

摩根沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金
2023 年中期报告
2023 年 6 月 30 日

基金管理人：摩根基金管理（中国）有限公司

基金托管人：江苏银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年八月三十一日

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。

基金托管人江苏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 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 2023 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.....	7
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	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	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
5 托管人报告	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的真实、准确和完整发表意见	15
6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 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	44
7.1 期末基金资产组合情况.....	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	58
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	58
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	58
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	58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
7.12 本报告期投资基金情况	59
7.13 投资组合报告附注	59
8 基金份额持有人信息	60

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
8.3 发起式基金发起资金持有份额情况	61
9 开放式基金份额变动	61
10 重大事件揭示	61
10.1 基金份额持有人大会决议	61
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	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
10.4 基金投资策略的改变	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	62
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	62
10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	62
10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	62
10.8 其他重大事件	63
11 影响投资者决策的其他重要信息	64
12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录	64
12.2 存放地点	64
12.3 查阅方式	65

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	摩根沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	摩根沪深 300 指数增强发起式	
基金主代码	017445	
交易代码	017445	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 12 月 28 日	
基金管理人	摩根基金管理（中国）有限公司	
基金托管人	江苏银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	16,319,747.41 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	摩根沪深 300 指数增强发起式 A	摩根沪深 300 指数增强发起式 C
下属分级基金的交易代码	017445	017446
报告期末下属分级基金的份额总额	15,488,884.08 份	830,863.33 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过量化的方法进行积极的组合管理与严格的风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金为指数增强型基金，股票资产占基金资产的比例不低于 80%，一般情况下将保持资产配置的基本稳定。基金运作过程中，将综合考量系统性风险、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素，对基金资产配置做出合适调整。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金属于指数增强型股票基金，一方面采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数，另一方面采用量化模型调整投资组合力求超越标的指数表现。力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%。</p> <p>本基金所采用的股票量化投资模型主要包含三个部分，以实现股票收益预测，风险控制和跟踪误差控制。这三个部分包括收益预测模型，风险模型和组合优化模型。</p> <p>收益预测模型以量化投资团队开发的多因子选股模型和事件驱动策略为基础，深入分析个股的估值水平、盈利指标、波动指标、运营指标、市场情绪面等指标，根据行情变化进行动态调整，争取做出全面优质的股票收益预测。</p> <p>风险模型控制投资组合对各类风险因子的敞口，包括资产波动率、行业集中度、风格暴露等，力求主动风险以及跟踪误差控制在目标范围内。</p> <p>组合优化模型结合收益预测模型和风险模型的产出，并综合考虑交易成本</p>

	<p>等因素，在风险约束条件下，将投研成果转化成实际的可投资组合。力争股票配置最优化，以期达到持续超越业绩比较基准收益率的投资目标。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金将在控制市场风险与流动性风险的前提下，根据对财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的持续跟踪，结合不同债券品种的到期收益率、流动性、市场规模等情况，灵活运用久期管理策略、期限结构配置策略、信用债投资策略、可转换债券投资策略、证券公司短期公司债券投资策略等多种投资策略，实施积极主动的组合管理，并根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预测，对债券组合进行动态调整。</p> <p>4、股指期货投资策略</p> <p>本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。</p> <p>5、股票期权投资策略</p> <p>本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，参与股票期权的投资。本基金将在有效控制风险的前提下，选择流动性好、交易活跃的期权合约进行投资。本基金将基于对证券市场的预判，并结合股票期权定价模型，选择估值合理的期权合约。</p> <p>6、国债期货投资策略</p> <p>基金管理人将按照相关法律法规的规定，根据风险管理原则，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，主要选择流动性好、交易活跃的国债期货合约进行交易。</p> <p>7、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量等因素，主要从资产池信用状况、违约相关性、历史违约记录和损失比例、证券的信用增强方式、利差补偿程度等方面对资产支持证券的风险与收益状况进行评估，在严格控制风险的情况下，确定资产合理配置比例，在保证资产安全性的前提条件下，以期获得长期稳定收益。</p> <p>8、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> <p>9、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，在保障基金投资组合充足流动性以及有效控制融资杠杆风险的前提下，确定融资比例。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率 \times 95% + 银行活期存款利率(税后) \times 5%
风险收益特征	本基金为指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，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		摩根基金管理（中国）有限公司	江苏银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	邹树波	周宏
	联系电话	021-38794888	025-58588217
	电子邮箱	services@cifm.com	zhouhong1@jsbchina.cn
客户服务电话		400-889-4888	95319
传真		021-20628400	025-58588155
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	南京市中华路26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	南京市中华路26号
邮政编码		200120	210001
法定代表人		王琼慧	夏平

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	am.jpmorgan.com/cn
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	摩根基金管理（中国）有限公司	中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号 震旦国际大楼 25 楼

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日）	
	摩根沪深 300 指数增强发起式 A	摩根沪深 300 指数增强发起式 C
本期已实现收益	83,080.91	3,136.64
本期利润	-781,964.71	-65,318.56
加权平均基金份额本期利润	-0.0513	-0.0931

本期加权平均净值利润率	-5.17%	-9.46%
本期基金份额净值增长率	-5.07%	-5.20%
报告期末(2023 年 6 月 30 日)		
3.1.2 期末数据和指标	摩根沪深 300 指数增强发起式 A	摩根沪深 300 指数增强发起式 C
期末可供分配利润	-788,416.07	-43,410.62
期末可供分配基金份额利润	-0.0509	-0.0522
期末基金资产净值	14,700,468.01	787,452.71
期末基金份额净值	0.9491	0.9478
报告期末(2023 年 6 月 30 日)		
3.1.3 累计期末指标	摩根沪深 300 指数增强发起式 A	摩根沪深 300 指数增强发起式 C
基金份额累计净值增长率	-5.09%	-5.22%

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。

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

摩根沪深 300 指数增强发起式 A

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	2.27%	0.86%	1.10%	0.83%	1.17%	0.03%
过去三个月	-4.60%	0.79%	-4.88%	0.79%	0.28%	0.00%
过去六个月	-5.07%	0.78%	-0.71%	0.80%	-4.36%	-0.02%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-5.09%	0.77%	-1.10%	0.79%	-3.99%	-0.02%

摩根沪深 300 指数增强发起式 C

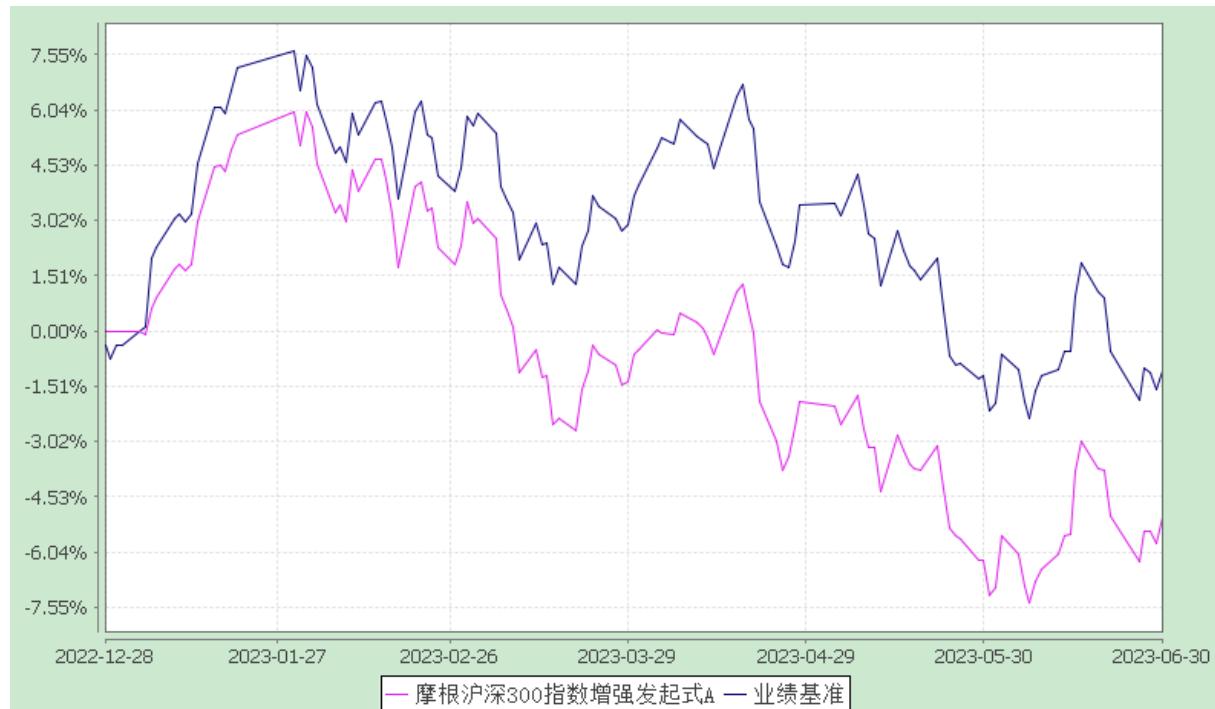
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.25%	0.87%	1.10%	0.83%	1.15%	0.04%
过去三个月	-4.67%	0.79%	-4.88%	0.79%	0.21%	0.00%
过去六个月	-5.20%	0.78%	-0.71%	0.80%	-4.49%	-0.02%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-

