

上投摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金
2022 年中期报告
2022 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：二〇二二年八月三十一日

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 2022 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 2022 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.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
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	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
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 净资产（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	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.....	54
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	56
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.....	57
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.....	57
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.....	57
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.....	57
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	57
7.11 本报告期投资基金情况.....	57
7.12 投资组合报告附注.....	58

8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	59
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	59
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	60
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.....	60
9 开放式基金份额变动	60
10 重大事件揭示	60
10.1 基金份额持有人大会决议.....	60
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.....	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	60
10.4 基金投资策略的改变.....	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	60
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.....	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	61
10.8 其他重大事件.....	62
11 影响投资者决策的其他重要信息	62
12 备查文件目录	62
12.1 备查文件目录.....	62
12.2 存放地点.....	63
12.3 查阅方式.....	63

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	90,727,323.00 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（2022年1月1日至2022年6月30日）
本期已实现收益	-2,023,039.32
本期利润	-13,205,757.61
加权平均基金份额本期利润	-0.1309
本期加权平均净值利润率	-10.52%
本期基金份额净值增长率	-8.35%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)
期末可供分配利润	27,026,684.39
期末可供分配基金份额利润	0.2979
期末基金资产净值	117,754,007.39
期末基金份额净值	1.2979
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)
基金份额累计净值增长率	29.79%

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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。

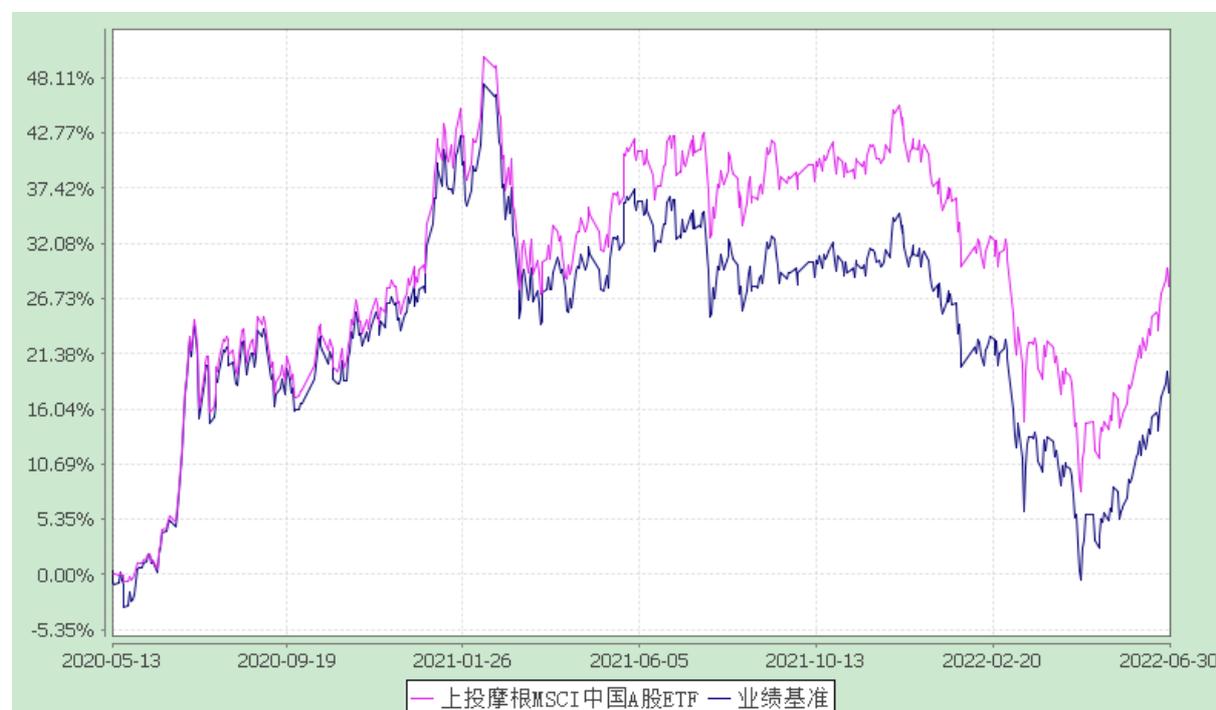
3.2 基金净值表现

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	9.68%	1.02%	9.38%	1.07%	0.30%	-0.05%
过去三个月	7.14%	1.41%	6.60%	1.46%	0.54%	-0.05%
过去六个月	-8.35%	1.42%	-9.07%	1.46%	0.72%	-0.04%
过去一年	-8.92%	1.21%	-12.39%	1.24%	3.47%	-0.03%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	29.79%	1.23%	19.42%	1.27%	10.37%	-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
 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 2022 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 2022 年 6 月底，公司旗下运作的基金共有八十四只，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、上投摩根恒生科技交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)、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、上投摩根全景优势股票型证券投资基金、上投摩根鑫睿优选一年持有期混合型证券投资基金、上投摩根沃享远见一年持有期混合型证券投资基金、上投摩根博睿均衡一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、上投摩根中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金。

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		
胡迪	指数及量化投资部总监、本基金基金经理	2021-01-07	-	14 年	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 1 月至 2022 年 6 月同时担任上投摩根优选多因子股票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。自 2022 年 5 月起同时担任上投摩根中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
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 2 月至 2022 年 6

					月同时担任上投摩根优选多因子股票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	-	8 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.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。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。

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

今年上半年，本基金跟踪的 MSCI 中国 A 股指数显著波动，一季度大幅下跌，二季度显著反弹，上半年整体下跌 9.07%，同期沪深 300 指数下跌 9.22%。一季度内，在贸易、企业投资、财政支持下，年初经济增长超预期。但随着新一轮的疫情再起，消费和服务业反弹乏力。3 月国务院金融委会议传达出稳定宏观经济和金融市场的明确信号，市场出现反弹。但地产销售疲弱，叠加北上资金流出、俄乌冲突的发展，共同压制了 A 股市场。随着二季度内疫情的影响边际改善，市场在 5 月初开始反弹，尤其以食品饮料、汽车等为代表的消费板块反弹显著。本基金继续采用完全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:-8.35%，同期业绩比较基准收益率为:-9.07%。

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 2022 年下半年，未来的四大主线围绕着“稳增长、高景气、疫后修复、全球通胀”。稳增长政策的落地，有助于提振消费，尤其是耐用品消费。主要的风险来自于疫情传播超预期、政策不及预期、中美关系再度恶化、海外货币政策变化等。

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,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：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	7,848,850.17	10,606,177.32
结算备付金		2,927,730.83	3,380,756.73
存出保证金		826,792.41	1,285,019.45
交易性金融资产	6.4.7.2	107,136,199.14	148,370,215.92
其中：股票投资		106,441,347.68	147,785,339.40
基金投资		-	-
债券投资		694,851.46	584,876.52
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	342,066.94
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	2,415.91
资产总计		118,739,572.55	163,986,652.27
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 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		-	-
应付清算款		-	557,745.36
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		14,795.98	21,687.14
应付托管费		4,932.02	7,229.05
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.67	0.35

