

# 摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资 基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：摩根士丹利华鑫基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

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。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
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	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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
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
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
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	49

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 .....	49
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 .....	49
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 .....	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	50
7.12 投资组合报告附注 .....	50
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>51</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	51
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 .....	51
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>52</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>52</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	52
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 .....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	52
10.4 基金投资策略的改变 .....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	53
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 .....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	53
10.8 其他重大事件 .....	54
<b>§ 11 备查文件目录 .....</b>	<b>56</b>
11.1 备查文件目录 .....	56
11.2 存放地点 .....	56
11.3 查阅方式 .....	56

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资基金	
基金简称	大摩量化配置混合	
基金主代码	233015	
交易代码	233015	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012 年 12 月 11 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	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	103,826,823.52 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	大摩量化配置混合 A	大摩量化配置混合 C
下属分级基金的交 易代码	233015	008305
报告期末下属分级 基金的份额总额	102,600,968.98 份	1,225,854.54 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化模型，优化资产配置权重，力争在降低组合风险的同时，获得超越比较基准的超额收益。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>资产配置采取“自上而下”的多因素分析决策支持，结合定性分析和定量分析，确定中长期的资产配置方案。</p> <p>2、行业配置策略</p> <p>本基金通过量化方法分析各个行业的股价表现与宏观经济、产业链指标之间的关系，并结合各行业的估值水平、一致预期、盈利水平、动量反转等指标，获得各行业的预期收益率，并运用 BL 模型对行业配置权重进行优化。</p> <p>3、股票配置策略</p> <p>在行业内选股策略上，本基金采用量化模型的方法进行选股。量化选股模型包括但不限于以下两种：一种是持有行业内若干权重股，并优化其在基金中的权重以拟合行业平均收益；另一种是通过量化</p>

	多因子选股模型挑选优势个股。
业绩比较基准	80%×沪深 300 指数收益率+20%×标普中国债券指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金,其预期收益和风险高于货币型基金、债券型基金,而低于股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		摩根士丹利华鑫基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	许菲菲	秦一楠
	联系电话	(0755)88318883	(010)66060069
	电子邮箱	xxpl@msfunds.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-8888-668	95599
传真		(0755)82990384	(010)68121816
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	北京市东城区建国门内大街 69 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	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518048	100031
法定代表人		王鸿嫔	谷澍

### 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)	
	大摩量化配置混合 A	大摩量化配置混合 C
本期已实现收益	48,320,095.79	3,090,408.17
本期利润	7,546,920.48	-1,361,111.24

加权平均基金份额本期利润	0.0671	-0.2281
本期加权平均净值利润率	2.91%	-9.81%
本期基金份额净值增长率	2.02%	1.89%
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	118,977,303.91	1,676,004.87
期末可供分配基金份额利润	1.1596	1.3672
期末基金资产净值	243,554,013.55	2,901,859.41
期末基金份额净值	2.374	2.367
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	197.96%	40.56%

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

大摩量化配置混合 A

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	1.45%	0.92%	-1.57%	0.64%	3.02%	0.28%

过去三个月	10.37%	1.08%	3.05%	0.78%	7.32%	0.30%
过去六个月	2.02%	1.59%	0.75%	1.05%	1.27%	0.54%
过去一年	30.94%	1.52%	20.93%	1.07%	10.01%	0.45%
过去三年	59.22%	1.39%	42.47%	1.09%	16.75%	0.30%
自基金合同生效起 至今	197.96%	1.37%	116.47%	1.17%	81.49%	0.20%

## 大摩量化配置混合 C

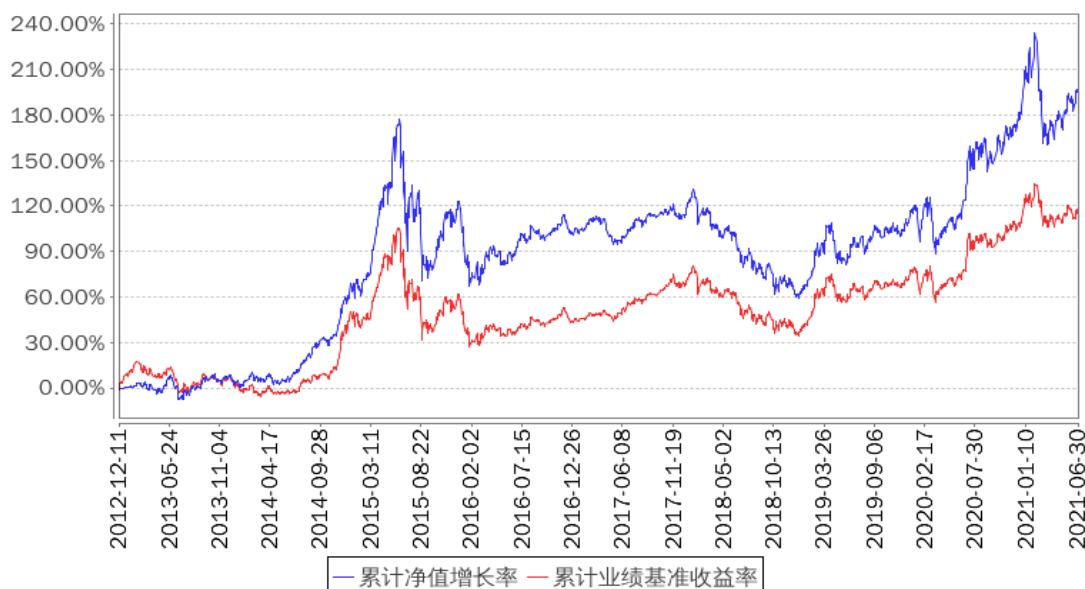
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.41%	0.90%	-1.57%	0.64%	2.98%	0.26%
过去三个月	10.25%	1.07%	3.05%	0.78%	7.20%	0.29%
过去六个月	1.89%	1.59%	0.75%	1.05%	1.14%	0.54%
过去一年	30.63%	1.52%	20.93%	1.07%	9.70%	0.45%
自基金合同生效起 至今	40.56%	1.52%	24.74%	1.10%	15.82%	0.42%

