

**上投摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金**  
**2021 年年度报告**  
**2021 年 12 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：平安银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年三月三十一日

## §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。本年度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 2022 年 3 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。

本报告中财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	8
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
<b>§4 管理人报告</b>	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
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	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
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	18
<b>§5 托管人报告</b>	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	18
<b>§6 审计报告</b>	18
6.1 审计意见	19
6.2 形成审计意见的基础	19
6.3 管理层对财务报表的责任	19
6.4 注册会计师的责任	19
<b>§7 年度财务报表</b>	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	24
7.4 报表附注	25
<b>§8 投资组合报告</b>	56
8.1 期末基金资产组合情况	56
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	57
8.3 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	59
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	71
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	73

8.6	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 .....	74
8.7	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 .....	74
8.8	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 .....	74
8.9	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 .....	74
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	74
8.12	投资组合报告附注 .....	75
<b>§9</b>	<b>基金份额持有人信息</b> .....	<b>76</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	76
9.2	期末上市基金前十名持有人 .....	76
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	77
9.4	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 .....	77
<b>§10</b>	<b>开放式基金份额变动</b> .....	<b>77</b>
<b>§11</b>	<b>重大事件揭示</b> .....	<b>77</b>
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	77
11.2	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 .....	77
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	78
11.4	基金投资策略的改变 .....	78
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	78
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	78
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	78
11.8	其他重大事件 .....	79
<b>12</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>79</b>
<b>§13</b>	<b>备查文件目录</b> .....	<b>80</b>
13.1	备查文件目录 .....	80
13.2	存放地点 .....	80
13.3	查阅方式 .....	80

## §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	114,727,323.00 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</p>

	<p>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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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</p>
--	---

	<p>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</p> <p>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）自由贸易试验区富城路99号震旦国际大楼25楼	广东省深圳市福田区益田路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》
----------------	---------

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.cifm.com">http://www.cifm.com</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	中国·上海市
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、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2021 年	2020 年 5 月 13 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日
本期已实现收益	62,083,323.88	96,951,711.89
本期利润	17,565,060.92	156,181,536.98
加权平均基金份额本期利润	0.1146	0.3278
本期加权平均净值利润率	8.29%	28.35%
本期基金份额净值增长率	5.70%	33.97%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末
期末可供分配利润	47,739,869.55	61,898,584.28
期末可供分配基金份额利润	0.4161	0.2286
期末基金资产净值	162,467,192.55	362,682,843.67
期末基金份额净值	1.4161	1.3397
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末
基金份额累计净值增长率	41.61%	33.97%

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

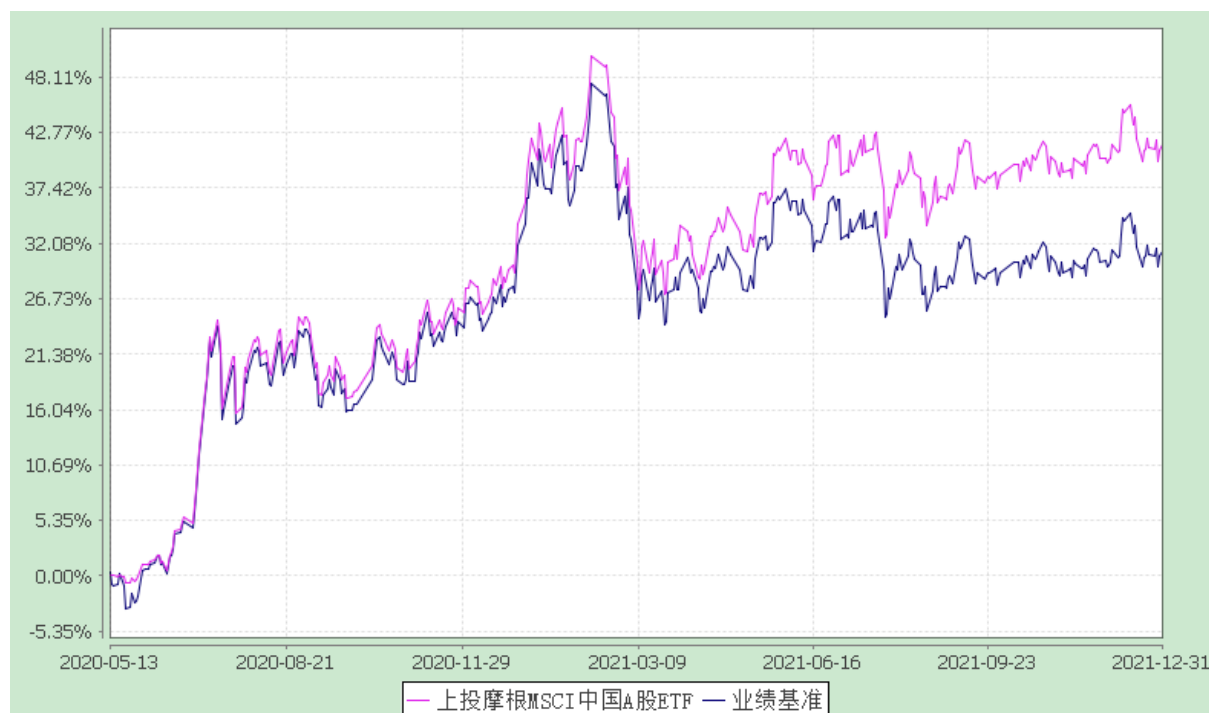
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	2.15%	0.75%	1.57%	0.75%	0.58%	0.00%
过去六个月	-0.62%	0.97%	-3.66%	0.98%	3.04%	-0.01%
过去一年	5.70%	1.15%	-0.40%	1.16%	6.10%	-0.01%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	41.61%	1.17%	31.32%	1.21%	10.29%	-0.04%

#### 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

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2020 年 5 月 13 日至 2021 年 12 月 31 日)



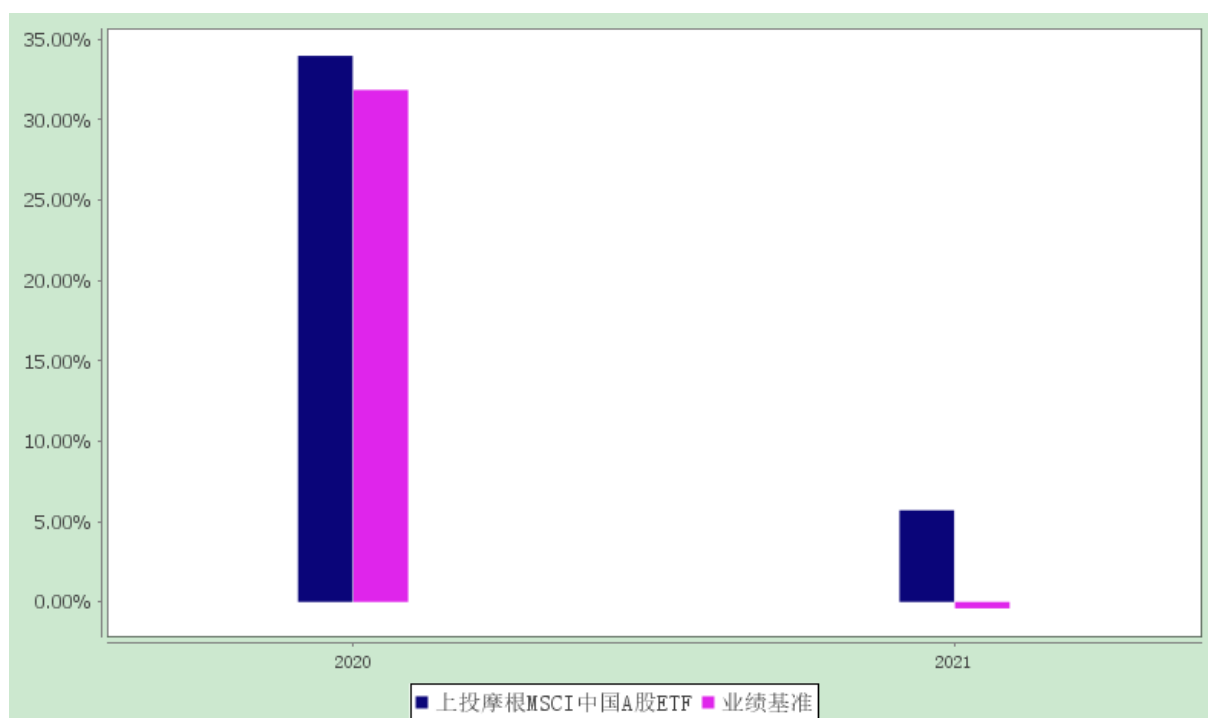
注：本基金合同生效日为 2020 年 5 月 13 日，图示的时间段为合同生效日至本报告期末。

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。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

上投摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

## §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 12 月底，

公司旗下运作的基金共有七十九只，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、上投摩根安荣回报混合型证券投资基金、上投摩根中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、上投摩根景气甄选混合型证券投资基金、上投摩根均衡优选混合型证券投资基金、上投摩根中证沪港深科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、上投摩根月月盈 30 天滚动持有发起式短债债券型证券投资基金、上投摩根恒生科技交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)。

#### 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

					<p>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	-	14 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，自 2021 年 11 月起同时担任上投摩根富时发达市场 REITs 指数型证券投资</p>

					基金（QDII）、上投摩根中证沪港深科技 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 12 月起同时担任上投摩根恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理。
何智豪	本基金基金经理	2021-02-19	-	8 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，自 2021 年 12 月起同时担任上投摩根中证沪港深科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、上投摩根恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理。
张皓	本基金基金经理助理	2020-12-22	-	7.5 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 公平交易制度和控制方法

