

摩根士丹利 ESG 量化先行混合型证券投资  
基金  
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：摩根士丹利基金管理（中国）有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 28 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 26 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。

本报告中财务资料经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计并出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	14
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	14
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>14</b>
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>16</b>
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	17
7.3 净资产变动表	19
7.4 报表附注	20
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>46</b>

8.1 期末基金资产组合情况 .....	46
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	46
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 .....	47
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	57
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	59
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 .....	59
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 .....	59
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 .....	59
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 .....	59
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	59
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	59
8.12 投资组合报告附注 .....	59
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>60</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	60
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	60
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情况 .....	60
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>60</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>61</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	61
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 .....	61
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	61
11.4 基金投资策略的改变 .....	61
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	61
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 .....	61
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	62
11.8 其他重大事件 .....	65
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>68</b>
12.1 备查文件目录 .....	68
12.2 存放地点 .....	68
12.3 查阅方式 .....	68

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	摩根士丹利 ESG 量化先行混合型证券投资基金
基金简称	大摩 ESG 量化混合
基金主代码	009246
交易代码	009246
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 7 月 16 日
基金管理人	摩根士丹利基金管理（中国）有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	243,025,060.59 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过大类资产配置和量化优选的方法，精选符合 ESG 要求的股票进行投资，力争获取超越比较基准的投资回报与长期资本增值。
投资策略	<p>本基金遴选出在 ESG 相关概念指数中起显著解释作用的因子，并按照成熟方法对之进行评价、赋权，以筛选出符合 ESG 要求的股票；从风险和收益的角度出发，构建出互补性较强的多因子模型，按照既定比例进行加权，综合策略适应不同市场。</p> <p>1. 股票投资策略</p> <p>本基金以“量化投资”为主要投资策略，该“量化投资”是运用建立在已为国际市场上广泛应用的多因子阿尔法模型（Multiple Factors Alpha Model）的基础上，根据中国资本市场的实际情况，由本基金管理人的数量化投资团队开发的更具针对性和实用性的修正的多因子阿尔法选股模型。在符合 ESG 要求的股票中通过基金管理人自主开发的多因子阿尔法模型进行股票选择并据此构建股票投资组合。该多因子阿尔法模型在实际运行过程中将定期或不定期地进行修正，优化股票投资组合。</p> <p>2. 资产配置策略</p> <p>本基金实行在管理人投资决策委员会统一指导下的资产配置机制。投资决策委员会定期或针对特定事件临时召开，讨论、确定具体的基金资产未来一段时期内在权益类资产及固定收益类资产之间的配置比例范围，形成资产配置相关决议。基金经理根据投资决策委员会关于资产配置的决议具体执行并实施资产配置方案。</p> <p>数量化投资策略是本基金的主要投资策略，为了有效实施数量化投资策略，本基金将在投资决策委员会关于资产配置决议的允许范围内，采取相对稳定的股票持仓比例控制措施，降低由于股票持仓比例波动过于频繁影响到数量化投资策略的效果。</p> <p>3. 其他金融工具投资策略</p> <p>(1) 债券投资策略</p> <p>管理人通过评估货币政策、财政政策和国际环境等因素，分析市场价格中隐含的对经济增长、通货膨胀、违约概率、提前偿付速度等</p>

	<p>因素的预测，根据债券市场中存在的各种投资机会的相对投资价值和风险决定总体的投资策略及类属（政府、企业/公司、可转换债券等）和期限（短期、中期和长期）等部分的投资比例，并基于价值分析精选投资品种构建债券投资组合。</p> <p>本基金采用的主要债券投资策略包括：利率预期策略、收益率曲线策略、信用利差策略、公司/企业债券策略、可转换债券策略等。</p> <p>（2）股指期货投资策略</p> <p>本基金将以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。</p> <p>（3）资产支持证券投资策略</p> <p>本基金通过对资产支持证券的发行条款、基础资产的构成及质量等基本面研究，结合相关定价模型评估其内在价值，谨慎参与资产支持证券投资。</p>
业绩比较基准	中证中财沪深 100ESG 领先指数收益率*80%+中证综合债券指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其长期平均预期风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

### 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		摩根士丹利基金管理（中国）有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	许菲菲	王小飞
	联系电话	(0755)88318883	021-60637103
	电子邮箱	im-disclosure@morganstanley.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8888-668	021-60637228
传真		(0755)82990384	021-60635778
注册地址		深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第二座第17层01-04室	北京市西城区金融大街25号
办公地址		深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第二座第17层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		518048	100033
法定代表人		王鸿嫔	田国立

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

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼
注册登记机构	摩根士丹利基金管理（中国）有限公司	深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第二座第17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	-40,643,894.11	-103,935,916.87	262,564,165.52
本期利润	-34,061,579.07	-119,137,076.34	102,065,962.98
加权平均基金份额本期利润	-0.1331	-0.3954	0.2438
本期加权平均净值利润率	-15.66%	-39.31%	19.77%
本期基金份额净值增长率	-14.91%	-30.19%	14.12%
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	-57,122,138.94	-26,844,837.78	90,264,091.75
期末可供分配基金份额利润	-0.2350	-0.1010	0.2878
期末基金资产净值	185,902,921.65	238,898,200.23	403,902,672.25
期末基金份额净值	0.7650	0.8990	1.2878
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	-23.50%	-10.10%	28.78%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2. 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，而非当期发生数）；

3. 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，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

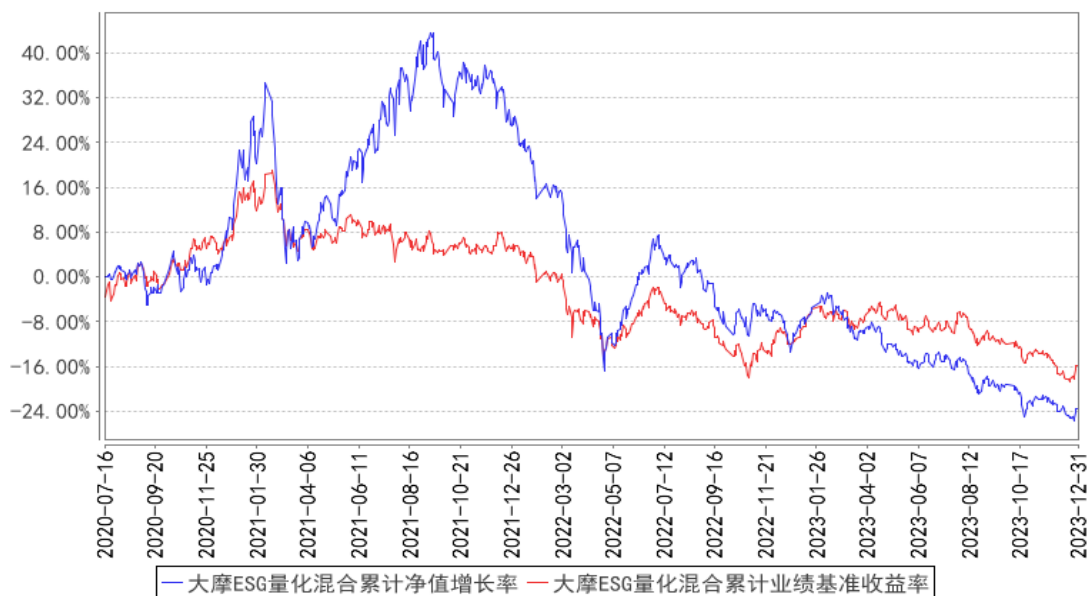
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-5.19%	0.71%	-4.61%	0.58%	-0.58%	0.13%
过去六个月	-11.18%	0.74%	-7.65%	0.66%	-3.53%	0.08%
过去一年	-14.91%	0.76%	-5.47%	0.67%	-9.44%	0.09%
过去三年	-32.21%	1.33%	-23.19%	0.88%	-9.02%	0.45%
自基金合同生效起至今	-23.50%	1.30%	-15.98%	0.89%	-7.52%	0.41%

注：1、本基金基金合同于 2020 年 7 月 16 日正式生效；

2、按照本基金基金合同的规定，基金管理人自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

### 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

大摩ESG量化混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

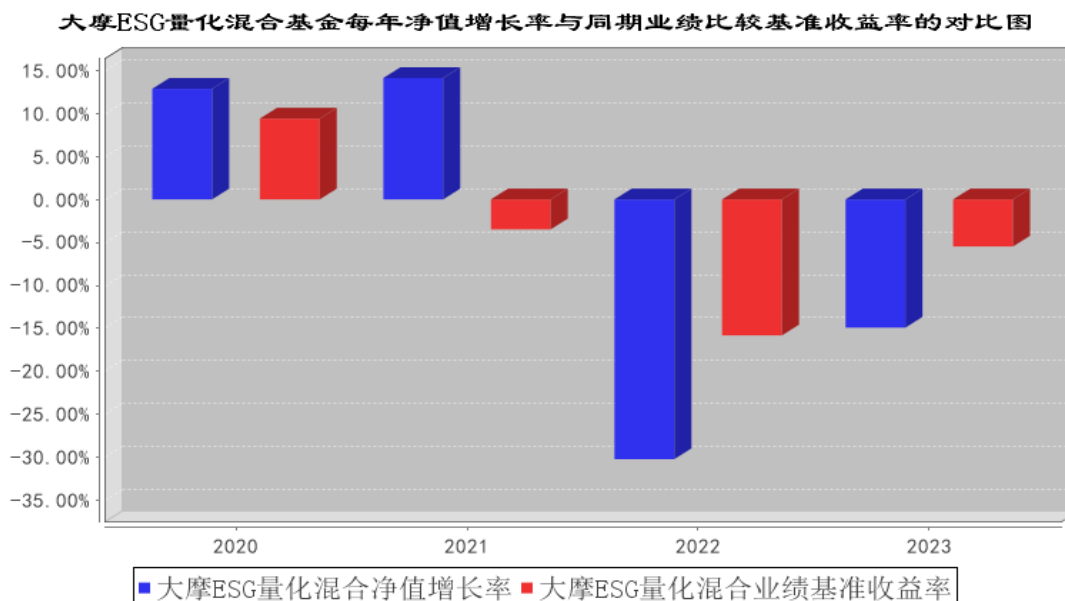


注：1、本基金基金合同于 2020 年 7 月 16 日正式生效；

2、按照本基金基金合同的规定，基金管理人自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。



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



注：本基金基金合同于 2020 年 7 月 16 日正式生效。上述指标在基金合同生效当年按照实际存续期进行计算，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

