

摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券 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	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内容的真实、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	33
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	33
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	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	42

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	42
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	42
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	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	43
7.12 投资组合报告附注	43
§ 8 基金份额持有人信息	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	44
§ 9 开放式基金份额变动	45
§ 10 重大事件揭示	45
10.1 基金份额持有人大会决议	45
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	45
10.4 基金投资策略的改变	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	45
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	46
10.8 其他重大事件	49
§ 11 备查文件目录	50
11.1 备查文件目录	50
11.2 存放地点	50
11.3 查阅方式	50

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金
基金简称	大摩深证 300 指数增强
基金主代码	233010
交易代码	233010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 11 月 15 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	25,507,384.20 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，以深证 300 指数作为本基金投资组合跟踪的目标指数。本基金在有效跟踪深证 300 指数的基础上，通过运用增强型投资策略，力争获取超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增长。本基金对业绩比较基准的跟踪目标是：力求控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。
投资策略	<p>本基金以深证 300 指数为目标指数，采用指数化投资为主要投资策略，适度增强型投资策略为辅助投资策略。</p> <p>1、股票投资策略</p> <p>本基金股票投资策略由指数化投资策略和增强型投资策略组成。</p> <p>(1) 指数化投资策略</p> <p>指数化投资策略是本基金主要股票投资策略，通过采用复制指数的方法，根据目标指数即深证 300 指数的成份股及其权重构建指数投资组合。</p> <p>(2) 增强型主动投资策略</p> <p>增强型主动投资策略是本基金辅助股票投资策略，包括：成份股增强策略和非成份股增强策略。管理人将对当前及未来国内外宏观经济形势的判断和经济景气周期预测作为基础，从多个方面把握不同行业的景气度变化情况和上市公司业绩增长的趋势，以“自下而上”与“自上而下”相结合的方法，重点投资价值被市场低估的指数成份股，并适度投资一些具有估值优势、持续成长能力的非成份股，对指数投资组合进行优化增强。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>本基金债券投资的目的是基金资产流动性管理，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。本基金将根据国内外宏观经济形势、货币政策、债券市场供求状况以及市场利率走势等因素，合理预期债券市场利率变动趋势，制定以久期控制下的债券资产配置策略，主要投资于到期日在一年以内的政府债券、金融债等。</p>

	<p>3、股指期货投资策略</p> <p>本基金可运用股指期货，以提高投资效率，有效控制指数的跟踪误差，更好地实现投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，本着审慎原则，适度参与股指期货投资，改善投资组合风险收益特征。另外，本基金将利用股指期货流动性好、杠杆交易的特点，进行现金管理，以应对大额申购赎回、大额现金分红等，管理流动性风险，优化投资组合对目标指数的跟踪效果，提高投资组合的运作效率等。</p>
业绩比较基准	深证 300 价格指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票指数型基金，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.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	2,304,225.18

本期利润	3,698,133.61
加权平均基金份额本期利润	0.1438
本期加权平均净值利润率	6.11%
本期基金份额净值增长率	7.01%
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	27,425,689.21
期末可供分配基金份额利润	1.0752
期末基金资产净值	63,433,416.35
期末基金份额净值	2.487
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	148.70%