本公司按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规的要求，制订了《上投摩根基金管理有限公司公平交易制度》，规范了公司所管理的所有投资组合的股票、债券等投资品种的投资管理活动，同时涵盖了授权、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各个环节，以确保本公司管理的不同投资组合均得到公平对待。

公司执行自上而下的三级授权体系，依次为投资决策委员会、投资总监、经理人，经理人在其授权范围内自主决策，投资决策委员会和投资总监均不得干预其授权范围内的投资活动。公司已建立客观的研究方法，严禁利用内幕信息作为投资依据，各投资组合享有公平的投资决策机会。公司建立集中交易制度，执行公平交易分配。对于交易所市场投资活动，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机会；对于银行间市场投资活动，通过交易对手库控制和交易室询价机制，严格防范交易对手风险并抽检价格公允性；对于一级市场申购投资行为，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。

公司制订了《异常交易监控与报告制度》，通过系统和人工相结合的方式对投资交易行为的监控分析，并执行异常交易行为监控分析记录工作机制，确保公平交易可稽核。公司分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的收益率差异及不同时间窗下同向交易的交易价差进行分析，并留存报告备查。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行上述公平交易制度和控制方法，开展公平交易工作。通过对不同投资组合之间的收益率差异、以及不同投资组合之间同向交易和反向交易的交易时机和交易价差等方面的监控分析，公司未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

其中，在同向交易的监控和分析方面，根据法规要求，公司对不同投资组合的同日和临近交易日的同向交易行为进行监控，通过定期抽查前述的同向交易行为，定性分析交易时机、对比不同投资组合长期的交易趋势，重点关注任何可能导致不公平交易的情形。对于识别的异常情况，由相关投资组合经理对异常交易情况进行合理解释。同时，公司根据法规的要求，通过系统模块定期对连续四个季度内不同投资组合在不同时间窗内（日内、3 日内、5 日内）的同向交易价差进行分析，采用概率统计方法，主要关注不同投资组合之间同向交易价差均值为零的显著性检验，以及同向交易价格占优的交易次数占比分析。

报告期内，通过前述分析方法，未发现不同投资组合之间同向交易价差异异常的情况。

#### 4.3.3 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，公司未发现存在异常交易行为。

报告期内，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 年年内，本基金跟踪的 MSCI 中国 A 股指数（人民币）收跌 0.4%，同期沪深 300 指数下跌 5.2%，指数相对沪深 300 的超额收益为 4.8%。年内各个板块的结构化走势显著，其中电力设备、周期类、公用事业等板块表现强劲，而消费、金融、地产等板块收跌，申万一级行业中：电力设备、有色金属、采掘指数分别上涨 47.86%、40.47%、38.07%，家电、非银金融、房地产指数分别下跌 19.54%、17.55%、11.89%。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:5.70%，同期业绩比较基准收益率为:-0.40%。



#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021 年 12 月份以来，A 股受抑制于海外市场风险和国内经济压力等因素，出现较为显著的调整。展望后市，A 股超跌令其具有配置价值。从政策方面，稳增长成为政策基调，财政与货币政策积极发力；资金面上，随着降准的落地，货币政策边际趋松；随着区域全面经济伙伴关系协定(RCEP)落地生效，中国经济“外循环”的韧性有望增强。后续主要的风险来自于 Omicron 疫情变种的反复，以及美联储加息节奏的变化。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人在内部监察稽核工作中以继续坚持“建立风险综合防控机制、保障合规诚信、支持业务发展、提高工作水平”为总体目标，一切从合规运作、保障基金份额持有人利益出发，由独立的监察稽核部门按照工作计划结合实际情况对公司各项业务进行全面的监察稽核工作，保障和促进公司各项业务合法合规运作，推动内部控制机制的完善与优化，保证各项法规和管理制度的落实，发现问题及时提出建议并督促有关部门改进。

在本报告期内，本基金管理人内部监察稽核工作贯穿三条主线：

1. 注意密切追踪监管法规政策变化和监管新要求，组织员工学习理解监管精神，推动公司各部门完善制度建设和业务流程，防范日常运作中的违规行为发生。
2. 继续紧抓员工行为、公平交易、利益冲突等方面的日常监控，坚守“三条底线”不动摇；进一步加强内部合规培训和合规宣传，强化合规意识，规范员工行为操守，严格防范利益冲突。
3. 针对风险控制的需求和重点，强化内部审计，提高内部审计工作的水平和效果；按照监管部门的要求，严格推行风险控制自我评估制度，对控制不足的风险点，制订了进一步的控制措施。

在本报告期内的监察稽核工作中，未发现基金投资运作存在违法违规或未履行基金合同承诺从而对基金份额持有人利益的情形。

公司自成立以来，各项业务运作正常，内部控制和风险防范措施逐步完善并积极发挥作用。本基金运作合法合规，保障了基金份额持有人的利益。我们将继续以合规运作和风险管理为核心，提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金份额持有人的利益。

#### 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，所有相关成员均具有丰富的证券投资基金行业从业经验。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

无。

#### 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，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 托管人对本年度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 审计报告

普华永道中天审字(2022)第 22693 号

上投摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

## 6.1 审计意见

我们审计了上投摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“上投摩根 MSCI 中国 A 股 ETF 基金”)的财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了上投摩根 MSCI 中国 A 股 ETF 基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。

## 6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于上投摩根 MSCI 中国 A 股 ETF 基金,并履行了职业道德方面的其他责任。

## 6.3 管理层对财务报表的责任

上投摩根 MSCI 中国 A 股 ETF 基金的基金管理人上投摩根基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估上投摩根 MSCI 中国 A 股 ETF 基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算上投摩根 MSCI 中国 A 股 ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督上投摩根 MSCI 中国 A 股 ETF 基金的财务报告过程。

## 6.4 注册会计师的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也

执行以下工作：

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对上投摩根 MSCI 中国 A 股 ETF 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致上投摩根 MSCI 中国 A 股 ETF 基金不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

中国注册会计师

陈熹 金诗涛

中国·上海市

2022 年 3 月 29 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	10,606,177.32	15,476,548.13
结算备付金		3,380,756.73	2,713,542.23
存出保证金		1,285,019.45	2,134,598.10
交易性金融资产	7.4.7.2	148,370,215.92	347,448,057.14
其中：股票投资		147,785,339.40	347,107,057.14
基金投资		-	-
债券投资		584,876.52	341,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		342,066.94	512,493.90
应收利息	7.4.7.5	2,415.91	2,272.15
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>163,986,652.27</b>	<b>368,287,511.65</b>
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		557,745.36	251,040.36

应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		21,687.14	53,870.60
应付托管费		7,229.05	17,956.89
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	34,691.14	106,862.82
应交税费		0.35	5,780.46
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	898,106.68	5,169,156.85
<b>负债合计</b>		<b>1,519,459.72</b>	<b>5,604,667.98</b>
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	7.4.7.9	114,727,323.00	270,727,323.00
未分配利润	7.4.7.10	47,739,869.55	91,955,520.67
<b>所有者权益合计</b>		<b>162,467,192.55</b>	<b>362,682,843.67</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>163,986,652.27</b>	<b>368,287,511.65</b>

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日,基金份额净值 1.4161 元,基金份额总额 114,727,323.00 份。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 5 月 13 日（基 金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		<b>18,729,853.27</b>	<b>159,023,592.12</b>
1.利息收入		61,185.33	192,302.53
其中：存款利息收入	7.4.7.11	60,628.21	192,273.08
债券利息收入		557.12	29.45

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）		62,648,651.15	97,557,697.76
其中：股票投资收益	7.4.7.12	58,508,976.85	89,730,935.59
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	4,088.82	7,304.45
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	1,328,841.55	292,887.38
股利收益	7.4.7.15	2,806,743.93	7,526,570.34
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-44,518,262.96	59,229,825.09
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	538,279.75	2,043,766.74
<b>减：二、费用</b>		<b>1,164,792.35</b>	<b>2,842,055.14</b>
1. 管理人报酬		319,825.61	519,688.56
2. 托管费		106,608.56	173,229.52
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	435,605.14	1,834,453.07
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		5,643.41	1,054.47
7. 其他费用	7.4.7.19	297,109.63	313,629.52
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>17,565,060.92</b>	<b>156,181,536.98</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>17,565,060.92</b>	<b>156,181,536.98</b>

## 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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）	-	17,565,060.92	17,565,060.92
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-156,000,000.00	-61,780,712.04	-217,780,712.04
其中：1.基金申购款	51,000,000.00	20,470,264.45	71,470,264.45
2.基金赎回款	-207,000,000.00	-82,250,976.49	-289,250,976.49
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）	114,727,323.00	47,739,869.55	162,467,192.55
项目	上年度可比期间		
	2020 年 5 月 13 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 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）	-	156,181,536.98	156,181,536.98
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）	-474,000,000.00	-64,226,016.31	-538,226,016.31
其中：1.基金申购款	339,000,000.00	57,131,569.98	396,131,569.98
2.基金赎回款	-813,000,000.00	-121,357,586.29	-934,357,586.29
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）	270,727,323.00	91,955,520.67	362,682,843.67

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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]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》准予注册，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。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 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，本基金的投资范围为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)、存托凭证、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%。股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。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 2022 年 3 月 29 日批准报出。

#### 7.4.2 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 7.4.4 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。

### 7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较财务报表的实际编制期间为 2020 年 5 月 13 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

## (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行

调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### **7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### **7.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### **7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支

持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。当基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1% 以上时，可进行收益分配；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；本基金收益每年最多分配 12 次。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### **7.4.4.12 分部报告**

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则

合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 14 号—收入》，本基金于 2021 年 1 月 1 日起执行。本基金在编制 2021 年度财务报表时已采用该准则，该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

