13,000	73,931.18	0.71
20	Kingsoft Corp Ltd	金山软件	03888	香港联合交易所	中国香港	2,800	73,272.68	0.71
21	China Power International Development Ltd	中国电力	02380	香港联合交易所	中国香港	16,000	68,141.54	0.66
22	Fuyao Glass Industry Group Co Ltd	福耀玻璃	03606	香港联合交易所	中国香港	2,000	68,073.12	0.66
23	Sinopharm Group Co Ltd	国药控股	01099	香港联合交易所	中国香港	4,000	65,062.86	0.63



24	Guangzhou Automobile Group Co Ltd	广汽集团	02238	香港联合交易所	中国香港	10,000	64,908.92	0.63
25	Weichai Power Co Ltd	潍柴动力	02338	香港联合交易所	中国香港	6,000	63,934.00	0.62
26	China International Capital Corp Ltd	中金公司	03908	香港联合交易所	中国香港	4,400	62,914.62	0.61
27	Shandong Weigao Group Medical Polymer Co Ltd	威高股份	01066	香港联合交易所	中国香港	8,000	62,394.66	0.60
28	Swire Pacific Ltd	太古股份公司	00019	香港联合交易所	中国香港	1,500	59,970.20	0.58
29	Zhuzhou CRRC Times Electric Co Ltd	时代电气	03898	香港联合交易所	中国香港	1,800	59,572.54	0.57
30	Samsonite International SA	新秀丽	01910	香港联合交易所	中国香港	4,300	57,439.69	0.55
31	ASMPT Ltd	ASM PACIFIC	00522	香港联合交易所	中国香港	1,000	56,998.41	0.55
32	Chinasoft International Ltd	中国软件国际	00354	香港联合交易所	中国香港	8,000	54,937.41	0.53
33	Topsports International Holdings Ltd	滔搏	06110	香港联合交易所	中国香港	9,000	54,877.54	0.53
34	Xtep International Holdings Ltd	特步国际	01368	香港联合交易所	中国香港	4,500	54,646.64	0.53
35	China Railway Group Ltd	中国中铁	00390	香港联合交易所	中国香港	13,000	53,919.73	0.52
36	CGN Power Co Ltd	中国广核	01816	香港联合交易所	中国香港	33,000	53,620.41	0.52
37	Jiumaojiu International Holdings Ltd	九毛九	09922	香港联合交易所	中国香港	3,000	53,492.13	0.52
38	Yadea Group Holdings Ltd	雅迪控股	01585	香港联合交易所	中国香港	4,000	52,542.87	0.51

				所				
39	Tongcheng Travel Holdings Ltd	同程旅行	00780	香港联合交易所	中国香港	3,600	51,968.19	0.50
40	Huatai Securities Co Ltd	华泰证券	06886	香港联合交易所	中国香港	5,200	51,762.94	0.50
41	China Minsheng Banking Corp Ltd	民生银行	01988	香港联合交易所	中国香港	21,500	51,482.44	0.50
42	People's Insurance Co Group of China Ltd/The	中国人保	01339	香港联合交易所	中国香港	25,000	51,311.40	0.50
43	New China Life Insurance Co Ltd	新华保险	01336	香港联合交易所	中国香港	2,700	50,913.74	0.49
44	Kingboard Holdings Ltd	建滔集团	00148	香港联合交易所	中国香港	2,000	50,798.29	0.49
45	ZhongAn Online P&C Insurance Co Ltd	众安在线	06060	香港联合交易所	中国香港	2,300	50,255.24	0.48
46	Bank of East Asia Ltd/The	东亚银行	00023	香港联合交易所	中国香港	5,200	49,094.75	0.47
47	CIFI Holdings Group Co Ltd	旭辉控股集团	00884	香港联合交易所	中国香港	14,480	48,789.62	0.47
48	Hua Hong Semiconductor Ltd	华虹半导体	01347	香港联合交易所	中国香港	2,000	48,574.79	0.47
49	China Communications Construction Co Ltd	中国交建	01800	香港联合交易所	中国香港	14,000	48,369.55	0.47
50	China Jinmao Holdings Group Ltd	中国金茂	00817	香港联合交易所	中国香港	26,000	46,915.72	0.45
51	PCCW Ltd	电讯盈科	00008	香港联合交易所	中国香港	13,000	46,137.50	0.45
52	China Merchants Port Holdings Co	招商局港	00144	香港联合交易所	中国香港	4,000	45,632.94	0.44

	Ltd	口		所				
53	China Literature Ltd	阅文集团	00772	香港联合交易所	中国香港	1,400	45,376.38	0.44
54	Hygeia Healthcare Holdings Co Ltd	海吉亚医疗	06078	香港联合交易所	中国香港	1,000	44,598.16	0.43
55	China State Construction International Holdings Ltd	中国建筑国际	03311	香港联合交易所	中国香港	6,000	44,538.30	0.43
56	JS Global Lifestyle Co Ltd	JS 环球生活	01691	香港联合交易所	中国香港	5,000	43,700.21	0.42
57	China Meidong Auto Holdings Ltd	美东汽车	01268	香港联合交易所	中国香港	2,000	42,246.39	0.41
58	Dongyue Group Ltd	东岳集团	00189	香港联合交易所	中国香港	5,000	41,989.83	0.41
59	China Medical System Holdings Ltd	康哲药业	00867	香港联合交易所	中国香港	4,000	41,870.10	0.40
60	Bosideng International Holdings Ltd	波司登	03998	香港联合交易所	中国香港	10,000	41,647.75	0.40
61	China Traditional Chinese Medicine Holdings Co Ltd	中国中药	00570	香港联合交易所	中国香港	10,000	41,476.72	0.40
62	Dongfeng Motor Group Co Ltd	东风集团股份	00489	香港联合交易所	中国香港	8,000	40,775.46	0.39
63	China Galaxy Securities Co Ltd	中国银河	06881	香港联合交易所	中国香港	10,500	40,677.11	0.39
64	Hysan Development Co Ltd	希慎兴业	00014	香港联合交易所	中国香港	2,000	40,450.49	0.39
65	Pharmaron Beijing Co Ltd	康龙化成	03759	香港联合交易所	中国香港	600	40,305.10	0.39
66	Huaneng Power International Inc	华能国际	00902	香港联合交易所	中国香港	12,000	40,125.51	0.39

