

# 上投摩根日本精选股票型证券投资基金（QDII）

**2021 年中期报告**

**2021 年 6 月 30 日**

基金管理人：上投摩根基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年八月三十一日

## 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 30 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> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>2 基金简介</b> .....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 其他相关资料.....	6
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	6
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> .....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	11
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 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.....	14
<b>5 托管人报告</b> .....	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	14
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
<b>7 投资组合报告</b> .....	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	35
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	36
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	37
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	44
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	44
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	44
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细.....	44
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	45
7.11 本报告期投资基金情况.....	45
7.12 投资组合报告附注.....	45

<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
<b>9 开放式基金份额变动</b> .....	46
<b>10 重大事件揭示</b> .....	46
10.1 基金份额持有人大会决议.....	46
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.....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
10.4 基金投资策略的改变.....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
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.....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8 其他重大事件.....	48
<b>11 备查文件目录</b> .....	49
11.1 备查文件目录.....	49
11.2 存放地点.....	49
11.3 查阅方式.....	49

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	上投摩根日本精选股票型证券投资基金（QDII）
基金简称	上投摩根日本精选股票(QDII)
基金主代码	007280
交易代码	007280
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 7 月 31 日
基金管理人	上投摩根基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	98,469,839.68 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于日本上市公司股票，在严格控制风险的前提下追求超越业绩比较基准的回报。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将综合分析和持续跟踪日本市场情况，企业基本面、竞争优势等多方面因素，精选优秀的日本企业进行配置以构建股票投资组合。同时，本基金将结合股票、债券等各类资产风险收益特征，确定合适的资产配置比例。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>个股选择方面，本基金通过对上市公司的财务状况、业绩持续性、公司治理三个方面的分析对公司投资价值进行评估，主要投资于财务状况良好，业绩增长具有可持续性，公司治理结构合理的公司。根据上述精选出的个股，结合各项定量和定性指标挑选出最具上涨潜力的标的自下而上构建投资组合。</p> <p>3、其他投资策略：包括债券投资策略、中小企业私募债投资策略、证券公司短期公司债投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生品投资策略。</p>
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准： $90\% \times$ 东京证券交易所股价总指数收益率 + $10\% \times$ 税后银行活期存款收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金产品，预期风险和收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

### 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		上投摩根基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	邹树波	许俊
	联系电话	021-38794888	010-66594319
	电子邮箱	services@cifm.com	fcid@bankofchina.com

客户服务电话	400-889-4888	95566
传真	021-20628400	010-66594942
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区富城路99号震旦国际大楼25楼	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区富城路99号震旦国际大楼25楼	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码	200120	100818
法定代表人	陈兵	刘连舸

## 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	JPMORGAN ASSET MANAGEMENT (ASIA PACIFIC) LIMITED	Bank of China (Hong Kong) Limited
	中文	摩根资产管理（亚太）有限公司	中国银行(香港)有限公司
注册地址		香港中环干诺道中 8 号遮打大厦 21 楼	香港中环花园道 1 号中银大厦
办公地址		香港中环干诺道中 8 号遮打大厦 21 楼	香港中环花园道 1 号中银大厦
邮政编码		-	-

## 2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.cifm.com">http://www.cifm.com</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	上投摩根基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号震旦国际大楼 25 楼

## 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 日至 2021 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	16,271,556.90
本期利润	5,944,392.18
加权平均基金份额本期利润	0.0619

本期加权平均净值利润率	4.65%
本期基金份额净值增长率	5.29%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2021年6月30日)</b>
期末可供分配利润	35,181,310.84
期末可供分配基金份额利润	0.3573
期末基金资产净值	133,651,150.52
期末基金份额净值	1.3573
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2021年6月30日)</b>
基金份额累计净值增长率	35.73%

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，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。

2.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（例如，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

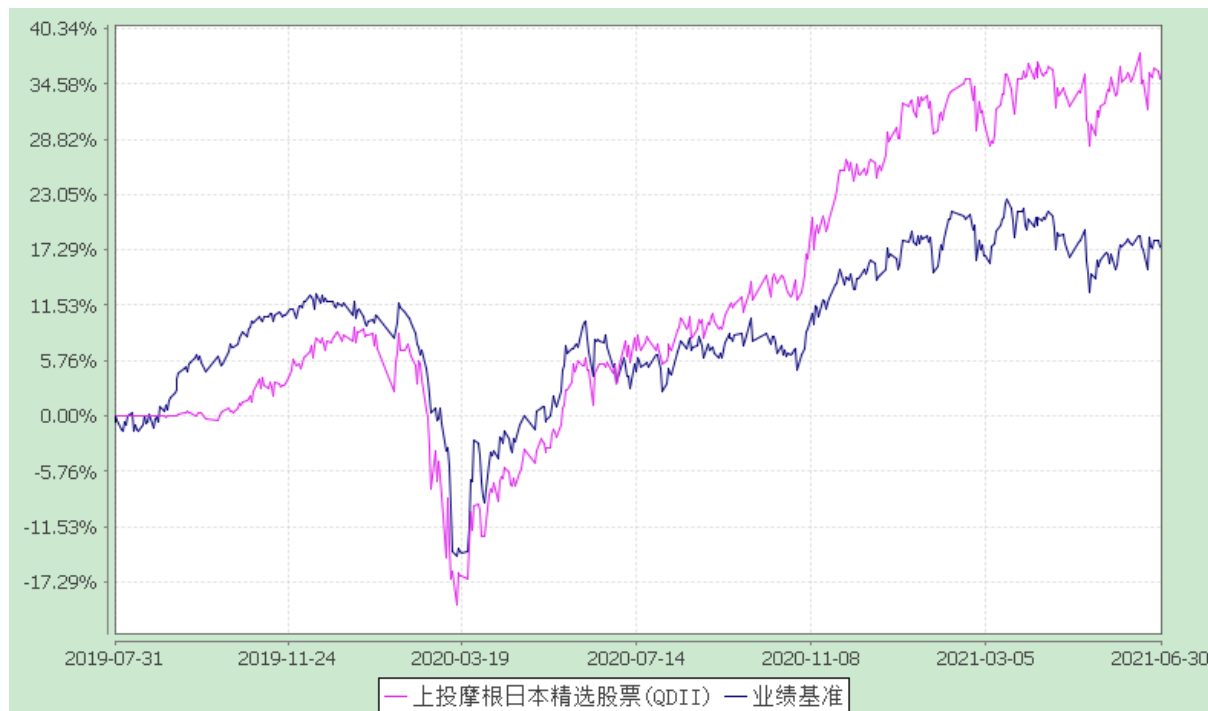
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.78%	1.13%	1.84%	0.90%	-0.06%	0.23%
过去三个月	0.32%	1.12%	-1.98%	0.94%	2.30%	0.18%
过去六个月	5.29%	1.07%	0.57%	0.94%	4.72%	0.13%
过去一年	28.94%	1.06%	11.79%	0.91%	17.15%	0.15%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	35.73%	1.31%	17.47%	1.06%	18.26%	0.25%

