

# 摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金

## 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：摩根士丹利华鑫基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 27 日

## § 1 重要提示及目录

### 1. 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	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 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	6
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>	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 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>	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本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>	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	42

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	42
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	43
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	43
7.12 投资组合报告附注 .....	43
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>44</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	44
8.3 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 .....	44
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>44</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>45</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	45
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 .....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	45
10.4 基金投资策略的改变 .....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	45
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 .....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	45
10.8 其他重大事件 .....	47
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>48</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 .....	48
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>49</b>
12.1 备查文件目录 .....	49
12.2 存放地点 .....	49
12.3 查阅方式 .....	49

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金
基金简称	大摩基础行业混合
基金主代码	233001
交易代码	233001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004 年 3 月 26 日
基金管理人	摩根士丹利华鑫基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	171,842,203.52 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	分享中国经济持续发展过程所带来的基础行业的稳定增长，为基金份额持有人谋求长期、稳定的投资回报。
投资策略	<p>(1) 股票投资策略</p> <p>基于宏观经济的自上而下方式，结合自下而上个股精选，形成动态股票组合，追求持续稳定收益。</p> <p>(2) 债券投资策略</p> <p>我们以“类别资产配置、久期管理”为核心，通过“自上而下”的投资策略，以长期利率趋势分析为基础，兼顾中短期经济周期、政策方向等因素在类别资产配置、不同市场间的资产配置、券种选择三个层面进行投资管理；并结合使用“自下而上”的投资策略，即收益率曲线分析，久期管理，新债分析，信用分析，流动性分析等方法，实施动态投资管理，动态调整组合的投资品种，以达到预期投资目标。</p> <p>(3) 权证投资策略</p> <p>对权证的投资建立在对标的证券和组合收益风险进行分析的基础上，权证在基金的投资中将主要起到锁定收益和控制风险的作用。以 BS 模型和二叉树模型为基础来对权证进行定价，并根据市场情况对定价模型和参数进行适当修正。在组合构建和操作中运用的投资策略主要包括但不限于保护性看跌策略、抛补的认购权证、双限策略等。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数 $\times$ 55% + 中证综合债券指数 $\times$ 45%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期收益和风险高于货币型基金、债券型基金，而低于股票型基金。

### 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	摩根士丹利华鑫基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	许菲菲	石立平
	联系电话	(0755) 88318883	(010) 63639180
	电子邮箱	xxp1@msfunds. com. cn	shiliping@cebbank. com
客户服务电话	400-8888-668	95595	
传真	(0755) 82990384	(010) 63639132	
注册地址	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第二座第 17 层 01-04 室	北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心	
办公地址	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第二座第 17 层	北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心	
邮政编码	518048	100033	
法定代表人	王鸿嫔	李晓鹏	

## 2.4 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. msfunds. com. cn
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	摩根士丹利华鑫基金管理有限公司	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第二座第 17 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	27,853,064.98
本期利润	34,243,544.25
加权平均基金份额本期利润	0.1956
本期加权平均净值利润率	13.70%
本期基金份额净值增长率	14.34%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	74,388,040.14
期末可供分配基金份额利润	0.4329
期末基金资产净值	266,236,896.06
期末基金份额净值	1.5493
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	447.75%

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，而非当期发生数）。

3. 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.16%	0.96%	-0.97%	0.44%	2.13%	0.52%
过去三个月	15.90%	1.07%	2.38%	0.54%	13.52%	0.53%
过去六个月	14.34%	1.46%	1.20%	0.72%	13.14%	0.74%
过去一年	42.79%	1.37%	15.76%	0.73%	27.03%	0.64%
过去三年	117.96%	1.29%	33.38%	0.75%	84.58%	0.54%
自基金合同生效起至 2012 年 3 月 4 日	13.08%	1.53%	59.27%	1.37%	-46.19 %	0.16%
2012 年 3 月 5 日至 2021 年 6 月 30 日	384.41%	1.37%	82.31%	0.79%	302.10 %	0.58%

注：1. 本基金自 2012 年 3 月 5 日起修改了基金合同中基础行业定义及投资比例，并相应调整基金业绩比较基准为：

沪深 300 指数  $\times$  55% + 中证综合债券指数  $\times$  45%

沪深 300 指数是由中证指数有限公司编制，在上海和深圳证券市场中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数。该指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值，具有良好的市场代表性，是目前中国证券市场中公允性较好的股票指数，适合作为本基金的业绩比较基准。

中证综合债券指数是中证指数有限公司编制的综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短期融资券的跨市场债券指数。该指数的推出旨在更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势，为债券投资人提供更切合的市场基准，适合作为本基金的业绩比较基准。

2. 基金合同修改前本基金的业绩比较基准计算公式为：

上证综指与深证综指的复合指数  $\times 75\%$ +中信标普全债指数  $\times 20\%$ +同业存款利率  $\times 5\%$ ；

其中：上证综指与深证综指的复合指数 = (上证 A 股流通市值 / A 股总流通市值)  $\times$  上证综指 + (深证 A 股流通市值 / A 股总流通市值)  $\times$  深证综指

基准指数的构建考虑了三个原则：

(1) 由于当前并不存在一个为投资者广泛接受的基础行业指数，所以以自定义方式来构建业绩比较基准，若将来出现一个能得到市场认可的基础行业指数，我们将在研究对比的基础上选择更为合理的业绩比较基准。

