

摩根量化多因子灵活配置混合型证券投资基金

2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：摩根基金管理（中国）有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年三月二十八日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

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

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§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合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§6 审计报告	17
6.1 审计意见	17
6.2 形成审计意见的基础	17
6.3 管理层对财务报表的责任	17
6.4 注册会计师的责任	18
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	22
7.4 报表附注	24
§8 投资组合报告	52
8.1 期末基金资产组合情况	52
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	53
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	64

8.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	65
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	65
8.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	65
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	65
8.12	本报告期投资基金情况	65
8.13	投资组合报告附注	65
§9	基金份额持有人信息	66
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	66
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66
9.3	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	67
§10	开放式基金份额变动	67
§11	重大事件揭示	67
11.1	基金份额持有人大会决议	67
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	67
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	68
11.4	基金投资策略的改变	68
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	68
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	68
11.6.1	管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	68
11.6.2	托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	68
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	68
11.8	其他重大事件	70
12	影响投资者决策的其他重要信息	71
§13	备查文件目录	71
13.1	备查文件目录	71
13.2	存放地点	71
13.3	查阅方式	71

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	摩根量化多因子灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	摩根量化多因子混合
基金主代码	005120
交易代码	005120
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 1 月 19 日
基金管理人	摩根基金管理（中国）有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	16,329,528.78 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	采用量化投资对基金资产进行积极管理，力争获取超越业绩基准的投资收益。
投资策略	<p>本基金采用“量化多因子模型”进行个股选择，并结合适当的资产配置策略搭建基金投资组合。</p> <p>资产配置方面，本基金通过对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等影响证券市场的等因素进行深入分析，确定基金资产在股票、债券及现金等类别资产间的分配比例，并动态优化投资组合。</p> <p>在股票投资过程中，本基金将运用“量化多因子模型”选股构建股票投资组合的投资策略，对基金资产进行积极管理，力争获取超越业绩基准的投资收益。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将综合分析和持续跟踪基本面、政策面、市场面等多方面因素，对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等影响证券市场的重要因素进行深入分析，重点关注包括 GDP 增速、固定资产投资增速、净出口增速、通胀率、货币供应、利率等宏观指标的变化趋势，结合股票、债券等各类</p>

	<p>资产风险收益特征，确定合适的资产配置比例。本基金将根据各类证券的风险收益特征的相对变化，适度的调整确定基金资产在股票、债券及现金等类别资产间的分配比例，动态优化投资组合。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金通过基金管理人量化投资团队开发的“量化多因子模型”进行股票选择并据此构建股票投资组合。“量化多因子模型”在实际运行过程中将进行定期动态调整，力争股票配置最优化，以期持续超越业绩比较基准收益率的投资目标。</p> <p>“量化多因子模型”是基于因子动量的可持续性的逻辑，由本基金管理人量化投资团队开发的更具针对性和实用性的数量化选股模型。通过筛选因子、因子打分、因子动态调整等步骤建立选股模型。通过各个因子的权重对所有个股进行打分，构建在当前市场环境下得分较高的股票组合。并根据市场运行情况，定期更新因子，对备选股票进行重新打分和排序，进行组合调整。</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，灵活运用久期策略、期限结构配置策略、信用债策略、可转债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、其他投资策略：包括存托凭证投资策略、股指期货投资策略、资产支持证券投资策略、股票期权投资策略等。</p>
业绩比较基准	<p>中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%</p>
风险收益特征	<p>本基金属于混合型基金产品，预期风险和收益水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金，属于较高风险收益水平的基金产品。根据 2017 年 7 月 1 日施行的《证券期货投资者适当性管理办法》，基金管理人和相关销售机构已对本基金重新进行风险评级，风险评级行为不改变本基金的实质性风险收益特征，但由于风险等级分类标准的变化，本基金的风险等级表述可能有相应变化，具体风险评级结果应以基金管理人和销售机构提供的评级结果为准。</p>

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	邹树波	郭明
	联系电话	021-38794888	010-66105799
	电子邮箱	services@cifm.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-889-4888	95588
传真		021-20628400	010-66105798
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路479号42层和43层	北京市西城区复兴门内大街55 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路479号42层和43层	北京市西城区复兴门内大街55 号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		王琼慧	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	am.jpmorgan.com/cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	中国·上海市
注册登记机构	摩根基金管理（中国）有限公司	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路479号42层和43层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	-1,824,613.58	-2,166,368.63	1,973,853.54
本期利润	-1,473,915.12	-3,603,579.86	2,537,895.97
加权平均基金份额本期利润	-0.0937	-0.2373	0.1371
本期加权平均净值利润率	-7.37%	-17.77%	9.78%
本期基金份额净值增长率	-6.84%	-15.59%	10.26%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	2,826,542.42	3,844,126.03	7,655,762.25
期末可供分配基金份额利润	0.1731	0.2592	0.4918
期末基金资产净值	19,156,071.20	18,675,347.73	23,221,475.58
期末基金份额净值	1.1731	1.2592	1.4918
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率	17.31%	25.92%	49.18%

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

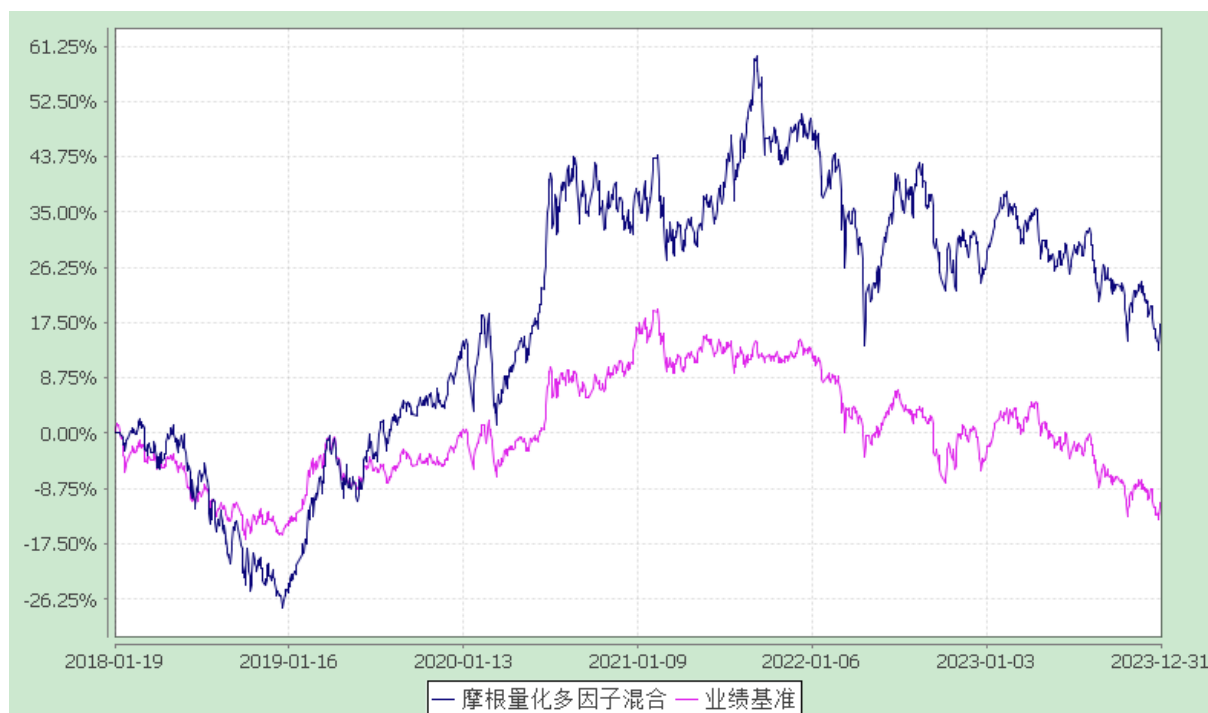
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-5.10%	0.87%	-4.36%	0.82%	-0.74%	0.05%
过去六个月	-8.64%	0.86%	-9.01%	0.81%	0.37%	0.05%
过去一年	-6.84%	0.81%	-7.03%	0.78%	0.19%	0.03%
过去三年	-13.30%	1.08%	-20.96%	0.77%	7.66%	0.31%
过去五年	57.70%	1.15%	8.63%	0.79%	49.07%	0.36%