##### 7.4.5.2 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。

### 7.4.5.3 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。

### 7.4.6 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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
活期存款	10,606,177.32	15,476,548.13
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	10,606,177.32	15,476,548.13

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2021 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	132,970,013.79	147,785,339.40	14,815,325.61	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	523,400.00	584,876.52	61,476.52
	银行间市场	-	-	-
	合计	523,400.00	584,876.52	61,476.52

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	133,493,413.79	148,370,215.92	14,876,802.13
项目	上年度末		
	2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	288,658,018.05	347,107,057.14	58,449,039.09
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	341,000.00	341,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	341,000.00	341,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	288,999,018.05	347,448,057.14	58,449,039.09

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末			
	2021 年 12 月 31 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	10,561,500.00	-	-	-
-股指期货	10,561,500.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-

合计	10,561,500.00	-	-	-
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 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	13,302,954.00	-	-	-
—股指期货	13,302,954.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	13,302,954.00	-	-	-

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 12 月 31 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
IF2203	IF2203	7	10,396,260.00	-165,240.00
	减：可抵销期货暂收款			-165,240.00
	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。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	1,105.93	1,435.38
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	767.86	589.86
应收债券利息	523.53	26.91

应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	18.59	220.00
合计	2,415.91	2,272.15

#### 7.4.7.6 其他资产

无余额。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	34,691.14	106,862.82
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	34,691.14	106,862.82

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 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	180,000.00	140,000.00
应付指数使用费	21,276.90	62,269.17
应付替代款	696,829.78	4,966,887.68
合计	898,106.68	5,169,156.85

#### 7.4.7.9 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 12 月 31 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	51,000,000.00	51,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-207,000,000.00	-207,000,000.00
本期末	114,727,323.00	114,727,323.00

注：截至 2021 年 12 月 31 日止，本基金于上交所上市的基金份额为 114,727,323.00 份(2020 年 12 月 31 日：270,727,323.00 份)，无托管在场外未上市交易的基金份额(2020 年 12 月 31 日：同)。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。**7.4.7.10 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	62,083,323.88	-44,518,262.96	17,565,060.92
本期基金份额交易产生的变动数	-58,251,124.99	-3,529,587.05	-61,780,712.04
其中：基金申购款	23,416,642.87	-2,946,378.42	20,470,264.45
基金赎回款	-81,667,767.86	-583,208.63	-82,250,976.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	65,730,783.17	-17,990,913.62	47,739,869.55

**7.4.7.11 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 5 月 13 日（基金合同 生效日）至 2020 年 12 月 31

		日
活期存款利息收入	34,339.49	170,141.94
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	24,509.50	17,212.36
其他	1,779.22	4,918.78
合计	60,628.21	192,273.08

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 5 月 13 日（基金合 同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	36,115,688.52	50,390,586.12
股票投资收益——赎回差价收入	22,393,288.33	39,340,349.47
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	58,508,976.85	89,730,935.59

##### 7.4.7.12.2 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 5 月 13 日（基金合 同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	200,714,436.04	485,496,405.91
减：卖出股票成本总额	164,598,747.52	435,105,819.79
买卖股票差价收入	36,115,688.52	50,390,586.12

##### 7.4.7.12.3 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 5 月 13 日（基金合 同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	289,250,976.49	934,357,586.29

减：现金支付赎回款总额	130,493,436.49	412,026,028.29
减：赎回股票成本总额	136,364,251.67	482,991,208.53
赎回差价收入	22,393,288.33	39,340,349.47

#### 7.4.7.12.4 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年5月13日(基金合同生效日)至2020年12月31日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	345,153.10	45,407.71
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	341,000.00	38,100.00
减：应收利息总额	64.28	3.26
买卖债券差价收入	4,088.82	7,304.45

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年5月13日(基金合同生效日)至2020年12月31日
股指期货投资收益	1,328,841.55	292,887.38

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年5月13日(基金合同生效日)至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,806,743.93	7,526,570.34
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,806,743.93	7,526,570.34

## 7.4.7.16 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12月31日	上年度可比期间 2020年5月13日（基金合同生效日）至2020年12月31日
1.交易性金融资产	-43,572,236.96	58,449,039.09
——股票投资	-43,633,713.48	58,449,039.09
——债券投资	61,476.52	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-946,026.00	780,786.00
——权证投资	-	-
——股指期货	-946,026.00	780,786.00
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	-44,518,262.96	59,229,825.09

## 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年5月13日（基金合同生效日）至 2020年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	538,279.75	1,710,818.34
其他	-	332,948.40
合计	538,279.75	2,043,766.74

## 7.4.7.18 交易费用



单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年5月13日（基金合同生效日） 至2020年12月31日
交易所市场交易费用	435,605.14	1,834,453.07
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	435,605.14	1,834,453.07

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月 31日	2020年5月13日（基金合同生效日） 至2020年12月31日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
律师费	2,000.00	-
指数使用费	115,109.63	173,229.52
其他费用	-	400.00
合计	297,109.63	313,629.52

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.0125% 的季度费率计提，本基金标的指数许可使用费收取下限为每季度 5,000 美元或等值人民币。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 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。

## 7.4.9 关联方关系

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
上海国际信托有限公司(“上海信托”)	基金管理人的股东
摩根资产管理(英国)有限公司	基金管理人的股东
上海浦东发展银行股份有限公司(“浦发银行”)	基金管理人的股东上海国际信托有限公司的控股股东
尚腾资本管理有限公司	基金管理人的子公司
上投摩根资产管理(香港)有限公司	基金管理人的子公司
上信资产管理有限公司	基金管理人的股东上海国际信托有限公司控制的公司
上海国利货币经纪有限公司	基金管理人的股东上海国际信托有限公司控制的公司
J.P. Morgan 8CS Investments (GP) Limited	基金管理人的股东摩根资产管理(英国)有限公司控制的公司
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。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

## 7.4.10.2 关联方报酬

## 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年5月13日（基金合同 生效日）至2020年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	319,825.61	519,688.56
其中：支付销售机构的客户维护费	12,579.70	12,575.02

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。

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年5月13日（基金合同 生效日）至2020年12月31 日
当期发生的基金应支付的托管费	106,608.56	173,229.52

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：

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

**7.4.10.2.3 销售服务费**

无。

**7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

无。

**7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**

**7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

无。

**7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况**

无。

**7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**

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

无

**7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021 年 12 月 31 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	持有的基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例

		例		
上投摩根 MSCI 中国 A 股 ETF 联接	34,967,800.00	30.48%	96,270,800.00	35.56%

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年5月13日（基金合同生效日） 至2020年12月31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	10,606,177.32	34,339.49	15,476,548.13	170,141.94

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

(1) 于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有 64,000 股平安银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 1,012,157.58 元，估值总额为人民币 1,054,720.00 元，占基金资产净值的比例为 0.65%(2020 年 12 月 31 日：本基金持有 161,500 股平安银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 2,196,770.70 元，估值总额为人民币 3,123,410.00 元，占基金资产净值的比例为 0.8612%)。

(2) 于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有 97,515 股浦发银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 973,326.61 元，估值总额为人民币 831,802.95 元，占基金资产净值的比例为 0.51%(2020 年 12 月 31 日：本基金持有 243,815 股浦发银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 2,566,303.79 元，估值总额为人民币 2,360,129.20 元，占基金资产净值的比例为 0.6507%)。

##### 7.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

无。

## 7.4.12 期末（2021 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300774	倍杰特	2021-07-26	2022-02-16	新股锁定期内	4.57	21.08	444.00	2,029.08	9,359.52	-
300854	中兰环保	2021-09-08	2022-03-16	新股锁定期内	9.96	27.29	203.00	2,021.88	5,539.87	-
300994	久祺股份	2021-08-02	2022-02-14	新股锁定期内	11.90	45.45	215.00	2,558.50	9,771.75	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	新股锁定期内	8.86	23.80	464.00	4,111.04	11,043.20	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	新股锁定期内	8.29	26.06	648.00	5,371.92	16,886.88	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	新股锁定期内	10.64	30.44	360.00	3,830.40	10,958.40	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新股锁定期内	9.46	41.43	262.00	2,478.52	10,854.66	-
301025	读客文化	2021-07-06	2022-01-24	新股锁定期内	1.55	20.88	403.00	624.65	8,414.64	-
301026	浩通科技	2021-07-08	2022-01-17	新股锁定期内	18.03	62.73	157.00	2,830.71	9,848.61	-
301027	华蓝集团	2021-07-08	2022-01-19	新股锁定期内	11.45	16.65	250.00	2,862.50	4,162.50	-

301028	东亚机械	2021-07-12	2022-01-20	新股锁定期内	5.31	13.50	401.00	2,129.31	5,413.50	-
301030	仕净科技	2021-07-15	2022-01-24	新股锁定期内	6.10	31.52	242.00	1,476.20	7,627.84	-
301032	新柴股份	2021-07-15	2022-01-24	新股锁定期内	4.97	12.51	513.00	2,549.61	6,417.63	-
301033	迈普医学	2021-07-15	2022-01-26	新股锁定期内	15.14	59.97	108.00	1,635.12	6,476.76	-
301037	保立佳	2021-07-21	2022-02-07	新股锁定期内	14.82	24.26	177.00	2,623.14	4,294.02	-
301038	深水规院	2021-07-22	2022-02-07	新股锁定期内	6.68	20.23	266.00	1,776.88	5,381.18	-
301039	中集车辆	2021-07-01	2022-01-10	新股锁定期内	6.96	12.51	499.00	3,473.04	6,242.49	-
301046	能辉科技	2021-08-10	2022-02-17	新股锁定期内	8.34	48.99	241.00	2,009.94	11,806.59	-
301048	金鹰重工	2021-08-11	2022-02-28	新股锁定期内	4.13	12.96	496.00	2,048.48	6,428.16	-
301056	森赫股份	2021-08-27	2022-03-07	新股锁定期内	3.93	11.09	572.00	2,247.96	6,343.48	-
301057	汇隆新材	2021-08-31	2022-03-09	新股锁定期内	8.03	19.02	182.00	1,461.46	3,461.64	-
301059	金三江	2021-09-03	2022-03-14	新股锁定期内	8.09	19.30	243.00	1,965.87	4,689.90	-
301062	上海艾录	2021-09-07	2022-03-14	新股锁定期内	3.31	17.01	523.00	1,731.13	8,896.23	-
301063	海锅股份	2021-09-09	2022-03-24	新股锁定期内	17.40	36.11	124.00	2,157.60	4,477.64	-
301068	大地海洋	2021-09-16	2022-03-28	新股锁定	13.98	28.38	144.00	2,013.12	4,086.72	-

