

上投摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金
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：平安银行股份有限公司

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。

基金托管人平安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

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	15
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.....	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
6 半年度财务会计报告（未经审计）	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.....	19
7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	42
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.....	43
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.....	43
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.....	55
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	58
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.....	59
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.....	59
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.....	59
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.....	59
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	59
7.12 本报告期投资基金情况.....	59

7.13 投资组合报告附注.....	60
8 基金份额持有人信息.....	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	61
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	61
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	62
8.4 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的情况.....	62
9 开放式基金份额变动.....	62
10 重大事件揭示.....	62
10.1 基金份额持有人大会决议.....	62
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.....	62
基金托管人：2021 年 1 月 26 日，根据工作安排，陈正涛先生不再担任平安银行股份有限公司资产托管事业部总裁。2021 年 2 月 26 日，平安银行股份有限公司任命黄伟先生担任资产托管事业部副总裁（主持工作）。.....	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	62
10.4 基金投资策略的改变.....	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	63
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.....	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	63
10.8 其他重大事件.....	64
11 影响投资者决策的其他重要信息.....	64
12 备查文件目录.....	64
12.1 备查文件目录.....	64
12.2 存放地点.....	65
12.3 查阅方式.....	65

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	上投摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	上投摩根 MSCI 中国 A 股 ETF
基金主代码	515770
交易代码	515770
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 5 月 13 日
基金管理人	上投摩根基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	153,727,323.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020 年 6 月 19 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	<p>本基金采用完全复制法，按照标的指数成份股构成及其权重构建股票资产组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化对股票组合进行动态调整。但因特殊情况导致基金无法有效跟踪标的指数时，本基金将运用其他方法建立实际组合，力求实现基金相对业绩比较基准的跟踪误差最小化。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>为了实现跟踪误差最小化，本基金投资于标的指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产 80%。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>(1) 投资组合构建</p> <p>本基金采用完全复制法构建股票资产组合，对于因法规限制、流动性限制而无法交易的成份股，将采用与被限制股预期收益率相近的股票或股票组合进行相应的替代。本基金根据成份股构成及其权重的变动进行动态调整。</p> <p>(2) 投资组合调整</p> <p>1) 定期调整</p> <p>本基金所构建的投资组合将定期根据标的指数成份股的调整进行相应的跟踪调整。若成份股的集中调整短期内会对跟踪误差产生较大影响，将采用逐步调整的方式。</p> <p>2) 不定期调整</p> <p>①根据指数编制规则，当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时，本基金将根据标的指数权重比例的变化，进行相应调整。</p>

	<p>②当标的指数成份股因停牌、流动性不足等因素导致基金无法按照指数权重进行配置，基金管理人将选择相关股票进行适当的替代。</p> <p>③本基金将根据申购和赎回情况对股票投资组合进行调整，保证基金正常运行。</p> <p>本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。</p> <p>3、金融衍生品投资策略 本基金将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的衍生品合约，力争利用金融衍生品提高投资效率，降低交易成本和跟踪误差。</p> <p>4、债券投资策略 在保证基金资产流动性的基础上，使基金资产得到更加合理有效的利用，从而提高投资组合收益。</p> <p>5、资产支持证券投资策略：综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量等因素，在严格控制风险的情况下，确定资产合理配置比例。</p> <p>6、融资及转融通证券出借策略 本基金参与融资业务，将综合考虑融资成本、保证金比例、冲抵保证金证券折算率、信用资质等条件，选择合适的交易对手方。同时，在保障投资组合流动性以及控制融资杠杆风险的前提下，确定融资比例。转融通证券出借策略按照分散化投资原则，分批、分期进行交易。</p> <p>7、存托凭证投资策略 本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p>
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数，即 MSCI 中国 A 股人民币指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

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	平安银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	邹树波	李帅帅
	联系电话	021-38794888	0755-25878287
	电子邮箱	services@cifm.com	LISHUAISHUAI130@pingan.com.cn
客户服务电话		400-889-4888	95511-3
传真		021-20628400	0755-82080387
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	广东省深圳市罗湖区深南东路5047号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区	广东省深圳市福田区益田路

	富城路99号震旦国际大楼25楼	5023号平安金融中心B座26楼
邮政编码	200120	518001
法定代表人	陈兵	谢永林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.cifm.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

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	45,780,575.10
本期利润	19,053,922.33
加权平均基金份额本期利润	0.1063
本期加权平均净值利润率	7.74%
本期基金份额净值增长率	6.37%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	65,329,649.24
期末可供分配基金份额利润	0.4250
期末基金资产净值	219,056,972.24
期末基金份额净值	1.4250
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	42.50%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。对期末可供分配利润，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

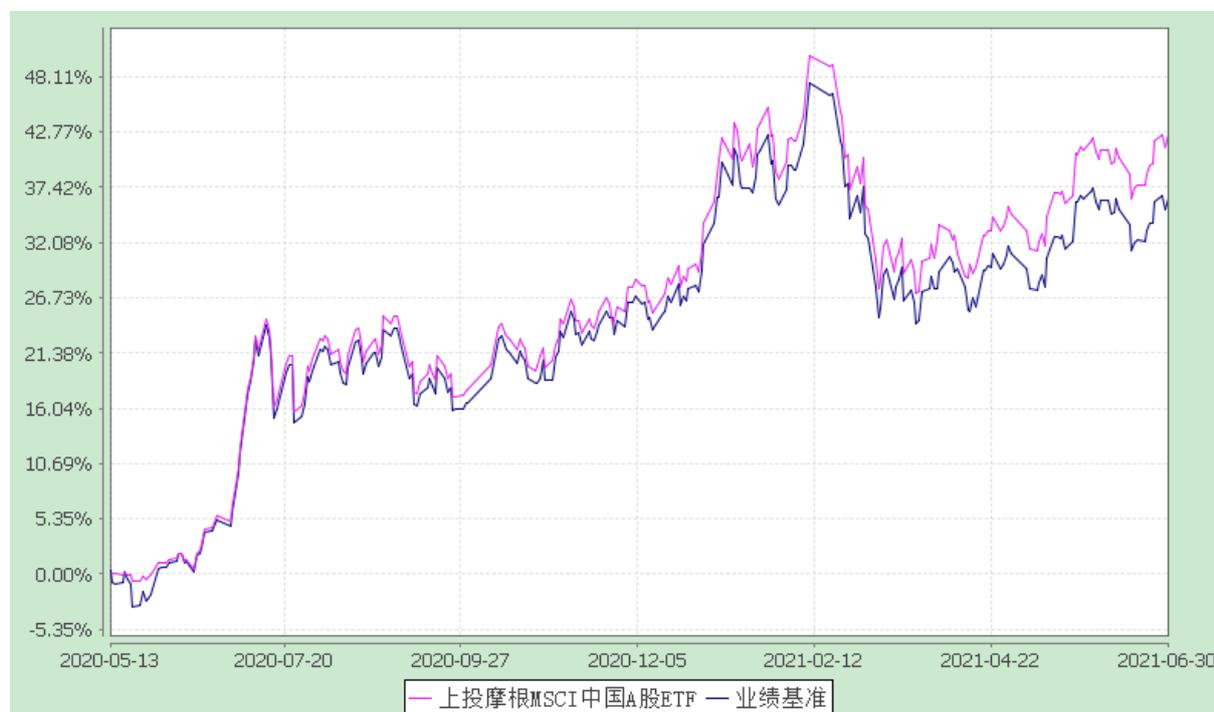
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.47%	0.84%	-0.55%	0.84%	1.02%	0.00%
过去三个月	9.12%	0.97%	6.84%	0.99%	2.28%	-0.02%
过去六个月	6.37%	1.31%	3.38%	1.33%	2.99%	-0.02%
过去一年	33.60%	1.32%	28.40%	1.34%	5.20%	-0.02%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	42.50%	1.25%	36.31%	1.30%	6.19%	-0.05%

注：本基金的业绩比较基准为：MSCI 中国 A 股人民币指数收益率

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 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金
 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
 （2020 年 5 月 13 日至 2021 年 6 月 30 日）



注：本基金合同生效日为 2020 年 5 月 13 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、上投摩根全球自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		
施焜文	本基金基金经理	2020-05-13	2021-01-07	9 年	基金经理施焜文先生, 北京大学经济学硕士, 2012 年 7 月起加入上投摩根基金管理有限公司, 先后担任助理研究员、研究员/基金经理助理、基金经理, 主要承担量化支持方面的工作。2017 年 1 月至 2019 年 9 月担任上投摩根安丰回报混合型证券投资基金基金经理, 2017 年 1 月至 2018 年 10 月同时担任上投摩根安泽回报混合型证券投资基金基金经理, 2017 年 12 月至 2021 年 1 月担任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, 2018 年 2 月至 2019 年 4 月同时担任上投摩根安隆回报混合型证券投资基金基金经理, 2018 年 2 月至 7 月同时担任上投