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	965,836.49	932,797.82
负债合计		985,565.16	1,519,459.72
净资产：		-	-
实收基金	6.4.7.7	90,727,323.00	114,727,323.00
未分配利润	6.4.7.8	27,026,684.39	47,739,869.55
净资产合计		117,754,007.39	162,467,192.55
负债和净资产总计		118,739,572.55	163,986,652.27

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日,基金份额净值:1.2979,基金份额总额:90,727,323.00 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-12,930,554.26	19,748,284.81
1.利息收入		22,780.23	30,450.38
其中：存款利息收入	6.4.7.9	22,780.23	30,226.27
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）		-1,996,257.82	45,970,785.09
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-2,008,446.97	43,245,264.09
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	942.54	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	6.4.7.12	-1,009,883.20	1,384,041.55
股利收益	6.4.7.13	1,021,129.81	1,337,390.63
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	-11,182,718.29	-26,726,652.77
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	225,641.62	473,702.11
减：二、营业总支出		275,203.35	694,362.48
1. 管理人报酬		93,867.65	184,095.48

2. 托管费		31,289.21	61,365.16
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		0.40	5,643.17
8. 其他费用	6.4.7.16	150,046.09	443,258.67
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-13,205,757.61	19,053,922.33
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-13,205,757.61	19,053,922.33
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-13,205,757.61	19,053,922.33

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

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	114,727,323.00	-	47,739,869.55	162,467,192.55
二、本期期初净资产（基金净值）	114,727,323.00	-	47,739,869.55	162,467,192.55
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-24,000,000.00	-	-20,713,185.16	-44,713,185.16
（一）、综合收益总额	-	-	-13,205,757.61	-13,205,757.61
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-24,000,000.00	-	-7,507,427.55	-31,507,427.55
其中：1. 基金申购款	24,000,000.00	-	4,701,875.34	28,701,875.34
2. 基金赎回款	-48,000,000.00	-	-12,209,302.89	-60,209,302.89
（三）、本期向基	-	-	-	-

金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）				
四、本期期末净资产（基金净值）	90,727,323.00	-	27,026,684.39	117,754,007.39
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	270,727,323.00	-	91,955,520.67	362,682,843.67
二、本期期初净资产（基金净值）	270,727,323.00	-	91,955,520.67	362,682,843.67
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-117,000,000.00	-	-26,625,871.43	-143,625,871.43
（一）、综合收益总额	-	-	19,053,922.33	19,053,922.33
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-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
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	153,727,323.00	-	65,329,649.24	219,056,972.24

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：郭海明，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]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 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 2022 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年上半年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

除下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外，本基金本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年上半年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下： 1 会计政策变更的性质、内容和原因 (a) 金融资产和金融负债的分类 金融工具，是指形成一方的金融资产并形成

其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产 金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具 本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量： 本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益： 本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具 权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债 金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的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。

(3) 衍生金融工具 本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

(b) 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在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，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，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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。 本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。 本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。 于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增

加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。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。

(c) 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。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证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投资收益。以公允价值计量且其变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息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相关交易费用及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。

2 当期报表中受影响的项目名称和调整金额

(a) 金融工具 根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定

进行分类和计量的结果如下：原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息和应收证券清算款，金额分别为 10,606,177.32 元、3,380,756.73 元、1,285,019.45 元、2,415.91 元和 342,066.94 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息和应收清算款，金额分别为 10,607,283.25 元、3,381,524.59 元、1,285,038.04 元、0.00 元和 342,066.94 元。原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 148,370,215.92 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 148,370,739.45 元。原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 557,745.36 元、21,687.14 元、7,229.05 元、34,691.14 元和 718,106.68 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 557,745.36 元、21,687.14 元、7,229.05 元、34,691.14 元和 718,106.68 元。于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。(b) 修订后的《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>》根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	7,848,850.17
等于：本金	7,848,082.93
加：应计利息	767.24
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	7,848,850.17

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	102,983,463.84	-	106,441,347.68	3,457,883.84
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所	648.60		
	市场	582,400.00	694,851.46	111,802.86
	银行间		-	
	市场	-	-	-
合计	582,400.00	648.60	694,851.46	111,802.86
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	103,565,863.84	648.60	107,136,199.14	3,569,686.70

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	6,711,642.86	-	-	-
股指期货	6,711,642.86	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	6,711,642.86	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2209	IF2209	5.00	6,670,800.00	-40,842.86
合计	-	-	-	-40,842.86
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-40,842.86
净额	-	-	-	-

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。

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 其他资产

无余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-

应付交易费用	18,921.26
其中：交易所市场	18,921.26
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,260.15
应付指数使用费	14,540.03
应付替代款	843,115.05
合计	965,836.49

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	114,727,323.00	114,727,323.00
本期申购	24,000,000.00	24,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-48,000,000.00	-48,000,000.00
本期末	90,727,323.00	90,727,323.00

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	65,730,783.17	-17,990,913.62	47,739,869.55
本期利润	-2,023,039.32	-11,182,718.29	-13,205,757.61
本期基金份额交易产生的变动数	-13,647,983.74	6,140,556.19	-7,507,427.55
其中：基金申购款	13,363,619.94	-8,661,744.60	4,701,875.34
基金赎回款	-27,011,603.68	14,802,300.79	-12,209,302.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	50,059,760.11	-23,033,075.72	27,026,684.39

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
	活期存款利息收入
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	9,616.82
其他	265.65
合计	22,780.23

6.4.7.10 股票投资收益**6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-2,113,864.11
股票投资收益——赎回差价收入	105,417.14
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-2,008,446.97

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	30,074,354.66
减：卖出股票成本总额	32,122,793.53
减：交易费用	65,425.24
买卖股票差价收入	-2,113,864.11

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	60,209,302.89
减：现金支付赎回款总额	26,349,308.89
减：赎回股票成本总额	33,754,576.86
减：交易费用	-
赎回差价收入	105,417.14

6.4.7.11 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	942.54
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-

合计	942.54
----	--------

6.4.7.12 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股指期货投资收益	-1,009,883.20

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,021,129.81
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	1,021,129.81

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1.交易性金融资产	-11,307,115.43
——股票投资	-11,357,441.77
——债券投资	50,326.34
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	124,397.14
——权证投资	-
——股指期货	124,397.14
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	-11,182,718.29

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	-

替代损益	225,641.62
合计	225,641.62

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	60,785.94
合计	150,046.09

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
上投摩根基金管理有限公司	基金管理人
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 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	93,867.65	184,095.48
其中：支付销售机构的客户维护费	4,171.61	6,561.73

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 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	31,289.21	61,365.16

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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.05% / 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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 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	29,547,900.00	32.57%	34,967,800.00	30.48%

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2022年1月1日至2022年6月30日		2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
平安银行	7,848,850.17	12,897.76	8,646,940.94	15,495.76