67	China Everbright Environment Group Ltd	光大环境	00257	香港联合交易所	中国香港	10,000	39,595.30	0.38
68	China Oilfield Services Ltd	中海油服	02883	香港联合交易所	中国香港	6,000	39,458.47	0.38
69	China Ruyi Holdings Ltd	中国儒意	00136	香港联合交易所	中国香港	16,000	39,407.16	0.38
70	TravelSky Technology Ltd	中国民航信息网络	00696	香港联合交易所	中国香港	3,000	39,099.29	0.38
71	Pacific Basin Shipping Ltd	太平洋航运	02343	香港联合交易所	中国香港	15,000	38,483.55	0.37
72	China Taiping Insurance Holdings Co Ltd	中国太平	00966	香港联合交易所	中国香港	4,600	38,079.90	0.37
73	Kerry Properties Ltd	嘉里建设	00683	香港联合交易所	中国香港	2,000	37,286.28	0.36
74	Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co Ltd	复星医药	02196	香港联合交易所	中国香港	1,500	37,264.90	0.36
75	Jinxin Fertility Group Ltd	锦欣生殖	01951	香港联合交易所	中国香港	6,000	37,098.14	0.36
76	Golden Solar New Energy Technology Holdings Ltd	金阳新能源	01121	香港联合交易所	中国香港	4,000	37,081.04	0.36
77	Minth Group Ltd	敏实集团	00425	香港联合交易所	中国香港	2,000	36,602.13	0.35
78	C&D International Investment Group Ltd	建发国际集团	01908	香港联合交易所	中国香港	2,000	36,260.06	0.35
79	China Overseas Property Holdings Ltd	中海物业	02669	香港联合交易所	中国香港	5,000	36,131.78	0.35
80	China Resources Cement Holdings Ltd	华润水泥控股	01313	香港联合交易所	中国香港	8,000	36,054.81	0.35
81	Beijing	北京	00392	香港联	中国	1,500	35,789.70	0.35

	Enterprises Holdings Ltd	控股		合 交 易 所	香 港			
82	Air China Ltd	中国 国航	00753	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	6,000	34,994.37	0.34
83	CRRC Corp Ltd	中国 中车	01766	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	14,000	34,960.17	0.34
84	Man Wah Holdings Ltd	敏华 控股	01999	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	4,800	34,809.65	0.34
85	Greentown China Holdings Ltd	绿城 中国	03900	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	2,500	34,763.47	0.34
86	China Everbright Bank Co Ltd	光大 银行	06818	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	16,000	34,754.92	0.34
87	Yuexiu Property Co Ltd	越秀 地产	00123	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	4,000	34,412.85	0.33
88	ZTE Corp	中兴 通讯	00763	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	2,200	34,392.32	0.33
89	InnoCare Pharma Ltd	诺诚 健华	09969	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	3,000	34,327.33	0.33
90	Haitian International Holdings Ltd	海天 国际	01882	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	2,000	34,293.12	0.33
91	Nine Dragons Paper Holdings Ltd	玖龙 纸业	02689	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	6,000	34,070.77	0.33
92	BOC Aviation Ltd	中银 航空 租赁	02588	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	600	33,839.87	0.33
93	CMOC Group Ltd	洛阳 钼业	03993	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	9,000	33,711.59	0.33
94	Yum China Holdings Inc	百胜 中国	09987	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	100	32,736.67	0.32
95	LK Technology Holdings Ltd	力劲 科技	00558	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	2,500	32,069.63	0.31

96	GF Securities Co Ltd	广发证券	01776	香港联交所	中国香港	3,600	31,956.74	0.31
97	NWS Holdings Ltd	新创建集团	00659	香港联交所	中国香港	5,000	31,855.83	0.31
98	Hangzhou Tigermed Consulting Co Ltd	泰格医药	03347	香港联交所	中国香港	400	31,026.29	0.30
99	AAC Technologies Holdings Inc	瑞声科技	02018	香港联交所	中国香港	2,000	30,889.46	0.30
100	AviChina Industry & Technology Co Ltd	中航科工	02357	香港联交所	中国香港	8,000	30,718.42	0.30
101	China Cinda Asset Management Co Ltd	中国信达	01359	香港联交所	中国香港	29,000	30,504.63	0.29
102	Aluminum Corp of China Ltd	中国铝业	02600	香港联交所	中国香港	12,000	30,478.97	0.29
103	China Lesso Group Holdings Ltd	中国联塑	02128	香港联交所	中国香港	3,000	30,376.35	0.29
103	Greentown Service Group Co Ltd	绿城服务	02869	香港联交所	中国香港	4,000	30,376.35	0.29
104	Xinjiang Goldwind Science & Technology Co Ltd	金风科技	02208	香港联交所	中国香港	2,400	30,130.05	0.29
105	Shenzhen International Holdings Ltd	深圳国际	00152	香港联交所	中国香港	4,500	29,709.30	0.29
106	Lifetech Scientific Corp	先健科技	01302	香港联交所	中国香港	12,000	29,657.99	0.29
107	Cathay Pacific Airways Ltd	国泰航空	00293	香港联交所	中国香港	4,000	29,384.33	0.28
108	COFCO Joycome Foods Ltd	中粮家佳康	01610	香港联交所	中国香港	9,000	29,247.50	0.28
109	China Yongda Automobiles	永达汽车	03669	香港联交所	中国香港	4,500	28,554.79	0.28

	Services Holdings Ltd			所				
110	COSCO SHIPPING Ports Ltd	中远海运港口有限公司	01199	香港联合交易所	中国香港	6,000	28,426.52	0.27
111	Beijing Enterprises Water Group Ltd	北控水务集团有限公司	00371	香港联合交易所	中国香港	14,000	28,375.20	0.27
112	Far East Horizon Ltd	远东宏信	03360	香港联合交易所	中国香港	5,000	28,135.75	0.27
113	Fortune Real Estate Investment Trust	置富产业信托	00778	香港联合交易所	中国香港	5,000	27,793.68	0.27
114	Jiangxi Copper Co Ltd	江西铜业	00358	香港联合交易所	中国香港	3,000	27,554.22	0.27
115	Weimob Inc	微盟集团	02013	香港联合交易所	中国香港	6,000	27,502.91	0.27
116	Beijing Capital International Airport Co Ltd	北京首都机场股份	00694	香港联合交易所	中国香港	6,000	27,451.60	0.26
117	China Railway Construction Corp Ltd	中国铁建	01186	香港联合交易所	中国香港	6,500	27,293.39	0.26
118	Jiangsu Expressway Co Ltd	宁沪高速	00177	香港联合交易所	中国香港	4,000	27,024.00	0.26
119	A-Living Smart City Services Co Ltd	雅生活服务	03319	香港联合交易所	中国香港	2,500	26,981.24	0.26
120	Angelalign Technology Inc	时代天使	06699	香港联合交易所	中国香港	200	26,887.17	0.26
121	Shanghai Pharmaceuticals Holding Co Ltd	上海医药	02607	香港联合交易所	中国香港	2,400	26,681.93	0.26
122	Linklogis Inc	联易	09959	香港联	中国	4,000	26,545.10	0.26