注：本基金过去三年未发生利润分配。

## § 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

摩根士丹利基金管理（中国）有限公司（以下简称“公司”）是一家外国法人独资基金管理公司，前身为经中国证监会证监基金字[2003]33 号文批准设立并于 2003 年 3 月 14 日成立的巨田基金管理有限公司、摩根士丹利华鑫基金管理有限公司。公司的股东为摩根士丹利国际控股公司。

截至 2023 年 12 月 31 日，公司旗下共管理 35 只公募基金，其中股票型 4 只，混合型 20 只，指数型 1 只，债券型 9 只、基金中基金 1 只。同时，公司还管理着多个私募资产管理计划。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
余斌	数量化投资部总监、基金	2020 年 7 月 16 日	-	16 年	南开大学经济学硕士，金融风险管理师（FRM）。曾任招商证券股份有限公司风险管理部风险分析师、鹏华基金管理有限公司

	经理				司量化及衍生品投资部基金经理。2019 年 5 月加入本公司，现任数量化投资部总监、基金经理。2019 年 8 月起担任摩根士丹利深证 300 指数增强型证券投资基金、摩根士丹利量化多策略股票型证券投资基金、摩根士丹利多因子精选策略混合型证券投资基金基金经理，2020 年 7 月起担任摩根士丹利 ESG 量化先行混合型证券投资基金基金经理，2020 年 7 月至 2023 年 4 月担任摩根士丹利华鑫 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金经理，2023 年 12 月起担任摩根士丹利量化配置混合型证券投资基金基金经理。
--	----	--	--	--	---

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期；非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；基金的基金经理助理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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

报告期内，基金管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在认真控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

## 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

基金管理人遵照《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，制定了《摩根士丹利基金管理（中国）有限公司公平交易管理办法》、《摩根士丹利基金管理（中国）有限公司异常交易管理办法》、《摩根士丹利基金管理（中国）有限公司公平交易分析报告实施细则》等内部制度，形成较为完备的公平交易制度及异常交易分析体系。

基金管理人的公平交易管理涵盖了所管理的所有投资组合，管理的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时也包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资管理活动相关的各个环节。基金管理人通过投资交易以及其他相关系统实现了有效系统控制，通过投资交易行为的监控、异常交易的识别与分析、公平交易的分析与报告等方式实现了有效的人工控制，并通过定期及不定期的回顾不断完善相关制度及流程，实

现公平交易管理控制目标。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及内部相关制度和流程，通过流程和系统控制保证有效实现公平交易管理要求，并通过对投资交易行为的监控和分析，确保基金管理人旗下各投资组合在研究、决策、交易执行等各方面均得到公平对待。本报告期，基金管理人严格执行各项公平交易制度及流程。

经对报告期内公司管理所有投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异，连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现异常情况。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金管理人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% 的情况有 3 次，为量化投资基金因执行投资策略与其他组合发生的反向交易。基金管理人未发现其他异常交易行为。

## 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 股市场仍然呈现结构分化的行情特点。分化程度可以简单采用个股区间收益的离散程度来表示。离散程度越大，理论上量化策略获得的超额收益也越高。在报告期内，研究和投资团队针对有利的市场环境，不断优化模型，使得量化模型对个股预期回报做出更加合理和稳定的预测，并据此构建持仓分散、风险优化的投资组合。

报告期内，本基金仍然坚持将 ESG 投资理念与量化方法相结合。ESG 投资在我国方兴未艾。ESG 不仅是一种独特的投资视角，也是严格而规范的投资标准。立足当下，着眼未来，我们相信践行 ESG 投资理念、坚持成熟投资理念和先进的量化投资方法能够让我们更有信心迎接未来更大的机遇和挑战。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期截至 2023 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.7650 元，累计份额净值为 0.7650 元，基金份额净值增长率为-14.91%，同期业绩比较基准收益率为-5.47%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前，我国面临着经济结构转型进而实现高质量发展的重大历史课题。在经济转型的同时，我国也面对着国际政治环境的急剧变化、传统产业的有序退出、债务水平的优化与调降、人口老龄化和少子化等一系列重大挑战，其中属债务问题为重中之重。经济结构转型任重而道远，债务

优化牵一发而动全身，客观环境要求我们不得不稳字当头，稳定才能为经济转型创造更好的发展条件，为解决债务问题争取更多有利的时机选择。

尽管我国市场资产价格呈现一定程度的波动，但是宏观经济持续稳定向好。新能源汽车、高端消费电子产品、操作系统、智能制造等领域不断取得突破，无疑将持续增强我国在制造业领域的原有优势。当今世界面临百年未有之大变局，新一轮技术变革在即，原有产业体系将面临极大的调整，新业态和新商业模式将可能异军突起，产业投资逻辑和资产市场定价机制也将发生系统性重估。寻找在新发展阶段具有更强适应能力和定价能力的上市公司是投资管理过程中最大的挑战。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期，基金管理人在完善内部控制制度的同时，通过开展日常监控、例行检查、专项检查等方式，检查内控制度的执行情况、基金运作的合法合规情况，及时发现问题，形成改进方案并跟踪落实。

本报告期，基金管理人完成的主要监察稽核工作如下：

(1) 开展专项检查工作。专项检查范围覆盖投资研究交易、基金销售、基金运营等方面。同时，开展合规管理有效性评估、新法规落实情况自查、网络和信息安全自查、资管产品统计工作自查等监管机构要求的自查工作。

(2) 做好日常监控工作。通过监控基金投资运作、优化关键业务流程、审核宣传推介材料、监督后台运营业务等工作，加强日常风险监控，规范基金投资、销售以及运营等各项业务管理，保障公司和基金运作合法合规。

(3) 通过制度定期回顾机制持续完善公司内控制度体系。同时，适时解读监管政策与要求，组织落实投资运作管理、网络和信息安全、人员管理、绩效考核与薪酬管理、声誉风险管理等法律法规和自律规则的相关要求。基金管理人已建立起覆盖公司业务各个方面的内控制度体系，保障公司合规、安全、高效运营。

(4) 加强员工合规行为管理。根据法律法规和业务环境的变化不断修订、充实培训材料并组织开展培训工作，进一步提升员工风控意识及合规意识。

(5) 加强新产品和新业务的风险管理。组织对新产品、新业务的合规性进行评估，保障新产品和新业务合规落地。

2024 年，基金管理人将继续本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，加强风险控制，保障公司和基金的合法合规运作，保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，则及时就所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见。

本基金管理人设有基金估值委员会，委员会由主任委员（基金运营部的业务条线负责人）以及相关成员（包括研究管理部负责人、固定收益投资部信用研究员、基金运营部负责人、基金会计、风险管理部及监察稽核部相关业务人员）构成。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会的相关人员均具有一定年限的专业从业经验，具有良好的专业能力，并能在相关工作中保持独立性。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和估值方法的最终决策和日常估值的执行。

由于基金经理、相关投资研究人员对特定投资品种的估值有深入的理解，经估值委员会主任委员同意，在需要时可以列席估值委员会会议并提出估值建议，估值委员会对特定品种估值方法需经委员充分讨论后确定。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、基金合同的相关规定以及本基金的实际运作情况，本基金本报告期未实施利润分配。

#### 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，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

## 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

本托管人复核审查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。

# § 6 审计报告

## 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第 26150 号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	摩根士丹利 ESG 量化先行混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了摩根士丹利 ESG 量化先行混合型证券投资基金(以下简称“摩根士丹利 ESG 量化先行基金”)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变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>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，公允反映了摩根士丹利 ESG 量化先行基金 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。</p>
形成审计意见的基础	<p>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。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于摩根士丹利 ESG 量化先行基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	摩根士丹利 ESG 量化先行基金的基金管理人摩根士丹利基金

	<p>管理(中国)有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括摩根士丹利 ESG 量化先行基金 2023 年年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已经执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>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。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估摩根士丹利 ESG 量化先行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士丹利 ESG 量化先行基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督摩根士丹利 ESG 量化先行基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>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。</p> <p>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:</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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,就可能对导致对摩根士</p>