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。

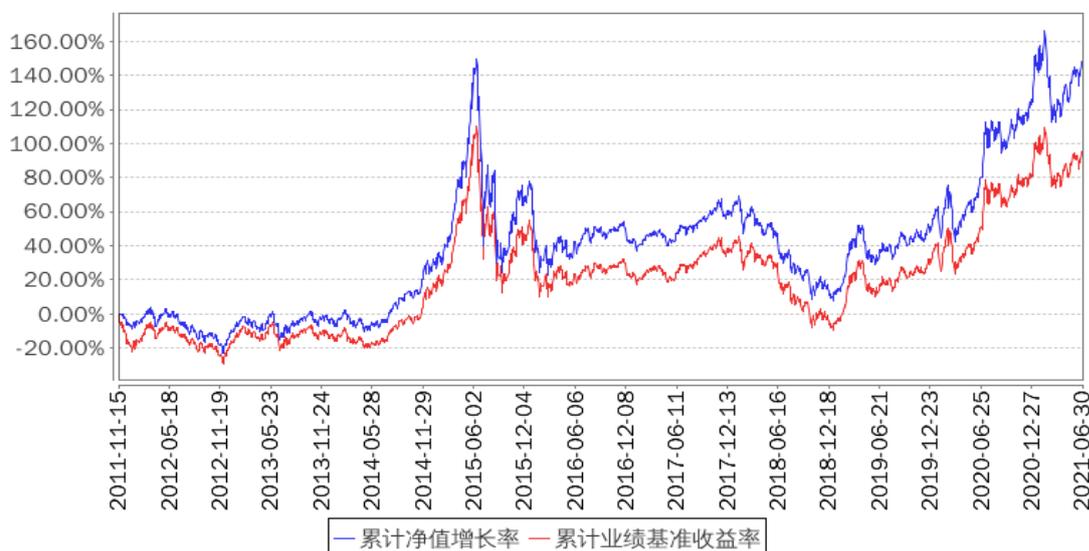
3.2 基金净值表现

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%	1.07%	0.73%	1.00%	1.03%	0.07%
过去三个月	13.30%	1.17%	9.78%	1.09%	3.52%	0.08%
过去六个月	7.01%	1.65%	4.59%	1.45%	2.42%	0.20%
过去一年	35.53%	1.56%	28.15%	1.44%	7.38%	0.12%
过去三年	83.54%	1.51%	65.86%	1.50%	17.68%	0.01%
自基金合同生效起至今	148.70%	1.58%	95.79%	1.53%	52.91%	0.05%

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

大摩深证300指数增强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		
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

					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	2020 年 5 月 11 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 6 月 30 日，本基金份额净值为 2.487 元，累计份额净值为 2.487 元，基金份额净值增长率为 7.01%，同期业绩比较基准收益率为 4.59%。

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，好公司难以再有好的价格。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

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：摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金

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	4,327,922.67	3,318,306.18
结算备付金		29,999.07	23,514.48
存出保证金		3,772.17	3,163.35
交易性金融资产	6.4.7.2	59,659,122.65	51,951,455.69
其中：股票投资		59,629,007.73	51,916,330.49
基金投资		-	-
债券投资		30,114.92	35,125.20
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	472.03	392.13
应收股利		-	-
应收申购款		155,267.25	149,974.17
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		64,176,555.84	55,446,806.00
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		4,000.00	559.00
应付赎回款		568,507.47	190,608.84
应付管理人报酬		51,505.44	43,293.33
应付托管费		7,725.81	6,494.01
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	10,596.92	19,361.58
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	100,803.85	195,017.23
负债合计		743,139.49	455,333.99
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	25,507,384.20	23,660,764.01
未分配利润	6.4.7.10	37,926,032.15	31,330,708.00
所有者权益合计		63,433,416.35	54,991,472.01
负债和所有者权益总计		64,176,555.84	55,446,806.00

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.487 元，基金份额总额 25,507,384.20 份。

6.2 利润表

会计主体：摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金

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		4,236,441.31	8,456,992.10
1. 利息收入		7,940.29	10,595.89
其中：存款利息收入	6.4.7.11	7,920.73	10,553.69
债券利息收入		19.56	42.20
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）		2,814,465.38	4,374,798.21
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,498,497.85	4,058,766.40
基金投资收益	-	-	-

债券投资收益	6.4.7.13	36,780.60	37,472.19
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	279,186.93	278,559.62
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,393,908.43	4,056,003.92
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	20,127.21	15,594.08
减：二、费用		538,307.70	502,725.84
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	301,533.22	218,359.87
2. 托管费	6.4.10.2.2	45,229.98	32,754.00
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	37,597.84	97,558.04
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.05	0.13
7. 其他费用	6.4.7.20	153,946.61	154,053.80
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,698,133.61	7,954,266.26
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,698,133.61	7,954,266.26

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金

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）	23,660,764.01	31,330,708.00	54,991,472.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,698,133.61	3,698,133.61
三、本期基金份额交易产生的基	1,846,620.19	2,897,190.54	4,743,810.73

金净值变动数 (净值减少以 “-”号填列)			
其中: 1. 基金申 购款	9,785,845.44	13,798,333.18	23,584,178.62
2. 基金赎 回款	-7,939,225.25	-10,901,142.64	-18,840,367.89
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)	25,507,384.20	37,926,032.15	63,433,416.35
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)	29,459,995.77	15,643,106.49	45,103,102.26
二、本期经营活 动产生的基金净 值变动数(本期 利润)	-	7,954,266.26	7,954,266.26
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)	-4,116,085.51	-2,438,792.31	-6,554,877.82
其中: 1. 基金申 购款	8,516,747.59	5,243,602.90	13,760,350.49
2. 基金赎 回款	-12,632,833.10	-7,682,395.21	-20,315,228.31
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)	25,343,910.26	21,158,580.44	46,502,490.70