注：本基金从 2019 年 12 月 18 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2019 年 12 月 18 日起存续。

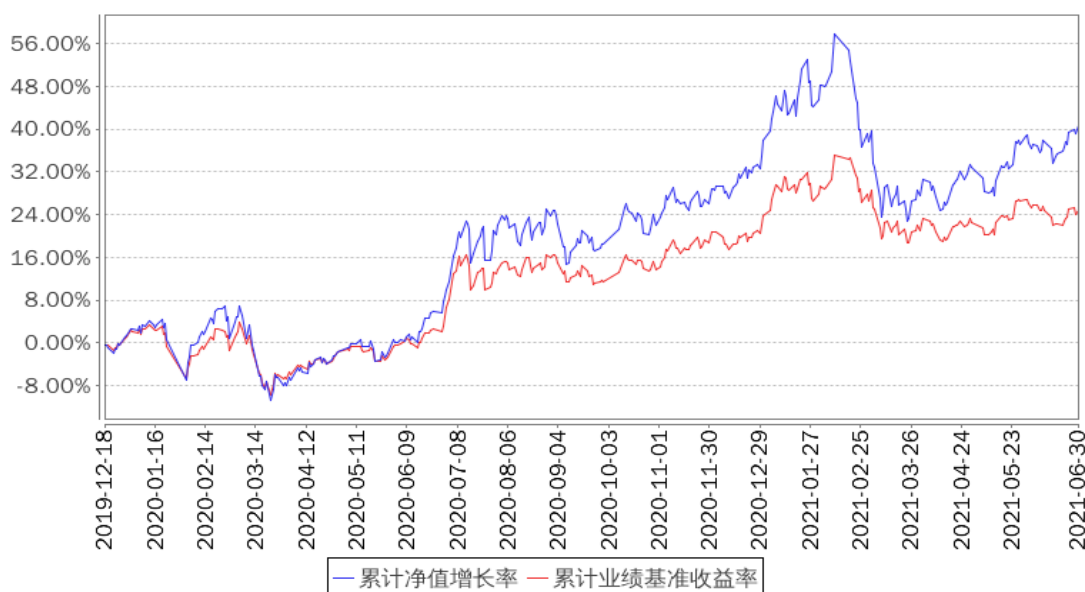


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

大摩量化配置混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



大摩量化配置混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## § 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		
陈健夫	基金经理	2018 年 8 月 1 日	-	11 年	美国南加州大学应用数学博士。曾任美国联合银行量化分析师，美国汇丰证券高级量化分析师，阳光资产管理有限公司高级量化研究员。2018 年 7 月加入本公司，现任量化投资部基金经理。2018 年 8 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，2018 年 8 月至 2020 年 9 月担任摩根士丹利华鑫睿成中小盘弹性股票型证券投资基金基金经理。
王联欣	基金经理	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、基金经理的任职日期为根据本公司决定确定的聘任日期；

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

2021 年上半年，A 股市场展现出了非常明显的风格差异。以宽基指数为例，中证 500 在上半年收涨 6.93%，沪深 300 在上半年收涨 0.24%，反映出上半年中小盘股票明显跑赢大盘股票；创业板指和科创 50 指数在上半年分别收涨 17.22% 和 14.01%，上证 50 指数在上半年下跌 3.90%，反映出成长风格在上半年显著跑赢价值风格。此外，分行业来看，受益于高景气和政策支持的新能源车、光伏、电子、医药等行业在上半年的表现较好，房地产、消费者服务、家电等传统行业表现较差。

本基金主要通过多因子模型进行选股，并辅以科学的风险管理手段，试图在业绩基准的基础上获取相对稳健的超额回报。回顾上半年，本基金在成长和质量因子上始终处于正向暴露的水平，因此在春节后市场风格迅速切换时遭遇了比较明显的回撤，但进入二季度后，市场重新回归成长风格，因此本基金在二季度取得了比较显著的超额回报。整个上半年来看，基金跑赢了业绩基准。不过在行业配置层面，本基金相对业绩基准的偏移程度有限，所以在行业配置上的超额贡献不大。

### 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 A 类份额净值为 2.374 元，份额累计净值为 2.774 元，C 类份额净值为 2.367 元，份额累计净值为 2.367 元，报告期内 A 类基金份额净值增长率为 2.02%，C 类基金份额净值增长率为 1.89%，同期业绩比较基准收益率为 0.75%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，在市场流动性并未实质性收紧的前提下，我们认为成长风格有望继续延续，所以我们依然会从模型出发，选择基本面良好且存在一定业绩弹性的个股进行优先配置。但我们同时观察到，随着市场逐渐在一些标的上形成共识，进而推动部分个股的估值进入极端的高估区间或低估区间，估值的因素也会逐渐凸显出来，即部分高度或低估品种存在均值回复的需求。所以我们会从风险管理的角度出发，适当对组合的估值暴露进行调整，以尽量控制组合的跟踪误差，力争为投资人创造更稳健的超额回报。

## 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—摩根士丹利华鑫基金管理有限公司 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，摩根士丹利华鑫基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，摩根士丹利华鑫基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	15,661,281.14	21,988,836.40
结算备付金		506,052.53	693,584.28
存出保证金		49,358.76	83,905.57
交易性金融资产	6.4.7.2	232,084,938.42	325,683,135.35
其中：股票投资		231,752,050.86	325,325,325.39
基金投资		-	-
债券投资		332,887.56	357,809.96
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,227,353.84	231,653.62
应收利息	6.4.7.5	3,250.19	5,120.09
应收股利		-	-
应收申购款		6,950.48	31,808.17
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		249,539,185.36	348,718,043.48
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>