	<p>丹利 ESG 量化先行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士丹利 ESG 量化先行基金不能持续经营。</p> <p>(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。</p> <p>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。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	魏佳亮 仲文渊
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2024 年 03 月 27 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：摩根士丹利 ESG 量化先行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
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	13,325,785.48	16,032,494.16
结算备付金		504,942.85	705,311.52
存出保证金		19,479.89	91,617.24
交易性金融资产	7.4.7.2	172,079,784.44	221,068,563.62
其中：股票投资		172,079,784.44	220,129,889.17
基金投资		-	-
债券投资		-	938,674.45
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	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-



其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		1,214,868.12	2,347,173.29
应收股利		-	-
应收申购款		11,296.35	74,946.69
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		187,156,157.13	240,320,106.52
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年12月31日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债:</b>			
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		-	-
应付赎回款		546,876.12	167,098.30
应付管理人报酬		188,627.87	337,427.11
应付托管费		31,437.99	56,237.86
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		15.41	4.92
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	486,278.09	861,138.10
负债合计		1,253,235.48	1,421,906.29
<b>净资产:</b>			
实收基金	7.4.7.7	243,025,060.59	265,743,038.01
未分配利润	7.4.7.8	-57,122,138.94	-26,844,837.78
净资产合计		185,902,921.65	238,898,200.23
负债和净资产总计		187,156,157.13	240,320,106.52

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.7650 元，基金份额总额 243,025,060.59 份。

## 7.2 利润表

会计主体：摩根士丹利 ESG 量化先行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 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
一、营业总收入		-30,184,059.07	-113,621,623.58

1. 利息收入		80,753.33	135,620.89
其中：存款利息收入	7.4.7.9	80,753.33	135,620.89
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）		-36,869,519.88	-98,638,347.35
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-40,427,130.04	-102,855,515.20
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	179,700.26	337,824.56
资产支持证券投资	7.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	3,377,909.90	3,879,343.29
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	6,582,315.04	-15,201,159.47
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	22,392.44	82,262.35
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>3,877,520.00</b>	<b>5,515,452.76</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,153,069.05	4,556,883.32
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	525,511.54	759,480.54
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	7.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		9.41	3.90
8. 其他费用	7.4.7.19	198,930.00	199,085.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-34,061,579.07</b>	<b>-119,137,076.34</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-34,061,579.07</b>	<b>-119,137,076.34</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>

六、综合收益总额		-34,061,579.07	-119,137,076.34
----------	--	----------------	-----------------

### 7.3 净资产变动表

会计主体：摩根士丹利 ESG 量化先行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	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	265,743,038.01	-	-26,844,837.78	238,898,200.23
二、本期期初净资产	265,743,038.01	-	-26,844,837.78	238,898,200.23
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-22,717,977.42	-	-30,277,301.16	-52,995,278.58
(一)、综合收益总额	-	-	-34,061,579.07	-34,061,579.07
(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)	-22,717,977.42	-	3,784,277.91	-18,933,699.51
其中：1. 基金申购款	19,955,252.02	-	-2,689,370.91	17,265,881.11
2. 基金赎回款	-42,673,229.44	-	6,473,648.82	-36,199,580.62
(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	243,025,060.59	-	-57,122,138.94	185,902,921.65
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	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	313,638,580.50	-	90,264,091.75	403,902,672.25
二、本期期初净资产	313,638,580.50	-	90,264,091.75	403,902,672.25
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-47,895,542.49	-	-117,108,929.5	-165,004,472.02

号填列)			3	
(一)、综合收益总额	-	-	-119,137,076.34	-119,137,076.34
(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)	-47,895,542.49	-	2,028,146.81	-45,867,395.68
其中：1. 基金申购款	48,570,179.73	-	1,539,333.15	50,109,512.88
2. 基金赎回款	-96,465,722.22	-	488,813.66	-95,976,908.56
(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	265,743,038.01	-	-26,844,837.78	238,898,200.23

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

王鸿斌

贺草

杜志强

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

摩根士丹利 ESG 量化先行混合型证券投资基金(原名为“摩根士丹利华鑫 ESG 量化先行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[2020]第 445 号《关于准予摩根士丹利华鑫 ESG 量化先行混合型证券投资基金注册的批复》核准，由摩根士丹利基金管理(中国)有限公司(原摩根士丹利华鑫基金管理有限公司，已于 2023 年 6 月 1 日办理完成股权及相应董事变更的工商变更登记，于 2023 年 6 月 2 日办理完成名称的相关工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《摩根士丹利华鑫 ESG 量化先行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 2,225,232,661.56 元，业经普华永道中天会计师事务

所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第 0600 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《摩根士丹利华鑫 ESG 量化先行混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 7 月 16 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,225,819,599.15 份基金份额,其中认购资金利息折合 586,937.59 份基金份额。本基金的基金管理人为摩根士丹利基金管理(中国)有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据基金管理人于 2023 年 6 月 8 日发布的《摩根士丹利基金管理(中国)有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》,自 2023 年 6 月 8 日起,摩根士丹利华鑫 ESG 量化先行混合型证券投资基金更名为摩根士丹利 ESG 量化先行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《摩根士丹利 ESG 量化先行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,包括国内依法上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、次级债、短期融资券、超短期融资券、中期票据及其他中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款、股指期货、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资组合范围为:股票资产占基金资产的比例范围为 60%-95%,投资于符合 ESG 要求的上市公司证券的资产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合约需缴纳的保证金后,本基金持有现金或到期日在一年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。股指期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金的业绩比较基准为:中证中财沪深 100ESG 领先指数收益率\*80%+中证综合债券指数收益率\*20%。

本财务报表由本基金的基金管理人摩根士丹利基金管理(中国)有限公司于 2024 年 3 月 27 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》、本基金基金合同和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 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。

#### (3) 衍生金融工具

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

### 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、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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



#### 7.4.4.7 实收基金

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

票投资和债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。

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。

##### 7.4.5.2 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 2023年12月31日		上年度末 2022年12月31日	
	活期存款	13,325,785.48		16,032,494.16
等于：本金	13,324,371.93		16,030,090.66	
加：应计利息	1,413.55		2,403.50	
减：坏账准备	-		-	
定期存款	-		-	
等于：本金	-		-	
加：应计利息	-		-	
减：坏账准备	-		-	
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	-		-	
减：坏账准备	-		-	
合计	13,325,785.48		16,032,494.16	

## 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	177,371,520.84	-	172,079,784.44	-5,291,736.40
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	177,371,520.84	-	172,079,784.44	-5,291,736.40
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	232,097,130.77	-	220,129,889.17	-11,967,241.60
贵金属投资-金交所	-	-	-	-

黄金合约					
债券	交易所市场	845,200.00	284.29	938,674.45	93,190.16
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	845,200.00	284.29	938,674.45	93,190.16
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		232,942,330.77	284.29	221,068,563.62	-11,874,051.44

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.6 其他负债

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
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	49.29	92.55
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	301,728.80	676,545.55
其中：交易所市场	301,728.80	676,545.55
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	184,500.00	184,500.00
合计	486,278.09	861,138.10

#### 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	265,743,038.01	265,743,038.01
本期申购	19,955,252.02	19,955,252.02
本期赎回（以“-”号填列）	-42,673,229.44	-42,673,229.44
基金拆分/份额折算前	-	-

基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	243,025,060.59	243,025,060.59

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

目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	72,483,757.51	-99,328,595.29	-26,844,837.78
本期期初	72,483,757.51	-99,328,595.29	-26,844,837.78
本期利润	-40,643,894.11	6,582,315.04	-34,061,579.07
本期基金份额交易产生的变动数	-4,030,459.81	7,814,737.72	3,784,277.91
其中：基金申购款	4,109,799.35	-6,799,170.26	-2,689,370.91
基金赎回款	-8,140,259.16	14,613,907.98	6,473,648.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	27,809,403.59	-84,931,542.53	-57,122,138.94

#### 7.4.7.9 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
活期存款利息收入	59,274.54	103,622.05
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	20,496.46	29,767.79
其他	982.33	2,231.05
合计	80,753.33	135,620.89

#### 7.4.7.10 股票投资收益

##### 7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-40,427,130.04	-102,855,515.20
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-40,427,130.04	-102,855,515.20

##### 7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 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
卖出股票成交总额	1,730,754,728.14	2,463,082,106.20
减：卖出股票成本总额	1,766,833,269.80	2,559,479,786.13
减：交易费用	4,348,588.38	6,457,835.27
买卖股票差价收入	-40,427,130.04	-102,855,515.20

#### 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 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
债券投资收益——利息收入	2,867.10	1,154.42



债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	176,833.16	336,670.14
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	179,700.26	337,824.56

#### 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 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
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,095,598.19	1,635,763.90
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	918,000.00	1,297,900.00
减：应计利息总额	721.23	1,147.42
减：交易费用	43.80	46.34
买卖债券差价收入	176,833.16	336,670.14

#### 7.4.7.12 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.13 贵金属投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

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
股票投资产生的股利收益	3,377,909.90	3,879,343.29
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	3,377,909.90	3,879,343.29

## 7.4.7.16 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 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
1. 交易性金融资产	6,582,315.04	-15,201,159.47
股票投资	6,675,505.20	-14,975,908.83
债券投资	-93,190.16	-225,250.64
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	6,582,315.04	-15,201,159.47