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

基金管理人负责人

邓寰乐

主管会计工作负责人

谢先斌

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金(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 1218 号《关于核准摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强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《摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强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 421,871,132.46 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 439 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2011 年 11 月 15 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 421,922,840.88 份基金份额,其中认购资金利息折合 51,708.42 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《摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强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)。基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例范围为 90%—95%,其中投资于深证 300 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产的 80%;除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 5%—10%,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%,股指期货、权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金力求控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%,年化跟踪误差不超过 7.75%。本基金的业绩比较基准为:深证 300 价格指数收益率 \times 95%+银行活期存款利率(税后) \times 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强

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	4,327,922.67
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	4,327,922.67

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	39,747,279.64	59,629,007.73	19,881,728.09
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	30,114.92	5,314.92
	银行间市场	-	-
	合计	30,114.92	5,314.92
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-

合计	39,772,079.64	59,659,122.65	19,887,043.01
----	---------------	---------------	---------------

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	453.92
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	13.50
应收债券利息	2.91
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	1.70
合计	472.03

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	10,596.92
银行间市场应付交易费用	-
合计	10,596.92

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	1,672.87
应付证券出借违约金	-
预提费用	49,130.98
应付指数使用费	50,000.00
合计	100,803.85

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	23,660,764.01	23,660,764.01
本期申购	9,785,845.44	9,785,845.44
本期赎回（以“-”号填列）	-7,939,225.25	-7,939,225.25
- 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	25,507,384.20	25,507,384.20

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	23,326,827.33	8,003,880.67	31,330,708.00
本期利润	2,304,225.18	1,393,908.43	3,698,133.61
本期基金份额交易产生的变动数	1,794,636.70	1,102,553.84	2,897,190.54
其中：基金申购款	9,888,651.26	3,909,681.92	13,798,333.18
基金赎回款	-8,094,014.56	-2,807,128.08	-10,901,142.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	27,425,689.21	10,500,342.94	37,926,032.15

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	7,631.23
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	259.34	
其他	30.16	
合计	7,920.73	

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	2,498,497.85
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	2,498,497.85

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	11,363,907.32
减：卖出股票成本总额	8,865,409.47
买卖股票差价收入	2,498,497.85

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	36,780.60
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	36,780.60

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	146,602.59
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）	109,800.00

成本总额	
减：应收利息总额	21.99
买卖债券差价收入	36,780.60

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	279,186.93
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	279,186.93

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	1,393,908.43
股票投资	1,395,218.71
债券投资	-1,310.28
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	1,393,908.43

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	20,057.21
基金转换费收入	70.00
合计	20,127.21

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。赎回费中不低于赎回费总额的 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	37,597.84
银行间市场交易费用	-
合计	37,597.84

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	24,795.19
证券出借违约金	-
银行费用	315.63
债券账户维护费	9,000.00
指数使用费	100,000.00
合计	153,946.61

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度（自然季度）人民币 50,000 元。

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

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	301,533.22	218,359.87
其中：支付销售机构的客户维护费	137,867.69	105,289.20

注：支付基金管理人摩根士丹利华鑫基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.00% / 当年天数。

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	45,229.98	32,754.00

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 0.15%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 × 0.15% / 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	4,327,922.67	7,631.23	3,567,385.92	9,945.02

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

本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末(2021年6月30日)本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113626	伯特转债	2021年6月29日	2021年7月21日	配债流通受限	100.00	100.00	40	4,000.00	4,000.00	-

123117	健帆转债	2021年 6月23 日	2021年 7月12 日	配债流通 受限	100.00	100.00	181,800.00	1,800.00	-
127038	国微转债	2021年 6月10 日	2021年 7月14 日	配债流通 受限	100.00	100.00	474,700.00	4,700.00	-

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
002024	苏宁易购	2021年 6月16 日	重大事项 停牌	5.59	2021年 07月 06日	6.15	2,000	23,896.83	11,180.00	-

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

本基金为股票指数增强型基金，以深证 300 指数作为本基金投资组合跟踪的目标指数。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，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。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例为 0.05% (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和资产支持证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同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、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	4,327,922.67	-	-	-	4,327,922.67
结算备付金	29,999.07	-	-	-	29,999.07
存出保证金	3,772.17	-	-	-	3,772.17
交易性金融资产	-	-	30,114.92	59,629,007.73	59,659,122.65
应收利息	-	-	-	472.03	472.03
应收申购款	-	-	-	155,267.25	155,267.25
资产总计	4,361,693.91	-	30,114.92	59,784,747.01	64,176,555.84
负债					
应付赎回款	-	-	-	568,507.47	568,507.47
应付管理人报酬	-	-	-	51,505.44	51,505.44
应付托管费	-	-	-	7,725.81	7,725.81
应付证券清算款	-	-	-	4,000.00	4,000.00
应付交易费用	-	-	-	10,596.92	10,596.92
其他负债	-	-	-	100,803.85	100,803.85
负债总计	-	-	-	743,139.49	743,139.49
利率敏感度缺口	4,361,693.91	-	30,114.92	59,041,607.52	63,433,416.35
上年度末	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