自基金合同生效起至今	17.31%	1.18%	-11.02%	0.79%	28.33%	0.39%
------------	--------	-------	---------	-------	--------	-------

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

摩根量化多因子灵活配置混合型证券投资基金

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2018 年 1 月 19 日至 2023 年 12 月 31 日)



注：本基金合同生效日为 2018 年 1 月 19 日，图示的时间段为合同生效日至本报告期末。

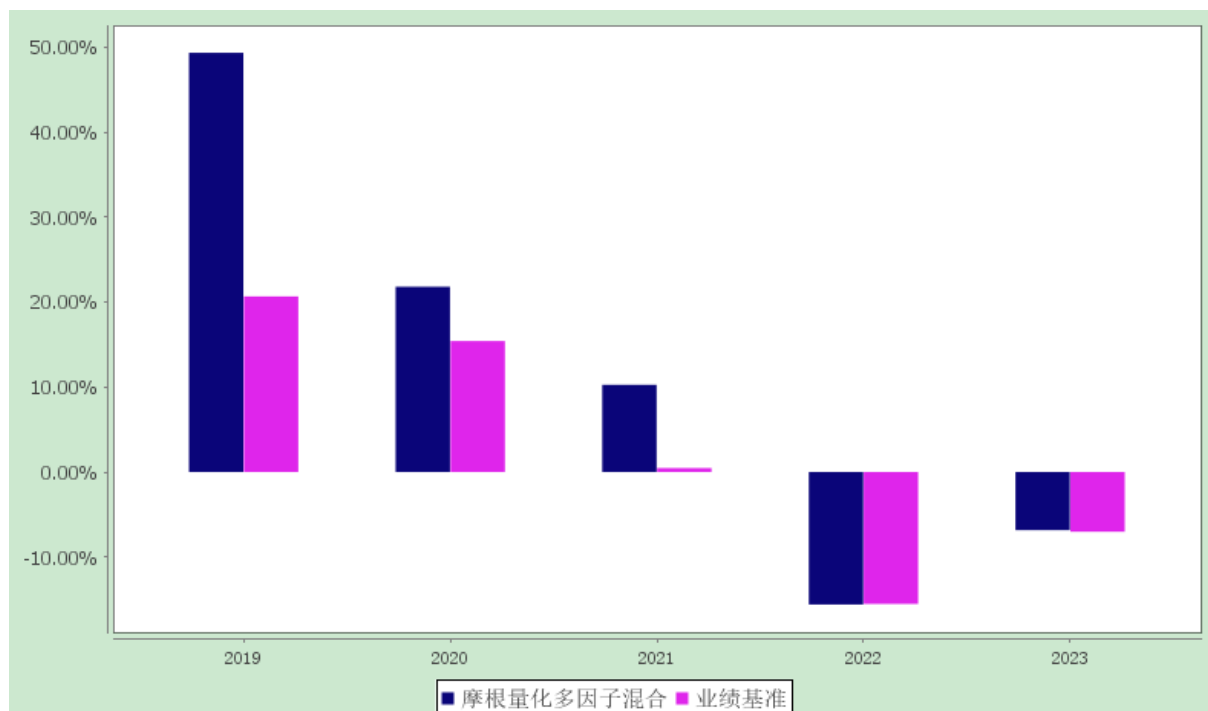
本基金建仓期为本基金合同生效日起 6 个月，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

本基金自 2022 年 9 月 9 日起，将基金业绩比较基准由“中证 800 指数收益率×60%+中债总指数收益率×40%”变更为“中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%”。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

摩根量化多因子灵活配置混合型证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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 12 月底，公司旗下运作的基金共有九十四只，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、摩根行业睿选股股票型证券投资基金、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、摩根时代睿选股票型证券投资基金、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)、摩根双季鑫 6 个月持有期债券型发起式基金中基金(FOF)、摩根恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)、摩根世代趋势混合型发起式证券投资基金、摩根纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金(QDII)、摩根瑞锦纯债债券型证券投资基金、摩根标普港股通低波红利交易型开放式指数证券投资基金、摩根中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金。

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	本基金基金经理、指数及量化投资部总监	2021-01-07	-	16 年	胡迪女士曾任纽约美林证券全球资产管理部高级经理，纽约标准普尔量化投资主管，中国国际金融股份有限公司资产管理部执行总经理。2020 年 5 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总监兼基金经理。
何智豪	本基金基金经理	2021-02-05	-	9 年	何智豪先生曾任中国国际金融股份有限公司组合与量化策略研究员、资产管理部高级经理。2020 年 7 月起加入摩根基金管理（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.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。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。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 公平交易制度和控制方法

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

公司执行自上而下的三级授权体系，依次为投资决策委员会、投资总监、经理人，经理人在其授权范围内自主决策，投资决策委员会和投资总监均不得干预其授权范围内的投资活动。公司已建立客观的研究方法，严禁利用内幕信息作为投资依据，各投资组合享有公平的投资决策机会。公司建立集中交易制度，执行公平交易分配。对于交易所市场投资活动，不同投资组合在买卖同一证券时，按照时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易机会；对于银行间市场投资活动，通过交易对手库控制和交易室询价机制，严格防范交易对手风险并抽检价格公允性；对于一级市场申购投资行为，遵循价格优先、比例分配的原则，根据事前独立申报的价格和数量对交易结果进行公平分配。

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

价格占优的交易次数占比分析。

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形：无。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年 A 股市场下行。分市值看市场连续第二年呈现出明显的小盘强势，大盘弱势的局面，沪深 300 指数、中证 500 指数，中证 1000 指数均不同程度下跌，而中证 2000 指数上行，微盘股指数则大幅上行。资金在这一年里显然发现了更为前途明朗的赛道，即中小盘交易型策略，这类策略的实际体量，还远未抵达其潜在资金容量；从行业来看，一季度人工智能生成内容（AIGC）、中特估的强势宛如昙花一现，三季度房地产、非银等周期行业在跌势中展示的抗跌属性似乎也不持久，纵观全年，无论是自下而上选股还是自上而下选择赛道，长期主义均面临交易环境的巨大挑战。从 alpha 角度看，2023 年鲜明的特征是机器学习类价量 alpha 的强势表现，应用此类策略的产品收益表现较为突出，相比之下基本面甚至普通线性价量 alpha 有些黯然失色。这完全贴合了 2023 年市场的宏观特征：即存量博弈而非增量博弈，由负债端驱动而非由资产端驱动，价格由估值和交易主导而非曝光度和热点主导。本基金选股从多因子角度出发，基本面和价量 Alpha 配置较为均衡。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金份额净值增长率为:-6.84%，同期业绩比较基准收益率为:-7.03%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

