

摩根士丹利华鑫多因子精选策略混合型证 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：中国建设银行股份有限公司

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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设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

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	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	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	45

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	45
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	45
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	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12 投资组合报告附注	46
§ 8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
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	47
§ 9 开放式基金份额变动	47
§ 10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议	48
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	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4 基金投资策略的改变	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	48
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	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
10.8 其他重大事件	51
§ 11 备查文件目录	53
11.1 备查文件目录	53
11.2 存放地点	53
11.3 查阅方式	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	摩根士丹利华鑫多因子精选策略混合型证券投资基金
基金简称	大摩多因子策略混合
基金主代码	233009
基金代码	233009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 5 月 17 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	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	516,782,856.08 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过多因子量化模型方法，精选股票进行投资，在充分控制风险的前提下，力争获取超越比较基准的投资回报。
投资策略	本基金采用数量化模型驱动的选股策略为主导投资策略，结合适当的资产配置策略。 1. 股票投资策略 本基金以“量化投资”为主要投资策略，通过基金管理人开发的“大摩多因子阿尔法模型”进行股票选择并据此构建股票投资组合。“大摩多因子阿尔法模型”在实际运行过程中将定期或不定期地进行修正，优化股票投资组合。 2. 资产配置策略 本基金实行在公司投资决策委员会统一指导下的资产配置机制。资产配置采取“自上而下”的多因素分析决策支持，结合定性分析和定量分析，对股票资产和固定收益类资产的风险收益特征进行分析预测，确定中长期的资产配置方案。 3. 其他金融工具投资策略 (1) 固定收益投资策略 本基金遵循中长期资产配置策略，进行国债、金融债、公司债等固定收益类证券以及可转换债券的投资。 本基金采用的主要固定收益投资策略包括：利率预期策略、收益率曲线策略、信用利差策略、公司/企业债券策略、可转换债券策略等。 (2) 股指期货投资策略 本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。 (3) 权证投资策略 本基金对权证的投资建立在对标的证券和组合收益风险分析的基础上，以 Black-Scholes 模型和二叉树期权定价模型为基础对权证进行分析定价，并根据市场情况对定价模型和参数进行适当修正。

业绩比较基准	中证 500 指数×80% + 中证综合债券指数×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	许菲菲
	联系电话	(0755)88318883
	电子邮箱	xxpl@msfunds.com.cn
客户服务电话	400-8888-668	(021)60637111
传真	(0755)82990384	(021)60635778
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	北京市西城区金融大街 25 号
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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	518048	100033
法定代表人	王鸿嫔	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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	176,074,814.11
本期利润	108,731,319.60
加权平均基金份额本期利润	0.2018
本期加权平均净值利润率	11.75%
本期基金份额净值增长率	11.66%
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	146,104,197.42
期末可供分配基金份额利润	0.2827

期末基金资产净值	921,243,509.60
期末基金份额净值	1.783
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	250.01%

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。

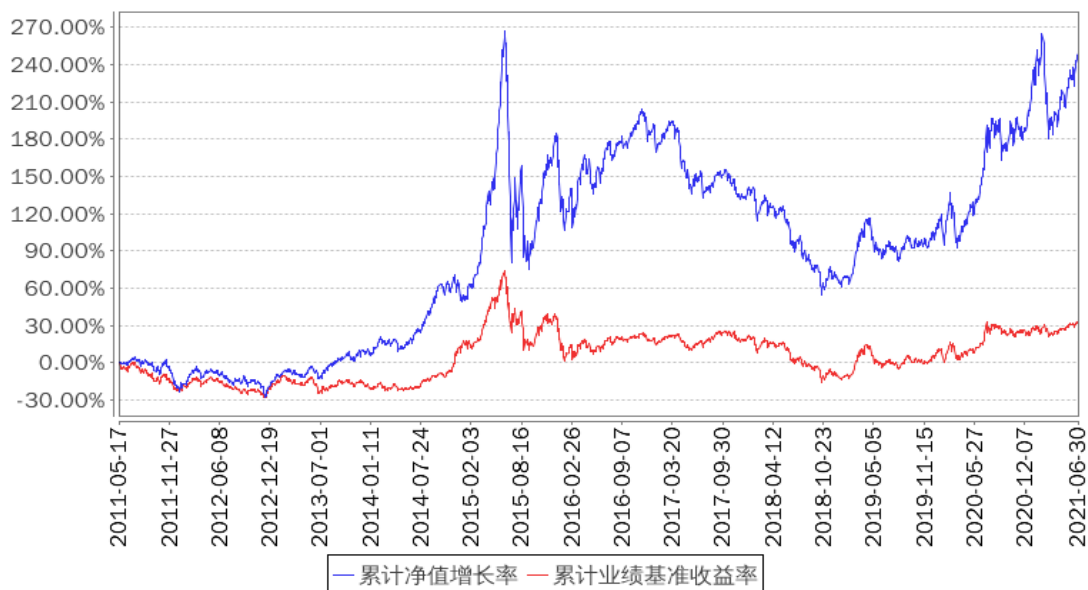
3.2 基金净值表现

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	4.09%	1.36%	1.01%	0.58%	3.08%	0.78%
过去三个月	18.49%	1.24%	7.24%	0.54%	11.25%	0.70%
过去六个月	11.66%	1.77%	5.98%	0.79%	5.68%	0.98%
过去一年	36.58%	1.70%	13.84%	1.00%	22.74%	0.70%
过去三年	76.94%	1.54%	28.28%	1.18%	48.66%	0.36%
自基金合同生效起至今	250.01%	1.59%	32.68%	1.25%	217.33%	0.34%