				期内						
301072	中捷精工	2021-09-22	2022-03-29	新股锁定期内	7.46	33.41	181.00	1,350.26	6,047.21	-
301073	君亭酒店	2021-09-22	2022-03-30	新股锁定期内	12.24	32.00	123.00	1,505.52	3,936.00	-
301079	邵阳液压	2021-10-11	2022-04-19	新股锁定期内	11.92	24.82	140.00	1,668.80	3,474.80	-
301089	拓新药业	2021-10-20	2022-04-27	新股锁定期内	19.11	67.93	130.00	2,484.30	8,830.90	-
301188	力诺特玻	2021-11-04	2022-05-11	新股锁定期内	13.00	20.48	289.00	3,757.00	5,918.72	-
688622	禾信仪器	2021-09-03	2022-03-14	新股锁定期内	17.70	56.93	1,204.00	21,310.80	68,543.72	-
688800	瑞可达	2021-07-14	2022-01-24	新股锁定期内	15.02	133.53	1,549.00	23,265.98	206,837.97	-
<b>7.4.12.1.2 受限证券类别：债券</b>										
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
113052	兴业转债	2021-12-27	2022-01-14	老股东配债	100.00	100.00	1,750.00	175,000.00	175,000.00	-

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、以上可流通日的日期为预估日期，最终以上市公司公告为准。

#### **7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

无。

#### **7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

##### **7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

无。

##### **7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

无。

#### **7.4.13 金融工具风险及管理**

##### **7.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金为股票型指数基金，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。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通过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。

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；风险管理部负责建立并完善公司市场风险、流动性风险、信用风险管理框架，运用系统化分析工具对以上进行分析和识别，提升公司风险科技水平。运营风险管理部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。投资准则管理部负责执行和管控投资准则，通过设立投资准则、事前管控、事后管控，保障基金投资运作符合法规、合同及公司内部要求。

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。

#### 7.4.13.2 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 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.36%(2020 年 12 月 31 日：0.09%)。

#### 7.4.13.3 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 12 月 31 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。

#### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 7.4.13.3.2 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 7.4.12。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 12 月 31 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 0.41%。

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 12 月 31 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 158,365,425.43 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	10,606,177.32	-	-	-	10,606,177.32
结算备付金	3,380,756.73	-	-	-	3,380,756.73
存出保证金	37,468.25	-	-	1,247,551.20	1,285,019.45
交易性金融资产	-	-	584,876.52	147,785,339.40	148,370,215.92
买入返售金融资产	-	-	-	-	-

应收证券清算款	-	-	-	342,066.94	342,066.94
应收利息	-	-	-	2,415.91	2,415.91
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	14,024,402.30	-	584,876.52	149,377,373.45	163,986,652.27
负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	557,745.36	557,745.36
应付管理人报酬	-	-	-	21,687.14	21,687.14
应付托管费	-	-	-	7,229.05	7,229.05
应付交易费用	-	-	-	34,691.14	34,691.14
应付税费	-	-	-	0.35	0.35
其他负债	-	-	-	898,106.68	898,106.68
负债总计	-	-	-	1,519,459.72	1,519,459.72
利率敏感度缺口	14,024,402.30	-	584,876.52	147,857,913.73	162,467,192.55
<b>上年度末</b>					
<b>2020 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
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

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.36%(2020 年 12 月 31 日：0.09%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2020 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 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或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过完全复制策略进行被动式指数化投资，根据标的指数成份股的基准权重构建股票资产组合，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。在投资运作过程中，本基金根据成份股构成及其权重的变动进行动态调整。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中标的指数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%。股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。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。

## 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 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	147,785,339.40	90.96	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	584,876.52	0.36	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	-	-	-	-
合计	148,370,215.92	91.32	347,448,057.14	95.80

## 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
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 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	增加约 802	增加约 1,958
2. 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	减少约 802	减少约 1,958	

## 7.4.14 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 12 月 31 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 147,702,742.79 元，属于第二层次的余额为 175,000.00 元，属于第三层次的余额为 492,473.13 元(2020 年 12 月 31 日：第一层次 346,492,630.79 元，第二层次 955,426.35 元，无第三层次)。

(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

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有公允价值归属于第三层次的金融工具 492,473.13 元(2020 年 12 月 31 日：无)。本基金本年度购买第三层次的金融工具 115,360.72 元(2020 年 5 月 13 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间：无)，计入损益的第三层次的金融工具公允价值变动损益 377,112.41 元(2020 年 5 月 13 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间：无)。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产(均为证券交易所上市但尚在限售期内的股票投资)公允价值为 492,473.13 元，采用平均价格亚式期权模型进行估值，不可观察输入值为该流通受限股票在剩余限售期内的股价预期年化波动率，与公允价值之间为负相关关系。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020 年 12 月 31 日:同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 基金申购款

于 2021 年度,本基金申购基金份额的对价总额为 71,470,264.45 元(2020 年 5 月 13 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间:396,131,569.98 元),其中包括以股票支付的申购款 38,535,261.00 元和以现金支付的申购款 32,935,003.45 元(2020 年 5 月 13 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间:其中包括以股票支付的申购款 216,924,962.08 元和以现金支付的申购款 179,206,607.90 元)。

(3) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定,以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日,本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质,新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自 2022 年 1 月 1 日起追溯执行相关新规定,并采用准则允许的实务简便方法,调整期初所有者权益,2021 年的比较数据将不作重述。

(4) 除公允价值、基金申购款和执行新金融工具准则外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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	147,785,339.40	90.12
	其中：股票	147,785,339.40	90.12
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	584,876.52	0.36
	其中：债券	584,876.52	0.36
	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	13,986,934.05	8.53
8	其他各项资产	1,629,502.30	0.99
9	合计	163,986,652.27	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	1,758,357.56	1.08
B	采矿业	4,005,658.60	2.47
C	制造业	89,236,401.03	54.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,631,314.00	2.24
E	建筑业	2,360,016.60	1.45
F	批发和零售业	1,379,381.91	0.85
G	交通运输、仓储和邮政业	3,968,139.10	2.44
H	住宿和餐饮业	175,800.00	0.11

I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,504,526.30	3.39
J	金融业	26,429,735.02	16.27
K	房地产业	2,523,736.29	1.55
L	租赁和商务服务业	1,968,236.04	1.21
M	科学研究和技术服务业	1,828,840.08	1.13
N	水利、环境和公共设施管理业	342,548.00	0.21
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,275,136.88	0.78
R	文化、体育和娱乐业	595,838.30	0.37
S	综合	124,098.00	0.08
	合计	147,107,763.71	90.55

## 8.2.2 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	608,145.29	0.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	20,830.10	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	3,936.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	21,350.27	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	14,899.39	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	8,414.64	0.01
S	综合	-	-
	合计	677,575.69	0.42

### 8.3 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

#### 8.3.1 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	4,248.00	8,708,400.00	5.36
2	300750	宁德时代	7,744.00	4,553,472.00	2.80
3	600036	招商银行	68,225.00	3,323,239.75	2.05
4	000858	五粮液	13,100.00	2,916,846.00	1.80
5	601318	中国平安	36,020.00	1,815,768.20	1.12
6	600900	长江电力	75,780.00	1,720,206.00	1.06
7	002594	比亚迪	5,953.00	1,596,118.36	0.98
8	601012	隆基股份	18,000.00	1,551,600.00	0.96
9	300760	迈瑞医疗	4,067.00	1,548,713.60	0.95
10	601888	中国中免	6,344.00	1,391,937.04	0.86
11	601166	兴业银行	68,500.00	1,304,240.00	0.80
12	600809	山西汾酒	4,120.00	1,301,013.60	0.80
13	000568	泸州老窖	5,059.00	1,284,328.33	0.79
14	300059	东方财富	34,172.00	1,268,122.92	0.78
15	603288	海天味业	11,756.00	1,235,673.16	0.76
16	002475	立讯精密	23,350.00	1,148,820.00	0.71
17	002352	顺丰控股	16,300.00	1,123,396.00	0.69
18	600276	恒瑞医药	21,428.00	1,086,613.88	0.67
19	000001	平安银行	64,000.00	1,054,720.00	0.65
20	600309	万华化学	10,200.00	1,030,200.00	0.63
21	603259	药明康德	8,416.00	997,969.28	0.61