		2021 年 6 月 30 日	2020 年 12 月 31 日
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		2,343,121.77	3,095,991.25
应付管理人报酬		301,375.81	429,231.32
应付托管费		50,229.30	71,538.57
应付销售服务费		465.67	3,350.76
应付交易费用	6.4.7.7	289,148.89	368,867.26
应交税费		0.26	1.26
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	98,970.70	189,339.08
负债合计		3,083,312.40	4,158,319.50
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	103,826,823.52	148,089,614.30
未分配利润	6.4.7.10	142,629,049.44	196,470,109.68
所有者权益合计		246,455,872.96	344,559,723.98
负债和所有者权益总计		249,539,185.36	348,718,043.48

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，大摩量化配置混合 A 基金份额净值 2.374 元，基金份额总额 102,600,968.98 份；大摩量化配置混合 C 基金份额净值 2.367 元，基金份额总额 1,225,854.54 份。大摩量化配置混合份额总额合计为 103,826,823.52 份。

## 6.2 利润表

会计主体：摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	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		10,036,529.00	31,444,501.81
1. 利息收入		70,328.10	129,848.09
其中：存款利息收入	6.4.7.11	70,246.35	129,737.21
债券利息收入		81.75	110.88
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）		55,177,731.10	39,733,767.18
其中：股票投资收益	6.4.7.12	53,545,247.89	36,499,913.18
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	155,768.83	255,407.21
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	1,476,714.38	2,978,446.79
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-45,224,694.72	-8,440,731.17
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	13,164.52	21,617.71
减：二、费用		3,850,719.76	6,650,013.89
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,050,011.42	3,410,840.94
2. 托管费	6.4.10.2.2	341,668.60	568,473.44
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	14,147.88	1.82
4. 交易费用	6.4.7.19	1,332,116.64	2,555,404.14
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.18	0.39
7. 其他费用	6.4.7.20	112,775.04	115,293.16
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,185,809.24	24,794,487.92
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,185,809.24	24,794,487.92

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	148,089,614.30	196,470,109.68	344,559,723.98

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,185,809.24	6,185,809.24
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）	-44,262,790.78	-60,026,869.48	-104,289,660.26
其中：1. 基金申购款	7,305,818.24	9,997,500.17	17,303,318.41
2. 基金赎回款	-51,568,609.02	-70,024,369.65	-121,592,978.67
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）	103,826,823.52	142,629,049.44	246,455,872.96
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）	315,795,123.06	223,524,474.53	539,319,597.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	24,794,487.92	24,794,487.92
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）	-75,842,845.80	-53,183,278.80	-129,026,124.60
其中：1. 基金申购款	8,741,882.88	5,828,848.69	14,570,731.57
2. 基金赎回款	-84,584,728.68	-59,012,127.49	-143,596,856.17
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)	239,952,277.26	195,135,683.65	435,087,960.91

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

王鸿嫔

邓寰乐

谢先斌

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资基金(原名为摩根士丹利华鑫量化配置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[2012]第 1238 号《关于核准摩根士丹利华鑫量化配置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《摩根士丹利华鑫量化配置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 1,094,111,652.89 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(2012)第 508 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《摩根士丹利华鑫量化配置股票型证券投资基金基金合同》于 2012 年 12 月 11 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,095,372,033.67 份基金份额,其中认购资金利息折合 1,260,380.78 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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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

根据《摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资基金基金合同》和《摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,自 2019 年 12 月 18 日起,本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资基金基金

合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括交易所和银行间两个市场的国债、金融债、企业债与可转换债、中期票据、短期融资券等）、银行存款、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规和中国证监会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 60%—95%，除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 5%—40%，其中权证资产占基金资产净值的比例范围为 0—3%，保持现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。自基金合同生效日至 2015 年 9 月 28 日止期间，本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+中信标普全债指数收益率×20%。根据本基金的基金管理人于 2015 年 9 月 29 日发布的《摩根士丹利华鑫基金管理有限公司关于部分开放式基金变更业绩比较基准的公告》，自 2015 年 9 月 29 日期，本基金的业绩比较基准变更为：沪深 300 指数收益率×80%+标普中国债券指数收益率×20%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资基金 基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红

利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

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

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
活期存款	15,661,281.14
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	15,661,281.14

#### 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	187,070,758.09	231,752,050.86	44,681,292.77
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	332,887.56	21,487.56
	银行间市场	-	-
	合计	332,887.56	21,487.56
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	187,382,158.09	232,084,938.42	44,702,780.33

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	2,972.03
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	227.70
应收债券利息	28.26
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	22.20
合计	3,250.19

#### 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	289,148.89
银行间市场应付交易费用	-
合计	289,148.89

#### 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	710.55
应付证券出借违约金	-
预提费用	98,260.15
合计	98,970.70

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

##### 大摩量化配置混合 A

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	139,134,166.79	139,134,166.79
本期申购	5,534,460.46	5,534,460.46
本期赎回(以“-”号填列)	-42,067,658.27	-42,067,658.27
-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	102,600,968.98	102,600,968.98
-----	----------------	----------------

## 大摩量化配置混合 C

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	8,955,447.51	8,955,447.51
本期申购	1,771,357.78	1,771,357.78
本期赎回 (以“-”号填列)	-9,500,950.75	-9,500,950.75
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	1,225,854.54	1,225,854.54

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

## 大摩量化配置混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	104,478,780.31	80,140,291.39	184,619,071.70
本期利润	48,320,095.79	-40,773,175.31	7,546,920.48
本期基金份额 交易产生的变 动数	-33,821,572.19	-17,391,375.42	-51,212,947.61
其中：基金申 购款	5,465,762.15	1,994,622.52	7,460,384.67
基金赎 回款	-39,287,334.34	-19,385,997.94	-58,673,332.28
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	118,977,303.91	21,975,740.66	140,953,044.57

## 大摩量化配置混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	11,043,084.63	807,953.35	11,851,037.98
本期利润	3,090,408.17	-4,451,519.41	-1,361,111.24
本期基金份额 交易产生的变 动数	-12,125,273.13	3,311,351.26	-8,813,921.87
其中：基金申 购款	2,450,204.14	86,911.36	2,537,115.50
基金赎 回款	-14,575,477.27	3,224,439.90	-11,351,037.37