2020 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	3,318,306.18	-	-	-	3,318,306.18
结算备付金	23,514.48	-	-	-	23,514.48
存出保证金	3,163.35	-	-	-	3,163.35
交易性金融资产	-	-	35,125.20	51,916,330.49	51,951,455.69
应收利息	-	-	-	392.13	392.13
应收申购款	-	-	-	149,974.17	149,974.17
资产总计	3,344,984.01	-	35,125.20	52,066,696.79	55,446,806.00
负债					
应付赎回款	-	-	-	190,608.84	190,608.84
应付管理人报酬	-	-	-	43,293.33	43,293.33
应付托管费	-	-	-	6,494.01	6,494.01
应付证券清算款	-	-	-	559.00	559.00
应付交易费用	-	-	-	19,361.58	19,361.58
其他负债	-	-	-	195,017.23	195,017.23
负债总计	-	-	-	455,333.99	455,333.99
利率敏感度缺口	3,344,984.01	-	35,125.20	51,611,362.80	54,991,472.01

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和资产支持证券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.05% (2020 年 12 月 31 日：本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券投资公允价值占基金资产净值的比例为 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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，在有效跟踪深证 300 指数的基础上，

通过运用增强型投资策略，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司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	59,629,007.73	94.00	51,916,330.49	94.41
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	59,629,007.73	94.00	51,916,330.49	94.41

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%	3,200,000.00	2,680,000.00
	业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-3,200,000.00	-2,680,000.00

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 59,637,442.65 元，属于第二层次的余额为 21,680.00 元，无属于第三层次的余额（2020 年 12 月 31 日：第一层次 51,940,688.25 元，第二层次 10,767.44 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	59,629,007.73	92.91
	其中：股票	59,629,007.73	92.91
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	30,114.92	0.05
	其中：债券	30,114.92	0.05
	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	4,357,921.74	6.79
8	其他各项资产	159,511.45	0.25
9	合计	64,176,555.84	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	938,866.72	1.48
B	采矿业	12,924.30	0.02
C	制造业	40,850,119.33	64.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	48,083.60	0.08
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	194,403.00	0.31
G	交通运输、仓储和邮政业	737,930.00	1.16
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,186,993.40	3.45
J	金融业	4,292,778.61	6.77
K	房地产业	1,022,994.00	1.61
L	租赁和商务服务业	411,217.00	0.65
M	科学研究和技术服务业	593,071.00	0.93
N	水利、环境和公共	34,032.00	0.05

	设施管理业		
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	94,005.00	0.15
Q	卫生和社会工作	2,329,733.58	3.67
R	文化、体育和娱乐业	399,252.00	0.63
S	综合	29,232.00	0.05
	合计	54,175,635.54	85.41

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	4,224,035.07	6.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	103,200.00	0.16
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,312.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	164,121.00	0.26
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	206,406.00	0.33
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	150,050.00	0.24
M	科学研究和技术服务业	604,248.12	0.95
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	5,453,372.19	8.60

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

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	5,500	2,941,400.00	4.64
2	000858	五粮液	9,400	2,800,166.00	4.41
3	000333	美的集团	28,042	2,001,357.54	3.16
4	002594	比亚迪	7,600	1,907,600.00	3.01
5	300347	泰格医药	7,600	1,469,080.00	2.32
6	300059	东方财富	42,549	1,395,181.71	2.20
7	002475	立讯精密	26,542	1,220,932.00	1.92
8	000651	格力电器	23,000	1,198,300.00	1.89
9	000001	平安银行	52,800	1,194,336.00	1.88
10	002415	海康威视	17,800	1,148,100.00	1.81
11	300760	迈瑞医疗	2,200	1,056,110.00	1.66
12	000568	泸州老窖	4,400	1,038,136.00	1.64
13	000725	京东方 A	166,300	1,037,712.00	1.64
14	300782	卓胜微	1,800	967,500.00	1.53
15	000002	万科 A	39,300	935,733.00	1.48
16	002142	宁波银行	22,300	869,031.00	1.37
17	300124	汇川技术	11,700	868,842.00	1.37
18	002460	赣锋锂业	7,000	847,630.00	1.34
19	002714	牧原股份	13,896	845,154.72	1.33
20	300014	亿纬锂能	7,865	817,409.45	1.29
21	300015	爱尔眼科	11,481	814,921.38	1.28
22	002352	顺丰控股	10,900	737,930.00	1.16
23	300122	智飞生物	3,834	715,922.82	1.13
24	002311	海大集团	8,300	677,280.00	1.07
25	002271	东方雨虹	12,150	672,138.00	1.06
26	002812	恩捷股份	2,620	613,342.00	0.97
27	300274	阳光电源	5,100	586,806.00	0.93
28	002241	歌尔股份	13,700	585,538.00	0.92
29	000661	长春高新	1,500	580,500.00	0.92
30	002709	天赐材料	5,100	543,558.00	0.86
31	300142	沃森生物	8,200	505,940.00	0.80
32	300012	华测检测	15,200	484,576.00	0.76
33	002304	洋河股份	2,000	414,400.00	0.65
34	002230	科大讯飞	6,100	412,238.00	0.65
35	002027	分众传媒	43,700	411,217.00	0.65
36	300413	芒果超媒	5,820	399,252.00	0.63
37	000100	TCL 科技	49,600	379,440.00	0.60
38	300496	中科创达	2,400	376,944.00	0.59
39	300408	三环集团	8,700	369,054.00	0.58
40	300285	国瓷材料	7,100	346,125.00	0.55
41	002007	华兰生物	9,370	343,691.60	0.54
42	002821	凯莱英	900	335,340.00	0.53