					<p>摩根安腾回报混合型证券投资基金基金经理，2018 年 4 月至 2021 年 1 月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，2018 年 9 月至 2020 年 5 月同时担任上投摩根安裕回报混合型证券投资基金基金经理，2019 年 4 月至 2020 年 5 月同时担任上投摩根安通回报混合型证券投资基金基金经理，2019 年 12 月至 2021 年 1 月同时担任上投摩根动态多因子策略灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根量化多因子灵活配置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及上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金基金经理；2020 年 5 月至 2021 年 1 月同时担任上投摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2020 年 7 月至 2021 年 1 月同时担任上投摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金经理。</p>
胡迪	本基金基金经理、指数及量化投资部总监	2021-01-07	-	13 年	<p>胡迪女士，CFA，FRM，美国哥伦比亚大学金融工程硕士，现任指数及量化投资部总监。胡迪女士自 2008 年 2 月至 2009 年 12 月在纽约美林证券担任全球资产管理部高级经理；自 2010 年 1 月至 2012 年 10 月在纽约标准普尔担任量化投资主管；自 2012 年 11 月至 2020 年 4 月在中国国际金融股份有限公司担任资产管理部执行总经理；自 2020 年 5 月加入上投摩根基金管理有限公司，现任指数及量化投资部总监，自 2021 年 1 月起同时担任上投摩根量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根优选多因子股票型证券投资基金、上投摩根动态多因子策略灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金、上投摩根 MSCI 中国 A 股</p>

					交易型开放式指数证券投资基金、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、上投摩根标普港股通低波红利指数型证券投资基金基金经理。
何智豪	本基金基金经理	2021-02-19	-	7 年	何智豪先生,复旦大学应用数学硕士,现任指数及量化投资部基金经理。何智豪先生自 2014 年 7 月至 2020 年 7 月,在中国国际金融股份有限公司担任组合与量化策略研究员、资产管理部高级经理;自 2020 年 7 月起加入上投摩根基金管理有限公司。自 2021 年 2 月起同时担任上投摩根量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根优选多因子股票型证券投资基金、上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金、上投摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、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、上投摩根标普港股通低波红利指数型证券投资基金基金经理。
张皓	本基金基金经理助理	2020-12-22	-	7 年	美国哥伦比亚大学运筹学硕士,现任 ETF 业务总监/基金经理助理。张皓先生自 2011 年 9 月至 2014 年 5 月在瑞士信贷 Credit Suisse 担任新兴市场衍生品业务助理副总裁;自 2014 年 5 月至 2016 年 5 月在高盛 Goldman Sachs 担任 FICC 衍生品业务高级助理;自 2016 年 5 月至 2019 年 8 月在华夏基金管理有限公司担任数量投资部投资经理;自 2019 年 12 月至 2020 年 5 月在瑞银资产管理(上海)有限公司担任资产管理部业务分析师;自 2020 年 5 月加入上投摩根基金管理有限公司,现任 ETF 业务总监/基金经理助理。

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.施毓文先生为本基金首任基金经理,其任职日期指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 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 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》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。

4.3 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

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。

4.3.2 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。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年上半年，本基金跟踪的 MSCI 中国 A 股指数整体波动向上，报告期收涨 3.38%，同期沪深 300 指数上涨 0.24%，春节后市场显著下跌，随后保持震荡态势。整个上半年，海外通胀虽超出

市场预期，但美联储受限于高政府债务率、进一步赤字化压力，货币政策易松难紧。国内经济逐步从强势反弹向新常态回归，内外需出现弱化迹象。年初至今市场结构化行情显著，周期类板块，包括化工、钢铁、采掘等受益于通胀压力的行业表现相对突出，报告期内申万一级行业指数中，电气设备、化工、钢铁领涨，涨幅分别为 23.83%、21.46%、23.62%。本基金继续采用抽样复制的方法跟踪标的指数，跟踪误差保持在合理范围内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期上投摩根 MSCI 中国 A 股 ETF 份额净值增长率为:6.37%，同期业绩比较基准收益率为:3.38%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，随着新冠疫苗在全球范围内的持续推进，全球经济持续复苏，但边际动能有所放缓，下半年的出口仍是国内经济的重要动能来源。以目前的市场预期来看，全球流动性仍大概率保持宽松，美联储货币政策转向受制于劳动率短缺、就业市场不及预期。下半年市场的主要风险来自于不断出现的变异病毒，这将使得疫情成为下半年经济复苏和流动性预期最大的不确定风险。

4.6 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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

无。

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

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，平安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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、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 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	8,646,940.94	15,476,548.13
结算备付金		3,547,015.02	2,713,542.23
存出保证金		1,423,003.53	2,134,598.10
交易性金融资产	6.4.7.2	205,426,536.38	347,448,057.14
其中：股票投资		205,060,289.44	347,107,057.14
基金投资		-	-
债券投资		366,246.94	341,000.00
资产支持证券投资		-	-

贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		196,768.97	512,493.90
应收利息	6.4.7.5	1,828.56	2,272.15
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		219,242,093.40	368,287,511.65
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负 债:		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	251,040.36
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		26,972.05	53,870.60
应付托管费		8,990.67	17,956.89
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	27,970.56	106,862.82
应交税费		0.34	5,780.46
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	121,187.54	5,169,156.85
负债合计		185,121.16	5,604,667.98
所有者权益:		-	-
实收基金	6.4.7.9	153,727,323.00	270,727,323.00
未分配利润	6.4.7.10	65,329,649.24	91,955,520.67
所有者权益合计		219,056,972.24	362,682,843.67
负债和所有者权益总计		219,242,093.40	368,287,511.65

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日,基金份额净值 1.4250 元,基金份额总额 153,727,323.00 份。

6.2 利润表

会计主体：上投摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
----	-----	----	---------

		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 5 月 13 日 (基 金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		19,748,284.81	44,964,551.65
1.利息收入		30,450.38	156,351.30
其中：存款利息收入	6.4.7.11	30,226.27	156,351.30
债券利息收入		224.11	-
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）		45,970,785.09	18,925,498.28
其中：股票投资收益	6.4.7.12	43,245,264.09	15,357,383.62
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	4,088.82	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	1,384,041.55	-
股利收益	6.4.7.15	1,337,390.63	3,568,114.66
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-26,726,652.77	24,351,166.59
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	473,702.11	1,531,535.48
减：二、费用		694,362.48	1,420,797.49
1. 管理人报酬		184,095.48	135,957.77
2. 托管费		61,365.16	45,319.28
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	290,633.36	1,161,625.31
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		5,643.17	-
7. 其他费用	6.4.7.19	152,625.31	77,895.13
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		19,053,922.33	43,543,754.16
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		19,053,922.33	43,543,754.16

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上投摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	270,727,323.00	91,955,520.67	362,682,843.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	19,053,922.33	19,053,922.33
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）	-117,000,000.00	-45,679,793.76	-162,679,793.76
其中：1.基金申购款	21,000,000.00	8,584,253.65	29,584,253.65
2.基金赎回款	-138,000,000.00	-54,264,047.41	-192,264,047.41
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）	153,727,323.00	65,329,649.24	219,056,972.24
	上年度可比期间		
	2020 年 5 月 13 日（基金合同生效日）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）	744,727,323.00	-	744,727,323.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	43,543,754.16	43,543,754.16
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）	-285,000,000.00	-12,948,618.56	-297,948,618.56
其中：1.基金申购款	72,000,000.00	3,744,615.45	75,744,615.45
2.基金赎回款	-357,000,000.00	-16,693,234.01	-373,693,234.01
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）	459,727,323.00	30,595,135.60	490,322,458.60

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 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金(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[2020]第 5 号《关于准予上投摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》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》和《上投摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型、交易型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 744,727,323.00 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第 0323 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《上投摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2020 年 5 月 13 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 744,727,323.00 份基金份额,无有效认购资金产生的利息折份额。本基金的基金管理人为上投摩根基金管理有限公司,基金托管人为平安银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2020]154 号文审核同意,本基金 744,727,323.00 份基金份额于 2020 年 6 月 19 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上投摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%,年跟踪误差不超过 2%。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、衍生工具(股指期货、股票期权等)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为:投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%。本基金的业绩比较基准为:MSCI 中国 A 股人民币指数收益率。

本基金的基金管理人上投摩根基金管理有限公司以本基金为目标 ETF,成立了上投摩根 MSCI

中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“MSCI 中国 A 股 ETF 联接基金”)。MSCI 中国 A 股 ETF 联接基金为契约型开放式基金,投资目标与本基金类似,将绝大多数基金资产投资于本基金。

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 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》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 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

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[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，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
活期存款	8,646,940.94
定期存款	-
其他存款	-
合计	8,646,940.94

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	172,562,364.06	205,060,289.44	32,497,925.38	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	348,400.00	366,246.94	17,846.94
	银行间市场	-	-	-
	合计	348,400.00	366,246.94	17,846.94
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	172,910,764.06	205,426,536.38	32,515,772.32	

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			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	10,914,120.00	-	-	-

股指期货	10,914,120.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	10,914,120.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2107	IF2107	7	10,901,520.00	-12,600.00
总额合计				-12,600.00
减：可抵销期货暂收款				-12,600.00
股指期货投资净额				-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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	857.21
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	730.97
应收债券利息	188.68
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	51.70
合计	1,828.56

6.4.7.6 其他资产

无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	27,970.56
银行间市场应付交易费用	-
合计	27,970.56

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	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	89,260.15
指数使用费	31,927.39
合计	121,187.54