22	002714	牧原股份	18,066.00	964,001.76	0.59
23	601398	工商银行	206,900.00	957,947.00	0.59
24	600030	中信证券	35,100.00	926,991.00	0.57
25	603501	韦尔股份	2,827.00	878,546.79	0.54
26	600436	片仔癀	2,000.00	874,300.00	0.54
27	600887	伊利股份	20,300.00	841,638.00	0.52
28	002304	洋河股份	5,083.00	837,322.59	0.52
29	600000	浦发银行	97,515.00	831,802.95	0.51
30	002142	宁波银行	21,484.00	822,407.52	0.51
31	002812	恩捷股份	3,100.00	776,240.00	0.48
32	300015	爱尔眼科	18,146.00	767,212.88	0.47
33	600406	国电南瑞	19,080.00	763,772.40	0.47
34	300014	亿纬锂能	6,245.00	738,034.10	0.45
35	601919	中远海控	39,190.00	732,461.10	0.45
36	601288	农业银行	245,900.00	722,946.00	0.44
37	300274	阳光电源	4,800.00	699,840.00	0.43
38	601668	中国建筑	138,000.00	690,000.00	0.42
39	300122	智飞生物	5,386.00	671,095.60	0.41
40	601899	紫金矿业	68,400.00	663,480.00	0.41
41	600438	通威股份	14,693.00	660,597.28	0.41
42	601816	京沪高铁	134,000.00	647,220.00	0.40
43	600031	三一重工	28,200.00	642,960.00	0.40
44	000002	万科 A	32,437.00	640,955.12	0.39
45	000725	京东方 A	123,900.00	625,695.00	0.39
46	002241	歌尔股份	11,500.00	622,150.00	0.38
47	600048	保利发展	39,800.00	622,074.00	0.38
48	601601	中国太保	22,600.00	612,912.00	0.38
49	600690	海尔智家	20,400.00	609,756.00	0.38
50	002493	荣盛石化	33,047.00	600,133.52	0.37
51	601328	交通银行	129,500.00	596,995.00	0.37
52	300124	汇川技术	8,650.00	593,390.00	0.37
53	600111	北方稀土	12,600.00	577,080.00	0.36
54	600893	航发动力	8,600.00	545,756.00	0.34
55	600745	闻泰科技	4,200.00	543,060.00	0.33
56	600019	宝钢股份	75,000.00	537,000.00	0.33
57	600104	上汽集团	25,900.00	534,317.00	0.33
58	002460	赣锋锂业	3,720.00	531,402.00	0.33
59	600585	海螺水泥	13,047.00	525,794.10	0.32
60	002371	北方华创	1,500.00	520,530.00	0.32
61	601088	中国神华	21,800.00	490,936.00	0.30
62	601766	中国中车	78,100.00	475,629.00	0.29
63	002459	晶澳科技	5,100.00	472,770.00	0.29
64	000776	广发证券	19,100.00	469,669.00	0.29
65	603799	华友钴业	4,200.00	463,302.00	0.29

66	600016	民生银行	116,600.00	454,740.00	0.28
67	601818	光大银行	135,600.00	450,192.00	0.28
68	601658	邮储银行	87,700.00	447,270.00	0.28
69	600028	中国石化	105,400.00	445,842.00	0.27
70	002129	中环股份	10,602.00	442,633.50	0.27
71	601211	国泰君安	24,700.00	441,883.00	0.27
72	000538	云南白药	4,200.00	439,530.00	0.27
73	600999	招商证券	24,493.00	432,301.45	0.27
74	600010	包钢股份	154,200.00	430,218.00	0.26
75	000063	中兴通讯	12,800.00	428,800.00	0.26
76	600346	恒力石化	18,600.00	427,242.00	0.26
77	601688	华泰证券	23,900.00	424,464.00	0.26
78	601066	中信建投	14,300.00	418,275.00	0.26
79	603806	福斯特	3,200.00	417,760.00	0.26
80	601669	中国电建	51,500.00	416,120.00	0.26
81	300498	温氏股份	21,280.00	409,852.80	0.25
82	002311	海大集团	5,500.00	403,150.00	0.25
83	600050	中国联通	101,600.00	399,288.00	0.25
84	002230	科大讯飞	7,600.00	399,076.00	0.25
85	000338	潍柴动力	22,300.00	398,947.00	0.25
86	601985	中国核电	48,000.00	398,400.00	0.25
87	002027	分众传媒	48,600.00	398,034.00	0.24
88	601225	陕西煤业	32,400.00	395,280.00	0.24
89	002821	凯莱英	900.00	391,500.00	0.24
90	600837	海通证券	31,900.00	391,094.00	0.24
91	601390	中国中铁	67,300.00	389,667.00	0.24
92	603659	璞泰来	2,400.00	385,464.00	0.24
93	002049	紫光国微	1,700.00	382,500.00	0.24
94	000661	长春高新	1,400.00	379,960.00	0.23
95	601877	正泰电器	7,000.00	377,230.00	0.23
96	300433	蓝思科技	16,400.00	376,872.00	0.23
97	000166	申万宏源	73,600.00	376,832.00	0.23
98	300896	爱美客	700.00	375,277.00	0.23
99	603986	兆易创新	2,132.00	374,912.20	0.23
100	300782	卓胜微	1,140.00	372,552.00	0.23
101	688111	金山办公	1,400.00	371,000.00	0.23
102	002709	天赐材料	3,190.00	365,733.50	0.23
103	600588	用友网络	10,131.00	363,500.28	0.22
104	601100	恒立液压	4,366.00	357,138.80	0.22
105	001979	招商蛇口	26,501.00	353,523.34	0.22
106	601988	中国银行	115,900.00	353,495.00	0.22
107	300413	芒果超媒	6,135.00	351,044.70	0.22
108	601857	中国石油	71,400.00	350,574.00	0.22
109	601633	长城汽车	7,200.00	349,488.00	0.22

110	600150	中国船舶	14,000.00	347,060.00	0.21
111	688036	传音控股	2,200.00	345,180.00	0.21
112	000596	古井贡酒	1,400.00	341,600.00	0.21
113	600989	宝丰能源	19,300.00	335,048.00	0.21
114	601229	上海银行	46,766.00	333,441.58	0.21
115	600196	复星医药	6,500.00	318,110.00	0.20
116	000625	长安汽车	20,920.00	317,774.80	0.20
117	603993	洛阳钼业	56,900.00	317,502.00	0.20
118	300759	康龙化成	2,200.00	310,794.00	0.19
119	601169	北京银行	69,900.00	310,356.00	0.19
120	603392	万泰生物	1,400.00	310,100.00	0.19
121	300999	金龙鱼	4,900.00	308,357.00	0.19
122	600660	福耀玻璃	6,500.00	306,410.00	0.19
123	000895	双汇发展	9,600.00	302,880.00	0.19
124	600570	恒生电子	4,860.00	302,049.00	0.19
125	601360	三六零	23,299.00	296,363.28	0.18
126	601009	南京银行	32,700.00	292,992.00	0.18
127	002050	三花智控	11,550.00	292,215.00	0.18
128	300316	晶盛机电	4,200.00	291,900.00	0.18
129	600958	东方证券	19,700.00	290,378.00	0.18
130	600741	华域汽车	10,200.00	288,660.00	0.18
131	300142	沃森生物	5,100.00	286,620.00	0.18
132	000100	TCL 科技	46,100.00	284,437.00	0.18
133	600919	江苏银行	48,650.00	283,629.50	0.17
134	601138	工业富联	23,500.00	280,120.00	0.17
135	688012	中微公司	2,200.00	278,520.00	0.17
136	601865	福莱特	4,800.00	278,112.00	0.17
137	002001	新和成	8,720.00	271,366.40	0.17
138	300454	深信服	1,400.00	267,400.00	0.16
139	601336	新华保险	6,851.00	266,366.88	0.16
140	601600	中国铝业	43,600.00	265,524.00	0.16
141	601628	中国人寿	8,800.00	264,792.00	0.16
142	600886	国投电力	23,000.00	263,810.00	0.16
143	300408	三环集团	5,900.00	263,140.00	0.16
144	603833	欧派家居	1,781.00	262,697.50	0.16
145	300661	圣邦股份	850.00	262,650.00	0.16
146	600089	特变电工	12,200.00	258,274.00	0.16
147	600132	重庆啤酒	1,700.00	257,244.00	0.16
148	300751	迈为股份	400.00	256,920.00	0.16
149	603486	科沃斯	1,700.00	256,615.00	0.16
150	000799	酒鬼酒	1,200.00	255,000.00	0.16
151	600926	杭州银行	19,412.00	248,861.84	0.15
152	002736	国信证券	21,000.00	241,080.00	0.15
153	600029	南方航空	35,200.00	239,712.00	0.15

154	300033	同花顺	1,656.00	239,424.48	0.15
155	000723	美锦能源	14,700.00	238,581.00	0.15
156	600015	华夏银行	42,500.00	238,000.00	0.15
157	603369	今世缘	4,300.00	233,920.00	0.14
158	300628	亿联网络	2,850.00	232,132.50	0.14
159	600176	中国巨石	12,745.00	231,959.00	0.14
160	000876	新希望	15,200.00	231,192.00	0.14
161	002236	大华股份	9,800.00	230,104.00	0.14
162	601117	中国化学	19,100.00	229,200.00	0.14
163	000963	华东医药	5,700.00	229,140.00	0.14
164	603290	斯达半导	600.00	228,600.00	0.14
165	600011	华能国际	23,500.00	227,715.00	0.14
166	600600	青岛啤酒	2,300.00	227,700.00	0.14
167	300207	欣旺达	5,400.00	227,664.00	0.14
168	600460	士兰微	4,200.00	227,640.00	0.14
169	002920	德赛西威	1,600.00	226,416.00	0.14
170	601155	新城控股	7,731.00	225,204.03	0.14
171	600547	山东黄金	11,960.00	225,087.20	0.14
172	601618	中国中冶	58,600.00	224,438.00	0.14
173	600845	宝信软件	3,643.00	221,603.69	0.14
174	601377	兴业证券	22,200.00	219,336.00	0.14
175	600763	通策医疗	1,100.00	218,900.00	0.13
176	002013	中航机电	12,000.00	218,160.00	0.13
177	688008	澜起科技	2,600.00	218,062.00	0.13
178	002791	坚朗五金	1,200.00	217,908.00	0.13
179	002648	卫星化学	5,440.00	217,763.20	0.13
180	002601	龙佰集团	7,600.00	217,284.00	0.13
181	300601	康泰生物	2,200.00	216,788.00	0.13
182	300223	北京君正	1,600.00	214,400.00	0.13
183	002938	鹏鼎控股	5,000.00	212,150.00	0.13
184	000733	振华科技	1,700.00	211,276.00	0.13
185	601901	方正证券	26,900.00	210,896.00	0.13
186	600426	华鲁恒升	6,710.00	210,023.00	0.13
187	002916	深南电路	1,720.00	209,530.40	0.13
188	000938	紫光股份	9,131.00	208,643.35	0.13
189	600779	水井坊	1,738.00	208,542.62	0.13
190	300763	锦浪科技	900.00	208,395.00	0.13
191	300496	中科创达	1,500.00	207,630.00	0.13
192	002756	永兴材料	1,400.00	207,228.00	0.13
193	000301	东方盛虹	10,700.00	206,938.00	0.13
194	002602	世纪华通	24,360.00	204,380.40	0.13
195	601799	星宇股份	1,000.00	204,250.00	0.13
196	601727	上海电气	41,800.00	203,148.00	0.13
197	600875	东方电气	9,400.00	201,348.00	0.12