往后看，量化选股策略不做择时类的判断，我们仍然保持较高仓位运作。策略方面，如果说 2021 年以前，市场的 alpha 和 beta 稳定性均较强，那么目前市场的 alpha 和 beta 的稳定性虽然都在衰减，但仍越来越呈现出 alpha 稳定性大于行业和主题热点稳定性的特征。这也驱使了发现这一点的部分资金完成了从追逐市场焦点到追逐 alpha 蓝海的转变，中小盘个股虽然机构覆盖度较低，个股认知度较差，但交易宽度和广度均较大，alpha 来源丰富，正驱使追逐长期稳定 alpha 的资金流入。按照统计

的术语来说，整个市场正在被施加一个名为“交易机会均等化”的正则项，小盘股的流动性持续提升，小票不再因为缺乏分析师覆盖而默默无闻，预计这是一种长期趋势，值得我们投入精力去进行方法论上的迭代和策略思维的转变。同时，市场竞争格局愈发饱和的趋势下，中低频基本面和价量 alpha 均围绕大小盘不同、价值成长不同、时间周期不同等因素正呈现出分时分域表现的显著差异，这是我们近三年来观察到的市场较为显著的变化，这提示了我们需要用更开放的 alpha 构造方式，更包容的收益预测方法论来刻画更高维度、更局部、更为时变的个股收益特征。在具体投资策略上，我们在坚持基本面和价量结合的量化多因子选股策略的同时，希望从更为条件化，更追求 alpha 局部效率的角度出发，一方面自上而下由因及果研究主动规律，一方面自下而上使用机器学习工具由果索因挖掘未知规律，两相结合，争取构造风险收益特征优于市场基准的投资组合。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

在本报告期内，本基金管理人内部监察稽核工作贯穿三条主线：

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

无。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情况，出现该情况的时间范围为 2023 年 01 月 03 日至 2023 年 12 月 31 日。

基金管理人拟调整本基金运作方式，加大营销力度，提升基金规模，方案已报监管机关。

§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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，本基金的管理人——摩根基金管理（中国）有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内摩根量化多因子灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对摩根基金管理（中国）有限公司编制和披露的本基金 2023 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

普华永道中天审字(2024)第 22494 号

摩根量化多因子灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

(一) 我们审计的内容

我们审计了摩根量化多因子灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“摩根量化多因子混合基金”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。

(二) 我们的意见

我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了摩根量化多因子混合基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

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

按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于摩根量化多因子混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。

6.3 管理层对财务报表的责任

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

在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估摩根量化多因子混合基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算摩根量化多因子混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督摩根量化多因子混合基金的财务报告过程。

6.4 注册会计师的责任

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

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

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

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

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

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

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

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

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

中国注册会计师

陈熹 金诗涛

中国·上海市

2024 年 3 月 26 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：摩根量化多因子灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	1,304,502.40	999,008.29
结算备付金		51,499.94	132,533.01
存出保证金		2,808.39	2,510.83
交易性金融资产	7.4.7.2	17,923,313.47	17,668,672.00
其中：股票投资		17,923,313.47	17,668,672.00
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		32.95	0.03
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		19,282,157.15	18,802,724.16
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1.60	-
应付赎回款		11,310.66	-
应付管理人报酬		24,520.56	24,389.64
应付托管费		4,086.75	4,064.95
应付销售服务费		-	-
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	7.4.7.6	86,166.38	98,921.84
负债合计		126,085.95	127,376.43
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	16,329,528.78	14,831,221.70
未分配利润	7.4.7.8	2,826,542.42	3,844,126.03
净资产合计		19,156,071.20	18,675,347.73
负债和净资产总计		19,282,157.15	18,802,724.16

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日,基金份额净值:1.1731 元,基金份额总额:16,329,528.78 份。

7.2 利润表

会计主体：摩根量化多因子灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注 号	本期	上年度可比期间
		2023 年 1 月 1 日 至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日 至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-1,092,794.13	-3,217,485.24

1.利息收入		6,318.10	6,584.59
其中：存款利息收入	7.4.7.9	6,318.10	6,584.59
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,453,962.89	-1,790,475.11
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-1,820,424.59	-2,091,465.65
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	1,358.14	4,461.21
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.12	-	-
股利收益	7.4.7.13	365,103.56	296,529.33
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	350,698.46	-1,437,211.23
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	4,152.20	3,616.51
减：二、营业总支出		381,120.99	386,094.62
1. 管理人报酬		299,942.58	304,236.53
2. 托管费		49,990.41	50,706.08
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		-	0.01
8. 其他费用	7.4.7.16	31,188.00	31,152.00

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,473,915.12	-3,603,579.86
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,473,915.12	-3,603,579.86
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,473,915.12	-3,603,579.86

7.3 净资产变动表

会计主体：摩根量化多因子灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	14,831,221.70	3,844,126.03	18,675,347.73
二、本期期初净资产	14,831,221.70	3,844,126.03	18,675,347.73
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,498,307.08	-1,017,583.61	480,723.47
（一）、综合收益总额	-	-1,473,915.12	-1,473,915.12
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	1,498,307.08	456,331.51	1,954,638.59
其中：1.基金申购	3,973,507.42	1,158,161.61	5,131,669.03

款			
2.基金赎回款	-2,475,200.34	-701,830.10	-3,177,030.44
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	16,329,528.78	2,826,542.42	19,156,071.20
项目	上年度可比期间		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	15,565,713.33	7,655,762.25	23,221,475.58
二、本期期初净资产	15,565,713.33	7,655,762.25	23,221,475.58
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-734,491.63	-3,811,636.22	-4,546,127.85
(一)、综合收益总额	-	-3,603,579.86	-3,603,579.86
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-734,491.63	-208,056.36	-942,547.99
其中: 1.基金申购款	1,576,701.92	581,044.38	2,157,746.30

2.基金赎回款	-2,311,193.55	-789,100.74	-3,100,294.29
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	14,831,221.70	3,844,126.03	18,675,347.73

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从 7.1 至 7.4, 财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人: 王琼慧, 主管会计工作负责人: 王敏, 会计机构负责人: 俞文涵

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

摩根量化多因子灵活配置混合型证券投资基金(原名为上投摩根量化多因子灵活配置混合型证券投资基金, 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[2017]1469 号《关于准予上投摩根量化多因子灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准, 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《上投摩根量化多因子灵活配置混合型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 434,226,098.49 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(2018)第 0018 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《上投摩根量化多因子灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 1 月 19 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 434,553,026.96 份基金份额, 其中认购资金利息折合 326,928.47 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, 基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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》, 上投摩根量

化多因子灵活配置混合型证券投资基金自该日起更名为摩根量化多因子灵活配置混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《摩根量化多因子灵活配置混合型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，包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、权证、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、中小企业私募债、证券公司短期公司债等)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、股指期货、股票期权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(须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 0%-95%，权证占基金资产净值的 0-3%；每个交易日日终在扣除股指期货及股票期权保证金后，现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。根据本基金的基金管理人上投摩根基金管理有限公司于 2022 年 9 月 9 日发布的《关于调整上投摩根量化多因子灵活配置混合型证券投资基金业绩比较基准并修改基金合同的公告》及更新后的《上投摩根量化多因子灵活配置混合型证券投资基金基金合同》，自 2022 年 9 月 9 日起本基金的业绩比较基准由中证 800 指数收益率×60%+中债总指数收益率×40%调整为中证 500 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 2024 年 3 月 26 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《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》、《摩根量化多因子灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2023 年 12 月 31 日，本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理