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	270,727,323.00	270,727,323.00
本期申购	21,000,000.00	21,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-138,000,000.00	-138,000,000.00
本期末	153,727,323.00	153,727,323.00

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	61,898,584.28	30,056,936.39	91,955,520.67
本期利润	45,780,575.10	-26,726,652.77	19,053,922.33
本期基金份额交易产生的变动数	-38,367,603.94	-7,312,189.82	-45,679,793.76
其中：基金申购款	7,182,263.21	1,401,990.44	8,584,253.65
基金赎回款	-45,549,867.15	-8,714,180.26	-54,264,047.41

本期已分配利润	-	-	-
本期末	69,311,555.44	-3,981,906.20	65,329,649.24

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	15,495.76
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	13,319.92
其他	1,410.59
合计	30,226.27

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	25,710,915.59
股票投资收益——赎回差价收入	17,534,348.50
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	43,245,264.09

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	135,934,373.69
减：卖出股票成本总额	110,223,458.10
买卖股票差价收入	25,710,915.59

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	192,264,047.41
减：现金支付赎回款总额	85,761,359.41
减：赎回股票成本总额	88,968,339.50
赎回差价收入	17,534,348.50

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	345,153.10
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	341,000.00
减：应收利息总额	64.28
买卖债券差价收入	4,088.82

6.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股指期货投资收益	1,384,041.55

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,337,390.63
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,337,390.63

6.4.7.16 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	-25,933,266.77
——股票投资	-25,951,113.71
——债券投资	17,846.94
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-793,386.00

——权证投资	-
——股指期货	-793,386.00
4.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	-26,726,652.77

6.4.7.17 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	-
替代损益	473,702.11
合计	473,702.11

6.4.7.18 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	290,633.36
银行间市场交易费用	-
合计	290,633.36

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
律师费	2,000.00
指数使用费	61,365.16
合计	152,625.31

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

无。

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
上投摩根基金管理有限公司	基金管理人
平安银行股份有限公司(“平安银行”)	基金托管人
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 MSCI 中国 A 股 ETF 联接”)	本基金的基金管理人管理的其他基金

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5月13日(基金合同生 效日)至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	184,095.48	135,957.77
其中：支付销售机构的客户维护费	6,561.73	2,727.72

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 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.15%/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5月13日(基金合同生 效日)至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	61,365.16	45,319.28

注：支付基金托管人平安银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05%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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.3 销售服务费

无

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

无

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
上投摩根 MSCI 中国 A 股 ETF 联接	49,053,800.00	31.91%	96,270,800.00	35.56%

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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年5月13日（基金合同生效日）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
平安银行股份有限公司	8,646,940.94	15,495.76	30,842,831.64	151,746.02

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-07-02	新股锁定期内	24.60	163.00	226.00	5,559.60	36,838.00	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-12	新股锁定期内	10.76	22.20	359.00	3,862.84	7,969.80	-
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-21	新股锁定期内	13.87	29.55	183.00	2,538.21	5,407.65	-
300932	三友联众	2021-01-15	2021-07-22	新股锁定期内	24.69	31.71	389.00	9,604.41	12,335.19	-
300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	新股锁定期内	12.76	43.38	307.00	3,917.32	13,317.66	-
300941	创识科技	2021-02-02	2021-08-09	新股锁定期内	21.31	49.94	224.00	4,773.44	11,186.56	-
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	新股锁定期内	9.79	23.01	255.00	2,496.45	5,867.55	-
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	新股锁定期内	11.72	27.08	340.00	3,984.80	9,207.20	-
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	新股锁定期内	28.77	99.85	154.00	4,430.58	15,376.90	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	新股锁定期内	47.33	251.96	90.00	4,259.70	22,676.40	-
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	新股锁定期内	3.40	16.37	576.00	1,958.40	9,429.12	-
300971	博亚精工	2021-04-07	2021-10-15	新股锁定	18.24	28.29	245.00	4,468.80	6,931.05	-

				期内						
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	新股锁定期内	28.28	115.71	105.00	2,969.40	12,149.55	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	新股锁定期内	5.48	13.03	492.00	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭科技	2021-04-15	2021-10-26	新股锁定期内	8.42	13.60	490.00	4,125.80	6,664.00	-
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	新股锁定期内	15.83	45.29	317.00	5,018.11	14,356.93	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	新股锁定期内	24.90	24.81	130.00	3,237.00	3,225.30	-
300987	川网传媒	2021-04-28	2021-11-11	新股锁定期内	6.79	26.81	301.00	2,043.79	8,069.81	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	新股锁定期内	9.36	20.32	200.00	1,872.00	4,064.00	-
300993	玉马遮阳	2021-05-17	2021-11-24	新股锁定期内	12.10	19.29	287.00	3,472.70	5,536.23	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	新股锁定期内	6.02	21.32	201.00	1,210.02	4,285.32	-
301004	嘉益股份	2021-06-18	2021-12-27	新股锁定期内	7.81	21.94	312.00	2,436.72	6,845.28	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	新股锁定期内	5.29	14.44	303.00	1,602.87	4,375.32	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	新股锁定期内	7.83	17.61	218.00	1,706.94	3,838.98	-
301011	华立科技	2021-06-09	2021-12-17	新股锁定期内	14.20	33.84	175.00	2,485.00	5,922.00	-
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	新股锁定期内	7.64	38.83	323.00	2,467.72	12,542.09	-
301011	漱玉	2021-0	2022-0	新股	8.86	8.86	464.00	4,111.0	4,111.0	-

7	平民	6-23	1-05	锁定期内				4	4	
301017	漱玉平民	2021-06-23	2021-07-05	新股未上市	8.86	8.86	4,174.00	36,981.64	36,981.64	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	新股锁定期内	8.29	8.29	648.00	5,371.92	5,371.92	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	8.29	8.29	5,830.00	48,330.70	48,330.70	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	新股锁定期内	10.64	10.64	360.00	3,830.40	3,830.40	-
301020	密封科技	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	10.64	10.64	3,234.00	34,409.76	34,409.76	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新股锁定期内	9.46	9.46	262.00	2,478.52	2,478.52	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	9.46	9.46	2,354.00	22,268.84	22,268.84	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	31.56	31.56	349.00	11,014.44	11,014.44	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股未上市	21.96	21.96	1,160.00	25,473.60	25,473.60	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	6.42	6.42	2,693.00	17,289.06	17,289.06	-
688350	富淼科技	2021-01-21	2021-07-28	新股锁定期内	13.58	22.44	2,552.00	34,656.16	57,266.88	-
688456	有研粉材	2021-03-10	2021-09-17	新股锁定期内	10.62	26.50	3,396.00	36,065.52	89,994.00	-
688565	力源科技	2021-05-06	2021-11-15	新股锁定期内	9.39	14.00	2,464.00	23,136.96	34,496.00	-
688617	惠泰医疗	2020-12-30	2021-07-07	新股锁定期内	74.46	373.24	736.00	54,802.56	274,704.64	-

688669	聚石化学	2021-01-15	2021-07-26	新股锁定期内	36.65	32.39	1,915.00	70,184.75	62,026.85	-
688680	海优新材	2021-01-15	2021-07-22	新股锁定期内	69.94	243.61	1,216.00	85,047.04	296,229.76	-
688686	奥普特	2020-12-24	2021-07-01	新股锁定期内	78.49	451.00	1,048.00	82,257.52	472,648.00	-
688819	天能股份	2021-01-07	2021-07-19	新股锁定期内	41.79	43.69	2,625.00	109,698.75	114,686.25	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113050	南银转债	2021-06-15	2021-07-01	老股东配债	100.00	100.00	930.00	93,000.00	93,000.00	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

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

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002024	苏宁易购	2021-06-16	重要事项	5.59	2021-07-06	6.15	43,100.00	395,126.62	240,929.00	-

600460	士兰微	2021-06-30	重要事项	56.35	2021-07-01	59.49	6,000.00	107,617.36	338,100.00	-
--------	-----	------------	------	-------	------------	-------	----------	------------	------------	---

注：本基金截至 2021 年 06 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

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

本基金为股票型指数基金，预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于较高风险的基金产品。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金采用完全复制法，按照标的指数成份股构成及其权重构建股票资产组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化对股票组合进行动态调整。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对标指数的有效跟踪的风险收益目标。

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控管，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，将风险控制可在可承受的范围内。

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人平安银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.17%。

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来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

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。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.87%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2021 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值为 211,569,845.37 元，超过经确认的当日净赎回金额。

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月 30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	8,646,940.94	-	-	-	8,646,940.94
结算备付金	3,547,015.02	-	-	-	3,547,015.02
存出保证金	1,423,003.53	-	-	-	1,423,003.53
交易性金融资产	-	-	366,246.94	205,060,289.44	205,426,536.38
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	196,768.97	196,768.97
应收利息	-	-	-	1,828.56	1,828.56
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-

