

摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券  
投资基金  
2022 年中期报告

2022 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：2022 年 8 月 29 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 2022 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 2022 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>8</b>
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	9
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
<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	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
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>35</b>
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
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	46

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	46
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	46
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	47
7.12 投资组合报告附注 .....	47
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>48</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	49
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 .....	49
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>49</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	49
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 .....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	50
10.4 基金投资策略的改变 .....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	50
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 .....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	50
10.8 其他重大事件 .....	52
<b>§ 11 备查文件目录 .....</b>	<b>54</b>
11.1 备查文件目录 .....	54
11.2 存放地点 .....	54
11.3 查阅方式 .....	54

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	摩根士丹利华鑫深证 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	25,773,558.52 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(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-2,506,212.51
本期利润	-7,016,684.87

加权平均基金份额本期利润	-0.2818
本期加权平均净值利润率	-14.43%
本期基金份额净值增长率	-13.31%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)
期末可供分配利润	26,935,169.46
期末可供分配基金份额利润	1.0451
期末基金资产净值	52,708,727.98
期末基金份额净值	2.045
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)
基金份额累计净值增长率	104.50%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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。

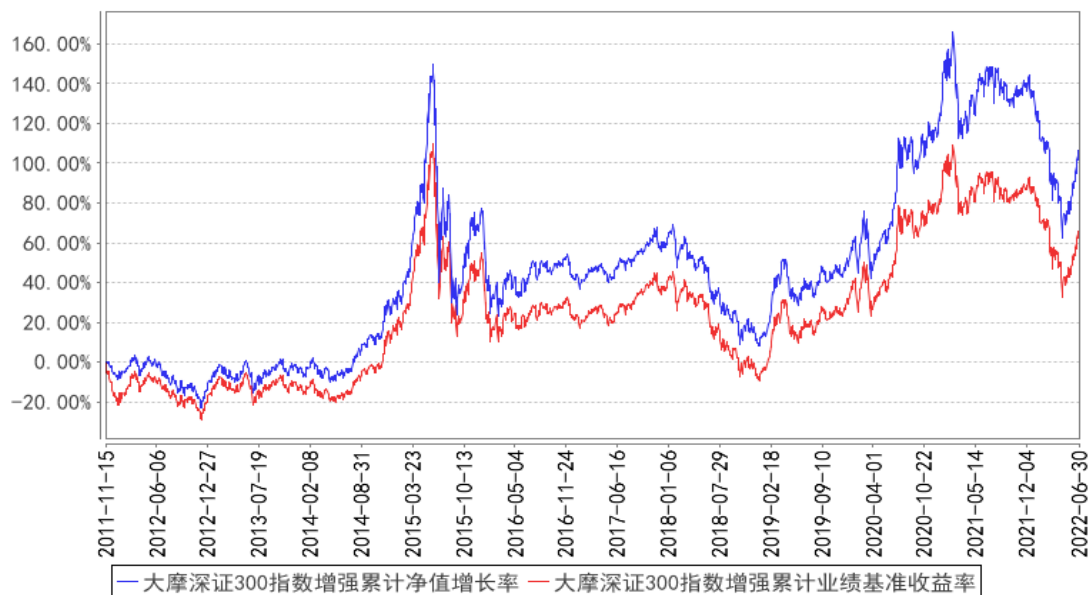
## 3.2 基金净值表现

### 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	12.24%	1.25%	11.53%	1.24%	0.71%	0.01%
过去三个月	7.69%	1.68%	6.90%	1.66%	0.79%	0.02%
过去六个月	-13.31%	1.63%	-12.16%	1.61%	-1.15%	0.02%
过去一年	-17.77%	1.41%	-15.70%	1.35%	-2.07%	0.06%
过去三年	49.27%	1.47%	40.70%	1.40%	8.57%	0.07%
自基金合同生效起至今	104.50%	1.56%	65.06%	1.51%	39.44%	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。

截至2022年6月30日，公司旗下共管理34只公募基金，其中股票型4只，混合型19只，指数型2只，债券型8只、基金中基金1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。
--	--	--	--	--	--

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合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未出现基金管理人管理的所有投资组合参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况，基金管理人未发现异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，我们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，力争实现投资组合的长期稳健增值。

报告期内，市场波动较大且叠加极端事件对市场的影响。我们观察到模型在极端市场环境里存在的局限性，以及短期时间维度下定价规律失效对投资组合复合回报的拉低。对应到投资端，针对极端市场下的风险管理理论和方法亟需加强，以更好地控制组合回撤和整体业绩表现。

报告期内，本基金超额收益保持稳定，跟踪误差和跟踪偏离符合基金合同要求。本基金将继续坚持均衡配置、风险分散的原则，在严格控制跟踪误差的前提下，力争实现投资组合的长期稳健增值。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期截至 2022 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 2.045 元，累计份额净值为 2.045 元，基金份额净值增长率为-13.31%，同期业绩比较基准收益率为-12.16%。

#### 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，市场可谓一波三折。从年初市场的小心翼翼至 3、4 月份的急转直下，再到 5、6 月份的霹雳反转。一切发生的宛若一部跌宕起伏、叹为观止的悲喜剧。不身处其中，不能体会市场在极端状态下对人心的纠缠与拉扯。

报告期内市场的急剧变化，至少反映出两方面很重要的信息：1、市场风险总是在人们放松警惕时悄然而至，“灰犀牛”和“黑天鹅”隐在角落里，伺机待发；2、资本市场的动荡也反映出经济环境的根本性变化。市场的脆弱性显现，是这些变化发生后的直接结果。