方案，故本财务报表仍以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 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 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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、金融负债或权益工具。

(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。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债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。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资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。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占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)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资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后的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,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。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足一定条件的,则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1)对于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估值业务的指导意见》及中国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》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2023 年 12 月 31 日	2022 年 12 月 31 日
活期存款	1,304,502.40	999,008.29
等于：本金	1,304,366.30	998,888.78
加：应计利息	136.10	119.51
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
合计	1,304,502.40	999,008.29

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	18,406,760.50	-	17,923,313.47	-483,447.03
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	18,406,760.50	-	17,923,313.47	-483,447.03
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	18,502,817.49	-	17,668,672.00	-834,145.49
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	18,502,817.49	-	17,668,672.00	-834,145.49

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

7.4.7.5 其他资产

无余额。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2023 年 12 月 31 日	2022 年 12 月 31 日

应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	0.14	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	56,166.24	68,921.84
其中：交易所市场	56,166.24	68,921.84
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	30,000.00	30,000.00
合计	86,166.38	98,921.84

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	14,831,221.70	14,831,221.70
本期申购	3,973,507.42	3,973,507.42
本期赎回（以“-”号填列）	-2,475,200.34	-2,475,200.34
本期末	16,329,528.78	16,329,528.78

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.8 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	7,971,412.32	-4,127,286.29	3,844,126.03
本期期初	7,971,412.32	-4,127,286.29	3,844,126.03
本期利润	-1,824,613.58	350,698.46	-1,473,915.12
本期基金份额交易产生的变动数	832,004.18	-375,672.67	456,331.51
其中：基金申购款	2,163,292.40	-1,005,130.79	1,158,161.61

基金赎回款	-1,331,288.22	629,458.12	-701,830.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,978,802.92	-4,152,260.50	2,826,542.42

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	4,496.40	5,051.14
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	1,731.78	1,491.23
其他	89.92	42.22
合计	6,318.10	6,584.59

7.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	159,318,141.13	140,338,941.95
减：卖出股票成本总额	160,678,741.54	142,007,051.18
减：交易费用	459,824.18	423,356.42
买卖股票差价收入	-1,820,424.59	-2,091,465.65

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

	月31日	月31日
债券投资收益——利息收入	2.33	489.58
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,355.81	3,971.63
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	1,358.14	4,461.21

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	11,258.60	220,647.12
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	9,900.00	211,940.00
减：应计利息总额	2.33	4,734.84
减：交易费用	0.46	0.65
买卖债券差价收入	1,355.81	3,971.63

7.4.7.12 衍生工具收益

无。

7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	365,103.56	296,529.33
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	365,103.56	296,529.33
----	------------	------------

7.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
1.交易性金融资产	350,698.46	-1,437,211.23
——股票投资	350,698.46	-1,433,466.21
——债券投资	-	-3,745.02
——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	350,698.46	-1,437,211.23

7.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
基金赎回费收入	4,014.96	3,244.54
转换费收入	137.24	371.97
合计	4,152.20	3,616.51

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
审计费用	30,000.00	30,000.00
信息披露费	-	-
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	1,188.00	1,152.00
合计	31,188.00	31,152.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
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
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
上海国际信托有限公司(“上海信托”)	基金管理人的股东（2023 年 3 月 24 日前）
摩根资产管理(英国)有限公司	基金管理人的股东（2023 年 3 月 24 日前）
上海浦东发展银行股份有限公司(“浦发银行”)	基金管理人的股东上海信托的控股股东（2023 年 3 月 24 日前）、基金销售机构
上信资产管理有限公司	基金管理人的股东上海国际信托有限公司控制的公司（2023 年 3 月 24 日前）
上海国利货币经纪有限公司	基金管理人的股东上海国际信托有限公司控制的公司（2023 年 3 月 24 日前）
摩根资产管理控股公司(JPMorgan Asset Management Holdings Inc.)	基金管理人的股东（自 2023 年 3 月 24 日起）
摩根大通公司(JPMorgan Chase &Co.)	基金管理人的实际控制人（自 2023 年 3 月 24 日起）

尚腾资本管理有限公司	基金管理人的子公司
上投摩根资产管理(香港)有限公司	基金管理人的子公司

注：1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	299,942.58	304,236.53
其中：应支付销售机构的客户维护费	139,891.03	145,241.13
应支付基金管理人的净管理费	160,051.55	158,995.40

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%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 1.5% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
----	---------------------------------	--------------------------------------

	月31日	月31日
当期发生的基金应支付的托管费	49,990.41	50,706.08

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	256,634.52	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	256,634.52	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.57%	-

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。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年12月31日		2022年1月1日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	1,304,502.40	4,496.40	999,008.29	5,051.14

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

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

无。

7.4.11 利润分配情况

本报告期本基金未实施利润分配。

7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于混合型基金产品，预期风险和收益水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金，属于较高风险收益水平的基金产品。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是采用量化投资对基金资产进行积极管理，力争获取超越业绩基准的投资收益。

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

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行，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 12 月 31 日，本基金未持有债券投资(2022 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险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 12 月 31 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。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2023 年 12 月 31 日，本基金无流动性受限资产。

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 2023 年 12

月 31 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值为 19,227,711.12 元，超过经确认的当日净赎回金额。

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

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产					
货币资金	1,304,502.40	-	-	-	1,304,502.40
结算备付金	51,499.94	-	-	-	51,499.94
存出保证金	2,808.39	-	-	-	2,808.39
交易性金融资产	-	-	-	17,923,313.47	17,923,313.47
应收申购款	-	-	-	32.95	32.95
资产总计	1,358,810.73	-	-	17,923,346.42	19,282,157.15
负债					
应付清算款	-	-	-	1.60	1.60
应付赎回款	-	-	-	11,310.66	11,310.66
应付管理人报酬	-	-	-	24,520.56	24,520.56
应付托管费	-	-	-	4,086.75	4,086.75
其他负债	-	-	-	86,166.38	86,166.38
负债总计	-	-	-	126,085.95	126,085.95
利率敏感度缺口	1,358,810.73	-	-	17,797,260.47	19,156,071.20
上年度末					
2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	999,008.29	-	-	-	999,008.29
结算备付金	132,533.01	-	-	-	132,533.01
存出保证金	2,510.83	-	-	-	2,510.83
交易性金融资产	-	-	-	17,668,672.00	17,668,672.00
应收申购款	-	-	-	0.03	0.03
资产总计	1,134,052.13	-	-	17,668,672.03	18,802,724.16
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	24,389.64	24,389.64
应付托管费	-	-	-	4,064.95	4,064.95
其他负债	-	-	-	98,921.84	98,921.84
负债总计	-	-	-	127,376.43	127,376.43
利率敏感度缺口	1,134,052.13	-	-	17,541,295.60	18,675,347.73

注：1.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。

2.根据中国证监会于 2024 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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2022 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2022 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“量化多因子模型”进行个股选择，通过对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等影响证券市场的等因素进行深入分析，确定基金资产在股票、债券及现金等类别资产间的分配比例，并动态优化投资组合。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产占基金资产的 0%-95%，权证占基金资产净值的 0-3%；每个交易日日终在扣除股指期货及股票期权保证金后，现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 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	17,923,313.47	93.56	17,668,672.00	94.61
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	-	-	-	-
合计	17,923,313.47	93.56	17,668,672.00	94.61

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币万元)	
		本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	增加约 95	增加约 126
	业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	减少约 95	减少约 126