其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	13,616,959.49	-	366,246.94	205,258,886.97	219,242,093.40
负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融 融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清 算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人 报酬	-	-	-	26,972.05	26,972.05
应付托管费	-	-	-	8,990.67	8,990.67
应付销售服 务费	-	-	-	-	-
应付交易费 用	-	-	-	27,970.56	27,970.56
应付税费	-	-	-	0.34	0.34
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	121,187.54	121,187.54
负债总计	-	-	-	185,121.16	185,121.16
利率敏感 度缺口	13,616,959.49	-	366,246.94	205,073,765.81	219,056,972.24
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产	-	-	-	-	-
银行存款	15,476,548.13	-	-	-	15,476,548.13
结算备付金	2,713,542.23	-	-	-	2,713,542.23
存出保证金	2,134,598.10	-	-	-	2,134,598.10
交易性金融 资产	-	-	341,000.00	347,107,057.14	347,448,057.14
应收证券清 算款	-	-	-	512,493.90	512,493.90
应收利息	-	-	-	2,272.15	2,272.15
资产总计	20,324,688.46	-	341,000.00	347,621,823.19	368,287,511.65

负债					
应付证券清算款	-	-	-	251,040.36	251,040.36
应付管理人报酬	-	-	-	53,870.60	53,870.60
应付托管费	-	-	-	17,956.89	17,956.89
应付交易费用	-	-	-	106,862.82	106,862.82
应交税费	-	-	-	5,780.46	5,780.46
其他负债	-	-	-	5,169,156.85	5,169,156.85
负债总计	-	-	-	5,604,667.98	5,604,667.98
利率敏感度缺口	20,324,688.46	-	341,000.00	342,017,155.21	362,682,843.67

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2021 年 6 月 30 日,本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.17%,因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 其他价格风险

6.4.13.4.2.1 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	205,060,289.44	93.61	347,107,057.14	95.71
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	366,246.94	0.17	341,000.00	0.09
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	205,426,536.38	93.78	347,448,057.14	95.80

6.4.13.4.2.2 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
	1. 业绩比较基准(附注6.4.1)上升5%	增加约 1,073	增加约 1,958
	2. 业绩比较基准(附注6.4.1)下降5%	减少约 1,073	减少约 1,958

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 203,512,947.87 元，属于第二层次的余额为 1,913,588.51 元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	205,060,289.44	93.53
	其中：股票	205,060,289.44	93.53
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	366,246.94	0.17
	其中：债券	366,246.94	0.17
	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	12,193,955.96	5.56
8	其他各项资产	1,621,601.06	0.74
9	合计	219,242,093.40	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,220,008.72	1.01
B	采矿业	5,066,835.40	2.31
C	制造业	119,258,733.14	54.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,662,395.20	1.67
E	建筑业	2,418,951.00	1.10
F	批发和零售业	2,630,807.54	1.20
G	交通运输、仓储和邮政业	5,833,744.80	2.66
H	住宿和餐饮业	233,495.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,932,682.34	2.71
J	金融业	38,640,688.96	17.64
K	房地产业	4,274,195.24	1.95
L	租赁和商务服务业	3,634,099.40	1.66
M	科学研究和技术服务业	2,913,043.44	1.33
N	水利、环境和公共设施管理业	227,020.00	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	215,501.24	0.10
Q	卫生和社会工作	3,162,855.08	1.44
R	文化、体育和娱乐业	964,346.46	0.44
S	综合	-	-
	合计	201,289,402.96	91.89

7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	27,347.92	0.01
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,337,040.50	1.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	36,330.57	0.02
F	批发和零售业	60,045.53	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	9,014.76	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	137,526.22	0.06
J	金融业	97,319.40	0.04
K	房地产业	10,095.90	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	39,903.65	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	16,262.03	0.01
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,770,886.48	1.72

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	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	-------	------	--------------

1	600519	贵州茅台	5,748.00	11,821,911.60	5.40
2	300750	宁德时代	10,644.00	5,692,411.20	2.60
3	000858	五粮液	17,600.00	5,242,864.00	2.39
4	600036	招商银行	93,625.00	5,073,538.75	2.32
5	601318	中国平安	49,220.00	3,163,861.60	1.44
6	300760	迈瑞医疗	5,567.00	2,672,438.35	1.22
7	601888	中国中免	8,844.00	2,654,084.40	1.21
8	601012	隆基股份	24,000.00	2,132,160.00	0.97
9	600900	长江电力	103,180.00	2,129,635.20	0.97
10	603288	海天味业	15,956.00	2,057,526.20	0.94
11	002594	比亚迪	8,153.00	2,046,403.00	0.93
12	000001	平安银行	88,000.00	1,990,560.00	0.91
13	600276	恒瑞医药	29,028.00	1,973,033.16	0.90
14	601166	兴业银行	94,300.00	1,937,865.00	0.88
15	603259	药明康德	11,716.00	1,834,608.44	0.84
16	600809	山西汾酒	3,900.00	1,747,200.00	0.80
17	300015	爱尔眼科	24,246.00	1,720,981.08	0.79
18	000568	泸州老窖	6,659.00	1,571,124.46	0.72
19	600309	万华化学	14,300.00	1,556,126.00	0.71
20	300059	东方财富	46,872.00	1,536,932.88	0.70
21	601398	工商银行	285,500.00	1,476,035.00	0.67
22	002475	立讯精密	31,750.00	1,460,500.00	0.67
23	002714	牧原股份	23,866.00	1,451,530.12	0.66
24	002304	洋河股份	6,883.00	1,426,157.60	0.65
25	002352	顺丰控股	20,700.00	1,401,390.00	0.64
26	601919	中远海控	44,000.00	1,343,760.00	0.61
27	300122	智飞生物	7,186.00	1,341,841.78	0.61
28	600000	浦发银行	131,815.00	1,318,150.00	0.60
29	603501	韦尔股份	3,927.00	1,264,494.00	0.58
30	600436	片仔癀	2,700.00	1,210,410.00	0.55
31	600030	中信证券	48,400.00	1,207,096.00	0.55
32	000333	美的集团	16,000.00	1,141,920.00	0.52
33	600031	三一重工	38,500.00	1,119,195.00	0.51
34	002142	宁波银行	27,267.00	1,062,594.99	0.49
35	000002	万科 A	44,137.00	1,050,901.97	0.48
36	600887	伊利股份	28,200.00	1,038,606.00	0.47
37	601288	农业银行	338,000.00	1,024,140.00	0.47
38	601816	京沪高铁	185,800.00	982,882.00	0.45
39	002812	恩捷股份	4,100.00	959,810.00	0.44
40	000725	京东方 A	153,600.00	958,464.00	0.44
41	601601	中国太保	31,000.00	898,070.00	0.41
42	300014	亿纬锂能	8,545.00	888,081.85	0.41
43	600438	通威股份	20,493.00	886,732.11	0.40
44	601668	中国建筑	190,500.00	885,825.00	0.40

45	601328	交通银行	178,100.00	872,690.00	0.40
46	300124	汇川技术	11,750.00	872,555.00	0.40
47	601899	紫金矿业	89,600.00	868,224.00	0.40
48	300782	卓胜微	1,540.00	827,750.00	0.38
49	002493	荣盛石化	45,947.00	793,504.69	0.36
50	600104	上汽集团	35,300.00	775,541.00	0.35
51	600019	宝钢股份	101,100.00	772,404.00	0.35
52	300274	阳光电源	6,700.00	770,902.00	0.35
53	600585	海螺水泥	18,147.00	744,934.35	0.34
54	600690	海尔智家	28,600.00	741,026.00	0.34
55	000661	长春高新	1,900.00	735,300.00	0.34
56	600016	民生银行	161,000.00	710,010.00	0.32
57	601818	光大银行	187,700.00	709,506.00	0.32
58	600346	恒力石化	26,600.00	697,984.00	0.32
59	002230	科大讯飞	10,100.00	682,558.00	0.31
60	000538	云南白药	5,800.00	671,176.00	0.31
61	300433	蓝思科技	22,600.00	664,666.00	0.30
62	002241	歌尔股份	15,500.00	662,470.00	0.30
63	600196	复星医药	9,100.00	656,383.00	0.30
64	600703	三安光电	20,400.00	653,820.00	0.30
65	600048	保利地产	54,300.00	653,772.00	0.30
66	300759	康龙化成	3,000.00	650,970.00	0.30
67	600893	航发动力	12,100.00	643,599.00	0.29
68	600999	招商证券	33,693.00	640,840.86	0.29
69	002371	北方华创	2,300.00	637,974.00	0.29
70	600028	中国石化	144,500.00	630,020.00	0.29
71	603799	华友钴业	5,500.00	628,100.00	0.29
72	002027	分众传媒	66,600.00	626,706.00	0.29
73	002460	赣锋锂业	5,120.00	619,980.80	0.28
74	601066	中信建投	19,700.00	619,171.00	0.28
75	600763	通策医疗	1,500.00	616,500.00	0.28
76	002311	海大集团	7,500.00	612,000.00	0.28
77	601658	邮储银行	120,700.00	605,914.00	0.28
78	601088	中国神华	30,000.00	585,600.00	0.27
79	600406	国电南瑞	25,180.00	585,183.20	0.27
80	601211	国泰君安	34,100.00	584,474.00	0.27
81	000063	中兴通讯	17,500.00	581,525.00	0.27
82	600745	闻泰科技	5,700.00	552,330.00	0.25
83	300413	芒果超媒	8,035.00	551,201.00	0.25
84	603986	兆易创新	2,932.00	550,922.80	0.25
85	000338	潍柴动力	30,700.00	548,609.00	0.25
86	601225	陕西煤业	45,300.00	536,805.00	0.25
87	000625	长安汽车	20,300.00	533,484.00	0.24
88	002129	中环股份	13,802.00	532,757.20	0.24