(2) 投资者认同度。选择被市场广泛认同的上证综指、深证综指、中信标普全债指数作为计算的基础指数，并以流通市值比例为权数对上证综指、深证综指作加权计算。

(3) 业绩比较的合理性。基金投资业绩受到资产配置比例限制的影响，根据基金资产配置比例来确定加权计算的权数，使业绩比较更具有合理性。

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合合同要求，基准指数每日按照 75%、20%、5% 的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

### 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

自基金合同生效以来至基金合同修改前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

摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2004 年 3 月 26 日至 2012 年 3 月 4 日)



注：本基金基金合同于 2004 年 3 月 26 日正式生效。按照本基金基金合同的规定，基金管理人自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合原基金合同约定。

#### 自基金合同修改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

摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012 年 3 月 5 日至 2021 年 6 月 30 日)



## § 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

摩根士丹利华鑫基金管理有限公司（以下简称“公司”）是一家中外合资基金管理公司，前身为经中国证监会证监基金字[2003]33号文批准设立并于2003年3月14日成立的巨田基金管理有限公司。公司的主要股东包括摩根士丹利国际控股公司、华鑫证券有限责任公司等国内外机构。

截止2021年6月30日，公司旗下共管理32只开放式基金，其中股票型基金4只，混合型基金16只，指数型基金3只，债券型基金9只。同时，公司还管理着多个私募资产管理计划。

#### 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		
王大鹏	研究管理部总监、基金经理	2017年5月25日	-	13年	中山大学金融学博士，注册会计师(CPA)。曾任长春工业大学工商管理学院金融学专业教师，宝盈基金管理有限公司医药行业研究员。2010年12月加入本公司，历任研究管理部研究员、总监助理、副总监，现任研究管理部总监、基金经理。2015年1月至2017年6月担任摩根士丹利华鑫资源优选混合型证券投资基金(LOF)基金经理，2016年2月至2017年4月担任摩根士丹利华鑫沪港深新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016年6月起担任摩根士丹利华鑫健康产业混合型证券投资基金基金经理，2017年5月起担任摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金基金经理，2017年6月至2018年12月担任摩根士丹利华鑫品质生活精选股票型证券投资基金基金经理，2017年6月起担任摩根士丹利华鑫卓越成长混合型证券投资基金基金经理，2018年12月起担任摩根士丹利华鑫消费领航混合型证券投资基金基金经理，2020年12月起担任摩根士丹利华鑫内需增长混合型证券投资基金基金经理。
朱睿	基金经理	2019年4月20日	2021年1月18日	9年	厦门大学工商管理硕士。曾任海通证券股份有限公司研究所化工行业研究员，2014年10月加入本公司，历任研究管理部研究员、基金经理助理，权益投资部基金经理。2019年4月至2021年5月担任摩根士丹利华鑫进取优选股票型证券投资基金基金经理。

					经理, 2019 年 4 月至 2021 年 1 月担任摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金管理经理。
--	--	--	--	--	--

- 注: 1、基金经理的任职日期和离任日期为根据本公司决定确定的聘任日期和解聘日期;
- 2、基金经理的任职和离任已按规定在中国证券投资基金业协会办理完毕基金经理注册和注销;
- 3、证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内,基金管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在认真控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及内部相关制度和流程,通过流程和系统控制保证有效实现公平交易管理要求,并通过对投资交易行为的监控和分析,确保基金管理人旗下各投资组合在研究、决策、交易执行等各方面均得到公平对待。本报告期,基金管理人严格执行各项公平交易制度及流程。

经对报告期内公司管理所有投资组合的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异,连续四个季度期间内、不同时间窗下(如日内、3 日内、5 日内)不同投资组合同向交易的交易价差进行分析,未发现异常情况。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金未出现基金管理人管理的所有投资组合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证券当日成交量的 5%的情况,基金管理人未发现异常交易行为。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年上半年上证综指上涨 3.40%,沪深 300 指数上涨 0.24%,创业板指数上涨 17.22%,指数整体表现平淡,但结构性机会明显。分行业看,中信基础化工、钢铁、电力设备及新能源分别上涨为 25.73%、24.69%、24.32%,表现较好;中信非银行金融、家电、国防军工分别下跌 10.44%、14.38%、17.49%,表现相对较弱。新能源、半导体、CXO、次高端白酒等高景气高增长的子行业表现突出。

本基金年初时仓位较高,春节后在市场快速下跌过程中,本基金小幅减持了大消费板块中估

值相对偏高的个股，二季度增持了医药板块，并在大消费板块内部对持仓个股做了小幅调整，重点持仓仍然集中在医药、食品饮料、建材、家电等行业，以竞争优势突出、基本面优秀、估值相对合理的个股为主。从市场风格角度看，本基金增持了估值和业绩增速匹配度相对较高的非龙头标的。本基金上半年跑赢业绩比较基准。医药板块对净值上涨有正贡献，受原材料价格快速上涨影响的家电、调味品行业表现较差，拖累基金净值。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期截至 2021 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.5493 元，累计份额净值为 3.4140 元，报告期内基金份额净值增长率为 14.34%，同期业绩比较基准收益率为 1.20%