### 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

上投摩根日本精选股票型证券投资基金（QDII）  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 (2019年7月31日至2021年6月30日)



注：本基金合同生效日为2019年7月31日，图示的时间段为合同生效日至本报告期末。

本基金建仓期为本基金合同生效日起6个月，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

## 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

上投摩根基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会批准，于2004年5月12日正式成立。公司由上海国际信托投资有限公司（2007年10月8日更名为“上海国际信托有限公司”）与摩根资产管理（英国）有限公司合资设立，注册资本为2.5亿元人民币，注册地上海。截至2021年6月底，公司旗下运作的基金共有七十六只，均为开放式基金，分别是：上投摩根中国优势证券投资基金、上投摩根货币市场基金、上投摩根阿尔法混合型证券投资基金、上投摩根双息平衡混合型证券投资基金、上投摩根成长先锋混合型证券投资基金、上投摩根内需动力混合型证券投资基金、上投摩根亚太优势混合型证券投资基金、上投摩根双核平衡混合型证券投资基金、上投摩根中小盘混合型证券投资基金、上投摩根纯债债券型证券投资基金、上投摩根行业轮动混合型证券投资基金、上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金、上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金、上投摩根新兴动力混合型证券投资基金、上投摩根强化回报债券型证券投资基金、上投摩根健康品质生活混合型证券



投资基金、上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金、上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金、上投摩根核心优选混合型证券投资基金、上投摩根智选 30 混合型证券投资基金、上投摩根成长动力混合型证券投资基金、上投摩根红利回报混合型证券投资基金、上投摩根转型动力灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根双债增利债券型证券投资基金、上投摩根核心成长股票型证券投资基金、上投摩根民生需求股票型证券投资基金、上投摩根纯债丰利债券型证券投资基金、上投摩根天添盈货币市场基金、上投摩根天添宝货币市场基金、上投摩根稳进回报混合型证券投资基金、上投摩根安全战略股票型证券投资基金、上投摩根卓越制造股票型证券投资基金、上投摩根整合驱动灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根动态多因子策略灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根智慧互联股票型证券投资基金、上投摩根科技前沿灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根新兴服务股票型证券投资基金、上投摩根医疗健康股票型证券投资基金、上投摩根文体休闲灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根中国生物医药混合型证券投资基金（QDII）、上投摩根策略精选灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根安鑫回报混合型证券投资基金、上投摩根中国世纪灵活配置混合型证券投资基金（QDII）、上投摩根全球多元配置证券投资基金（QDII）、上投摩根安丰回报混合型证券投资基金、上投摩根安通回报混合型证券投资基金、上投摩根优选多因子股票型证券投资基金、上投摩根丰瑞债券型证券投资基金、上投摩根标普港股通低波红利指数型证券投资基金、上投摩根量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根安隆回报混合型证券投资基金、上投摩根创新商业模式灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根富时发达市场 REITs 指数型证券投资基金（QDII）、上投摩根香港精选港股通混合型证券投资基金、上投摩根尚睿混合型基金中基金（FOF）、上投摩根安裕回报混合型证券投资基金、上投摩根欧洲动力策略股票型证券投资基金（QDII）、上投摩根核心精选股票型证券投资基金、上投摩根动力精选混合型证券投资基金、上投摩根领先优选混合型证券投资基金、上投摩根日本精选股票型证券投资基金（QDII）、上投摩根锦程均衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、上投摩根瑞益纯债债券型证券投资基金、上投摩根慧选成长股票型证券投资基金、上投摩根瑞泰 38 个月定期开放债券型证券投资基金、上投摩根锦程稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、上投摩根锦程积极成长养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、上投摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、上投摩根研究驱动股票型证券投资基金、上投摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上投摩根瑞盛 87 个月定期开放债券型证券投资基金、上投摩根慧见两年持有期混合型证券投资基金、上投摩根远见两年持有期混合型证券投资基金、上投摩根安享回报一年持有期债券型证券投资基金、上投摩根优势成长混合型证券投资基金、上投摩根行业睿选股票型证券投资基金。

## 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
张军	本基金基金经理、投资董事	2019-07-31	-	17 年（金融领域从业经验 28 年）	基金经理张军先生，毕业于上海复旦大学。曾担任上海国际信托有限公司国际业务部经理，交易部经理。2004 年 6 月加入上投摩根基金管理有限公司，先后担任交易部总监、投资经理、基金经理、投资组合管理部总监、投资绩效评估总监、国际投资部总监、组合基金投资部总监，现担任投资董事兼高级基金经理。自 2008 年 3 月起担任上投摩根亚太优势混合型证券投资基金基金经理，自 2012 年 3 月起同时担任上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金基金经理，自 2016 年 12 月起同时担任上投摩根全球多元配置证券投资基金基金经理，自 2018 年 10 月起同时担任上投摩根欧洲动力策略股票型证券投资基金（QDII）基金经理，自 2019 年 7 月起同时担任上投摩根日本精选股票型证券投资基金（QDII）基金经理，自 2021 年 1 月起同时担任上投摩根富时发达市场 REITs 指数型证券投资基金（QDII）基金经理，自 2021 年 6 月起同时担任上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金及上投摩根标普港股通低波红利指数型证券投资基金基金经理。