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

大摩多因子策略混合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：自 2015 年 9 月 29 日起，本基金的业绩基准由原来的“中证 800 指数×80%+中证综合债券指数×20%”变更为“中证 500 指数×80%+中证综合债券指数×20%”。上述事项已于 2015 年 9 月 29 日在指定媒体上公告。

§ 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		
余斌	数量化投资部总监、基金经理	2019 年 8 月 20 日	—	14 年	南开大学经济学硕士，金融风险管理师（FRM）。曾任招商证券股份有限公司风险管理部风险分析师、鹏华基金管理有限公司量化及衍生品投资部基金经理。2019 年 5 月加入本公司，现任数量化投资部总监、

					基金经理。2019 年 8 月起担任摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金、摩根士丹利华鑫量化多策略股票型证券投资基金、摩根士丹利华鑫多因子精选策略混合型证券投资基金基金经理，2020 年 7 月起担任摩根士丹利华鑫 ESG 量化先行混合型证券投资基金、摩根士丹利华鑫 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金经理。
王 联 欣	基金经 理助 理	2017 年 8 月 3 日	2021 年 3 月 24 日	6 年	天津大学技术经济及管理硕士。2015 年 2 月加入本公司，历任量化投资部助理量化研究员、基金经理助理，现任量化投资部基金经理。2021 年 3 月起担任摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资基金基金经理。

注：1、基金经理和基金经理助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；

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

报告期内，我们从数据和算法出发，坚持运用具有基本面逻辑的量化选股模型，组合构建层面坚持均衡配置、风险分散的原则，在报告期内复杂的市场环境下取得了相对稳健的投资收益。

新形势下，市场影响因素众多，上市股票数量不断增加，资产管理行业对投资管理人员的素质和要求越来越高。我们在坚持量化方法的基础上，保持开放心态，积极拥抱市场变化，不断学习和提高投资管理能力，力争获取更好的投资业绩表现。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期截至 2021 年 06 月 30 日，本基金份额净值为 1.783 元，累计份额净值为 2.935 元，基金份额净值增长率为 11.66%，同期业绩比较基准收益率为 5.98%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

报告期内，市场经过一季度的快速调整后，市场情绪趋于平稳，市场整体保持震荡上行趋势。从因子表现看，报告期内因子表现基本恢复至正常市场环境下的状态，长期因子表现符合预期。投资策略与正常市场环境下逐渐保持一致，组合持仓的风险分散效果得以显现，市场个股不再呈现同涨同跌或极端涨跌的股价表现。报告期内，模型策略效果明显，能够展现出模型设计的合理性和持续性。然而，市场总是高度变化的，对市场价值与价格的映射关系的理解和长期规律的把握始终是量化基金经理最重要的工作内容之一，对市场的收益和风险的平衡则是模型设计和组合风险管理的核心考量因素。

由于 A 股经历了两年多的整体大幅上涨，尽管宽基指数的估值水平并未处于历史高位，但市场结构分化加剧，板块间估值水平差异明显。对优质公司形成共识后，不断推动估值水平的提升，好公司难以再有好价格。多数公司基本面的高景气很难线性外推，当前的估值水平极大地兑现了未来的增长空间。在理性预期下，投资者需要降低权益市场未来投资回报水平的预期。市场大概率将很难复制过去一段时间的良好盈利体验。

然而，我们并不由此对市场保持负面观点，更多认为市场进入相对正常的投资环境，可能在期间穿插大类风险切换的一次性冲击，进而体现为投资业绩表现的非连续阶段性跳空，投资管理的难度显然大幅增加。

在当前的市场环境下，量化投资策略具有一定的优势。较为分散的持仓特点很大程度上减小了在极端环境下的利润损失，通过稳定的个股选择能力，力争实现组合业绩表现的复利增长。同时，量化投资组合的动态持仓再平衡机制，也有利于组合不断挖掘新的投资机会，不在热门领域“死磕到底”。

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

本基金合同约定，在符合有关基金分红条件，且每季度中间月份的最后个工作日每份基金份额可供分配利润不低于 0.08 元的前提下，本基金采用季度收益分配规则，每年最多进行 4 次收益分配，每次收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 25%。

报告期内，本基金实施利润分配金额 70,470,998.56 元。

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责

责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金实施利润分配金额 70,470,998.56 元。

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

本托管人复核审查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。

§ 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：摩根士丹利华鑫多因子精选策略混合型证券投资基金

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
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	58,160,448.21	84,018,483.58
结算备付金		2,598,518.57	3,331,974.63
存出保证金		179,101.18	254,544.12
交易性金融资产	6.4.7.2	865,004,247.08	996,434,413.82
其中：股票投资		864,646,809.99	995,842,313.12
基金投资		-	-
债券投资		357,437.09	592,100.70
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		1,009,504.89	535,271.60
应收利息	6.4.7.5	7,080.79	9,861.31
应收股利		-	-
应收申购款		449,487.48	124,484.49
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		927,408,388.20	1,084,709,033.55
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日

