

摩根士丹利华鑫进取优选股票型证券投资 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	11
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	12
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	12
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 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	39
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	42
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	46
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	46
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 影响投资者决策的其他重要信息	53
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	53
§ 12 备查文件目录	54
12.1 备查文件目录	54
12.2 存放地点	54
12.3 查阅方式	54

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	摩根士丹利华鑫进取优选股票型证券投资基金
基金简称	大摩进取优选股票
基金主代码	000594
交易代码	000594
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 5 月 29 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	472,871,112.39 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在适度控制风险并保持良好流动性的前提下，以进取型策略，选择趋势向上的行业里的具有高度进取精神并拥有一流团队、一流创新能力的优质公司作为投资对象，力争获取超越业绩比较基准的中长期稳定收益。
投资策略	<p>1、大类资产配置策略</p> <p>从宏观经济、宏观政策、基本面和流动性等四个纬度进行综合分析，在把握经济周期性波动的基础上，动态评估不同资产类在不同时期的投资价值、投资时机以及其风险收益特征，追求股票、债券和货币等大类资产的动态配置及资产的稳健增长。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>（1）行业配置策略</p> <p>从经济周期、行业政策和行业基本面指标三个方面评估行业发展趋势，在此基础上判断行业的可持续发展能力，作为本基金行业配置的依据。</p> <p>（2）个股选择策略</p> <p>采用“自下而上”的个股优选策略，坚持以深入细致的基本面研究为选股的基本原则，投资于具备以下几方面优选特质的上市企业：1）该企业处于趋势向上的优质行业；2）该企业为所处行业内最优质的公司；3）该企业具有激励充分的一流管理团队。依靠定量分析与定性分析相结合的方法对个股进行选择。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>将结合宏观经济变化趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，运用利率预期、久期管理、收益率曲线等投资管理策略，权衡到期收益率与市场流动性构建和调整债券组合，在追求投资收益的同时兼顾债券资产的流动性和安全性。</p> <p>4、权证投资策略</p> <p>在确保与基金投资目标相一致的前提下，通过对权证标的证券的基本面研究，并结合权证定价模型估计权证价值，本着谨慎和风险可</p>

	控的原则，为取得与承担风险相称的收益，投资于权证。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×85%+标普中国债券指数收益率×15%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。

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	李申
	联系电话	(0755)88318883	(021)60637102
	电子邮箱	xxpl@msfunds.com.cn	lishen.zh@ccb.com
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	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ms funds.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	-109,149,938.93
本期利润	-100,258,189.89
加权平均基金份额本期利润	-0.1788
本期加权平均净值利润率	-5.09%
本期基金份额净值增长率	24.36%
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	555,960,679.36

期末可供分配基金份额利润	1.1757
期末基金资产净值	1,718,810,463.53
期末基金份额净值	3.635
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	263.50%

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。

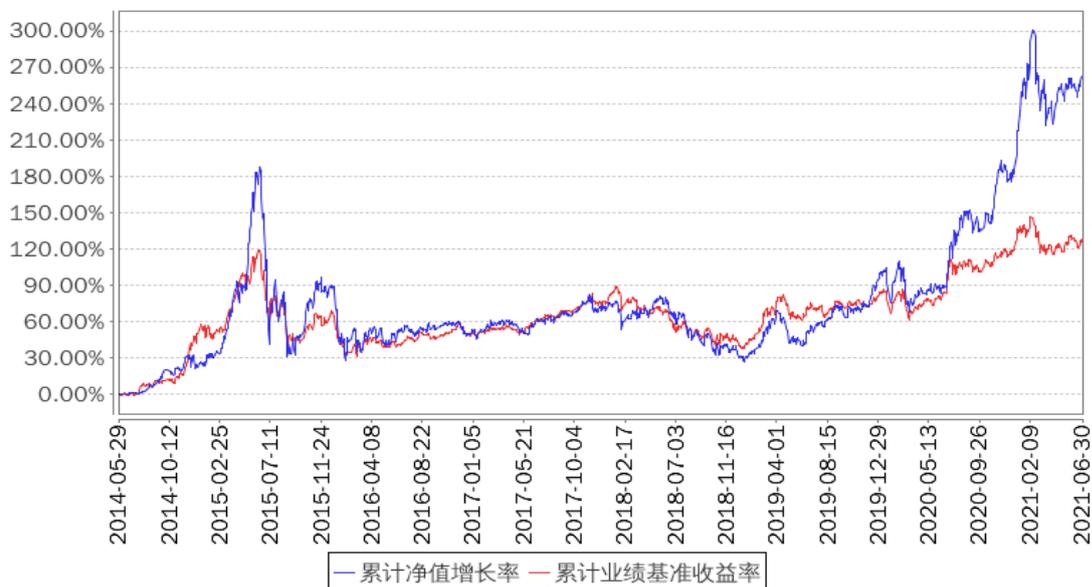
3.2 基金净值表现

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	1.76%	0.88%	-1.68%	0.68%	3.44%	0.20%
过去三个月	9.59%	1.09%	3.16%	0.83%	6.43%	0.26%
过去六个月	24.36%	1.78%	0.63%	1.12%	23.73%	0.66%
过去一年	90.31%	1.70%	22.06%	1.13%	68.25%	0.57%
过去三年	117.27%	1.60%	44.10%	1.16%	73.17%	0.44%
自基金合同生效起至今	263.50%	1.78%	126.35%	1.27%	137.15%	0.51%