相较于短期的经济数据，基金经理更愿意去思考和总结当前阶段影响经济的更本质和宏大的关键变量。经济环境的根本性变化在于几个方面：一、部分国家和地区的逆全球化的长期影响有可能被低估。全球化进程受阻，意味着人员、技术、资金、知识和商品的流转速度降低。当可贸易品的贸易属性降低时必然带来成本和终端价格的上涨；二、全球债务水平已然达到新的高度，传统货币政策工具的使用似乎难以为继。根据 IMF 全球债务数据库（GDD）显示，2020 年全球债务总额达到 GDP 的 256%，相较 2007 年提高了 61%。高企的债务水平，使得通胀与利率水平的变化对实体经济行为产生了巨大的撬动效应。同时，高企的债务水平亦增加了经济活动的脆弱性。一旦某一环节的资产负债表恶化，将可能引起多米诺骨牌式的连锁反应；三、全球传统能源价格的持续攀升，本质上是碳成本的显性化。过去 50 年，地球海洋温度在经过长时间的平稳波动后，开始逐年快速提升。根据美国国家海洋和大气管理局（NOAA）报告，2020 年全球海洋温度比过去 140 年平均水平高出 1.03℃。从统计数据看，几乎现在每一年的海洋温度都在创造历史新高。全球气候变化意味着化石能源的使用将不可能再无节制。传统能源价格处于高位将可能是长期现象，只有较高的价格才能抑制潜在的使用需求，而经济增长对能源的需求和传统能源供给之间的差额只能由可再生能源来填补。或许我们要适应长期的结构性通胀，并伴随而来的各种政策和经济规律的变化。

世界处于快速变化和变革中，中国今天的发展环境与以往已迥然不同。得益于庞大的消费市场、完善的产业链配套、强大的制造业能力和持续的政策助力，基金经理相信中国的未来会更加

美好。尤其是中国如果在可再生能源领域建立起强大的、低成本的能源保障能力，那么结合已有的优势，将可能实现新的跨越式发展。

#### 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

本基金于 2022 年 3 月 3 日至 2022 年 6 月 16 日存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万万元的情形，基金管理人已根据相关法规及基金合同规定向中国证监会报告并提出解决方案。本报告期内，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的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

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

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

本报告期，本基金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，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 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：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	4,372,627.04	3,646,752.35
结算备付金		153,970.60	30,320.00
存出保证金		3,562.92	2,000.61
交易性金融资产	6.4.7.2	48,518,102.22	53,104,585.16
其中：股票投资		48,507,035.66	53,061,075.84
基金投资		-	-
债券投资		11,066.56	43,509.32
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-

其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		132,411.17	24,361.50
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	405.17
资产总计		53,180,673.95	56,808,424.79
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年6月30日</b>	<b>上年度末 2021年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		4,446.39	-
应付赎回款		201,822.56	40,282.32
应付管理人报酬		41,205.73	48,653.94
应付托管费		6,180.88	7,298.11
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	218,290.41	265,972.83
负债合计		471,945.97	362,207.20
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	25,773,558.52	23,932,708.18
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	26,935,169.46	32,513,509.41
净资产合计		52,708,727.98	56,446,217.59
负债和净资产总计		53,180,673.95	56,808,424.79

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.045 元，基金份额总额 25,773,558.52 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 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
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年	2021 年 1 月 1 日至 2021 年

		6 月 30 日	6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-6,570,265.15	4,236,441.31
1. 利息收入		7,040.95	7,940.29
其中：存款利息收入	6.4.7.13	7,040.95	7,920.73
债券利息收入		-	19.56
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）		-2,072,321.87	2,814,465.38
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-2,433,495.70	2,498,497.85
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	10,648.49	36,780.60
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	350,525.34	279,186.93
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-4,510,472.36	1,393,908.43
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	5,488.13	20,127.21
<b>减：二、营业总支出</b>		446,419.72	538,307.70
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	241,545.47	301,533.22
2. 托管费	6.4.10.2.2	36,231.88	45,229.98
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费	6.4.10.2.1.1	-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	0.05
8. 其他费用	6.4.7.23	168,642.37	191,544.45
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-7,016,684.87	3,698,133.61
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-7,016,684.87	3,698,133.61
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-7,016,684.87	3,698,133.61

### 6.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	23,932,708.18	-	32,513,509.41	56,446,217.59
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	23,932,708.18	-	32,513,509.41	56,446,217.59
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,840,850.34	-	-5,578,339.95	-3,737,489.61
(一)、综合收益总额	-	-	-7,016,684.87	-7,016,684.87
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	1,840,850.34	-	1,438,344.92	3,279,195.26

(净值减少以“-”号填列)				
其中:1. 基金申购款	4,378,470.15	-	3,792,171.17	8,170,641.32
2. 基金赎回款	-2,537,619.81	-	-2,353,826.25	-4,891,446.06
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	25,773,558.52	-	26,935,169.46	52,708,727.98
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	23,660,764.01	-	31,330,708.00	54,991,472.01
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-



其他	-	-	-	-
二、本 期初 净 资 产(基 金 净 值)	23,660,764.01	-	31,330,708.00	54,991,472.01
三、本 期 增 减 变 动 额(减 少以“-” 号填列)	1,846,620.19	-	6,595,324.15	8,441,944.34
(一)、 综合收 益总额	-	-	3,698,133.61	3,698,133.61
(二)、 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)	1,846,620.19	-	2,897,190.54	4,743,810.73
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
(三)、 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)	-	-	-	-
(四)、 其他综	-	-	-	-