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无

6.4.11 利润分配情况

本报告期本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末（2022年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型指数基金，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。

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 2022 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.59%(2021 年 12 月 31 日：0.36%)。

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 2022 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 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有流动性受限资产。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2022 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值为 115,024,476.33 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 2022年6月 30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	7,848,850.17	-	-	-	7,848,850.17
结算备付金	2,927,730.83	-	-	-	2,927,730.83
存出保证金	826,792.41	-	-	-	826,792.41
交易性金融资产	-	412,039.94	282,811.52	106,441,347.68	107,136,199.14
资产总计	11,603,373.41	412,039.94	282,811.52	106,441,347.68	118,739,572.55
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	14,795.98	14,795.98
应付托管费	-	-	-	4,932.02	4,932.02
应交税费	-	-	-	0.67	0.67
其他负债	-	-	-	965,836.49	965,836.49
负债总计	-	-	-	985,565.16	985,565.16
利率敏感度 缺口	11,603,373.41	412,039.94	282,811.52	105,455,782.52	117,754,007.39
上年度末	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

2021 年 12 月 31 日					
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
应收清算款	-	-	-	342,066.94	342,066.94
应收利息	-	-	-	2,415.91	2,415.91
资产总计	14,024,402.30	-	584,876.52	149,377,373.45	163,986,652.27
负债					
应付清算款	-	-	-	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
应交税费	-	-	-	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

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2022 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.59%(2021 年 12 月 31 日：0.36%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2021 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	106,441,347.68	90.39	147,785,339.40	90.96
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	694,851.46	0.59	584,876.52	0.36

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	107,136,199.14	90.98	148,370,215.92	91.32

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%	增加约 574	增加约 802
	2. 业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	减少约 574	减少约 802

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	106,441,347.68	147,702,742.79
第二层次	694,851.46	175,000.00

第三层次	-	492,473.13
合计	107,136,199.14	148,370,215.92

6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有公允价值归属于第三层次的金融工具(2021 年 12 月 31 日：492,473.13 元)。本基金本年度购买第三层次的金融工具 0.00 元(2021 年 1 月 11 日至 2021 年 12 月 31 日止期间：115,360.72 元)，计入损益的第三层次的金融工具公允价值变动损益 0.00 元(2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日止期间：377,112.41 元)。

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有的第三层次的交易性金融资产。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2021 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	106,441,347.68	89.64
	其中：股票	106,441,347.68	89.64
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	694,851.46	0.59
	其中：债券	694,851.46	0.59
	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	10,776,581.00	9.08
8	其他各项资产	826,792.41	0.70
9	合计	118,739,572.55	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	1,313,642.02	1.12
B	采矿业	4,205,908.40	3.57
C	制造业	63,023,926.84	53.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,228,955.60	2.74
E	建筑业	1,909,240.00	1.62
F	批发和零售业	856,802.83	0.73
G	交通运输、仓储和邮政业	3,250,411.00	2.76
H	住宿和餐饮业	207,820.00	0.18
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,247,022.65	2.76
J	金融业	18,805,396.52	15.97

K	房地产业	1,949,057.66	1.66
L	租赁和商务服务业	1,469,638.92	1.25
M	科学研究和技术服务业	1,301,927.64	1.11
N	水利、环境和公共设施管理业	223,676.00	0.19
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	889,999.42	0.76
R	文化、体育和娱乐业	328,947.60	0.28
S	综合	91,732.00	0.08
	合计	106,304,105.10	90.28

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	120,448.38	0.10
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	12,758.56	0.01
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	4,035.64	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	137,242.58	0.12

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	3,148.00	6,437,660.00	5.47
2	300750	宁德时代	5,844.00	3,120,696.00	2.65
3	600036	招商银行	50,525.00	2,132,155.00	1.81
4	000858	五粮液	9,200.00	1,857,756.00	1.58
5	002594	比亚迪	4,353.00	1,451,681.97	1.23
6	600900	长江电力	57,680.00	1,333,561.60	1.13
7	601318	中国平安	27,120.00	1,266,232.80	1.08
8	601012	隆基绿能	18,900.00	1,259,307.00	1.07
9	601888	中国中免	4,744.00	1,105,019.92	0.94
10	601166	兴业银行	53,300.00	1,060,670.00	0.90
11	300760	迈瑞医疗	3,167.00	991,904.40	0.84
12	600809	山西汾酒	3,020.00	980,896.00	0.83
13	000568	泸州老窖	3,659.00	902,089.86	0.77
14	603288	海天味业	9,562.00	864,022.32	0.73
15	300059	东方财富	33,766.00	857,656.40	0.73
16	601398	工商银行	160,500.00	765,585.00	0.65
17	600309	万华化学	7,800.00	756,522.00	0.64
18	000001	平安银行	49,600.00	743,008.00	0.63
19	002714	牧原股份	13,366.00	738,738.82	0.63
20	600438	通威股份	11,693.00	699,942.98	0.59
21	002304	洋河股份	3,783.00	692,856.45	0.59
22	603259	药明康德	6,516.00	677,598.84	0.58
23	600030	中信证券	31,215.00	676,116.90	0.57
24	002352	顺丰控股	11,900.00	664,139.00	0.56
25	601288	农业银行	217,500.00	656,850.00	0.56
26	600887	伊利股份	16,200.00	630,990.00	0.54
27	002142	宁波银行	16,984.00	608,197.04	0.52
28	600000	浦发银行	75,715.00	606,477.15	0.52
29	002475	立讯精密	17,850.00	603,151.50	0.51