负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	1,290.70
应付赎回款		3,195,234.97	11,814,644.84
应付管理人报酬		1,113,311.58	1,340,243.05
应付托管费		185,551.91	223,373.84
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,548,665.52	1,628,802.56
应交税费		1.62	1.74
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	122,113.00	232,771.22
负债合计		6,164,878.60	15,241,127.95
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	516,782,856.08	617,622,315.00
未分配利润	6.4.7.10	404,460,653.52	451,845,590.60
所有者权益合计		921,243,509.60	1,069,467,905.60
负债和所有者权益总计		927,408,388.20	1,084,709,033.55

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.783 元，基金份额总额 516,782,856.08 份。

6.2 利润表

会计主体：摩根士丹利华鑫多因子精选策略混合型证券投资基金

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
一、收入		122,789,140.60	315,287,827.30
1. 利息收入		140,303.52	369,530.59
其中：存款利息收入	6.4.7.11	140,139.36	368,720.10
债券利息收入		164.16	810.49
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）		189,918,122.11	147,403,542.07

其中：股票投资收益	6.4.7.12	186,358,248.54	140,878,027.79
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	369,776.14	289,202.17
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13.5	-	-
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	3,190,097.43	6,236,312.11
3. 公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.17	-67,343,494.51	167,365,914.71
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	74,209.48	148,839.93
减：二、费用		14,057,821.00	23,969,795.40
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	6,926,039.11	9,842,384.51
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,154,339.83	1,640,397.37
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	5,845,743.95	12,348,112.53
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支 出		-	-
6. 税金及附加		0.75	2.95
7. 其他费用	6.4.7.20	131,697.36	138,898.04
三、利润总额（亏损总额以 “-”号填列）		108,731,319.60	291,318,031.90
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		108,731,319.60	291,318,031.90

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：摩根士丹利华鑫多因子精选策略混合型证券投资基金

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）	617,622,315.00	451,845,590.60	1,069,467,905.60
二、本期经营活 动产生的基金净 值变动数（本期 利润）	-	108,731,319.60	108,731,319.60

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）	-100,839,458.92	-85,645,258.12	-186,484,717.04
其中：1. 基金申购款	67,540,175.10	48,092,434.12	115,632,609.22
2. 基金赎回款	-168,379,634.02	-133,737,692.24	-302,117,326.26
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）	-	-70,470,998.56	-70,470,998.56
五、期末所有者权益（基金净值）	516,782,856.08	404,460,653.52	921,243,509.60
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）	1,273,574,634.14	170,889,220.02	1,444,463,854.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	291,318,031.90	291,318,031.90
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）	-333,676,714.65	-71,366,520.40	-405,043,235.05
其中：1. 基金申购款	65,333,478.44	12,344,572.55	77,678,050.99
2. 基金赎回款	-399,010,193.09	-83,711,092.95	-482,721,286.04
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）	939,897,919.49	390,840,731.52	1,330,738,651.01

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

摩根士丹利华鑫多因子精选策略混合型证券投资基金(原名为摩根士丹利华鑫多因子精选策略股票型证券投资基金,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”)证监许可[2011]第 356 号《关于核准摩根士丹利华鑫多因子精选策略股票型证券投资基金募集的批复》核准,由摩根士丹利华鑫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《摩根士丹利华鑫多因子精选策略股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。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 1,043,431,652.00 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 183 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《摩根士丹利华鑫多因子精选策略股票型证券投资基金基金合同》于 2011 年 5 月 17 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,043,603,222.41 份基金份额,其中认购资金利息折合 171,570.41 份基金份额。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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其配套规定的相关要求,自 2015 年 8 月 7 日起,摩根士丹利华鑫多因子精选策略股票型证券投资基金更名为摩根士丹利华鑫多因子精选策略混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《摩根士丹利华鑫多因子精选策略混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金投资组合的资产配置范围为:股票资产占基金资产的比例范围为 60% - 95%;除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 5% - 40%,其中权证资产占基金资产净值的比例范围为 0 - 3%,保持现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。自基金合同生效日至 2015 年 9 月 28 日止期间,本基金的业绩比较基准为:中证 800 指数×80% + 中证综合债券指数×20%。根据本基金的基金管理人于 2015 年 9 月 29 日发布的《摩根士丹利华鑫多因子精选策略混合型证券投资基金变更业绩比较基准及修改相关基金合同的公告》,自 2015

年 9 月 29 日起，本基金的业绩比较基准变更为：中证 500 指数×80%+中证综合债券指数×20%。

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》、《摩根士丹利华鑫多因子精选策略混合型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	58,160,448.21
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	58,160,448.21

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		720,682,624.35	864,646,809.99	143,964,185.64
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	253,400.00	357,437.09	104,037.09
	银行间市场	-	-	-
	合计	253,400.00	357,437.09	104,037.09
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		720,936,024.35	865,004,247.08	144,068,222.73

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	5,784.40
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	1,169.30
应收债券利息	46.49
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	80.60
合计	7,080.79

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	1,548,665.52
银行间市场应付交易费用	—
合计	1,548,665.52

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	4,017.06
应付证券出借违约金	—
预提费用	118,095.94
合计	122,113.00

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	617,622,315.00	617,622,315.00
本期申购	67,540,175.10	67,540,175.10
本期赎回（以“-”号填列）	-168,379,634.02	-168,379,634.02
- 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	516,782,856.08	516,782,856.08