注：1. 任职日期和离任日期均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2. 张军先生为本基金首任基金经理，其任职日期为本基金基金合同生效之日；
3. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
水泽祥一	摩根资产管理(亚太)董事总经理，日本股票专家，新兴市场和亚太地区（EMAP）股票团队中日本股票团队的负责人	28 年	水泽祥一，董事总经理，是日本股票专家，也是新兴市场和亚太地区（EMAP）股票团队中日本股票团队的负责人。他常驻日本，负责管理在香港和东京的日本股票投资组合管理团队。水泽祥一于 1997 年加入公司，担任负责日本养老金基金的市场经理。他于 2000 年调入日本投资组合团队，并于 2010 年担任现职。在加入公司之前，水泽祥一在芬兰邮政银行（Postipankki）担任了四年的东京资本市场代表。他于 1989 年在三菱汽车公司开始其职业生涯。水泽祥一获得了早稻田大学（Waseda University）政治科学和经济学学士学位，以及西蒙弗雷泽大学（Simon Fraser University）的工商管理硕士学位。
Julian Wong	摩根资产管理(亚太)副总裁，新兴市场和亚太地区（EMAP）股票团队中亚太股票的产品分析师	11 年	Julian Wong，副总裁，是新兴市场和亚太地区（EMAP）股票团队中亚太股票的产品分析师。他常驻香港，于 2014 年加入公司，担任 EMAP 股票团队的初级投资专家。在此之前，Julian 是德勤（Deloitte）的管理顾问，并曾在施罗德投资管理公司（Schroder Investment Management）工作。Julian 拥有香港大学信息系统和金融专业的工商管理学士学位。他还是特许金融分析师。

#### 4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益。本基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《上投摩根日本精选股票型证券投资基金（QDII）基金合同》的规定。除以下情况外，基金经理对个股和投资组合的比例遵循了投资决策委员会的授权限制，基金投资比例符合基金合同和法律法规的要求：本基金曾出现个别由于市场原因引起的投资组合的投资指标被动偏离相关比例要求的情形，但已在规定时间内调整完毕。

## 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.4.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司继续贯彻落实《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规和公司内部公平交易流程的各项要求，严格规范境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等活动，通过系统和人工相结合的方式进行交易执行和监控分析，以确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的环节均得到公平对待。

对于交易所市场投资活动，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在买卖同一证券时，按照时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量；对于银行间市场投资活动，本公司通过对手库控制和交易室询价机制，严格防范对手风险并检查价格公允性；对于申购投资行为，本公司遵循价格优先、比例分配的原则，根据事前独立申报的价格和数量对交易结果进行公平分配。

报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异比较、对同向交易和反向交易的交易时机和交易价差监控分析，未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

### 4.4.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，通过对交易价格、交易时间、交易方向等的抽样分析，未发现存在异常交易行为。

所有投资组合参与的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% 的情形：无。

## 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

日本股市在 2021 年初跟随外部市场，主要是美股波动。第一季度内日股的表现中出现价值股较快反弹的现象。这与日本的新增新冠确诊人数下降有关。一旦疫情在日本得到控制，经济重启后，对前期受压制较重的价值股的利好大于疫情期间表现一直较好的“居家受益股”。但是价值股表现的持续性仍值得继续观察，现在很难下结论认定风格转换。毕竟银行板块还没有表现出带领价值股的领军地位。

日本股市在二季度上半段时期的表现差强人意，相比其他股票市场表现较弱，但从 5 月中旬开始发力上扬，逐渐追赶上来。其背后的推动因素包括：1) 美债收益率再次上升，日元兑美元贬值；2) 新冠疫情确诊人数下降，疫苗接种率提升；3) 投资者对新财年的企业盈利前景持乐观预期。

股票价格反映了对盈利的乐观预期，随着政府取消行动限制政策后，社会恢复到正常活动状态，

将进一步推动更乐观的盈利预测。

本基金维持采取汇率避险策略，基本上规避了日元贬值的负面影响。

#### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期上投摩根日本精选股票(QDII)份额净值增长率为:5.29%，同期业绩比较基准收益率为:0.57%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，在新冠肺炎大流行期间，由于人类生活和社会的数字化速度加快，导致提高生产力的需求增长，数字化转型战略的重要性迅速增长。数字化转型战略的进展程度可能直接导致生产力和增长潜力的差距。

在数字化转型战略上的进步对日本企业在全全球竞争中的生存至关重要。日本企业一直普遍不愿意通过数字化转换来转变企业文化。然而，自新冠肺炎以来，企业在加大软件投资的同时，政府也在积极推广 DX（数字革新）。有能力通过数字化转换改变企业文化的企业与没有能力通过 DX 改变企业文化的企业之间的差距正在扩大，但尽管面临许多其他挑战，日本企业普遍开始更加积极地追求数字化转换。我们预计这将有助于日本经济的生产率增长。以 IT 行业为例：数字化转换需要转换现有的业务模式和业务流程，是离不开对管理策略的审查。因此，IT 服务公司近年来加强了咨询业务。

进入夏季后，疫苗接种的普及对运输、地产等行业的拉动效果相对更明显，因为这些行业原先的低基数效应。相比之下，半导体、设备和通讯行业的受益程度相对较小。这种对比反差与消费者的行为改变有关。

整体而言，日本经济有望在 2021 和 2022 年间表现相对稳健，尤其在生产领域。随着疫苗的全面推广接种，公共医疗卫生限制不再制约经济活力。经济恢复到疫情前的增速后，经济结构将有所改变，如在消费习惯、工作模式、电子化程度等方面都将改变未来的劳动力市场。后疫情时代的发展进程中，会出现行业整合的趋势，采购渠道多样化趋势、更多地使用信息科技的趋势以及远程办公的趋势。因此，相关企业盈利增速也有望达到较快水平。而质地优良、在变化趋势中受益的行业和公司基金所重点关注的。此外，基金还关注公司治理水平不断改善的公司，日本的这类公司的改善空间要高于美、欧企业。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司的基金估值和会计核算由基金会计部负责，根据相关的法律法规规定、基金合同的约定，