自基金合同生效起至今	-5.22%	0.77%	-1.10%	0.79%	-4.12%	-0.02%
------------	--------	-------	--------	-------	--------	--------

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

摩根沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金
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
(2022 年 12 月 28 日至 2023 年 6 月 30 日)

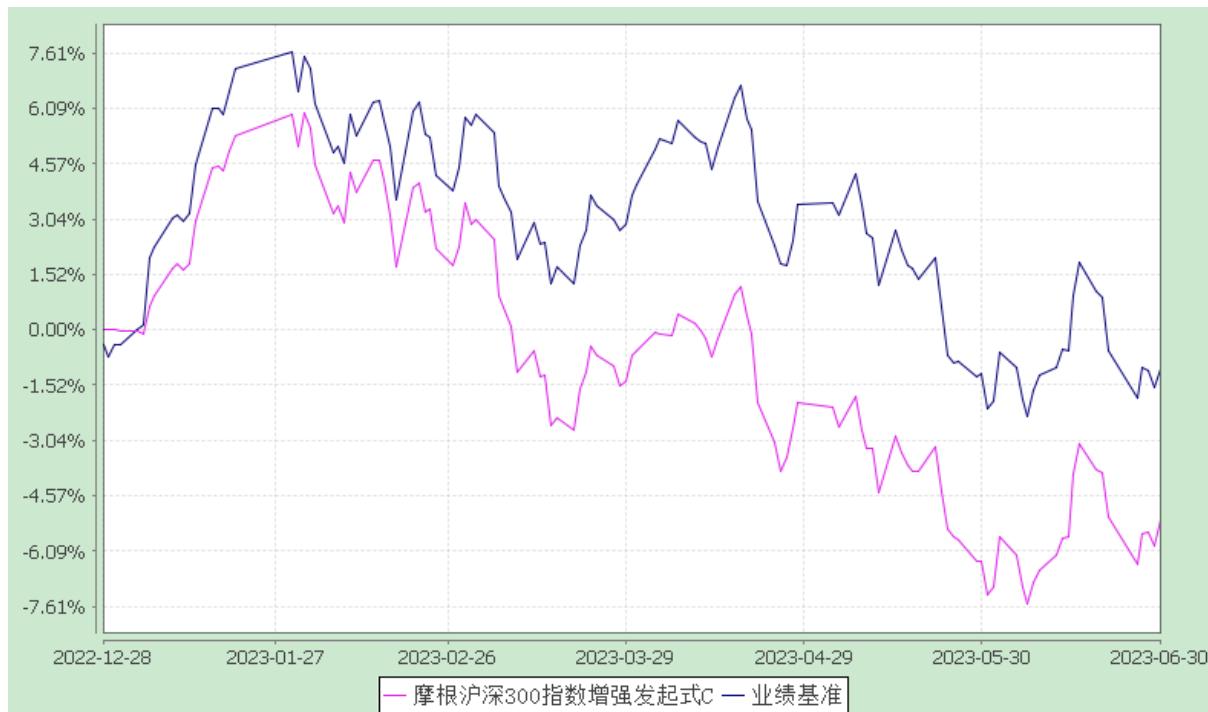
摩根沪深 300 指数增强发起式 A



注：本基金合同生效日为 2022 年 12 月 28 日，截至本报告期末本基金合同生效未满一年。

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。

摩根沪深 300 指数增强发起式 C



注：本基金合同生效日为 2022 年 12 月 28 日，截至本报告期末本基金合同生效未满一年。

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

摩根基金管理（中国）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，注册资本为 2.5 亿元人民币，注册地上海。2023 年 1 月 19 日，经中国证监会批准，本公司原股东之一上海国际信托有限公司将其持有的本公司 51% 股权，与原另一股东 JPMorgan Asset Management (UK) Limited 将其持有的本公司 49% 股权转让给摩根资产管理控股公司 (JPMorgan Asset Management Holdings Inc.)，从而摩根资产管理控股公司取得本公司全部股权。2023 年 4 月 10 日，基金管理人的名称由“上投摩根基金管理有限公司”变更为“摩根基金管理（中国）有限公司”。截至 2023 年 6 月底，公司旗下运作的基金共有八十七只，均为开放式基金，分别是：摩根中国优势证券投资基金、摩根货币市场基金、摩根阿尔法混合型证券投资基金、摩根双息平衡混合型证券投资基金、摩根成长先锋混合型证券投资基金、摩根内需动力混合型证券投资基金、摩根亚太优势混合型证券投资基金(QDII)、摩根双核平衡混合型证券投资基金、摩根中小盘混合型证券投资基金、摩根

纯债债券型证券投资基金、摩根行业轮动混合型证券投资基金、摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金、摩根全球新兴市场混合型证券投资基金(QDII)、摩根新兴动力混合型证券投资基金、摩根强化回报债券型证券投资基金、摩根健康品质生活混合型证券投资基金、摩根全球天然资源混合型证券投资基金(QDII)、摩根核心优选混合型证券投资基金、摩根智选 30 混合型证券投资基金、摩根成长动力混合型证券投资基金、摩根转型动力灵活配置混合型证券投资基金、摩根双债增利债券型证券投资基金、摩根核心成长股票型证券投资基金、摩根民生需求股票型证券投资基金、摩根纯债丰利债券型证券投资基金、摩根天添盈货币市场基金、摩根天添宝货币市场基金、摩根安全战略股票型证券投资基金、摩根卓越制造股票型证券投资基金、摩根整合驱动灵活配置混合型证券投资基金、摩根动态多因子策略灵活配置混合型证券投资基金、摩根智慧互联股票型证券投资基金、摩根科技前沿灵活配置混合型证券投资基金、摩根新兴服务股票型证券投资基金、摩根医疗健康股票型证券投资基金、摩根中国世纪灵活配置混合型证券投资基金(QDII)、摩根全球多元配置证券投资基金(QDII-FOF)、摩根安通回报混合型证券投资基金、摩根丰瑞债券型证券投资基金、摩根标普港股通低波红利指数型证券投资基金、摩根量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、摩根安隆回报混合型证券投资基金、摩根创新商业模式灵活配置混合型证券投资基金、摩根富时发达市场 REITs 指数型证券投资基金(QDII)、摩根香港精选港股通混合型证券投资基金、摩根尚睿混合型基金中基金(FOF)、摩根安裕回报混合型证券投资基金、摩根欧洲动力策略股票型证券投资基金(QDII)、摩根核心精选股票型证券投资基金、摩根动力精选混合型证券投资基金、摩根中国生物医药混合型证券投资基金(QDII)、摩根领先优选混合型证券投资基金、摩根日本精选股票型证券投资基金(QDII)、摩根锦程均衡养老目标三年持有期混合型基金中基金(FOF)、摩根瑞益纯债债券型证券投资基金、摩根慧选成长股票型证券投资基金、摩根瑞泰 38 个月定期开放债券型证券投资基金、摩根锦程稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)、摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、摩根研究驱动股票型证券投资基金、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、摩根瑞盛 87 个月定期开放债券型证券投资基金、摩根慧见两年持有期混合型证券投资基金、摩根远见两年持有期混合型证券投资基金、摩根安享回报一年持有期债券型证券投资基金、摩根行业睿选股型证券投资基金、摩根优势成长混合型证券投资基金、摩根安荣回报混合型证券投资基金、摩根中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、摩根景气甄选混合型证券投资基金、摩根均衡优选混合型证券投资基金、摩根中证沪港深科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、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、摩根恒生科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)、摩根全景优势股票型证券投资基金、摩根沃享远见一年持有期混合型证券投资基金、摩根鑫睿优选一年持有期混合型证券投资基金、摩根博睿均衡一年持有期混合型基金中基金(FOF)、摩根中证创新药产