43	300595	欧普康视	3,220	333,431.00	0.53
44	002601	龙佰集团	9,300	321,594.00	0.51
45	000063	中兴通讯	9,500	315,685.00	0.50
46	002001	新和成	10,940	313,759.20	0.49
47	002179	中航光电	3,880	306,597.60	0.48
48	002371	北方华创	1,100	305,118.00	0.48
49	002129	中环股份	7,751	299,188.60	0.47
50	002049	紫光国微	1,900	292,961.00	0.46
51	000338	潍柴动力	16,300	291,281.00	0.46
52	300207	欣旺达	8,800	286,528.00	0.45
53	002459	晶澳科技	5,800	284,200.00	0.45
54	002511	中顺洁柔	9,800	269,990.00	0.43
55	002414	高德红外	9,660	266,422.80	0.42
56	002410	广联达	3,900	265,980.00	0.42
57	000157	中联重科	28,500	263,340.00	0.42
58	300454	深信服	1,000	259,480.00	0.41
59	002080	中材科技	9,800	256,466.00	0.40
60	000768	中航西飞	9,400	247,032.00	0.39
61	300751	迈为股份	540	245,538.00	0.39
62	300724	捷佳伟创	2,100	243,621.00	0.38
63	002493	荣盛石化	13,950	240,916.50	0.38
64	300450	先导智能	4,000	240,560.00	0.38
65	000729	燕京啤酒	33,200	240,368.00	0.38
66	002050	三花智控	9,280	222,534.40	0.35
67	002920	德赛西威	1,900	209,152.00	0.33
68	000776	广发证券	13,600	205,904.00	0.32
69	002340	格林美	21,300	199,155.00	0.31
70	002508	老板电器	4,200	195,300.00	0.31
71	300433	蓝思科技	6,600	194,106.00	0.31
72	000596	古井贡酒	800	191,600.00	0.30
73	000895	双汇发展	6,000	190,800.00	0.30
74	300146	汤臣倍健	5,600	184,240.00	0.29
75	000963	华东医药	3,900	179,439.00	0.28
76	002236	大华股份	8,300	175,130.00	0.28
77	000786	北新建材	4,300	168,775.00	0.27
78	300999	金龙鱼	1,900	161,424.00	0.25
79	000977	浪潮信息	5,644	158,765.72	0.25
80	300316	晶盛机电	3,100	156,550.00	0.25
81	002185	华天科技	10,100	155,439.00	0.25
82	000783	长江证券	21,000	153,720.00	0.24
83	000703	恒逸石化	12,710	151,884.50	0.24
84	300661	圣邦股份	600	151,638.00	0.24