制定了内部控制措施，对基金估值和会计核算的各个环节和整个流程进行风险控制，目的是保证基金估值和会计核算的准确性。基金会计部人员均具备基金从业资格和相关工作经历。本公司成立了估值委员会，并制订有关议事规则。估值委员会成员包括公司管理层、督察长、基金会计、风险管理等方面的负责人以及相关基金经理，所有相关成员均具有丰富的证券基金行业从业经验。公司估值委员会对估值事项发表意见，评估基金估值的公允性和合理性。基金经理是估值委员会的重要成员，参加估值委员会会议，参与估值程序和估值技术的讨论。估值委员会各方不存在任何重大利益冲突。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内，本基金未实施利润分配。

#### 4.9 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

无。

## 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在上投摩根日本精选股票型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，如实描述违法违规或损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组

合报告等数据真实、准确和完整。

## 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：上投摩根日本精选股票型证券投资基金（QDII）

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	22,371,179.65	15,319,831.98
结算备付金		-	-
存出保证金		52,022.87	1,037,994.29
交易性金融资产	6.4.7.2	120,404,662.52	104,153,609.44
其中：股票投资		120,404,662.52	104,153,609.44
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	523,661.60	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	1,179.18	1,378.73
应收股利		65,338.02	66,089.26
应收申购款		908,469.91	2,211,885.23
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>144,326,513.75</b>	<b>122,790,788.93</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债	6.4.7.3	-	-
衍生金融负债		-	680,753.60
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		3,096,464.25	-
应付赎回款		7,194,126.60	11,114,492.25
应付管理人报酬		196,804.85	165,032.16
应付托管费		27,334.00	22,921.10
应付销售服务费		-	-

应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		74,700.03	6,977.38
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	85,933.50	159,681.52
<b>负债合计</b>		<b>10,675,363.23</b>	<b>12,149,858.01</b>
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	98,469,839.68	85,829,859.67
未分配利润	6.4.7.10	35,181,310.84	24,811,071.25
<b>所有者权益合计</b>		<b>133,651,150.52</b>	<b>110,640,930.92</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>144,326,513.75</b>	<b>122,790,788.93</b>

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日,基金份额净值 1.3573 元,基金份额总额 98,469,839.68 份。

## 6.2 利润表

会计主体：上投摩根日本精选股票型证券投资基金（QDII）

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>7,499,868.10</b>	<b>2,048,892.52</b>
1.利息收入		23,101.87	36,157.51
其中：存款利息收入	6.4.7.11	23,101.87	36,157.51
债券利息收入		-	-
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）		17,744,722.41	453,623.98
其中：股票投资收益	6.4.7.12	7,567,444.66	1,210,453.75
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	9,331,966.01	-1,495,500.00
股利收益	6.4.7.16	845,311.74	738,670.23
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-10,327,164.72	1,102,114.94
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-441,725.46	35,095.31
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	500,934.00	421,900.78
<b>减：二、费用</b>		<b>1,555,475.92</b>	<b>1,584,916.39</b>



1. 管理人报酬		1,141,474.40	1,011,199.82
2. 托管费		158,538.06	140,444.45
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	118,753.79	154,637.41
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		50,677.63	196,500.00
7. 其他费用	6.4.7.20	86,032.04	82,134.71
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>5,944,392.18</b>	<b>463,976.13</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>5,944,392.18</b>	<b>463,976.13</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上投摩根日本精选股票型证券投资基金（QDII）

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）	85,829,859.67	24,811,071.25	110,640,930.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,944,392.18	5,944,392.18
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）	12,639,980.01	4,425,847.41	17,065,827.42
其中：1.基金申购款	110,591,154.77	36,599,754.32	147,190,909.09
2.基金赎回款	-97,951,174.76	-32,173,906.91	-130,125,081.67
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）	98,469,839.68	35,181,310.84	133,651,150.52
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）	131,460,899.73	11,068,332.83	142,529,232.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	463,976.13	463,976.13
三、本期基金份额交易产生	-15,675,025.05	-5,436,118.88	-21,111,143.93

的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	114,376,423.31	-3,091,571.70	111,284,851.61
2.基金赎回款	-130,051,448.36	-2,344,547.18	-132,395,995.54
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）	115,785,874.68	6,096,190.08	121,882,064.76

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：

基金管理人负责人：王大智，主管会计工作负责人：杨怡，会计机构负责人：张璐

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

上投摩根日本精选股票型证券投资基金(QDII)(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[2019]280 号《关于准予上投摩根日本精选股票型证券投资基金(QDII)注册的批复》核准，由上投摩根基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《上投摩根日本精选股票型证券投资基金(QDII)合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 233,744,168.33 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(2019)第 0418 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《上投摩根日本精选股票型证券投资基金(QDII)基金合同》于 2019 年 7 月 31 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 233,846,547.33 份基金份额，其中认购资金利息折合 102,379.00 份基金份额。本基金的基金管理人为上投摩根基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司，境外资产托管人为中国银行(香港)有限公司，境外投资顾问为摩根资产管理(亚太)有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上投摩根日本精选股票型证券投资基金(QDII)基金合同》的有关规定，本基金境外主要投资于在日本证券市场以及在其他证券市场交易的日本公司股票，此外，本基金还可投资于银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证；

已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品。本基金境内主要投资于具有良好流动性的金融工具，具体包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、证券公司短期公司债、地方政府债、公开发行的次级债、短期融资券、中期票据、中小企业私募债、可分离交易可转债的纯债部分、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款等，及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金投资组合中股票资产占基金资产的 80%-95%，其中投资于日本上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的 80%，投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为： $90\% \times$  东京证券交易所股价总指数收益率 +  $10\% \times$  税后银行活期存款收益率

本财务报表由本基金的基金管理人上投摩根基金管理有限公司于 2021 年 8 月 30 日批准报出。

#### 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》、《上投摩根日本精选股票型证券投资基金(QDII) 基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报告相一致。

## 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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

### 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[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》及其他相关境内外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，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区

税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

(4) 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	22,371,179.65
定期存款	-
其他存款	-
合计	22,371,179.65