业交易型开放式指数证券投资基金、摩根慧享成长混合型证券投资基金、摩根瑞享纯债债券型证券投资基金、摩根中证碳中和 60 交易型开放式指数证券投资基金、摩根沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金、摩根标普 500 指数型发起式证券投资基金(QDII)、摩根锦颐养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、摩根海外稳健配置混合型证券投资基金(QDII-FOF)、摩根时代睿选股票型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
毛时超	本基金基金经理	2022-12-28	-	7 年	毛时超先生曾任平安基金管理有限公司量化研究员、基金经理助理、基金经理；自 2021 年 11 月加入摩根基金管理（中国）有限公司（原上投摩根基金管理有限公司），现任指数及量化投资部基金经理。

注：1. 任职日期和离任日期均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2. 毛时超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遵规守信情况的说明

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。基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、本基金基金合同的规定。除以下情况外，基金经理对个股和投资组合的比例遵循了投资决策委员会的授权限制，基金投资比例符合基金合同和法律法规的要求：本基金曾出现个别由于市场原因引起的投资组合的投资指标被动偏离相关比例要求的情形，但已在规定时间内调整完毕。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司继续贯彻落实《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规和公司内部公平交易流程的各项要求，严格规范境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等活动，通过系统和人工相结合的方式进行交易执行和监控分析，以确保本公司管理的不同

投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的环节均得到公平对待。

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，通过对交易价格、交易时间、交易方向等的抽样分析，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

报告期内，A 股市场出现一定程度的分化，受益于人工智能技术发展的电子、通信、计算机、传媒等泛科技行业，估值处于历史相对低位的国企，成为市场两条主要的投资主线，并且两者在去年股价处于低位、机构持股金额较低。相反去年末机构投资者持有金额较高的新能源、泛消费、医药等行业，因为宏观经济弱复苏、需求不足被动去库存、汇率走弱、外资流入放缓等影响，虽然在期初有所反弹，但是整体表现较差。从因子表现来看，机构持股比例较高的公司表现较差，低估值、高股息、低波动等防御因子表现较好，成长类因子表现一般。此外在大盘股中低估值相比高成长因子，出现非常明显的占优趋势，对跟踪指数成分股的分化表现，产生了较大的影响。

本基金采用指数增强投资策略，采用多因子模型进行选股，重点配置估值相对业绩增速较为合理的公司，在严格控制行业和风格风险偏离与持股分散的情况下，力争实现相对基准指数长期稳健的超额收益表现。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期摩根沪深 300 增强 A 份额净值增长率为:-5.07%，同期业绩比较基准收益率为:-0.71%
摩根沪深 300 增强 C 份额净值增长率为:-5.20%，同期业绩比较基准收益率为:-0.71%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，本基金跟踪的标的指数相关企业，与中国宏观经济发展紧密相关，估值水平处于历史较低位置，股息率与股权风险溢价率，也处于历史较高位置，具有较好的中长期投资配置价值。

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

本报告期内，本基金托管人——江苏银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定以及《托管协议》的约定，尽职尽责履行了托管人应尽的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，本基金托管人——江苏银行股份有限公司未发现摩根基金管理（中国）有限公司在基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上存在损害基金份额持有人利益的行为，或违反《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、在各重要方面的运作违反基金合同规定的情况。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由基金管理人所编制和披露的定期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：摩根沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	876,665.24	14,802,812.49
结算备付金		1,005.00	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	14,683,981.89	254,299.00
其中：股票投资		14,683,981.89	254,299.00
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,758.53	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		15,563,410.66	15,057,111.49
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 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		-	-
应付赎回款		11,199.62	-

应付管理人报酬		6,300.72	618.76
应付托管费		1,260.14	123.75
应付销售服务费		172.96	0.03
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	56,556.50	1,192.40
负债合计		75,489.94	1,934.94
净资产：		-	-
实收基金	6.4.7.7	16,319,747.41	15,057,436.49
未分配利润	6.4.7.8	-831,826.69	-2,259.94
净资产合计		15,487,920.72	15,055,176.55
负债和净资产总计		15,563,410.66	15,057,111.49

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日,基金份额总额:16,319,747.41 份,其中:

A 类,基金份额净值:0.9491 元,基金份额:15,488,884.08 份,

C 类,基金份额净值:0.9478 元,基金份额:830,863.33 份。

6.2 利润表

会计主体：摩根沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	
		2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
一、营业总收入			-744,849.90
1.利息收入			2,034.48
其中：存款利息收入	6.4.7.9		1,998.91
债券利息收入			-
资产支持证券利息收入			-
买入返售金融资产收入			35.57
证券出借利息收入			-
其他利息收入			-
2.投资收益（损失以“-”填列）			186,244.85
其中：股票投资收益	6.4.7.10		-3,964.69
基金投资收益			-
债券投资收益	6.4.7.11		517.09
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		-
股利收益	6.4.7.13		189,692.45

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	-933,500.82
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	371.59
减：二、营业总支出		102,433.37
1. 管理人报酬		39,219.87
2. 托管费		7,844.00
3. 销售服务费		1,013.40
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		-
8. 其他费用	6.4.7.16	54,356.10
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-847,283.27
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-847,283.27
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-847,283.27

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：摩根沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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）	15,057,436.49	-	-2,259.94	15,055,176.55
二、本期期初净资产（基金净值）	15,057,436.49	-	-2,259.94	15,055,176.55
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,262,310.92	-	-829,566.75	432,744.17
(一)、综合收益总额	-	-	-847,283.27	-847,283.27
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	1,262,310.92	-	17,716.52	1,280,027.44

(净值减少以“-”号填列)				
其中：1.基金申购款	6,100,120.21	-	21,080.76	6,121,200.97
2.基金赎回款	-4,837,809.29	-	-3,364.24	-4,841,173.53
(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)	16,319,747.41	-	-831,826.69	15,487,920.72

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：王琼慧，主管会计工作负责人：王敏，会计机构负责人：俞文涵

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

摩根沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金(原名为上投摩根沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金，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[2022]2643 号《关于准予上投摩根沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》准予注册，由摩根基金管理(中国)有限公司(原上投摩根基金管理有限公司，已于 2023 年 4 月 10 日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《上投摩根沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，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 15,056,758.91 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(2022)第 1068 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《上投摩根沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于 2022 年 12 月 28 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 15,057,436.49 份基金份额，其中认购资金利息折合 677.58 份基金份额。本基金的基金管理人为摩根基金管理(中国)有限公司，基金托管人为江苏银行股份有限公司。

根据摩根基金管理(中国)有限公司 2023 年 4 月 12 日发布的《关于公司法定名称变更的公告》，本基金管理人的中文法定名称由“上投摩根基金管理有限公司”变更为“摩根基金管理(中国)有限公司”。根据同一天发布的《摩根基金管理(中国)有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》，上投摩根

沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金自该日起更名为摩根沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金。

根据《摩根沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用，而从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《摩根沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股、备选成份股、其他国内依法发行或上市的股票、存托凭证、衍生工具(股指期货、国债期货、股票期权等)、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、次级债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、证券公司短期公司债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单等，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)。在法律法规允许的前提下，本基金可进行融资及转融通证券出借业务交易。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例不低于 80%，投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%

本财务报表由本基金的基金管理人摩根基金管理(中国)有限公司于 2023 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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金管理XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、

中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《摩根沪深 300 指数增强型发起式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 2023 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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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。本期财务报表的实际编制期间为 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日和 2022 年 12 月 28 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 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业务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业务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、资产支持证券投资和基金投资，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。

6.4.4.4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。

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。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和资产支持证券投资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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 实收基金

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净资产比例计算的金额。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净资产比例计算的金额。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)。

6.4.4.8 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净资产比例计算的金额。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净资产比例计算的金额。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)。

6.4.4.9 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。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

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后的净额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。

6.4.4.10 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确认。

以摊余成本计量的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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的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，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 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。

6.4.4.13 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、基金投资、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) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金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》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 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。

(3) 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管理业务的指导意见》及中国证券投资基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1会计政策变更的说明

本基金本报告期内未发生会计政策变更。

6.4.5.2会计估计变更的说明

本基金本报告期内未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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。

对基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通或深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	460,133.41
等于： 本金	460,088.79
加： 应计利息	44.62
定期存款	-
等于： 本金	-
加： 应计利息	-
其他存款	416,531.83
等于： 本金	416,508.99
加： 应计利息	22.84
合计	876,665.24

注：其他存款为本基金存放在开立于基金结算机构的证券账户内的存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	15,618,092.71	-	14,683,981.89	-934,110.82
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所 市场	-	-	-
	银行间	-	-	-

市场				
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	15,618,092.71	-	14,683,981.89	-934,110.82

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

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
其他应付款	1,408.00
预提费用	55,148.50
合计	56,556.50