本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,008,219.67	-332,214.80	1,676,004.87

#### 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		64,471.56
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		5,313.03
其他		461.76
合计		70,246.35

#### 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	53,545,247.89
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	53,545,247.89

##### 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	510,646,015.35
减：卖出股票成本总额	457,100,767.46
买卖股票差价收入	53,545,247.89

#### 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	155,768.83

券到期兑付) 差价收入	
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	155,768.83

#### 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	607,392.40
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	451,500.00
减：应收利息总额	123.57
买卖债券差价收入	155,768.83

#### 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	1,476,714.38
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,476,714.38

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-45,224,694.72
股票投资	-45,168,572.32
债券投资	-56,122.40
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	-45,224,694.72

#### 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	12,962.03
基金转换费收入	202.49
合计	13,164.52

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，未归入基金资产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于赎回费 25% 的部分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	1,332,116.64
银行间市场交易费用	-
合计	1,332,116.64

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	4,914.89
债券账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	112,775.04

#### 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
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
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	-	-	37,147,480.47	2.14

###### 6.4.10.1.2 权证交易

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(%)

-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
华鑫证券	34,593.49	2.42	25,398.40	4.06

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,050,011.42	3,410,840.94
其中：支付销售机构的客户维护费	969,536.61	2,017,159.15

注：支付基金管理人摩根士丹利华鑫基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	341,668.60	568,473.44

注：支付基金托管人中国农业银行股份有限公司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。

##### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联	本期
-------------	----

方名称	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大摩量化配置混合 A	大摩量化配置混合 C	合计
摩根士丹利华鑫基金管理 有限公司	-	5.81	5.81
华鑫证券	-	-	-
中国农业银行	-	-	-
合计	-	5.81	5.81
获得销售服务费的各关联 方名称	上年度可比期间		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大摩量化配置混合 A	大摩量化配置混合 C	合计
摩根士丹利华鑫基金管理 有限公司	-	1.82	1.82
华鑫证券	-	-	-
中国农业银行	-	-	-
合计	-	1.82	1.82

注：支付 C 类基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.20% 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：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 × 0.20% / 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自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自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
中国农业银行	15,661,281.14	64,471.56	29,292,947.37	119,520.75

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，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
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月12日	新股流通受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	新股流通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐环保	2021年1月12日	2021年7月21日	新股流通受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300932	三友联众	2021年1月15日	2021年7月22日	新股流通受限	24.69	31.71	463	11,431.47	14,681.73	-
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	216	6,214.32	21,567.60	-
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	120	5,679.60	30,235.20	-
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 11日	新股流 通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300967	晓鸣股份	2021年 4月2 日	2021年 10月 13日	新股流 通受限	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300968	格林精密	2021年 4月6 日	2021年 10月	新股流 通受限	6.87	12.07	787	5,406.69	9,499.09	-

		日	15日								
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	171	4,835.88	19,786.41		-
300975	商络电子	2021年4月14日	2021年10月21日	新股流通受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76		-
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	新股流通受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80		-
300982	苏文电能	2021年4月19日	2021年10月27日	新股流通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93		-
300985	致远新能	2021年4月21日	2021年10月29日	新股流通受限	24.90	24.81	180	4,482.00	4,465.80		-
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	198	2,928.42	6,052.86		-
300987	川网传媒	2021年4月28日	2021年11月11日	新股流通受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81		-
300991	创益通	2021年5月12日	2021年11月22日	新股流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54		-
300992	泰福泵业	2021年5月17日	2021年11月25日	新股流通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00		-
300995	奇德新材	2021年5月17日	2021年11月26日	新股流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12		-
300997	欢乐家	2021年5月26日	2021年12月2日	新股流通受限	4.94	13.05	841	4,154.54	10,975.05		-
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		-
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	2021年	2021年	新股流	12.54	27.89	457	5,730.78	12,745.73		-

	股份	6月8日	12月17日	通受限						
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	387	2,956.68	15,027.21	-
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	-
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	-
688087	英科再生	2021年6月30日	2021年7月9日	新股未上市	21.96	21.96	1,308	28,723.68	28,723.68	-
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	2022年1月5日	新股流通受限	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688315	诺禾致源	2021年4月2日	2021年10月13日	新股流通受限	12.76	39.20	2,424	30,930.24	95,020.80	-
688317	之江生物	2021年1月8日	2021年7月19日	新股流通受限	43.22	63.82	1,927	83,284.94	122,981.14	-
688456	有研粉材	2021年3月10日	2021年9月17日	新股流通受限	10.62	26.50	3,358	35,661.96	88,987.00	-
688611	杭州柯林	2021年4月1日	2021年10月12日	新股流通受限	33.44	42.34	1,400	46,816.00	59,276.00	-



688621	阳光诺和	2021年 6月11 日	2021年 12月 21日	新股流 通受限	26.89	63.99	1,485	39,931.65	95,025.15	-
688633	星球石墨	2021年 3月17 日	2021年 9月24 日	新股流 通受限	33.62	53.14	1,272	42,764.64	67,594.08	-
688655	迅捷兴	2021年 4月28 日	2021年 11月 11日	新股流 通受限	7.59	15.77	3,083	23,399.97	48,618.91	-
688683	莱尔科技	2021年 4月1 日	2021年 10月 12日	新股流 通受限	9.51	14.73	3,296	31,344.96	48,550.08	-
688687	凯因科技	2021年 1月29 日	2021年 8月9 日	新股流 通受限	18.98	27.98	4,322	82,031.56	120,929.56	-
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	265	6,519.00	43,195.00	-

## 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
113049	长汽转债	2021年 6月10 日	2021年 7月8 日	配债流 通受限	100.00	100.00	160	16,000.00	16,000.00	-
113050	南银转债	2021年 6月15 日	2021年 7月1 日	配债流 通受限	100.00	100.00	2,320	232,000.00	232,000.00	-
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	152	15,200.00	15,200.00	-

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

2、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。

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

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 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