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	2022 年 12 月 31 日
第一层次	17,923,313.47	17,668,672.00
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	17,923,313.47	17,668,672.00

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中： 计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他	-	-	-

综合收益的利得或损失（若有）			
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	647,088.61	647,088.61
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	644,057.75	644,057.75
当期利得或损失总额	-	-3,030.86	-3,030.86
其中：计入损益的利得或损失	-	-3,030.86	-3,030.86
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	-	-

期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-
--	---	---	---

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 12 月 31 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022 年 12 月 31 日:同)。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	17,923,313.47	92.95
	其中:股票	17,923,313.47	92.95
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	1,356,002.34	7.03
8	其他各项资产	2,841.34	0.01
9	合计	19,282,157.15	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	215,622.00	1.13
B	采矿业	636,482.00	3.32
C	制造业	12,056,826.47	62.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	295,037.00	1.54
E	建筑业	478,387.00	2.50
F	批发和零售业	358,857.00	1.87
G	交通运输、仓储和邮政业	370,824.00	1.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,578,371.00	8.24
J	金融业	1,371,704.00	7.16
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	101,222.00	0.53
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-

R	文化、体育和娱乐业	459,981.00	2.40
S	综合	-	-
	合计	17,923,313.47	93.56

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	000513	丽珠集团	15,300.00	535,653.00	2.80
2	600403	大有能源	102,700.00	390,260.00	2.04
3	002249	大洋电机	76,900.00	382,193.00	2.00
4	000156	华数传媒	51,800.00	381,766.00	1.99
5	600362	江西铜业	19,500.00	348,270.00	1.82
6	600606	绿地控股	142,000.00	326,600.00	1.70
7	600171	上海贝岭	22,200.00	315,684.00	1.65
8	600420	国药现代	28,500.00	279,015.00	1.46
9	000422	湖北宜化	24,000.00	251,040.00	1.31
10	601607	上海医药	14,500.00	242,585.00	1.27
11	000559	万向钱潮	46,200.00	239,778.00	1.25
12	001696	宗申动力	35,500.00	235,365.00	1.23
13	300613	富瀚微	5,200.00	220,688.00	1.15
14	002124	天邦食品	59,400.00	215,622.00	1.13
15	601766	中国中车	40,100.00	210,926.00	1.10
16	601555	东吴证券	28,400.00	207,604.00	1.08
17	600429	三元股份	46,400.00	206,944.00	1.08
18	000650	仁和药业	31,200.00	206,856.00	1.08
19	600030	中信证券	10,000.00	203,700.00	1.06
20	002396	星网锐捷	10,700.00	193,349.00	1.01
21	600869	远东股份	43,800.00	192,282.00	1.00
22	002008	大族激光	8,800.00	182,336.00	0.95
23	603866	桃李面包	23,600.00	180,776.00	0.94
24	600531	豫光金铅	28,900.00	174,845.00	0.91
25	600835	上海机电	14,500.00	172,115.00	0.90
26	002624	完美世界	14,500.00	171,680.00	0.90
27	002745	木林森	19,500.00	168,870.00	0.88
28	601336	新华保险	5,300.00	164,989.00	0.86
29	002129	TCL 中环	9,500.00	148,580.00	0.78
30	601869	长飞光纤	5,400.00	148,284.00	0.77
31	002534	西子洁能	11,800.00	147,382.00	0.77
32	601326	秦港股份	51,500.00	146,775.00	0.77

33	601600	中国铝业	25,800.00	145,512.00	0.76
34	300166	东方国信	15,300.00	143,820.00	0.75
35	000880	潍柴重机	13,400.00	142,442.00	0.74
36	601952	苏垦农发	13,900.00	142,336.00	0.74
37	000063	中兴通讯	5,300.00	140,344.00	0.73
38	603185	上机数控	4,200.00	139,776.00	0.73
39	002065	东华软件	22,500.00	138,825.00	0.72
40	300323	华灿光电	18,700.00	136,884.00	0.71
41	300777	中简科技	4,500.00	134,235.00	0.70
42	300009	安科生物	13,000.00	132,860.00	0.69
43	000990	诚志股份	15,800.00	129,718.00	0.68
44	600332	白云山	4,500.00	128,700.00	0.67
45	603876	鼎胜新材	9,900.00	124,047.00	0.65
46	002537	海联金汇	18,600.00	123,876.00	0.65
47	002214	大立科技	10,600.00	121,582.00	0.63
48	300671	富满微	3,700.00	119,621.00	0.62
49	600548	深高速	13,100.00	117,769.00	0.61
50	300787	海能实业	7,000.00	117,740.00	0.61
51	000823	超声电子	12,300.00	117,711.00	0.61
52	300696	爱乐达	6,700.00	116,647.00	0.61
53	600297	广汇汽车	67,600.00	116,272.00	0.61
54	600028	中国石化	20,800.00	116,064.00	0.61
55	002923	润都股份	9,300.00	114,762.00	0.60
56	300306	远方信息	9,500.00	114,760.00	0.60
57	002287	奇正藏药	5,100.00	114,699.00	0.60
58	000725	京东方 A	29,400.00	114,660.00	0.60
59	000060	中金岭南	26,400.00	114,048.00	0.60
60	000519	中兵红箭	8,100.00	113,724.00	0.59
61	601318	中国平安	2,800.00	112,840.00	0.59
62	300219	鸿利智汇	13,300.00	111,986.00	0.58
63	002449	国星光电	11,500.00	108,905.00	0.57
64	600008	首创环保	38,100.00	102,489.00	0.54
65	600596	新安股份	11,100.00	101,232.00	0.53
66	000415	渤海租赁	47,300.00	101,222.00	0.53
67	000688	国城矿业	9,800.00	101,038.00	0.53
68	002405	四维图新	11,300.00	100,570.00	0.53
69	600267	海正药业	10,700.00	100,152.00	0.52
70	300458	全志科技	4,400.00	99,836.00	0.52
71	300296	利亚德	16,600.00	99,600.00	0.52
72	000807	云铝股份	8,100.00	98,982.00	0.52
73	600787	中储股份	19,400.00	98,940.00	0.52
74	300271	华宇软件	11,900.00	97,461.00	0.51
75	688586	江航装备	8,773.00	97,292.57	0.51
76	002434	万里扬	12,600.00	93,870.00	0.49