		融科技		合 交 易 所	香 港			
123	Shandong Gold Mining Co Ltd	山东黄金	01787	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	2,250	26,438.20	0.26
124	VTech Holdings Ltd	VTECH HOLDINGS	00303	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	500	26,382.61	0.25
125	Alibaba Pictures Group Ltd	阿里影业	01060	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	40,000	26,339.85	0.25
126	L'Occitane International SA	L'OC CITANE	00973	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	1,250	26,190.19	0.25
127	Hopson Development Holdings Ltd	合生创展集团	00754	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	2,530	25,920.30	0.25
128	China Resources Pharmaceutical Group Ltd	华润医药	03320	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	5,500	25,069.89	0.24
129	Guotai Junan Securities Co Ltd	国泰君安	02611	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	3,000	25,065.62	0.24
130	Kingboard Laminates Holdings Ltd	建滔积层板	01888	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	3,000	24,834.72	0.24
131	HUTCHMED China Ltd	和黄医药	00013	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	1,500	24,809.06	0.24
132	Zhejiang Expressway Co Ltd	浙江沪杭甬	00576	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	4,000	24,766.30	0.24
133	United Energy Group Ltd	联合能源集团	00467	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	30,000	24,116.36	0.23
134	China Communications Services Corp Ltd	中国通信服务股份有限公司	00552	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	8,000	23,603.24	0.23
134	Flat Glass Group Co Ltd	福莱特	06865	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	1,000	23,603.24	0.23



				所				
135	Vitasoy International Holdings Ltd	VITA SOY INT'L	00345	香港联合交易所	中国香港	2,000	23,466.41	0.23
136	Helens International Holdings Co Ltd	海伦司	09869	香港联合交易所	中国香港	1,500	23,218.41	0.22
137	Uni-President China Holdings Ltd	统一企业中国	00220	香港联合交易所	中国香港	4,000	23,021.71	0.22
138	HKBN Ltd	香港宽频	01310	香港联合交易所	中国香港	3,000	22,859.23	0.22
139	NagaCorp Ltd	金界控股	03918	香港联合交易所	中国香港	4,000	21,961.28	0.21
140	Yue Yuen Industrial Holdings Ltd	裕元集团	00551	香港联合交易所	中国香港	2,500	21,850.10	0.21
141	Shanghai Junshi Biosciences Co Ltd	君实生物	01877	香港联合交易所	中国香港	600	21,679.07	0.21
142	Cafe de Coral Holdings Ltd	大家乐集团	00341	香港联合交易所	中国香港	2,000	21,585.00	0.21
143	Fufeng Group Ltd	阜丰集团	00546	香港联合交易所	中国香港	5,000	21,508.03	0.21
144	Sany Heavy Equipment International Holdings Co Ltd	三一国际	00631	香港联合交易所	中国香港	3,000	21,396.85	0.21
145	3SBio Inc	三生制药	01530	香港联合交易所	中国香港	4,000	21,345.54	0.21
146	SJM Holdings Ltd	澳博控股	00880	香港联合交易所	中国香港	7,000	21,311.33	0.21
147	Champion REIT	冠君产业信托	02778	香港联合交易所	中国香港	7,000	20,892.29	0.20
148	First Pacific Co Ltd	第一太平	00142	香港联合交易所	中国香港	8,000	20,798.22	0.20

				所				
149	Xinyi Energy Holdings Ltd	信义能源	03868	香港联合交易所	中国香港	6,000	20,627.18	0.20
150	Zhaojin Mining Industry Co Ltd	招金矿业	01818	香港联合交易所	中国香港	3,500	20,533.11	0.20
151	China Merchants Securities Co Ltd	招商证券	06099	香港联合交易所	中国香港	2,800	20,401.41	0.20
152	New Horizon Health Ltd	诺辉健康	06606	香港联合交易所	中国香港	1,000	20,182.48	0.19
153	MMG Ltd	五矿资源	01208	香港联合交易所	中国香港	8,000	19,977.24	0.19
154	China Education Group Holdings Ltd	中教控股	00839	香港联合交易所	中国香港	3,000	19,908.82	0.19
154	Seazen Group Ltd	新城发展	01030	香港联合交易所	中国香港	6,000	19,908.82	0.19
155	Vobile Group Ltd	阜博集团	03738	香港联合交易所	中国香港	5,000	19,840.41	0.19
156	Akeso Inc	康方生物	09926	香港联合交易所	中国香港	1,000	19,712.13	0.19
157	Grand Pharmaceutical Group Ltd	远大医药	00512	香港联合交易所	中国香港	5,000	19,412.81	0.19
158	Fu Shou Yuan International Group Ltd	福寿园	01448	香港联合交易所	中国香港	4,000	19,327.29	0.19
159	Sinotruk Hong Kong Ltd	中国重汽	03808	香港联合交易所	中国香港	2,000	18,814.18	0.18
160	Remegen Co Ltd	荣昌生物	09995	香港联合交易所	中国香港	500	18,792.80	0.18
161	Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co Ltd	中联重科	01157	香港联合交易所	中国香港	5,200	18,632.88	0.18

162	China International Marine Containers Group Co Ltd	中集集团	02039	香港联合交易所	中国香港	1,700	18,492.63	0.18
163	Realord Group Holdings Ltd	伟禄集团	01196	香港联合交易所	中国香港	2,000	18,027.41	0.17
164	China Overseas Grand Oceans Group Ltd	中国海外宏洋集团	00081	香港联合交易所	中国香港	5,000	17,830.71	0.17
165	CSC Financial Co Ltd	中信建投	06066	香港联合交易所	中国香港	2,500	17,787.95	0.17
166	Zhongyu Energy Holdings Ltd	中裕能源	03633	香港联合交易所	中国香港	3,000	17,625.47	0.17
167	Jinke Smart Services Group Co Ltd	金科服务	09666	香港联合交易所	中国香港	1,000	17,274.84	0.17
168	Luk Fook Holdings International Ltd	六福集团	00590	香港联合交易所	中国香港	1,000	17,232.08	0.17
169	Vinda International Holdings Ltd	维达国际	03331	香港联合交易所	中国香港	1,000	17,189.32	0.17
170	CIFI Ever Sunshine Services Group Ltd	旭辉永升服务	01995	香港联合交易所	中国香港	2,000	17,103.80	0.17
170	Poly Property Services Co Ltd	保利物业服务股份有限公司	06049	香港联合交易所	中国香港	400	17,103.80	0.17
171	Chongqing Rural Commercial Bank Co Ltd	渝农商行	03618	香港联合交易所	中国香港	7,000	16,881.45	0.16
172	Legend Holdings Corp	联想控股	03396	香港联合交易所	中国香港	1,900	16,736.07	0.16
173	Shougang Fushan Resources Group Ltd	首钢资源	00639	香港联合交易所	中国香港	6,000	16,727.52	0.16