198	603899	晨光文具	3,100.00	199,981.00	0.12
199	601111	中国国航	21,900.00	199,947.00	0.12
200	002074	国轩高科	3,900.00	199,875.00	0.12
201	603260	合盛硅业	1,500.00	197,955.00	0.12
202	000786	北新建材	5,515.00	197,602.45	0.12
203	600383	金地集团	15,100.00	195,847.00	0.12
204	600188	兖矿能源	8,300.00	195,299.00	0.12
205	002555	三七互娱	7,200.00	194,544.00	0.12
206	601788	光大证券	12,900.00	192,597.00	0.12
207	601916	浙商银行	55,000.00	192,500.00	0.12
208	601689	拓普集团	3,600.00	190,800.00	0.12
209	000069	华侨城 A	27,100.00	190,784.00	0.12
210	300450	先导智能	2,560.00	190,387.20	0.12
211	603882	金域医学	1,700.00	189,329.00	0.12
212	600219	南山铝业	40,100.00	188,871.00	0.12
213	002120	韵达股份	9,200.00	188,232.00	0.12
214	002202	金风科技	11,400.00	187,758.00	0.12
215	600918	中泰证券	18,700.00	186,439.00	0.11
216	002414	高德红外	7,682.00	185,981.22	0.11
217	601939	建设银行	31,600.00	185,176.00	0.11
218	600039	四川路桥	15,300.00	184,212.00	0.11
219	600795	国电电力	57,500.00	182,275.00	0.11
220	600885	宏发股份	2,400.00	179,136.00	0.11
221	603737	三棵树	1,280.00	178,112.00	0.11
222	002080	中材科技	5,200.00	176,904.00	0.11
223	600183	生益科技	7,500.00	176,625.00	0.11
224	600754	锦江酒店	3,000.00	175,800.00	0.11
225	002007	华兰生物	6,000.00	174,840.00	0.11
226	002600	领益智造	23,700.00	174,432.00	0.11
227	600061	国投资本	21,192.00	174,198.24	0.11
228	600584	长电科技	5,600.00	173,712.00	0.11
229	603160	汇顶科技	1,600.00	172,432.00	0.11
230	000977	浪潮信息	4,800.00	171,984.00	0.11
231	002841	视源股份	2,111.00	171,835.40	0.11
232	601995	中金公司	3,500.00	171,605.00	0.11
233	603707	健友股份	4,060.00	170,520.00	0.10
234	688126	沪硅产业	6,600.00	170,412.00	0.10
235	601233	桐昆股份	8,000.00	169,440.00	0.10
236	601878	浙商证券	12,800.00	168,704.00	0.10
237	601966	玲珑轮胎	4,600.00	168,130.00	0.10
238	002625	光启技术	7,000.00	168,070.00	0.10
239	002180	纳思达	3,500.00	167,160.00	0.10
240	300347	泰格医药	1,300.00	166,140.00	0.10
241	000157	中联重科	23,100.00	165,627.00	0.10



242	600018	上港集团	30,200.00	165,496.00	0.10
243	600233	圆通速递	9,800.00	163,464.00	0.10
244	600298	安琪酵母	2,700.00	162,972.00	0.10
245	002064	华峰化学	15,600.00	162,864.00	0.10
246	600563	法拉电子	700.00	162,680.00	0.10
247	688169	石头科技	200.00	162,600.00	0.10
248	601615	明阳智能	6,200.00	161,820.00	0.10
249	688180	君实生物	2,400.00	160,752.00	0.10
250	600332	白云山	4,700.00	160,740.00	0.10
251	600038	中直股份	2,000.00	160,600.00	0.10
252	300595	欧普康视	2,790.00	160,062.30	0.10
253	688006	杭可科技	1,486.00	159,863.88	0.10
254	600522	中天科技	9,400.00	159,424.00	0.10
255	300037	新宙邦	1,400.00	158,200.00	0.10
256	601881	中国银河	14,100.00	157,779.00	0.10
257	002340	格林美	15,200.00	157,320.00	0.10
258	002240	盛新锂能	2,700.00	156,465.00	0.10
259	000425	徐工机械	26,000.00	155,740.00	0.10
260	688122	西部超导	1,600.00	155,104.00	0.10
261	603816	顾家家居	2,000.00	154,320.00	0.09
262	600115	中国东航	29,900.00	154,284.00	0.09
263	600362	江西铜业	6,900.00	154,077.00	0.09
264	603345	安井食品	900.00	153,702.00	0.09
265	603456	九洲药业	2,700.00	151,902.00	0.09
266	002384	东山精密	5,600.00	151,760.00	0.09
267	600674	川投能源	12,100.00	151,250.00	0.09
268	300146	汤臣倍健	5,600.00	150,976.00	0.09
269	601636	旗滨集团	8,800.00	150,480.00	0.09
270	603185	上机数控	900.00	150,282.00	0.09
271	601555	东吴证券	16,886.00	149,609.96	0.09
272	600009	上海机场	3,200.00	149,408.00	0.09
273	601058	赛轮轮胎	10,100.00	149,379.00	0.09
274	002252	上海莱士	21,900.00	149,358.00	0.09
275	300724	捷佳伟创	1,300.00	148,590.00	0.09
276	601216	君正集团	28,400.00	148,532.00	0.09
277	603589	口子窖	2,084.00	147,693.08	0.09
278	002568	百润股份	2,460.00	147,181.80	0.09
279	600256	广汇能源	22,400.00	146,496.00	0.09
280	603605	珀莱雅	700.00	145,817.00	0.09
281	002268	卫士通	2,600.00	145,444.00	0.09
282	600803	新奥股份	7,900.00	145,044.00	0.09
283	300529	健帆生物	2,720.00	144,976.00	0.09
284	600486	扬农化工	1,100.00	144,320.00	0.09
285	601838	成都银行	12,000.00	144,000.00	0.09

286	300699	光威复材	1,700.00	143,616.00	0.09
287	603267	鸿远电子	800.00	143,552.00	0.09
288	603517	绝味食品	2,100.00	143,493.00	0.09
289	002385	大北农	13,609.00	142,758.41	0.09
290	603568	伟明环保	3,900.00	142,467.00	0.09
291	300073	当升科技	1,600.00	138,992.00	0.09
292	603198	迎驾贡酒	2,000.00	138,900.00	0.09
293	002326	永太科技	2,700.00	138,267.00	0.09
294	000739	普洛药业	3,900.00	136,851.00	0.08
295	000783	长江证券	18,100.00	136,474.00	0.08
296	002624	完美世界	6,700.00	136,077.00	0.08
297	600516	方大炭素	12,560.00	135,899.20	0.08
298	600352	浙江龙盛	10,700.00	135,141.00	0.08
299	601108	财通证券	12,100.00	134,552.00	0.08
300	603127	昭衍新药	1,160.00	133,898.80	0.08
301	000825	太钢不锈	19,000.00	133,760.00	0.08
302	300003	乐普医疗	5,900.00	133,517.00	0.08
303	000066	中国长城	9,400.00	133,104.00	0.08
304	600161	天坛生物	4,580.00	132,636.80	0.08
305	600141	兴发集团	3,500.00	132,580.00	0.08
306	002185	华天科技	10,400.00	132,184.00	0.08
307	603338	浙江鼎力	1,640.00	131,626.40	0.08
308	000738	航发控制	4,300.00	130,204.00	0.08
309	300726	宏达电子	1,300.00	130,078.00	0.08
310	002409	雅克科技	1,600.00	129,872.00	0.08
311	300390	天华超净	1,600.00	129,600.00	0.08
312	603019	中科曙光	4,700.00	129,579.00	0.08
313	603613	国联股份	1,200.00	129,000.00	0.08
314	002850	科达利	800.00	128,272.00	0.08
315	603939	益丰药房	2,316.00	127,634.76	0.08
316	601607	上海医药	6,400.00	127,168.00	0.08
317	688208	道通科技	1,600.00	127,040.00	0.08
318	002024	苏宁易购	30,800.00	126,896.00	0.08
319	002372	伟星新材	5,200.00	126,464.00	0.08
320	000703	恒逸石化	11,891.00	126,282.42	0.08
321	002266	浙富控股	17,700.00	126,024.00	0.08
322	000831	五矿稀土	3,200.00	124,864.00	0.08
323	002223	鱼跃医疗	3,300.00	124,740.00	0.08
324	002532	天山铝业	15,300.00	124,695.00	0.08
325	000009	中国宝安	8,600.00	124,098.00	0.08
326	002353	杰瑞股份	3,100.00	124,000.00	0.08
327	300251	光线传媒	9,600.00	123,360.00	0.08
328	601198	东兴证券	10,575.00	122,987.25	0.08
329	300676	华大基因	1,400.00	122,920.00	0.08