85	300601	康泰生物	1,000	149,000.00	0.23
86	300357	我武生物	2,300	147,476.00	0.23
87	002507	涪陵榨菜	3,800	143,108.00	0.23
88	002555	三七互娱	5,900	141,718.00	0.22
89	002013	中航机电	13,600	136,952.00	0.22
90	300699	光威复材	1,800	136,710.00	0.22
91	002791	坚朗五金	700	135,835.00	0.21
92	002568	百润股份	1,400	132,706.00	0.21
93	300037	新宙邦	1,300	130,130.00	0.21
94	000513	丽珠集团	2,500	125,050.00	0.20
95	002916	深南电路	1,116	124,021.08	0.20
96	300529	健帆生物	1,420	122,631.20	0.19
97	000166	申万宏源	26,200	122,616.00	0.19
98	002626	金达威	2,700	120,690.00	0.19
99	002797	第一创业	16,800	119,952.00	0.19
100	002065	东华软件	14,100	111,813.00	0.18
101	002223	鱼跃医疗	2,900	110,577.00	0.17
102	300759	康龙化成	500	108,495.00	0.17
103	000807	云铝股份	9,000	107,100.00	0.17
104	000301	东方盛虹	4,700	98,230.00	0.15
105	000708	中信特钢	4,600	95,864.00	0.15
106	002607	中公教育	4,500	94,005.00	0.15
107	300188	美亚柏科	5,200	90,480.00	0.14
108	002439	启明星辰	3,100	89,931.00	0.14
109	002008	大族激光	2,168	87,565.52	0.14
110	002212	天融信	4,400	86,988.00	0.14
111	000825	太钢不锈	11,600	86,884.00	0.14
112	300253	卫宁健康	5,340	86,881.80	0.14
113	000938	紫光股份	3,960	86,644.80	0.14
114	002557	洽洽食品	2,000	86,200.00	0.14
115	002078	太阳纸业	6,400	85,440.00	0.13
116	002595	豪迈科技	3,200	85,440.00	0.13
117	000625	长安汽车	3,200	84,096.00	0.13
118	300088	长信科技	10,000	82,600.00	0.13
119	000547	航天发展	4,300	81,141.00	0.13
120	000739	普洛药业	2,600	76,440.00	0.12
121	002075	沙钢股份	7,000	76,370.00	0.12
122	002157	正邦科技	6,300	75,285.00	0.12
123	001979	招商蛇口	6,700	73,365.00	0.12
124	000066	中国长城	4,900	71,540.00	0.11
125	300003	乐普医疗	2,200	70,664.00	0.11
126	300383	光环新网	4,900	70,511.00	0.11

127	002600	领益智造	7,600	69,844.00	0.11
128	300498	温氏股份	4,800	68,976.00	0.11
129	300747	锐科激光	600	68,436.00	0.11
130	002690	美亚光电	1,200	66,912.00	0.11
131	300558	贝达药业	600	64,944.00	0.10
132	000878	云南铜业	4,800	61,584.00	0.10
133	300017	网宿科技	10,400	60,840.00	0.10
134	000401	冀东水泥	4,900	60,515.00	0.10
135	000738	航发控制	2,900	60,407.00	0.10
136	002372	伟星新材	2,900	59,943.00	0.09
137	000750	国海证券	14,100	59,784.00	0.09
138	002202	金风科技	4,900	59,584.00	0.09
139	002736	国信证券	5,300	56,975.00	0.09
140	000425	徐工机械	8,900	56,693.00	0.09
141	002294	信立泰	1,700	55,930.00	0.09
142	000876	新希望	3,700	54,279.00	0.09
143	000728	国元证券	6,590	52,522.30	0.08
144	002373	千方科技	3,000	50,100.00	0.08
145	002242	九阳股份	1,500	48,735.00	0.08
146	000951	中国重汽	1,800	48,708.00	0.08
147	000538	云南白药	400	46,288.00	0.07
148	002044	美年健康	5,020	45,732.20	0.07
149	002773	康弘药业	1,800	41,634.00	0.07
150	002074	国轩高科	900	39,204.00	0.06
151	002180	纳思达	1,200	38,640.00	0.06
152	300136	信维通信	1,200	37,056.00	0.06
153	002422	科伦药业	1,700	33,915.00	0.05
154	002156	通富微电	1,400	33,656.00	0.05
155	002500	山西证券	4,960	33,281.60	0.05
156	002110	三钢闽光	4,600	31,004.00	0.05
157	300308	中际旭创	800	30,816.00	0.05
158	000009	中国宝安	1,600	29,232.00	0.05
159	300271	华宇软件	1,500	28,875.00	0.05
160	002152	广电运通	2,100	27,363.00	0.04
161	000686	东北证券	3,000	25,350.00	0.04
162	000027	深圳能源	2,680	24,575.60	0.04
163	000999	华润三九	900	24,075.00	0.04
164	000959	首钢股份	4,200	23,604.00	0.04
165	002405	四维图新	1,600	23,520.00	0.04
166	000997	新大陆	1,200	19,908.00	0.03
167	300296	利亚德	2,400	18,768.00	0.03
168	000883	湖北能源	3,900	17,901.00	0.03