## 7.4.7.17 其他收入

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
基金赎回费收入	22,358.83	80,724.68
基金转换费收入	33.61	1,537.67
合计	22,392.44	82,262.35

## 7.4.7.18 信用减值损失

注：本基金本报告期及上年度可比期间无信用减值损失。

## 7.4.7.19 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	60,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	930.00	1,085.00
债券账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	198,930.00	199,085.00

## 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
摩根士丹利基金管理（中国）有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
摩根士丹利国际控股公司	基金管理人的股东

注：于 2023 年 7 月 18 日，基金管理人公告公司股权变更交割手续办理完毕，由摩根士丹利国际控股公司依法受让原股东华鑫证券有限责任公司与深圳基石创业投资有限公司 51% 股权，Morgan Stanley 成为实际控制人。华鑫证券有限责任公司与深圳基石创业投资有限公司自 2023 年 7 月 18 日起不再作为本基金关联方。

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 7 月 17 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
华鑫证券	3,593,527.00	0.14	117,796,352.75	2.42

#### 7.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 7 月 17 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
华鑫证券	2,627.91	0.14	0.00	0.00

关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
华鑫证券	86,147.48	2.42	41,959.77	6.20

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 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	3,153,069.05	4,556,883.32
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,396,365.26	1,824,750.83
应支付基金管理人的净管理费	1,756,703.79	2,732,132.49

注：自2020年7月16日至2023年10月15日，支付基金管理人摩根士丹利基金管理(中国)有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%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×1.50%/当年天数。

根据《关于摩根士丹利 ESG 量化先行混合型证券投资基金下调基金管理费率和基金托管费率并相应修改基金合同、托管协议的公告》，自2023年10月16日起，支付基金管理人摩根士丹利基金管理(中国)有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.20%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×1.20%/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
当期发生的基金应支付的托管费	525,511.54	759,480.54

注：自2020年7月16日至2023年10月15日，支付基金托管人中国建设银行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×0.25%/当年天数。

根据《关于摩根士丹利 ESG 量化先行混合型证券投资基金下调基金管理费率和基金托管费率并相应修改基金合同、托管协议的公告》，自 2023 年 10 月 16 日起，支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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×0.20%/当年天数。

#### 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

注：本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 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

注：本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行证券出借业务。

#### 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

注：本基金本报告期及上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

##### 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

注：本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	13,325,785.48	59,274.54	16,032,494.16	103,622.05

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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

注：本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期无利润分配事项。

## 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

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

### 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

注：本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金。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市场风险、流动性风险及信用风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，通过大类资产配置和量化优选的方法，精选符合 ESG 要求的股票进行投资，力争获取超额收益与长期资本增值。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任，其下设的风险控制和审计委员会负责制定风险管理政策，检查公司和基金运作的合法合规情况；公司经营层对内部控制制度的有效执行承担责任，其下设的风险管理委员会负责讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；督察长监督检查基金和公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况；监察稽核部、风险管理部分工负责风险监督与控制，前者负责合规风险管理，后者主要负责操作风险和基金投资的信用风险、市场风险以及流动性风险的监督管理；基金经理、投资总监以及投资决策委员会负责对基金投资业务风险进行直接管理。

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。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建设银行，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，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券（2022 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例为 0.39%）。

#### 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 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上市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% (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该比例限制)，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%。

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，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例未超过 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。于 2023 年 12 月 31 日，本基金最近工作日确认的净赎回金额未超过组合资产中 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。

#### 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、存出保证金及债券投资等。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
货币资金	13,325,785.48	-	-	-	13,325,785.48
结算备付金	504,942.85	-	-	-	504,942.85
存出保证金	19,479.89	-	-	-	19,479.89
交易性金融资产	-	-	-	172,079,784.44	172,079,784.44
应收申购款	-	-	-	11,296.35	11,296.35
应收清算款	-	-	-	1,214,868.12	1,214,868.12
资产总计	13,850,208.22	-	-	173,305,948.91	187,156,157.13
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	546,876.12	546,876.12
应付管理人报酬	-	-	-	188,627.87	188,627.87
应付托管费	-	-	-	31,437.99	31,437.99
应交税费	-	-	-	15.41	15.41
其他负债	-	-	-	486,278.09	486,278.09
负债总计	-	-	-	1,253,235.48	1,253,235.48
利率敏感度缺口	13,850,208.22	-	-	-172,052,713.43	185,902,921.65
<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>					
<b>资产</b>					
货币资金	16,032,494.16	-	-	-	16,032,494.16
结算备付金	705,311.52	-	-	-	705,311.52
存出保证金	91,617.24	-	-	-	91,617.24
交易性金融资产	-	-	938,674.45	220,129,889.17	221,068,563.62
应收申购款	-	-	-	74,946.69	74,946.69
应收清算款	-	-	-	2,347,173.29	2,347,173.29
资产总计	16,829,422.92	-	938,674.45	222,552,009.15	240,320,106.52
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	167,098.30	167,098.30
应付管理人报酬	-	-	-	337,427.11	337,427.11
应付托管费	-	-	-	56,237.86	56,237.86

应交税费	-	-	-	4.92	4.92
其他负债	-	-	-	861,138.10	861,138.10
负债总计	-	-	-	1,421,906.29	1,421,906.29
利率敏感度缺口	16,829,422.92	-	938,674.45	221,130,102.86	238,898,200.23

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资（2022 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券投资公允价值占基金净资产的比例为 0.39%），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，结合定性分析和定量分析方法的结论，以实现大类资产的动态配置。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的证券不得超过该证券的 10%。此外，本基金的基金管理人日常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、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	172,079,784.44	92.56	220,129,889.17	92.14

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	172,079,784.44	92.56	220,129,889.17	92.14

#### 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:人民币元)	
		对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		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%	8,030,000.00	11,700,000.00
	业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-8,030,000.00	-11,700,000.00

#### 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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	172,079,784.44	220,343,024.97

第二层次	-	552,793.04
第三层次	-	172,745.61
合计	172,079,784.44	221,068,563.62

#### 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	-	172,745.61	172,745.61
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	204,135.19	204,135.19
转出第三层次	-	413,747.39	413,747.39
当期利得或损失总额	-	36,866.59	36,866.59
其中：计入损益的利得或损失	-	36,866.59	36,866.59
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
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	-	4,122,276.06	4,122,276.06
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,393,546.83	1,393,546.83
转出第三层次	-	5,393,530.75	5,393,530.75
当期利得或损失总额	-	50,453.47	50,453.47
其中：计入损益的利得或损失	-	50,453.47	50,453.47
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	172,745.61	172,745.61
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	-	26,747.10	26,747.10

注：

## 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	-	平均价格亚式期权模型	预期波动率	-	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	172,745.61	平均价格亚式期权模型	预期波动率	23.19%-165%	负相关

## 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工具(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	172,079,784.44	91.94
	其中：股票	172,079,784.44	91.94
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	13,830,728.33	7.39
8	其他各项资产	1,245,644.36	0.67
9	合计	187,156,157.13	100.00

### 8.2 报告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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	407,443.00	0.22
B	采矿业	10,066,027.00	5.41
C	制造业	115,672,210.84	62.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,264,695.00	2.29
E	建筑业	2,912,636.80	1.57
F	批发和零售业	3,529,801.40	1.90
G	交通运输、仓储和邮政业	5,782,971.00	3.11
H	住宿和餐饮业	238,668.00	0.13
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,613,463.40	7.32
J	金融业	8,407,066.00	4.52
K	房地产业	496,148.00	0.27

L	租赁和商务服务业	1,152,136.00	0.62
M	科学研究和技术服务业	1,670,847.00	0.90
N	水利、环境和公共设施管理业	1,151,780.00	0.62
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	720,885.00	0.39
Q	卫生和社会工作	619,106.00	0.33
R	文化、体育和娱乐业	1,373,900.00	0.74
S	综合	-	-
	合计	172,079,784.44	92.56

### 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	3,000	5,178,000.00	2.79
2	300750	宁德时代	14,260	2,328,087.60	1.25
3	002475	立讯精密	56,700	1,953,315.00	1.05
4	601857	中国石油	276,500	1,952,090.00	1.05
5	600941	中国移动	18,600	1,850,328.00	1.00
6	600285	羚锐制药	100,500	1,719,555.00	0.92
7	300760	迈瑞医疗	5,700	1,656,420.00	0.89
8	000333	美的集团	28,900	1,578,807.00	0.85
9	600557	康缘药业	74,600	1,530,792.00	0.82
10	600329	达仁堂	44,800	1,507,520.00	0.81
11	600900	长江电力	62,500	1,458,750.00	0.78
12	600436	片仔癀	5,900	1,427,741.00	0.77
13	600845	宝信软件	28,200	1,376,160.00	0.74
14	000568	泸州老窖	7,600	1,363,592.00	0.73
15	000063	中兴通讯	44,600	1,181,008.00	0.64
16	600028	中国石化	211,300	1,179,054.00	0.63
17	002027	分众传媒	182,300	1,152,136.00	0.62
18	300723	一品红	38,500	1,148,455.00	0.62
19	600938	中国海油	53,700	1,126,089.00	0.61
20	601006	大秦铁路	145,800	1,051,218.00	0.57
21	601668	中国建筑	218,200	1,049,542.00	0.56
22	000725	京东方 A	262,300	1,022,970.00	0.55
23	600919	江苏银行	151,400	1,012,866.00	0.54
24	601126	四方股份	70,000	991,200.00	0.53
25	000408	藏格矿业	38,200	967,988.00	0.52
26	603556	海兴电力	33,200	963,796.00	0.52
27	601567	三星医疗	47,000	963,500.00	0.52
28	000858	五粮液	6,800	954,108.00	0.51
29	688111	金山办公	2,997	947,651.40	0.51
30	601318	中国平安	23,300	938,990.00	0.51