174	China Youran Dairy Group Ltd	优然牧业	09858	香港联交所	中国香港	6,000	16,624.89	0.16
175	Luye Pharma Group Ltd	绿叶制药	02186	香港联交所	中国香港	7,500	16,547.93	0.16
176	Sun Art Retail Group Ltd	高鑫零售	06808	香港联交所	中国香港	7,500	16,355.51	0.16
177	Sunac Services Holdings Ltd	融创服务	01516	香港联交所	中国香港	4,000	16,317.03	0.16
178	Zhou Hei Ya International Holdings Co Ltd	周黑鸭	01458	香港联交所	中国香港	3,500	16,163.09	0.16
178	Differ Group Holding Co Ltd	鼎丰集团控股	06878	香港联交所	中国香港	10,000	16,163.09	0.16
179	Koolearn Technology Holding Ltd	新东方在线	01797	香港联交所	中国香港	1,000	16,111.78	0.16
180	Kintor Pharmaceutical Ltd	开拓药业	09939	香港联交所	中国香港	1,000	15,992.05	0.15
181	United Laboratories International Holdings Ltd/The	联邦制药	03933	香港联交所	中国香港	4,000	15,906.53	0.15
182	CStone Pharmaceuticals	基石药业	02616	香港联交所	中国香港	3,500	15,714.12	0.15
183	Yuexiu Real Estate Investment Trust	越秀房产信托基金	00405	香港联交所	中国香港	6,000	15,701.29	0.15
184	China Southern Airlines Co Ltd	南方航空	01055	香港联交所	中国香港	4,000	15,530.25	0.15
185	Huabao International Holdings Ltd	华宝国际	00336	香港联交所	中国香港	3,000	15,496.04	0.15
185	Yuexiu Transport Infrastructure Ltd	越秀交通基建	01052	香港联交所	中国香港	4,000	15,496.04	0.15

		有限公司						
186	Yeahka Ltd	移卡	09923	香港联合交易所	中国香港	800	15,188.17	0.15
187	Venus MedTech Hangzhou Inc	启明医疗	02500	香港联合交易所	中国香港	1,000	14,965.83	0.14
188	Sincere Pharmaceutical Group Ltd	先声药业	02096	香港联合交易所	中国香港	2,000	14,709.27	0.14
189	Tianneng Power International Ltd	天能动力	00819	香港联合交易所	中国香港	2,000	14,521.13	0.14
190	Nexteer Automotive Group Ltd	耐世特	01316	香港联合交易所	中国香港	3,000	14,469.81	0.14
190	Brii Biosciences Ltd	腾盛博药	02137	香港联合交易所	中国香港	2,000	14,469.81	0.14
191	Kerry Logistics Network Ltd	嘉里物流	00636	香港联合交易所	中国香港	1,000	14,435.61	0.14
191	NetDragon Websoft Holdings Ltd	网龙	00777	香港联合交易所	中国香港	1,000	14,435.61	0.14
192	CIMC Enric Holdings Ltd	中集安瑞科	03899	香港联合交易所	中国香港	2,000	14,418.50	0.14
193	SSY Group Ltd	石四药集团	02005	香港联合交易所	中国香港	4,000	14,332.98	0.14
194	Sihuan Pharmaceutical Holdings Group Ltd	四环医药	00460	香港联合交易所	中国香港	13,000	14,230.36	0.14
195	Keymed Biosciences Inc	康诺亚	02162	香港联合交易所	中国香港	500	14,110.64	0.14
196	XD Inc	心动公司	02400	香港联合交易所	中国香港	800	13,990.91	0.13
197	CanSino Biologics Inc	康希诺	06185	香港联合交易所	中国香港	200	13,742.90	0.13

				所				
198	China Gold International Resources Corp Ltd	中国黄金国际	02099	香港联合交易所	中国香港	700	13,499.17	0.13
199	Gemdale Properties & Investment Corp Ltd	金地商置	00535	香港联合交易所	中国香港	22,000	13,358.07	0.13
200	Skyworth Group Ltd	创维集团	00751	香港联合交易所	中国香港	4,000	13,272.55	0.13
201	Shanghai Electric Group Co Ltd	上海电气	02727	香港联合交易所	中国香港	8,000	13,204.13	0.13
202	H World Group Ltd	华住集团	01179	香港联合交易所	中国香港	500	12,998.89	0.13
203	Yidu Tech Inc	医渡科技	02158	香港联合交易所	中国香港	1,600	12,807.33	0.12
204	GOME Retail Holdings Ltd	国美零售	00493	香港联合交易所	中国香港	39,000	12,673.92	0.12
205	CGN New Energy Holdings Co Ltd	中广核新能源	01811	香港联合交易所	中国香港	4,000	12,656.81	0.12
206	China Everbright Ltd	中国光大控股	00165	香港联合交易所	中国香港	2,000	12,622.60	0.12
207	China Dili Group	中国地利	01387	香港联合交易所	中国香港	10,000	12,571.29	0.12
208	Sino-Ocean Group Holding Ltd	远洋集团	03377	香港联合交易所	中国香港	11,000	12,511.43	0.12
209	CARsgen Therapeutics Holdings Ltd	科济药业	02171	香港联合交易所	中国香港	1,000	12,502.88	0.12
210	China Water Affairs Group Ltd	中国水务	00855	香港联合交易所	中国香港	2,000	12,485.77	0.12
211	China Nonferrous Mining Corp Ltd	中国有色	01258	香港联合交易所	中国香港	4,000	12,383.15	0.12

		矿业		所				
212	Genertec Universal Medical Group Co Ltd	环球 医疗	02666	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	3,000	12,289.08	0.12
213	BAIC Motor Corp Ltd	北京 汽车	01958	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	5,500	12,276.25	0.12
214	MGM China Holdings Ltd	美高 梅中 国	02282	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	3,200	12,177.91	0.12
215	Ocumension Therapeutics	欧康 维视 生物	01477	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	1,000	12,006.87	0.12
216	CMGE Technology Group Ltd	中手 游	00302	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	6,000	11,852.93	0.11
217	Livzon Pharmaceutical Group Inc	丽珠 集团	01513	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	500	11,609.20	0.11
218	China Risun Group Ltd	中国 旭阳 集团	01907	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	4,000	11,562.17	0.11
219	Lee & Man Paper Manufacturing Ltd	理文 造纸	02314	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	4,000	11,527.96	0.11
220	Sinopec Shanghai Petrochemical Co Ltd	上海 石化	00338	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	10,000	11,459.55	0.11
221	Zai Lab Ltd	再鼎 医药	09688	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	500	11,438.17	0.11
222	China Travel International Investment Hong Kong Ltd	香港 中旅	00308	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	8,000	11,220.09	0.11
223	China Railway Signal & Communication Corp Ltd	中国 通号	03969	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	5,000	11,202.99	0.11
224	Datang International Power Generation Co Ltd	大唐 发电	00991	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	10,000	11,117.47	0.11
224	CITIC Telecom	中信	01883	香 港 联	中 国	5,000	11,117.47	0.11