330	600027	华电国际	22,900.00	122,515.00	0.08
331	000630	铜陵有色	35,100.00	122,148.00	0.08
332	300144	宋城演艺	8,480.00	121,433.60	0.07
333	600606	绿地控股	27,940.00	121,259.60	0.07
334	601933	永辉超市	29,800.00	120,690.00	0.07
335	601990	南京证券	12,100.00	119,911.00	0.07
336	300558	贝达药业	1,500.00	119,745.00	0.07
337	002028	思源电气	2,400.00	118,104.00	0.07
338	688009	中国通号	23,700.00	118,026.00	0.07
339	000519	中兵红箭	4,400.00	117,348.00	0.07
340	000807	云铝股份	10,500.00	117,285.00	0.07
341	002192	融捷股份	900.00	117,135.00	0.07
342	600079	人福医药	5,200.00	117,104.00	0.07
343	002673	西部证券	14,500.00	117,015.00	0.07
344	000932	华菱钢铁	22,800.00	116,508.00	0.07
345	002405	四维图新	7,300.00	116,216.00	0.07
346	002444	巨星科技	3,800.00	115,938.00	0.07
347	600705	中航产融	29,000.00	115,130.00	0.07
348	601162	天风证券	28,400.00	115,020.00	0.07
349	600160	巨化股份	8,900.00	114,899.00	0.07
350	600369	西南证券	21,700.00	114,793.00	0.07
351	688185	康希诺	383.00	114,727.65	0.07
352	300253	卫宁健康	6,830.00	114,470.80	0.07
353	600392	盛和资源	5,800.00	113,796.00	0.07
354	002507	涪陵榨菜	3,000.00	113,400.00	0.07
355	601699	潞安环能	10,000.00	113,100.00	0.07
356	600338	西藏珠峰	3,000.00	112,980.00	0.07
357	603658	安图生物	2,050.00	112,873.00	0.07
358	601077	渝农商行	29,200.00	112,420.00	0.07
359	600109	国金证券	9,900.00	112,167.00	0.07
360	000983	山西焦煤	13,520.00	111,810.40	0.07
361	002508	老板电器	3,100.00	111,662.00	0.07
362	002939	长城证券	8,600.00	111,370.00	0.07
363	300308	中际旭创	2,600.00	110,500.00	0.07
364	002557	洽洽食品	1,800.00	110,448.00	0.07
365	600487	亨通光电	7,300.00	110,376.00	0.07
366	600655	豫园股份	10,700.00	110,210.00	0.07
367	000728	国元证券	14,300.00	110,110.00	0.07
368	000999	华润三九	3,214.00	110,047.36	0.07
369	688002	睿创微纳	1,400.00	109,998.00	0.07
370	601319	中国人保	23,400.00	109,980.00	0.07
371	603233	大参林	2,600.00	109,486.00	0.07
372	000629	攀钢钒钛	28,100.00	109,309.00	0.07
373	000155	川能动力	4,100.00	108,773.00	0.07

374	002032	苏泊尔	1,739.00	108,235.36	0.07
375	300088	长信科技	8,100.00	107,568.00	0.07
376	300850	新强联	600.00	107,106.00	0.07
377	600549	厦门钨业	4,710.00	106,587.30	0.07
378	002456	欧菲光	10,900.00	105,730.00	0.07
379	000050	深天马 A	8,100.00	105,462.00	0.06
380	603218	日月股份	3,200.00	105,440.00	0.06
381	600177	雅戈尔	15,300.00	105,417.00	0.06
382	000591	太阳能	9,400.00	105,280.00	0.06
383	600170	上海建工	29,200.00	105,120.00	0.06
384	000027	深圳能源	12,900.00	104,490.00	0.06
385	600521	华海药业	4,820.00	104,401.20	0.06
386	002603	以岭药业	5,320.00	104,272.00	0.06
387	000800	一汽解放	10,100.00	103,929.00	0.06
388	603712	七一二	2,400.00	103,920.00	0.06
389	002407	多氟多	2,300.00	103,477.00	0.06
390	002497	雅化集团	3,600.00	103,176.00	0.06
391	002138	顺络电子	2,700.00	103,086.00	0.06
392	600704	物产中大	17,400.00	103,008.00	0.06
393	002157	正邦科技	10,600.00	102,396.00	0.06
394	000423	东阿阿胶	2,100.00	102,375.00	0.06
395	601016	节能风电	15,600.00	101,556.00	0.06
396	000960	锡业股份	5,200.00	101,556.00	0.06
397	002294	信立泰	3,700.00	101,084.00	0.06
398	002797	第一创业	13,800.00	101,016.00	0.06
399	002531	天顺风能	5,200.00	100,828.00	0.06
400	600143	金发科技	8,000.00	100,640.00	0.06
401	000998	隆平高科	4,300.00	100,018.00	0.06
402	601577	长沙银行	12,800.00	99,968.00	0.06
403	002463	沪电股份	6,020.00	99,811.60	0.06
404	002044	美年健康	12,700.00	99,695.00	0.06
405	300725	药石科技	700.00	99,519.00	0.06
406	002299	圣农发展	4,100.00	99,097.00	0.06
407	002430	杭氧股份	3,300.00	99,033.00	0.06
408	600699	均胜电子	4,500.00	98,865.00	0.06
409	002078	太阳纸业	8,600.00	98,814.00	0.06
410	600872	中炬高新	2,600.00	98,722.00	0.06
411	688202	美迪西	200.00	97,118.00	0.06
412	603077	和邦生物	28,100.00	95,821.00	0.06
413	002153	石基信息	3,320.00	95,416.80	0.06
414	002152	广电运通	8,000.00	95,200.00	0.06
415	600711	盛屯矿业	8,700.00	93,351.00	0.06
416	000830	鲁西化工	6,100.00	93,086.00	0.06
417	300677	英科医疗	1,600.00	92,544.00	0.06

418	002408	齐翔腾达	8,800.00	92,400.00	0.06
419	601456	国联证券	6,600.00	92,202.00	0.06
420	300357	我武生物	1,602.00	91,794.60	0.06
421	000860	顺鑫农业	2,400.00	91,632.00	0.06
422	600998	九州通	6,200.00	91,264.00	0.06
423	002010	传化智联	10,400.00	90,480.00	0.06
424	300418	昆仑万维	3,900.00	90,285.00	0.06
425	002422	科伦药业	4,758.00	90,068.94	0.06
426	000988	华工科技	3,200.00	89,152.00	0.05
427	600315	上海家化	2,200.00	88,902.00	0.05
428	002030	达安基因	4,428.00	88,825.68	0.05
429	603638	艾迪精密	2,780.00	88,737.60	0.05
430	300568	星源材质	2,400.00	88,152.00	0.05
431	300296	利亚德	8,600.00	88,150.00	0.05
432	300832	新产业	2,000.00	88,100.00	0.05
433	600415	小商品城	18,100.00	87,785.00	0.05
434	000987	越秀金控	10,055.00	87,478.50	0.05
435	000709	河钢股份	35,100.00	86,346.00	0.05
436	603866	桃李面包	3,020.00	85,768.00	0.05
437	002541	鸿路钢构	1,600.00	85,664.00	0.05
438	000547	航天发展	5,100.00	85,170.00	0.05
439	002925	盈趣科技	2,500.00	85,075.00	0.05
440	600153	建发股份	9,365.00	84,940.55	0.05
441	600801	华新水泥	4,400.00	84,920.00	0.05
442	600688	上海石化	20,300.00	84,651.00	0.05
443	603444	吉比特	200.00	84,370.00	0.05
444	002926	华西证券	8,500.00	83,725.00	0.05
445	600380	健康元	6,500.00	83,460.00	0.05
446	600598	北大荒	5,700.00	82,992.00	0.05
447	002690	美亚光电	2,200.00	82,412.00	0.05
448	000021	深科技	5,200.00	82,368.00	0.05
449	601696	中银证券	6,100.00	82,045.00	0.05
450	002145	中核钛白	6,500.00	81,835.00	0.05
451	601866	中远海发	25,100.00	81,575.00	0.05
452	600988	赤峰黄金	5,400.00	80,460.00	0.05
453	000513	丽珠集团	2,000.00	80,420.00	0.05
454	000683	远兴能源	11,000.00	80,300.00	0.05
455	603858	步长制药	3,800.00	80,142.00	0.05
456	002465	海格通信	7,300.00	79,716.00	0.05
457	002156	通富微电	4,100.00	79,663.00	0.05
458	002092	中泰化学	8,300.00	79,182.00	0.05
459	000975	银泰黄金	9,000.00	79,020.00	0.05
460	002558	巨人网络	6,600.00	79,002.00	0.05
461	600511	国药股份	2,500.00	78,825.00	0.05