31	603259	药明康德	12,900	938,604.00	0.50
32	600373	中文传媒	70,200	925,236.00	0.50
33	002270	华明装备	65,000	917,800.00	0.49
34	002304	洋河股份	8,300	912,170.00	0.49
35	600535	天士力	53,400	908,868.00	0.49
36	600660	福耀玻璃	24,000	897,360.00	0.48
37	601728	中国电信	165,800	896,978.00	0.48
38	600066	宇通客车	67,500	894,375.00	0.48
39	601377	兴业证券	146,600	860,542.00	0.46
40	002833	弘亚数控	48,100	853,294.00	0.46
41	600755	厦门国贸	121,300	845,461.00	0.45
42	600183	生益科技	45,900	840,429.00	0.45
43	002603	以岭药业	36,400	839,748.00	0.45
44	600276	恒瑞医药	18,500	836,755.00	0.45
45	600582	天地科技	151,800	825,792.00	0.44
46	601138	工业富联	54,000	816,480.00	0.44
47	000423	东阿阿胶	16,500	813,780.00	0.44
48	002815	崇达技术	84,800	812,384.00	0.44
49	000513	丽珠集团	23,200	812,232.00	0.44
50	002545	东方铁塔	112,700	805,805.00	0.43
50	601717	郑煤机	63,700	805,805.00	0.43
51	002415	海康威视	22,900	795,088.00	0.43
52	600377	宁沪高速	77,500	794,375.00	0.43
53	600033	福建高速	250,400	776,240.00	0.42
54	000895	双汇发展	28,800	769,248.00	0.41
55	002938	鹏鼎控股	34,300	765,576.00	0.41
56	600750	江中药业	36,300	757,944.00	0.41
57	603279	景津装备	34,200	756,162.00	0.41
58	002372	伟星新材	52,000	752,440.00	0.40
59	600406	国电南瑞	33,700	752,184.00	0.40
60	601168	西部矿业	52,700	752,029.00	0.40
61	601222	林洋能源	117,600	751,464.00	0.40
62	601877	正泰电器	34,900	750,699.00	0.40
63	603920	世运电路	40,600	742,168.00	0.40
64	002533	金杯电工	91,500	739,320.00	0.40
65	601766	中国中车	140,400	738,504.00	0.40
66	601211	国泰君安	48,900	727,632.00	0.39
67	600050	中国联通	165,000	722,700.00	0.39
68	605098	行动教育	18,700	720,885.00	0.39
69	000651	格力电器	22,300	717,391.00	0.39
70	600438	通威股份	28,200	705,846.00	0.38
71	601899	紫金矿业	55,700	694,022.00	0.37
72	601919	中远海控	72,400	693,592.00	0.37



73	000538	云南白药	14,100	693,015.00	0.37
74	601699	潞安环能	31,600	692,356.00	0.37
75	300532	今天国际	42,100	691,282.00	0.37
76	605009	豪悦护理	17,700	675,609.00	0.36
77	000429	粤高速 A	78,800	666,648.00	0.36
78	600210	紫江企业	140,400	659,880.00	0.35
79	002558	巨人网络	59,100	658,374.00	0.35
80	600398	海澜之家	88,600	657,412.00	0.35
81	603328	依顿电子	80,600	656,890.00	0.35
82	002422	科伦药业	22,600	656,530.00	0.35
83	603688	石英股份	7,500	651,600.00	0.35
84	603757	大元泵业	26,000	630,240.00	0.34
85	603228	景旺电子	27,900	629,424.00	0.34
86	600089	特变电工	44,800	618,240.00	0.33
87	002191	劲嘉股份	115,000	617,550.00	0.33
88	000090	天健集团	133,700	615,020.00	0.33
89	600737	中粮糖业	74,500	613,880.00	0.33
90	601369	陕鼓动力	76,500	610,470.00	0.33
91	002595	豪迈科技	20,500	610,285.00	0.33
92	600566	济川药业	19,400	609,742.00	0.33
93	601225	陕西煤业	29,100	607,899.00	0.33
94	000157	中联重科	93,000	607,290.00	0.33
95	000830	鲁西化工	59,800	599,794.00	0.32
96	600655	豫园股份	96,300	598,023.00	0.32
97	601216	君正集团	155,500	581,570.00	0.31
98	601985	中国核电	77,400	580,500.00	0.31
99	600585	海螺水泥	25,500	575,280.00	0.31
100	600497	驰宏锌锗	113,800	574,690.00	0.31
101	601000	唐山港	164,000	574,000.00	0.31
102	603639	海利尔	36,300	569,910.00	0.31
103	688169	石头科技	2,000	565,900.00	0.30
104	002128	电投能源	39,600	565,092.00	0.30
105	000783	长江证券	102,900	553,602.00	0.30
106	000878	云南铜业	50,700	552,123.00	0.30
107	600039	四川路桥	72,120	540,178.80	0.29
108	601607	上海医药	32,200	538,706.00	0.29
109	603360	百傲化学	50,800	536,956.00	0.29
110	688777	中控技术	11,800	535,130.00	0.29
111	603599	广信股份	36,780	533,310.00	0.29
112	600150	中国船舶	18,100	532,864.00	0.29
113	601688	华泰证券	37,800	527,310.00	0.28
114	002158	汉钟精机	23,600	525,336.00	0.28
115	002916	深南电路	7,400	525,326.00	0.28

116	002179	中航光电	13,400	522,600.00	0.28
117	603387	基蛋生物	47,400	521,400.00	0.28
118	688200	华峰测控	4,200	515,760.00	0.28
119	301389	隆扬电子	26,300	501,804.00	0.27
120	688036	传音控股	3,600	498,240.00	0.27
121	300866	安克创新	5,600	496,160.00	0.27
122	300741	华宝股份	23,000	492,430.00	0.26
123	600873	梅花生物	51,500	491,825.00	0.26
124	601058	赛轮轮胎	41,600	488,800.00	0.26
125	600887	伊利股份	18,000	481,500.00	0.26
126	600674	川投能源	31,800	480,816.00	0.26
127	002001	新和成	27,800	471,488.00	0.25
128	002030	达安基因	48,200	466,576.00	0.25
129	688617	惠泰医疗	1,200	466,200.00	0.25
130	002206	海利得	90,900	456,318.00	0.25
131	600867	通化东宝	41,200	446,196.00	0.24
132	000708	中信特钢	31,200	438,048.00	0.24
133	002138	顺络电子	16,000	432,160.00	0.23
134	603367	辰欣药业	29,300	428,952.00	0.23
135	603345	安井食品	4,100	428,901.00	0.23
136	000848	承德露露	54,200	425,470.00	0.23
137	000596	古井贡酒	1,800	419,040.00	0.23
138	601288	农业银行	114,100	415,324.00	0.22
139	600809	山西汾酒	1,800	415,314.00	0.22
140	000738	航发控制	20,800	413,920.00	0.22
141	601328	交通银行	71,400	409,836.00	0.22
142	600012	皖通高速	36,800	405,536.00	0.22
143	002737	葵花药业	15,600	405,288.00	0.22
144	601666	平煤股份	35,000	404,600.00	0.22
145	601088	中国神华	12,900	404,415.00	0.22
146	603301	振德医疗	16,500	404,250.00	0.22
147	603551	奥普家居	37,800	400,302.00	0.22
148	000338	潍柴动力	29,000	395,850.00	0.21
149	301103	何氏眼科	13,200	395,736.00	0.21
150	300856	科思股份	6,200	385,826.00	0.21
151	601825	沪农商行	67,200	385,728.00	0.21
152	688009	中国通号	87,600	383,688.00	0.21
153	601388	怡球资源	144,600	378,852.00	0.20
154	600236	桂冠电力	68,200	377,828.00	0.20
155	002091	江苏国泰	48,200	377,406.00	0.20
156	600967	内蒙一机	45,600	376,656.00	0.20
157	600176	中国巨石	38,300	376,489.00	0.20
158	600177	雅戈尔	57,300	375,315.00	0.20