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，新冠疫情后中国经济深跌反弹后的惯性可能已经接近尾声，经济增长逐渐向潜在增速回归，但经济仍有韧性。4月30日政治局会议对宏观经济政策的定调相对温和，7月7日国常会决定在坚决不搞大水漫灌的基础上，保持货币政策稳定性、增强有效性，适时运用降准等货币政策工具，流动性仍保持宽松状态。海外资金、居民资金、企业年金及养老金等主体继续增加权益资产配置。政府鼓励资本市场发展，借助资本市场鼓励创新、促进经济转型的政策方向不会发生改变，市场风险偏好上行，预计下半年市场仍有结构性机会。从结构上看，成长板块盈利修复的弹性大于价值板块，高景气高增长的成长板块可能占优，但随着成长板块估值的抬升，价值板块也将迎来投资机会。除非出现重大的宏观利空因素，本基金计划维持中性偏高仓位，重点持仓仍以医药、食品饮料、家电、建材等大消费板块，以及部分优质成长股为主。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的，则及时就所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见。

本基金管理人设有基金估值委员会，委员会由主任委员（分管基金运营部的公司领导）以及相关成员（包括研究管理部负责人、基金运营部负责人、基金会计、风险管理部及监察稽核部相关业务人员）构成。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会的相关人员均具有一定年限的专业从业经验，具有良好的专业能力，并能在相关工作中保持独立性。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和估值方法的最终决策和日常估值的执行。

由于基金经理、相关投资研究人员、债券信用分析师对特定投资品种的估值有深入的理解，经估值委员会主任委员同意，在需要时可以列席估值委员会议并提出估值建议，估值委员会对特定品种估值方法需经委员充分讨论后确定。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、基金合同的相关规定以及本基金的实际运作情况，本基金本报告期内未实施利润分配。

#### 4.8 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

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金（以下简称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

#### 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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

### 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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金 2021 年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

## § 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：摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金管理人

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	15,464,629.50	49,673,507.56
结算备付金		104,747.19	229,229.15
存出保证金		65,043.18	116,544.07
交易性金融资产	6.4.7.2	252,017,955.13	197,285,454.54
其中：股票投资		211,837,955.13	197,285,454.54
基金投资		—	—
债券投资		40,180,000.00	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—	—
应收证券清算款		142,871.68	1,027,667.94
应收利息	6.4.7.5	315,051.00	11,004.20
应收股利		—	—
应收申购款		40,015.10	10,092.37
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		268,150,312.78	248,353,499.83
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 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		—	—
应付证券清算款		254,318.54	3,190.00

应付赎回款		665,809.83	183,886.89
应付管理人报酬		324,650.93	302,347.90
应付托管费		54,108.47	50,391.35
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6. 4. 7. 7	135,927.10	196,289.35
应交税费		358,034.67	358,034.67
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6. 4. 7. 8	120,567.18	185,126.87
负债合计		1,913,416.72	1,279,267.03
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6. 4. 7. 9	171,842,203.52	182,340,039.09
未分配利润	6. 4. 7. 10	94,394,692.54	64,734,193.71
所有者权益合计		266,236,896.06	247,074,232.80
负债和所有者权益总计		268,150,312.78	248,353,499.83

注： 报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.5493 元，基金份额总额 171,842,203.52 份。

## 6.2 利润表

会计主体：摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		36,997,177.66	34,836,054.99
1. 利息收入		441,749.13	149,964.18
其中：存款利息收入	6. 4. 7. 11	170,066.45	149,958.20
债券利息收入		196,383.56	5.98
资产支持证券利息收 入		-	-
买入返售金融资产收 入		75,299.12	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填 列）		30,133,371.76	14,792,301.48
其中：股票投资收益	6. 4. 7. 12	28,909,879.38	13,496,965.91
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6. 4. 7. 13	-	30,534.11
资产支持证券投资收 入	6. 4. 7. 13.5	-	-

益			
贵金属投资收益	6. 4. 7. 14	-	-
衍生工具收益	6. 4. 7. 15	-	-
股利收益	6. 4. 7. 16	1, 223, 492. 38	1, 264, 801. 46
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6. 4. 7. 17	6, 390, 479. 27	19, 854, 514. 89
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6. 4. 7. 18	31, 577. 50	39, 274. 44
减: 二、费用		2, 753, 633. 41	2, 298, 544. 79
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	1, 867, 311. 31	1, 265, 388. 28
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	311, 218. 53	210, 898. 08
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	-	-
4. 交易费用	6. 4. 7. 19	476, 843. 42	728, 723. 05
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	0. 02
7. 其他费用	6. 4. 7. 20	98, 260. 15	93, 535. 36
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		34, 243, 544. 25	32, 537, 510. 20
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		34, 243, 544. 25	32, 537, 510. 20

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金

本报告期: 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	182, 340, 039. 09	64, 734, 193. 71	247, 074, 232. 80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	34, 243, 544. 25	34, 243, 544. 25
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)	-10, 497, 835. 57	-4, 583, 045. 42	-15, 080, 880. 99

“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	8,694,945.94	3,761,160.30	12,456,106.24
2. 基金赎回款	-19,192,781.51	-8,344,205.72	-27,536,987.23
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)	171,842,203.52	94,394,692.54	266,236,896.06
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	158,262,960.06	10,247,991.76	168,510,951.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	32,537,510.20	32,537,510.20
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)	88,982,447.34	13,476,189.98	102,458,637.32
其中：1. 基金申购款	119,429,221.13	15,852,182.84	135,281,403.97
2. 基金赎回款	-30,446,773.79	-2,375,992.86	-32,822,766.65
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）	-	-35,246,366.70	-35,246,366.70
五、期末所有者权益(基金净值)	247,245,407.40	21,015,325.24	268,260,732.64