注：于2021年6月30日，银行存款中包含的外币余额为：日元104,466,230.00元(折合人民币6,103,752.88元)。

##### 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	115,780,580.12	120,404,662.52	4,624,082.40
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	115,780,580.12	120,404,662.52	4,624,082.40

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-

货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	523,661.60	-	-
合计	-	523,661.60	-	-

注：其他衍生工具为外汇远期。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

#### 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	1,179.18
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	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	1,179.18

#### 6.4.7.6 其他资产

无余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

无余额。

#### 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	13,533.50
应付证券出借违约金	-
预提费用	72,400.00

合计	85,933.50
----	-----------

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	85,829,859.67	85,829,859.67
本期申购	110,591,154.77	110,591,154.77
本期赎回（以“-”号填列）	-97,951,174.76	-97,951,174.76
本期末	98,469,839.68	98,469,839.68

注：申购含转换入份额。

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	17,164,583.02	7,646,488.23	24,811,071.25
本期利润	16,271,556.90	-10,327,164.72	5,944,392.18
本期基金份额交易产生的变动数	3,536,205.16	889,642.25	4,425,847.41
其中：基金申购款	32,801,543.14	3,798,211.18	36,599,754.32
基金赎回款	-29,265,337.98	-2,908,568.93	-32,173,906.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	36,972,345.08	-1,791,034.24	35,181,310.84

## 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
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	-
其他	-
合计	23,101.87

## 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日

卖出股票成交总额	71,356,434.87
减：卖出股票成本总额	63,788,990.21
买卖股票差价收入	7,567,444.66

#### 6.4.7.13 基金投资收益

无。

#### 6.4.7.14 债券投资收益

无。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

##### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
外汇远期投资收益	9,331,966.01

#### 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	845,311.74
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	845,311.74

#### 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	-11,531,579.92
——股票投资	-11,531,579.92
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-



——基金投资	-
——其他	-
2.衍生工具	1,204,415.20
——权证投资	-
——远期投资	1,204,415.20
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	-10,327,164.72

## 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	500,934.00
印花税返还	-
其他	-
转换费收入	-
合计	500,934.00

## 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	118,753.79
银行间市场交易费用	-
合计	118,753.79

## 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	32,728.42
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行费用	13,632.04
合计	86,032.04

## 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，本基金并无须作披露的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并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
上投摩根基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构
中国银行(香港)有限公司(“中银香港”)	境外资产托管人

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

无

#### 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	1,141,474.40	1,011,199.82
其中：支付销售机构的客户维护费	309,786.75	297,102.68

注：支付基金管理人上投摩根基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.8%的费率计提，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 X 1.8% / 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	158,538.06	140,444.45
----------------	------------	------------

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

#### 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

无

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	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
基金合同生效日（2019年7月31日）持有的基金份额	20,002,600.00	20,002,600.00
期初持有的基金份额	-	20,002,600.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	5,000,650.00
期末持有的基金份额	-	15,001,950.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	12.96%

##### 6.4.10.4.2 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

无。

#### 6.4.10.5 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		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	2020年1月1日至2020年6月30日	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
中国银行	16,267,427.70	23,101.87	14,924,111.19	36,157.51
中银香港	6,103,751.95	-	4,536,319.37	-

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国银行和境外资产托管人中银香港保管，按适用利率计息。

#### 6.4.10.6 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.6.1 其他关联交易事项的说明

无

#### 6.4.11 利润分配情况

本报告期本基金未实施利润分配。

#### 6.4.12 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 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

无。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 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

本基金属于股票型基金产品，预期风险和收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于高风险收益水平的投资品种。本基金主要投资于日本上市公司股票等。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“风险和收益相匹配”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，董事会主要负责基金管理人风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。董事会下设督察长，负责对基金管理人各业务环节合法合规运作的监督检查和基金管理人内部稽核监控工作，并可向基金管理人董事会和中国证监会直接报告。经营管理层下设风险评估联席会议，进行各部门管理程序的风险确认，并对各类风险予以事先充分的评估和防范，并进行及时控制和采取应急措施；在业务操作层面监察稽核部负责基金管理人

各部门的风险控制检查，定期或不定期对业务部门内部控制制度执行情况和遵循国家法律，法规及其他规定的执行情况进行检查，并适时提出修改建议；风险管理部负责投资限制指标体系的设定和更新，对于违反指标体系的投资进行监查和风险评估，并负责协助各部门修正、修订内部控制作业制度，并对各部门的日常作业，依据风险管理的考评，定期或不定期对各项风险指标进行管控，并提出内控建议。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

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。而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，及时可靠地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充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人 中国银行，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通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在场外交易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，通过对投资品种的信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有债券。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风

险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### **6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析**

无。

#### **6.4.13.3.2 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%，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%(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%。

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。

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等。

##### **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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

#### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日				
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	日元 (其他主要 币种) 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产					
银行存款	-	-	6,103,752.88	-	6,103,752.88
交易性金融资产	-	-	120,404,662.52	-	120,404,662.52
应收股利	-	-	65,338.02	-	65,338.02
资产合计	-	-	126,573,753.42	-	126,573,753.42
以外币计价的负债					
应付证券清算款	-	-	3,096,464.25	-	3,096,464.25
负债合计	-	-	3,096,464.25	-	3,096,464.25
资产负债表 外汇风险敞 口净额	-	-	123,477,289.17	-	123,477,289.17
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日				
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	日元 (其他主要 币种)	其他币种 折合人民币	合计



			折合人民币		
以外币计价的资产					
银行存款	-	-	3,395,600.25	-	3,395,600.25
交易性金融资产	-	-	104,153,609.44	-	104,153,609.44
应收股利	-	-	66,089.26	-	66,089.26
<b>资产合计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>107,615,298.95</b>	<b>-</b>	<b>107,615,298.95</b>
以外币计价的负债					
负债合计	-	-	-	-	-
<b>资产负债表外汇风险敞口净额</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>107,615,298.95</b>	<b>-</b>	<b>107,615,298.95</b>

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

分析	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：人民币万元）	
		本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
		1.所有外币相对人民币升值5%	增加约617
2.所有外币相对人民币贬值5%	减少约617	减少约538	

#### 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。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和衍生工具，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，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券