	International Holdings Ltd	国际电讯		合 交 易 所	香 港			
225	Ascentage Pharma Group International	亚盛医药	06855	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	600	10,929.33	0.11
226	China Tobacco International HK Co Ltd	中烟香港	06055	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	1,000	10,895.12	0.11
227	Shui On Land Ltd	瑞安房地产	00272	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	12,000	10,878.02	0.10
228	China Resources Medical Holdings Co Ltd	华润医疗	01515	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	2,500	10,860.91	0.10
229	Midea Real Estate Holding Ltd	美的置业	03990	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	1,000	10,843.81	0.10
230	Beijing Tong Ren Tang Chinese Medicine Co Ltd	同仁堂国药	03613	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	1,000	10,826.71	0.10
231	VSTECS Holdings Ltd	伟仕佳杰	00856	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	2,000	10,741.19	0.10
231	Agile Group Holdings Ltd	雅居乐集团	03383	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	4,000	10,741.19	0.10
232	Towngas Smart Energy Co Ltd	港华智慧能源	01083	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	3,000	10,724.08	0.10
233	Microport Cardioflow Medtech Corp	心通医疗	02160	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	4,000	10,706.98	0.10
234	Shenzhen Investment Ltd	深圳控股	00604	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	8,000	10,672.77	0.10
235	Hong Kong Technology Venture Co Ltd	香港科技探索	01137	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	2,000	10,553.04	0.10
236	PAX Global Technology Ltd	百富环球	00327	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	2,000	10,450.42	0.10
237	Greentown Management Holdings Co Ltd	绿城管理控股	09979	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	2,000	10,364.90	0.10



238	China Eastern Airlines Corp Ltd	中国东航	00670	香港联合交易所	中国香港	4,000	10,296.49	0.10
239	SUNeVision Holdings Ltd	新意网集团	01686	香港联合交易所	中国香港	2,000	10,228.07	0.10
240	Value Partners Group Ltd	惠理集团	00806	香港联合交易所	中国香港	4,000	10,125.45	0.10
241	China Modern Dairy Holdings Ltd	现代牧业	01117	香港联合交易所	中国香港	10,000	10,091.24	0.10
242	AK Medical Holdings Ltd	爱康医疗	01789	香港联合交易所	中国香港	2,000	10,057.03	0.10
243	Kangji Medical Holdings Ltd	康基医疗	09997	香港联合交易所	中国香港	1,500	9,992.90	0.10
244	Digital China Holdings Ltd	神州控股	00861	香港联合交易所	中国香港	3,000	9,980.07	0.10
245	Melco International Development Ltd	新濠国际发展	00200	香港联合交易所	中国香港	2,000	9,920.20	0.10
246	Guangzhou R&F Properties Co Ltd	富力地产	02777	香港联合交易所	中国香港	5,600	9,913.36	0.10
247	K Wah International Holdings Ltd	嘉华国际	00173	香港联合交易所	中国香港	4,000	9,886.00	0.10
248	Lonking Holdings Ltd	中国龙工	03339	香港联合交易所	中国香港	6,000	9,749.17	0.09
249	Poly Property Group Co Ltd	保利置业集团	00119	香港联合交易所	中国香港	6,000	9,697.85	0.09
249	Shanghai Industrial Holdings Ltd	上海实业控股	00363	香港联合交易所	中国香港	1,000	9,697.85	0.09
249	Shimao Services Holdings Ltd	世茂服务	00873	香港联合交易所	中国香港	3,000	9,697.85	0.09
250	Tiangong International Co	天工国际	00826	香港联合交易所	中国香港	4,000	9,680.75	0.09

	Ltd			所				
251	KWG Group Holdings Ltd	合景泰富集团	01813	香港联合交易所	中国香港	4,500	9,620.89	0.09
251	Everest Medicines Ltd	云顶新耀	01952	香港联合交易所	中国香港	500	9,620.89	0.09
252	FIH Mobile Ltd	富智康集团	02038	香港联合交易所	中国香港	10,000	9,578.13	0.09
253	TCL Electronics Holdings Ltd	TCL 电子	01070	香港联合交易所	中国香港	3,000	9,518.26	0.09
254	Sunlight Real Estate Investment Trust	阳光房地产基金	00435	香港联合交易所	中国香港	3,000	9,364.33	0.09
255	Sinopec Kantons Holdings Ltd	中石化冠德	00934	香港联合交易所	中国香港	4,000	9,201.84	0.09
256	Fosun Tourism Group	复星旅游文化	01992	香港联合交易所	中国香港	800	9,099.22	0.09
257	Theme International Holdings Ltd	荣晖国际	00990	香港联合交易所	中国香港	10,000	9,065.01	0.09
258	Antengene Corp Ltd	德琪医药	06996	香港联合交易所	中国香港	1,500	9,043.63	0.09
259	China South City Holdings Ltd	华南城	01668	香港联合交易所	中国香港	16,000	9,030.81	0.09
260	Mobvista Inc	汇量科技	01860	香港联合交易所	中国香港	2,000	8,945.29	0.09
261	Bank of Chongqing Co Ltd	重庆银行	01963	香港联合交易所	中国香港	2,500	8,936.74	0.09
262	SOHO China Ltd	SOHO 中国	00410	香港联合交易所	中国香港	7,000	8,919.63	0.09
263	Johnson Electric Holdings Ltd	德昌电机控股	00179	香港联合交易所	中国香港	1,000	8,722.94	0.08

263	IGG Inc	IGG	00799	香港联交所	中国香港	3,000	8,722.94	0.08
264	Nayuki Holdings Ltd	奈雪的茶	02150	香港联交所	中国香港	1,500	8,530.52	0.08
265	Haitong International Securities Group Ltd	海通国际	00665	香港联交所	中国香港	8,800	8,428.75	0.08
266	Joy Spreader Group Inc	乐享集团	06988	香港联交所	中国香港	4,000	8,415.07	0.08
267	C-Mer Eye Care Holdings Ltd	希玛眼科	03309	香港联交所	中国香港	2,000	8,397.97	0.08
267	Bairong Inc	百融云	06608	香港联交所	中国香港	1,000	8,397.97	0.08
268	KWG Living Group Holdings Ltd	合景悠活	03913	香港联交所	中国香港	4,000	8,380.86	0.08
269	LVGEM China Real Estate Investment Co Ltd	绿景中国地产	00095	香港联交所	中国香港	8,000	8,278.24	0.08
270	Maoyan Entertainment	猫眼娱乐	01896	香港联交所	中国香港	1,200	8,209.82	0.08
271	Shoucheng Holdings Ltd	首程控股	00697	香港联交所	中国香港	8,000	8,072.99	0.08
272	Pacific Textiles Holdings Ltd	互太纺织	01382	香港联交所	中国香港	3,000	8,055.89	0.08
273	China High Speed Transmission Equipment Group Co Ltd	中国高速传动	00658	香港联交所	中国香港	2,000	7,953.27	0.08
274	Radiance Holdings Group Co Ltd	金辉控股	09993	香港联交所	中国香港	2,000	7,867.75	0.08
275	S-Enjoy Service Group Co Ltd	新城悦服务	01755	香港联交所	中国香港	1,000	7,807.88	0.08