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：

王鸿嫔

邓寰乐

谢先斌

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

摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金(原名为巨田基础行业证券投资基金,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”)证监基金字[2004]第 11 号《关于同意巨田基础行业证券投资基金设立的批复》核准,由巨田基金管理有限公司(现已更名为摩根士丹利华鑫基金管理有限公司)依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《巨田基础行业证券投资基金基金契约》(后更名为《摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金基金合同》)发起,并于 2004 年 3 月 26 日募集成立。本基金为契约型开放式,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 1,854,428,324.58 元,业经深圳天健信德会计师事务所信德验资字(2004)第 8 号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为摩根士丹利华鑫基金管理有限公司,基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下,本基金的投资组合范围为:股票投资占基金净值的 50%-75%;债券投资占基金净值的 20%-45%;现金资产占基金净值的 5%-20%。其中投资于基础行业类股票的比例不低于股票资产的 80%。本基金的业绩比较基准为:上证综指与深证综指的复合指数×75%+中信标普全债指数×20%+同业存款利率×5%。

经中国证券监督管理委员会证监许可[2012]277 号文《关于核准摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》的核准,本基金自 2012 年 3 月 5 日起修改了基金合同中基础行业定义,并相应修改投资比例、业绩比较基准及收益分配条款。

2012 年 3 月 5 日本基金修改合同后,本基金的投资组合比例变更为:股票等权益类资产占基金资产的 30%-80%,其中投资于基础行业的上市公司股票市值不低于股票等权益类资产的 80%,持有权证的市值不得超过基金资产净值的 3%;现金、债券等固定收益类资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 20%-70%,其中现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准变更为:沪深 300 指数×55%+中证综合债券指数×45%。

### 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》、《摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金基金合同》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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年上半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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年上半年度的经营成果和基金净值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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 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。

#### 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[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]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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017

年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。

(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。

(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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	15,464,629.50
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	15,464,629.50

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	154,464,139.13	211,837,955.13	57,373,816.00
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	40,239,280.00	-59,280.00
	合计	40,239,280.00	-59,280.00

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	194,703,419.13	252,017,955.13	57,314,536.00

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	2,872.65
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	42.39
应收债券利息	312,109.59
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	26.37
合计	315,051.00

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	135,677.10
银行间市场应付交易费用	250.00
合计	135,927.10

### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	646.86
应付证券出借违约金	-
预提费用	93,760.15
其他	26,160.17
合计	120,567.18

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	182,340,039.09	182,340,039.09
本期申购	8,694,945.94	8,694,945.94
本期赎回 (以“-”号填列)	-19,192,781.51	-19,192,781.51
- 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	171,842,203.52	171,842,203.52

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

### 6.4.7.10 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	49,952,126.10	14,782,067.61	64,734,193.71
本期利润	27,853,064.98	6,390,479.27	34,243,544.25
本期基金份额交易产生的变动数	-3,417,150.94	-1,165,894.48	-4,583,045.42
其中：基金申购款	3,084,349.58	676,810.72	3,761,160.30
基金赎回款	-6,501,500.52	-1,842,705.20	-8,344,205.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	74,388,040.14	20,006,652.40	94,394,692.54

### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	166,258.17
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	3,164.64
其他	643.64
合计	170,066.45

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	28,909,879.38
股票投资收益——赎回差价收入	—
股票投资收益——申购差价收入	—
股票投资收益——证券出借差价收入	—
合计	28,909,879.38

##### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	164,588,559.42
减：卖出股票成本总额	135,678,680.04
买卖股票差价收入	28,909,879.38

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期无债券投资收益。

##### 6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,223,492.38
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	1,223,492.38

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	6,390,479.27
股票投资	6,449,759.27
债券投资	-59,280.00
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	6,390,479.27

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	30,968.72
基金转换费收入	608.78
合计	31,577.50

注：1. 本基金的赎回费用按基金份额持有人持有时间的增加而递减。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。不低于赎回费用的 40% 归入基金财产，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于赎回费部分的 40% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	476,593.42

银行间市场交易费用	250.00
合计	476,843.42

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
债券账户维护费	9,000.00
合计	98,260.15

#### 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

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 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
摩根士丹利华鑫基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司（“中国光大银行”）	基金托管人、基金销售机构
华鑫证券有限责任公司（“华鑫证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

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。

#### 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

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行交易。

##### 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	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,867,311.31	1,265,388.28

其中：支付销售机构的客户维护费	244,098.95	167,074.20
-----------------	------------	------------

注：支付基金管理人摩根士丹利华鑫基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%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×1.50%/当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	311,218.53	210,898.08

注：支付基金托管人中国光大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。

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行证券出借业务。

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

##### 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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 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 2021年1月1日至2021年6月30 日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国光大银行	15,464,629.50	166,258.17	53,778,491.00	144,313.49

注：本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

#### 6.4.12 期末(2021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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	新股流通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐环保	2021年1月12日	2021年07月21日	新股流通受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300932	三友联众	2021年1月15日	2021年7月22日	新股流通受限	24.69	31.71	335	8,271.15	10,622.85	-
300942	易瑞生物	2021年2月2日	2021年8月9日	新股流通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300950	德固特	2021年2月24日	2021年9月3日	新股流通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300952	恒辉安防	2021年3月3日	2021年9月13日	新股流通受限	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
300953	震裕科技	2021年3月11日	2021年9月22日	新股流通受限	28.77	99.85	182	5,236.14	18,172.70	-
300956	英力股份	2021年3月16日	2021年9月27日	新股流通受限	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300957	贝泰妮	2021年3月18日	2021年9月27日	新股流通受限	47.33	251.96	101	4,780.33	25,447.96	-
300958	建工	2021年	2021年	新股流	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-