30	600276	恒瑞医药	16,228.00	601,896.52	0.51
31	300015	爱尔眼科	13,146.00	588,546.42	0.50
32	601668	中国建筑	108,900.00	579,348.00	0.49
33	601088	中国神华	17,000.00	566,100.00	0.48
34	002812	恩捷股份	2,200.00	550,990.00	0.47
35	600048	保利发展	31,300.00	546,498.00	0.46
36	601225	陕西煤业	25,100.00	531,618.00	0.45
37	000002	万科 A	25,137.00	515,308.50	0.44
38	601816	京沪高铁	102,600.00	515,052.00	0.44
39	601328	交通银行	101,000.00	502,980.00	0.43
40	600436	片仔癀	1,400.00	499,422.00	0.42
41	002129	TCL 中环	8,202.00	483,015.78	0.41
42	601899	紫金矿业	51,300.00	478,629.00	0.41
43	600905	三峡能源	72,900.00	458,541.00	0.39
44	300122	智飞生物	4,086.00	453,586.86	0.39
45	300124	汇川技术	6,850.00	451,209.50	0.38
46	601919	中远海控	32,390.00	450,221.00	0.38
47	600406	国电南瑞	16,656.00	449,712.00	0.38
48	002459	晶澳科技	5,640.00	444,996.00	0.38
49	300014	亿纬锂能	4,545.00	443,137.50	0.38
50	600690	海尔智家	15,900.00	436,614.00	0.37
51	002460	赣锋锂业	2,920.00	434,204.00	0.37
52	600031	三一重工	21,800.00	415,508.00	0.35
53	601601	中国太保	17,600.00	414,128.00	0.35
54	000725	京东方 A	100,400.00	395,576.00	0.34
55	002493	荣盛石化	25,647.00	394,707.33	0.34
56	603799	华友钴业	4,060.00	388,217.20	0.33
57	002371	北方华创	1,400.00	387,968.00	0.33
58	300274	阳光电源	3,800.00	373,350.00	0.32
59	601658	邮储银行	68,700.00	370,293.00	0.31
60	688599	天合光能	5,600.00	365,400.00	0.31
61	000625	长安汽车	20,896.00	361,918.72	0.31
62	600585	海螺水泥	10,147.00	357,986.16	0.30
63	603501	韦尔股份	2,027.00	350,731.81	0.30
64	600104	上汽集团	19,600.00	349,076.00	0.30
65	300498	温氏股份	16,280.00	346,601.20	0.29
66	600016	民生银行	91,900.00	341,868.00	0.29
67	600019	宝钢股份	56,400.00	339,528.00	0.29
68	600028	中国石化	81,200.00	331,296.00	0.28
69	601390	中国中铁	53,400.00	327,876.00	0.28
70	600111	北方稀土	9,300.00	326,988.00	0.28
71	601766	中国中车	62,300.00	323,960.00	0.28
72	600346	恒力石化	14,500.00	322,480.00	0.27
73	601066	中信建投	11,100.00	320,901.00	0.27

74	601818	光大银行	105,800.00	318,458.00	0.27
75	601985	中国核电	45,800.00	314,188.00	0.27
76	600893	航发动力	6,900.00	314,019.00	0.27
77	601669	中国电建	38,800.00	305,356.00	0.26
78	300896	爱美客	500.00	300,005.00	0.25
79	002709	天赐材料	4,780.00	296,646.80	0.25
80	601988	中国银行	89,900.00	293,074.00	0.25
81	002241	歌尔股份	8,700.00	292,320.00	0.25
82	601857	中国石油	55,000.00	291,500.00	0.25
83	601211	国泰君安	19,100.00	290,320.00	0.25
84	603659	璞泰来	3,400.00	286,960.00	0.24
85	002049	紫光国微	1,500.00	284,580.00	0.24
86	000776	广发证券	15,200.00	284,240.00	0.24
87	001979	招商蛇口	20,701.00	278,014.43	0.24
88	600050	中国联通	78,800.00	272,648.00	0.23
89	600745	闻泰科技	3,200.00	272,352.00	0.23
90	600010	包钢股份	115,800.00	272,130.00	0.23
91	601009	南京银行	26,100.00	271,962.00	0.23
92	600919	江苏银行	38,050.00	270,916.00	0.23
93	000538	云南白药	4,480.00	270,547.20	0.23
94	000895	双汇发展	9,100.00	266,630.00	0.23
95	601688	华泰证券	18,600.00	264,120.00	0.22
96	600999	招商证券	18,193.00	262,161.13	0.22
97	600188	兖矿能源	6,600.00	260,568.00	0.22
98	000063	中兴通讯	10,100.00	257,853.00	0.22
99	603993	洛阳钼业	45,000.00	257,850.00	0.22
100	600089	特变电工	9,400.00	257,466.00	0.22
101	002311	海大集团	4,200.00	252,042.00	0.21
102	601138	工业富联	25,500.00	250,920.00	0.21
103	601006	大秦铁路	38,000.00	250,420.00	0.21
104	000596	古井贡酒	1,000.00	249,660.00	0.21
105	000651	格力电器	7,400.00	249,528.00	0.21
106	000166	申万宏源	57,500.00	246,675.00	0.21
107	601169	北京银行	53,900.00	244,706.00	0.21
108	600837	海通证券	24,600.00	241,326.00	0.20
109	002230	科大讯飞	5,800.00	239,076.00	0.20
110	002027	分众传媒	35,400.00	238,242.00	0.20
111	300759	康龙化成	2,500.00	238,050.00	0.20
112	601229	上海银行	36,266.00	237,542.30	0.20
113	688111	金山办公	1,200.00	236,544.00	0.20
114	300751	迈为股份	480.00	235,632.00	0.20
115	000661	长春高新	1,000.00	233,420.00	0.20
116	600926	杭州银行	15,512.00	232,369.76	0.20
117	603806	福斯特	3,440.00	225,388.80	0.19

118	600989	宝丰能源	15,300.00	224,145.00	0.19
119	603392	万泰生物	1,440.00	223,632.00	0.19
120	300316	晶盛机电	3,300.00	223,047.00	0.19
121	601633	长城汽车	5,900.00	218,536.00	0.19
122	603986	兆易创新	1,532.00	217,865.72	0.19
123	600196	复星医药	4,900.00	216,041.00	0.18
124	601628	中国人寿	6,900.00	214,452.00	0.18
125	000338	潍柴动力	17,100.00	213,237.00	0.18
126	600150	中国船舶	10,900.00	206,882.00	0.18
127	300142	沃森生物	4,200.00	203,238.00	0.17
128	300782	卓胜微	1,504.00	203,040.00	0.17
129	300763	锦浪科技	950.00	202,350.00	0.17
130	002821	凯莱英	700.00	202,300.00	0.17
131	601100	恒立液压	3,266.00	201,577.52	0.17
132	600660	福耀玻璃	4,800.00	200,688.00	0.17
133	600029	南方航空	27,400.00	200,294.00	0.17
134	300999	金龙鱼	3,700.00	199,874.00	0.17
135	600958	东方证券	19,560.00	199,707.60	0.17
136	600522	中天科技	8,600.00	198,660.00	0.17
137	600886	国投电力	18,800.00	197,400.00	0.17
138	601877	正泰电器	5,500.00	196,790.00	0.17
139	601868	中国能建	82,700.00	195,999.00	0.17
140	603833	欧派家居	1,281.00	193,021.08	0.16
141	603290	斯达半导	500.00	192,950.00	0.16
142	601111	中国国航	16,600.00	192,726.00	0.16
143	000733	振华科技	1,400.00	190,358.00	0.16
144	000963	华东医药	4,200.00	189,672.00	0.16
145	688012	中微公司	1,622.00	189,368.50	0.16
146	601238	广汽集团	12,300.00	187,452.00	0.16
147	600460	士兰微	3,600.00	187,200.00	0.16
148	600588	用友网络	8,531.00	185,208.01	0.16
149	601689	拓普集团	2,700.00	184,761.00	0.16
150	002074	国轩高科	4,000.00	182,400.00	0.15
151	002001	新和成	7,964.00	181,658.84	0.15
152	600795	国电电力	45,900.00	179,469.00	0.15
153	600256	广汇能源	17,000.00	179,180.00	0.15
154	601615	明阳智能	5,300.00	179,140.00	0.15
155	002920	德赛西威	1,200.00	177,600.00	0.15
156	300661	圣邦股份	975.00	177,469.50	0.15
157	002180	纳思达	3,500.00	177,170.00	0.15
158	000876	新希望	11,500.00	175,950.00	0.15
159	600132	重庆啤酒	1,200.00	175,920.00	0.15
160	600741	华域汽车	7,600.00	174,800.00	0.15
161	600233	圆通速递	8,500.00	173,315.00	0.15