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

大摩进取优选股票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



§ 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		
缪东航	基金经理	2021年4月17日	-	11年	北京大学金融学硕士。曾任华安基金管理有限公司建材行业研究员，2012年9月加入本公司，历任研究管理部研究员、基金经理助理，现任权益投资部基金经理。2017年1月起担任摩根士丹利华鑫主题优选混合型证券投资基金基金经理，2017年5月至2020年5月以及2021年4月起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，2017年5月至2021年1月

					担任摩根士丹利华鑫新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 11 月至 2020 年 12 月担任摩根士丹利华鑫新趋势灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 12 月至 2020 年 5 月担任摩根士丹利华鑫万众创新灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 3 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。
朱睿	基金经理	2019 年 4 月 20 日	2021 年 5 月 29 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，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基金经理。

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合规守信情况的说明

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

回顾 2021 年上半年，新冠疫情在全球范围内得以缓解，全球经济有序复苏。A 股市场震荡上行，板块之间分化非常大，上证指数上涨 3.4%，但创业板指数上涨 17.2%。在全球各国政府的政策的推动下，光伏和电动车的需求持续高增长，相关公司的业绩持续超预期推动股价上涨。同时，电动车和消费电子的需求井喷，也在一定程度上造成了芯片供应紧张，部分芯片公司的业绩在今年上半年出现了明显改善。上半年全球疫苗接种率快速提升，疫苗板块的业绩预期持续改善，受益于工程师红利以及良好的基础设施，医药研发需求持续向中国转移，CRO 和 CDMO 产业在中国快速发展。

本基金上半年对组合进行了一些调整。在调整过程中，股票仓位基本保持稳定。本基金采取了以下个股调整思路：

1) 本基金精选的公司具有相关领域渠道、品牌、技术或上下游产业链等护城河，业务创新体系顺畅，进入壁垒高；

2) 减持了大炼化板块。本基金在一季度持有较多大炼化相关的个股，大炼化板块的走势受到油价的影响较大，本基金在二季度根据对原油需求和价格的判断适当调整了板块配置。疫情之后国际原油价格一度下跌到 20 美元/桶的历史低位，从去年二季度开始原油价格持续反弹，去年四季度原油价格加速上涨。疫情之后原油价格的反弹不仅将推动炼化行业盈利的改善，而且也推动了原油相关的化工品的价格上涨，石化产业链的盈利在疫情之后普遍呈现向好趋势。今年二季度原油价格突破 70 美元/桶，接近了 2018 年的高点，油价进一步上涨的空间相对有限。从长期看，目前全球主要国家都在积极推进新能源产业的发展，将对原油需求形成一定替代。考虑到原油价格在短期面临的调整风险，以及原油需求在长期面临的下行压力，本基金减持了大炼化相关的个股。

3) 降低了周期股的配置。除了石化相关的个股，本基金还持有其他板块的周期股。受益于下游较为旺盛的需求，今年以来大宗商品的价格涨幅较大。在二季度，随着疫情的缓解，海内外的复工复产有序进行，周期品的供给逐渐释放。目前大部分周期品的价格和盈利处于历史较高水平，鉴于周期品后续面临的价格压力，本基金基于逆向投资的原则，在二季度的上涨中逐步减持了周期品。

4) 重点配置了高端制造业。中国政府在新冠疫情中采取了刺激生产以促进经济复苏的措施，同时，海外产能在新冠疫情中普遍停工停产，疫情以来全球都在购买中国的商品，不仅是高端制造业在疫情期间实现了进口替代，甚至有些转移出中国的低端制造业也开始回流国内。不过，相比于低端制造业，本基金更加看好高端制造业增长的持续性。

5) 在消费品领域偏重于偏刚需的消费品。得益于中国政府强有力的控制手段，国内疫情已经得到控制，新冠疫情仍然深刻改变了人们的消费行为，在结构上，消费支出主要用于确保食品和家居等相对必需的生活开支，适当削减了外出旅游和观影等非刚性需求，可选消费品的复苏是大势所趋，但仍然需要一定的时间等待消费者信心恢复，本基金在消费板块的配置也顺应这些居民消费结构的变化，适当做了一些调整。

本基金将动态调整资产配置比例并寻求结构性投资机会。在资产配置方面，除非出现重大的宏观利空因素，本基金将维持中性偏高的仓位，个股选择是本基金获取超额收益的主要手段，本基金将以逆向投资思维进行个股选择，重点关注个股的预期差。在个股的风格方面，本基金认为中盘蓝筹股兼具核心竞争力和成长性，中盘蓝筹将是本基金的重点选股方面。相比于行业的景气度和公司业务的成长性，本基金更加关注公司的核心竞争力。本基金始终坚信，具有核心竞争力的公司，才能为股东持续创造超额利润，从而为投资者持续创造超额收益。