的定性分析及定量分析，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。本基金投资于股票投资的比例为基金资产的 80%-95%，其中投资于日本上市公司股票的比例不低于非现金基金净资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货和股票期权等合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日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，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 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	120,404,662.52	90.09	104,153,609.44	94.14
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	120,404,662.52	90.09	104,153,609.44	94.14

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	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：人民币万元）	
		本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日

	业绩比较基准上升 5%	增加约 133	增加约 631
	业绩比较基准下降 5%	减少约 133	减少约 631

#### 6.4.14 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	120,404,662.52	83.43
	其中：普通股	120,404,662.52	83.43
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	523,661.60	0.36
	其中：远期	523,661.60	0.36
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	22,371,179.65	15.50
8	其他各项资产	1,027,009.98	0.71
9	合计	144,326,513.75	100.00

### 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
日本	120,404,662.52	90.09

合计	120,404,662.52	90.09
----	----------------	-------

## 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
电子设备、仪器和元件	13,209,571.67	9.88
化学制品	11,942,811.73	8.94
家庭耐用消费品	9,169,871.45	6.86
汽车	7,663,731.99	5.73
保险	7,415,319.51	5.55
医疗保健设备与用品	5,460,610.77	4.09
专业服务	5,172,630.84	3.87
综合金融服务	4,662,379.12	3.49
汽车零配件	4,479,300.82	3.35
机械制造	4,298,927.74	3.22
半导体产品与设备	4,258,203.42	3.19
制药	3,868,006.63	2.89
贸易公司与经销商	3,440,240.64	2.57
金属与采矿	3,285,114.30	2.46
软件	3,220,732.48	2.41
电气设备	3,084,268.05	2.31
公路与铁路	2,846,074.62	2.13
媒体	2,121,228.54	1.59
信息技术服务	2,015,140.82	1.51
房地产管理和开发	1,984,425.22	1.48
无线电信业务	1,862,538.57	1.39
休闲设备与用品	1,846,488.40	1.38
个人用品	1,829,964.96	1.37
互动媒体与服务	1,590,597.13	1.19
娱乐	1,482,961.07	1.11
生物科技	1,333,940.45	1.00
互联网与售货目录零售	1,208,933.75	0.90
专营零售	1,033,825.03	0.77
多元化零售	988,181.08	0.74
建筑产品	846,212.72	0.63
居家用品	749,806.52	0.56
股权房地产投资信托（REITs）	702,246.13	0.53
综合消费者服务	521,434.84	0.39
燃气公用事业	408,154.64	0.31
资本市场	400,786.87	0.30
合计	120,404,662.52	90.09

注：行业分类标准：MSCI

## 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证 券市场	所属国家 (地区)	数量（股）	公允价值	占基金资 产净值比 例（%）
1	Sony Corp	索尼	6758	东京证 券交易 所	日本	9,000.00	5,687,089.38	4.26
2	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	信越化学 工业	4063	东京证 券交易 所	日本	4,700.00	5,102,283.53	3.82
3	Toyota Motor Corp	丰田汽车	7203	东京证 券交易 所	日本	8,800.00	4,992,555.74	3.74
4	Keyence Corp	基恩士	6861	东京证 券交易 所	日本	1,400.00	4,586,481.14	3.43
5	Hoya Corp	豪雅公司	7741	东京证 券交易 所	日本	5,000.00	4,303,222.20	3.22
6	Recruit Holdings Co Ltd	瑞可利集 团	6098	东京证 券交易 所	日本	12,600.00	4,026,974.62	3.01
7	Murata Manufacturing Co Ltd	村田	6981	东京证 券交易 所	日本	7,900.00	3,915,131.74	2.93
8	Sompo Japan Nipponkoa Holdings Inc	Sompo 公 司	8630	东京证 券交易 所	日本	14,500.00	3,478,627.84	2.60
9	Itochu Corp	伊藤忠商 事	8001	东京证 券交易 所	日本	18,400.00	3,440,240.64	2.57
10	Orix Corp	欧力士株 式会社	8591	东京证 券交易 所	日本	30,000.00	3,285,698.58	2.46
11	Sumitomo Metal	住友金属 矿山株式	5713	东京证 券交易 所	日本	13,000.00	3,285,114.30	2.46

	Mining Co Ltd	会社		所				
12	Nidec Corp	日本电产株式会社	6594	东京证券交易所	日本	4,100.00	3,084,268.05	2.31
13	Bridgestone Corp	普利司通公司	5108	东京证券交易所	日本	9,200.00	2,717,252.57	2.03
14	T&D Holdings Inc	T&D 控股	8795	东京证券交易所	日本	27,000.00	2,265,370.42	1.69
15	Mitsubishi Chemical Holdings Corp	三菱化学控股	4188	东京证券交易所	日本	40,600.00	2,214,427.04	1.66
16	Taiyo Nippon Sanso Corp	大阳日酸株式会社	4091	东京证券交易所	日本	15,700.00	2,088,736.73	1.56
17	Honda Motor Co Ltd	日本本田汽车公司	7267	东京证券交易所	日本	9,700.00	2,011,968.18	1.51
18	Mitsui Fudosan Co Ltd	三井不动产株式会社	8801	东京证券交易所	日本	13,200.00	1,984,425.22	1.48
19	SMC Corp	SMC 株式会社	6273	东京证券交易所	日本	500.00	1,917,899.10	1.44
20	Casio Computer Co Ltd	卡西欧	6952	东京证券交易所	日本	17,300.00	1,877,063.77	1.40
21	SoftBank Group Corp	软银	9984	东京证券交易所	日本	4,100.00	1,862,538.57	1.39
22	Hitachi Ltd	日立	6501	东京证券交易所	日本	5,000.00	1,858,302.54	1.39
23	Bandai Namco Holdings Inc	-	7832	东京证券交易所	日本	4,100.00	1,846,488.40	1.38
24	Fancl Corp	-	4921	东京证券交易所	日本	8,700.00	1,829,964.96	1.37