162	600547	山东黄金	9,260.00	171,865.60	0.15
163	600176	中国巨石	9,845.00	171,401.45	0.15
164	300628	亿联网络	2,250.00	171,337.50	0.15
165	000100	TCL 科技	35,700.00	171,003.00	0.15
166	600015	华夏银行	32,600.00	169,846.00	0.14
167	601336	新华保险	5,251.00	169,029.69	0.14
168	002756	永兴材料	1,100.00	167,431.00	0.14
169	000301	东方盛虹	9,900.00	167,409.00	0.14
170	000799	酒鬼酒	900.00	167,229.00	0.14
171	600600	青岛啤酒	1,600.00	166,272.00	0.14
172	600011	华能国际	23,500.00	165,440.00	0.14
173	603260	合盛硅业	1,400.00	165,144.00	0.14
174	601865	福莱特	4,300.00	163,830.00	0.14
175	300769	德方纳米	400.00	163,472.00	0.14
176	300413	芒果超媒	4,835.00	161,295.60	0.14
177	688036	传音控股	1,800.00	160,614.00	0.14
178	600383	金地集团	11,900.00	159,936.00	0.14
179	601618	中国中冶	45,600.00	159,600.00	0.14
180	600570	恒生电子	3,660.00	159,356.40	0.14
181	603369	今世缘	3,100.00	158,100.00	0.13
182	600884	杉杉股份	5,300.00	157,516.00	0.13
183	688008	澜起科技	2,600.00	157,508.00	0.13
184	601600	中国铝业	32,900.00	156,275.00	0.13
185	002736	国信证券	16,300.00	155,991.00	0.13
186	601838	成都银行	9,400.00	155,852.00	0.13
187	002648	卫星化学	6,012.00	155,410.20	0.13
188	688005	容百科技	1,200.00	155,328.00	0.13
189	601360	三六零	18,099.00	154,203.48	0.13
190	688396	华润微	2,600.00	153,582.00	0.13
191	603185	上机数控	980.00	152,870.20	0.13
192	300957	贝泰妮	700.00	152,271.00	0.13
193	600426	华鲁恒升	5,210.00	152,132.00	0.13
194	688180	君实生物	2,000.00	150,680.00	0.13
195	601788	光大证券	9,500.00	149,720.00	0.13
196	601155	新城控股	5,831.00	148,282.33	0.13
197	601939	建设银行	24,300.00	147,258.00	0.13
198	603486	科沃斯	1,200.00	146,268.00	0.12
199	000786	北新建材	4,215.00	145,923.30	0.12
200	300408	三环集团	4,800.00	144,480.00	0.12
201	600845	宝信软件	2,643.00	144,307.80	0.12
202	601117	中国化学	15,300.00	143,973.00	0.12
203	300496	中科创达	1,100.00	143,528.00	0.12
204	002938	鹏鼎控股	4,700.00	141,987.00	0.12
205	601916	浙商银行	42,700.00	141,764.00	0.12

206	000983	山西焦煤	10,520.00	140,862.80	0.12
207	300433	蓝思科技	12,700.00	140,589.00	0.12
208	000938	紫光股份	7,231.00	140,281.40	0.12
209	601901	方正证券	20,900.00	140,239.00	0.12
210	605117	德业股份	500.00	139,945.00	0.12
211	600763	通策医疗	800.00	139,552.00	0.12
212	600754	锦江酒店	2,200.00	138,380.00	0.12
213	600018	上港集团	23,600.00	137,588.00	0.12
214	600009	上海机场	2,400.00	136,080.00	0.12
215	603345	安井食品	800.00	134,296.00	0.11
216	000723	美锦能源	11,000.00	134,200.00	0.11
217	601727	上海电气	32,600.00	133,986.00	0.11
218	000069	华侨城 A	20,600.00	133,694.00	0.11
219	601995	中金公司	3,000.00	133,470.00	0.11
220	688126	沪硅产业	5,800.00	133,284.00	0.11
221	002916	深南电路	1,420.00	133,068.20	0.11
222	300207	欣旺达	4,200.00	132,720.00	0.11
223	002202	金风科技	8,800.00	130,240.00	0.11
224	603606	东方电缆	1,700.00	130,220.00	0.11
225	600039	四川路桥	12,300.00	129,519.00	0.11
226	603899	晨光股份	2,300.00	128,984.00	0.11
227	300223	北京君正	1,200.00	127,500.00	0.11
228	603737	三棵树	980.00	126,841.40	0.11
229	002240	盛新锂能	2,100.00	126,756.00	0.11
230	601607	上海医药	7,000.00	126,560.00	0.11
231	600115	中国东航	23,000.00	126,270.00	0.11
232	002120	韵达股份	7,300.00	124,538.00	0.11
233	300919	中伟股份	1,000.00	123,900.00	0.11
234	600779	水井坊	1,338.00	123,818.52	0.11
235	688169	石头科技	200.00	123,340.00	0.10
236	600141	兴发集团	2,800.00	123,172.00	0.10
237	002236	大华股份	7,500.00	123,150.00	0.10
238	600563	法拉电子	600.00	123,096.00	0.10
239	300390	天华超净	1,400.00	122,360.00	0.10
240	601377	兴业证券	17,300.00	121,965.00	0.10
241	688099	晶晨股份	1,200.00	121,200.00	0.10
242	002013	中航机电	9,800.00	121,030.00	0.10
243	002555	三七互娱	5,700.00	121,011.00	0.10
244	300033	同花顺	1,256.00	120,764.40	0.10
245	601799	星宇股份	700.00	119,700.00	0.10
246	603613	国联股份	1,350.00	119,610.00	0.10
247	600584	长电科技	4,400.00	118,800.00	0.10
248	300601	康泰生物	2,620.00	118,371.60	0.10
249	002601	龙佰集团	5,900.00	118,295.00	0.10