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 3.635 元，累计份额净值为 3.635 元，报告期内基金份额净值增长率为 24.36%，同期业绩比较基准收益率为 0.63%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于宏观经济，我们保持相对乐观。近期虽然政府进行了全面降准等操作，但我们认为目前国内经济增长仍然具有较强的韧性，降准是政府在进行跨周期调节以及对冲下半年的 MLF 到期，并不意味着政府在托底经济。从出口、地产投资和基建投资等拉动经济增长的几个方面看，虽然经济在远期有压力，但不可低估经济在中短期的韧性。此外，我们观察到近期制造业投资复苏较快，这意味着经济的内生增长动力较强，下半年的经济增长或将好于预期。

对于证券市场，我们保持相对乐观。今年宏观经济总体将保持平稳，货币政策不会急转弯，市场流动性将保持合理充裕。在持续的地产调控下，房价的上涨趋缓，理财市场被规范，居民资金入市的需求较为旺盛，将成为维持 A 股估值的重要力量。此外，资本市场的制度不断优化，科创板和创业板的注册制已经平稳运行，大量优质公司的上市将为 A 股的上涨注入新的活力。

对于行业走势，我们认为会有所分化。受益于工程师红利和进口替代，中国的科技产业和高端制造业在全球的竞争力将不断提升，近期上市的新股也主要是集中在这两个板块。此外，电动

车和光伏产业的蓬勃发展带来了较强的溢出效应，从根本上提升了中国制造业和科技产业在全球的竞争力。消费板块的内部也将出现分化，我们观察到偏刚需的消费品在疫情之后复苏较快，可选消费的复苏不达预期。在碳中和的背景下，周期品的景气度表现出较强的持续性，我们关注的是，需求还能持续增长的周期品，而不是看短期的行业景气度。

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合规守信情况声明

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。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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：摩根士丹利华鑫进取优选股票型证券投资基金

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	155,673,997.69	15,308,281.28
结算备付金		16,892,151.73	2,006,396.81
存出保证金		1,205,282.35	66,590.70
交易性金融资产	6.4.7.2	1,571,723,934.30	220,234,316.01
其中：股票投资		1,571,723,934.30	220,234,316.01
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		21,148,480.45	2,080,641.20
应收利息	6.4.7.5	23,842.40	2,857.74

应收股利		-	-
应收申购款		8,088,634.14	313,932.13
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,774,756,323.06	240,013,015.87
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		-	-
应付赎回款		47,734,009.54	5,718,353.86
应付管理人报酬		2,270,966.71	324,767.69
应付托管费		378,494.46	54,127.94
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	5,397,707.26	427,444.95
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	164,681.56	103,826.82
负债合计		55,945,859.53	6,628,521.26
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	472,871,112.39	79,852,676.46
未分配利润	6.4.7.10	1,245,939,351.14	153,531,818.15
所有者权益合计		1,718,810,463.53	233,384,494.61
负债和所有者权益总计		1,774,756,323.06	240,013,015.87

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 3.635 元，基金份额总额 472,871,112.39 份。

6.2 利润表

会计主体：摩根士丹利华鑫进取优选股票型证券投资基金

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	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
一、收入		-67,593,115.14	-434,891.11
1. 利息收入		403,868.31	16,666.54
其中：存款利息收入	6.4.7.11	399,860.90	16,666.54
债券利息收入		4,007.41	-
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）		-98,057,851.16	2,024,223.43
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-113,317,509.12	1,666,516.07
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	787,784.89	-
资产支持证券投资	6.4.7.13.5	-	-
收益			
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	14,471,873.07	357,707.36
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	8,891,749.04	-2,621,581.66
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	21,169,118.67	145,800.58
减：二、费用		32,665,074.75	922,372.86
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	14,670,678.09	363,012.00
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,445,112.98	60,502.03
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	15,471,821.55	443,429.48
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		14.42	-
7. 其他费用	6.4.7.20	77,447.71	55,429.35
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-100,258,189.89	-1,357,263.97
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-100,258,189.89	-1,357,263.97

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：摩根士丹利华鑫进取优选股票型证券投资基金

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)	79,852,676.46	153,531,818.15	233,384,494.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-100,258,189.89	-100,258,189.89
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)	393,018,435.93	1,192,665,722.88	1,585,684,158.81
其中：1. 基金申购款	1,444,297,657.02	3,856,515,884.25	5,300,813,541.27
2. 基金赎回款	-1,051,279,221.09	-2,663,850,161.37	-3,715,129,382.46
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)	472,871,112.39	1,245,939,351.14	1,718,810,463.53
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)	28,969,492.38	27,636,826.41	56,606,318.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,357,263.97	-1,357,263.97
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)	-6,136,313.54	-5,496,675.82	-11,632,989.36
其中：1. 基金申购款	11,733,282.91	10,910,892.90	22,644,175.81
2. 基金赎回款	-17,869,596.45	-16,407,568.72	-34,277,165.17
四、本期向基金	-	-	-