25	Sumitomo Electric Industries Ltd	住友电气工业株式会社	5802	东京证券交易所	日本	18,400.00	1,762,048.25	1.32
26	Tokio Marine Holdings Inc	东京海上控股	8766	东京证券交易所	日本	5,600.00	1,671,321.25	1.25
27	Kyowa Kirin Co Ltd	-	4151	东京证券交易所	日本	7,100.00	1,634,464.87	1.22
28	Rinnai Corp	-	5947	东京证券交易所	日本	2,600.00	1,605,718.30	1.20
29	Anritsu Corp	-	6754	东京证券交易所	日本	13,100.00	1,585,157.48	1.19
30	Nomura Research Institute Ltd	野村研究所	4307	东京证券交易所	日本	7,300.00	1,567,477.17	1.17
31	Central Japan Railway Co	中央铁道公司	9022	东京证券交易所	日本	1,500.00	1,476,767.70	1.10
32	Kadokawa Corp	-	9468	东京证券交易所	日本	5,300.00	1,396,604.48	1.04
33	Sumco Corp	-	3436	东京证券交易所	日本	8,700.00	1,385,181.81	1.04
34	Mitsubishi UFJ Lease & Finance Co Ltd	-	8593	东京证券交易所	日本	39,600.00	1,376,680.54	1.03
35	West Japan Railway Co Ltd	-	9021	东京证券交易所	日本	3,700.00	1,369,306.92	1.02
36	Misumi Group Inc	-	9962	东京证券交易所	日本	6,100.00	1,340,104.61	1.00
37	Takara Bio Inc	-	4974	东京证券交易所	日本	7,700.00	1,333,940.45	1.00

				所				
38	Rakuten Inc	-	4755	东京证券交易所	日本	16,500.00	1,208,933.75	0.90
39	Disco Corp	-	6146	东京证券交易所	日本	600.00	1,190,178.36	0.89
40	Shionogi & Co Ltd	盐野义制药	4507	东京证券交易所	日本	3,500.00	1,184,247.92	0.89
41	Terumo Corp	-	4543	东京证券交易所	日本	4,400.00	1,157,388.57	0.87
42	Daiichi Sankyo Co Ltd	-	4568	东京证券交易所	日本	7,500.00	1,049,293.84	0.79
43	Miura Co Ltd	-	6005	东京证券交易所	日本	3,700.00	1,040,924.03	0.78
44	Nitori Holdings Co Ltd	-	9843	东京证券交易所	日本	900.00	1,033,825.03	0.77
45	Marui Group Co Ltd	-	8252	东京证券交易所	日本	8,100.00	988,181.08	0.74
46	Atrae Inc	-	6194	东京交易所高增长新兴股票市场	日本	7,200.00	909,092.94	0.68
47	Daikin Industries Ltd	-	6367	东京证券交易所	日本	700.00	846,212.72	0.63
48	Tokyo Electron Ltd	-	8035	东京证券交易所	日本	300.00	842,765.47	0.63
49	Rohm Co Ltd	-	6963	东京证券交易所	日本	1,400.00	840,077.78	0.63
50	Fuso Chemical Co Ltd	-	4368	JASDAQ	日本	3,200.00	766,575.36	0.57
51	Plaid Inc	-	4165	东京证券交易所	日本	4,700.00	760,124.91	0.57



				所				
52	SMS Co Ltd	-	2175	东京证券交易所	日本	3,900.00	757,665.09	0.57
53	Pigeon Corp	-	7956	东京证券交易所	日本	4,100.00	749,806.52	0.56
54	Cyber Agent Inc	-	4751	东京证券交易所	日本	5,200.00	724,624.06	0.54
55	Maruwa Co Ltd (5344)	-	5344	东京证券交易所	日本	1,100.00	719,190.25	0.54
56	Mec Co Ltd	-	4971	东京证券交易所	日本	3,800.00	717,145.27	0.54
57	Nippon Prologis REIT Inc	-	3283	东京证券交易所	日本	34.00	702,246.13	0.53
58	Sansan Inc	-	4443	东京证交所高增长新兴股票市场	日本	1,200.00	687,113.28	0.51
59	Bengo4.Com Inc	-	6027	东京证交所高增长新兴股票市场	日本	1,200.00	681,504.19	0.51
60	Suzuki Motor Corp	-	7269	东京证券交易所	日本	2,400.00	659,208.07	0.49
61	Appier Group Inc	-	4180	东京证券交易所	日本	7,000.00	645,804.68	0.48
62	Square Enix Holdings Co Ltd	-	9684	东京证券交易所	日本	1,900.00	611,682.73	0.46
63	Kaonavi Inc	-	4435	东京证交所高增长新兴股票市场	日本	3,000.00	607,359.06	0.45
64	Kansai	关西涂料	4613	东京证	日本	3,600.00	595,474.80	0.45

	Paint Co Ltd			券交易所				
65	Taiyo Yuden Co Ltd	-	6976	东京证券交易所	日本	1,700.00	545,308.52	0.41
66	Riso Kyoiku Co Ltd	-	4714	东京证券交易所	日本	26,800.00	521,434.84	0.39
67	Capcom Co Ltd	-	9697	东京证券交易所	日本	2,600.00	493,716.60	0.37
68	Nippon Paint Co Ltd	立邦涂料	4612	东京证券交易所	日本	5,200.00	458,169.00	0.34
69	Ascentech KK	-	3565	东京证交所高增长新兴股票市场	日本	5,800.00	447,663.65	0.33
70	Nippon Gas Co Ltd	-	8174	东京证券交易所	日本	3,700.00	408,154.64	0.31
71	Wealthnav i Inc	-	7342	东京证券交易所	日本	1,700.00	400,786.87	0.30
72	Benefit One Inc	-	2412	东京证券交易所	日本	1,900.00	387,991.13	0.29
73	Nintendo Co Ltd	日本任天堂公司	7974	东京证券交易所	日本	100.00	377,561.74	0.28
74	Yappli Inc	-	4168	东京证券交易所	日本	1,500.00	341,365.59	0.26
75	Freee KK	-	4478	东京证券交易所	日本	300.00	178,964.96	0.13