	修复	3月18日	9月29日	通受限						
300960	通业科技	2021年3月22日	2021年9月29日	新股流通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水海纳	2021年3月23日	2021年9月30日	新股流通受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300966	共同药业	2021年3月31日	2021年10月11日	新股流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300967	晓鸣股份	2021年4月2日	2021年10月13日	新股流通受限	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300968	格林精密	2021年4月6日	2021年10月15日	新股流通受限	6.87	12.07	718	4,932.66	8,666.26	-
300972	万辰生物	2021年4月8日	2021年10月19日	新股流通受限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300973	立高食品	2021年4月8日	2021年10月15日	新股流通受限	28.28	115.71	156	4,411.68	18,050.76	-
300975	商络电子	2021年4月14日	2021年10月21日	新股流通受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	新股流通受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300982	苏文电能	2021年4月19日	2021年10月27日	新股流通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300985	致远新能	2021年4月21日	2021年10月29日	新股流通受限	24.90	24.81	174	4,332.60	4,316.94	-
300986	志特新材	2021年4月21日	2021年11月1日	新股流通受限	14.79	30.57	190	2,810.10	5,808.30	-
300987	川网传媒	2021年4月28日	2021年11月11日	新股流通受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300991	创益通	2021年5月12日	2021年11月22日	新股流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-

300992	泰福泵业	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 25 日	新股流通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300995	奇德新材	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	新股流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300997	欢乐家	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 2 日	新股流通受限	4.94	13.05	886	4,376.84	11,562.30	-
300998	宁波方正	2021 年 5 月 25 日	2021 年 12 月 2 日	新股流通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021 年 5 月 27 日	2021 年 12 月 7 日	新股流通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301007	德迈仕	2021 年 6 月 4 日	2021 年 12 月 16 日	新股流通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301009	可靠股份	2021 年 6 月 8 日	2021 年 12 月 17 日	新股流通受限	12.54	27.89	489	6,132.06	13,638.21	-
301010	晶雪节能	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 20 日	新股流通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301013	利和兴	2021 年 6 月 21 日	2021 年 12 月 29 日	新股流通受限	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
301015	百洋医药	2021 年 6 月 22 日	2021 年 12 月 30 日	新股流通受限	7.64	38.83	413	3,155.32	16,036.79	-
301018	申菱环境	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股未上市	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-
301018	申菱环境	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 7 日	新股流通受限	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	-
688070	纵横股份	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 10 日	新股流通受限	23.16	34.47	2,407	55,746.12	82,969.29	-
688076	诺泰生物	2021 年 5 月 12 日	2021 年 11 月 22 日	新股流通受限	15.57	48.55	3,396	52,875.72	164,875.80	-
688087	英科再生	2021 年 6 月 30 日	2021 年 7 月 9 日	新股未上市	21.96	21.96	1,407	30,897.72	30,897.72	-

		日	日							
688109	品茗股份	2021 年 3 月 22 日	2021 年 9 月 30 日	新股流通受限	50.05	72.10	722	36,136.10	52,056.20	-
688191	智洋创新	2021 年 3 月 30 日	2021 年 10 月 8 日	新股流通受限	11.38	17.74	3,016	34,322.08	53,503.84	-
688226	威腾电气	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688239	航宇科技	2021 年 6 月 25 日	2021 年 7 月 5 日	新股未上市	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688328	深科达	2021 年 3 月 1 日	2021 年 9 月 9 日	新股流通受限	16.49	37.79	1,499	24,718.51	56,647.21	-
688350	富淼科技	2021 年 1 月 21 日	2021 年 7 月 28 日	新股流通受限	13.58	22.44	2,552	34,656.16	57,266.88	-
688499	利元亨	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 1 日	新股未上市	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
688517	金冠电气	2021 年 6 月 10 日	2021 年 12 月 20 日	新股流通受限	7.71	11.88	2,892	22,297.32	34,356.96	-
688597	煜邦电力	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 17 日	新股流通受限	5.88	10.16	3,907	22,973.16	39,695.12	-
688661	和林微纳	2021 年 3 月 19 日	2021 年 9 月 29 日	新股流通受限	17.71	84.01	1,452	25,714.92	121,982.52	-
688681	科汇股份	2021 年 6 月 4 日	2021 年 12 月 16 日	新股流通受限	9.56	14.54	1,899	18,154.44	27,611.46	-
300919	中伟股份	2020 年 12 月 15 日	2021 年 07 月 02 日	新股流通受限	24.60	163.00	186	4,575.60	30,318.00	-

注：1、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

2、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上

市之日起 6 个月；

3、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 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
688368	晶丰明源	2021 年 6 月 21 日	重大事项停牌	335.26	2021 年 7 月 5 日	402.31	29,802	2,717,596.05	9,991,418.52	-

注：本基金截至 2021 年 6 月 30 日止持有以上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

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

#### 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

本基金为混合型证券投资基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动面临的与这些金融工具相关的风险主要包括市场风险、流动性风险及信用风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对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“谋求超过业绩比较基准的投资业绩”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建设，公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任，其下设的风险控制和审计委员会负责制定风险管理政策，检查公司和基金运作的合法合规情况；公司经营层对内部控制制度的有效执行承担责任，其下设的风险管