份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	22,833,178.84	20,782,886.62	43,616,065.46

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：

王鸿斌

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

摩根士丹利华鑫进取优选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[2013]1596号《关于核准摩根士丹利华鑫进取优选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《摩根士丹利华鑫进取优选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证券投资基金,存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集422,043,460.71元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2014)第304号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《摩根士丹利华鑫进取优选股票型证券投资基金基金合同》于2014年5月29日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为422,102,094.73份,其中认购资金利息折合58,634.02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《中华人民共和国证券投资基金法》和《摩根士丹利华鑫进取优选股票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、债券、权证、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合的资产配置:股票投资占基金资产的比例为80%-95%,其中投资于进取优选相关股票的比例不低于非现金基金资产的80%;权证投资占基金资产净值的比例不高于3%;现金或者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:沪深300指数收益率×85%+中信标普全债指数收益率×15%。根据本基金的基金管理人于2015年9月29日发布的《摩根士丹利华鑫基金管理有限公司关于旗下部分开放式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

金业绩比较基准变更为：沪深 300 指数收益率×85%+标普中国债券指数收益率×15%。

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》、《摩根士丹利华鑫进取优选股票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	155,673,997.69
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	155,673,997.69

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	1,551,325,259.19	1,571,723,934.30	20,398,675.11
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,551,325,259.19	1,571,723,934.30	20,398,675.11

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	15,698.60
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	7,601.40
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	542.40
合计	23,842.40

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	5,397,707.26
银行间市场应付交易费用	-
合计	5,397,707.26

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	96,174.19
应付证券出借违约金	-
预提费用	68,507.37
合计	164,681.56

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	79,852,676.46	79,852,676.46
本期申购	1,444,297,657.02	1,444,297,657.02
本期赎回（以“-”号填列）	-1,051,279,221.09	-1,051,279,221.09
- 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	472,871,112.39	472,871,112.39

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	96,489,161.77	57,042,656.38	153,531,818.15
本期利润	-109,149,938.93	8,891,749.04	-100,258,189.89
本期基金份额交易产生的变动数	568,621,456.52	624,044,266.36	1,192,665,722.88
其中：基金申购款	1,937,357,953.53	1,919,157,930.72	3,856,515,884.25
基金赎回款	-1,368,736,497.01	-1,295,113,664.36	-2,663,850,161.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	555,960,679.36	689,978,671.78	1,245,939,351.14

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	307,714.43
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	86,515.55
其他	5,630.92
合计	399,860.90

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	-113,317,509.12
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	-113,317,509.12

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	4,841,013,073.28
减：卖出股票成本总额	4,954,330,582.40
买卖股票差价收入	-113,317,509.12

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	787,784.89
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	787,784.89

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	12,589,212.53
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	11,797,300.00
减：应收利息总额	4,127.64
买卖债券差价收入	787,784.89

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	14,471,873.07
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	14,471,873.07

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	8,891,749.04
股票投资	8,891,749.04
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-

减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	8,891,749.04

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	21,098,511.80
基金转换费收入	70,606.87
合计	21,169,118.67

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% 归入基金资产，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	15,471,821.55
银行间市场交易费用	-
合计	15,471,821.55

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	19,835.79
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行费用	8,940.34
债券账户维护费	9,000.00
合计	77,447.71

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	1,271,680,739.35	11.43	-	-

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的权证交易。

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	1,184,318.53	12.32	613,041.78	11.36
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(%)
-	-	-	-	-

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	14,670,678.09	363,012.00
其中：支付销售机构的客户维护费	6,009,148.92	170,113.40

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	2,445,112.98	60,502.03

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	155,673,997.69	307,714.43	2,626,426.22	14,347.07

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

本基金本报告期无利润分配事项。

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日	2021年11月25日	新股流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
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	214	5,264.40	34,882.00	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年07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	325	8,024.25	10,305.75	-
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	853	40,372.49	214,921.88	-
300958	建工修复	2021年 3月18 日	2021年 9月29 日	新股流 通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
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	新股流 通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-

		日	11日							
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	925	30,728.50	80,937.50	-
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	2021年	2021年	新股流	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-

	家	5月26日	12月2日	通受限						
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	-
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	-