276	Dah Sing Financial Holdings Ltd	大新金融	00440	香港交易所	中国香港	400	7,645.40	0.07
277	SY Holdings Group Ltd	盛业资本	06069	香港交易所	中国香港	1,500	7,555.60	0.07
278	Chervon Holdings Ltd	Chervon Holdings Ltd	02285	香港交易所	中国香港	200	7,542.78	0.07
279	Chow Sang Sang Holdings International Ltd	周生生	00116	香港交易所	中国香港	1,000	7,482.91	0.07
280	Xiabuxiabu Catering Management China Holdings Co Ltd	呷哺呷哺	00520	香港交易所	中国香港	2,000	7,337.53	0.07
281	Global New Material International Holdings Ltd	环球新材国际	06616	香港交易所	中国香港	2,000	7,183.60	0.07
282	China Yuhua Education Corp Ltd	宇华教育	06169	香港交易所	中国香港	6,000	7,132.28	0.07
283	Texhong Textile Group Ltd	天虹纺织	02678	香港交易所	中国香港	1,000	7,098.08	0.07
284	Ausnutria Dairy Corp Ltd	澳优	01717	香港交易所	中国香港	1,000	7,080.97	0.07
285	Jinchuan Group International Resources Co Ltd	金川国际	02362	香港交易所	中国香港	8,000	7,046.77	0.07
286	Dexin China Holdings Co Ltd	德信中国	02019	香港交易所	中国香港	3,000	6,978.35	0.07
287	Canvest Environmental Protection Group Co Ltd	粤丰环保	01381	香港交易所	中国香港	2,000	6,961.25	0.07
287	HBM Holdings Ltd	和铂医药	02142	香港交易所	中国香港	2,000	6,961.25	0.07

288	JW Cayman Therapeutics Co Ltd	药明 巨诺	02126	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	1,000	6,927.04	0.07
289	Alphamab Oncology	康宁 杰瑞 生物 制药	09966	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	1,000	6,918.49	0.07
290	China New Higher Education Group Ltd	新高 教集 团	02001	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	3,000	6,901.38	0.07
291	Comba Telecom Systems Holdings Ltd	京信 通信	02342	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	6,000	6,875.73	0.07
292	EC Healthcare	医思 健康	02138	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	1,000	6,773.10	0.07
292	West China Cement Ltd	西部 水泥	02233	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	8,000	6,773.10	0.07
293	Times China Holdings Ltd	时代 中国 控股	01233	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	3,000	6,670.48	0.06
293	China Lilang Ltd	中国 利郎	01234	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	2,000	6,670.48	0.06
294	Autohome Inc	汽车 之家	02518	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	100	6,661.93	0.06
295	Peijia Medical Ltd	沛嘉 医疗	09996	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	1,000	6,636.27	0.06
296	Redsun Properties Group Ltd	弘阳 地产	01996	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	3,000	6,593.51	0.06
297	China Oriental Group Co Ltd	中国 东方 集团	00581	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	4,000	6,533.65	0.06
298	Dah Sing Banking Group Ltd	大新 银行 集团	02356	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	1,200	6,516.55	0.06
299	FIT Hon Teng Ltd	鸿腾 六零 八八 精密	06088	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	7,000	6,405.37	0.06

		科技股份有限						
300	Tian Lun Gas Holdings Ltd	天伦燃气	01600	香港联合交易所	中国香港	1,500	6,324.13	0.06
301	Huijing Holdings Co Ltd	汇景控股	09968	香港联合交易所	中国香港	4,000	6,123.16	0.06
302	Sinofert Holdings Ltd	中化化肥	00297	香港联合交易所	中国香港	6,000	5,900.81	0.06
303	China Renaissance Holdings Ltd	华兴资本控股	01911	香港联合交易所	中国香港	700	5,890.55	0.06
304	Viva Biotech Holdings	维亚生物	01873	香港联合交易所	中国香港	2,500	5,815.29	0.06
305	Zhuguang Holdings Group Co Ltd	珠光控股	01176	香港联合交易所	中国香港	6,000	5,746.88	0.06
305	Kaisa Group Holdings Ltd	佳兆业集团	01638	香港联合交易所	中国香港	8,000	5,746.88	0.06
306	Powerlong Real Estate Holdings Ltd	宝龙地产	01238	香港联合交易所	中国香港	5,000	5,601.49	0.05
307	Guotai Junan International Holdings Ltd	国泰君安国际	01788	香港联合交易所	中国香港	7,000	5,567.29	0.05
308	Hope Education Group Co Ltd	希望教育	01765	香港联合交易所	中国香港	10,000	5,558.74	0.05
309	Asia Cement China Holdings Corp	亚洲水泥(中国)	00743	香港联合交易所	中国香港	1,500	5,515.98	0.05
310	CK Life Sciences Int'l Holdings Inc	长江生命科技	00775	香港联合交易所	中国香港	8,000	5,473.22	0.05
311	Shun Tak Holdings Ltd	信德集团	00242	香港联合交易所	中国香港	4,000	5,370.59	0.05
312	Frontage Holdings	方达	01521	香港联	中国	2,000	5,353.49	0.05

	Corp	控股		合 交 易 所	香 港			
313	China East Education Holdings Ltd	中国东方教育	00667	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	1,500	5,336.39	0.05
314	Zensun Enterprises Ltd	正商实业	00185	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	2,000	5,302.18	0.05
315	Hutchison Telecommunications Hong Kong Holdings Ltd	和记电讯香港	00215	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	4,000	5,131.14	0.05
316	Medlive Technology Co Ltd	医脉通	02192	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	500	4,934.45	0.05
317	CSSC Hong Kong Shipping Co Ltd	中国船舶租赁	03877	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	4,000	4,823.27	0.05
318	Archosaur Games Inc	祖龙娱乐	09990	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	1,000	4,814.72	0.05
319	Road King Infrastructure Ltd	路劲	01098	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	1,000	4,789.06	0.05
320	China Foods Ltd	中国食品	00506	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	2,000	4,754.86	0.05
321	Jacobio Pharmaceuticals Group Co Ltd	加科思	01167	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	900	4,694.99	0.05
322	Q Technology Group Co Ltd	丘钛科技	01478	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	1,000	4,618.03	0.04
322	China SCE Group Holdings Ltd	中骏集团控股	01966	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	5,000	4,618.03	0.04
323	Citychamp Watch & Jewellery Group Ltd	冠城钟表珠宝	00256	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	4,000	4,549.61	0.04
324	Yixin Group Ltd	易鑫集团	02858	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	5,000	4,532.51	0.04
325	Nissin Foods Co Ltd	日清食品	01475	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	1,000	4,489.75	0.04