6.4.7.7 实收基金

摩根沪深 300 指数增强发起式 A

金额单位：人民币元

项目	本期	
	基金份额	账面金额
上年度末	15,056,216.44	15,056,216.44
本期申购	510,565.68	510,565.68
本期赎回（以“-”号填列）	-77,898.04	-77,898.04
本期末	15,488,884.08	15,488,884.08

摩根沪深 300 指数增强发起式 C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	基金份额	账面金额
上年度末	1,220.05	1,220.05
本期申购	5,589,554.53	5,589,554.53
本期赎回（以“-”号填列）	-4,759,911.25	-4,759,911.25
本期末	830,863.33	830,863.33

6.4.7.8 未分配利润

摩根沪深 300 指数增强发起式 A

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	-1,649.79	-609.95	-2,259.74
本期利润	83,080.91	-865,045.62	-781,964.71
本期基金份额交易产生的变动数	-1,693.78	-2,497.84	-4,191.62
其中：基金申购款	-2,062.84	-2,269.71	-4,332.55
基金赎回款	369.06	-228.13	140.93
本期已分配利润	-	-	-
本期末	79,737.34	-868,153.41	-788,416.07

摩根沪深 300 指数增强发起式 C

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	-0.15	-0.05	-0.20
本期利润	3,136.64	-68,455.20	-65,318.56
本期基金份额交易产生的	-29.09	21,937.23	21,908.14

变动数			
其中：基金申购款	-22,107.92	47,521.23	25,413.31
基金赎回款	22,078.83	-25,584.00	-3,505.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,107.40	-46,518.02	-43,410.62

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	807.65
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,187.26
结算备付金利息收入	4.00
其他	-
合计	1,998.91

注：其他存款利息收入为本基金存放在开立于基金结算机构的证券账户内的存款产生的利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	3,021,173.59
减：卖出股票成本总额	3,000,606.31
减：交易费用	24,531.97
买卖股票差价收入	-3,964.69

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	0.29
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	516.80
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	517.09
----	--------

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	2,619.71
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	2,100.00
减：应计利息总额	0.29
减：交易费用	2.62
买卖债券差价收入	516.80

6.4.7.12 衍生工具收益

无。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	189,692.45
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	189,692.45

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	-933,500.82
——股票投资	-933,500.82
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的	-

预估增值税	
合计	-933,500.82

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	369.99
转换费收入	1.60
合计	371.59

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	14,715.30
信息披露费	39,240.80
证券出借违约金	-
开户费	400.00
合计	54,356.10

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

根据中国证监会证监许可(2023)151 号《关于核准上投摩根基金管理有限公司变更股东、实际控制人的批复》，核准摩根资产管理控股公司(JPMorgan Asset Management Holdings Inc.)成为上投摩根基金管理有限公司主要股东；核准摩根大通公司(JPMorgan Chase & Co.)成为上投摩根基金管理有限公司实际控制人；对摩根资产管理控股公司依法受让上投摩根基金管理有限公司 2.5 亿元出资(占注册资本比例 100%)无异议。相关股权变更工商变更手续于 2023 年 3 月 24 日完成。公司股东由摩根资产管理(英国)有限公司及上海浦东发展银行股份有限公司变更为摩根资产管理控股公司。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
江苏银行股份有限公司	基金托管人
摩根基金管理（中国）有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

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 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	39,219.87
其中：支付销售机构的客户维护费	809.38

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.5% 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 0.5% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	7,844.00

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.01% 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 0.01% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
	摩根沪深 300 指数增	摩根沪深 300 指数增强发
		合计

	强发起式 A	起式 C	
摩根基金管理(中国)有限公司	-	2.63	2.63
合计	-	2.63	2.63

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值 0.3% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费=前一日 C 类基金份额资产净值 X 0.3% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	摩根沪深300指数增强发起式A	摩根沪深300指数增强发起式C
基金合同生效日（2022 年 12 月 28 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	14,999,675.00	-
期间申购/买入总份额	159,063.63	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	15,158,738.63	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	92.89%	-

注：上述基金管理人持有的份额包括基金管理人的高级管理人员、主要业务部门负责人、基金经理根据《基金管理公司绩效考核与薪酬管理指引》的要求，将一定比例的绩效薪酬购买本基金的部分。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2023年1月1日至2023年6月30日	当期利息收入
江苏银行	460,133.41	807.65

注：本基金的银行存款由基金托管人江苏银行保管，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（2023 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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601298	青岛港	2023-06-28	重要事项	6.97	2023-07-03	7.40	2,300.00	14,220.00	16,031.00	-

注：本基金截至 2023 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

本基金为指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过量化的方法进行积极的组合管理与严格的风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系建设，董事会主要负责基金管理人风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。董事会下设督察长，负责对基金管理人各业务环节合法合规运作的监督检查和基金管理人内部稽核监控工作，并可向基金管理人董事会和中国证监会直接报告。经营管理层下设风险评估联席会议，进行各部门管理程序的风险确认，并对各类风险予以事先充分的评估和防范，并进行及时控制和采取应急措施；在业务操作层面监察稽核部负责基金管理人各部门的风险控制检查，定期或不定期对业务部门内部控制制度执行情况和遵循国家法律，法规及其他规定的执行情况进行检查，并适时提出修改建议；风险管理部负责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控管，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江苏银行，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 2023 年 6 月 30 日，本基金无债券投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

于 2023 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)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。

6.4.13.4 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 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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

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

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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

6.4.13.4.2 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、存出保证金和应收申购款等。

6.4.13.4.2.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 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	876,665.24	-	-	-	876,665.24
结算备付金	1,005.00	-	-	-	1,005.00
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	14,683,981.89	14,683,981.89
买入返售金融资 产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,758.53	1,758.53

其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	877,670.24	-	-	14,685,740.42	15,563,410.66	
负债						
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	11,199.62	11,199.62	
应付管理人报酬	-	-	-	6,300.72	6,300.72	
应付托管费	-	-	-	1,260.14	1,260.14	
应付销售服务费	-	-	-	172.96	172.96	
应付交易费用	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	56,556.50	56,556.50	
负债总计	-	-	-	75,489.94	75,489.94	
利率敏感度缺口	877,670.24	-	-	14,610,250.48	15,487,920.72	

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

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.4 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。

本基金属于指数增强型股票基金，一方面采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数，另一方面采用量化模型调整投资组合力求超越标的指数表现。力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票资产不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终，扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.4.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末		上年度末	
	2023 年 6 月 30 日	占基金资产净值比例 (%)	2022 年 12 月 31 日	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	14,683,981.89	94.81	254,299.00	1.69
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	14,683,981.89	94.81	254,299.00	1.69

6.4.13.4.4.2 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	上年度末
	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日	
1. 业绩比较基准上升 5%		增加约 72	
2. 业绩比较基准下降 5%		减少约 72	

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	上年度末
	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
第一层次	14,683,981.89	254,299.00
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	14,683,981.89	254,299.00

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨停时的交易不活跃)、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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 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。

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	14,683,981.89	94.35
	其中：股票	14,683,981.89	94.35
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	877,670.24	5.64
8	其他各项资产	1,758.53	0.01
9	合计	15,563,410.66	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	164,985.00	1.07
B	采矿业	318,517.00	2.06
C	制造业	6,967,469.66	44.99

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	341,548.00	2.21
E	建筑业	320,758.40	2.07
F	批发和零售业	26,022.00	0.17
G	交通运输、仓储和邮政业	244,139.00	1.58
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	356,073.80	2.30
J	金融业	2,816,663.00	18.19
K	房地产业	193,109.00	1.25
L	租赁和商务服务业	115,664.00	0.75
M	科学研究和技术服务业	119,281.00	0.77
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	60,287.50	0.39
R	文化、体育和娱乐业	20,526.00	0.13
S	综合	-	-
	合计	12,065,043.36	77.90

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	7,162.00	0.05
B	采矿业	76,207.50	0.49
C	制造业	1,839,565.16	11.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	43,331.00	0.28
E	建筑业	10,977.60	0.07
F	批发和零售业	67,771.00	0.44
G	交通运输、仓储和邮政业	131,619.60	0.85
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	187,033.57	1.21
J	金融业	131,354.50	0.85
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	24,922.60	0.16
M	科学研究和技术服务业	93,578.00	0.60
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	5,416.00	0.03
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,618,938.53	16.91