159	601689	拓普集团	5,100	374,850.00	0.20
160	688303	大全能源	12,600	372,582.00	0.20
161	300408	三环集团	12,600	371,070.00	0.20
162	300468	四方精创	33,900	367,815.00	0.20
163	603529	爱玛科技	14,600	365,584.00	0.20
164	000733	振华科技	6,200	364,808.00	0.20
165	300308	中际旭创	3,200	361,312.00	0.19
166	002065	东华软件	58,000	357,860.00	0.19
167	002517	恺英网络	32,000	357,440.00	0.19
168	002832	比音勒芬	11,100	351,870.00	0.19
169	600760	中航沈飞	8,200	345,876.00	0.19
170	002049	紫光国微	5,100	343,995.00	0.19
171	600211	西藏药业	6,900	336,720.00	0.18
172	300433	蓝思科技	25,100	331,320.00	0.18
173	600985	淮北矿业	19,800	329,274.00	0.18
174	688106	金宏气体	13,600	327,624.00	0.18
175	603338	浙江鼎力	6,400	327,488.00	0.18
176	600060	海信视像	15,500	323,950.00	0.17
177	688626	翔宇医疗	5,800	309,082.00	0.17
178	002543	万和电气	34,300	305,956.00	0.16
179	600027	华电国际	59,500	305,830.00	0.16
180	002690	美亚光电	15,500	304,420.00	0.16
181	605368	蓝天燃气	28,100	302,637.00	0.16
182	000786	北新建材	12,900	301,344.00	0.16
183	600888	新疆众和	41,600	301,184.00	0.16
184	601568	北元集团	63,500	300,990.00	0.16
185	002706	良信股份	33,900	299,337.00	0.16
186	000636	风华高科	21,800	297,788.00	0.16
187	002283	天润工业	50,900	297,765.00	0.16
188	002600	领益智造	44,000	297,440.00	0.16
189	603444	吉比特	1,200	294,144.00	0.16
190	600577	精达股份	71,000	293,940.00	0.16
191	600161	天坛生物	9,500	293,930.00	0.16
192	002025	航天电器	6,100	292,922.00	0.16
193	601169	北京银行	64,300	291,279.00	0.16
194	601678	滨化股份	68,800	289,648.00	0.16
195	002033	丽江股份	35,500	287,195.00	0.15
196	601238	广汽集团	32,800	287,000.00	0.15
197	600741	华域汽车	17,600	286,528.00	0.15
198	601958	金钼股份	30,300	286,335.00	0.15
199	600999	招商证券	20,900	285,076.00	0.15
200	300296	利亚德	47,100	282,600.00	0.15
201	300782	卓胜微	2,000	282,000.00	0.15

202	603927	中科软	9,400	281,812.00	0.15
203	603299	苏盐井神	33,000	281,160.00	0.15
204	002152	广电运通	22,900	280,754.00	0.15
205	600282	南钢股份	75,800	280,460.00	0.15
206	000002	万科A	26,800	280,328.00	0.15
207	601009	南京银行	37,700	278,226.00	0.15
208	601231	环旭电子	18,400	278,024.00	0.15
209	600998	九州通	39,440	276,474.40	0.15
210	688589	力合微	6,900	275,379.00	0.15
211	600795	国电电力	64,800	269,568.00	0.15
212	688699	明微电子	6,600	266,310.00	0.14
213	300623	捷捷微电	16,700	265,029.00	0.14
214	688209	英集芯	14,800	264,328.00	0.14
215	002236	大华股份	14,200	261,990.00	0.14
216	002469	三维化学	42,200	255,732.00	0.14
217	000933	神火股份	15,100	253,680.00	0.14
218	000932	华菱钢铁	48,400	249,260.00	0.13
219	603606	东方电缆	5,800	247,950.00	0.13
220	300787	海能实业	14,700	247,254.00	0.13
221	600757	长江传媒	32,800	244,360.00	0.13
222	601965	中国汽研	10,900	240,454.00	0.13
223	002014	永新股份	28,700	239,645.00	0.13
224	000906	浙商中拓	32,600	238,306.00	0.13
225	000012	南玻A	41,000	228,370.00	0.12
226	002402	和而泰	15,900	227,211.00	0.12
227	603185	弘元绿能	6,800	226,304.00	0.12
228	688658	悦康药业	10,800	225,288.00	0.12
229	600481	双良节能	26,400	223,344.00	0.12
230	300389	艾比森	12,800	221,952.00	0.12
231	002078	太阳纸业	18,200	221,494.00	0.12
232	600502	安徽建工	47,400	220,410.00	0.12
233	603699	纽威股份	15,800	218,988.00	0.12
234	002643	万润股份	13,100	217,329.00	0.12
235	600048	保利发展	21,800	215,820.00	0.12
236	002597	金禾实业	9,800	214,718.00	0.12
237	688526	科前生物	10,500	213,990.00	0.12
238	000426	兴业银锡	23,300	211,564.00	0.11
239	002439	启明星辰	7,800	210,600.00	0.11
240	688722	同益中	13,700	209,610.00	0.11
241	002472	双环传动	8,000	208,160.00	0.11
242	603393	新天然气	6,800	207,876.00	0.11
243	688006	杭可科技	8,800	206,624.00	0.11
244	601186	中国铁建	27,000	205,470.00	0.11

245	300349	金卡智能	16,500	204,930.00	0.11
246	605088	冠盛股份	8,900	204,700.00	0.11
247	002432	九安医疗	5,400	203,418.00	0.11
248	600475	华光环能	19,500	202,800.00	0.11
249	002601	龙佰集团	11,800	202,134.00	0.11
250	002274	华昌化工	26,600	200,830.00	0.11
251	002034	旺能环境	13,100	199,775.00	0.11
252	603658	安图生物	3,500	199,535.00	0.11
253	300738	奥飞数据	18,800	199,092.00	0.11
254	300776	帝尔激光	3,300	198,858.00	0.11
255	300017	网宿科技	25,300	198,605.00	0.11
256	601816	京沪高铁	40,100	197,292.00	0.11
257	000893	亚钾国际	7,500	196,800.00	0.11
258	000682	东方电子	24,400	196,420.00	0.11
259	000778	新兴铸管	51,400	196,348.00	0.11
260	300360	炬华科技	14,300	195,338.00	0.11
261	600141	兴发集团	10,700	195,275.00	0.11
262	600499	科达制造	18,500	195,175.00	0.10
263	002080	中材科技	12,200	194,224.00	0.10
264	002991	甘源食品	2,700	192,942.00	0.10
265	600015	华夏银行	34,300	192,766.00	0.10
266	600219	南山铝业	65,500	192,570.00	0.10
267	601952	苏垦农发	18,800	192,512.00	0.10
268	002293	罗莱生活	20,700	192,303.00	0.10
269	000166	申万宏源	43,300	192,252.00	0.10
270	001965	招商公路	19,600	191,492.00	0.10
271	600761	安徽合力	10,500	191,205.00	0.10
272	603109	神驰机电	11,600	190,472.00	0.10
273	002730	电光科技	20,000	189,600.00	0.10
274	601658	邮储银行	43,400	188,790.00	0.10
275	300696	爱乐达	10,800	188,028.00	0.10
276	300777	中简科技	6,300	187,929.00	0.10
277	000049	德赛电池	6,900	187,128.00	0.10
278	601866	中远海发	79,500	186,030.00	0.10
279	600704	物产中大	41,900	185,617.00	0.10
280	600521	华海药业	12,600	184,842.00	0.10
281	600166	福田汽车	67,400	184,002.00	0.10
282	600332	白云山	6,400	183,040.00	0.10
283	300595	欧普康视	8,100	182,898.00	0.10
284	002056	横店东磁	13,500	182,790.00	0.10
285	002624	完美世界	15,400	182,336.00	0.10
286	002677	浙江美大	18,000	181,980.00	0.10
287	000792	盐湖股份	11,400	181,830.00	0.10

288	688468	科美诊断	16,800	181,272.00	0.10
289	000581	威孚高科	12,000	180,840.00	0.10
290	603896	寿仙谷	5,600	180,544.00	0.10
291	603886	元祖股份	9,900	180,477.00	0.10
292	600905	三峡能源	41,100	179,607.00	0.10
293	688105	诺唯赞	5,600	179,312.00	0.10
294	601375	中原证券	46,800	179,244.00	0.10
295	300451	创业慧康	27,300	178,815.00	0.10
296	603317	天味食品	13,420	178,351.80	0.10
297	600850	电科数字	8,200	178,350.00	0.10
298	300613	富瀚微	4,200	178,248.00	0.10
299	002315	焦点科技	5,300	175,589.00	0.09
300	600918	中泰证券	25,500	174,930.00	0.09
301	002841	视源股份	3,800	173,888.00	0.09
302	600705	中航产融	55,000	171,050.00	0.09
303	600143	金发科技	21,400	170,986.00	0.09
304	603010	万盛股份	15,800	170,482.00	0.09
305	002266	浙富控股	49,900	169,660.00	0.09
306	300130	新国都	7,000	169,400.00	0.09
307	600529	山东药玻	6,600	168,960.00	0.09
308	002867	周大生	11,100	168,498.00	0.09
309	600426	华鲁恒升	6,100	168,299.00	0.09
310	300079	数码视讯	29,300	166,717.00	0.09
311	603986	兆易创新	1,800	166,302.00	0.09
312	600511	国药股份	5,800	165,996.00	0.09
313	600380	健康元	13,300	165,319.00	0.09
314	000997	新大陆	8,400	164,724.00	0.09
315	688301	奕瑞科技	500	162,630.00	0.09
316	301175	中科环保	32,400	161,676.00	0.09
317	300088	长信科技	24,100	161,229.00	0.09
318	600968	海油发展	55,400	157,890.00	0.08
319	600885	宏发股份	5,600	154,784.00	0.08
320	688188	柏楚电子	600	151,866.00	0.08
321	002563	森马服饰	26,300	151,751.00	0.08
322	002772	众兴菌业	18,900	149,121.00	0.08
323	600754	锦江酒店	4,900	146,510.00	0.08
324	603198	迎驾贡酒	2,200	145,838.00	0.08
325	603589	口子窖	3,200	144,960.00	0.08
326	002757	南兴股份	9,200	143,888.00	0.08
327	603876	鼎胜新材	11,200	140,336.00	0.08
328	002594	比亚迪	700	138,600.00	0.07
329	603050	科林电气	7,700	138,215.00	0.07
330	603882	金域医学	2,200	137,654.00	0.07