				所				
326	Health & Happiness H&H International Holdings Ltd	H&H 国际控股	01112	香港 联合交易所	中国香港	500	4,421.33	0.04
327	Vesync Co Ltd	Vesync Co Ltd	02148	香港 联合交易所	中国香港	1,000	4,104.91	0.04
328	Lifestyle International Holdings Ltd	利福国际	01212	香港 联合交易所	中国香港	1,500	4,079.26	0.04
329	Meitu Inc	美图公司	01357	香港 联合交易所	中国香港	4,500	4,002.29	0.04
330	Pou Sheng International Holdings Ltd	宝胜国际	03813	香港 联合交易所	中国香港	5,000	3,805.60	0.04
331	SciClone Pharmaceuticals Holdings Ltd	赛生药业	06600	香港 联合交易所	中国香港	500	3,720.08	0.04
332	China Everbright Greentech Ltd	中国光大绿色环保	01257	香港 联合交易所	中国香港	2,000	3,694.42	0.04
333	Genor Biopharma Holdings Ltd	嘉和生物	06998	香港 联合交易所	中国香港	1,000	3,660.21	0.04
334	China Kepei Education Group Ltd	中国科培	01890	香港 联合交易所	中国香港	2,000	3,523.38	0.03
335	Redco Properties Group Ltd	力高集团	01622	香港 联合交易所	中国香港	2,000	3,437.86	0.03
336	China Dongxiang Group Co Ltd	中国动向	03818	香港 联合交易所	中国香港	9,000	3,425.04	0.03
337	Tongdao Liepin Group	同道猎聘	06100	香港 联合交易所	中国香港	400	3,379.71	0.03
338	Excellence Commercial Property & Facilities Management Group	卓越商企服务	06989	香港 联合交易所	中国香港	1,000	3,369.45	0.03



	Ltd							
339	Gushengtang Holdings Ltd	固生堂	02273	香港联合交易所	中国香港	100	3,335.24	0.03
340	Central China New Life Ltd	建业新生活	09983	香港联合交易所	中国香港	1,000	3,326.69	0.03
341	Weibo Corp	微博公司	09898	香港联合交易所	中国香港	20	3,256.56	0.03
342	Sun Hung Kai & Co Ltd	新鸿基有限公司	00086	香港联合交易所	中国香港	1,000	3,138.55	0.03
343	China Aoyuan Group Ltd	中国奥园	03883	香港联合交易所	中国香港	3,000	3,027.37	0.03
344	Fire Rock Holdings Ltd	火岩控股	01909	香港联合交易所	中国香港	6,000	2,873.44	0.03
345	Tianli International Holdings Ltd	天立国际控股	01773	香港联合交易所	中国香港	3,000	2,719.50	0.03
346	Greenland Hong Kong Holdings Ltd	绿地香港	00337	香港联合交易所	中国香港	2,000	2,651.09	0.03
347	Ronshine China Holdings Ltd	融信中国	03301	香港联合交易所	中国香港	1,500	2,501.43	0.02
348	Zhenro Properties Group Ltd	正荣地产	06158	香港联合交易所	中国香港	5,000	2,480.05	0.02
349	Baozun Inc	宝尊电商	09991	香港联合交易所	中国香港	100	2,475.78	0.02
350	Yuzhou Group Holdings Co Ltd	禹洲集团	01628	香港联合交易所	中国香港	6,000	2,385.98	0.02
351	Powerlong Commercial Management Holdings Ltd	宝龙商业	09909	香港联合交易所	中国香港	500	2,274.81	0.02
352	Zhongliang Holdings Group Co	中梁控股	02772	香港联合交易所	中国香港	2,000	2,257.70	0.02

	Ltd			所				
353	Cheerwin Group Ltd	朝云集团	06601	香港联合交易所	中国香港	1,000	2,043.90	0.02
354	Central China Real Estate Ltd	建业地产	00832	香港联合交易所	中国香港	3,000	1,872.87	0.02
355	ANE Cayman Inc	ANE Cayman Inc	09956	香港联合交易所	中国香港	500	1,684.72	0.02
356	Jiayuan International Group Ltd	佳源国际控股	02768	香港联合交易所	中国香港	4,000	1,488.03	0.01
357	E-House China Enterprise Holdings Ltd	易居企业控股	02048	香港联合交易所	中国香港	1,500	1,282.79	0.01
358	Cathay Media And Education Group Inc	华夏视听教育	01981	香港联合交易所	中国香港	1,000	1,051.88	0.01
359	Shinsun Holdings Group Co Ltd	祥生控股集团	02599	香港联合交易所	中国香港	2,000	1,026.23	0.01
360	Glory Sun Financial Group Ltd	宝新金融	01282	香港联合交易所	中国香港	20,000	786.77	0.01
361	Skyfame Realty Holdings Ltd	天誉置业	00059	香港联合交易所	中国香港	8,000	677.31	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	Brilliance China Automotive Holdings Ltd	BRILLIAN CE CHI	01114	香港联合交易所	中国香港	8,000	49,943.10	0.48
2	CHINA LOGISTICS PROPERTY HOL	中国物流资产	01589	香港联合交易所	中国香港	2,000	7,388.84	0.07

3	China Zhongwang Holdings Ltd	中国忠旺	01333	香港联合交易所	中国香港	4,000	5,746.88	0.06
4	CT Environmental Group Ltd	中滔环保(退市)	01363	香港联合交易所	中国香港	16,000	4,652.23	0.04
5	Tenwong International Holdings Ltd	天喔国际(退市)	01219	香港联合交易所	中国香港	8,000	2,599.78	0.03
6	Convoy Global Holdings Ltd	康宏环球(退市)	01019	香港联合交易所	中国香港	270,000	2,309.01	0.02
7	MH Development Ltd	美好发展(退市)	02662	香港联合交易所	中国香港	2,000	1,984.04	0.02
8	CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS COMPANY LTD	辉山乳业(退市)	06863	香港联合交易所	中国香港	212,000	1,813.00	0.02
9	Southern Energy Holdings Group Ltd	南方能源(退市)	01573	香港联合交易所	中国香港	2,000	1,163.06	0.01
10	NATIONAL AGRICULTURAL HOLDINGS LTD	国农控股(退市)	01236	香港联合交易所	中国香港	46,000	1,016.91	0.01
11	Sinic Holdings Group Co Ltd	新力控股集团	02103	香港联合交易所	中国香港	2,000	855.19	0.01
12	Agritrade Resources Ltd	鸿宝资源(退市)	01131	香港联合交易所	中国香港	10,000	709.81	0.01
13	Glory Sun Land Group Ltd	宝新置地	00299	香港联合交易所	中国香港	40	20.52	0.00
14	SMI Holdings Group Ltd	星美控股(退市)	00198	香港联合交易所	中国香港	8,800	7.53	0.00
15	China Huiyuan Juice Group Ltd	汇源果汁	01886	香港联合交易所	中国香港	10,000	0.86	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	GCL Technology Holdings Ltd	3800 HK	147,987.59	1.65
2	China Tower Corp Ltd	788 HK	97,043.60	1.08
3	Angelalign Technology Inc	6699 HK	50,352.91	0.56
4	Golden Solar New Energy Technology Holdings Ltd	1121 HK	43,715.42	0.49
5	China Shenhua Energy Co Ltd	1088 HK	43,372.71	0.48
6	China National Building Material Co Ltd	3323 HK	42,817.02	0.48
7	PICC Property & Casualty Co Ltd	2328 HK	39,678.95	0.44
8	China Longyuan Power Group Corp Ltd	916 HK	39,579.79	0.44
9	Yadea Group Holdings Ltd	1585 HK	39,460.32	0.44
10	HAITONG SECURITIES CO LTD-H	6837 HK	39,387.99	0.44
11	Swire Pacific Ltd	19 HK	39,176.14	0.44
12	CITIC Securities Co Ltd	6030 HK	38,159.02	0.43
13	Zijin Mining Group Co Ltd	2899 HK	38,067.03	0.42
14	AAC Technologies Holdings Inc	2018 HK	36,578.36	0.41
15	WuXi AppTec Co Ltd	2359 HK	36,260.16	0.40
16	Ganfeng Lithium Co Ltd	1772 HK	32,511.70	0.36
17	China Telecom Corp Ltd	728 HK	29,523.00	0.33
18	L'Occitane International SA	973 HK	27,558.16	0.31
19	CIFI Holdings Group Co Ltd	884 HK	25,767.38	0.29
20	China Conch Venture Holdings Ltd	586 HK	25,458.56	0.28