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	500.00	845,500.00	5.46
2	300750	宁德时代	2,160.00	494,186.40	3.19
3	601318	中国平安	8,800.00	408,320.00	2.64
4	600036	招商银行	10,900.00	357,084.00	2.31
5	000858	五粮液	1,600.00	261,712.00	1.69
6	002594	比亚迪	900.00	232,443.00	1.50
7	000333	美的集团	3,700.00	218,004.00	1.41
8	601012	隆基绿能	5,800.00	166,286.00	1.07
9	002475	立讯精密	5,100.00	165,495.00	1.07
10	600900	长江电力	7,000.00	154,420.00	1.00
11	601166	兴业银行	9,800.00	153,370.00	0.99
12	600887	伊利股份	5,400.00	152,928.00	0.99
13	002415	海康威视	4,100.00	135,751.00	0.88
14	000651	格力电器	3,500.00	127,785.00	0.83
15	002714	牧原股份	3,000.00	126,450.00	0.82
16	000568	泸州老窖	600.00	125,742.00	0.81
17	300760	迈瑞医疗	400.00	119,920.00	0.77
18	601398	工商银行	24,100.00	116,162.00	0.75
19	600276	恒瑞医药	2,400.00	114,960.00	0.74
20	600309	万华化学	1,300.00	114,192.00	0.74
21	601601	中国太保	4,300.00	111,714.00	0.72
22	600030	中信证券	5,600.00	110,768.00	0.72
23	000001	平安银行	9,500.00	106,685.00	0.69

24	600438	通威股份	3,100.00	106,361.00	0.69
25	002352	顺丰控股	2,300.00	103,707.00	0.67
26	300014	亿纬锂能	1,700.00	102,850.00	0.66
27	300059	东方财富	6,960.00	98,832.00	0.64
28	601658	邮储银行	20,200.00	98,778.00	0.64
29	601328	交通银行	16,500.00	95,700.00	0.62
30	603259	药明康德	1,500.00	93,465.00	0.60
31	601899	紫金矿业	8,100.00	92,097.00	0.59
32	002304	洋河股份	700.00	91,945.00	0.59
33	600031	三一重工	5,500.00	91,465.00	0.59
34	601888	中国中免	800.00	88,424.00	0.57
35	002459	晶澳科技	2,100.00	87,570.00	0.57
36	600048	保利发展	6,300.00	82,089.00	0.53
37	002230	科大讯飞	1,200.00	81,552.00	0.53
38	601668	中国建筑	14,200.00	81,508.00	0.53
39	601688	华泰证券	5,900.00	81,243.00	0.52
40	601816	京沪高铁	15,000.00	78,900.00	0.51
41	002129	TCL 中环	2,375.00	78,850.00	0.51
42	601288	农业银行	22,300.00	78,719.00	0.51
43	002142	宁波银行	3,000.00	75,900.00	0.49
44	600809	山西汾酒	400.00	74,028.00	0.48
45	000063	中兴通讯	1,600.00	72,864.00	0.47
46	601225	陕西煤业	4,000.00	72,760.00	0.47
47	601877	正泰电器	2,600.00	71,890.00	0.46
48	601319	中国人保	12,300.00	71,832.00	0.46
49	000725	京东方 A	17,300.00	70,757.00	0.46
50	600690	海尔智家	3,000.00	70,440.00	0.45
51	300274	阳光电源	600.00	69,978.00	0.45
52	000733	振华科技	700.00	67,095.00	0.43
53	601998	中信银行	11,000.00	65,780.00	0.42
54	600941	中国移动	700.00	65,310.00	0.42
55	601689	拓普集团	800.00	64,560.00	0.42
56	300124	汇川技术	1,000.00	64,210.00	0.41
57	600745	闻泰科技	1,300.00	63,570.00	0.41
58	002371	北方华创	200.00	63,530.00	0.41
59	600999	招商证券	4,600.00	62,422.00	0.40
60	000002	万科 A	4,400.00	61,688.00	0.40
61	601390	中国中铁	8,000.00	60,640.00	0.39
62	300015	爱尔眼科	3,250.00	60,287.50	0.39
63	300122	智飞生物	1,350.00	59,670.00	0.39
64	002938	鹏鼎控股	2,400.00	58,296.00	0.38
65	000977	浪潮信息	1,200.00	58,200.00	0.38
66	002812	恩捷股份	600.00	57,810.00	0.37
67	600436	片仔癀	200.00	57,272.00	0.37

68	601985	中国核电	8,100.00	57,105.00	0.37
69	600837	海通证券	6,100.00	56,242.00	0.36
70	002049	紫光国微	600.00	55,950.00	0.36
71	600905	三峡能源	10,300.00	55,311.00	0.36
72	000661	长春高新	400.00	54,520.00	0.35
73	002841	视源股份	800.00	53,472.00	0.35
74	000538	云南白药	1,000.00	52,480.00	0.34
75	688599	天合光能	1,176.00	50,109.36	0.32
76	600150	中国船舶	1,500.00	49,365.00	0.32
77	601988	中国银行	12,600.00	49,266.00	0.32
78	002050	三花智控	1,600.00	48,416.00	0.31
79	601211	国泰君安	3,400.00	47,566.00	0.31
80	600585	海螺水泥	2,000.00	47,480.00	0.31
81	002179	中航光电	1,040.00	47,164.00	0.30
82	002311	海大集团	1,000.00	46,840.00	0.30
83	002920	德赛西威	300.00	46,743.00	0.30
84	600383	金地集团	6,300.00	45,423.00	0.29
85	300896	爱美客	100.00	44,495.00	0.29
86	603659	璞泰来	1,160.00	44,335.20	0.29
87	300628	亿联网络	1,260.00	44,188.20	0.29
88	601615	明阳智能	2,600.00	43,888.00	0.28
89	300316	晶盛机电	600.00	42,540.00	0.27
90	600741	华域汽车	2,300.00	42,458.00	0.27
91	600795	国电电力	11,000.00	42,130.00	0.27
92	002466	天齐锂业	600.00	41,946.00	0.27
93	601669	中国电建	7,300.00	41,902.00	0.27
94	603799	华友钴业	900.00	41,319.00	0.27
95	600926	杭州银行	3,500.00	41,125.00	0.27
96	601336	新华保险	1,100.00	40,447.00	0.26
97	601088	中国神华	1,300.00	39,975.00	0.26
98	601117	中国化学	4,800.00	39,744.00	0.26
99	601169	北京银行	8,500.00	39,355.00	0.25
100	601009	南京银行	4,900.00	39,200.00	0.25
101	600989	宝丰能源	3,100.00	39,091.00	0.25
102	600346	恒力石化	2,700.00	38,691.00	0.25
103	300498	温氏股份	2,100.00	38,535.00	0.25
104	601857	中国石油	5,000.00	37,350.00	0.24
105	000100	TCL 科技	9,460.00	37,272.40	0.24
106	600958	东方证券	3,800.00	36,860.00	0.24
107	601838	成都银行	3,000.00	36,630.00	0.24
108	002460	赣锋锂业	600.00	36,576.00	0.24
109	600406	国电南瑞	1,560.00	36,036.00	0.23
110	002271	东方雨虹	1,300.00	35,438.00	0.23
111	601238	广汽集团	3,400.00	35,428.00	0.23

112	000157	中联重科	5,200.00	35,100.00	0.23
113	300033	同花顺	200.00	35,056.00	0.23
114	000776	广发证券	2,300.00	33,833.00	0.22
115	600188	兖矿能源	1,100.00	32,912.00	0.21
116	600588	用友网络	1,600.00	32,800.00	0.21
117	300450	先导智能	900.00	32,553.00	0.21
118	601186	中国铁建	3,300.00	32,505.00	0.21
119	688005	容百科技	601.00	32,466.02	0.21
120	688012	中微公司	200.00	31,290.00	0.20
121	300763	锦浪科技	300.00	31,230.00	0.20
122	603486	科沃斯	400.00	31,108.00	0.20
123	600019	宝钢股份	5,500.00	30,910.00	0.20
124	002180	纳思达	900.00	30,825.00	0.20
125	600845	宝信软件	600.00	30,486.00	0.20
126	600039	四川路桥	2,940.00	28,841.40	0.19
127	600050	中国联通	6,000.00	28,800.00	0.19
128	600111	北方稀土	1,200.00	28,776.00	0.19
129	000792	盐湖股份	1,500.00	28,755.00	0.19
130	002648	卫星化学	1,900.00	28,424.00	0.18
131	603288	海天味业	600.00	28,110.00	0.18
132	601628	中国人寿	800.00	27,968.00	0.18
133	002555	三七互娱	800.00	27,904.00	0.18
134	688008	澜起科技	484.00	27,791.28	0.18
135	601229	上海银行	4,800.00	27,600.00	0.18
136	002027	分众传媒	4,000.00	27,240.00	0.18
137	605117	德业股份	180.00	26,919.00	0.17
138	600176	中国巨石	1,900.00	26,904.00	0.17
139	002007	华兰生物	1,200.00	26,892.00	0.17
140	603369	今世缘	500.00	26,400.00	0.17
141	000963	华东医药	600.00	26,022.00	0.17
142	300347	泰格医药	400.00	25,816.00	0.17
143	601818	光大银行	8,300.00	25,481.00	0.16
144	600196	复星医药	800.00	24,720.00	0.16
145	300433	蓝思科技	2,100.00	24,696.00	0.16
146	601377	兴业证券	3,900.00	23,868.00	0.15
147	601939	建设银行	3,800.00	23,788.00	0.15
148	002821	凯莱英	200.00	23,572.00	0.15
149	300408	三环集团	800.00	23,480.00	0.15
150	600029	南方航空	3,800.00	22,914.00	0.15
151	300454	深信服	200.00	22,650.00	0.15
152	000708	中信特钢	1,400.00	22,176.00	0.14
153	600460	士兰微	700.00	21,189.00	0.14
154	603806	福斯特	560.00	20,826.40	0.13
155	601808	中海油服	1,500.00	20,820.00	0.13