331	301096	百诚医药	2,100	136,710.00	0.07
332	002195	岩山科技	44,300	136,001.00	0.07
333	300775	三角防务	4,800	133,920.00	0.07
334	600612	老凤祥	1,900	131,100.00	0.07
335	601827	三峰环境	17,400	130,674.00	0.07
336	603613	国联股份	5,900	129,859.00	0.07
337	600563	法拉电子	1,400	129,640.00	0.07
338	688075	安旭生物	3,198	128,815.44	0.07
339	002258	利尔化学	10,600	126,882.00	0.07
340	002050	三花智控	4,300	126,420.00	0.07
341	002017	东信和平	12,100	125,961.00	0.07
342	601298	青岛港	20,300	125,454.00	0.07
343	603676	卫信康	12,000	125,160.00	0.07
344	002414	高德红外	17,000	124,100.00	0.07
345	600570	恒生电子	4,300	123,668.00	0.07
346	300037	新宙邦	2,600	122,980.00	0.07
347	688981	中芯国际	2,300	121,946.00	0.07
348	002745	木林森	14,000	121,240.00	0.07
349	600035	楚天高速	31,700	121,094.00	0.07
350	600926	杭州银行	12,000	120,120.00	0.06
351	601163	三角轮胎	8,300	119,603.00	0.06
352	300896	爱美客	400	117,732.00	0.06
353	601398	工商银行	24,600	117,588.00	0.06
354	301087	可孚医疗	3,100	117,490.00	0.06
355	600933	爱柯迪	5,300	116,282.00	0.06
356	601117	中国化学	17,700	112,572.00	0.06
357	000630	铜陵有色	32,900	107,912.00	0.06
358	002831	裕同科技	3,900	107,289.00	0.06
359	300699	光威复材	4,000	106,680.00	0.06
360	002032	苏泊尔	2,000	106,020.00	0.06
361	601098	中南传媒	10,300	104,751.00	0.06
362	603939	益丰药房	2,600	104,104.00	0.06
363	002028	思源电气	2,000	104,080.00	0.06
364	603368	柳药集团	5,500	104,060.00	0.06
365	603712	七一二	3,300	103,983.00	0.06
366	600131	国网信通	6,800	103,020.00	0.06
367	002281	光迅科技	3,600	102,600.00	0.06
368	600195	中牧股份	8,600	101,996.00	0.05
369	002273	水晶光电	7,500	101,550.00	0.05
370	601139	深圳燃气	14,700	101,283.00	0.05
371	600486	扬农化工	1,600	100,992.00	0.05
372	600378	昊华科技	3,300	100,584.00	0.05
373	002223	鱼跃医疗	2,900	100,282.00	0.05

374	603786	科博达	1,400	99,904.00	0.05
375	600862	中航高科	4,500	99,675.00	0.05
376	601928	凤凰传媒	11,300	99,553.00	0.05
377	002966	苏州银行	15,400	99,484.00	0.05
378	300136	信维通信	4,200	99,120.00	0.05
379	600372	中航机载	7,500	98,850.00	0.05
380	688220	翱捷科技	1,400	98,616.00	0.05
381	601577	长沙银行	14,400	98,208.00	0.05
382	002465	海格通信	7,600	97,660.00	0.05
383	600528	中铁工业	13,000	96,720.00	0.05
384	002185	华天科技	11,300	96,276.00	0.05
385	603883	老百姓	3,200	95,648.00	0.05
386	300373	扬杰科技	2,600	95,420.00	0.05
387	600328	中盐化工	12,200	95,404.00	0.05
388	600298	安琪酵母	2,700	94,986.00	0.05
389	300146	汤臣倍健	5,500	93,665.00	0.05
390	601555	东吴证券	12,800	93,568.00	0.05
391	300383	光环新网	9,600	93,312.00	0.05
392	002299	圣农发展	5,400	92,772.00	0.05
393	601128	常熟银行	14,500	92,655.00	0.05
394	600489	中金黄金	9,300	92,628.00	0.05
395	600597	光明乳业	10,600	92,538.00	0.05
396	600170	上海建工	39,400	92,196.00	0.05
397	688012	中微公司	600	92,160.00	0.05
398	600258	首旅酒店	5,900	92,158.00	0.05
399	300003	乐普医疗	5,700	92,112.00	0.05
400	002511	中顺洁柔	9,200	92,000.00	0.05
401	002508	老板电器	4,200	91,476.00	0.05
402	603866	桃李面包	11,900	91,154.00	0.05
403	603816	顾家家居	2,600	91,000.00	0.05
404	603868	飞科电器	1,800	90,900.00	0.05
405	002373	千方科技	8,100	90,801.00	0.05
406	600801	华新水泥	7,300	90,739.00	0.05
407	002557	洽洽食品	2,600	90,532.00	0.05
408	300285	国瓷材料	3,900	90,168.00	0.05
409	002444	巨星科技	4,000	90,080.00	0.05
410	600498	烽火通信	5,400	89,856.00	0.05
411	603160	汇顶科技	1,300	89,830.00	0.05
412	300888	稳健医疗	2,400	89,400.00	0.05
413	600315	上海家化	4,200	88,956.00	0.05
414	300012	华测检测	6,200	88,040.00	0.05
415	603127	昭衍新药	3,700	87,727.00	0.05
416	301029	怡合达	3,400	87,652.00	0.05



417	002507	涪陵榨菜	6,100	87,169.00	0.05
418	603456	九洲药业	3,600	87,156.00	0.05
419	000729	燕京啤酒	10,000	86,300.00	0.05
420	603517	绝味食品	3,200	85,952.00	0.05
421	300244	迪安诊断	3,600	85,716.00	0.05
422	688588	凌志软件	7,200	85,680.00	0.05
423	300395	菲利华	2,300	84,088.00	0.05
424	000998	隆平高科	5,900	83,190.00	0.04
425	002714	牧原股份	2,000	82,360.00	0.04
426	603267	鸿远电子	1,600	80,320.00	0.04
427	000921	海信家电	3,900	79,560.00	0.04
428	601390	中国中铁	13,600	77,248.00	0.04
429	300633	开立医疗	1,600	75,680.00	0.04
430	600580	卧龙电驱	3,600	42,228.00	0.02
431	000975	银泰黄金	2,400	36,000.00	0.02
432	603707	健友股份	1,400	21,000.00	0.01

#### 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	300750	宁德时代	14,138,815.00	5.92
2	000568	泸州老窖	8,699,195.70	3.64
3	600519	贵州茅台	8,484,020.00	3.55
4	002475	立讯精密	7,459,240.00	3.12
5	300015	爱尔眼科	7,384,044.51	3.09
6	688111	金山办公	6,355,362.22	2.66
7	002594	比亚迪	6,171,106.00	2.58
8	300896	爱美客	6,049,902.99	2.53
9	600862	中航高科	6,040,379.00	2.53
10	600941	中国移动	5,982,155.08	2.50
11	688558	国盛智科	5,936,610.68	2.48
12	601006	大秦铁路	5,788,255.00	2.42
13	688305	科德数控	5,387,145.79	2.25
14	601882	海天精工	5,230,496.00	2.19
15	603348	文灿股份	5,220,215.53	2.19
16	002559	亚威股份	5,209,151.50	2.18
17	601899	紫金矿业	5,202,788.00	2.18
18	600570	恒生电子	5,163,252.12	2.16
19	000858	五粮液	5,146,817.00	2.15
20	300760	迈瑞医疗	5,144,189.00	2.15
21	600761	安徽合力	5,106,494.00	2.14
22	600048	保利发展	5,092,516.00	2.13

23	000516	国际医学	4,965,675.39	2.08
24	688122	西部超导	4,821,316.86	2.02

注：“买入金额”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	300750	宁德时代	14,230,951.71	5.96
2	002594	比亚迪	9,748,623.19	4.08
3	300015	爱尔眼科	7,781,196.50	3.26
4	000568	泸州老窖	6,546,520.00	2.74
5	300896	爱美客	6,510,059.00	2.73
6	688122	西部超导	6,447,141.38	2.70
7	600256	广汇能源	6,257,291.00	2.62
8	600862	中航高科	6,068,155.00	2.54
9	688558	国盛智科	5,978,913.10	2.50
10	688111	金山办公	5,801,540.64	2.43
11	002475	立讯精密	5,712,139.00	2.39
12	600761	安徽合力	5,543,707.00	2.32
13	601882	海天精工	5,506,012.00	2.30
14	002559	亚威股份	5,426,165.00	2.27
15	600309	万华化学	5,409,320.00	2.26
16	300308	中际旭创	5,352,436.46	2.24
17	600570	恒生电子	5,302,267.12	2.22
18	601225	陕西煤业	5,296,520.00	2.22
19	601838	成都银行	5,274,827.98	2.21
20	688066	航天宏图	5,261,994.31	2.20
21	688518	联赢激光	5,238,028.70	2.19
22	688777	中控技术	5,001,188.09	2.09
23	300580	贝斯特	4,990,769.13	2.09
24	600900	长江电力	4,957,614.30	2.08
25	688305	科德数控	4,900,175.50	2.05
26	002714	牧原股份	4,868,617.60	2.04
27	300777	中简科技	4,829,899.00	2.02
28	600048	保利发展	4,806,803.00	2.01
29	600763	通策医疗	4,795,373.00	2.01