理委员会负责讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；督察长监督检查基金和公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况；监察稽核部、风险管理部分工负责风险监督与控制，前者负责合规风险管理，后者主要负责操作风险和基金投资的信用风险、市场风险以及流动性风险的监督管理；基金经理、投资总监以及投资决策委员会负责对基金投资业务风险进行直接管理。

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。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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国光大银行，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以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。在银行间同业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 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例为 15.09%（2020 年 12 月 31 日：本基金无债券投资）。

#### 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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购

赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 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在基金运作过程中严格按照《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》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。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投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2021 年 6 月 30 日，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%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2021 年 6 月 30 日，本基金最近工作日确认的净赎回金额未超过组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允

价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 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、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

###### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	15,464,629.50	-	-	-	15,464,629.50
结算备付金	104,747.19	-	-	-	104,747.19
存出保证金	65,043.18	-	-	-	65,043.18
交易性金融资产	40,180,000.00	-	-211,837,955.13	252,017,955.13	
应收利息	-	-	-	315,051.00	315,051.00
应收申购款	-	-	-	40,015.10	40,015.10
应收证券清算款	-	-	-	142,871.68	142,871.68
资产总计	55,814,419.87	-	-212,335,892.91	268,150,312.78	
负债					
应付赎回款	-	-	-	665,809.83	665,809.83
应付管理人报酬	-	-	-	324,650.93	324,650.93
应付托管费	-	-	-	54,108.47	54,108.47
应付证券清算款	-	-	-	254,318.54	254,318.54
应付交易费用	-	-	-	135,927.10	135,927.10
应交税费	-	-	-	358,034.67	358,034.67
其他负债	-	-	-	120,567.18	120,567.18
负债总计	-	-	-	1,913,416.72	1,913,416.72

利率敏感度缺口	55,814,419.87	-	-	210,422,476.19	266,236,896.06
上年度末 2020 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	49,673,507.56	-	-	-	49,673,507.56
结算备付金	229,229.15	-	-	-	229,229.15
存出保证金	116,544.07	-	-	-	116,544.07
交易性金融资产	-	-	-	197,285,454.54	197,285,454.54
应收利息	-	-	-	11,004.20	11,004.20
应收申购款	-	-	-	10,092.37	10,092.37
应收证券清算款	-	-	-	1,027,667.94	1,027,667.94
资产总计	50,019,280.78	-	-	198,334,219.05	248,353,499.83
负债					
应付赎回款	-	-	-	183,886.89	183,886.89
应付管理人报酬	-	-	-	302,347.90	302,347.90
应付托管费	-	-	-	50,391.35	50,391.35
应付证券清算款	-	-	-	3,190.00	3,190.00
应付交易费用	-	-	-	196,289.35	196,289.35
应交税费	-	-	-	358,034.67	358,034.67
其他负债	-	-	-	185,126.87	185,126.87
负债总计	-	-	-	1,279,267.03	1,279,267.03
利率敏感度缺口	50,019,280.78	-	-	197,054,952.02	247,074,232.80

注：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予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券投资公允价值占基金资产净值的比例为 15.09% (2020 年 12 月 31 日：本基金未持有交易性债券投资)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2020 年 12 月 31 日：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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 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。本基金主要投资于股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的

影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。此外，本基金的基金管理人日常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、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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	211,837,955.13	79.57	197,285,454.54	79.85
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	211,837,955.13	79.57	197,285,454.54	79.85

#### 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(附注 6.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末(2021 年 6 月 30 日)	上年度末(2020 年 12 月 31 日)
分析	业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%	15,860,000.00	14,100,000.00
	业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-15,860,000.00	-14,100,000.00

	注 6.4.1) 下降 5%	
--	----------------	--

### 6.4.14 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 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 200,556,456.63 元，属于第二层次余额为 51,461,498.50 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次的余额为 195,818,199.92 元，第二层次的余额为 1,467,254.62 元，无属于第三层次的余额)。

###### (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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

###### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020 年 12 月 31 日：同)。

##### (d) 不以公允价值计量的金融工具

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

#### (2)

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。

## § 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	211,837,955.13	79.00
	其中：股票	211,837,955.13	79.00
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	40,180,000.00	14.98
	其中：债券	40,180,000.00	14.98
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	15,569,376.69	5.81
8	其他各项资产	562,980.96	0.21
9	合计	268,150,312.78	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	11,290.28	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	168,873,688.84	63.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,662.00	0.00
E	建筑业	14,356.93	0.01
F	批发和零售业	22,447.55	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,131,317.63	3.81
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	32,709,993.83	12.29
N	水利、环境和公共设施管理业	70,198.07	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育				
Q	卫生和社会工作				
R	文化、体育和娱乐业				
S	综合				
	合计		211,837,955.13		79.57