156	300413	芒果超媒	600.00	20,526.00	0.13
157	688981	中芯国际	400.00	20,208.00	0.13
158	601138	工业富联	800.00	20,160.00	0.13
159	600104	上汽集团	1,400.00	19,838.00	0.13
160	000786	北新建材	800.00	19,608.00	0.13
161	600015	华夏银行	3,600.00	19,476.00	0.13
162	000166	申万宏源	4,200.00	19,404.00	0.13
163	600219	南山铝业	6,300.00	19,026.00	0.12
164	601800	中国交建	1,700.00	18,547.00	0.12
165	600132	重庆啤酒	200.00	18,432.00	0.12
166	601919	中远海控	1,900.00	17,860.00	0.12
167	600803	新奥股份	900.00	17,082.00	0.11
168	601618	中国中冶	4,300.00	17,071.00	0.11
169	601728	中国电信	3,000.00	16,890.00	0.11
170	002756	永兴材料	260.00	16,278.60	0.11
171	300999	金龙鱼	400.00	15,996.00	0.10
172	002916	深南电路	200.00	15,074.00	0.10
173	601066	中信建投	600.00	14,520.00	0.09
174	601788	光大证券	900.00	14,301.00	0.09
175	601995	中金公司	400.00	14,208.00	0.09
176	003816	中国广核	4,500.00	13,995.00	0.09
177	002001	新和成	900.00	13,860.00	0.09
178	601600	中国铝业	2,500.00	13,725.00	0.09
179	002410	广联达	420.00	13,645.80	0.09
180	000338	潍柴动力	1,000.00	12,460.00	0.08
181	601901	方正证券	1,900.00	12,426.00	0.08
182	601865	福莱特	300.00	11,553.00	0.07
183	601021	春秋航空	200.00	11,494.00	0.07
184	002736	国信证券	1,300.00	11,349.00	0.07
185	603986	兆易创新	100.00	10,625.00	0.07
186	600600	青岛啤酒	100.00	10,363.00	0.07
187	000895	双汇发展	400.00	9,796.00	0.06
188	603392	万泰生物	140.00	9,347.80	0.06
189	601872	招商轮船	1,600.00	9,264.00	0.06
190	600918	中泰证券	1,300.00	8,983.00	0.06
191	601878	浙商证券	900.00	8,892.00	0.06
192	600732	爱旭股份	280.00	8,610.00	0.06
193	600061	国投资本	1,200.00	8,544.00	0.06
194	688223	晶科能源	600.00	8,436.00	0.05
195	000983	山西焦煤	900.00	8,190.00	0.05
196	600362	江西铜业	400.00	7,592.00	0.05
197	600875	东方电气	400.00	7,460.00	0.05
198	601881	中国银河	600.00	6,966.00	0.04
199	603993	洛阳钼业	1,300.00	6,929.00	0.04

200	002252	上海莱士	600.00	4,506.00	0.03
201	601898	中煤能源	500.00	4,220.00	0.03
202	002709	天赐材料	100.00	4,119.00	0.03
203	001979	招商蛇口	300.00	3,909.00	0.03
204	601766	中国中车	600.00	3,900.00	0.03
205	601699	潞安环能	200.00	3,264.00	0.02
206	600426	华鲁恒升	100.00	3,063.00	0.02
207	600674	川投能源	100.00	1,505.00	0.01

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	002484	江海股份	2,000.00	42,580.00	0.27
2	300476	胜宏科技	1,600.00	38,576.00	0.25
3	600009	上海机场	800.00	36,336.00	0.23
4	688800	瑞可达	560.00	34,804.00	0.22
5	600765	中航重机	1,300.00	34,463.00	0.22
6	603338	浙江鼎力	600.00	33,606.00	0.22
7	300390	天华新能	910.00	32,578.00	0.21
8	600976	健民集团	400.00	30,836.00	0.20
9	688556	高测股份	560.00	29,758.40	0.19
10	603345	安井食品	200.00	29,360.00	0.19
11	603893	瑞芯微	400.00	29,140.00	0.19
12	002839	张家港行	6,400.00	27,072.00	0.17
13	002801	微光股份	1,000.00	27,060.00	0.17
14	600988	赤峰黄金	2,000.00	26,920.00	0.17
15	300861	美畅股份	600.00	26,022.00	0.17
16	688518	联赢激光	921.00	25,659.06	0.17
17	600908	无锡银行	4,700.00	25,192.00	0.16
18	600481	双良节能	1,800.00	25,164.00	0.16
19	605168	三人行	290.00	24,922.60	0.16
20	301096	百诚医药	400.00	24,244.00	0.16
21	688202	美迪西	280.00	23,870.00	0.15
22	300856	科思股份	300.00	23,631.00	0.15
23	601128	常熟银行	3,300.00	22,506.00	0.15
24	002402	和而泰	1,300.00	22,074.00	0.14
25	605358	立昂微	600.00	22,038.00	0.14
26	300258	精锻科技	1,500.00	21,735.00	0.14
27	688078	龙软科技	400.00	20,620.00	0.13
28	603127	昭衍新药	500.00	20,450.00	0.13
29	688668	鼎通科技	207.00	20,244.60	0.13

30	688066	航天宏图	332.00	20,218.80	0.13
31	002444	巨星科技	900.00	19,692.00	0.13
32	603606	东方电缆	400.00	19,612.00	0.13
33	300438	鹏辉能源	400.00	19,216.00	0.12
34	600256	广汇能源	2,800.00	19,208.00	0.12
35	002025	航天电器	300.00	19,140.00	0.12
36	688100	威胜信息	638.00	19,018.78	0.12
37	601636	旗滨集团	2,200.00	18,964.00	0.12
38	300777	中简科技	400.00	18,904.00	0.12
39	603324	盛剑环境	500.00	18,850.00	0.12
40	600004	白云机场	1,300.00	18,642.00	0.12
41	300377	赢时胜	2,300.00	18,630.00	0.12
42	300682	朗新科技	800.00	18,624.00	0.12
43	603889	新澳股份	2,460.00	18,474.60	0.12
44	300770	新媒股份	400.00	18,344.00	0.12
45	002056	横店东磁	1,000.00	18,210.00	0.12
46	688568	中科星图	224.00	18,049.92	0.12
47	002810	山东赫达	1,000.00	18,000.00	0.12
48	603179	新泉股份	400.00	17,556.00	0.11
49	600210	紫江企业	3,300.00	17,556.00	0.11
50	002036	联创电子	1,800.00	17,478.00	0.11
51	300772	运达股份	1,300.00	16,744.00	0.11
52	603690	至纯科技	480.00	16,723.20	0.11
53	600160	巨化股份	1,200.00	16,536.00	0.11
54	603129	春风动力	100.00	16,190.00	0.10
55	601298	青岛港	2,300.00	16,031.00	0.10
56	300590	移为通信	1,300.00	15,886.00	0.10
57	603920	世运电路	800.00	15,624.00	0.10
58	688122	西部超导	280.00	15,604.40	0.10
59	002384	东山精密	600.00	15,540.00	0.10
60	688239	航宇科技	222.00	15,528.90	0.10
61	605088	冠盛股份	900.00	15,435.00	0.10
62	600710	苏美达	1,800.00	15,408.00	0.10
63	300447	全信股份	800.00	15,352.00	0.10
64	002318	久立特材	900.00	15,327.00	0.10
65	002405	四维图新	1,300.00	15,054.00	0.10
66	601869	长飞光纤	400.00	14,804.00	0.10
67	600000	浦发银行	2,000.00	14,480.00	0.09
68	002738	中矿资源	280.00	14,263.20	0.09
69	000811	冰轮环境	900.00	14,184.00	0.09
70	600153	建发股份	1,300.00	14,183.00	0.09
71	688123	聚辰股份	260.00	13,967.20	0.09
72	603305	旭升集团	500.00	13,935.00	0.09
73	002833	弘亚数控	700.00	13,762.00	0.09