合收益 结转留 存收益				
四、本期 期末净 资产(基 金净值)	25,507,384.20	-	37,926,032.15	63,433,416.35

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

王鸿斌

邓寰乐

谢先斌

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

摩根士丹利华鑫深证 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%，年化跟踪误差不得超过 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 2022 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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 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

除下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外，本基金本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，财政部于 2022 年颁布了《关于印发〈资产管理产品相关会计处理规定〉的通知》（财会[2022]14 号），本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

##### (a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息和应收申购款，金额分别为 3,646,752.35 元、30,320.00 元、2,000.61 元、405.17 元和 24,361.50 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息和应收申购款，金额分别为 3,647,124.67 元、30,335.07 元、2,001.60 元、0.00 元和 24,361.50 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 53,104,585.16 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 53,104,601.95 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 40,282.32 元、48,653.94 元、7,298.11 元、21,348.37 元和 124.46 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 40,282.32 元、48,653.94 元、7,298.11 元、21,348.37 元和 124.46 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

#### (b) 《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计估计变更。

### 6.4.5.3 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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	4,372,627.04
等于：本金	4,372,319.67
加：应计利息	307.37
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	4,372,627.04

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	41,196,319.39	-	48,507,035.66	7,310,716.27	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	9,300.00	5.14	11,066.56	1,761.42
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	9,300.00	5.14	11,066.56	1,761.42
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	41,205,619.39	5.14	48,518,102.22	7,312,477.69	

## 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 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

## 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	609.53
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	53,673.51
其中：交易所市场	53,673.51
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	64,007.37
应付指数使用费	100,000.00
合计	218,290.41

## 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	23,932,708.18	23,932,708.18
本期申购	4,378,470.15	4,378,470.15
本期赎回（以“-”号填列）	-2,537,619.81	-2,537,619.81
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	25,773,558.52	25,773,558.52

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

## 6.4.7.8 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
本期期初	30,486,140.60	2,027,368.81	32,513,509.41

本期利润	-2,506,212.51	-4,510,472.36	-7,016,684.87
本期基金份额交易产生的变动数	2,303,459.44	-865,114.52	1,438,344.92
其中：基金申购款	5,382,004.46	-1,589,833.29	3,792,171.17
基金赎回款	-3,078,545.02	724,718.77	-2,353,826.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	30,283,387.53	-3,348,218.07	26,935,169.46

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	6,166.09
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	851.22
其他	23.64
合计	7,040.95

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-2,433,495.70
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	-2,433,495.70

##### 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	78,139,544.25
减：卖出股票成本总额	80,365,584.21
减：交易费用	207,455.74
买卖股票差价收入	-2,433,495.70

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
----	----



	2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	17.08
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	10,631.41
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	10,648.49

#### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	46,261.79
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	35,600.00
减：应计利息总额	28.73
减：交易费用	1.65
买卖债券差价收入	10,631.41

#### 6.4.7.12 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。

#### 6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	350,525.34
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	350,525.34

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	-4,510,472.36
股票投资	-4,500,324.46

债券投资	-10,147.90
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	-4,510,472.36

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	5,189.50
基金转换费收入	298.63
合计	5,488.13

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。

#### 6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行费用	135.00
债券账户维护费	9,000.00
指数使用费	100,000.00
合计	168,642.37

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	241,545.47	301,533.22
其中：支付销售机构的客户维护费	109,338.83	137,867.69

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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.00\% / \text{当年天数}。$$

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
----	--	---

当期发生的基金应支付的托管费	36,231.88	45,229.98
----------------	-----------	-----------

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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

#### 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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	4,372,627.04	6,166.09	4,327,922.67	7,631.23

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

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末(2022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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 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
002670	国盛金控	2022 年 06 月 01 日	重大事项停牌	9.60	2022 年 07 月 14 日	9.99	4,300	33,196.00	41,280.00	-

注：本基金截至 2022 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信用风险、流动性风险及市场风险。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，前者负责协调并与各部门合作完成运营及合规风险管理，后者主要负责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 2022 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 0.02% (2021 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 0.08%)。

#### 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 2022 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 2022 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 2022 年 6 月 30 日，本基金最近工作日确认的净赎回金额未超过组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感

性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022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	4,372,627.04	-	-	-	4,372,627.04
结算备付金	153,970.60	-	-	-	153,970.60
存出保证金	3,562.92	-	-	-	3,562.92
交易性金融资产	-	-	11,066.56	48,507,035.66	48,518,102.22
应收申购款	-	-	-	132,411.17	132,411.17
资产总计	4,530,160.56	-	11,066.56	48,639,446.83	53,180,673.95
负债					
应付赎回款	-	-	-	201,822.56	201,822.56
应付管理人报酬	-	-	-	41,205.73	41,205.73
应付托管费	-	-	-	6,180.88	6,180.88
应付清算款	-	-	-	4,446.39	4,446.39
其他负债	-	-	-	218,290.41	218,290.41
负债总计	-	-	-	471,945.97	471,945.97
利率敏感度缺口	4,530,160.56	-	11,066.56	48,167,500.86	52,708,727.98
上年度末 2021年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,646,752.35	-	-	-	3,646,752.35
结算备付金	30,320.00	-	-	-	30,320.00
存出保证金	2,000.61	-	-	-	2,000.61
交易性金融资产	-	-	43,509.32	53,061,075.84	53,104,585.16
应收申购款	-	-	-	24,361.50	24,361.50
其他资产	-	-	-	405.17	405.17
资产总计	3,679,072.96	-	43,509.32	53,085,842.51	56,808,424.79
负债					
应付赎回款	-	-	-	40,282.32	40,282.32
应付管理人报酬	-	-	-	48,653.94	48,653.94
应付托管费	-	-	-	7,298.11	7,298.11