688079	美迪凯	2021年 2月23 日	2021年 9月2 日	新股流 通受限	10.19	18.40	10,622	108,238.18	195,444.80	-
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	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688092	爱科科技	2021年 3月12 日	2021年 9月22 日	新股流 通受限	19.11	33.21	1,137	21,728.07	37,759.77	-
688113	联测科技	2021年 4月26 日	2021年 11月8 日	新股流 通受限	19.14	49.29	1,415	27,083.10	69,745.35	-
688161	威高骨科	2021年 6月23 日	2021年 12月 30日	新股流 通受限	36.22	82.27	3,069	111,159.18	252,486.63	-
688201	信安世纪	2021年 4月13 日	2021年 10月 21日	新股流 通受限	26.78	45.41	2,129	57,014.62	96,677.89	-
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	-
688323	瑞华泰	2021年 4月21 日	2021年 10月 28日	新股流 通受限	5.97	22.78	4,513	26,942.61	102,806.14	-
688499	利元亨	2021年 6月23 日	2022年 1月1 日	新股流 通受限	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
688607	康众医疗	2021年 1月25 日	2021年 8月2 日	新股流 通受限	23.21	44.50	1,890	43,866.90	84,105.00	-
688636	智明达	2021年 3月30 日	2021年 10月8 日	新股流 通受限	34.50	80.72	918	31,671.00	74,100.96	-
688689	银河微电	2021年 1月15 日	2021年 7月27 日	新股流 通受限	14.01	35.62	3,258	45,644.58	116,049.96	-

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

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

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

本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金，属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的基金产品。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资。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限定在限定的范围之内，力争获取超越业绩比较基准的中长期稳定收益。

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建设银行，因而与上述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，本基金未持有债券和资产支持证券投资(2020 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

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

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期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上市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、结算备付金及存出保证金等。

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	155,673,997.69	-	-	-	155,673,997.69
结算备付金	16,892,151.73	-	-	-	16,892,151.73
存出保证金	1,205,282.35	-	-	-	1,205,282.35
交易性金融资产	-	-	-	1,571,723,934.30	1,571,723,934.30
应收利息	-	-	-	23,842.40	23,842.40
应收申购款	-	-	-	8,088,634.14	8,088,634.14
应收证券清算款	-	-	-	21,148,480.45	21,148,480.45
资产总计	173,771,431.77	-	-	1,600,984,891.29	1,774,756,323.06
负债					
应付赎回款	-	-	-	47,734,009.54	47,734,009.54
应付管理人报酬	-	-	-	2,270,966.71	2,270,966.71
应付托管费	-	-	-	378,494.46	378,494.46
应付交易费用	-	-	-	5,397,707.26	5,397,707.26
其他负债	-	-	-	164,681.56	164,681.56
负债总计	-	-	-	55,945,859.53	55,945,859.53
利率敏感度缺口	173,771,431.77	-	-	1,545,039,031.76	1,718,810,463.53
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	15,308,281.28	-	-	-	15,308,281.28
结算备付金	2,006,396.81	-	-	-	2,006,396.81
存出保证金	66,590.70	-	-	-	66,590.70
交易性金融资产	-	-	-	220,234,316.01	220,234,316.01
应收利息	-	-	-	2,857.74	2,857.74
应收申购款	-	-	-	313,932.13	313,932.13

应收证券清算款	-	-	-	2,080,641.20	2,080,641.20
资产总计	17,381,268.79	-	-	222,631,747.08	240,013,015.87
负债					
应付赎回款	-	-	-	5,718,353.86	5,718,353.86
应付管理人报酬	-	-	-	324,767.69	324,767.69
应付托管费	-	-	-	54,127.94	54,127.94
应付交易费用	-	-	-	427,444.95	427,444.95
其他负债	-	-	-	103,826.82	103,826.82
负债总计	-	-	-	6,628,521.26	6,628,521.26
利率敏感度缺口	17,381,268.79	-	-	216,003,225.82	233,384,494.61

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，本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资(2020 年 12 月 31 日：同)，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，结合定性分析和定量分析方法的结论，以实现大类资产的动态配置。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。本基金持有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	1,571,723,934.30	91.44	220,234,316.01	94.37
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	1,571,723,934.30	91.44	220,234,316.01	94.37

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%	93,570,000.00	13,800,000.00
	业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-93,570,000.00	-13,800,000.00

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 1,569,582,482.01 元，属于第二层次的余额为 2,141,452.29 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日,属于第一层次的余额为 220,049,085.64 元，属于第二层次的余额为 185,230.37 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	1,571,723,934.30	88.56
	其中：股票	1,571,723,934.30	88.56
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	-	-

	产		
7	银行存款和结算备付金合计	172,566,149.42	9.72
8	其他各项资产	30,466,239.34	1.72
9	合计	1,774,756,323.06	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	1,061,397,691.16	61.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,662.00	0.00
E	建筑业	60,334,466.77	3.51
F	批发和零售业	37,455.46	0.00
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	114,190,409.36	6.64
J	金融业	69,721,019.76	4.06
K	房地产业	87,016,026.00	5.06
L	租赁和商务服务业	61,840,638.00	3.60
M	科学研究和技术服务业	54,446,343.00	3.17
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	62,688,378.26	3.65
S	综合	-	-
	合计	1,571,723,934.30	91.44