462	300136	信维通信	3,100.00	78,492.00	0.05
463	000656	金科股份	17,500.00	78,400.00	0.05
464	600895	张江高科	5,200.00	78,312.00	0.05
465	002500	山西证券	11,850.00	78,210.00	0.05
466	002065	东华软件	10,000.00	78,000.00	0.05
467	601992	金隅集团	27,400.00	77,816.00	0.05
468	688188	柏楚电子	200.00	77,092.00	0.05
469	601231	环旭电子	4,800.00	77,088.00	0.05
470	600848	上海临港	5,140.00	76,431.80	0.05
471	002373	千方科技	5,000.00	74,750.00	0.05
472	002511	中顺洁柔	4,450.00	74,359.50	0.05
473	300383	光环新网	5,000.00	74,200.00	0.05
474	300212	易华录	2,099.00	74,199.65	0.05
475	300070	碧水源	10,300.00	74,057.00	0.05
476	000750	国海证券	17,900.00	73,569.00	0.05
477	002212	天融信	3,800.00	72,846.00	0.04
478	300773	拉卡拉	2,500.00	72,550.00	0.04
479	002429	兆驰股份	14,900.00	72,414.00	0.04
480	002506	协鑫集成	19,000.00	72,200.00	0.04
481	002151	北斗星通	1,800.00	70,650.00	0.04
482	002958	青农商行	18,300.00	70,638.00	0.04
483	603883	老百姓	1,420.00	70,119.60	0.04
484	000686	东北证券	7,800.00	68,484.00	0.04
485	300432	富临精工	2,300.00	67,620.00	0.04
486	600583	海油工程	14,600.00	67,306.00	0.04
487	002563	森马服饰	8,700.00	67,251.00	0.04
488	600498	烽火通信	3,700.00	66,526.00	0.04
489	002146	荣盛发展	14,300.00	62,205.00	0.04
490	600026	中远海能	10,400.00	61,568.00	0.04
491	601598	中国外运	13,700.00	61,376.00	0.04

## 8.3.2 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	688800	瑞可达	1,549.00	206,837.97	0.13
2	688107	安路科技	1,610.00	115,437.00	0.07
3	688622	禾信仪器	1,204.00	68,543.72	0.04
4	301018	申菱环境	648.00	16,886.88	0.01
5	301046	能辉科技	241.00	11,806.59	0.01
6	300943	春晖智控	255.00	11,801.40	0.01
7	301017	漱玉平民	464.00	11,043.20	0.01
8	301020	密封科技	360.00	10,958.40	0.01

9	301021	英诺激光	262.00	10,854.66	0.01
10	301011	华立科技	175.00	10,535.00	0.01
11	301026	浩通科技	157.00	9,848.61	0.01
12	301015	百洋医药	323.00	9,786.90	0.01
13	300994	久祺股份	215.00	9,771.75	0.01
14	300774	倍杰特	444.00	9,359.52	0.01
15	301062	上海艾录	523.00	8,896.23	0.01
16	301089	拓新药业	130.00	8,830.90	0.01
17	301025	读客文化	403.00	8,414.64	0.01
18	300993	玉马遮阳	287.00	8,239.77	0.01
19	301030	仕净科技	242.00	7,627.84	0.00
20	300998	宁波方正	201.00	6,699.33	0.00
21	301033	迈普医学	108.00	6,476.76	0.00
22	301048	金鹰重工	496.00	6,428.16	0.00
23	301032	新柴股份	513.00	6,417.63	0.00
24	301004	嘉益股份	312.00	6,389.76	0.00
25	301056	森赫股份	572.00	6,343.48	0.00
26	301039	中集车辆	499.00	6,242.49	0.00
27	301072	中捷精工	181.00	6,047.21	0.00
28	301007	德迈仕	303.00	6,035.76	0.00
29	301188	力诺特玻	289.00	5,918.72	0.00
30	300854	中兰环保	203.00	5,539.87	0.00
31	301028	东亚机械	401.00	5,413.50	0.00
32	301038	深水规院	266.00	5,381.18	0.00
33	301010	晶雪节能	218.00	5,227.64	0.00
34	300992	泰福泵业	200.00	4,950.00	0.00
35	301059	金三江	243.00	4,689.90	0.00
36	301063	海锅股份	124.00	4,477.64	0.00
37	301037	保立佳	177.00	4,294.02	0.00
38	301027	华蓝集团	250.00	4,162.50	0.00
39	301068	大地海洋	144.00	4,086.72	0.00
40	301073	君亭酒店	123.00	3,936.00	0.00
41	301079	邵阳液压	140.00	3,474.80	0.00
42	301057	汇隆新材	182.00	3,461.64	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 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	000858	五 粮 液	2,778,914.00	0.77
2	300750	宁德时代	2,772,576.00	0.76
3	000333	美的集团	2,049,337.00	0.57
4	002594	比亚迪	1,506,629.55	0.42
5	002352	顺丰控股	1,363,612.00	0.38
6	300760	迈瑞医疗	1,286,494.00	0.35
7	600436	片仔癀	1,124,450.00	0.31
8	300122	智飞生物	1,057,991.00	0.29
9	000001	平安银行	1,004,429.00	0.28
10	601318	中国平安	959,561.00	0.26
11	002475	立讯精密	952,581.00	0.26
12	300015	爱尔眼科	936,799.95	0.26
13	002714	牧原股份	917,903.00	0.25
14	601816	京沪高铁	873,964.00	0.24
15	300759	康龙化成	870,702.00	0.24
16	300059	东方财富	829,333.00	0.23
17	600036	招商银行	819,654.00	0.23
18	000002	万 科 A	798,451.00	0.22
19	002304	洋河股份	792,973.00	0.22
20	300999	金龙鱼	780,467.00	0.22

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。

#### 8.4.2 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	8,009,817.62	2.21
2	300750	宁德时代	7,903,886.10	2.18
3	002415	海康威视	4,272,123.00	1.18
4	002594	比亚迪	3,417,274.20	0.94
5	600519	贵州茅台	3,296,706.00	0.91
6	000001	平安银行	3,103,603.36	0.86
7	300760	迈瑞医疗	3,080,366.80	0.85
8	002475	立讯精密	2,629,713.59	0.73
9	002304	洋河股份	2,595,123.50	0.72
10	002714	牧原股份	2,489,782.10	0.69
11	300015	爱尔眼科	2,464,388.70	0.68
12	002352	顺丰控股	2,445,209.18	0.67



13	300059	东方财富	2,399,110.99	0.66
14	000568	泸州老窖	2,340,544.50	0.65
15	300122	智飞生物	2,205,045.61	0.61
16	000002	万 科 A	2,132,285.00	0.59
17	002142	宁波银行	1,716,331.48	0.47
18	600690	海尔智家	1,682,251.00	0.46
19	000333	美的集团	1,619,236.00	0.45
20	000725	京东方 A	1,586,147.00	0.44

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。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	106,739,733.93
卖出股票的收入（成交）总额	200,714,436.04

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。

#### 8.5 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）	584,876.52	0.36
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	584,876.52	0.36
----	----	------------	------

### 8.6 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	113052	兴业转债	1,750	175,000.00	0.11
2	113042	上银转债	1,240	130,931.60	0.08
3	113050	南银转债	930	110,037.60	0.07
4	110079	杭银转债	810	100,877.40	0.06
5	123107	温氏转债	504	68,029.92	0.04

### 8.7 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。

### 8.8 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。

### 8.9 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。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 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
IF2203	IF2203	7.00	10,396,260.00	-165,240.00	-
公允价值变动总额合计					-165,240.00
股指期货投资本期收益					1,328,841.55
股指期货投资本期公允价值变动					-946,026.00

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 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。

**8.12 投资组合报告附注**

8.12.1 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。

8.12.2 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。

**8.12.3 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	1,285,019.45
2	应收证券清算款	342,066.94
3	应收股利	-
4	应收利息	2,415.91
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,629,502.30

**8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产 净值比例(%)
1	113042	上银转债	130,931.60	0.08
2	113050	南银转债	110,037.60	0.07
3	110079	杭银转债	100,877.40	0.06
4	123107	温氏转债	68,029.92	0.04

**8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明****8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

**8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明**

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	688800	瑞可达	206,837.97	0.13	新股锁定期内
2	688622	禾信仪器	68,543.72	0.04	新股锁定期内
3	301018	申菱环境	16,886.88	0.01	新股锁定期内
4	301046	能辉科技	11,806.59	0.01	新股锁定期内

### 8.12.6 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。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
1,467	78,205.40	67,965,038.00	59.24%	46,762,285.00	40.76%

### 9.2 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	8,863,463.00	7.73%
2	招商证券股份有限公司	8,722,378.00	7.60%
3	东方证券股份有限公司	5,380,483.00	4.69%
4	华泰证券股份有限公司	4,450,376.00	3.88%
5	中航安盟财产保险有限公司—自有资金	3,609,900.00	3.15%
6	陈永军	2,009,000.00	1.75%
7	纪少健	2,000,000.00	1.74%
8	陈茂春	1,500,000.00	1.31%
9	孙奇峰	1,175,600.00	1.02%
10	李霞	1,083,000.00	0.94%

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。

**9.3 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%

**9.4 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

**§10 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	51,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	207,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	114,727,323.00

**§11 重大事件揭示****11.1 基金份额持有人大会决议**

报告期内无基金份额持有人大会决议。

**11.2 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：

基金管理人于 2021 年 8 月 12 日公告，自 2021 年 8 月 10 日起，杨红女士不再担任公司副总经理。

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)。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

### 11.5 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情况。报告年度应支付给聘任普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为 60,000 元，目前该审计机构已提供审计服务的连续年限为 2 年。

### 11.6 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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	302,295,110.82	100.00%	190,840.05	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。

11.7.2 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
中信证券	345,153.10	100.00%	-	-	-	-

11.8 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
5	上投摩根基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	同上	2021-08-12
6	上投摩根基金管理有限公司关于注销厦门分公司的公告	同上	2021-09-04

12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		20%的时间区间					
联接基金	1	20210101-20211231	96,270,800.00	3,772,000.00	65,075,000.00	34,967,800.00	30.48%
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。							

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §13 备查文件目录

### 13.1 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

### 13.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所。

### 13.3 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

二〇二二年三月三十一日