其他负债	-	-	-	265,972.83	265,972.83
负债总计	-	-	-	362,207.20	362,207.20
利率敏感度缺口	3,679,072.96	-	43,509.32	52,723,635.31	56,446,217.59

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 2022 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 0.02% (2021 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 0.08%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2021 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 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	48,507,035.66	92.03	53,061,075.84	94.00
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	48,507,035.66	92.03	53,061,075.84	94.00

#### 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 7.4.1)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(2022年6月30日)	上年度末(2021年12月31日)
分析	业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%	2,490,000.00	2,940,000.00
	业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-2,490,000.00	-2,940,000.00

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 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。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位:人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	48,476,822.22	53,104,601.95

第二层次	41,280.00	-
第三层次	-	-
合计	48,518,102.22	53,104,601.95

#### 6.4.14.2.2 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。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 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(2021 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	48,507,035.66	91.21
	其中：股票	48,507,035.66	91.21
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	11,066.56	0.02
	其中：债券	11,066.56	0.02
	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	4,526,597.64	8.51
8	其他各项资产	135,974.09	0.26
9	合计	53,180,673.95	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	1,308,179.92	2.48
B	采矿业	475,365.00	0.90
C	制造业	33,643,942.63	63.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	80,650.00	0.15
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	949,869.00	1.80
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,058,165.80	2.01
J	金融业	3,293,886.65	6.25
K	房地产业	360,800.00	0.68
L	租赁和商务服务业	239,835.00	0.46
M	科学研究和技术服务业	193,862.00	0.37
N	水利、环境和公共设施管理业	53,169.00	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	615,028.37	1.17
R	文化、体育和娱乐业	470,105.00	0.89
S	综合	-	-
	合计	42,742,858.37	81.09

### 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	675,093.00	1.28
C	制造业	3,585,822.29	6.80
D	电力、热力、燃气	-	-

	及水生产和供应业		
E	建筑业	147,386.00	0.28
F	批发和零售业	92,725.00	0.18
G	交通运输、仓储和邮政业	236,857.00	0.45
H	住宿和餐饮业	265,395.00	0.50
I	信息传输、软件和信息技术服务业	186,909.00	0.35
J	金融业	549,128.00	1.04
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	18,459.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	6,403.00	0.01
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	5,764,177.29	10.94

### 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	5,600	2,990,400.00	5.67
2	000858	五粮液	8,600	1,736,598.00	3.29
3	002594	比亚迪	4,700	1,567,403.00	2.97
4	000333	美的集团	24,342	1,470,013.38	2.79
5	000568	泸州老窖	4,200	1,035,468.00	1.96
6	300059	东方财富	40,599	1,031,214.60	1.96
7	000001	平安银行	57,000	853,860.00	1.62
8	002460	赣锋锂业	5,300	788,110.00	1.50
9	002142	宁波银行	21,320	763,469.20	1.45
10	000651	格力电器	21,100	711,492.00	1.35
11	300014	亿纬锂能	7,165	698,587.50	1.33
12	300760	迈瑞医疗	2,100	657,720.00	1.25
13	002475	立讯精密	19,442	656,945.18	1.25
14	002352	顺丰控股	11,700	652,977.00	1.24
15	002812	恩捷股份	2,420	606,089.00	1.15

16	000725	京东方 A	126,700	499,198.00	0.95
17	002714	牧原股份	8,896	491,681.92	0.93
18	300390	天华超净	5,500	480,700.00	0.91
19	300015	爱尔眼科	10,681	478,188.37	0.91
20	002304	洋河股份	2,600	476,190.00	0.90
21	000661	长春高新	2,000	466,840.00	0.89
22	300274	阳光电源	4,600	451,950.00	0.86
23	002415	海康威视	12,100	438,020.00	0.83
24	002709	天赐材料	6,900	428,214.00	0.81
25	300568	星源材质	14,135	410,480.40	0.78
26	002074	国轩高科	8,900	405,840.00	0.77
27	000792	盐湖股份	13,400	401,464.00	0.76
28	002049	紫光国微	2,000	379,440.00	0.72
29	300142	沃森生物	7,800	377,442.00	0.72
30	300498	温氏股份	17,200	366,188.00	0.69
31	300316	晶盛机电	5,400	364,986.00	0.69
32	000002	万 科 A	17,600	360,800.00	0.68
33	000625	长安汽车	20,800	360,256.00	0.68
34	300661	圣邦股份	1,950	354,939.00	0.67
35	300763	锦浪科技	1,650	351,450.00	0.67
36	002459	晶澳科技	4,340	342,426.00	0.65
37	300144	宋城演艺	22,000	337,700.00	0.64
38	000983	山西焦煤	24,900	333,411.00	0.63
39	002129	TCL 中环	5,551	326,898.39	0.62
40	300124	汇川技术	4,700	309,589.00	0.59
41	300832	新产业	6,700	302,237.00	0.57
42	300450	先导智能	4,700	296,946.00	0.56
43	002299	圣农发展	15,400	295,372.00	0.56
44	300122	智飞生物	2,634	292,400.34	0.55
45	000776	广发证券	15,600	291,720.00	0.55
46	002821	凯莱英	1,000	289,000.00	0.55
47	002756	永兴材料	1,800	273,978.00	0.52
48	300529	健帆生物	5,320	270,734.80	0.51
49	000733	振华科技	1,900	258,343.00	0.49
50	000063	中兴通讯	10,100	257,853.00	0.49
51	300751	迈为股份	524	257,231.60	0.49
52	000100	TCL 科技	53,300	255,307.00	0.48
53	002920	德赛西威	1,700	251,600.00	0.48
54	002120	韵达股份	14,600	249,076.00	0.47
55	002311	海大集团	4,100	246,041.00	0.47
56	000799	酒鬼酒	1,300	241,553.00	0.46
57	300896	爱美客	400	240,004.00	0.46