169	002831	裕同科技	600	17,814.00	0.03
170	300070	碧水源	2,400	17,544.00	0.03
171	002299	圣农发展	700	16,716.00	0.03
172	000967	盈峰环境	2,400	16,488.00	0.03
173	000988	华工科技	600	14,112.00	0.02
174	000656	金科股份	2,400	13,896.00	0.02
175	002465	海格通信	1,400	13,244.00	0.02
176	002385	大北农	1,800	12,240.00	0.02
177	000983	山西焦煤	1,430	11,883.30	0.02
178	300009	安科生物	780	11,622.00	0.02
179	000050	深天马 A	800	11,344.00	0.02
180	002024	苏宁易购	2,000	11,180.00	0.02
181	000623	吉林敖东	700	10,843.00	0.02
182	002602	世纪华通	1,680	10,785.60	0.02
183	002456	欧菲光	1,200	10,656.00	0.02
184	000581	威孚高科	500	10,415.00	0.02
185	002019	亿帆医药	600	10,350.00	0.02
186	000960	锡业股份	600	9,618.00	0.02
187	002056	横店东磁	700	9,100.00	0.01
188	300024	机器人	800	8,536.00	0.01
189	000998	隆平高科	500	8,020.00	0.01
190	000630	铜陵有色	2,900	7,888.00	0.01
191	000932	华菱钢铁	1,100	7,260.00	0.01
192	003816	中国广核	2,100	5,607.00	0.01
193	000559	万向钱潮	800	4,248.00	0.01
194	002625	光启技术	200	4,162.00	0.01
195	002673	西部证券	500	4,125.00	0.01
196	002745	木林森	300	4,020.00	0.01
197	000028	国药一致	100	3,784.00	0.01
198	300001	特锐德	100	3,011.00	0.00
199	002653	海思科	100	2,152.00	0.00
200	002563	森马服饰	100	1,195.00	0.00
201	002128	露天煤业	100	1,041.00	0.00

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	601012	隆基股份	6,860	609,442.40	0.96
2	600438	通威股份	11,100	480,297.00	0.76
3	600519	贵州茅台	200	411,340.00	0.65
4	603259	药明康德	2,568	402,123.12	0.63

5	688002	睿创微纳	2,600	259,558.00	0.41
6	603501	韦尔股份	800	257,600.00	0.41
7	600031	三一重工	8,600	250,002.00	0.39
8	601799	星宇股份	1,100	248,292.00	0.39
9	002025	航天电器	4,400	220,748.00	0.35
10	603127	昭衍新药	1,100	202,125.00	0.32
11	002891	中宠股份	4,500	184,500.00	0.29
12	600176	中国巨石	11,559	179,280.09	0.28
13	603713	密尔克卫	1,500	161,970.00	0.26
14	300623	捷捷微电	4,000	151,320.00	0.24
15	601888	中国中免	500	150,050.00	0.24
16	600660	福耀玻璃	2,500	139,625.00	0.22
17	600036	招商银行	2,000	108,380.00	0.17
18	603456	九洲药业	2,200	106,876.00	0.17
19	300769	德方纳米	500	103,345.00	0.16
20	600900	长江电力	5,000	103,200.00	0.16
21	600887	伊利股份	2,700	99,441.00	0.16
22	601398	工商银行	18,400	95,128.00	0.15
23	603899	晨光文具	1,100	93,016.00	0.15
24	600703	三安光电	2,700	86,535.00	0.14
25	688036	传音控股	400	83,800.00	0.13
26	603596	伯特利	1,800	64,350.00	0.10
27	603799	华友钴业	500	57,100.00	0.09
28	603267	鸿远电子	400	51,168.00	0.08
29	601689	拓普集团	1,200	44,916.00	0.07
30	001207	联科科技	597	19,766.67	0.03
31	001208	华菱线缆	1,567	12,112.91	0.02
32	002191	劲嘉股份	500	5,320.00	0.01
33	002217	合力泰	1,200	4,284.00	0.01
34	000563	陕国投 A	900	2,898.00	0.00
35	000429	粤高速 A	300	2,151.00	0.00
36	002419	天虹股份	200	1,312.00	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	000001	平安银行	739,872.00	1.35
2	002594	比亚迪	616,425.00	1.12
3	000002	万科 A	592,146.00	1.08
4	002475	立讯精密	519,755.00	0.95
5	002352	顺丰控股	445,891.00	0.81
6	600519	贵州茅台	401,123.00	0.73

7	002601	龙佰集团	352,079.00	0.64
8	000858	五粮液	335,377.00	0.61
9	300782	卓胜微	325,263.00	0.59
10	002236	大华股份	323,627.00	0.59
11	000100	TCL 科技	321,467.00	0.58
12	002078	太阳纸业	311,447.00	0.57
13	000333	美的集团	304,700.00	0.55
14	000651	格力电器	300,326.00	0.55
15	000725	京东方 A	289,704.00	0.53
16	300408	三环集团	284,079.00	0.52
17	002142	宁波银行	283,219.00	0.52
18	300750	宁德时代	267,209.00	0.49
19	000895	双汇发展	248,877.00	0.45
20	300012	华测检测	243,929.00	0.44