本基金为进行主动投资的混合型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括市场风险、流动性风险及信用风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，通过量化模型，优化资产配置权重，力争在降低组合风险的同时，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农业银行，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。在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.14%(2020 年 12 月 31 日：本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.10%)。

#### 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、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
<b>资产</b>					
银行存款	15,661,281.14	-	-	-	15,661,281.14
结算备付金	506,052.53	-	-	-	506,052.53
存出保证金	49,358.76	-	-	-	49,358.76
交易性金融资产	-	-	332,887.56	231,752,050.86	232,084,938.42
应收利息	-	-	-	3,250.19	3,250.19
应收申购款	-	-	-	6,950.48	6,950.48
应收证券清算款	-	-	-	1,227,353.84	1,227,353.84
<b>资产总计</b>	<b>16,216,692.43</b>	<b>-</b>	<b>332,887.56</b>	<b>232,989,605.37</b>	<b>249,539,185.36</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	2,343,121.77	2,343,121.77
应付管理人报酬	-	-	-	301,375.81	301,375.81
应付托管费	-	-	-	50,229.30	50,229.30
应付销售服务费	-	-	-	465.67	465.67
应付交易费用	-	-	-	289,148.89	289,148.89
应交税费	-	-	-	0.26	0.26
其他负债	-	-	-	98,970.70	98,970.70
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>3,083,312.40</b>	<b>3,083,312.40</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>16,216,692.43</b>	<b>-</b>	<b>332,887.56</b>	<b>229,906,292.97</b>	<b>246,455,872.96</b>
<b>上年度末 2020年12月31日</b>					
<b>资产</b>					
银行存款	21,988,836.40	-	-	-	21,988,836.40
结算备付金	693,584.28	-	-	-	693,584.28
存出保证金	83,905.57	-	-	-	83,905.57
交易性金融资产	-	109,773.10	248,036.86	325,325,325.39	325,683,135.35
应收利息	-	-	-	5,120.09	5,120.09
应收申购款	-	-	-	31,808.17	31,808.17
应收证券清算款	-	-	-	231,653.62	231,653.62
<b>资产总计</b>	<b>22,766,326.25</b>	<b>109,773.10</b>	<b>248,036.86</b>	<b>325,593,907.27</b>	<b>348,718,043.48</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	3,095,991.25	3,095,991.25

应付管理人报酬	-	-	-	429,231.32	429,231.32
应付托管费	-	-	-	71,538.57	71,538.57
应付销售服务费	-	-	-	3,350.76	3,350.76
应付交易费用	-	-	-	368,867.26	368,867.26
应交税费	-	-	-	1.26	1.26
其他负债	-	-	-	189,339.08	189,339.08
负债总计	-	-	-	4,158,319.50	4,158,319.50
利率敏感度缺口	22,766,326.25	109,773.10	248,036.86	321,435,587.77	344,559,723.98

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.14% (2020 年 12 月 31 日：本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.10%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2020 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过开发各类量化模型进行股票选择并据此构建投资组合。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	231,752,050.86	94.03	325,325,325.39	94.42
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	231,752,050.86	94.03	325,325,325.39	94.42

#### 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%	15,730,000.00	20,790,000.00
	业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-15,730,000.00	-20,790,000.00

#### 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 230,450,434.23 元，属于第二层次的余额为 1,634,504.19 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次 323,247,948.77 元，第二层次 2,435,186.58 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	231,752,050.86	92.87
	其中：股票	231,752,050.86	92.87
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	332,887.56	0.13
	其中：债券	332,887.56	0.13
	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	16,167,333.67	6.48
8	其他各项资产	1,286,913.27	0.52
9	合计	249,539,185.36	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	732,980.40	0.30
B	采矿业	1,587,063.00	0.64
C	制造业	151,407,611.46	61.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,662.00	0.00
E	建筑业	25,371.37	0.01
F	批发和零售业	34,543.21	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	1,245,530.00	0.51
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,116,088.52	3.29
J	金融业	45,961,018.40	18.65
K	房地产业	3,721,142.00	1.51
L	租赁和商务服务业	5,188,542.00	2.11
M	科学研究和技术服务业	10,426,548.95	4.23
N	水利、环境和公共设施管理业	534,346.13	0.22
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,485,343.42	1.01
R	文化、体育和娱乐业	281,260.00	0.11
S	综合	-	-
	合计	231,752,050.86	94.03

## 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	600519	贵州茅台	6,000	12,340,200.00	5.01
2	600036	招商银行	175,300	9,499,507.00	3.85
3	000858	五粮液	26,400	7,864,296.00	3.19
4	601318	中国平安	119,600	7,687,888.00	3.12
5	601012	隆基股份	69,571	6,180,687.64	2.51
6	300750	宁德时代	9,500	5,080,600.00	2.06
7	300759	康龙化成	21,700	4,708,683.00	1.91