58	002153	石基信息	14,480	229,797.60	0.44
59	002271	东方雨虹	4,250	218,747.50	0.42
60	002572	索菲亚	7,600	209,000.00	0.40
61	002241	歌尔股份	6,200	208,320.00	0.40
62	300628	亿联网络	2,700	205,605.00	0.39
63	300001	特锐德	11,500	199,065.00	0.38
64	000876	新希望	12,800	195,840.00	0.37
65	300037	新宙邦	3,640	191,318.40	0.36
66	002027	分众传媒	28,400	191,132.00	0.36
67	002497	雅化集团	5,800	189,370.00	0.36
68	300454	深信服	1,800	186,804.00	0.35
69	300861	美畅股份	2,000	185,380.00	0.35
70	002399	海普瑞	10,500	184,590.00	0.35
71	002493	荣盛石化	11,650	179,293.50	0.34
72	002430	杭氧股份	5,600	175,056.00	0.33
73	000596	古井贡酒	700	174,762.00	0.33
74	300207	欣旺达	5,500	173,800.00	0.33
75	000878	云南铜业	14,900	169,711.00	0.32
76	000987	越秀金控	23,895	167,981.85	0.32
77	002385	大北农	21,500	167,915.00	0.32
78	002600	领益智造	33,300	167,166.00	0.32
79	000301	东方盛虹	9,700	164,027.00	0.31
80	300073	当升科技	1,800	162,612.00	0.31
81	002407	多氟多	3,300	161,403.00	0.31
82	002624	完美世界	11,100	159,507.00	0.30
83	000860	顺鑫农业	5,800	155,556.00	0.30
84	300769	德方纳米	380	155,298.40	0.29
85	000998	隆平高科	9,300	154,938.00	0.29
86	002410	广联达	2,800	152,432.00	0.29
87	002867	周大生	9,800	152,194.00	0.29
88	002409	雅克科技	2,700	149,877.00	0.28
89	000960	锡业股份	8,900	149,253.00	0.28
90	300919	中伟股份	1,200	148,680.00	0.28
91	002601	龙佰集团	7,400	148,370.00	0.28
92	000425	徐工机械	26,600	143,374.00	0.27
93	300244	迪安诊断	4,400	136,840.00	0.26
94	002202	金风科技	9,100	134,680.00	0.26
95	300308	中际旭创	4,300	133,515.00	0.25
96	002831	裕同科技	4,500	132,975.00	0.25
97	002739	万达电影	9,700	132,405.00	0.25
98	000932	华菱钢铁	25,900	131,831.00	0.25
99	002340	格林美	14,300	130,130.00	0.25

100	300724	捷佳伟创	1,400	125,090.00	0.24
101	300677	英科医疗	4,680	118,684.80	0.23
102	300433	蓝思科技	10,600	117,342.00	0.22
103	002064	华峰化学	13,900	117,316.00	0.22
104	000830	鲁西化工	6,700	115,843.00	0.22
105	002508	老板电器	3,200	115,296.00	0.22
106	002371	北方华创	400	110,848.00	0.21
107	000807	云铝股份	11,100	109,668.00	0.21
108	000825	太钢不锈	19,600	106,820.00	0.20
109	300759	康龙化成	1,050	99,981.00	0.19
110	002230	科大讯飞	2,400	98,928.00	0.19
111	002841	视源股份	1,300	97,916.00	0.19
112	002532	天山铝业	14,800	96,644.00	0.18
113	300601	康泰生物	2,100	94,878.00	0.18
114	002938	鹏鼎控股	3,100	93,651.00	0.18
115	300347	泰格医药	800	91,560.00	0.17
116	002791	坚朗五金	700	90,804.00	0.17
117	002797	第一创业	14,100	90,381.00	0.17
118	002901	大博医疗	2,300	90,022.00	0.17
119	300474	景嘉微	1,300	88,907.00	0.17
120	000988	华工科技	3,800	88,046.00	0.17
121	300595	欧普康视	1,520	86,928.80	0.16
122	000729	燕京啤酒	8,900	85,974.00	0.16
123	002384	东山精密	3,700	84,841.00	0.16
124	002128	电投能源	5,900	84,488.00	0.16
125	002030	达安基因	4,900	84,231.00	0.16
126	000338	潍柴动力	6,700	83,549.00	0.16
127	300357	我武生物	1,600	83,248.00	0.16
128	300296	利亚德	11,300	82,490.00	0.16
129	002001	新和成	3,600	82,116.00	0.16
130	300888	稳健医疗	1,200	79,800.00	0.15
131	300866	安克创新	1,200	79,584.00	0.15
132	300136	信维通信	4,700	79,195.00	0.15
133	000738	航发控制	2,800	78,680.00	0.15
134	000709	河钢股份	34,700	78,422.00	0.15
135	300253	卫宁健康	8,840	77,615.20	0.15
136	002555	三七互娱	3,400	72,182.00	0.14
137	300725	药石科技	700	69,293.00	0.13
138	000977	浪潮信息	2,600	68,848.00	0.13
139	000630	铜陵有色	20,600	67,156.00	0.13
140	300496	中科创达	500	65,240.00	0.12
141	002050	三花智控	2,280	62,654.40	0.12