注：申购含红利再投、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	57,821,969.68	394,023,620.92	451,845,590.60
本期利润	176,074,814.11	-67,343,494.51	108,731,319.60
本期基金份额交易产生的变动数	-17,321,587.81	-68,323,670.31	-85,645,258.12
其中：基金申购款	15,172,397.93	32,920,036.19	48,092,434.12
基金赎回款	-32,493,985.74	-101,243,706.50	-133,737,692.24
本期已分配利润	-70,470,998.56	—	-70,470,998.56
本期末	146,104,197.42	258,356,456.10	404,460,653.52

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	115,860.04
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	22,522.71
其他	1,756.61
合计	140,139.36

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	186,358,248.54
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	186,358,248.54

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	2,048,158,115.45
减：卖出股票成本总额	1,861,799,866.91
买卖股票差价收入	186,358,248.54

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

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	369,776.14
债券投资收益——赎回差价收入	—
债券投资收益——申购差价收入	—
合计	369,776.14

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,292,564.14
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	922,600.00
减：应收利息总额	188.00
买卖债券差价收入	369,776.14

6.4.7.13.3 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	3,190,097.43
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	3,190,097.43

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	-67,343,494.51
股票投资	-67,291,930.90
债券投资	-51,563.61
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	-67,343,494.51

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	73,320.24
基金转换费收入	774.58
其他	114.66
合计	74,209.48

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 25% 归基金财产，其余用于支付注册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 25% 归入转出基金的资产。

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	5,845,743.95
银行间市场交易费用	-
合计	5,845,743.95

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	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	4,001.42
债券账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	131,697.36

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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	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：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 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	
	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 (%)
华鑫证券	102,734,784.33	2.68	130,021,170.89	1.59

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	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 (%)
华鑫证券	95,673.33	2.79	75,003.66	4.84
关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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 (%)
华鑫证券	121,088.76	1.66	-	-

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后的净额列示。

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 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管理费	6,926,039.11	9,842,384.51
其中：支付销售机构的客户维护费	3,040,786.37	4,889,793.83

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 1.5% 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 × 1.5% / 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	1,154,339.83	1,640,397.37

注：支付基金托管人中国建设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未与关联方进行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基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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
中国建设银行	58,160,448.21	115,860.04	82,008,738.06	312,633.48

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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

单位：人民币元

序号	权益 登记 日	除息日		每 10 份基 金份 额分 红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2021 年 3 月 12 日	-	2021 年 3 月 12 日	0.640	19,966,636.21	13,794,628.29	33,761,264.50	-
2	2021 年 6 月 8 日	-	2021 年 6 月 8 日	0.710	21,328,832.66	15,380,901.40	36,709,734.06	-
合计	-	-	-	1.350	41,295,468.87	29,175,529.69	70,470,998.56	-

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
300614	百川 畅银	2021 年 5 月 18	2021 年 11 月 25	新股流 通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-

		日	日							
300926	博俊科技	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 12 日	新股流 通受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
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 7 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	492	12,147.48	15,601.32	-
300933	中辰股份	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股流 通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易购	2021 年 1 月 20 日	2021 年 7 月 27 日	新股流 通受限	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300940	南极光	2021 年 1 月 27 日	2021 年 8 月 3 日	新股流 通受限	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300941	创识科技	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	新股流 通受限	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
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	240	6,904.80	23,964.00	-
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	392	18,553.36	98,768.32	-
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	-
300962	中金辐照	2021年3月29日	2021年10月11日	新股流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300963	中洲特材	2021年3月30日	2021年10月11日	新股流通受限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
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	1,162	7,982.94	14,025.34	-
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	360	10,180.80	41,655.60	-
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	-
300979	华利集团	2021年4月15日	2021年10月26日	新股流通受限	33.22	87.50	689	22,888.58	60,287.50	-
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	295	7,345.50	7,318.95	-

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	264	3,904.56	8,070.48	-
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	928	4,584.32	12,110.40	-
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	801	10,044.54	22,339.89	-
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	-
301012	扬电科技	2021 年 6 月 15 日	2021 年 12 月 22 日	新股流 通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
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	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔伟	2021 年 6 月 23 日	2021 年 12 月 30 日	新股流 通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-

		日	日							
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	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未 上市	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股流 通受限	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
605287	德才股份	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未 上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688059	华锐精密	2021 年 2 月 1 日	2021 年 8 月 9 日	新股流 通受限	37.09	160.26	1,023	37,943.07	163,945.98	-
688067	爱威科技	2021 年 6 月 7 日	2021 年 12 月 16 日	新股流 通受限	14.71	24.83	1,259	18,519.89	31,260.97	-
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	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688117	圣诺生物	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 3 日	新股流 通受限	17.90	35.97	1,672	29,928.80	60,141.84	-
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	-
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	-
688676	金盘科技	2021 年 3 月 2 日	2021 年 9 月 9 日	新股流 通受限	10.10	16.24	3,750	37,875.00	60,900.00	-
688685	迈信林	2021 年 4 月 30 日	2021 年 11 月 15 日	新股流 通受限	9.02	19.50	2,612	23,560.24	50,934.00	-
688690	纳微	2021 年	2021 年	新股流	8.07	79.89	3,477	28,059.39	277,777.53	-