8	603259	药明康德	28,800	4,509,792.00	1.83
9	300059	东方财富	127,860	4,192,529.40	1.70
10	300122	智飞生物	20,700	3,865,311.00	1.57
11	601888	中国中免	11,200	3,361,120.00	1.36
12	002271	东方雨虹	59,700	3,302,604.00	1.34
13	300363	博腾股份	35,500	2,986,260.00	1.21
14	300782	卓胜微	5,484	2,947,650.00	1.20
15	600030	中信证券	113,100	2,820,714.00	1.14
16	600309	万华化学	25,300	2,753,146.00	1.12
17	000568	泸州老窖	11,200	2,642,528.00	1.07
18	000333	美的集团	36,800	2,626,416.00	1.07
19	300760	迈瑞医疗	5,400	2,592,270.00	1.05
20	002415	海康威视	38,200	2,463,900.00	1.00
21	002812	恩捷股份	10,400	2,434,640.00	0.99
22	002460	赣锋锂业	19,800	2,397,582.00	0.97
23	603501	韦尔股份	7,200	2,318,400.00	0.94
24	000002	万科A	95,400	2,271,474.00	0.92
25	000001	平安银行	97,800	2,212,236.00	0.90
26	300014	亿纬锂能	21,000	2,182,530.00	0.89
27	002594	比亚迪	8,600	2,158,600.00	0.88
28	600919	江苏银行	297,500	2,112,250.00	0.86
29	300737	科顺股份	65,400	2,056,176.00	0.83
30	688363	华熙生物	7,200	2,000,592.00	0.81
31	002142	宁波银行	49,500	1,929,015.00	0.78
32	000725	京东方A	298,500	1,862,640.00	0.76
33	002027	分众传媒	194,200	1,827,422.00	0.74
34	603369	今世缘	32,700	1,771,032.00	0.72
35	300763	锦浪科技	9,520	1,719,312.00	0.70
36	601009	南京银行	161,500	1,698,980.00	0.69
37	002241	歌尔股份	39,500	1,688,230.00	0.69
38	000651	格力电器	32,200	1,677,620.00	0.68
39	603986	兆易创新	8,800	1,653,520.00	0.67
40	601166	兴业银行	80,000	1,644,000.00	0.67
41	688169	石头科技	1,300	1,639,300.00	0.67
42	300347	泰格医药	8,300	1,604,390.00	0.65
43	600031	三一重工	54,800	1,593,036.00	0.65
44	002230	科大讯飞	22,600	1,527,308.00	0.62
45	603833	欧派家居	10,700	1,518,972.00	0.62
46	601636	旗滨集团	80,000	1,484,800.00	0.60
47	000100	TCL 科技	191,300	1,463,445.00	0.59
48	688390	固德威	4,300	1,436,200.00	0.58
49	600887	伊利股份	38,600	1,421,638.00	0.58

50	603801	志邦家居	44,120	1,410,075.20	0.57
51	600298	安琪酵母	25,900	1,408,442.00	0.57
52	601688	华泰证券	87,400	1,380,920.00	0.56
53	300327	中颖电子	16,100	1,372,203.00	0.56
54	603444	吉比特	2,500	1,325,000.00	0.54
55	601377	兴业证券	136,300	1,316,658.00	0.53
56	688188	柏楚电子	2,900	1,264,400.00	0.51
57	603180	金牌厨柜	26,480	1,262,831.20	0.51
58	300124	汇川技术	16,600	1,232,716.00	0.50
59	002410	广联达	17,600	1,200,320.00	0.49
60	300316	晶盛机电	23,300	1,176,650.00	0.48
61	688396	华润微	12,700	1,155,954.00	0.47
62	600570	恒生电子	12,300	1,146,975.00	0.47
63	600809	山西汾酒	2,500	1,120,000.00	0.45
64	300623	捷捷微电	29,300	1,108,419.00	0.45
65	002138	顺络电子	28,400	1,101,068.00	0.45
66	600196	复星医药	14,900	1,074,737.00	0.44
67	603195	公牛集团	5,300	1,070,600.00	0.43
68	300274	阳光电源	9,300	1,070,058.00	0.43
69	601225	陕西煤业	89,200	1,057,020.00	0.43
70	300529	健帆生物	12,200	1,053,592.00	0.43
71	600660	福耀玻璃	18,200	1,016,470.00	0.41
72	601100	恒立液压	11,700	1,005,264.00	0.41
73	300496	中科创达	6,200	973,772.00	0.40
74	601865	福莱特	24,600	972,438.00	0.39
75	300037	新宙邦	9,500	950,950.00	0.39
76	002402	和而泰	39,500	946,815.00	0.38
77	603345	安井食品	3,700	939,874.00	0.38
78	603456	九洲药业	19,300	937,594.00	0.38
79	601689	拓普集团	25,000	935,750.00	0.38
80	600837	海通证券	80,100	921,150.00	0.37
81	300724	捷佳伟创	7,900	916,479.00	0.37
82	601211	国泰君安	53,300	913,562.00	0.37
83	600438	通威股份	20,700	895,689.00	0.36
84	600019	宝钢股份	117,000	893,880.00	0.36
85	601155	新城控股	21,400	890,240.00	0.36
86	601336	新华保险	19,200	881,472.00	0.36
87	000776	广发证券	57,600	872,064.00	0.35
88	600600	青岛啤酒	7,500	867,375.00	0.35
89	002179	中航光电	10,900	861,318.00	0.35
90	300638	广和通	18,380	858,346.00	0.35
91	000739	普洛药业	28,800	846,720.00	0.34

92	002891	中宠股份	20,650	846,650.00	0.34
93	002677	浙江美大	46,300	846,364.00	0.34
94	601128	常熟银行	132,500	821,500.00	0.33
95	002340	格林美	85,400	798,490.00	0.32
96	000157	中联重科	86,000	794,640.00	0.32
97	002139	拓邦股份	43,900	789,761.00	0.32
98	002920	德赛西威	7,100	781,568.00	0.32
99	601995	中金公司	12,500	768,750.00	0.31
100	300415	伊之密	35,000	752,500.00	0.31
101	600926	杭州银行	50,200	740,450.00	0.30
102	002714	牧原股份	11,866	721,690.12	0.29
103	600276	恒瑞医药	10,440	709,606.80	0.29
104	601615	明阳智能	43,700	707,503.00	0.29
105	002709	天赐材料	6,500	692,770.00	0.28
106	603799	华友钴业	6,000	685,200.00	0.28
107	688139	海尔生物	6,300	662,130.00	0.27
108	600741	华域汽车	25,100	659,377.00	0.27
109	300142	沃森生物	10,600	654,020.00	0.27
110	601838	成都银行	51,200	647,168.00	0.26
111	601939	建设银行	97,000	645,050.00	0.26
112	002032	苏泊尔	10,000	637,900.00	0.26
113	603378	亚士创能	11,500	632,730.00	0.26
114	603613	国联股份	6,225	622,313.25	0.25
115	002236	大华股份	29,300	618,230.00	0.25
116	002557	洽洽食品	14,000	603,400.00	0.24
117	002245	蔚蓝锂芯	30,600	602,820.00	0.24
118	603906	龙蟠科技	16,800	588,000.00	0.24
119	300699	光威复材	7,600	577,220.00	0.23
120	300012	华测检测	18,100	577,028.00	0.23
121	601658	邮储银行	114,400	574,288.00	0.23
122	300474	景嘉微	5,700	558,144.00	0.23
123	601233	桐昆股份	23,100	556,479.00	0.23
124	601169	北京银行	114,200	556,154.00	0.23
125	300015	爱尔眼科	7,779	552,153.42	0.22
126	002493	荣盛石化	31,400	542,278.00	0.22
127	002311	海大集团	6,600	538,560.00	0.22
128	601899	紫金矿业	54,700	530,043.00	0.22
129	601628	中国人寿	15,400	521,906.00	0.21
130	300034	钢研高纳	16,000	515,360.00	0.21
131	603568	伟明环保	22,430	512,076.90	0.21
132	002129	中环股份	13,200	509,520.00	0.21
133	603486	科沃斯	2,200	501,776.00	0.20