142	300088	长信科技	8,400	62,328.00	0.12
143	000708	中信特钢	3,000	60,450.00	0.11
144	002179	中航光电	952	60,280.64	0.11
145	000739	普洛药业	2,800	57,792.00	0.11
146	000975	银泰黄金	5,900	57,466.00	0.11
147	002266	浙富控股	11,100	53,169.00	0.10
148	300146	汤臣倍健	2,300	49,795.00	0.09
149	000155	川能动力	2,200	48,730.00	0.09
150	002653	海思科	3,000	48,330.00	0.09
151	000785	居然之家	10,800	48,060.00	0.09
152	000938	紫光股份	2,400	46,560.00	0.09
153	000683	远兴能源	4,000	42,040.00	0.08
154	000895	双汇发展	1,300	38,090.00	0.07
155	300003	乐普医疗	1,800	33,426.00	0.06
156	003816	中国广核	11,400	31,920.00	0.06
157	000999	华润三九	700	31,500.00	0.06
158	002422	科伦药业	1,600	29,920.00	0.06
159	002236	大华股份	1,800	29,556.00	0.06
160	002032	苏泊尔	500	28,170.00	0.05
161	000617	中油资本	5,800	27,898.00	0.05
162	001965	招商公路	3,200	24,416.00	0.05
163	001872	招商港口	1,500	23,400.00	0.04
164	002945	华林证券	1,500	22,875.00	0.04
165	300212	易华录	900	15,660.00	0.03
166	000750	国海证券	4,200	15,246.00	0.03
167	300285	国瓷材料	400	14,368.00	0.03
168	002745	木林森	1,400	13,678.00	0.03
169	002500	山西证券	2,300	13,202.00	0.03
170	002466	天齐锂业	100	12,480.00	0.02
171	300363	博腾股份	100	7,799.00	0.01
172	300979	华利集团	100	7,308.00	0.01
173	002673	西部证券	1,100	7,194.00	0.01
174	002936	郑州银行	2,400	6,456.00	0.01
175	300558	贝达药业	100	6,080.00	0.01
176	300999	金龙鱼	100	5,402.00	0.01
177	300482	万孚生物	100	4,071.00	0.01
178	300747	锐科激光	100	3,890.00	0.01
179	000513	丽珠集团	100	3,621.00	0.01
180	002414	高德红外	280	3,603.60	0.01
181	300012	华测检测	100	2,321.00	0.00
182	002736	国信证券	100	957.00	0.00
183	000800	一汽解放	100	934.00	0.00

184	002423	中粮资本	100	671.00	0.00
185	002010	传化智联	100	643.00	0.00
186	002563	森马服饰	100	592.00	0.00
187	000166	申万宏源	100	429.00	0.00
188	002958	青农商行	100	332.00	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	603505	金石资源	5,300	216,823.00	0.41
2	688123	聚辰股份	1,700	181,084.00	0.34
3	603348	文灿股份	3,300	176,880.00	0.34
4	600256	广汇能源	16,400	172,856.00	0.33
5	688408	中信博	1,800	166,464.00	0.32
6	600882	妙可蓝多	3,100	145,080.00	0.28
7	688556	高测股份	1,680	135,576.00	0.26
8	688006	杭可科技	1,800	126,108.00	0.24
9	688198	佰仁医疗	980	119,481.60	0.23
10	600258	首旅酒店	4,800	119,040.00	0.23
11	603688	石英股份	800	106,088.00	0.20
12	688388	嘉元科技	1,200	101,844.00	0.19
13	688559	海目星	1,400	101,780.00	0.19
14	002840	华统股份	5,500	97,075.00	0.18
15	600919	江苏银行	13,500	96,120.00	0.18
16	600754	锦江酒店	1,500	94,350.00	0.18
17	002324	普利特	6,400	92,672.00	0.18
18	688286	敏芯股份	1,700	89,029.00	0.17
19	601666	平煤股份	6,500	88,335.00	0.17
20	002738	中矿资源	940	87,053.40	0.17
21	688155	先惠技术	800	83,360.00	0.16
22	002928	华夏航空	7,000	82,390.00	0.16
23	688518	联赢激光	2,300	78,177.00	0.15
24	600438	通威股份	1,300	77,818.00	0.15
25	603392	万泰生物	490	76,097.00	0.14
26	600026	中远海能	7,300	75,409.00	0.14
27	603818	曲美家居	7,900	75,050.00	0.14
28	603613	国联股份	835	73,981.00	0.14
29	600499	科达制造	3,500	72,240.00	0.14
30	300842	帝科股份	1,200	71,520.00	0.14
31	300767	震安科技	1,200	69,816.00	0.13
32	688116	天奈科技	400	67,792.00	0.13
33	603826	坤彩科技	1,100	64,746.00	0.12