250	300450	先导智能	1,860.00	117,514.80	0.10
251	300073	当升科技	1,300.00	117,442.00	0.10
252	002791	坚朗五金	900.00	116,748.00	0.10
253	002738	中矿资源	1,260.00	116,688.60	0.10
254	300347	泰格医药	1,000.00	114,450.00	0.10
255	300454	深信服	1,100.00	114,158.00	0.10
256	002841	视源股份	1,511.00	113,808.52	0.10
257	688363	华熙生物	800.00	113,744.00	0.10
258	600332	白云山	3,600.00	113,724.00	0.10
259	600875	东方电气	6,900.00	113,505.00	0.10
260	600803	新奥股份	6,100.00	113,399.00	0.10
261	600918	中泰证券	14,800.00	113,220.00	0.10
262	002080	中材科技	4,100.00	112,750.00	0.10
263	601878	浙商证券	9,900.00	112,662.00	0.10
264	000157	中联重科	18,100.00	111,496.00	0.09
265	000425	徐工机械	20,600.00	111,034.00	0.09
266	002340	格林美	12,200.00	111,020.00	0.09
267	600674	川投能源	9,300.00	110,856.00	0.09
268	688122	西部超导	1,200.00	110,640.00	0.09
269	603816	顾家家居	1,950.00	110,428.50	0.09
270	603568	伟明环保	3,300.00	110,121.00	0.09
271	601699	潞安环能	7,500.00	109,650.00	0.09
272	603456	九洲药业	2,100.00	108,570.00	0.09
273	600219	南山铝业	29,300.00	108,117.00	0.09
274	300595	欧普康视	1,890.00	108,089.10	0.09
275	605358	立昂微	1,600.00	107,808.00	0.09
276	002414	高德红外	8,375.00	107,786.25	0.09
277	002192	融捷股份	700.00	107,590.00	0.09
278	603882	金域医学	1,300.00	107,315.00	0.09
279	600486	扬农化工	800.00	106,624.00	0.09
280	601881	中国银河	11,000.00	106,370.00	0.09
281	002176	江特电机	4,200.00	105,168.00	0.09
282	603198	迎驾贡酒	1,600.00	104,224.00	0.09
283	000999	华润三九	2,314.00	104,130.00	0.09
284	688187	时代电气	1,600.00	103,984.00	0.09
285	601216	君正集团	21,300.00	103,944.00	0.09
286	002064	华峰化学	12,300.00	103,812.00	0.09
287	300529	健帆生物	2,020.00	102,797.80	0.09
288	002007	华兰生物	4,500.00	102,600.00	0.09
289	002603	以岭药业	4,220.00	102,546.00	0.09
290	002252	上海莱士	17,200.00	101,996.00	0.09
291	002372	伟星新材	4,200.00	100,968.00	0.09
292	000977	浪潮信息	3,800.00	100,624.00	0.09
293	600183	生益科技	5,900.00	100,241.00	0.09

294	000683	远兴能源	9,500.00	99,845.00	0.08
295	300373	扬杰科技	1,400.00	99,750.00	0.08
296	600885	宏发股份	2,380.00	99,603.00	0.08
297	300144	宋城演艺	6,480.00	99,468.00	0.08
298	600392	盛和资源	4,400.00	99,440.00	0.08
299	000519	中兵红箭	3,400.00	99,110.00	0.08
300	002384	东山精密	4,300.00	98,599.00	0.08
301	603127	昭衍新药	860.00	97,868.00	0.08
302	300037	新宙邦	1,860.00	97,761.60	0.08
303	600298	安琪酵母	2,000.00	97,500.00	0.08
304	603939	益丰药房	1,816.00	95,939.28	0.08
305	002850	科达利	600.00	95,400.00	0.08
306	688202	美迪西	280.00	95,090.80	0.08
307	600153	建发股份	7,265.00	94,953.55	0.08
308	600499	科达制造	4,600.00	94,944.00	0.08
309	002497	雅化集团	2,900.00	94,685.00	0.08
310	600985	淮北矿业	6,500.00	94,640.00	0.08
311	603077	和邦生物	22,200.00	94,572.00	0.08
312	601108	财通证券	11,990.00	94,361.30	0.08
313	600348	华阳股份	6,100.00	94,306.00	0.08
314	601966	玲珑轮胎	3,700.00	93,869.00	0.08
315	601233	桐昆股份	5,900.00	93,692.00	0.08
316	002625	光启技术	5,400.00	93,258.00	0.08
317	601696	中银证券	7,000.00	93,100.00	0.08
318	600026	中远海能	9,000.00	92,970.00	0.08
319	002407	多氟多	1,900.00	92,929.00	0.08
320	002602	世纪华通	19,260.00	92,833.20	0.08
321	000738	航发控制	3,300.00	92,730.00	0.08
322	600362	江西铜业	5,200.00	92,716.00	0.08
323	000703	恒逸石化	8,791.00	92,393.41	0.08
324	000009	中国宝安	6,800.00	91,732.00	0.08
325	000932	华菱钢铁	17,900.00	91,111.00	0.08
326	601319	中国人保	18,000.00	91,080.00	0.08
327	300146	汤臣倍健	4,200.00	90,930.00	0.08
328	600160	巨化股份	6,900.00	90,735.00	0.08
329	600655	豫园股份	9,600.00	90,624.00	0.08
330	002268	卫士通	2,100.00	90,111.00	0.08
331	002600	领益智造	17,900.00	89,858.00	0.08
332	603707	健友股份	3,160.00	89,112.00	0.08
333	600521	华海药业	3,920.00	88,984.00	0.08
334	002353	杰瑞股份	2,200.00	88,660.00	0.08
335	601555	东吴证券	12,686.00	87,913.98	0.07
336	002405	四维图新	5,800.00	87,406.00	0.07
337	600487	亨通光电	6,000.00	87,240.00	0.07

338	000630	铜陵有色	26,600.00	86,716.00	0.07
339	601636	旗滨集团	6,800.00	86,700.00	0.07
340	600109	国金证券	9,600.00	86,400.00	0.07
341	002078	太阳纸业	7,000.00	86,170.00	0.07
342	000807	云铝股份	8,700.00	85,956.00	0.07
343	601666	平煤股份	6,300.00	85,617.00	0.07
344	300850	新强联	950.00	84,578.50	0.07
345	000066	中国长城	7,800.00	84,396.00	0.07
346	300568	星源材质	2,896.00	84,099.84	0.07
347	000783	长江证券	14,100.00	83,613.00	0.07
348	300003	乐普医疗	4,500.00	83,565.00	0.07
349	601077	渝农商行	22,500.00	83,250.00	0.07
350	000830	鲁西化工	4,800.00	82,992.00	0.07
351	688009	中国通号	18,300.00	82,899.00	0.07
352	002508	老板电器	2,300.00	82,869.00	0.07
353	000629	攀钢钒钛	21,800.00	82,840.00	0.07
354	300699	光威复材	1,400.00	82,418.00	0.07
355	601058	赛轮轮胎	7,200.00	81,144.00	0.07
356	603589	口子窖	1,384.00	81,116.24	0.07
357	603517	绝味食品	1,400.00	80,948.00	0.07
358	603267	鸿远电子	600.00	80,598.00	0.07
359	600848	上海临港	5,940.00	80,546.40	0.07
360	002385	大北农	10,309.00	80,513.29	0.07
361	300724	捷佳伟创	900.00	80,415.00	0.07
362	002557	洽洽食品	1,400.00	79,702.00	0.07
363	600161	天坛生物	3,280.00	79,638.40	0.07
364	002507	涪陵榨菜	2,300.00	79,396.00	0.07
365	600027	华电国际	20,200.00	79,386.00	0.07
366	601577	长沙银行	10,000.00	79,300.00	0.07
367	000825	太钢不锈	14,500.00	79,025.00	0.07
368	300676	华大基因	1,100.00	78,870.00	0.07
369	002294	信立泰	2,800.00	78,680.00	0.07
370	601990	南京证券	9,400.00	78,396.00	0.07
371	600177	雅戈尔	11,800.00	78,234.00	0.07
372	600549	厦门钨业	3,610.00	78,048.20	0.07
373	600705	中航产融	22,500.00	77,850.00	0.07
374	002568	百润股份	2,584.00	77,623.36	0.07
375	603444	吉比特	200.00	77,600.00	0.07
376	000155	川能动力	3,500.00	77,525.00	0.07
377	000027	深圳能源	12,000.00	76,920.00	0.07
378	002185	华天科技	8,200.00	76,916.00	0.07
379	600415	小商品城	13,800.00	76,866.00	0.07
380	603233	大参林	2,440.00	76,372.00	0.06
381	688185	康希诺	383.00	76,247.64	0.06