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600132	重庆啤酒	111,685	22,108,045.75	8.30
2	300737	科顺股份	600,300	18,873,432.00	7.09
3	000333	美的集团	251,900	17,978,103.00	6.75
4	600519	贵州茅台	8,500	17,481,950.00	6.57
5	300122	智飞生物	91,900	17,160,487.00	6.45
6	688202	美迪西	25,826	13,426,937.40	5.04
7	603369	今世缘	227,200	12,305,152.00	4.62
8	688677	海泰新光	107,047	11,721,646.50	4.40
9	688626	翔宇医疗	93,201	11,262,408.84	4.23
10	300759	康龙化成	51,557	11,187,353.43	4.20
11	688368	晶丰明源	29,802	9,991,418.52	3.75
12	300760	迈瑞医疗	20,427	9,805,981.35	3.68
13	601233	桐昆股份	365,900	8,814,531.00	3.31
14	600872	中炬高新	206,300	8,668,726.00	3.26
15	603801	志邦家居	268,700	8,587,652.00	3.23
16	603259	药明康德	51,700	8,095,703.00	3.04
17	300791	仙乐健康	44,300	2,454,220.00	0.92
18	688135	利扬芯片	5,658	318,998.04	0.12
19	688076	诺泰生物	3,396	164,875.80	0.06
20	688661	和林微纳	1,452	121,982.52	0.05
21	688093	世华科技	2,855	113,514.80	0.04
22	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.03
23	688070	纵横股份	2,407	82,969.29	0.03
24	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.02
25	301007	德迈仕	3,022	60,305.15	0.02
26	688350	富森科技	2,552	57,266.88	0.02
27	688328	深科达	1,499	56,647.21	0.02
28	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.02
29	688191	智洋创新	3,016	53,503.84	0.02
30	688109	品茗股份	722	52,056.20	0.02
31	688156	路德环境	2,602	47,928.84	0.02
32	688597	煜邦电力	3,907	39,695.12	0.01

33	688517	金冠电气	2,892	34,356.96	0.01
34	688087	英科再生	1,407	30,897.72	0.01
35	300919	中伟股份	186	30,318.00	0.01
36	688681	科汇股份	1,899	27,611.46	0.01
37	300957	贝泰妮	101	25,447.96	0.01
38	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
39	300953	震裕科技	182	18,172.70	0.01
40	300973	立高食品	156	18,050.76	0.01
41	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
42	301015	百洋医药	413	16,036.79	0.01
43	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.01
44	300925	法本信息	534	14,038.86	0.01
45	301009	可靠股份	489	13,638.21	0.01
46	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
47	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
48	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
49	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
50	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
51	300997	欢乐家	886	11,562.30	0.00
52	300932	三友联众	344	10,912.20	0.00
53	300918	南山智尚	999	10,399.59	0.00
54	300922	天秦装备	287	9,996.21	0.00
55	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
56	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
57	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
58	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
59	300968	格林精密	718	8,666.26	0.00
60	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
61	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
62	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
63	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
64	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
65	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
66	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
67	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
68	300986	志特新材	190	5,808.30	0.00
69	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
70	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
71	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
72	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
73	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
74	300985	致远新能	174	4,316.94	0.00

75	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
76	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
77	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300122	智飞生物	16,663,382.00	6.74
2	688677	海泰新光	10,449,188.89	4.23
3	603801	志邦家居	9,767,428.80	3.95
4	601318	中国平安	9,487,860.00	3.84
5	603883	老百姓	8,862,811.21	3.59
6	000333	美的集团	8,766,085.82	3.55
7	688626	翔宇医疗	7,866,691.55	3.18
8	601128	常熟银行	7,056,488.00	2.86
9	002773	康弘药业	6,063,958.92	2.45
10	600600	青岛啤酒	6,006,015.00	2.43
11	603259	药明康德	5,606,871.40	2.27
12	603369	今世缘	5,573,922.00	2.26
13	688202	美迪西	5,443,651.72	2.20
14	601012	隆基股份	5,185,279.00	2.10
15	601166	兴业银行	4,862,321.00	1.97
16	000661	长春高新	4,699,352.00	1.90
17	600132	重庆啤酒	4,495,322.00	1.82
18	300759	康龙化成	2,687,414.00	1.09
19	601009	南京银行	2,201,862.00	0.89
20	300791	仙乐健康	2,181,102.45	0.88

注：“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600600	青岛啤酒	18,192,609.00	7.36
2	600132	重庆啤酒	12,797,624.00	5.18
3	603259	药明康德	12,319,150.60	4.99
4	000651	格力电器	11,804,171.00	4.78
5	300759	康龙化成	10,150,050.73	4.11
6	688202	美迪西	9,091,215.23	3.68
7	603883	老百姓	7,625,456.06	3.09
8	300737	科顺股份	7,547,273.00	3.05
9	601318	中国平安	7,124,623.98	2.88

10	300760	迈瑞医疗	6,791,750.00	2.75
11	002798	帝欧家居	6,106,194.77	2.47
12	601128	常熟银行	5,729,921.00	2.32
13	603369	今世缘	5,643,714.00	2.28
14	300623	捷捷微电	5,479,478.40	2.22
15	601012	隆基股份	5,256,879.00	2.13
16	688368	晶丰明源	4,696,851.02	1.90
17	000661	长春高新	4,668,780.00	1.89
18	601166	兴业银行	4,150,752.00	1.68
19	002773	康弘药业	3,295,364.76	1.33
20	600872	中炬高新	2,762,287.00	1.12

注：“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	143,781,421.36
卖出股票收入（成交）总额	164,588,559.42

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	40,180,000.00	15.09
	其中：政策性金融债	40,180,000.00	15.09
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	40,180,000.00	15.09

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	190403	19农发03	400,000	40,180,000.00	15.09

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

根据本基金基金合同规定，本基金不参与贵金属投资。

**7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

**7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

根据本基金基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

**7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

根据本基金基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.11.1 本期国债期货投资政策**

根据本基金基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

**7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

根据本基金基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

**7.11.3 本期国债期货投资评价**

根据本基金基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

**7.12 投资组合报告附注****7.12.1 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未出现报告期内被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**7.12.2 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。

**7.12.3 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	65,043.18
2	应收证券清算款	142,871.68
3	应收股利	—
4	应收利息	315,051.00
5	应收申购款	40,015.10
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—