134	002001	新 和 成	17,160	492,148.80	0.20
135	600426	华鲁恒升	14,820	458,679.00	0.19
136	603127	昭衍新药	2,400	441,000.00	0.18
137	000063	中兴通讯	12,900	428,667.00	0.17
138	603606	东方电缆	19,700	396,758.00	0.16
139	601021	春秋航空	6,300	358,470.00	0.15
140	600893	航发动力	6,500	345,735.00	0.14
141	002821	凯莱英	900	335,340.00	0.14
142	000625	长安汽车	12,700	333,756.00	0.14
143	300595	欧普康视	3,200	331,360.00	0.13
144	603043	广州酒家	12,880	331,273.60	0.13
145	600763	通策医疗	800	328,800.00	0.13
146	002254	泰和新材	15,700	318,239.00	0.13
147	600779	水井坊	2,500	315,875.00	0.13
148	600012	皖通高速	44,000	284,240.00	0.12
149	300413	芒果超媒	4,100	281,260.00	0.11
150	300394	天孚通信	10,800	273,456.00	0.11
151	002648	卫星石化	6,800	266,492.00	0.11
152	688696	极米科技	300	249,600.00	0.10
153	002966	苏州银行	33,100	243,285.00	0.10
154	600383	金地集团	23,200	237,568.00	0.10
155	300003	乐普医疗	7,200	231,264.00	0.09
156	000799	酒鬼酒	900	230,040.00	0.09
157	002807	江阴银行	56,900	224,186.00	0.09
158	002511	中顺洁柔	8,100	223,155.00	0.09
159	002475	立讯精密	4,800	220,800.00	0.09
160	688005	容百科技	1,800	218,160.00	0.09
161	600176	中国巨石	13,878	215,247.78	0.09
162	002867	周大生	10,800	213,516.00	0.09
163	000961	中南建设	32,200	190,624.00	0.08
164	300119	瑞普生物	5,600	189,392.00	0.08
165	603899	晨光文具	2,100	177,576.00	0.07
166	603236	移远通信	1,040	177,434.40	0.07
167	000977	浪潮信息	5,900	165,967.00	0.07
168	600183	生益科技	6,900	161,529.00	0.07
169	603517	绝味食品	1,800	151,722.00	0.06
170	300033	同花顺	1,200	135,336.00	0.05
171	002563	森马服饰	11,300	135,035.00	0.05
172	600048	保利地产	10,900	131,236.00	0.05
173	002508	老板电器	2,700	125,550.00	0.05
174	688317	之江生物	1,927	122,981.14	0.05
175	688687	凯因科技	4,322	120,929.56	0.05

176	002007	华兰生物	3,100	113,708.00	0.05
177	002541	鸿路钢构	1,900	110,865.00	0.04
178	688621	阳光诺和	1,485	95,025.15	0.04
179	688315	诺禾致源	2,424	95,020.80	0.04
180	688456	有研粉材	3,358	88,987.00	0.04
181	688633	星球石墨	1,272	67,594.08	0.03
182	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.03
183	688611	杭州柯林	1,400	59,276.00	0.02
184	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.02
185	688597	煜邦电力	3,907	49,306.34	0.02
186	688655	迅捷兴	3,083	48,618.91	0.02
187	688683	莱尔科技	3,296	48,550.08	0.02
188	300919	中伟股份	265	43,195.00	0.02
189	300957	贝泰妮	120	30,235.20	0.01
190	688087	英科再生	1,308	28,723.68	0.01
191	300953	震裕科技	216	21,567.60	0.01
192	300941	创识科技	399	19,926.06	0.01
193	300973	立高食品	171	19,786.41	0.01
194	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
195	300925	法本信息	600	15,774.00	0.01
196	301015	百洋医药	387	15,027.21	0.01
197	300932	三友联众	463	14,681.73	0.01
198	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.01
199	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
200	300940	南极光	307	13,317.66	0.01
201	300937	药易购	244	13,105.24	0.01
202	301013	利和兴	471	12,768.81	0.01
203	301009	可靠股份	457	12,745.73	0.01
204	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.01
205	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
206	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
207	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
208	300997	欢乐家	841	10,975.05	0.00
209	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
210	300968	格林精密	787	9,499.09	0.00
211	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
212	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
213	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
214	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
215	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
216	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
217	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00

218	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
219	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
220	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
221	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
222	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
223	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
224	300986	志特新材	198	6,052.86	0.00
225	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
226	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
227	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
228	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
229	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
230	300985	致远新能	180	4,465.80	0.00
231	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
232	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
233	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
234	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
235	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
236	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	603501	韦尔股份	5,652,496.00	1.64
2	300347	泰格医药	5,611,346.00	1.63
3	000568	泸州老窖	5,211,273.00	1.51
4	600426	华鲁恒升	4,992,939.00	1.45
5	000002	万科A	4,629,380.29	1.34
6	002415	海康威视	4,560,933.78	1.32
7	300014	亿纬锂能	4,361,667.00	1.27
8	600690	海尔智家	4,231,647.00	1.23
9	603233	大参林	4,062,459.00	1.18
10	688036	传音控股	4,019,692.62	1.17
11	002271	东方雨虹	3,932,895.00	1.14
12	688396	华润微	3,896,454.06	1.13
13	601995	中金公司	3,809,676.00	1.11
14	002371	北方华创	3,794,770.00	1.10
15	000100	TCL 科技	3,675,284.00	1.07
16	601318	中国平安	3,652,227.00	1.06
17	600276	恒瑞医药	3,601,362.00	1.05
18	300274	阳光电源	3,594,915.72	1.04