34	688071	华依科技	1,400	64,736.00	0.12
35	603355	莱克电气	2,500	63,075.00	0.12
36	688599	天合光能	900	58,725.00	0.11
37	600732	爱旭股份	1,700	56,134.00	0.11
38	002268	卫士通	1,300	55,783.00	0.11
39	600188	兖矿能源	1,400	55,272.00	0.10
40	300666	江丰电子	900	54,900.00	0.10
41	002242	九阳股份	2,900	53,244.00	0.10
42	301073	君亭酒店	750	52,005.00	0.10
43	002651	利君股份	6,600	51,810.00	0.10
44	600338	西藏珠峰	1,800	51,660.00	0.10
45	000951	中国重汽	3,900	50,661.00	0.10
46	600546	山煤国际	2,500	48,650.00	0.09
47	601336	新华保险	1,500	48,285.00	0.09
48	603666	亿嘉和	700	48,020.00	0.09
49	601601	中国太保	2,000	47,060.00	0.09
50	603997	继峰股份	4,300	46,784.00	0.09
51	601838	成都银行	2,800	46,424.00	0.09
52	688772	珠海冠宇	1,500	46,050.00	0.09
53	601816	京沪高铁	9,100	45,682.00	0.09
54	601688	华泰证券	3,200	45,440.00	0.09
55	002539	云图控股	2,800	44,772.00	0.08
56	601658	邮储银行	8,200	44,198.00	0.08
57	601211	国泰君安	2,900	44,080.00	0.08
58	002091	江苏国泰	4,100	44,075.00	0.08
59	600522	中天科技	1,900	43,890.00	0.08
60	600170	上海建工	14,000	42,420.00	0.08
61	600039	四川路桥	4,000	42,120.00	0.08
62	601318	中国平安	900	42,021.00	0.08
63	601668	中国建筑	7,800	41,496.00	0.08
64	002670	国盛金控	4,300	41,280.00	0.08
65	600486	扬农化工	300	39,984.00	0.08
66	000933	神火股份	3,000	39,240.00	0.07
67	603737	三棵树	300	38,829.00	0.07
68	301050	雷电微力	380	38,592.80	0.07
69	601128	常熟银行	4,700	35,908.00	0.07
70	600547	山东黄金	1,900	35,264.00	0.07
71	002468	申通快递	2,800	33,376.00	0.06
72	688232	新点软件	800	30,096.00	0.06
73	601166	兴业银行	1,500	29,850.00	0.06
74	601808	中海油服	2,100	29,295.00	0.06
75	300575	中旗股份	1,450	29,290.00	0.06

76	688533	上声电子	400	28,576.00	0.05
77	300233	金城医药	1,000	28,530.00	0.05
78	002597	金禾实业	600	25,998.00	0.05
79	601618	中国中冶	6,100	21,350.00	0.04
80	002258	利尔化学	900	21,258.00	0.04
81	601899	紫金矿业	2,200	20,526.00	0.04
82	603369	今世缘	400	20,400.00	0.04
83	603086	先达股份	2,100	20,370.00	0.04
84	300639	凯普生物	950	20,311.00	0.04
85	601009	南京银行	1,900	19,798.00	0.04
86	600057	厦门象屿	2,100	18,459.00	0.04
87	603236	移远通信	130	17,375.80	0.03
88	601799	星宇股份	100	17,100.00	0.03
89	688066	航天宏图	200	15,760.00	0.03
90	300681	英搏尔	190	10,976.30	0.02
91	688157	松井股份	100	10,435.00	0.02
92	600030	中信证券	400	8,664.00	0.02
93	688787	海天瑞声	100	6,935.00	0.01
94	688265	南模生物	100	6,403.00	0.01
95	688386	泛亚微透	100	5,429.00	0.01
96	688567	孚能科技	179	5,085.39	0.01
97	688025	杰普特	100	4,958.00	0.01
98	300777	中简科技	100	4,820.00	0.01
99	600570	恒生电子	100	4,354.00	0.01
100	000915	华特达因	100	4,135.00	0.01
101	688089	嘉必优	100	3,275.00	0.01
102	601225	陕西煤业	100	2,118.00	0.00
103	600988	赤峰黄金	100	1,595.00	0.00
104	603181	皇马科技	100	1,509.00	0.00
105	688223	晶科能源	100	1,493.00	0.00
106	603165	荣晟环保	100	1,460.00	0.00
107	600711	盛屯矿业	100	776.00	0.00
108	600516	方大炭素	100	760.00	0.00
109	603993	洛阳钼业	100	573.00	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	002027	分众传媒	790,840.00	1.40
2	000651	格力电器	777,263.90	1.38
3	300059	东方财富	672,423.00	1.19

4	002594	比亚迪	644,834.00	1.14
5	300015	爱尔眼科	598,630.22	1.06
6	000001	平安银行	597,603.00	1.06
7	300274	阳光电源	553,497.00	0.98
8	000725	京东方 A	544,171.00	0.96
9	002601	龙佰集团	531,969.00	0.94
10	002821	凯莱英	531,225.00	0.94
11	000568	泸州老窖	528,163.00	0.94
12	002407	多氟多	514,515.00	0.91
13	002475	立讯精密	506,095.00	0.90
14	000792	盐湖股份	503,055.00	0.89
15	000858	五粮液	498,989.00	0.88
16	300207	欣旺达	494,608.92	0.88
17	002271	东方雨虹	488,162.00	0.86
18	002352	顺丰控股	483,907.27	0.86
19	000733	振华科技	478,468.00	0.85
20	002304	洋河股份	462,524.00	0.82