77	600438	通威股份	3,600.00	90,108.00	0.47
78	300059	东方财富	6,400.00	89,856.00	0.47
79	000600	建投能源	17,000.00	85,170.00	0.44
80	688209	英集芯	4,400.00	78,584.00	0.41
81	600528	中铁工业	10,400.00	77,376.00	0.40
82	002085	万丰奥威	15,500.00	76,570.00	0.40
83	600351	亚宝药业	10,800.00	74,520.00	0.39
84	601139	深圳燃气	10,800.00	74,412.00	0.39
85	002736	国信证券	8,600.00	73,444.00	0.38
86	000921	海信家电	3,600.00	73,440.00	0.38
87	002649	博彦科技	5,900.00	72,393.00	0.38
88	300078	思创医惠	16,500.00	72,270.00	0.38
89	002465	海格通信	5,600.00	71,960.00	0.38
90	000568	泸州老窖	400.00	71,768.00	0.37
91	300672	国科微	1,200.00	70,728.00	0.37
92	000933	神火股份	4,200.00	70,560.00	0.37
93	600875	东方电气	4,800.00	70,176.00	0.37
94	601881	中国银河	5,500.00	66,275.00	0.35
95	300136	信维通信	2,800.00	66,080.00	0.34
96	000049	德赛电池	2,420.00	65,630.40	0.34
97	002938	鹏鼎控股	2,900.00	64,728.00	0.34
98	002500	山西证券	12,000.00	64,680.00	0.34
99	600500	中化国际	14,600.00	64,532.00	0.34
100	601601	中国太保	2,700.00	64,206.00	0.34
101	002574	明牌珠宝	10,600.00	63,600.00	0.33
102	002216	三全食品	4,700.00	62,980.00	0.33
103	000581	威孚高科	4,100.00	61,787.00	0.32
104	300772	运达股份	5,800.00	61,712.00	0.32
105	600095	湘财股份	8,200.00	61,582.00	0.32
106	688128	中国电研	3,000.00	61,560.00	0.32
107	300082	奥克股份	8,800.00	61,336.00	0.32
108	000617	中油资本	11,300.00	61,020.00	0.32
109	688699	明微电子	1,500.00	60,525.00	0.32
110	300140	节能环保	7,900.00	58,223.00	0.30
111	000703	恒逸石化	8,500.00	57,120.00	0.30
112	601186	中国铁建	7,500.00	57,075.00	0.30
113	300308	中际旭创	500.00	56,455.00	0.29
114	002376	新北洋	7,300.00	55,626.00	0.29
115	000627	天茂集团	19,500.00	55,380.00	0.29
116	600690	海尔智家	2,600.00	54,600.00	0.29
117	300369	绿盟科技	5,700.00	53,751.00	0.28
118	300377	赢时胜	6,800.00	52,768.00	0.28
119	000938	紫光股份	2,700.00	52,245.00	0.27
120	601949	中国出版	6,300.00	50,904.00	0.27

121	600746	江苏索普	6,800.00	49,776.00	0.26
122	603766	隆鑫通用	9,500.00	49,020.00	0.26
123	600577	精达股份	11,800.00	48,852.00	0.26
124	000566	海南海药	10,600.00	47,912.00	0.25
125	600584	长电科技	1,600.00	47,776.00	0.25
126	001218	丽臣实业	2,200.00	47,542.00	0.25
127	300383	光环新网	4,700.00	45,684.00	0.24
128	601390	中国中铁	7,900.00	44,872.00	0.23
129	002408	齐翔腾达	8,400.00	44,352.00	0.23
130	300036	超图软件	2,100.00	43,890.00	0.23
131	002541	鸿路钢构	2,000.00	43,460.00	0.23
132	600482	中国动力	2,400.00	43,224.00	0.23
133	600479	千金药业	4,000.00	43,080.00	0.22
134	002367	康力电梯	5,700.00	42,864.00	0.22
135	603858	步长制药	2,500.00	42,525.00	0.22
136	688148	芳源股份	5,400.00	41,418.00	0.22
137	002491	通鼎互联	7,600.00	39,824.00	0.21
138	300451	创业慧康	6,000.00	39,300.00	0.21
139	300726	宏达电子	1,300.00	39,247.00	0.20
140	002670	国盛金控	4,200.00	39,144.00	0.20
141	600141	兴发集团	2,100.00	38,325.00	0.20
142	600765	中航重机	2,000.00	38,220.00	0.20
143	000683	远兴能源	6,500.00	38,155.00	0.20
144	600718	东软集团	4,100.00	37,925.00	0.20
145	002241	歌尔股份	1,800.00	37,818.00	0.20
146	002372	伟星新材	2,500.00	36,175.00	0.19
147	603511	爱慕股份	2,300.00	35,604.00	0.19
148	300077	国民技术	3,100.00	34,999.00	0.18
149	600958	东方证券	4,000.00	34,800.00	0.18
150	002151	北斗星通	1,100.00	34,738.00	0.18
151	600206	有研新材	2,700.00	33,453.00	0.17
152	002602	世纪华通	6,400.00	33,024.00	0.17
153	003816	中国广核	10,600.00	32,966.00	0.17
154	601360	三六零	3,600.00	32,436.00	0.17
155	600741	华域汽车	1,900.00	30,932.00	0.16
156	002636	金安国纪	3,400.00	30,294.00	0.16
157	603993	洛阳钼业	5,600.00	29,120.00	0.15
158	002761	浙江建投	2,800.00	28,728.00	0.15
159	300003	乐普医疗	1,700.00	27,472.00	0.14
160	601928	凤凰传媒	3,100.00	27,311.00	0.14
161	600959	江苏有线	8,600.00	27,004.00	0.14
162	600210	紫江企业	5,700.00	26,790.00	0.14
163	000977	浪潮信息	800.00	26,560.00	0.14
164	601136	首创证券	1,500.00	25,440.00	0.13

165	603444	吉比特	100.00	24,512.00	0.13
166	600198	大唐电信	3,700.00	24,309.00	0.13
167	600696	岩石股份	1,350.00	24,286.50	0.13
168	603363	傲农生物	4,000.00	24,280.00	0.13
169	601099	太平洋	6,500.00	24,050.00	0.13
170	601166	兴业银行	1,400.00	22,694.00	0.12
171	600521	华海药业	1,500.00	22,005.00	0.11
172	002051	中工国际	2,600.00	21,112.00	0.11
173	002815	崇达技术	2,200.00	21,076.00	0.11
174	600703	三安光电	1,500.00	20,775.00	0.11
175	603227	雪峰科技	3,000.00	20,700.00	0.11
176	300579	数字认证	800.00	20,688.00	0.11
177	002835	同为股份	1,100.00	19,734.00	0.10
178	600285	羚锐制药	1,100.00	18,821.00	0.10
179	600150	中国船舶	600.00	17,664.00	0.09
180	002912	中新赛克	600.00	16,794.00	0.09
181	300853	申昊科技	600.00	16,320.00	0.09
182	601138	工业富联	1,000.00	15,120.00	0.08
183	000016	深康佳 A	3,400.00	14,178.00	0.07
184	002932	明德生物	600.00	13,782.00	0.07
185	603228	景旺电子	600.00	13,536.00	0.07
186	600498	烽火通信	800.00	13,312.00	0.07
187	002385	大北农	2,200.00	13,112.00	0.07
188	002279	久其软件	2,000.00	13,020.00	0.07
189	603927	中科软	400.00	11,992.00	0.06
190	300630	普利制药	500.00	11,310.00	0.06
191	600075	新疆天业	2,500.00	10,800.00	0.06
192	600346	恒力石化	800.00	10,536.00	0.06
193	600879	航天电子	1,300.00	10,023.00	0.05
194	300259	新天科技	2,600.00	9,438.00	0.05
195	000716	黑芝麻	1,500.00	9,030.00	0.05
196	600361	华联综超	1,800.00	9,018.00	0.05
197	002845	同兴达	500.00	8,875.00	0.05
198	600597	光明乳业	1,000.00	8,730.00	0.05
199	600309	万华化学	100.00	7,682.00	0.04
200	600600	青岛啤酒	100.00	7,475.00	0.04
201	600839	四川长虹	1,400.00	7,406.00	0.04
202	601111	中国国航	1,000.00	7,340.00	0.04
203	300439	美康生物	600.00	6,966.00	0.04
204	600271	航天信息	600.00	6,384.00	0.03