	科技	6月16日	12月23日	通受限						
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年7月2日	新股流通受限	24.60	163.00	610	15,006.00	99,430.00	-

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
600460	士兰微	2021年6月30日	重大事项停牌	56.35	2021年07月01日	59.49	120,800	6,960,654.00	6,807,080.00	-

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

本基金为进行主动投资的混合型基金。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中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以上风险控制在限定的范围之内，采用数量化模型驱动的选股策略为主导投资策略，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的建设，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同责任，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建设银行，因而与该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占基金资产净值的比例为 0.04%(2020 年 12 月 31 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占基金资产净值的比例为 0.06%)。

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、流通受限制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 2020 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 2020 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	58,160,448.21	-	-	-	58,160,448.21

结算备付金	2,598,518.57	-	-	-	2,598,518.57
存出保证金	179,101.18	-	-	-	179,101.18
交易性金融资产	-	-	357,437.09	864,646,809.99	865,004,247.08
应收利息	-	-	-	7,080.79	7,080.79
应收申购款	-	-	-	449,487.48	449,487.48
应收证券清算款	-	-	-	1,009,504.89	1,009,504.89
资产总计	60,938,067.96	-	357,437.09	866,112,883.15	927,408,388.20
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	3,195,234.97	3,195,234.97
应付管理人报酬	-	-	-	1,113,311.58	1,113,311.58
应付托管费	-	-	-	185,551.91	185,551.91
应付交易费用	-	-	-	1,548,665.52	1,548,665.52
应交税费	-	-	-	1.62	1.62
其他负债	-	-	-	122,113.00	122,113.00
负债总计	-	-	-	6,164,878.60	6,164,878.60
利率敏感度缺口	60,938,067.96	-	357,437.09	859,948,004.55	921,243,509.60
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	84,018,483.58	-	-	-	84,018,483.58
结算备付金	3,331,974.63	-	-	-	3,331,974.63
存出保证金	254,544.12	-	-	-	254,544.12
交易性金融资产	-	-	592,100.70	995,842,313.12	996,434,413.82
应收利息	-	-	-	9,861.31	9,861.31
应收申购款	-	-	-	124,484.49	124,484.49
应收证券清算款	-	-	-	535,271.60	535,271.60
资产总计	87,605,002.33	-	592,100.70	996,511,930.52	1,084,709,033.55
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	11,814,644.84	11,814,644.84
应付管理人报酬	-	-	-	1,340,243.05	1,340,243.05
应付托管费	-	-	-	223,373.84	223,373.84
应付证券清算款	-	-	-	1,290.70	1,290.70
应付交易费用	-	-	-	1,628,802.56	1,628,802.56
应交税费	-	-	-	1.74	1.74
其他负债	-	-	-	232,771.22	232,771.22
负债总计	-	-	-	15,241,127.95	15,241,127.95
利率敏感度缺口	87,605,002.33	-	592,100.70	981,270,802.57	1,069,467,905.60

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 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.04%(2020 年 12 月 31 日：本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为

0.06%)，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。

本基金结合定性分析和定量分析，对股票资产和固定收益类资产的风险收益特征进行分析预测，确定中长期的资产配置方案。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	864,646,809.99	93.86	995,842,313.12	93.12
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	864,646,809.99	93.86	995,842,313.12	93.12

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		
	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%	60,860,000.00	62,160,000.00
	业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-60,860,000.00	-62,160,000.00

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 856,506,890.96 元,属于第二层次的余额为 8,497,356.12 元,无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日:第一层 992,850,231.78 元,属于第二层次的余额为 3,584,182.04 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或交易不活跃(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	864,646,809.99	93.23
	其中：股票	864,646,809.99	93.23
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	357,437.09	0.04
	其中：债券	357,437.09	0.04
	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	60,758,966.78	6.55
8	其他各项资产	1,645,174.34	0.18
9	合计	927,408,388.20	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	3,872,319.00	0.42
C	制造业	756,080,296.16	82.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,662.00	0.00
E	建筑业	1,538,322.37	0.17
F	批发和零售业	3,663,043.46	0.40
G	交通运输、仓储和邮政业	23,576,320.60	2.56

H	住宿和餐饮业	2,557,055.00	0.28
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,693,664.27	0.73
J	金融业	21,643,620.40	2.35
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	7,802,600.00	0.85
M	科学研究和技术服务业	23,385,772.20	2.54
N	水利、环境和公共设施管理业	35,554.25	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	13,782,290.00	1.50
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	864,646,809.99	93.86