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	002475	立讯精密	510,154.00	0.93
2	002352	顺丰控股	455,722.00	0.83
3	000001	平安银行	445,997.00	0.81
4	600763	通策医疗	312,854.12	0.57
5	002572	索菲亚	303,723.00	0.55
6	000002	万科 A	302,397.00	0.55
7	300012	华测检测	297,025.00	0.54
8	000895	双汇发展	273,363.00	0.50
9	002078	太阳纸业	268,137.00	0.49
10	300059	东方财富	265,492.00	0.48
11	002179	中航光电	254,360.00	0.46
12	002463	沪电股份	240,409.00	0.44
13	000100	TCL 科技	232,737.00	0.42
14	002541	鸿路钢构	227,963.00	0.41
15	002415	海康威视	227,166.90	0.41
16	002568	百润股份	221,166.00	0.40
17	600519	贵州茅台	207,500.00	0.38
18	000625	长安汽车	204,415.00	0.37
19	600436	片仔癀	204,321.00	0.37
20	002714	牧原股份	204,090.00	0.37

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	15,182,868.00
卖出股票收入（成交）总额	11,363,907.32

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）	30,114.92	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	30,114.92	0.05

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	127036	三花转债	78	10,217.22	0.02
2	123115	捷捷转债	65	9,397.70	0.01
3	127038	国微转债	47	4,700.00	0.01
4	113626	伯特转债	40	4,000.00	0.01
5	123117	健帆转债	18	1,800.00	0.00

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规定，本基金可运用股指期货，以提高投资效率，有效控制指数的跟踪误差，更好地实现投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，本着审慎原则，适度参与股指期货投资，改善投资组合风险收益特征。另外，本基金将利用股指期货流动性好、杠杆交易的特点，进行现金管理，以应对大额申购赎回、大额现金分红等，管理流动性风险，优化投资组合对目标指数的跟踪效果，提高投资组合的运作效率等。

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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体除平安银行股份有限公司（以下简称“平安银行”）外，其余的没有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。

2020 年 10 月，中国银行保险监督管理委员会宁波监管局发布《宁波银保监局行政处罚信息公开表》（甬银保监罚决字〔2020〕66 号）对平安银行贷款资金用途管控不到位等违法违规行为，处以罚款。

2021 年 6 月，中国银行保险监督管理委员会云南监管局发布《中国银保监会云南监管局行政处罚信息公开表》（云银保监罚决字〔2021〕34 号）对平安银行利用来源于本行授信的固定资产贷款和黄金租赁融资的资金发放委托贷款，用于承接处置本行其他贷款风险等违法违规行为，处以罚款。

本基金投资平安银行（000001）决策流程符合本基金管理人投资管理制度的相关规定。针对上述情况，本基金管理人进行了分析和研究，认为上述事件对平安银行的投资价值未造成实质性

影响。本基金管理人将继续对上述公司进行跟踪研究。

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	3,772.17
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	472.03
5	应收申购款	155,267.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	159,511.45

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

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五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 (%)
2,434	10479.62	446,853.95	1.75	25,060,530.25	98.25

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	107.47	0.0004

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 11 月 15 日） 基金份额总额	421,922,840.88
本报告期期初基金份额总额	23,660,764.01
本报告期基金总申购份额	9,785,845.44
减：本报告期基金总赎回份额	7,939,225.25
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	25,507,384.20

§ 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	
方正证券	2	16,036,410.45	60.64%	14,934.75	62.54%	-
广发证券	1	5,205,635.29	19.68%	4,848.05	20.30%	-
开源证券	1	3,208,664.08	12.13%	2,346.51	9.83%	-
兴业证券	1	750,272.00	2.84%	698.78	2.93%	-
海通证券	1	719,387.00	2.72%	669.93	2.81%	-
西部证券	1	524,725.50	1.98%	383.70	1.61%	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-

国金证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	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	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-

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	成交金额	占当期权 证 成交总额

				比例		的比例
方正证券	29,729.48	20.28%	-	-	-	-
广发证券	105,822.61	72.18%	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	11,050.50	7.54%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

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	关于本基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改基金合同部分条款的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 3 月 31 日
15	本基金招募说明书、基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 3 月 31 日
16	本公司关于调整旗下部分基金申购、	中国证监会规定报刊及	2021 年 3 月 31 日

	定期定额申购、赎回、转换及最低持有份额数额限制的公告	网站	
17	本基金基金合同更新	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 3 月 31 日
18	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
19	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
20	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
21	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 29 日
22	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
23	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
24	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
25	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
26	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