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000513	丽珠集团	1,619,695.00	8.67
2	002460	赣锋锂业	1,175,126.00	6.29
3	601766	中国中车	1,162,868.00	6.23
4	000725	京东方 A	1,097,850.00	5.88
5	000156	华数传媒	1,060,847.00	5.68
6	002249	大洋电机	940,670.00	5.04
7	300900	广联航空	919,861.00	4.93
8	601318	中国平安	919,387.00	4.92
9	600606	绿地控股	906,229.00	4.85
10	600583	海油工程	902,989.00	4.84
11	600362	江西铜业	894,458.00	4.79
12	002376	新北洋	821,327.00	4.40
13	600380	健康元	785,547.00	4.21
14	601607	上海医药	784,090.00	4.20
15	601991	大唐发电	766,088.00	4.10
16	000878	云南铜业	750,366.00	4.02
17	001696	宗申动力	741,431.00	3.97
18	600967	内蒙一机	734,553.00	3.93
19	002030	达安基因	709,195.54	3.80
20	600956	新天绿能	708,415.00	3.79
21	002152	广电运通	706,462.00	3.78
22	002594	比亚迪	687,472.00	3.68
23	600835	上海机电	684,658.00	3.67
24	600690	海尔智家	667,753.00	3.58
25	300088	长信科技	633,134.00	3.39
26	688561	奇安信	628,850.37	3.37
27	600271	航天信息	624,235.00	3.34
28	600143	金发科技	619,930.00	3.32
29	600258	首旅酒店	609,327.00	3.26
30	600600	青岛啤酒	603,531.00	3.23
31	000823	超声电子	584,908.00	3.13
32	600500	中化国际	580,299.00	3.11
33	600216	浙江医药	578,827.00	3.10
34	002056	横店东磁	577,808.00	3.09
35	600528	中铁工业	576,770.00	3.09
36	000002	万科 A	560,776.00	3.00
37	002635	安洁科技	559,697.00	3.00
38	600196	复星医药	559,147.00	2.99

39	600026	中远海能	556,246.00	2.98
40	601609	金田股份	550,772.00	2.95
41	002831	裕同科技	549,143.00	2.94
42	600718	东软集团	543,990.00	2.91
43	601139	深圳燃气	541,167.00	2.90
44	300602	飞荣达	540,110.00	2.89
45	000338	潍柴动力	530,574.00	2.84
46	300777	中简科技	529,815.00	2.84
47	300009	安科生物	525,937.00	2.82
48	002396	星网锐捷	524,225.00	2.81
49	300377	赢时胜	522,892.00	2.80
50	000555	神州信息	519,612.00	2.78
51	002273	水晶光电	515,443.00	2.76
52	601956	东贝集团	515,317.00	2.76
53	601618	中国中冶	509,731.00	2.73
54	000921	海信家电	505,692.00	2.71
55	000063	中兴通讯	503,082.00	2.69
56	603876	鼎胜新材	492,271.00	2.64
57	601211	国泰君安	486,096.00	2.60
58	000559	万向钱潮	483,843.00	2.59
59	600089	特变电工	483,588.00	2.59
60	002545	东方铁塔	480,380.00	2.57
61	002688	金河生物	479,567.00	2.57
62	600030	中信证券	469,533.00	2.51
63	002008	大族激光	466,066.00	2.50
64	603160	汇顶科技	464,444.00	2.49
65	600662	外服控股	464,168.00	2.49
66	600403	大有能源	463,374.00	2.48
67	600710	苏美达	462,495.62	2.48
68	300115	长盈精密	461,909.00	2.47
69	000069	华侨城 A	458,996.00	2.46
70	603866	桃李面包	454,452.00	2.43
71	002214	大立科技	450,101.00	2.41
72	600879	航天电子	448,683.00	2.40
73	600028	中国石化	448,033.00	2.40
74	002600	领益智造	447,070.00	2.39
75	000547	航天发展	446,751.00	2.39
76	601231	环旭电子	444,802.00	2.38
77	600433	冠豪高新	440,293.00	2.36
78	601728	中国电信	438,838.00	2.35
79	603127	昭衍新药	438,355.00	2.35
80	600596	新安股份	437,585.00	2.34
81	688390	固德威	431,566.59	2.31
82	000630	铜陵有色	427,937.00	2.29

83	600887	伊利股份	426,906.00	2.29
84	000422	湖北宜化	425,159.29	2.28
85	002938	鹏鼎控股	424,991.00	2.28
86	002055	得润电子	421,660.00	2.26
87	603858	步长制药	420,646.77	2.25
88	601899	紫金矿业	420,272.00	2.25
89	000039	中集集团	420,022.00	2.25
90	601111	中国国航	416,134.00	2.23
91	600959	江苏有线	415,639.00	2.23
92	000100	TCL 科技	415,174.00	2.22
93	002624	完美世界	414,107.00	2.22
94	000157	中联重科	412,689.00	2.21
95	600008	首创环保	412,594.00	2.21
96	600623	华谊集团	406,602.00	2.18
97	002130	沃尔核材	402,776.00	2.16
98	000776	广发证券	400,529.00	2.14
99	002421	达实智能	398,953.00	2.14
100	002266	浙富控股	397,169.00	2.13
101	603589	口子窖	388,506.00	2.08
102	600549	厦门钨业	387,643.00	2.08
103	002815	崇达技术	386,536.00	2.07
104	600420	国药现代	385,350.00	2.06
105	300136	信维通信	384,985.00	2.06
106	002085	万丰奥威	383,610.00	2.05
107	002745	木林森	382,212.00	2.05
108	600696	岩石股份	380,252.00	2.04
109	300026	红日药业	376,200.00	2.01
110	002171	楚江新材	376,160.00	2.01
111	600585	海螺水泥	375,615.00	2.01
112	601800	中国交建	375,538.00	2.01
113	603369	今世缘	375,087.00	2.01
114	601717	郑煤机	374,270.00	2.00
115	600438	通威股份	374,014.00	2.00
116	600459	贵研铂业	373,734.00	2.00

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例
----	------	------	----------	-------------

				(%)
1	002460	赣锋锂业	1,324,437.50	7.09
2	002594	比亚迪	1,206,575.50	6.46
3	000513	丽珠集团	1,156,178.95	6.19
4	601318	中国平安	1,089,826.50	5.84
5	600967	内蒙一机	1,080,326.00	5.78
6	000725	京东方 A	954,222.50	5.11
7	000039	中集集团	912,299.00	4.89
8	600583	海油工程	902,382.10	4.83
9	300900	广联航空	894,439.00	4.79
10	601991	大唐发电	892,503.00	4.78
11	601766	中国中车	886,955.00	4.75
12	002030	达安基因	877,449.50	4.70
13	600380	健康元	814,557.00	4.36
14	600690	海尔智家	788,410.00	4.22
15	002376	新北洋	773,820.75	4.14
16	600362	江西铜业	762,216.90	4.08
17	000921	海信家电	722,454.00	3.87
18	002152	广电运通	717,925.00	3.84
19	000878	云南铜业	712,158.24	3.81
20	600956	新天绿能	686,538.00	3.68
21	300115	长盈精密	678,165.00	3.63
22	002938	鹏鼎控股	670,736.00	3.59
23	601231	环旭电子	646,460.00	3.46
24	000156	华数传媒	632,605.01	3.39
25	600026	中远海能	629,227.00	3.37
26	601857	中国石油	619,676.00	3.32
27	600258	首旅酒店	617,054.01	3.30
28	688561	奇安信	614,221.05	3.29
29	600710	苏美达	599,951.00	3.21
30	600606	绿地控股	597,580.00	3.20
31	600600	青岛啤酒	588,891.96	3.15
32	600143	金发科技	587,294.25	3.14
33	300088	长信科技	585,865.00	3.14
34	600030	中信证券	585,691.00	3.14
35	600216	浙江医药	576,380.00	3.09
36	603613	国联股份	575,940.00	3.08
37	603127	昭衍新药	574,077.00	3.07
38	600271	航天信息	564,147.55	3.02
39	300602	飞荣达	561,457.00	3.01
40	002091	江苏国泰	561,162.25	3.00
41	600196	复星医药	557,441.50	2.98
42	002635	安洁科技	553,418.01	2.96