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	300750	宁德时代	51,500	27,542,200.00	2.99
2	300122	智飞生物	133,200	24,872,436.00	2.70
3	002594	比亚迪	92,800	23,292,800.00	2.53
4	600519	贵州茅台	9,700	19,949,990.00	2.17
5	600660	福耀玻璃	313,002	17,481,161.70	1.90
6	601012	隆基股份	196,140	17,425,077.60	1.89
7	600104	上汽集团	767,900	16,870,763.00	1.83
8	002460	赣锋锂业	135,900	16,456,131.00	1.79
9	000858	五粮液	54,600	16,264,794.00	1.77
10	002475	立讯精密	323,440	14,878,240.00	1.62
11	002812	恩捷股份	63,200	14,795,120.00	1.61
12	300763	锦浪科技	79,220	14,307,132.00	1.55
13	300037	新宙邦	141,600	14,174,160.00	1.54
14	300207	欣旺达	434,304	14,140,938.24	1.53
15	300347	泰格医药	71,300	13,782,290.00	1.50
16	300012	华测检测	414,840	13,225,099.20	1.44
17	300777	中简科技	284,200	12,840,156.00	1.39
18	601995	中金公司	208,216	12,805,284.00	1.39
19	002821	凯莱英	34,200	12,742,920.00	1.38
20	300760	迈瑞医疗	26,100	12,529,305.00	1.36
21	002271	东方雨虹	213,350	11,802,522.00	1.28
22	603806	福斯特	112,160	11,791,380.80	1.28
23	002311	海大集团	142,200	11,603,520.00	1.26

24	601865	福莱特	273,200	10,799,596.00	1.17
25	000012	南玻A	1,034,200	10,590,208.00	1.15
26	300782	卓胜微	18,900	10,158,750.00	1.10
27	300274	阳光电源	88,200	10,148,292.00	1.10
28	300014	亿纬锂能	97,500	10,133,175.00	1.10
29	002585	双星新材	495,500	9,974,415.00	1.08
30	002709	天赐材料	91,750	9,778,715.00	1.06
31	600438	通威股份	222,700	9,636,229.00	1.05
32	300737	科顺股份	305,700	9,611,208.00	1.04
33	000739	普洛药业	319,300	9,387,420.00	1.02
34	601689	拓普集团	242,864	9,090,399.52	0.99
35	601636	旗滨集团	482,100	8,947,776.00	0.97
36	600089	特变电工	693,800	8,915,330.00	0.97
37	002920	德赛西威	80,000	8,806,400.00	0.96
38	603801	志邦家居	275,358	8,800,441.68	0.96
39	601966	玲珑轮胎	200,700	8,778,618.00	0.95
40	002916	深南电路	78,000	8,668,140.00	0.94
41	600031	三一重工	292,900	8,514,603.00	0.92
42	603712	七一二	229,200	8,274,120.00	0.90
43	002352	顺丰控股	116,000	7,853,200.00	0.85
44	601888	中国中免	26,000	7,802,600.00	0.85
45	603713	密尔克卫	69,600	7,515,408.00	0.82
46	300888	稳健医疗	60,400	7,466,648.00	0.81
47	603638	艾迪精密	168,980	7,244,172.60	0.79
48	688002	睿创微纳	69,664	6,954,557.12	0.75
49	600460	士兰微	120,800	6,807,080.00	0.74
50	603185	上机数控	37,500	6,710,625.00	0.73
51	688188	柏楚电子	15,224	6,637,664.00	0.72
52	688626	翔宇医疗	54,200	6,549,528.00	0.71
53	002597	金禾实业	186,600	6,475,020.00	0.70
54	300699	光威复材	83,700	6,357,015.00	0.69
55	603486	科沃斯	27,615	6,298,429.20	0.68
56	002080	中材科技	236,300	6,183,971.00	0.67
57	600862	中航高科	198,000	6,094,440.00	0.66
58	600176	中国巨石	374,859	5,814,063.09	0.63
59	603737	三棵树	32,200	5,667,200.00	0.62
60	300751	迈为股份	12,220	5,556,434.00	0.60
61	300595	欧普康视	52,460	5,432,233.00	0.59
62	300285	国瓷材料	107,200	5,226,000.00	0.57
63	603260	合盛硅业	64,900	4,991,459.00	0.54
64	600363	联创光电	175,901	4,898,842.85	0.53
65	002677	浙江美大	259,800	4,749,144.00	0.52

66	300059	东方财富	141,960	4,654,868.40	0.51
67	600885	宏发股份	73,700	4,620,990.00	0.50
68	603128	华贸物流	323,140	4,553,042.60	0.49
69	603901	永创智能	248,900	4,487,667.00	0.49
70	600309	万华化学	41,000	4,461,620.00	0.48
71	002568	百润股份	46,060	4,366,027.40	0.47
72	300769	德方纳米	20,800	4,299,152.00	0.47
73	002025	航天电器	85,400	4,284,518.00	0.47
74	600036	招商银行	77,200	4,183,468.00	0.45
75	300623	捷捷微电	110,500	4,180,215.00	0.45
76	601799	星宇股份	18,500	4,175,820.00	0.45
77	300759	康龙化成	18,400	3,992,616.00	0.43
78	002810	山东赫达	83,690	3,946,820.40	0.43
79	600563	法拉电子	24,100	3,816,476.00	0.41
80	688519	南亚新材	99,582	3,760,216.32	0.41
81	603816	顾家家居	47,000	3,632,160.00	0.39
82	000963	华东医药	78,800	3,625,588.00	0.39
83	002891	中宠股份	87,650	3,593,650.00	0.39
84	002791	坚朗五金	18,409	3,572,266.45	0.39
85	603799	华友钴业	31,200	3,563,040.00	0.39
86	002049	紫光国微	22,900	3,530,951.00	0.38
87	300149	睿智医药	182,300	3,516,567.00	0.38
88	002138	顺络电子	88,000	3,411,760.00	0.37
89	300724	捷佳伟创	28,900	3,352,689.00	0.36
90	002384	东山精密	158,600	3,305,224.00	0.36
91	002444	巨星科技	96,028	3,272,634.24	0.36
92	002340	格林美	331,000	3,094,850.00	0.34
93	603195	公牛集团	14,900	3,009,800.00	0.33
94	603297	永新光学	45,500	2,993,900.00	0.32
95	002407	多氟多	83,600	2,971,144.00	0.32
96	002139	拓邦股份	161,600	2,907,184.00	0.32
97	300357	我武生物	45,100	2,891,812.00	0.31
98	603290	斯达半导	8,500	2,720,000.00	0.30
99	601100	恒立液压	31,500	2,706,480.00	0.29
100	300223	北京君正	26,600	2,684,472.00	0.29
101	688202	美迪西	5,100	2,651,490.00	0.29
102	603345	安井食品	10,200	2,591,004.00	0.28
103	000825	太钢不锈	343,200	2,570,568.00	0.28
104	600754	锦江酒店	44,900	2,557,055.00	0.28
105	600219	南山铝业	709,100	2,552,760.00	0.28
106	000513	丽珠集团	50,900	2,546,018.00	0.28
107	600580	卧龙电驱	190,600	2,534,980.00	0.28