89	601229	上海银行	64,466.00	528,621.20	0.24
90	601688	华泰证券	33,400.00	527,720.00	0.24
91	601857	中国石油	98,000.00	518,420.00	0.24
92	601100	恒立液压	5,966.00	512,598.72	0.23
93	600660	福耀玻璃	9,100.00	508,235.00	0.23
94	600837	海通证券	43,800.00	503,700.00	0.23
95	603486	科沃斯	2,200.00	501,776.00	0.23
96	600588	用友网络	14,831.00	493,279.06	0.23
97	300454	深信服	1,900.00	493,012.00	0.23
98	300999	金龙鱼	5,800.00	492,768.00	0.22
99	601988	中国银行	159,400.00	490,952.00	0.22
100	000100	TCL 科技	63,600.00	486,540.00	0.22
101	601390	中国中铁	92,400.00	484,176.00	0.22
102	000166	申万宏源	102,200.00	478,296.00	0.22
103	601009	南京银行	45,400.00	477,608.00	0.22
104	600919	江苏银行	67,050.00	476,055.00	0.22
105	601169	北京银行	96,000.00	467,520.00	0.21
106	300601	康泰生物	3,100.00	461,900.00	0.21
107	002709	天赐材料	4,190.00	446,570.20	0.20
108	600760	中航沈飞	7,360.00	443,808.00	0.20
109	603806	福斯特	4,200.00	441,546.00	0.20
110	601633	长城汽车	10,100.00	440,259.00	0.20
111	600570	恒生电子	4,700.00	438,275.00	0.20
112	300142	沃森生物	7,100.00	438,070.00	0.20
113	600132	重庆啤酒	2,200.00	435,490.00	0.20
114	601336	新华保险	9,451.00	433,895.41	0.20
115	000596	古井贡酒	1,800.00	431,100.00	0.20
116	601628	中国人寿	12,600.00	427,014.00	0.19
117	601989	中国重工	103,500.00	426,420.00	0.19
118	601155	新城控股	10,231.00	425,609.60	0.19
119	603659	璞泰来	3,100.00	423,460.00	0.19
120	000895	双汇发展	13,100.00	416,580.00	0.19
121	300498	温氏股份	28,980.00	416,442.60	0.19
122	002049	紫光国微	2,700.00	416,313.00	0.19
123	603993	洛阳钼业	80,200.00	413,832.00	0.19
124	601138	工业富联	33,100.00	410,771.00	0.19
125	002821	凯莱英	1,100.00	409,860.00	0.19
126	000776	广发证券	26,800.00	405,752.00	0.19
127	300595	欧普康视	3,890.00	402,809.50	0.18
128	600926	杭州银行	26,912.00	396,952.00	0.18
129	002179	中航光电	5,000.00	395,100.00	0.18
130	001979	招商蛇口	35,901.00	393,115.95	0.18
131	002050	三花智控	16,350.00	392,073.00	0.18
132	000799	酒鬼酒	1,500.00	383,400.00	0.18

133	600989	宝丰能源	27,700.00	378,936.00	0.17
134	600741	华域汽车	14,300.00	375,661.00	0.17
135	002841	视源股份	3,011.00	374,237.19	0.17
136	600600	青岛啤酒	3,200.00	370,080.00	0.17
137	000963	华东医药	7,900.00	363,479.00	0.17
138	600015	华夏银行	58,200.00	360,258.00	0.16
139	603899	晨光文具	4,200.00	355,152.00	0.16
140	002601	龙蟠佰利	10,200.00	352,716.00	0.16
141	601901	方正证券	37,400.00	350,064.00	0.16
142	300408	三环集团	8,200.00	347,844.00	0.16
143	600111	北方稀土	16,400.00	339,480.00	0.15
144	300628	亿联网络	4,050.00	339,390.00	0.15
145	600460	士兰微	6,000.00	338,100.00	0.15
146	002001	新和成	11,720.00	336,129.60	0.15
147	603882	金域医学	2,100.00	335,517.00	0.15
148	600150	中国船舶	20,300.00	335,153.00	0.15
149	601985	中国核电	66,000.00	333,960.00	0.15
150	300347	泰格医药	1,700.00	328,610.00	0.15
151	000768	中航西飞	12,500.00	328,500.00	0.15
152	601877	正泰电器	9,800.00	327,124.00	0.15
153	603833	欧派家居	2,281.00	323,810.76	0.15
154	600010	包钢股份	206,900.00	320,695.00	0.15
155	002568	百润股份	3,360.00	318,494.40	0.15
156	601788	光大证券	17,700.00	316,653.00	0.14
157	600547	山东黄金	16,460.00	316,361.20	0.14
158	601600	中国铝业	59,300.00	314,290.00	0.14
159	300496	中科创达	2,000.00	314,120.00	0.14
160	603737	三棵树	1,780.00	313,280.00	0.14
161	002736	国信证券	29,100.00	312,825.00	0.14
162	300529	健帆生物	3,620.00	312,623.20	0.14
163	603369	今世缘	5,700.00	308,712.00	0.14
164	000301	东方盛虹	14,600.00	305,140.00	0.14
165	002007	华兰生物	8,300.00	304,444.00	0.14
166	600886	国投电力	31,600.00	303,676.00	0.14
167	002648	卫星石化	7,740.00	303,330.60	0.14
168	000786	北新建材	7,715.00	302,813.75	0.14
169	600584	长电科技	8,000.00	301,440.00	0.14
170	601916	浙商银行	75,900.00	301,323.00	0.14
171	000876	新希望	20,500.00	300,735.00	0.14
172	002064	华峰化学	21,100.00	299,620.00	0.14
173	300316	晶盛机电	5,900.00	297,950.00	0.14
174	688185	康希诺	383.00	297,885.91	0.14
175	600426	华鲁恒升	9,610.00	297,429.50	0.14
176	000157	中联重科	32,100.00	296,604.00	0.14

177	002414	高德红外	10,682.00	294,609.56	0.13
178	002600	领益智造	32,000.00	294,080.00	0.13
179	601377	兴业证券	30,400.00	293,664.00	0.13
180	601799	星宇股份	1,300.00	293,436.00	0.13
181	002791	坚朗五金	1,500.00	291,075.00	0.13
182	601939	建设银行	43,600.00	289,940.00	0.13
183	002236	大华股份	13,600.00	286,960.00	0.13
184	000938	紫光股份	12,980.00	284,002.40	0.13
185	600779	水井坊	2,238.00	282,771.30	0.13
186	600176	中国巨石	18,145.00	281,428.95	0.13
187	603345	安井食品	1,100.00	279,422.00	0.13
188	600029	南方航空	46,400.00	279,328.00	0.13
189	000069	华侨城 A	37,200.00	276,768.00	0.13
190	601966	玲珑轮胎	6,300.00	275,562.00	0.13
191	603160	汇顶科技	2,100.00	272,223.00	0.12
192	600958	东方证券	27,100.00	270,729.00	0.12
193	601669	中国电建	69,400.00	268,578.00	0.12
194	300033	同花顺	2,356.00	265,709.68	0.12
195	300661	圣邦股份	1,050.00	265,366.50	0.12
196	601360	三六零	21,599.00	263,723.79	0.12
197	300003	乐普医疗	8,100.00	260,172.00	0.12
198	002938	鹏鼎控股	7,200.00	258,336.00	0.12
199	600115	中国东航	50,800.00	258,064.00	0.12
200	600845	宝信软件	5,043.00	256,688.70	0.12
201	300146	汤臣倍健	7,700.00	253,330.00	0.12
202	002074	国轩高科	5,800.00	252,648.00	0.12
203	601233	桐昆股份	10,400.00	250,536.00	0.11
204	600061	国投资本	29,192.00	247,840.08	0.11
205	002916	深南电路	2,220.00	246,708.60	0.11
206	601995	中金公司	4,000.00	246,000.00	0.11
207	600143	金发科技	11,700.00	244,062.00	0.11
208	600183	生益科技	10,400.00	243,464.00	0.11
209	601618	中国中冶	81,000.00	241,380.00	0.11
210	002024	苏宁易购	43,100.00	240,929.00	0.11
211	002459	晶澳科技	4,800.00	235,200.00	0.11
212	601111	中国国航	30,200.00	234,956.00	0.11
213	600754	锦江酒店	4,100.00	233,495.00	0.11
214	601021	春秋航空	4,100.00	233,290.00	0.11
215	603185	上机数控	1,300.00	232,635.00	0.11
216	300207	欣旺达	7,100.00	231,176.00	0.11
217	002920	德赛西威	2,100.00	231,168.00	0.11
218	002555	三七互娱	9,600.00	230,592.00	0.11
219	601878	浙商证券	17,600.00	230,208.00	0.11
220	002252	上海莱士	30,600.00	229,194.00	0.10