8	其他	
9	合计	562,980.96

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
5,720	30042.34	101,138,295.48	58.86	70,703,908.04	41.14

### 8.2 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	0.00	0

### 8.3 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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2004 年 3 月 26 日)	1,854,893,478.59
基金份额总额	
本报告期期初基金份额总额	182,340,039.09
本报告期基金总申购份额	8,694,945.94
减：本报告期基金总赎回份额	19,192,781.51
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	171,842,203.52

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人的重大人事变动如下：

2021 年 5 月 26 日，基金管理人法定代表人变更为总经理王鸿嫔女士。基金管理人于 2021 年 5 月 28 日公告了上述事项。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金未改变投资策略。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

### 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、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 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	1	80,717,370.22	26.51%	75,171.00	27.40%	-
国泰君安证券	2	68,309,546.85	22.43%	63,617.59	23.18%	-
国金证券	1	56,914,406.49	18.69%	53,004.44	19.32%	-
海通证券	1	50,849,678.45	16.70%	47,355.75	17.26%	-

华西证券	1	19,481,046.94	6.40%	14,246.37	5.19%	-
平安证券	1	18,606,322.93	6.11%	13,606.69	4.96%	-
西南证券	1	7,765,388.25	2.55%	5,678.78	2.07%	-
中信证券	1	1,677,830.29	0.55%	1,562.54	0.57%	-
东兴证券	1	160,954.00	0.05%	149.89	0.05%	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-

注：1. 专用交易单元的选择标准和程序

- (1) 实力雄厚，信誉良好。
  - (2) 财务状况良好，经营行为规范。
  - (3) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。
  - (4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务。
  - (5) 研究实力较强，能及时、定期、全面地为本基金提供研究服务。
  - (6) 为基金份额持有人提供高水平的综合服务。
2. 基金管理人根据以上标准进行考察后确定合作券商。基金管理人与被选择的证券经营机构签订《专用证券交易单元租用协议》，报证券交易所办理交易单元相关租用手续。
  3. 本报告期内，本基金租用证券公司交易单元情况未发生变化。

### 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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
光大证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-

海通证券	-	-	157,300,000.00	100.00%	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

## 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	本公司关于旗下部分基金参与国金证券费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 1 月 18 日
2	本基金招募说明书更新、基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 1 月 19 日
3	公司旗下 27 只基金 2020 年第四季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 1 月 21 日
4	公司旗下 27 只基金 2020 年第四季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 1 月 21 日
5	本公司关于旗下部分基金参与烟台银行费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 1 月 21 日
6	本公司关于旗下基金股票估值调整情况的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 3 月 9 日
7	本公司关于旗下部分基金增加和耕传承为销售机构并参与费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 3 月 10 日
8	本公司关于旗下部分基金参加北京度小满基金销售有限公司转换费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 3 月 12 日
9	本公司关于旗下部分基金参与安信证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 3 月 15 日
10	本公司关于旗下部分基金在西藏东方财富证券股份有限公司开通基金定期定额投资业务并参与定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 3 月 26 日
11	公司旗下 26 只基金 2020 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 3 月 29 日
12	公司旗下 26 只基金 2020 年年度报告	中国证监会规定报刊及	2021 年 3 月 29 日

		网站	
13	本公司关于调整旗下部分基金申购、定期定额申购、赎回、转换及最低持有份额数额限制的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 3 月 31 日
14	本公司关于旗下部分基金增加中国人寿保险股份有限公司为销售机构并参与费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 4 月 12 日
15	本公司旗下基金 2021 年 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 4 月 21 日
16	本公司旗下基金 2021 年 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 4 月 21 日
17	本公司关于旗下部分基金参与招商证券费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 4 月 29 日
18	本基金参与中国建设银行股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 5 月 6 日
19	本公司关于直销网上交易停止受理工行直连支付渠道认购、申购及定期定额投资业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 5 月 25 日
20	本公司关于法定代表人变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 5 月 28 日
21	本公司关于旗下部分基金参与腾安基金销（深圳）有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 5 月 28 日
22	本公司关于旗下部分基金参与部分销售机构费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 6 月 8 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
机构	1	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	99,149,543.48	-	-	99,149,543.48	57.69
产品特有风险							
本基金存在单一投资者持有基金份额占比较大的情形。本基金属于开放式基金，在本基金存续期间，若上述投资者集中大额赎回本基金，可能会发生巨额赎回的情形，本基金投资者可能会面临以下风险：							

### 1. 基金份额净值波动风险

由于我国证券市场的波动性较大，在市场价格下跌时会出现交易量急剧减少的情形，此时若出现巨额赎回可能会导致基金资产变现困难，从而产生流动性风险，甚至影响基金份额净值。此外，当出现巨额赎回时，因基金运作特点导致的费用计提、计入基金资产的赎回费以及基金持仓证券价格波动等因素，也可能会影响基金份额净值，极端情况下可能会造成基金份额净值的大幅波动。

### 2. 无法赎回基金的流动性风险

当发生巨额赎回时，根据《基金合同》的约定，基金管理人可能决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能暂停接受基金的赎回申请，投资人将面临无法及时赎回所持有基金份额的风险。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准本基金募集的文件；
- 2、本基金基金合同；
- 3、本基金托管协议；
- 4、本基金招募说明书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内在规定媒介上披露的各项公告。

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件，还可以通过基金管理人网站查阅或下载。

摩根士丹利华鑫基金管理有限公司

2021 年 8 月 27 日