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	600315	上海家化	2,522,700	151,715,178.00	8.83
2	002677	浙江美大	7,756,669	141,791,909.32	8.25
3	300408	三环集团	3,278,792	139,086,356.64	8.09
4	603833	欧派家居	897,640	127,428,974.40	7.41
5	000002	万科A	3,654,600	87,016,026.00	5.06
6	300124	汇川技术	1,062,200	78,878,972.00	4.59
7	002230	科大讯飞	1,109,800	75,000,284.00	4.36

8	002027	分众传媒	6,571,800	61,840,638.00	3.60
9	300760	迈瑞医疗	117,602	56,454,840.10	3.28
10	603259	药明康德	347,700	54,446,343.00	3.17
11	601117	中国化学	5,843,223	51,186,633.48	2.98
12	000001	平安银行	2,100,100	47,504,262.00	2.76
13	300747	锐科激光	414,050	47,226,543.00	2.75
14	601799	星宇股份	198,083	44,711,294.76	2.60
15	600600	青岛啤酒	379,769	43,920,284.85	2.56
16	688111	金山办公	98,919	39,053,221.20	2.27
17	002367	康力电梯	3,887,500	34,754,250.00	2.02
18	603986	兆易创新	156,900	29,481,510.00	1.72
19	000333	美的集团	412,700	29,454,399.00	1.71
20	601233	桐昆股份	1,181,036	28,451,157.24	1.66
21	600031	三一重工	881,700	25,631,019.00	1.49
22	300860	锋尚文化	386,964	22,552,261.92	1.31
23	002739	万达电影	1,417,046	22,375,156.34	1.30
24	300033	同花顺	196,992	22,216,757.76	1.29
25	002376	新北洋	2,160,632	19,748,176.48	1.15
26	300144	宋城演艺	1,057,200	17,760,960.00	1.03
27	600741	华域汽车	674,200	17,711,234.00	1.03
28	300122	智飞生物	94,400	17,627,312.00	1.03
29	300737	科顺股份	326,337	10,260,035.28	0.60
30	605499	东鹏饮料	37,003	9,280,352.40	0.54
31	002081	金螳螂	1,151,826	9,122,461.92	0.53
32	603087	甘李药业	53,800	5,734,004.00	0.33
33	688161	威高骨科	3,069	252,486.63	0.01
34	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.01
35	688079	美迪凯	10,622	195,444.80	0.01
36	688689	银河微电	3,258	116,049.96	0.01
37	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.01
38	688323	瑞华泰	4,513	102,806.14	0.01
39	688201	信安世纪	2,129	96,677.89	0.01
40	688607	康众医疗	1,890	84,105.00	0.00
41	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.00
42	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
43	688636	智明达	918	74,100.96	0.00
44	688113	联测科技	1,415	69,745.35	0.00
45	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.00
46	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.00
47	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
48	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
49	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00

50	688092	爱科科技	1,137	37,759.77	0.00
51	300919	中伟股份	214	34,882.00	0.00
52	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
53	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
54	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
55	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
56	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
57	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
58	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
59	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
60	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
61	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
62	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
63	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
64	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
65	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
66	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
67	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
68	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
69	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
70	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
71	300932	三友联众	325	10,305.75	0.00
72	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
73	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
74	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
75	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
76	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
77	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
78	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
79	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
80	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
81	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
82	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
83	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
84	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
85	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
86	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
87	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
88	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
89	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
90	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
91	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00

92	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
93	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
94	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
95	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
96	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
97	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
98	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	601233	桐昆股份	300,901,538.97	128.93
2	002493	荣盛石化	265,586,613.70	113.80
3	002677	浙江美大	222,662,869.19	95.41
4	603833	欧派家居	217,936,923.82	93.38
5	600315	上海家化	203,219,403.90	87.07
6	300408	三环集团	187,216,600.13	80.22
7	002064	华峰化学	185,236,992.73	79.37
8	002597	金禾实业	182,325,913.49	78.12
9	600219	南山铝业	175,690,206.20	75.28
10	601966	玲珑轮胎	173,703,254.82	74.43
11	600409	三友化工	168,753,056.69	72.31
12	000100	TCL 科技	168,389,889.39	72.15
13	600346	恒力石化	161,860,643.19	69.35
14	603225	新凤鸣	159,516,174.38	68.35
15	000002	万 科 A	159,214,844.15	68.22
16	601808	中海油服	151,882,618.47	65.08
17	603612	索通发展	142,816,801.00	61.19
18	002027	分众传媒	135,299,995.02	57.97
19	002299	圣农发展	129,363,750.97	55.43
20	600988	赤峰黄金	126,981,965.38	54.41
21	002230	科大讯飞	126,290,561.66	54.11
22	000902	新洋丰	121,023,111.76	51.86
23	300737	科顺股份	111,811,184.25	47.91
24	002078	太阳纸业	108,779,127.36	46.61
25	000301	东方盛虹	106,598,756.51	45.68
26	600426	华鲁恒升	106,548,779.00	45.65
27	002978	安宁股份	101,122,445.00	43.33
28	300829	金丹科技	97,811,966.40	41.91
29	000998	隆平高科	86,467,748.08	37.05
30	300124	汇川技术	85,734,117.07	36.74