43	000568	泸州老窖	546,951.05	2.93
44	000338	潍柴动力	544,954.00	2.92
45	600835	上海机电	541,869.01	2.90
46	002249	大洋电机	540,703.51	2.90
47	601609	金田股份	526,101.20	2.82
48	601956	东贝集团	522,879.49	2.80
49	002688	金河生物	521,601.00	2.79
50	601717	郑煤机	518,023.00	2.77
51	601607	上海医药	516,609.47	2.77
52	600718	东软集团	515,258.26	2.76
53	002831	裕同科技	511,882.00	2.74
54	000002	万 科 A	509,184.00	2.73
55	001696	宗申动力	505,381.00	2.71
56	600959	江苏有线	501,926.50	2.69
57	002273	水晶光电	500,649.00	2.68
58	000555	神州信息	500,446.98	2.68
59	002056	横店东磁	498,342.49	2.67
60	000823	超声电子	498,011.99	2.67
61	600623	华谊集团	497,050.00	2.66
62	002422	科伦药业	486,763.00	2.61
63	600500	中化国际	482,943.00	2.59
64	002600	领益智造	475,547.01	2.55
65	601139	深圳燃气	470,962.25	2.52
66	601211	国泰君安	469,022.62	2.51
67	002545	东方铁塔	468,270.00	2.51
68	300951	博硕科技	467,658.50	2.50
69	301067	显盈科技	465,979.04	2.50
70	603585	苏利股份	465,686.30	2.49
71	603228	景旺电子	465,586.50	2.49
72	601618	中国中冶	461,576.00	2.47
73	000547	航天发展	461,038.50	2.47
74	600528	中铁工业	457,114.00	2.45
75	600273	嘉化能源	446,457.00	2.39
76	600549	厦门钨业	445,841.01	2.39
77	600887	伊利股份	444,350.01	2.38
78	688390	固德威	444,222.19	2.38
79	600305	恒顺醋业	439,840.00	2.36
80	600662	外服控股	438,975.50	2.35
81	600879	航天电子	437,713.02	2.34
82	601899	紫金矿业	436,949.00	2.34
83	300002	神州泰岳	434,270.00	2.33
84	000100	TCL 科技	434,205.80	2.33
85	300377	赢时胜	431,195.50	2.31
86	000157	中联重科	427,708.99	2.29

87	002055	得润电子	424,446.00	2.27
88	600089	特变电工	422,944.00	2.26
89	603160	汇顶科技	417,783.00	2.24
90	600150	中国船舶	416,613.53	2.23
91	601728	中国电信	416,283.00	2.23
92	000069	华侨城 A	415,279.50	2.22
93	002421	达实智能	414,132.00	2.22
94	002130	沃尔核材	411,680.50	2.20
95	603377	东方时尚	409,950.00	2.20
96	000630	铜陵有色	409,785.50	2.19
97	600036	招商银行	409,633.00	2.19
98	002266	浙富控股	406,263.00	2.18
99	300684	中石科技	405,678.60	2.17
100	300009	安科生物	404,823.50	2.17
101	603369	今世缘	400,042.00	2.14
102	601111	中国国航	396,453.01	2.12
103	600968	海油发展	391,500.00	2.10
104	603589	口子窖	386,725.00	2.07
105	002065	东华软件	386,380.00	2.07
106	603876	鼎胜新材	383,672.70	2.05
107	601699	潞安环能	380,977.00	2.04
108	002829	星网宇达	380,796.00	2.04
109	002299	圣农发展	380,469.00	2.04
110	600433	冠豪高新	378,020.00	2.02
111	002171	楚江新材	377,476.50	2.02
112	002048	宁波华翔	374,631.98	2.01

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	160,582,684.55
卖出股票的收入（成交）总额	159,318,141.13

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 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。

8.11 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。

8.12 本报告期投资基金情况

8.12.1 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。

8.13 投资组合报告附注

8.13.1 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。

8.13.2 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。

8.13.3 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	2,808.39
2	应收清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	32.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,841.34

8.13.4 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。

8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.13.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
602	27,125.46	256,634.52	1.57%	16,072,894.26	98.43%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有 本基金	417,590.93	2.5573%

9.3 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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2018年1月19日)基金份额总额	434,553,026.96
本报告期期初基金份额总额	14,831,221.70
本报告期基金总申购份额	3,973,507.42
减：本报告期基金总赎回份额	2,475,200.34
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	16,329,528.78

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：

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。

基金管理人于 2023 年 9 月 16 日公告，自 2023 年 9 月 15 日起，刘非女士担任公司副总经理。

本报告期内，托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未发生改聘为其审计的会计师事务所情况。报告年度应支付给聘任普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为 30,000 元，目前该审计机构已提供审计服务的连续年限为 6 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
上海证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
申港证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	2	80,648,428.22	25.21%	75,581.88	25.26%	-

国金证券	1	35,520,498.05	11.10%	33,281.89	11.12%	-
瑞银证券	2	29,915,911.63	9.35%	27,910.19	9.33%	-
中信证券	2	26,721,341.75	8.35%	24,935.01	8.33%	-
申万宏源证券	1	21,660,396.35	6.77%	20,185.07	6.75%	-
中金证券	2	21,644,616.07	6.77%	20,233.24	6.76%	-
国投证券	1	20,953,942.28	6.55%	19,515.37	6.52%	-
东北证券	1	18,379,513.29	5.75%	17,261.94	5.77%	-
华泰证券	1	18,362,635.91	5.74%	17,215.40	5.75%	-
长江证券	1	16,645,441.30	5.20%	15,557.96	5.20%	-
海通证券	1	15,425,580.54	4.82%	14,366.18	4.80%	-
东方证券	1	10,974,722.88	3.43%	10,303.90	3.44%	-
西南证券	1	3,019,866.21	0.94%	2,856.76	0.95%	-

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。
- 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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比	成交金额	占当期回购成交总额的比	成交金额	占当期权证成交总额的比

上海证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富 证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	5,560.05	49.38%	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	5,698.55	50.62%	-	-	-	-
中金证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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	基金管理人公司网站及本基金选定的信息披露报纸	2023-01-21
2	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
3	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
4	关于公司法定名称变更的公告	同上	2023-04-12
5	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
6	摩根基金管理（中国）有限公司关于董事长变更的公告	同上	2023-04-27
7	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
8	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
9	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

10	摩根基金管理（中国）有限公司关于旗下基金增加临时基金管理人条款并修改基金合同和托管协议的公告	同上	2023-09-12
11	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	2023-09-16
12	摩根基金管理（中国）有限公司关于公司住所变更的公告	同上	2023-11-17

12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予本基金募集注册的文件
- 2、《摩根量化多因子灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《摩根量化多因子灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 4、法律意见书
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 7、《摩根基金管理（中国）有限公司开放式基金业务规则》
- 8、中国证监会要求的其他文件

13.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

摩根基金管理（中国）有限公司

二〇二四年三月二十八日