108	002078	太阳纸业	189,700	2,532,495.00	0.27
109	002294	信立泰	76,800	2,526,720.00	0.27
110	688006	杭可科技	25,800	2,193,000.00	0.24
111	000975	银泰黄金	230,400	2,191,104.00	0.24
112	002690	美亚光电	38,100	2,124,456.00	0.23
113	688029	南微医学	6,366	1,984,218.54	0.22
114	601866	中远海发	496,000	1,860,000.00	0.20
115	002245	蔚蓝锂芯	91,100	1,794,670.00	0.19
116	002050	三花智控	74,600	1,788,908.00	0.19
117	601899	紫金矿业	173,500	1,681,215.00	0.18
118	688208	道通科技	18,100	1,574,519.00	0.17
119	600039	四川路桥	241,300	1,512,951.00	0.16
120	002048	宁波华翔	74,600	1,454,700.00	0.16
121	000528	柳 工	129,500	1,061,900.00	0.12
122	688276	百克生物	3,486	364,565.88	0.04
123	688690	纳微科技	3,477	277,777.53	0.03
124	688059	华锐精密	1,023	163,945.98	0.02
125	688216	气派科技	2,000	133,400.00	0.01
126	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.01
127	300957	贝泰妮	392	98,768.32	0.01
128	688560	XD 明冠新	3,832	92,351.20	0.01
129	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01
130	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.01
131	688676	金盘科技	3,750	60,900.00	0.01
132	300979	华利集团	689	60,287.50	0.01
133	688117	圣诺生物	1,672	60,141.84	0.01
134	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.01
135	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
136	688685	迈信林	2,612	50,934.00	0.01
137	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
138	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
139	688067	爱威科技	1,259	31,260.97	0.00
140	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
141	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
142	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
143	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
144	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
145	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
146	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
147	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
148	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
149	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00

150	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
151	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
152	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
153	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
154	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
155	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
156	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
157	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
158	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
159	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
160	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
161	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
162	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
163	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
164	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
165	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
166	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
167	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
168	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
169	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
170	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
171	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
172	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
173	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
174	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
175	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
176	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
177	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
178	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
179	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
180	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
181	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
182	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
183	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
184	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
185	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
186	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
187	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
188	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	000002	万 科 A	33,849,854.20	3.17
2	600999	招商证券	33,503,344.05	3.13
3	002352	顺丰控股	31,255,956.87	2.92
4	600036	招商银行	27,319,182.00	2.55
5	600660	福耀玻璃	23,637,391.24	2.21
6	601100	恒立液压	23,474,236.90	2.19
7	601318	中国平安	21,651,019.93	2.02
8	002475	立讯精密	20,996,431.14	1.96
9	300737	科顺股份	19,909,506.04	1.86
10	601865	福莱特	19,813,062.00	1.85
11	000858	五 粮 液	19,354,118.00	1.81
12	600570	恒生电子	19,133,631.60	1.79
13	601888	中国中免	18,832,326.00	1.76
14	600438	通威股份	18,285,729.00	1.71
15	002594	比亚迪	17,882,665.00	1.67
16	601995	中金公司	17,704,848.96	1.66
17	600176	中国巨石	17,364,482.95	1.62
18	600104	上汽集团	17,254,772.00	1.61
19	688002	睿创微纳	17,043,148.21	1.59
20	300037	新宙邦	16,753,120.99	1.57

注：“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）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	600036	招商银行	47,877,937.00	4.48
2	603345	安井食品	35,797,469.61	3.35
3	600570	恒生电子	33,847,377.37	3.16
4	002475	立讯精密	33,386,559.04	3.12
5	600999	招商证券	31,488,244.05	2.94
6	000333	美的集团	31,441,902.80	2.94
7	601318	中国平安	31,418,955.13	2.94
8	000002	万 科 A	30,905,229.00	2.89
9	002714	牧原股份	29,128,455.93	2.72
10	600426	华鲁恒升	28,063,344.00	2.62
11	002352	顺丰控股	27,857,903.00	2.60
12	601100	恒立液压	27,233,710.74	2.55
13	300725	药石科技	25,569,493.20	2.39