221	603517	绝味食品	2,700.00	227,583.00	0.10
222	300751	迈为股份	500.00	227,350.00	0.10
223	601636	旗滨集团	12,200.00	226,432.00	0.10
224	000425	徐工机械	35,500.00	226,135.00	0.10
225	300676	华大基因	1,900.00	225,340.00	0.10
226	300285	国瓷材料	4,600.00	224,250.00	0.10
227	300223	北京君正	2,200.00	222,024.00	0.10
228	002602	世纪华通	33,860.00	217,381.20	0.10
229	600332	白云山	6,400.00	216,640.00	0.10
230	603816	顾家家居	2,800.00	216,384.00	0.10
231	600089	特变电工	16,800.00	215,880.00	0.10
232	002607	中公教育	10,316.00	215,501.24	0.10
233	600161	天坛生物	6,280.00	215,090.00	0.10
234	600885	宏发股份	3,400.00	213,180.00	0.10
235	688008	澜起科技	3,400.00	212,092.00	0.10
236	600009	上海机场	4,400.00	211,772.00	0.10
237	002624	完美世界	8,800.00	210,408.00	0.10
238	600362	江西铜业	9,400.00	210,372.00	0.10
239	601881	中国银河	19,500.00	210,210.00	0.10
240	600383	金地集团	20,500.00	209,920.00	0.10
241	600079	人福医药	7,400.00	209,198.00	0.10
242	601838	成都银行	16,400.00	207,296.00	0.09
243	300558	贝达药业	1,900.00	205,656.00	0.09
244	601216	君正集团	40,400.00	205,636.00	0.09
245	601727	上海电气	48,400.00	205,216.00	0.09
246	600674	川投能源	16,600.00	204,678.00	0.09
247	601933	永辉超市	43,200.00	204,336.00	0.09
248	002625	光启技术	9,800.00	203,938.00	0.09
249	600352	浙江龙盛	14,800.00	203,352.00	0.09
250	002340	格林美	21,700.00	202,895.00	0.09
251	603127	昭衍新药	1,100.00	202,125.00	0.09
252	601865	福莱特	5,100.00	201,603.00	0.09
253	600298	安琪酵母	3,700.00	201,206.00	0.09
254	600018	上港集团	42,100.00	200,817.00	0.09
255	603658	安图生物	2,650.00	200,790.50	0.09
256	600606	绿地控股	36,800.00	200,560.00	0.09
257	002508	老板电器	4,300.00	199,950.00	0.09
258	300677	英科医疗	1,600.00	199,680.00	0.09
259	688002	睿创微纳	2,000.00	199,660.00	0.09
260	000703	恒逸石化	16,691.00	199,457.45	0.09
261	002080	中材科技	7,600.00	198,892.00	0.09
262	300144	宋城演艺	11,780.00	197,904.00	0.09
263	600862	中航高科	6,400.00	196,992.00	0.09
264	601117	中国化学	22,400.00	196,224.00	0.09

265	300450	先导智能	3,260.00	196,056.40	0.09
266	600219	南山铝业	54,200.00	195,120.00	0.09
267	000066	中国长城	13,300.00	194,180.00	0.09
268	000825	太钢不锈	25,900.00	193,991.00	0.09
269	002353	杰瑞股份	4,300.00	192,210.00	0.09
270	601162	天风证券	39,400.00	191,484.00	0.09
271	002202	金风科技	15,700.00	190,912.00	0.09
272	002185	华天科技	12,400.00	190,836.00	0.09
273	300037	新宙邦	1,900.00	190,190.00	0.09
274	600489	中金黄金	22,000.00	189,640.00	0.09
275	601689	拓普集团	5,000.00	187,150.00	0.09
276	000977	浪潮信息	6,600.00	185,658.00	0.08
277	300724	捷佳伟创	1,600.00	185,616.00	0.08
278	688009	中国通号	32,600.00	185,494.00	0.08
279	603456	九洲药业	3,800.00	184,604.00	0.08
280	603233	大参林	3,600.00	183,996.00	0.08
281	601607	上海医药	8,700.00	183,831.00	0.08
282	000783	长江证券	25,100.00	183,732.00	0.08
283	000932	华菱钢铁	27,800.00	183,480.00	0.08
284	603589	口子窖	2,684.00	181,679.96	0.08
285	600315	上海家化	3,000.00	180,420.00	0.08
286	600704	物产中大	22,700.00	178,649.00	0.08
287	002120	韵达股份	13,100.00	177,243.00	0.08
288	002013	中航机电	17,600.00	177,232.00	0.08
289	002444	巨星科技	5,200.00	177,216.00	0.08
290	603605	珀莱雅	900.00	177,039.00	0.08
291	601990	南京证券	16,700.00	175,684.00	0.08
292	603939	益丰药房	3,116.00	174,776.44	0.08
293	300699	光威复材	2,300.00	174,685.00	0.08
294	600109	国金证券	13,700.00	173,853.00	0.08
295	600188	兖州煤业	11,300.00	173,568.00	0.08
296	601696	中银证券	8,400.00	172,956.00	0.08
297	002223	鱼跃医疗	4,500.00	171,585.00	0.08
298	601108	财通证券	16,300.00	170,987.00	0.08
299	600655	豫园股份	14,700.00	170,373.00	0.08
300	002409	雅克科技	2,100.00	170,100.00	0.08
301	601872	招商轮船	36,640.00	169,276.80	0.08
302	000807	云铝股份	14,200.00	168,980.00	0.08
303	002157	正邦科技	14,100.00	168,495.00	0.08
304	002673	西部证券	20,300.00	167,475.00	0.08
305	002690	美亚光电	3,000.00	167,280.00	0.08
306	000027	深圳能源	18,000.00	165,060.00	0.08
307	002511	中顺洁柔	5,950.00	163,922.50	0.07
308	603638	艾迪精密	3,780.00	162,048.60	0.07

309	002044	美年健康	17,700.00	161,247.00	0.07
310	000830	鲁西化工	8,600.00	161,078.00	0.07
311	601699	潞安环能	13,600.00	160,616.00	0.07
312	002384	东山精密	7,700.00	160,468.00	0.07
313	002603	以岭药业	5,500.00	160,380.00	0.07
314	688006	杭可科技	1,886.00	160,310.00	0.07
315	601077	渝农商行	40,100.00	159,999.00	0.07
316	603613	国联股份	1,600.00	159,952.00	0.07
317	603444	吉比特	300.00	159,000.00	0.07
318	601319	中国人保	26,800.00	158,924.00	0.07
319	002078	太阳纸业	11,900.00	158,865.00	0.07
320	000050	深天马 A	11,200.00	158,816.00	0.07
321	000739	普洛药业	5,400.00	158,760.00	0.07
322	300253	卫宁健康	9,730.00	158,307.10	0.07
323	600699	均胜电子	6,200.00	158,224.00	0.07
324	000728	国元证券	19,800.00	157,806.00	0.07
325	002180	纳思达	4,900.00	157,780.00	0.07
326	600486	扬农化工	1,400.00	156,478.00	0.07
327	600705	中航资本	40,400.00	156,348.00	0.07
328	002032	苏泊尔	2,439.00	155,583.81	0.07
329	000983	山西焦煤	18,620.00	154,732.20	0.07
330	002294	信立泰	4,700.00	154,630.00	0.07
331	002405	四维图新	10,400.00	152,880.00	0.07
332	000800	一汽解放	14,100.00	152,562.00	0.07
333	002430	杭氧股份	4,400.00	152,196.00	0.07
334	600872	中炬高新	3,600.00	151,272.00	0.07
335	002507	涪陵榨菜	4,000.00	150,640.00	0.07
336	002372	伟星新材	7,200.00	148,824.00	0.07
337	300357	我武生物	2,302.00	147,604.24	0.07
338	600369	西南证券	30,200.00	147,074.00	0.07
339	000723	美锦能源	19,400.00	146,664.00	0.07
340	002156	通富微电	6,100.00	146,644.00	0.07
341	601555	东吴证券	17,574.00	146,567.16	0.07
342	603707	健友股份	3,500.00	146,125.00	0.07
343	600739	辽宁成大	7,000.00	145,670.00	0.07
344	600827	百联股份	7,200.00	145,080.00	0.07
345	600372	中航电子	8,700.00	143,985.00	0.07
346	300251	光线传媒	13,300.00	143,773.00	0.07
347	002152	广电运通	11,000.00	143,330.00	0.07
348	600233	圆通速递	14,300.00	143,143.00	0.07
349	601615	明阳智能	8,800.00	142,472.00	0.07
350	600803	新奥股份	8,600.00	141,986.00	0.06
351	603267	鸿远电子	1,100.00	140,712.00	0.06
352	600011	华能国际	33,300.00	140,526.00	0.06