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	ESR Group Ltd	1821 HK	90,971.06	1.01
2	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	2333 HK	74,363.48	0.83
3	SITC International Holdings Co Ltd	1308 HK	68,134.08	0.76
4	China Hongqiao Group Ltd	1378 HK	49,190.37	0.55

5	HAITONG SECURITIES CO LTD-H	6837 HK	40,665.46	0.45
6	Razer Inc	1337 HK	33,601.20	0.37
7	HANG LUNG GROUP LTD	10 HK	25,631.39	0.29
8	China Merchants Port Holdings Co Ltd	144 HK	22,659.48	0.25
9	Zijin Mining Group Co Ltd	2899 HK	20,896.51	0.23
10	China Shenhua Energy Co Ltd	1088 HK	20,742.26	0.23
11	China Conch Environment Protection Holdings Ltd	587 HK	20,513.62	0.23
12	WuXi AppTec Co Ltd	2359 HK	19,563.05	0.22
13	Swire Pacific Ltd	19 HK	19,464.24	0.22
14	Yadea Group Holdings Ltd	1585 HK	19,334.47	0.22
15	Angelalign Technology Inc	6699 HK	19,232.25	0.21
16	SHANGRI-LA ASIA LTD	69 HK	18,785.54	0.21
17	CanSino Biologics Inc	6185 HK	18,217.47	0.20
18	China National Building Material Co Ltd	3323 HK	16,886.06	0.19
19	Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co Ltd	2196 HK	16,037.72	0.18
20	Ganfeng Lithium Co Ltd	1772 HK	15,846.92	0.18

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	2,998,762.17
卖出收入（成交）总额	1,304,311.02

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

本基金投资的前十名证券之一中国财险（2328.HK）的发行主体中国人民财产保险股份有限公司于 2021 年 8 月 25 日因存在未按照规定使用经批准或者备案的保险条款、保险费率的违法行为，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字〔2021〕34 号）。中国财险为本基金跟踪标的指数的成份股。

### 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	—
2	应收清算款	—
3	应收股利	136,068.85
4	应收利息	—
5	应收申购款	28,449.36
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	164,518.21

### 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	1114 HK	BRILLIANCE CHI	49,943.10	0.48	重大事项停牌
2	1589 HK	中国物流资产	7,388.84	0.07	重大事项停牌
3	1333 HK	中国忠旺	5,746.88	0.06	重大事项停牌
4	1363 HK	中滔环保(退市)	4,652.23	0.04	已退市
5	1219 HK	天喔国际(退市)	2,599.78	0.03	已退市

注：中国物流资产，股票代码 1589 HK，已于 2022 年 7 月 15 日起退市。

### 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

份额级别	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（%）
恒生中小 A	1,370	7,083.15	123,788.25	1.28	9,580,128.41	98.72
恒生中小 C	449	2,831.00	238,665.64	18.78	1,032,451.18	81.22
合计	1,819	6,033.55	362,453.89	3.30	10,612,579.59	96.70

注：1、上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2、持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

恒生中小 A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	邵常红	500,374.00	21.75
2	杨凯	329,623.00	14.33
3	范东启	126,921.00	5.52
4	王洪武	94,313.00	4.10
5	钱中明	86,546.00	3.76
6	卢珊珊	85,802.00	3.73

7	殷芳琴	83,536.00	3.63
8	叶宝君	69,200.00	3.01
9	田建化	64,000.00	2.78
10	王中	60,805.00	2.64

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	份额级别	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	恒生中小 A	1,528.75	0.0158
	恒生中小 C	0.00	0.0000
	合计	1,528.75	0.0139

注：上述占基金总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 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	份额级别	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	恒生中小 A	0
	恒生中小 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	恒生中小 A	0
	恒生中小 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	恒生中小 A	恒生中小 C
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	8,059,618.30	877,129.72
本报告期基金总申购份额	3,623,279.42	1,262,813.41
减：本报告期基金总赎回份额	1,978,981.06	868,826.31



本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	9,703,916.66	1,271,116.82

## § 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

1. 根据我司发布的《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第七届董事会第十四次会议审议通过并履行必要程序，自 2022 年 4 月 15 日起，周立新先生因工作安排离任公司副总经理。具体事宜详见公司公告。

2. 根据我司发布的《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第七届董事会第十五次会议审议通过并履行必要程序，自 2022 年 6 月 1 日起，赵冰女士担任公司副总经理，段皓静女士担任公司督察长。自同日起赵冰女士离任公司督察长。具体事宜详见公司公告。

#### 二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部总裁。

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王洪滨任托管业务部高级专家。

### 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

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其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 (%)	
光大证券	2	13,496.04	0.31	8.10	0.19	-
UBS Securities	1	4,289,577.15	99.69	4,173.78	99.81	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东财证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东亚前海	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	3	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-

申万宏源	1	-	-	-	-	-
申万宏源西部	1	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
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	3	-	-	-	-	-
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。

本报告期内本基金租用证券公司交易单元的变更情况如下：

本报告期内本基金新增交易单元：无，退租交易单元：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、规定报刊及本公司网站	2022 年 06 月 30 日
2	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 06 月 29 日
3	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、规定报刊及本公司网站	2022 年 06 月 02 日
4	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、规定报刊及本公司网站	2022 年 04 月 29 日
5	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、规定报刊及本公司网站	2022 年 04 月 22 日
6	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）2022 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 04 月 22 日
7	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、规定报刊及本公司网站	2022 年 04 月 16 日
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	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 04 月 15 日
9	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）2021 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 03 月 29 日
10	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、规定报刊及本公司网站	2022 年 03 月 25 日
11	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加诺亚正行基金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、规定报刊及本公司网站	2022 年 03 月 11 日
12	大成基金管理有限公司关于公司固有资金拟申购旗下偏股型公募基金的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 01 月 27 日
13	大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）2021 年第 4 季度报	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本	2022 年 01 月 21 日

	告	公司网站	
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、规定报刊及本公司网站	2022 年 01 月 19 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

2022 年 8 月 30 日