382	688006	杭可科技	1,086.00	76,085.16	0.06
383	601456	国联证券	6,200.00	76,074.00	0.06
384	601866	中远海发	25,300.00	75,900.00	0.06
385	000933	神火股份	5,800.00	75,864.00	0.06
386	002531	天顺风能	4,600.00	75,854.00	0.06
387	000831	五矿稀土	2,400.00	75,000.00	0.06
388	000987	越秀金控	10,619.00	74,651.57	0.06
389	002673	西部证券	11,400.00	74,556.00	0.06
390	300357	我武生物	1,402.00	72,946.06	0.06
391	601198	东兴证券	8,175.00	72,757.50	0.06
392	000401	冀东水泥	6,900.00	72,588.00	0.06
393	002326	永太科技	2,200.00	72,446.00	0.06
394	300832	新产业	1,600.00	72,176.00	0.06
395	601168	西部矿业	6,100.00	72,163.00	0.06
396	002409	雅克科技	1,300.00	72,163.00	0.06
397	002430	杭氧股份	2,300.00	71,898.00	0.06
398	600516	方大炭素	9,460.00	71,896.00	0.06
399	002422	科伦药业	3,758.00	70,274.60	0.06
400	600801	华新水泥	3,600.00	70,236.00	0.06
401	002128	电投能源	4,900.00	70,168.00	0.06
402	002032	苏泊尔	1,239.00	69,805.26	0.06
403	000728	国元证券	11,200.00	69,664.00	0.06
404	600258	首旅酒店	2,800.00	69,440.00	0.06
405	603605	珀莱雅	420.00	69,375.60	0.06
406	000800	一汽解放	7,400.00	69,116.00	0.06
407	002624	完美世界	4,800.00	68,976.00	0.06
408	002797	第一创业	10,700.00	68,587.00	0.06
409	300251	光线传媒	7,200.00	68,184.00	0.06
410	002939	长城证券	6,700.00	68,072.00	0.06
411	603338	浙江鼎力	1,340.00	67,938.00	0.06
412	601880	辽港股份	39,900.00	67,830.00	0.06
413	600704	物产中大	13,200.00	67,716.00	0.06
414	600170	上海建工	22,300.00	67,569.00	0.06
415	300726	宏达电子	1,100.00	67,287.00	0.06
416	600369	西南证券	16,900.00	67,093.00	0.06
417	000960	锡业股份	4,000.00	67,080.00	0.06
418	300558	贝达药业	1,100.00	66,880.00	0.06
419	000937	冀中能源	8,900.00	66,394.00	0.06
420	002153	石基信息	4,168.00	66,146.16	0.06
421	600338	西藏珠峰	2,300.00	66,010.00	0.06
422	600872	中炬高新	1,900.00	65,759.00	0.06
423	002266	浙富控股	13,700.00	65,623.00	0.06
424	600988	赤峰黄金	4,100.00	65,395.00	0.06
425	000893	亚钾国际	1,900.00	65,379.00	0.06

426	000975	银泰黄金	6,700.00	65,258.00	0.06
427	002463	沪电股份	4,420.00	65,239.20	0.06
428	002028	思源电气	1,800.00	64,188.00	0.05
429	002223	鱼跃医疗	2,500.00	64,150.00	0.05
430	600079	人福医药	4,000.00	64,000.00	0.05
431	688298	东方生物	560.00	63,924.00	0.05
432	603218	日月股份	2,500.00	63,500.00	0.05
433	600598	北大荒	4,300.00	63,468.00	0.05
434	002532	天山铝业	9,700.00	63,341.00	0.05
435	002030	达安基因	3,628.00	62,365.32	0.05
436	000739	普洛药业	3,000.00	61,920.00	0.05
437	000050	深天马 A	6,200.00	61,814.00	0.05
438	000591	太阳能	7,400.00	61,790.00	0.05
439	000709	河钢股份	27,300.00	61,698.00	0.05
440	688188	柏楚电子	280.00	61,611.20	0.05
441	002299	圣农发展	3,200.00	61,376.00	0.05
442	601016	节能风电	12,600.00	60,480.00	0.05
443	600380	健康元	4,800.00	59,280.00	0.05
444	000423	东阿阿胶	1,600.00	59,120.00	0.05
445	600143	金发科技	6,200.00	59,024.00	0.05
446	601992	金隅集团	21,300.00	59,001.00	0.05
447	300308	中际旭创	1,900.00	58,995.00	0.05
448	600038	中直股份	1,300.00	58,760.00	0.05
449	002541	鸿路钢构	1,750.00	58,450.00	0.05
450	002152	广电运通	6,300.00	58,401.00	0.05
451	002408	齐翔腾达	7,200.00	58,392.00	0.05
452	600688	上海石化	18,300.00	58,194.00	0.05
453	000513	丽珠集团	1,600.00	57,936.00	0.05
454	000988	华工科技	2,500.00	57,925.00	0.05
455	600056	中国医药	3,900.00	57,798.00	0.05
456	600808	马钢股份	15,100.00	57,229.00	0.05
457	600998	九州通	4,800.00	57,168.00	0.05
458	603858	步长制药	2,900.00	57,159.00	0.05
459	603712	七一二	1,800.00	56,700.00	0.05
460	002506	协鑫集成	15,100.00	56,172.00	0.05
461	002456	欧菲光	8,300.00	55,693.00	0.05
462	603866	桃李面包	3,348.00	55,409.40	0.05
463	600699	均胜电子	3,500.00	54,985.00	0.05
464	000998	隆平高科	3,300.00	54,978.00	0.05
465	002044	美年健康	9,800.00	54,586.00	0.05
466	600295	鄂尔多斯	3,020.00	54,511.00	0.05
467	002138	顺络电子	2,000.00	54,500.00	0.05
468	002926	华西证券	6,800.00	53,312.00	0.05
469	600711	盛屯矿业	6,800.00	52,768.00	0.04