31	002081	金螳螂	84,841,782.55	36.35
32	002739	万达电影	83,181,272.90	35.64
33	000001	平安银行	77,295,333.10	33.12
34	000807	云铝股份	73,373,788.89	31.44
35	300760	迈瑞医疗	72,020,962.75	30.86
36	002734	利民股份	60,741,577.22	26.03
37	002637	赞宇科技	59,615,463.00	25.54
38	603259	药明康德	55,710,433.00	23.87
39	300747	锐科激光	53,626,495.00	22.98
40	601117	中国化学	52,379,723.75	22.44
41	601799	星宇股份	52,197,554.76	22.37
42	000333	美的集团	51,668,297.96	22.14
43	603995	甬金股份	51,418,641.96	22.03
44	688111	金山办公	49,545,482.27	21.23
45	600600	青岛啤酒	49,427,977.41	21.18
46	003006	百亚股份	48,622,294.88	20.83
47	002367	康力电梯	48,092,095.36	20.61
48	300144	宋城演艺	47,799,203.80	20.48
49	601899	紫金矿业	47,637,374.00	20.41
50	600803	新奥股份	47,576,626.21	20.39
51	002353	杰瑞股份	47,239,230.47	20.24
52	603983	丸美股份	46,931,352.82	20.11
53	600031	三一重工	37,301,478.31	15.98
54	000923	河钢资源	30,288,250.92	12.98
55	300033	同花顺	29,072,399.16	12.46
56	300415	伊之密	28,050,249.82	12.02
57	300860	锋尚文化	27,869,967.37	11.94
58	603986	兆易创新	26,408,322.39	11.32
59	002376	新北洋	21,670,650.29	9.29
60	603505	金石资源	21,093,983.15	9.04
61	600741	华域汽车	19,223,553.00	8.24
62	605499	东鹏饮料	17,931,504.74	7.68
63	300122	智飞生物	17,067,379.00	7.31
64	603619	中曼石油	16,921,106.19	7.25
65	002206	海利得	16,257,513.00	6.97
66	600141	兴发集团	14,821,131.00	6.35
67	603087	甘李药业	9,629,831.15	4.13
68	603801	志邦家居	9,012,789.00	3.86
69	600201	生物股份	6,363,215.03	2.73
70	000921	海信家电	4,988,473.00	2.14

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	601233	桐昆股份	262,860,949.88	112.63
2	002493	荣盛石化	260,479,058.18	111.61
3	601966	玲珑轮胎	208,467,170.34	89.32
4	000100	TCL 科技	184,056,423.90	78.86
5	002064	华峰化学	180,307,153.60	77.26
6	603612	索通发展	171,478,398.66	73.47
7	600409	三友化工	169,293,841.33	72.54
8	600219	南山铝业	167,271,590.07	71.67
9	601808	中海油服	157,196,139.69	67.36
10	002597	金禾实业	156,150,468.02	66.91
11	600346	恒力石化	146,700,941.65	62.86
12	603225	新凤鸣	140,820,566.45	60.34
13	300737	科顺股份	133,210,654.38	57.08
14	600426	华鲁恒升	131,833,296.51	56.49
15	600988	赤峰黄金	124,161,996.03	53.20
16	000902	新洋丰	113,465,804.44	48.62
17	000301	东方盛虹	113,088,435.72	48.46
18	002299	圣农发展	111,261,593.79	47.67
19	002978	安宁股份	110,018,544.75	47.14
20	000807	云铝股份	104,382,889.84	44.73
21	002078	太阳纸业	102,307,562.40	43.84
22	000998	隆平高科	86,061,256.34	36.88
23	002230	科大讯飞	85,489,621.00	36.63
24	002027	分众传媒	73,202,713.59	31.37
25	300829	金丹科技	72,982,314.34	31.27
26	002637	赞宇科技	71,077,679.00	30.46
27	002081	金螳螂	66,081,430.77	28.31
28	603833	欧派家居	60,102,645.16	25.75
29	002734	利民股份	57,546,923.81	24.66
30	601899	紫金矿业	54,942,217.01	23.54
31	002739	万达电影	54,839,624.50	23.50
32	002677	浙江美大	54,281,001.45	23.26
33	000002	万科A	53,860,868.60	23.08
34	600315	上海家化	53,305,795.79	22.84
35	002353	杰瑞股份	52,166,476.00	22.35
36	003006	百亚股份	49,536,871.06	21.23
37	603995	甬金股份	47,450,665.20	20.33
38	300408	三环集团	44,509,108.70	19.07
39	603983	丸美股份	44,375,434.07	19.01