14	300059	东方财富	22,764,349.80	2.13
15	002891	中宠股份	22,061,077.46	2.06
16	002007	华兰生物	21,875,067.25	2.05
17	300347	泰格医药	21,148,448.00	1.98
18	300750	宁德时代	19,483,939.75	1.82
19	603713	密尔克卫	19,099,562.50	1.79
20	601865	福莱特	18,892,097.00	1.77

注：“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）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	1,797,896,294.68
卖出股票收入（成交）总额	2,048,158,115.45

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	357,437.09	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	357,437.09	0.04

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	123115	捷捷转债	1,877	271,376.66	0.03
2	127036	三花转债	657	86,060.43	0.01

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

报告期内，本基金未参与股指期货交易；截至报告期末，本基金未持有股指期货合约。

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的规定，本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。

本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素，结合定性和定量方法，确定投资时机。基金管理人另根据 CAPM 模型计算得到的组合 Beta 值，结合股票投资的总体规模，以及中国证监会的相关限定和要求，确定参与股指期货交易的投资比例。

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

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本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没有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	179,101.18
2	应收证券清算款	1,009,504.89
3	应收股利	—

4	应收利息	7,080.79
5	应收申购款	449,487.48
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,645,174.34

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 (%)
52,277	9885.47	34,857,129.51	6.75	481,925,726.57	93.25

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	35,471.59	0.0069

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 (2011 年 5 月 17 日) 基金份额总额	1,043,603,222.41
本报告期期初基金份额总额	617,622,315.00
本报告期基金总申购份额	67,540,175.10
减：本报告期基金总赎回份额	168,379,634.02
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	516,782,856.08

§ 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	
长江证券	2	883,450,920.40	23.02%	822,750.08	23.98%	—
海通证券	1	323,285,808.38	8.42%	301,076.88	8.78%	—
天风证券	1	321,882,139.98	8.39%	235,392.64	6.86%	—
广发证券	1	294,604,574.82	7.68%	274,366.84	8.00%	—
中信证券	3	246,101,523.51	6.41%	229,194.17	6.68%	—

国信证券	1	243,438,761.69	6.34%	226,713.23	6.61%	—
申万宏源	2	207,493,233.15	5.41%	193,239.09	5.63%	—
中泰证券	1	203,436,073.92	5.30%	189,459.82	5.52%	—
华创证券	1	179,112,155.07	4.67%	166,807.91	4.86%	—
东吴证券	1	164,953,691.72	4.30%	120,631.37	3.52%	—
瑞银证券	1	122,058,748.00	3.18%	113,671.47	3.31%	—
方正证券	2	121,619,706.93	3.17%	113,264.28	3.30%	—
华鑫证券	2	102,734,784.33	2.68%	95,673.33	2.79%	—
开源证券	1	85,182,364.92	2.22%	62,294.23	1.82%	—
浙商证券	2	77,812,103.66	2.03%	56,902.87	1.66%	—
国海证券	1	74,418,691.68	1.94%	69,305.45	2.02%	—
国泰君安	1	70,925,243.10	1.85%	66,052.48	1.93%	—
兴业证券	1	49,255,797.73	1.28%	45,872.03	1.34%	—
长城证券	2	35,416,981.60	0.92%	25,900.53	0.75%	—
西部证券	1	30,546,082.40	0.80%	22,339.48	0.65%	—
信达证券	1	137,965.25	0.00%	100.88	0.00%	—
东兴证券	1	—	—	—	—	—
东北证券	1	—	—	—	—	—
东方证券	2	—	—	—	—	—
中信建投	2	—	—	—	—	—
中投证券	1	—	—	—	—	—
中金公司	1	—	—	—	—	—
中银国际	2	—	—	—	—	—
光大证券	1	—	—	—	—	—
国金证券	1	—	—	—	—	—
太平洋证券	1	—	—	—	—	—
安信证券	2	—	—	—	—	—
宏信证券	1	—	—	—	—	—
川财证券	2	—	—	—	—	—

平安证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

注： 1. 专用交易单元的选择标准

(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
长江证券	337,920.00	26.14%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	667,090.17	51.61%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	287,553.97	22.25%	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-

开源证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

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
3	本公司旗下 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
4	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
5	本公司关于旗下部分基金参与中国农业银行股份有限公司定投费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 2 月 1 日
6	关于本基金暂停大额申购、转换转入	中国证监会规定报刊及	2021 年 3 月 9 日

	及定期定额投资业务的公告	网站	
7	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
8	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
9	本基金 2021 年第一次收益分配公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 3 月 10 日
10	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
11	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
12	本基金基金产品资料概要（更新）、基金招募说明书更新	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 3 月 24 日
13	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
14	本公司旗下 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 30 日
15	本公司旗下 26 只基金 2020 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 3 月 30 日
16	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
17	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
18	本公司旗下全部基金 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
19	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
20	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
21	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
22	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
23	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
24	本公司关于旗下部分基金增加腾安基	中国证监会规定报刊及	2021 年 5 月 28 日

	金销（深圳）有限公司为销售机构并参与费率优惠活动的公告	网站	
25	关于本基金暂停大额申购、转换转入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 6 月 3 日
26	本基金 2021 年第二次收益分配公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 6 月 4 日
27	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 备查文件目录

11.1 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。

11.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

11.3 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