74	601717	郑煤机	1,100.00	13,695.00	0.09
75	002993	奥海科技	400.00	13,568.00	0.09
76	600959	江苏有线	4,000.00	13,520.00	0.09
77	300775	三角防务	400.00	13,512.00	0.09
78	601231	环旭电子	900.00	13,464.00	0.09
79	688162	巨一科技	324.00	13,439.52	0.09
80	300358	楚天科技	900.00	13,437.00	0.09
81	603337	杰克股份	700.00	13,328.00	0.09
82	600549	厦门钨业	700.00	13,321.00	0.09
83	000758	中色股份	2,800.00	13,216.00	0.09
84	300938	信测标准	300.00	13,140.00	0.08
85	002929	润建股份	300.00	13,023.00	0.08
86	300007	汉威科技	600.00	12,690.00	0.08
87	000519	中兵红箭	700.00	12,663.00	0.08
88	002843	泰嘉股份	600.00	12,576.00	0.08
89	002353	杰瑞股份	500.00	12,565.00	0.08
90	603279	景津装备	400.00	12,544.00	0.08
91	600821	金开新能	1,800.00	12,402.00	0.08
92	300696	爱乐达	500.00	12,300.00	0.08
93	300373	扬杰科技	300.00	12,171.00	0.08
94	600372	中航电子	800.00	12,144.00	0.08
95	600761	安徽合力	600.00	11,958.00	0.08
96	002507	涪陵榨菜	650.00	11,901.50	0.08
97	600129	太极集团	200.00	11,898.00	0.08
98	300887	谱尼测试	300.00	11,874.00	0.08
99	301258	富士莱	300.00	11,796.00	0.08
100	002966	苏州银行	1,800.00	11,790.00	0.08
101	603987	康德莱	900.00	11,628.00	0.08
102	300121	阳谷华泰	1,200.00	11,460.00	0.07
103	002324	普利特	800.00	11,416.00	0.07
104	603688	石英股份	100.00	11,384.00	0.07
105	600026	中远海能	900.00	11,376.00	0.07
106	300171	东富龙	500.00	11,375.00	0.07
107	300613	富瀚微	200.00	11,348.00	0.07
108	605138	盛泰集团	1,300.00	11,336.00	0.07
109	600801	华新水泥	900.00	11,115.00	0.07
110	601966	玲珑轮胎	500.00	11,110.00	0.07
111	300458	全志科技	400.00	10,900.00	0.07
112	688196	卓越新能	234.00	10,822.50	0.07
113	600348	华阳股份	1,350.00	10,678.50	0.07
114	000027	深圳能源	1,600.00	10,544.00	0.07
115	600867	通化东宝	1,000.00	10,440.00	0.07
116	300776	帝尔激光	160.00	10,384.00	0.07
117	603876	鼎胜新材	540.00	10,362.60	0.07

118	001872	招商港口	600.00	10,362.00	0.07
119	601333	广深铁路	2,600.00	10,296.00	0.07
120	300481	濮阳惠成	500.00	10,280.00	0.07
121	002511	中顺洁柔	900.00	10,035.00	0.06
122	002895	川恒股份	500.00	9,850.00	0.06
123	603529	爱玛科技	300.00	9,666.00	0.06
124	300863	卡倍亿	150.00	9,436.50	0.06
125	603063	禾望电气	300.00	9,225.00	0.06
126	002824	和胜股份	300.00	8,859.00	0.06
127	688278	特宝生物	200.00	8,782.00	0.06
128	600566	济川药业	300.00	8,712.00	0.06
129	002567	唐人神	1,300.00	8,645.00	0.06
130	603681	永冠新材	600.00	8,568.00	0.06
131	601137	博威合金	500.00	7,780.00	0.05
132	300101	振芯科技	400.00	7,756.00	0.05
133	000883	湖北能源	1,700.00	7,752.00	0.05
134	688033	天宜上佳	400.00	7,648.00	0.05
135	601975	招商南油	2,600.00	7,436.00	0.05
136	002937	兴瑞科技	300.00	7,380.00	0.05
137	002658	雪迪龙	900.00	7,317.00	0.05
138	300260	新莱应材	180.00	7,113.60	0.05
139	688210	统联精密	360.00	7,027.20	0.05
140	301039	中集车辆	500.00	6,615.00	0.04
141	002100	天康生物	800.00	6,600.00	0.04
142	600390	五矿资本	1,200.00	6,456.00	0.04
143	603128	华贸物流	700.00	6,377.00	0.04
144	002545	东方铁塔	900.00	6,354.00	0.04
145	002807	江阴银行	1,700.00	6,273.00	0.04
146	600098	广州发展	1,000.00	6,180.00	0.04
147	300630	普利制药	300.00	5,865.00	0.04
148	688501	青达环保	260.00	5,785.00	0.04
149	002540	亚太科技	1,000.00	5,780.00	0.04
150	002541	鸿路钢构	200.00	5,762.00	0.04
151	300415	伊之密	300.00	5,760.00	0.04
152	600517	国网英大	1,000.00	5,700.00	0.04
153	002407	多氟多	280.00	5,560.80	0.04
154	603323	苏农银行	1,300.00	5,473.00	0.04
155	603197	保隆科技	100.00	5,425.00	0.04
156	603613	国联股份	145.00	5,354.85	0.03
157	603551	奥普家居	400.00	5,172.00	0.03
158	001283	豪鹏科技	100.00	4,829.00	0.03
159	600522	中天科技	300.00	4,773.00	0.03
160	603663	三祥新材	300.00	4,485.00	0.03
161	300726	宏达电子	100.00	4,472.00	0.03

162	600428	中远海特	700.00	4,410.00	0.03
163	002600	领益智造	600.00	4,146.00	0.03
164	002368	太极股份	100.00	4,117.00	0.03
165	600433	冠豪高新	1,200.00	4,092.00	0.03
166	603871	嘉友国际	260.00	4,084.60	0.03
167	605098	行动教育	100.00	3,959.00	0.03
168	003000	劲仔食品	300.00	3,777.00	0.02
169	300839	博汇股份	280.00	3,721.20	0.02
170	301389	隆扬电子	200.00	3,636.00	0.02
171	003040	楚天龙	200.00	3,628.00	0.02
172	605020	永和股份	140.00	3,613.40	0.02
173	605377	华旺科技	200.00	3,610.00	0.02
174	300138	晨光生物	200.00	3,580.00	0.02
175	000915	华特达因	100.00	3,529.00	0.02
176	300571	平治信息	100.00	3,496.00	0.02
177	002430	杭氧股份	100.00	3,436.00	0.02
178	300700	岱勒新材	180.00	3,429.00	0.02
179	002906	华阳集团	100.00	3,419.00	0.02
180	603477	巨星农牧	100.00	3,335.00	0.02
181	603738	泰晶科技	200.00	3,322.00	0.02
182	000032	深桑达 A	100.00	3,290.00	0.02
183	000728	国元证券	500.00	3,260.00	0.02
184	600562	国睿科技	200.00	3,240.00	0.02
185	600350	山东高速	500.00	3,185.00	0.02
186	000830	鲁西化工	300.00	3,168.00	0.02
187	601528	瑞丰银行	650.00	3,152.50	0.02
188	603755	日辰股份	100.00	3,139.00	0.02
189	002216	三全食品	200.00	3,116.00	0.02
190	000960	锡业股份	200.00	3,110.00	0.02
191	603309	维力医疗	200.00	3,094.00	0.02
192	603056	德邦股份	200.00	3,084.00	0.02
193	300239	东宝生物	500.00	3,080.00	0.02
194	603757	大元泵业	100.00	2,984.00	0.02
195	600066	宇通客车	200.00	2,948.00	0.02
196	600073	上海梅林	400.00	2,920.00	0.02
197	600582	天地科技	500.00	2,915.00	0.02
198	300791	仙乐健康	100.00	2,904.00	0.02
199	600546	山煤国际	200.00	2,894.00	0.02
200	300435	中泰股份	200.00	2,888.00	0.02
201	300900	广联航空	100.00	2,881.00	0.02
202	300349	金卡智能	200.00	2,776.00	0.02
203	002859	洁美科技	100.00	2,770.00	0.02
204	603456	九洲药业	100.00	2,738.00	0.02
205	600529	山东药玻	100.00	2,722.00	0.02