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	300059	东方财富	920,390.00	1.63
2	300760	迈瑞医疗	801,484.00	1.42
3	002271	东方雨虹	785,475.00	1.39
4	002821	凯莱英	759,716.00	1.35
5	002340	格林美	717,576.00	1.27
6	002475	立讯精密	676,636.00	1.20
7	002027	分众传媒	659,180.00	1.17
8	000009	中国宝安	641,360.00	1.14
9	002129	TCL 中环	604,823.00	1.07
10	300274	阳光电源	596,155.00	1.06
11	001979	招商蛇口	591,021.00	1.05
12	002920	德赛西威	587,834.00	1.04
13	000568	泸州老窖	582,243.00	1.03
14	000858	五粮液	576,745.00	1.02
15	002460	赣锋锂业	558,620.00	0.99
16	000001	平安银行	558,252.00	0.99
17	002459	晶澳科技	552,430.00	0.98
18	002709	天赐材料	550,666.00	0.98
19	002241	歌尔股份	546,209.00	0.97
20	300124	汇川技术	526,262.00	0.93

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	80,311,868.49
卖出股票收入（成交）总额	78,139,544.25

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）	11,066.56	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	11,066.56	0.02

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

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	127056	中特转债	93	11,066.56	0.02

#### 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 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 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”）、宁波银行股份有限公司（以下简称“宁波银行”）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。

2021 年 7 月，中国人民银行宁波市中心支行发布《行政处罚信息公开表》（甬银处罚字（2021）2 号）对宁波银行违规为存款人多头开立银行结算账户等违法违规行为，处以罚款。

2021 年 8 月，中国银行保险监督管理委员会宁波银保监局发布《宁波银保监局行政处罚信息公开表》（甬银保监罚决字（2021）57 号）对宁波银行贷款被挪用于缴纳土地款或土地收储等违法违规行为，处以罚款。

2022 年 3 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（2022）24 号）平安银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在的违法违规行为，处以罚款。

2022 年 4 月，中国银行保险监督管理委员会宁波银保监局发布《宁波银保监局行政处罚信息公开表》（甬银保监罚决字（2022）35 号）对宁波银行关联交易管理不规范等违法违规行为，处以罚款。

2022 年 4 月，中国银行保险监督管理委员会宁波银保监局发布《宁波银保监局行政处罚信息公开表》（甬银保监罚决字（2022）28 号）对宁波银行信贷资金违规流入房地产领域等违法违规行为，处以罚款。

2022 年 4 月，中国银行保险监督管理委员会宁波银保监局发布《宁波银保监局行政处罚信息

公开表》（甬银保监罚决字〔2022〕30 号）对宁波银行代理保险销售不规范等违法违规行为，处以罚款。

2022 年 5 月，中国银行保险监督管理委员会宁波银保监局发布《宁波银保监局行政处罚信息公开表》（甬银保监罚决字〔2022〕44 号）对宁波银行理财业务管理不规范等违法违规行为，处以罚款。

本基金投资平安银行（000001）、宁波银行（002142）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，认为上述事件对平安银行、宁波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	3,562.92
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	132,411.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	135,974.09

### 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	户均持有的	持有人结构
-------	-------	-------



(户)	基金份额	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 (%)
2,419	10,654.63	941,066.83	3.65	24,832,491.69	96.35

### 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、基金投资和研发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	23,932,708.18
本报告期基金总申购份额	4,378,470.15
减：本报告期基金总赎回份额	2,537,619.81
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	25,773,558.52

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人的重大人事变动如下：

1、自 2022 年 5 月 26 日起徐许女士担任公司财务负责人，基金管理人于 2022 年 5 月 28 日公告了上述事项；

2、自 2022 年 6 月 15 日起周熙先生不再担任公司董事长职务，基金管理人于 2022 年 6 月 16 日公告了上述事项；

3、自 2022 年 6 月 17 日起总经理王鸿嫔女士代为履行董事长职务，基金管理人于 2022 年 6 月 18 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 (%)	
申万宏源	2	129,396,824.67	81.70	94,628.82	81.70	-
开源证券	1	28,987,316.58	18.30	21,198.99	18.30	-
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	2	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
兴业证券	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	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
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，本基金减少租用长城证券、宏信证券各 1 个交易单元。

## 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 (%)
申万宏源	41,129.79	88.91	-	-	-	-
开源证券	5,132.00	11.09	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
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	本公司关于旗下资产管理产品执行新金融工具相关会计准则的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 1 月 1 日

2	本公司关于提醒投资者警惕非法电子平台仿冒本公司员工名义进行不法活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 1 月 6 日
3	本公司旗下全部基金 2021 年 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 1 月 21 日
4	本基金 2021 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 1 月 21 日
5	本公司关于旗下部分基金在山西证券股份有限公司开通基金定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 2 月 17 日
6	本公司关于调整官方网站网上交易和查询服务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 2 月 22 日
7	本公司关于旗下部分基金参与光大证券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	2022 年 3 月 17 日
8	本基金基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 3 月 23 日
9	本基金招募说明书（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 3 月 23 日
10	本公司旗下全部基金 2021 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 3 月 30 日
11	本基金 2021 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 3 月 30 日
12	本公司关于旗下部分基金增加泰信财富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	2022 年 4 月 15 日
13	本公司旗下全部基金 2022 年 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 4 月 21 日
14	本公司旗下全部基金 2022 年 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 4 月 21 日
15	本公司关于系统升级期间暂停电话自助语音服务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 5 月 19 日
16	本公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 5 月 28 日
17	本公司关于系统升级期间暂停电话自助语音服务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 6 月 3 日
18	本公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 6 月 16 日
19	本公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 6 月 18 日
20	本公司关于系统升级期间暂停电话自助语音服务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 6 月 21 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

2022 年 8 月 29 日