19	002601	龙佰集团	3,496,926.00	1.01
20	601398	工商银行	3,431,205.00	1.00

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	601318	中国平安	8,563,295.52	2.49
2	000333	美的集团	7,465,906.75	2.17
3	300124	汇川技术	6,152,282.05	1.79
4	600519	贵州茅台	5,956,333.00	1.73
5	603233	大参林	5,941,465.58	1.72
6	300750	宁德时代	5,929,613.00	1.72
7	000858	五粮液	5,892,658.00	1.71
8	601166	兴业银行	5,607,569.00	1.63
9	002475	立讯精密	5,142,645.35	1.49
10	600809	山西汾酒	5,066,593.00	1.47
11	600036	招商银行	4,854,235.99	1.41
12	000001	平安银行	4,723,603.00	1.37
13	600926	杭州银行	4,536,791.00	1.32
14	600872	中炬高新	4,412,704.60	1.28
15	688036	传音控股	4,401,223.26	1.28
16	000100	TCL 科技	4,372,466.00	1.27
17	002821	凯莱英	4,359,280.00	1.27
18	300015	爱尔眼科	4,192,223.20	1.22
19	002601	龙佰集团	4,139,084.00	1.20
20	600600	青岛啤酒	4,126,634.00	1.20

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	408,696,065.25
卖出股票收入（成交）总额	510,646,015.35

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）	332,887.56	0.14
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	332,887.56	0.14

## 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	113050	南银转债	2,320	232,000.00	0.09
2	123115	捷捷转债	482	69,687.56	0.03
3	113049	长汽转债	160	16,000.00	0.01
4	123117	健帆转债	152	15,200.00	0.01

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

根据本基金基金合同规定，本基金不参与贵金属投资。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

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

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同的规定，本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。

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

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南京银行股份有限公司（以下简称“南京银行”）、招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）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12月，中国人民银行南京分行发布《行政处罚公示》（南银罚字〔2020〕30号）对南京银行违规占压财政资金等违法违规行为，处以罚款。

2021年5月，中国银行保险监督管理委员会发布《中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表》（银保监罚决字〔2021〕16号）对招商银行为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产等违法违规行为，处以罚款。

本基金投资南银转债（113050）、招商银行（600036）的决策流程符合本基金管理人投资管理制度相关规定。针对上述情况，本基金管理人进行了分析和研究，认为上述事件对南银转债、招商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	49,358.76
2	应收证券清算款	1,227,353.84
3	应收股利	-
4	应收利息	3,250.19
5	应收申购款	6,950.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	1,286,913.27

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
大摩量化配置混合 A	8,577	11962.34	494,793.37	0.48	102,106,175.61	99.52
大摩量化配置混合 C	70	17512.21	1,160,728.74	94.69	65,125.80	5.31
合计	8,647	12007.27	1,655,522.11	1.59	102,171,301.41	98.41

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	大摩量化配置混合 A	0.00	0
	大摩量化配置混合 C	0.00	0
	合计	0.00	0

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	大摩量化配置混合 A	0
	大摩量化配置混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有	大摩量化配置混合 A	0

本开放式基金	大摩量化配置混合 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大摩量化配置混合 A	大摩量化配置混合 C
基金合同生效日 (2012 年 12 月 11 日) 基金份额总额	1,095,372,033.67	-
本报告期初基金份 额总额	139,134,166.79	8,955,447.51
本报告期基金总申 购份额	5,534,460.46	1,771,357.78
减: 本报告期基金总 赎回份额	42,067,658.27	9,500,950.75
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	102,600,968.98	1,225,854.54

注：本基金自 2019 年 12 月 18 日起新增 C 类份额，上述事项已于 2019 年 12 月 18 日在指定媒介上公告。

## § 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的重大人事变动如下：

2021 年 5 月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

### 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	
华西证券	1	380,508,790.37	41.62%	278,267.37	38.33%	-
招商证券	1	282,748,418.12	30.93%	263,325.72	36.27%	-
安信证券	2	163,889,699.73	17.93%	119,851.29	16.51%	-
新时代证券	1	51,749,660.09	5.66%	37,844.73	5.21%	-
东方财富	1	15,966,576.87	1.75%	11,675.99	1.61%	-
中金公司	2	15,431,553.32	1.69%	11,285.06	1.55%	-
中信证券	1	3,953,284.63	0.43%	3,681.76	0.51%	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	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
华西证券	371,162.70	61.11%	-	-	-	-
招商证券	236,229.70	38.89%	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-

### 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	关于本基金增加蚂蚁基金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1月20日
3	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
4	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
5	本公司关于旗下部分基金参与烟台银	中国证监会规定报刊及	2021年1月21日

	行费率优惠活动的公告	网站	
6	本基金招募说明书（更新）、基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 1 月 27 日
7	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
8	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
9	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
10	本公司关于旗下部分基金参加北京度小满基金销售有限公司转换费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 3 月 12 日
11	本公司关于旗下部分基金参与安信证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 3 月 15 日
12	本基金基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 3 月 25 日
13	本基金招募说明书（更新）、基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 3 月 25 日
14	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
15	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
16	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
17	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
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	关于本基金 C 类份额增加盈米基金为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 4 月 22 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	中国证监会规定报刊及	2021 年 5 月 6 日

	司费率优惠活动的公告	网站	
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腾安基金销（深圳）有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 5 月 28 日
27	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
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

## § 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