353	600521	华海药业	6,720.00	140,313.60	0.06
354	000656	金科股份	24,200.00	140,118.00	0.06
355	000513	丽珠集团	2,800.00	140,056.00	0.06
356	002138	顺络电子	3,600.00	139,572.00	0.06
357	000860	顺鑫农业	3,300.00	139,194.00	0.06
358	600177	雅戈尔	21,100.00	139,049.00	0.06
359	600522	中天科技	13,900.00	139,000.00	0.06
360	601058	赛轮轮胎	13,900.00	138,861.00	0.06
361	600875	东方电气	12,600.00	138,222.00	0.06
362	600392	盛和资源	7,900.00	137,144.00	0.06
363	600038	中直股份	2,600.00	137,124.00	0.06
364	600642	申能股份	22,300.00	136,922.00	0.06
365	002030	达安基因	6,428.00	136,530.72	0.06
366	002797	第一创业	19,100.00	136,374.00	0.06
367	601198	东兴证券	12,475.00	136,351.75	0.06
368	002299	圣农发展	5,700.00	136,116.00	0.06
369	300136	信维通信	4,400.00	135,872.00	0.06
370	000547	航天发展	7,200.00	135,864.00	0.06
371	600549	厦门钨业	6,510.00	135,603.30	0.06
372	600039	四川路桥	21,600.00	135,432.00	0.06
373	603866	桃李面包	4,320.00	134,784.00	0.06
374	002541	鸿路钢构	2,300.00	134,205.00	0.06
375	000021	深科技	7,000.00	133,980.00	0.06
376	300482	万孚生物	2,043.00	132,161.67	0.06
377	603338	浙江鼎力	2,240.00	131,465.60	0.06
378	002939	长城证券	11,800.00	131,334.00	0.06
379	600536	中国软件	2,300.00	130,939.00	0.06
380	002422	科伦药业	6,558.00	130,832.10	0.06
381	600998	九州通	8,500.00	130,645.00	0.06
382	000630	铜陵有色	47,800.00	130,016.00	0.06
383	600895	张江高科	7,100.00	129,717.00	0.06
384	600848	上海临港	7,240.00	129,596.00	0.06
385	002385	大北农	19,009.00	129,261.20	0.06
386	600516	方大炭素	17,260.00	128,414.40	0.06
387	600415	小商品城	24,900.00	128,235.00	0.06
388	603712	七一二	3,500.00	126,350.00	0.06
389	600066	宇通客车	10,100.00	126,149.00	0.06
390	002429	兆驰股份	20,600.00	125,042.00	0.06
391	300308	中际旭创	3,200.00	123,264.00	0.06
392	600380	健康元	8,900.00	122,197.00	0.06
393	002563	森马服饰	10,200.00	121,890.00	0.06
394	002266	浙富控股	24,400.00	121,756.00	0.06
395	002463	沪电股份	7,800.00	120,666.00	0.06
396	002373	千方科技	7,200.00	120,240.00	0.05

397	000975	银泰黄金	12,600.00	119,826.00	0.05
398	600598	北大荒	8,000.00	119,680.00	0.05
399	603218	日月股份	4,400.00	119,152.00	0.05
400	600909	华安证券	21,330.00	118,808.10	0.05
401	000709	河钢股份	48,200.00	118,572.00	0.05
402	000999	华润三九	4,414.00	118,074.50	0.05
403	603858	步长制药	5,200.00	116,948.00	0.05
404	002010	传化智联	15,000.00	115,650.00	0.05
405	002926	华西证券	11,900.00	114,597.00	0.05
406	002242	九阳股份	3,500.00	113,715.00	0.05
407	002925	盈趣科技	2,900.00	112,839.00	0.05
408	601231	环旭电子	6,700.00	112,627.00	0.05
409	600988	赤峰黄金	7,500.00	112,425.00	0.05
410	601456	国联证券	7,300.00	112,420.00	0.05
411	600511	国药股份	3,400.00	112,404.00	0.05
412	002065	东华软件	14,100.00	111,813.00	0.05
413	002146	荣盛发展	19,800.00	111,672.00	0.05
414	600170	上海建工	40,400.00	111,504.00	0.05
415	600867	通化东宝	9,200.00	109,848.00	0.05
416	002500	山西证券	16,350.00	109,708.50	0.05
417	002127	南极电商	11,200.00	109,424.00	0.05
418	002075	沙钢股份	10,000.00	109,100.00	0.05
419	600801	华新水泥	6,200.00	108,934.00	0.05
420	002456	欧菲光	12,200.00	108,336.00	0.05
421	000738	航发控制	5,200.00	108,316.00	0.05
422	000988	华工科技	4,600.00	108,192.00	0.05
423	002958	青农商行	25,200.00	107,856.00	0.05
424	600160	巨化股份	12,200.00	107,848.00	0.05
425	002212	天融信	5,400.00	106,758.00	0.05
426	002153	石基信息	4,520.00	106,265.20	0.05
427	600027	华电国际	30,800.00	105,952.00	0.05
428	300070	碧水源	14,400.00	105,264.00	0.05
429	300463	迈克生物	2,500.00	105,225.00	0.05
430	000987	越秀金控	8,300.00	105,078.00	0.05
431	600153	建发股份	12,965.00	105,016.50	0.05
432	601099	太平洋	30,900.00	104,751.00	0.05
433	000750	国海证券	24,700.00	104,728.00	0.05
434	600688	上海石化	27,700.00	104,152.00	0.05
435	000423	东阿阿胶	2,900.00	104,139.00	0.05
436	002557	洽洽食品	2,400.00	103,440.00	0.05
437	002151	北斗星通	2,400.00	103,368.00	0.05
438	300383	光环新网	7,100.00	102,169.00	0.05
439	600256	广汇能源	30,600.00	101,898.00	0.05
440	601992	金隅集团	37,800.00	101,682.00	0.05

441	300773	拉卡拉	3,600.00	101,628.00	0.05
442	000961	中南建设	17,100.00	101,232.00	0.05
443	603883	老百姓	1,920.00	101,145.60	0.05
444	600859	王府井	3,500.00	101,080.00	0.05
445	002558	巨人网络	7,600.00	101,080.00	0.05
446	601598	中国外运	19,900.00	100,495.00	0.05
447	002465	海格通信	10,500.00	99,330.00	0.05
448	600026	中远海能	15,800.00	97,328.00	0.04
449	000671	阳光城	18,700.00	97,240.00	0.04
450	002705	新宝股份	3,700.00	97,125.00	0.04
451	002019	亿帆医药	5,600.00	96,600.00	0.04
452	000998	隆平高科	6,000.00	96,240.00	0.04
453	002081	金螳螂	12,100.00	95,832.00	0.04
454	603027	千禾味业	3,620.00	95,169.80	0.04
455	600498	烽火通信	5,100.00	95,013.00	0.04
456	002683	宏大爆破	3,400.00	94,418.00	0.04
457	600340	华夏幸福	17,728.00	92,894.72	0.04
458	000729	燕京啤酒	12,800.00	92,672.00	0.04
459	300088	长信科技	11,200.00	92,512.00	0.04
460	600879	航天电子	12,300.00	92,496.00	0.04
461	002506	协鑫集成	26,500.00	92,220.00	0.04
462	000402	金融街	13,600.00	91,800.00	0.04
463	600529	山东药玻	2,700.00	91,665.00	0.04
464	300296	利亚德	11,600.00	90,712.00	0.04
465	600583	海油工程	20,100.00	90,450.00	0.04
466	000686	东北证券	10,600.00	89,570.00	0.04
467	002727	一心堂	2,700.00	89,397.00	0.04
468	000629	攀钢钒钛	39,000.00	89,310.00	0.04
469	000540	中天金融	31,800.00	86,814.00	0.04
470	300418	昆仑万维	5,300.00	86,814.00	0.04
471	001914	招商积余	4,800.00	82,464.00	0.04
472	000623	吉林敖东	5,300.00	82,097.00	0.04
473	000627	天茂集团	22,400.00	81,088.00	0.04
474	000581	威孚高科	3,800.00	79,154.00	0.04
475	300212	易华录	2,899.00	78,012.09	0.04
476	601128	常熟银行	12,400.00	76,880.00	0.04
477	000401	冀东水泥	6,100.00	75,335.00	0.03
478	002399	海普瑞	4,700.00	74,871.00	0.03
479	002131	利欧股份	30,600.00	71,604.00	0.03
480	601098	中南传媒	8,103.00	71,468.46	0.03
481	002572	索菲亚	2,100.00	50,820.00	0.02

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	占基金资产净值比例(%)
1	688686	奥普特	1,048.00	472,648.00	0.22
2	688690	纳微科技	2,851.00	334,992.50	0.15
3	688680	海优新材	1,216.00	296,229.76	0.14
4	688617	惠泰医疗	736.00	274,704.64	0.13
5	688383	新益昌	1,756.00	247,613.56	0.11
6	688076	诺泰生物	1,931.00	131,713.51	0.06
7	688819	天能股份	2,625.00	114,686.25	0.05
8	300987	川网传媒	3,004.00	113,378.69	0.05
9	688345	博力威	1,266.00	93,114.30	0.04
10	301004	嘉益股份	3,115.00	90,654.98	0.04
11	688456	有研粉材	3,396.00	89,994.00	0.04
12	688625	呈和科技	1,683.00	89,922.69	0.04
13	688217	睿昂基因	1,040.00	86,736.00	0.04
14	688575	亚辉龙	1,534.00	68,109.60	0.03
15	601665	齐鲁银行	6,731.00	62,598.30	0.03
16	688669	聚石化学	1,915.00	62,026.85	0.03
17	301007	德迈仕	3,022.00	60,305.15	0.03
18	688350	富淼科技	2,552.00	57,266.88	0.03
19	301018	申菱环境	6,478.00	53,702.62	0.02
20	301010	晶雪节能	2,172.00	50,480.96	0.02
21	688395	正弦电气	1,576.00	43,072.08	0.02
22	301017	漱玉平民	4,638.00	41,092.68	0.02
23	688067	爱威科技	1,259.00	39,520.01	0.02
24	301020	密封科技	3,594.00	38,240.16	0.02
25	300985	致远新能	1,295.00	36,882.15	0.02
26	300919	中伟股份	226.00	36,838.00	0.02
27	601528	瑞丰银行	2,230.00	34,721.10	0.02
28	688565	力源科技	2,464.00	34,496.00	0.02
29	605089	味知香	370.00	32,197.40	0.01
30	300894	火星人	469.00	31,892.00	0.01
31	300910	瑞丰新材	269.00	28,123.95	0.01
32	001201	东瑞股份	668.00	27,347.92	0.01
33	688087	英科再生	1,160.00	25,473.60	0.01
34	301021	英诺激光	2,616.00	24,747.36	0.01
35	300957	贝泰妮	90.00	22,676.40	0.01
36	001207	联科科技	682.00	22,581.02	0.01
37	300911	亿田智能	309.00	21,407.52	0.01
38	688226	威腾电气	2,693.00	17,289.06	0.01