470	002465	海格通信	5,800.00	52,722.00	0.04
471	002500	山西证券	9,150.00	52,521.00	0.04
472	002156	通富微电	3,400.00	52,360.00	0.04
473	002065	东华软件	8,200.00	51,824.00	0.04
474	002145	中核钛白	7,220.00	51,478.60	0.04
475	002092	中泰化学	6,600.00	51,216.00	0.04
476	000750	国海证券	13,800.00	50,094.00	0.04
477	300418	昆仑万维	3,100.00	49,600.00	0.04
478	002010	传化智联	7,700.00	49,511.00	0.04
479	002157	正邦科技	8,000.00	48,480.00	0.04
480	000860	顺鑫农业	1,800.00	48,276.00	0.04
481	300070	碧水源	9,200.00	47,932.00	0.04
482	688002	睿创微纳	1,200.00	47,664.00	0.04
483	600895	张江高科	3,800.00	47,310.00	0.04
484	300383	光环新网	4,500.00	46,890.00	0.04
485	002958	青农商行	14,100.00	46,812.00	0.04
486	300253	卫宁健康	5,330.00	46,797.40	0.04
487	002558	巨人网络	5,100.00	46,665.00	0.04
488	600583	海油工程	11,200.00	46,480.00	0.04
489	600498	烽火通信	3,000.00	43,440.00	0.04
490	601598	中国外运	11,100.00	43,068.00	0.04
491	000686	东北证券	6,100.00	42,639.00	0.04
492	002925	盈趣科技	1,900.00	40,888.00	0.03
493	300677	英科医疗	1,600.00	40,576.00	0.03
494	002563	森马服饰	6,800.00	40,256.00	0.03
495	000656	金科股份	13,800.00	39,468.00	0.03

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	688622	禾信仪器	1,204.00	41,200.88	0.03
2	300432	富临精工	1,000.00	22,000.00	0.02
3	301089	拓新药业	130.00	16,330.60	0.01
4	301073	君亭酒店	184.00	12,758.56	0.01
5	301062	上海艾录	523.00	6,103.41	0.01
6	301072	中捷精工	181.00	5,797.43	0.00
7	301188	力诺特玻	289.00	5,144.20	0.00
8	301056	森赫股份	572.00	4,953.52	0.00
9	301057	汇隆新材	182.00	4,431.70	0.00
10	301059	金三江	243.00	4,082.40	0.00
11	300854	中兰环保	203.00	4,035.64	0.00

12	301068	大地海洋	144.00	3,477.60	0.00
13	301079	邵阳液压	140.00	3,472.00	0.00
14	301063	海锅股份	124.00	3,454.64	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	300750	宁德时代	687,538.00	0.42
2	600905	三峡能源	587,300.00	0.36
3	000858	五粮液	541,074.00	0.33
4	002594	比亚迪	510,509.00	0.31
5	688599	天合光能	455,534.59	0.28
6	000651	格力电器	395,309.00	0.24
7	601006	大秦铁路	300,468.00	0.18
8	002049	紫光国微	280,202.00	0.17
9	300059	东方财富	271,699.64	0.17
10	601868	中国能建	257,850.00	0.16
11	300760	迈瑞医疗	240,918.00	0.15
12	000001	平安银行	221,791.00	0.14
13	002714	牧原股份	211,562.00	0.13
14	002352	顺丰控股	200,663.00	0.12
15	688005	容百科技	200,132.08	0.12
16	601238	广汽集团	191,875.00	0.12
17	688396	华润微	189,804.00	0.12
18	002475	立讯精密	184,613.00	0.11
19	002142	宁波银行	182,600.80	0.11
20	600884	杉杉股份	181,358.00	0.11

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	300750	宁德时代	1,669,799.60	1.03
2	000858	五粮液	1,296,945.10	0.80
3	002594	比亚迪	957,725.20	0.59

4	600519	贵州茅台	548,018.00	0.34
5	300760	迈瑞医疗	534,205.20	0.33
6	000568	泸州老窖	484,472.00	0.30
7	002714	牧原股份	480,551.40	0.30
8	300059	东方财富	464,914.00	0.29
9	002352	顺丰控股	459,138.30	0.28
10	000001	平安银行	443,825.12	0.27
11	002475	立讯精密	401,206.00	0.25
12	002812	恩捷股份	395,165.00	0.24
13	002304	洋河股份	343,805.30	0.21
14	002142	宁波银行	342,461.00	0.21
15	300015	爱尔眼科	334,708.00	0.21
16	002049	紫光国微	311,590.00	0.19
17	300014	亿纬锂能	303,057.00	0.19
18	300122	智飞生物	275,752.21	0.17
19	000002	万科 A	271,782.00	0.17
20	002493	荣盛石化	243,762.00	0.15

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	19,532,274.44
卖出股票的收入（成交）总额	30,074,354.66

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）	694,851.46	0.59
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	694,851.46	0.59

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	113052	兴业转债	1,750	195,425.18	0.17
2	113042	上银转债	1,240	130,293.36	0.11
3	113050	南银转债	930	114,096.15	0.10
4	110079	杭银转债	810	101,478.75	0.09
5	123107	温氏转债	504	66,171.68	0.06

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国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11 本报告期投资基金情况

7.11.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	826,792.41
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	826,792.41

7.12.4 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	113052	兴业转债	195,425.18	0.17
2	113042	上银转债	130,293.36	0.11
3	113050	南银转债	114,096.15	0.10
4	110079	杭银转债	101,478.75	0.09
5	123107	温氏转债	66,171.68	0.06

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名积极投资中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,313	69,099.26	51,218,822.00	56.45%	39,508,501.00	43.55%

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	招商证券股份有限公司	6,920,655.00	7.63%
2	东方证券股份有限公司	4,668,940.00	5.15%
3	华泰证券股份有限公司	3,134,426.00	3.45%
4	广发证券股份有限公司	3,109,663.00	3.43%
5	中航安盟财产保险有限公司—自有资金	2,395,200.00	2.64%
6	纪少健	2,000,000.00	2.20%
7	陈永军	1,506,800.00	1.66%
8	陈茂春	1,500,000.00	1.65%
9	李红	900,000.00	0.99%
10	朱茵	798,800.00	0.88%

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	114,727,323.00
本报告期基金总申购份额	24,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	48,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	90,727,323.00

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：无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未发生改聘为其审计的会计师事务所的情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	4	49,475,867.05	100.00%	31,234.30	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	-	-	-	-	-	-

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	上投摩根基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	基金管理人公司网站及本基金选定的信息披露报纸	2022-01-05
2	上投摩根基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票估值调整的公告	同上	2022-05-05
3	上投摩根基金管理有限公司关于旗下管理的上海证券交易所上市 ETF 实施申赎业务多码合一的公告	同上	2022-06-17

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	20220101-20220630	34,967,800.00	2,690,900.00	8,110,800.00	29,547,900.00	32.57%
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

二〇二二年八月三十一日