## 7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例
----	----------	------	----------	-------------

				(%)
1	Sony Corp	6758	4,192,559.07	3.79
2	Toyota Motor Corp	7203	3,351,071.77	3.03
3	Bridgestone Corp	5108	2,942,960.68	2.66
4	Recruit Holdings Co Ltd	6098	2,699,373.95	2.44
5	T&D Holdings Inc	8795	2,693,360.14	2.43
6	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	4063	2,673,508.70	2.42
7	Tokio Marine Holdings Inc	8766	2,626,086.22	2.37
8	Orix Corp	8591	2,425,595.50	2.19
9	Mitsui Fudosan Co Ltd	8801	2,324,275.66	2.10
10	Sumitomo Metal Mining Co Ltd	5713	2,321,993.18	2.10
11	Bandai Namco Holdings Inc	7832	2,279,932.67	2.06
12	Honda Motor Co Ltd	7267	2,172,504.56	1.96
13	Mitsubishi Chemical Holdings Corp	4188	2,127,709.22	1.92
14	Sumitomo Electric Industries Ltd	5802	2,112,003.85	1.91
15	Hoya Corp	7741	2,078,097.57	1.88
16	Keyence Corp	6861	1,859,097.80	1.68
17	Itochu Corp	8001	1,856,319.39	1.68
18	Casio Computer Co Ltd	6952	1,832,236.35	1.66
19	Nidec Corp	6594	1,827,286.24	1.65
20	Mitsubishi UFJ Lease & Finance Co Ltd	8593	1,816,708.70	1.64

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“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。

#### 7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Tokio Marine Holdings Inc	8766	4,891,947.51	4.42
2	Sumco Corp	3436	3,380,023.37	3.05
3	Fast Retailing Co Ltd	9983	3,349,001.43	3.03
4	Recruit Holdings Co Ltd	6098	3,009,037.62	2.72
5	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	4063	2,916,220.04	2.64
6	Sony Corp	6758	2,646,661.97	2.39
7	Nintendo Co Ltd	7974	2,268,738.89	2.05
8	Advantest Corp	6857	2,146,892.17	1.94

9	Sumitomo Metal Mining Co Ltd	5713	2,045,648.34	1.85
10	Itochu Corp	8001	1,990,362.63	1.80
11	Keyence Corp	6861	1,951,455.74	1.76
12	Hoya Corp	7741	1,897,525.09	1.72
13	Shift Inc	3697	1,764,951.56	1.60
14	Murata Manufacturing Co Ltd	6981	1,712,813.49	1.55
15	Nitori Holdings Co Ltd	9843	1,677,458.52	1.52
16	Cyber Agent Inc	4751	1,664,967.67	1.50
17	Kao Corp	4452	1,284,301.79	1.16
18	Orix Corp	8591	1,181,469.31	1.07
19	SMC Corp	6273	1,144,903.52	1.03
20	Toyota Motor Corp	7203	1,119,920.18	1.01

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“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。

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	91,573,090.07
卖出收入（成交）总额	71,356,434.87

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“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。

### 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

金额单位：人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	远期	外汇远期	523,661.60	0.39

**7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细**

本基金本报告期末未持有基金。

**7.11 本报告期投资基金情况****7.11.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细**

本基金本报告期末未持有基金。

**7.12 投资组合报告附注**

**7.12.1** 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

**7.12.2** 报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

**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	52,022.87
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	65,338.02
4	应收利息	1,179.18
5	应收申购款	908,469.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,027,009.98

**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。

**7.12.6 投资组合报告附注的其他需要说明的事项**

因四舍五入原因,投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
23,181	4,247.87	3,511,572.97	3.57%	94,958,266.71	96.43%

### 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	10,109.59	0.0103%

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019年7月31日）基金份额总额	233,846,547.33
本报告期期初基金份额总额	85,829,859.67
本报告期基金总申购份额	110,591,154.77
减：本报告期基金总赎回份额	97,951,174.76
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	98,469,839.68

## 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

基金管理人：无。

基金托管人：无。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

#### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

#### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未发生改聘为其审计的会计师事务所的情况。

#### 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

报告期内，管理人、托管人未受稽查或处罚，亦未发现管理人、托管人的高级管理人员受稽查或处罚。

#### 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	
Daiwa Capital Markets Hong Kong Ltd	1	493,513,413.10	100.00%	383,163.33	100.00%	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
Citigroup	1	-	-	-	-	-
Instinet Europe Limited	1	-	-	-	-	-

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

##### 2. 交易单元的选择标准：

- 1) 资本金雄厚,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。
- 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,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时、定期、全面地为本基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务。

##### 3. 交易单元的选择程序：

1) 本基金管理人定期召开会议，组织相关部门依据交易单元的选择标准对交易单元候选券商进行评估，确定选用交易单元的券商。

2) 本基金管理人与券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

4. 本报告期本基金无新增席位，无注销席位。

### 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		回购交易		权证交易		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
Daiwa Capital Markets Hong Kong Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
Citigroup	-	-	-	-	-	-	-	-
Instinet Europe Limited	-	-	-	-	-	-	-	-

### 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	上投摩根日本精选股票型证券投资基金（QDII）暂停申购、赎回、定期定额投资及转换转入业务的公告	基金管理人公司网站及本基金选定的信息披露报纸	2021-01-09
2	上投摩根日本精选股票型证券投资基金（QDII）暂停申购、赎回、定期定额投资及转换转入业务的公告	同上	2021-02-19
3	关于降低上投摩根旗下部分基金单笔最低交	同上	2021-03-10



	易限额的公告		
4	上投摩根日本精选股票型证券投资基金（QDII）暂停申购、赎回、定期定额投资及转换转入业务的公告	同上	2021-04-27
5	上投摩根基金管理有限公司关于修改公司旗下部分基金基金合同及托管协议的公告	同上	2021-05-14

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予上投摩根日本精选股票型证券投资（QDII）基金募集注册的文件
- 2.《上投摩根日本精选股票型证券投资基金（QDII）基金合同》
- 3.《上投摩根日本精选股票型证券投资基金（QDII）托管协议》
- 4.法律意见书
- 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.《上投摩根基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- 8.中国证监会要求的其他文件

### 11.2 存放地点

基金管理人或基金托管人住所。

### 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。

上投摩根基金管理有限公司

二〇二一年八月三十一日