206	000921	海信家电	100.00	2,695.00	0.02
207	600873	梅花生物	300.00	2,679.00	0.02
208	603040	新坐标	100.00	2,659.00	0.02
209	002332	仙琚制药	200.00	2,650.00	0.02
210	600502	安徽建工	500.00	2,640.00	0.02
211	000933	神火股份	200.00	2,600.00	0.02
212	600970	中材国际	200.00	2,550.00	0.02
213	603556	海兴电力	100.00	2,524.00	0.02
214	603088	宁波精达	300.00	2,514.00	0.02
215	002061	浙江交科	560.00	2,497.60	0.02
216	002158	汉钟精机	100.00	2,496.00	0.02
217	300031	宝通科技	100.00	2,472.00	0.02
218	603368	柳药集团	100.00	2,471.00	0.02
219	600461	洪城环境	300.00	2,451.00	0.02
219	600559	老白干酒	100.00	2,451.00	0.02
221	000738	航发控制	100.00	2,440.00	0.02
222	000012	南玻 A	400.00	2,384.00	0.02
223	002955	鸿合科技	100.00	2,355.00	0.02
224	600583	海油工程	400.00	2,340.00	0.02
225	600971	恒源煤电	300.00	2,337.00	0.02
226	600933	爱柯迪	100.00	2,329.00	0.02
227	300003	乐普医疗	100.00	2,261.00	0.01
228	003019	宸展光电	110.00	2,255.00	0.01
229	605507	国邦医药	100.00	2,127.00	0.01
230	603027	千禾味业	100.00	2,112.00	0.01
231	600859	王府井	100.00	1,979.00	0.01
232	002925	盈趣科技	100.00	1,940.00	0.01
233	002299	圣农发展	100.00	1,915.00	0.01
234	600975	新五丰	200.00	1,912.00	0.01
235	600521	华海药业	100.00	1,841.00	0.01
236	300119	瑞普生物	100.00	1,780.00	0.01
237	000810	创维数字	100.00	1,617.00	0.01
238	600876	洛阳玻璃	100.00	1,596.00	0.01
239	601666	平煤股份	200.00	1,508.00	0.01
240	003032	传智教育	100.00	1,457.00	0.01
241	600728	佳都科技	200.00	1,386.00	0.01
242	600236	桂冠电力	200.00	1,114.00	0.01

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
----	------	------	----------	--------

				资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	882,749.00	5.86
2	601318	中国平安	508,312.00	3.38
3	600036	招商银行	456,035.00	3.03
4	300750	宁德时代	445,360.00	2.96
5	000858	五粮液	307,380.00	2.04
6	002594	比亚迪	266,961.00	1.77
7	601012	隆基绿能	250,732.00	1.67
8	000333	美的集团	205,664.00	1.37
9	600030	中信证券	198,940.00	1.32
10	601888	中国中免	198,871.00	1.32
11	601166	兴业银行	197,670.00	1.31
12	000001	平安银行	193,049.00	1.28
13	600887	伊利股份	183,913.00	1.22
14	002142	宁波银行	180,433.00	1.20
15	002475	立讯精密	174,426.00	1.16
16	601838	成都银行	167,303.00	1.11
17	300059	东方财富	156,004.00	1.04
18	300014	亿纬锂能	155,329.00	1.03
19	600900	长江电力	154,136.00	1.02
20	002714	牧原股份	152,699.00	1.01

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）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	601838	成都银行	112,000.00	0.74
2	600030	中信证券	85,800.00	0.57
3	601009	南京银行	77,761.00	0.52
4	601318	中国平安	74,491.00	0.49
5	600926	杭州银行	72,368.00	0.48
6	002142	宁波银行	72,128.00	0.48
7	600958	东方证券	69,635.00	0.46
8	000776	广发证券	66,149.00	0.44
9	601211	国泰君安	63,269.00	0.42
10	600999	招商证券	55,559.00	0.37
11	688120	华海清科	49,032.00	0.33
12	000001	平安银行	48,720.00	0.32

13	000100	TCL 科技	48,678.00	0.32
14	300803	指南针	44,365.00	0.29
15	688696	极米科技	43,022.00	0.29
16	600036	招商银行	41,654.00	0.28
17	600129	太极集团	37,338.00	0.25
18	300059	东方财富	37,016.00	0.25
19	300630	普利制药	36,067.00	0.24
20	002807	江阴银行	34,943.00	0.23

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（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	18,363,790.02
卖出股票的收入（成交）总额	3,021,173.59

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排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 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 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。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,758.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,758.53

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.13.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.13.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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。

7.13.6 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

份额级别	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
摩根沪深 300 指数增强发起式 A	65	238,290.52	15,158,738.63	97.87%	330,145.45	2.13%
摩根沪深 300 指数增强发起式 C	739	1,124.31	-	0.00%	830,863.33	100.00%
合计	804	20,298.19	15,158,738.63	92.89%	1,161,008.78	7.11%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	摩根沪深 300 指数增强发起式 A	61,562.90	0.3975%
	摩根沪深 300 指数增强发起式 C	1,020.05	0.1228%
	合计	62,582.95	0.3835%

8.3 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	15,158,738.63	92.89%	10,000,783.32	61.28%	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	221,646.58	1.36%	-	-	-
合计	15,380,385.21	94.24%	10,000,783.32	61.28%	3 年

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	摩根沪深 300 指数增强发起式 A	摩根沪深 300 指数增强发起式 C
基金合同生效日(2022 年 12 月 28 日)基金份额总额	15,056,216.44	1,220.05
本报告期期初基金份额总额	15,056,216.44	1,220.05
本报告期基金总申购份额	510,565.68	5,589,554.53
减：本报告期基金总赎回份额	77,898.04	4,759,911.25
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	15,488,884.08	830,863.33

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：

2023 年 1 月，公司股东选举组成新的董事会：Daniel Watkins 先生、Paul Bateman 先生、Paul Quinsee 先生、王大智先生、汪棣先生、曾翀先生和 Matthew Bersani 先生；同时决定原董事会成员陈兵先生、陈海宁先生、林仪桥先生和周晔先生不再担任公司董事职务，刘红忠先生和王学杰先生不再担任公司独立董事职务。

2023 年 6 月，公司股东新增并选举王琼慧女士和杜猛先生出任公司董事职务。

基金管理人于 2023 年 4 月 1 日公告，自 2023 年 3 月 31 日起，刘鲁旦先生不再担任公司副总经理。

基金管理人于 2023 年 4 月 27 日公告，自 2023 年 4 月 25 日起，Daniel Watkins 先生担任公司董事长，王大智先生不再代为履行董事长职务。

基金管理人于 2023 年 6 月 30 日公告，自 2023 年 6 月 28 日起，王琼慧女士担任公司总经理、法定代表人，王大智先生不再担任公司总经理、法定代表人。

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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，管理人未受稽查或处罚，亦未发现管理人的高级管理人员受稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，托管人未受稽查或处罚，亦未发现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	2	21,384,963.61	100.00%	19,830.75	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. 本基金本期无新增席位,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	2,619.71	100.00%	160,000.00	100.00%	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	上投摩根沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务公告	基金管理人公司网站及本基金选定的信息披露报纸	2023-01-14
2	关于上投摩根基金管理有限公司股东及实际控制人变更的公告	同上	2023-01-21
3	上投摩根基金管理有限公司关于董事变更的公告	同上	2023-02-01
4	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	2023-04-01
5	关于公司法定名称变更的公告	同上	2023-04-12
6	摩根基金管理(中国)有限公司关于旗下基金更名事宜的公告	同上	2023-04-12
7	摩根基金管理(中国)有限公司关于董事长变	同上	2023-04-27

	更的公告		
8	摩根基金管理(中国)有限公司关于深圳分公司法定名称变更的公告	同上	2023-05-13
9	摩根基金管理(中国)有限公司关于北京分公司法定名称变更的公告	同上	2023-05-19
10	摩根基金管理(中国)有限公司关于高级管理人员变更的公告	同上	2023-06-30

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
机构	1	20230101-20230630	14,999,675.00	0.00	0.00	14,999,675.00	91.91%
产品特有风险							
本基金的集中度风险主要体现在有单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%，如果投资者发生大额赎回，可能出现基金可变现资产无法满足投资者赎回需要以及因为资产变现成本过高导致投资者的利益受到损害的风险。							

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一)中国证监会准予本基金募集注册的文件
- (二)摩根沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同
- (三)摩根沪深 300 指数增强型发起式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)摩根基金管理(中国)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

基金管理人或基金托管人处。

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。

摩根基金管理（中国）有限公司

二〇二三年八月三十一日