39	300913	兆龙互连	630.00	16,506.00	0.01
40	605098	行动教育	289.00	16,262.03	0.01
41	605196	华通线缆	1,172.00	16,079.84	0.01
42	605300	佳禾食品	576.00	16,012.80	0.01
43	300953	震裕科技	154.00	15,376.90	0.01
44	300982	苏文电能	317.00	14,356.93	0.01
45	605180	华生科技	384.00	14,208.00	0.01
46	605319	无锡振华	764.00	13,706.16	0.01
47	001208	华菱线缆	1,754.00	13,558.42	0.01
48	300940	南极光	307.00	13,317.66	0.01
49	300925	法本信息	493.00	12,960.97	0.01
50	301015	百洋医药	323.00	12,542.09	0.01
51	300932	三友联众	389.00	12,335.19	0.01
52	300909	汇创达	285.00	12,283.50	0.01
53	300973	立高食品	105.00	12,149.55	0.01
54	300941	创识科技	224.00	11,186.56	0.01
55	605287	德才股份	349.00	11,014.44	0.01
56	605289	罗曼股份	380.00	10,959.20	0.01
57	300918	南山智尚	974.00	10,139.34	0.00
58	300917	特发服务	365.00	10,095.90	0.00
59	300922	天秦装备	277.00	9,647.91	0.00
60	300962	中金辐照	576.00	9,429.12	0.00
61	300952	恒辉安防	340.00	9,207.20	0.00
62	001202	炬申股份	459.00	9,014.76	0.00
63	300926	博俊科技	359.00	7,969.80	0.00
64	300971	博亚精工	245.00	6,931.05	0.00
65	300978	东箭科技	490.00	6,664.00	0.00
66	300975	商络电子	492.00	6,410.76	0.00
67	301011	华立科技	175.00	5,922.00	0.00
68	300943	春晖智控	255.00	5,867.55	0.00
69	300993	玉马遮阳	287.00	5,536.23	0.00
70	300929	华骐环保	183.00	5,407.65	0.00
71	300998	宁波方正	201.00	4,285.32	0.00
72	300992	泰福泵业	200.00	4,064.00	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	000333	美的集团	1,938,290.00	0.53

2	000858	五粮液	1,591,393.00	0.44
3	300750	宁德时代	1,399,311.00	0.39
4	002352	顺丰控股	940,165.00	0.26
5	300760	迈瑞医疗	922,320.00	0.25
6	600436	片仔癀	841,715.00	0.23
7	601816	京沪高铁	828,259.00	0.23
8	601318	中国平安	820,481.00	0.23
9	002594	比亚迪	746,424.55	0.21
10	300999	金龙鱼	677,601.00	0.19
11	300122	智飞生物	664,997.00	0.18
12	300015	爱尔眼科	648,412.00	0.18
13	002714	牧原股份	611,800.00	0.17
14	300759	康龙化成	596,344.00	0.16
15	600036	招商银行	588,286.00	0.16
16	002475	立讯精密	585,497.00	0.16
17	002304	洋河股份	584,618.00	0.16
18	601658	邮储银行	577,692.00	0.16
19	000001	平安银行	573,395.00	0.16
20	000002	万科 A	567,607.00	0.16

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。

7.4.2 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	000858	五粮液	5,681,160.32	1.57
2	300750	宁德时代	4,903,090.60	1.35
3	002415	海康威视	4,272,123.00	1.18
4	600519	贵州茅台	2,942,360.00	0.81
5	000001	平安银行	2,201,326.36	0.61
6	300760	迈瑞医疗	2,103,722.80	0.58
7	002594	比亚迪	2,065,546.20	0.57
8	002304	洋河股份	2,052,193.40	0.57
9	002475	立讯精密	1,909,935.29	0.53
10	002714	牧原股份	1,871,755.10	0.52
11	300015	爱尔眼科	1,827,038.80	0.50
12	000568	泸州老窖	1,766,090.50	0.49
13	002352	顺丰控股	1,740,009.18	0.48
14	000002	万科 A	1,645,922.00	0.45
15	600690	海尔智家	1,635,030.00	0.45

16	300059	东方财富	1,537,629.99	0.42
17	300122	智飞生物	1,501,197.49	0.41
18	002142	宁波银行	1,195,727.98	0.33
19	002271	东方雨虹	1,181,228.78	0.33
20	601766	中国中车	1,139,000.00	0.31

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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	66,798,404.61
卖出股票的收入（成交）总额	135,934,373.69

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 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）	366,246.94	0.17
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	366,246.94	0.17

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	113042	上银转债	1,240	126,827.20	0.06
2	113050	南银转债	930	93,000.00	0.04
3	110079	杭银转债	810	92,234.70	0.04
4	123107	温氏转债	504	54,185.04	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

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
IF2107	IF2107	7.00	10,901,520.00	-12,600.00	-
公允价值变动总额合计					-12,600.00
股指期货投资本期收益					1,384,041.55
股指期货投资本期公允价值变动					-793,386.00

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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 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投资。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

7.13.2 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。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,423,003.53
2	应收证券清算款	196,768.97
3	应收股利	-
4	应收利息	1,828.56
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,621,601.06

7.13.4 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。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.13.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.13.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688686	奥普特	472,648.00	0.22	新股锁定期内
2	688680	海优新材	296,229.76	0.14	新股锁定期内
3	688617	惠泰医疗	274,704.64	0.13	新股锁定期

					内
--	--	--	--	--	---

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入的原因，投资组合报告中分项之和与合计数可能存在尾差。

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
2,040	75,356.53	88,988,616.00	57.89%	64,738,707.00	42.11%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	广发证券股份有限公司	11,964,176.00	7.78%
2	招商证券股份有限公司	8,875,068.00	5.77%
3	招商财富—青岛银行股份有限公司—招商财富—青新一号专项资产管理计划	8,193,300.00	5.33%
4	东方证券股份有限公司	3,213,719.00	2.09%
5	中航安盟财产保险有限公司—自有资金	2,547,800.00	1.66%
6	中泰证券股份有限公司	2,189,059.00	1.42%
7	陈永军	2,009,000.00	1.31%
8	纪少健	2,000,000.00	1.30%
9	陈茂春	1,500,000.00	0.98%
10	孙奇峰	1,250,800.00	0.81%

注：前十名持有人为除上投摩根 MSCI 中国 A 股 ETF 联接基金之外的前十名持有人。

8.3 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	0.00	0.0000%

8.4 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的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020年5月13日）基金份额总额	744,727,323.00
本报告期期初基金份额总额	270,727,323.00
本报告期基金总申购份额	21,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	138,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	153,727,323.00

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：2021年1月26日，根据工作安排，陈正涛先生不再担任平安银行股份有限公司资产托管事业部总裁。2021年2月26日，平安银行股份有限公司任命黄伟先生担任资产托管事业部副总裁（主持工作）。

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	
中信证券	4	199,386,024.96	100.00%	125,873.36	100.00%	-

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. 本基金本年度无新增席位，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	
	成交金额	占当期债券成交总额	成交金额	占当期回购成交总额	成交金额	占当期权证成交总额

		额的比例		额的比例		额的比例
中信证券	345,153.10	100.00%	-	-	-	-

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 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	基金管理人公司网站及本基金选定的信息披露报纸	2021-01-08
2	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	2021-02-19
3	上投摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金增聘基金经理公告	同上	2021-02-20
4	上投摩根基金管理有限公司关于修改公司旗下 5 只指数基金基金合同的公告	同上	2021-03-31

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
联接基金	1	20210101-20210630	96,270,800.00	1,472,000.00	48,689,000.00	49,053,800.00	31.91%
产品特有风险							
本基金的集中度风险主要体现在有单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%，如果投资者发生大额赎回，可能出现基金可变现资产无法满足投资者赎回需要以及因为资产变现成本过高导致投资者的利益受到损害的风险。							

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一)中国证监会准予上投摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件
- (二)上投摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- (三)上投摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- (四)法律意见书

- (五)基金管理人业务资格批件、营业执照
- (六)基金托管人业务资格批件、营业执照
- (七)上投摩根基金管理有限公司开放式基金业务规则
- (八)中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

上投摩根基金管理有限公司

二〇二一年八月三十一日