40	600803	新奥股份	43,745,489.44	18.74
41	000923	河钢资源	30,988,349.75	13.28
42	000001	平安银行	27,971,956.00	11.99
43	300415	伊之密	26,552,575.21	11.38
44	603505	金石资源	24,309,790.56	10.42
45	300124	汇川技术	23,589,380.72	10.11
46	300144	宋城演艺	22,618,162.04	9.69
47	603801	志邦家居	20,946,456.00	8.98
48	000333	美的集团	20,126,230.00	8.62
49	300760	迈瑞医疗	19,508,262.00	8.36
50	002206	海利得	17,261,151.00	7.40
51	601799	星宇股份	17,150,857.00	7.35
52	600600	青岛啤酒	16,525,587.82	7.08
53	603259	药明康德	16,441,757.64	7.04
54	603619	中曼石油	15,524,576.00	6.65
55	600141	兴发集团	14,346,151.00	6.15
56	300747	锐科激光	14,320,374.00	6.14
57	600201	生物股份	13,805,750.49	5.92
58	601117	中国化学	13,778,105.00	5.90
59	688111	金山办公	13,511,837.72	5.79
60	002367	康力电梯	12,174,622.00	5.22
61	605499	东鹏饮料	10,489,702.00	4.49
62	601318	中国平安	10,470,645.00	4.49
63	600031	三一重工	9,682,361.00	4.15
64	300033	同花顺	9,066,303.02	3.88
65	300860	锋尚文化	6,133,924.78	2.63
66	000921	海信家电	6,117,467.00	2.62
67	300059	东方财富	5,409,180.00	2.32

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	6,296,928,451.65
卖出股票收入（成交）总额	4,841,013,073.28

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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	1,205,282.35
2	应收证券清算款	21,148,480.45
3	应收股利	-
4	应收利息	23,842.40
5	应收申购款	8,088,634.14

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,466,239.34

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的情况。

§ 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 (%)
219,050	2158.74	28,055,806.92	5.93	444,815,305.47	94.07

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	116,736.10	0.0247

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 (2014 年 5 月 29 日) 基金份额总额	422,102,094.73
本报告期期初基金份额总额	79,852,676.46
本报告期基金总申购份额	1,444,297,657.02
减：本报告期基金总赎回份额	1,051,279,221.09
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	472,871,112.39

§ 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	
华鑫证券	2	1,271,680,739.35	11.43%	1,184,318.53	12.32%	-
开源证券	1	909,200,194.13	8.17%	664,889.30	6.91%	-
浙商证券	2	882,126,102.29	7.93%	645,078.91	6.71%	-
东吴证券	1	757,206,798.50	6.80%	553,748.39	5.76%	-
华创证券	1	636,590,017.71	5.72%	592,857.55	6.16%	-

海通证券	1	619,314,519.15	5.56%	576,770.49	6.00%	-
方正证券	2	588,854,689.88	5.29%	548,401.51	5.70%	-
天风证券	1	542,267,660.94	4.87%	396,564.24	4.12%	-
国泰君安	1	528,927,693.70	4.75%	492,590.94	5.12%	-
西部证券	1	521,524,382.64	4.69%	381,391.51	3.97%	-
广发证券	1	505,211,270.91	4.54%	470,505.25	4.89%	-
长江证券	2	492,909,761.10	4.43%	459,057.76	4.77%	-
中泰证券	1	487,337,408.75	4.38%	453,856.04	4.72%	-
中金公司	1	481,336,228.72	4.32%	448,270.49	4.66%	-
平安证券	1	356,280,441.35	3.20%	331,803.98	3.45%	-
兴业证券	1	334,872,200.46	3.01%	311,870.21	3.24%	-
申万宏源	2	311,169,390.44	2.80%	289,792.74	3.01%	-
中信建投	2	241,332,304.80	2.17%	224,753.60	2.34%	-
中信证券	3	232,729,799.05	2.09%	216,742.86	2.25%	-
东方证券	2	213,017,756.04	1.91%	198,380.18	2.06%	-
国信证券	1	87,666,496.19	0.79%	81,645.29	0.85%	-
长城证券	2	87,033,160.81	0.78%	63,648.33	0.66%	-
信达证券	1	21,274,536.37	0.19%	15,558.67	0.16%	-
东北证券	1	19,499,292.62	0.18%	14,259.35	0.15%	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	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	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	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
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	1,300,362.80	10.33%	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

中泰证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
平安证券	11,288,849.73	89.67%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
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	本基金增加北京度小满基金销售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2月25日
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
10	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
11	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
12	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
13	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
14	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
15	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
16	本基金基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2021年4月17日
17	本基金基金产品资料概要(更新)、招募说明书(更新)	中国证监会规定报刊及网站	2021年4月17日
18	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
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	2021年5月28日

		网站	
24	本公司关于旗下部分基金增加腾安基金销（深圳）有限公司为销售机构并参与费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 5 月 28 日
25	本基金基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 5 月 29 日
26	本基金基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 5 月 29 日
27	本基金招募说明书（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 5 月 29 日
28	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
29	本基金基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 6 月 23 日
30	本基金招募说明书（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 6 月 23 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 (%)
个人	1	2021 年 1 月 1 日-2021 年 1 月 18 日	19,721,391.30		19,721,391.30	0	0

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、中国证监会准予本基金注册的批复文件；
- 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