注：“卖出金额”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

买入股票成本(成交)总额	1,712,107,659.87
卖出股票收入(成交)总额	1,730,754,728.14

注：“买入股票成本”、“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

注：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

注：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

注：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

注：根据本基金基金合同规定，本基金不参与贵金属投资。

### 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

注：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

根据本基金基金合同的规定，本基金将以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。报告期内，本基金未参与股指期货交易。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

#### 8.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

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

#### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

#### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	19,479.89
2	应收清算款	1,214,868.12
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	11,296.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,245,644.36

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 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 (%)
20,238	12,008.35	0.00	0.00	243,025,060.59	100.00

### 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	835,881.56	0.3439

### 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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2020 年 7 月 16 日) 基金份额总额	2,225,819,599.15
本报告期期初基金份额总额	265,743,038.01
本报告期基金总申购份额	19,955,252.02
减：本报告期基金总赎回份额	42,673,229.44

本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	243,025,060.59

## § 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

本报告期内，基金管理人的重大人事变动如下：

1、自 2023 年 1 月 1 日起，何晓春先生担任副总经理；

2、自 2023 年 8 月 28 日起，ZHOU HAN（周涵）先生离任首席信息官，总经理王鸿嫔女士兼任首席信息官。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动如下：

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门根据工作需要，任命牛环起、施伟为资产托管业务部副总经理。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金未改变投资策略。

### 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改聘会计师事务所。报告期内本基金应支付给聘任会计师事务所——普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）2023 年度的报酬为 60,000.00 元。目前普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已连续四年向本基金提供审计服务。

### 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

注：本报告期内基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：根据我行审计报告，本行不存在涉嫌犯罪被依法立案调查的情况，本行的控股股东、实际控制人、董事、监事、高级管理人员不存在涉嫌犯罪被依法采取强制措施、涉嫌严重违纪违法或者职务犯罪被纪检监察机关采取留置措施且影响其履行职责的情况；本行或者本行的控股股东、实际控制人、董事、监事、高级管理人员不存在受到刑事处罚，涉嫌违法违规被中国证监会立案调

查或者受到中国证监会行政处罚，或者受到其他有权机关重大行政处罚，或者被中国证监会采取行政监管措施和被证券交易所采取纪律处分的情况；本行董事、监事、高级管理人员不存在因涉嫌违法违规被其他有权机关采取强制措施且影响其履行职责的情况。

## 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 (%)	
兴业证券	1	403,437,474.80	11.73	295,032.57	11.68	-
开源证券	1	371,175,362.03	10.79	271,556.39	10.75	-
华创证券	1	284,841,224.58	8.28	209,332.89	8.29	-
东方证券	2	281,881,754.46	8.19	207,333.95	8.21	-
东北证券	1	261,795,156.16	7.61	193,165.91	7.65	-
中信建投	2	249,360,934.48	7.25	182,359.05	7.22	-
财通证券	1	208,766,281.14	6.07	152,673.59	6.04	-
广发证券	1	180,588,346.03	5.25	133,893.26	5.30	-
光大证券	1	154,959,933.58	4.50	114,466.21	4.53	-
国海证券	1	148,519,614.91	4.32	108,613.50	4.30	-
天风证券	1	141,922,003.95	4.13	103,788.97	4.11	-
浙商证券	2	141,219,584.38	4.10	103,272.73	4.09	-
长江证券	2	105,423,894.07	3.06	77,095.54	3.05	-
国泰君安	2	101,909,311.57	2.96	74,526.45	2.95	-
国投证券	2	98,297,950.19	2.86	73,177.23	2.90	-
华鑫证券	2	73,362,828.5	2.13	54,669.27	2.16	-

		5				
中金公司	1	71,064,212.64	2.07	51,969.61	2.06	-
海通证券	1	66,741,467.80	1.94	48,808.13	1.93	-
中泰证券	1	45,722,622.86	1.33	33,435.53	1.32	-
东吴证券	1	30,872,469.94	0.90	23,028.21	0.91	-
西部证券	1	18,390,472.73	0.53	13,448.32	0.53	-
民生证券	1	72,486.40	0.00	53.01	0.00	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 专用交易单元的选择标准

- (1) 实力雄厚，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，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (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，能及时、定期、全面地为本基金提供研究服务；
- (6) 为基金份额持有人提供高水平的综合服务。

2. 基金管理人根据以上标准进行考察后确定合作券商。基金管理人与被选择的证券经营机构签订《专用证券交易单元租用协议》，报证券交易所办理交易单元相关租用手续。

3. 本报告期内，本基金增加租用财通证券、上海证券各 1 个交易单元，减少租用申万宏源证

券、信达证券、华鑫证券各 1 个交易单元。

### 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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券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(%)
兴业证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	891,188.80	81.34	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
海通证	204,409.39	18.66	-	-	-	-



券						
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
上海证 券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-
中投证 券	-	-	-	-	-	-
中银国 际	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-
川财证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
长城证 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	本公司关于系统升级期间暂停电话自助语音服务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023年1月7日

2	本公司旗下基金 2022 年 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 1 月 20 日
3	本基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 1 月 20 日
4	本公司关于系统升级期间暂停电话自助语音服务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 2 月 10 日
5	本公司关于系统升级期间暂停电话自助语音服务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 2 月 18 日
6	本公司关于系统升级期间暂停电话自助语音服务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 2 月 21 日
7	本基金招募说明书（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 3 月 10 日
8	本基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 3 月 10 日
9	本公司关于系统升级期间暂停电话自助语音服务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 3 月 16 日
10	本公司关于系统升级期间暂停电话自助语音服务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 3 月 17 日
11	本公司关于旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 3 月 30 日
12	本基金 2022 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 3 月 30 日
13	本公司关于系统升级期间暂停电话自助语音服务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 3 月 30 日
14	本公司关于公司官网在 2023 年 4 月 16 日部分时段暂停服务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 4 月 15 日
15	本公司旗下全部基金 2023 年 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 4 月 21 日
16	本基金 2023 年 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 4 月 21 日
17	本公司关于客服系统、公司官网、网上交易系统、短信及邮件系统相关服务暂停的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 4 月 21 日
18	本公司关于旗下基金增加上海中欧财富基金销售有限公司为销售机构并参与费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 4 月 26 日
19	本公司关于旗下基金增加上海中欧财富基金销售有限公司为销售机构并参与费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 4 月 27 日
20	本公司关于旗下基金增加上海中欧财富基金销售有限公司为销售机构并参与费率优惠活动的更正公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 4 月 27 日
21	本公司关于系统升级期间暂停电话自助语音服务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 5 月 12 日

22	关于公司法定名称变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 6 月 3 日
23	本基金招募说明书（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 6 月 7 日
24	本基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 6 月 7 日
25	本公司关于旗下基金更名事宜的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 6 月 8 日
26	本基金基金合同（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 6 月 8 日
27	本基金托管协议（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 6 月 8 日
28	本基金招募说明书（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 6 月 9 日
29	本基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 6 月 9 日
30	本公司关于调整开放式基金业务规则的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 6 月 10 日
31	本公司关于部分直销银行账户信息变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 6 月 16 日
32	本公司关于变更公司客服邮箱的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 7 月 10 日
33	本公司关于公司股东及实际控制人变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 7 月 18 日
34	本公司关于董事变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 7 月 18 日
35	本公司旗下全部基金 2023 年 2 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 7 月 20 日
36	本基金 2023 年第二季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 7 月 20 日
37	本公司关于公司官网、网上交易系统相关服务暂停的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 7 月 28 日
38	本公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 8 月 29 日
39	本公司关于上海分公司法定名称变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 8 月 29 日
40	本公司旗下基金 2023 年中期报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 8 月 29 日
41	本基金 2023 年中期报告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 8 月 29 日
42	关于暂停公司官网、网上交易系统相关服务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 9 月 15 日
43	本公司关于调低旗下部分基金费率并修改基金合同等法律文件的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 10 月 14 日

44	本基金基金合同（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 10 月 14 日
45	本基金托管协议（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 10 月 14 日
46	本基金招募说明书（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 10 月 17 日
47	本基金基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 10 月 17 日
48	本公司旗下全部基金 2023 年 3 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 10 月 24 日
49	本基金 2023 年 3 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 10 月 24 日
50	本公司关于增加海银基金销售有限公司为销售机构并参与费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 11 月 10 日
51	本公司关于旗下部分基金参加平安银行股份有限公司转换费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 11 月 23 日
52	本公司关于旗下部分基金增加洪泰财富（青岛）基金销售有限责任公司为销售机构并参与费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 12 月 22 日
53	本公司关于旗下基金增加上海中正达广基金销售有限公司为销售机构并参与费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 12 月 22 日

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予本基金注册的批复文件；
- 2、本基金基金合同；
- 3、本基金托管协议；
- 4、本基金招募说明书；
- 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、报告期内在规定媒介上披露的各项公告。

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件，还可以通过基金管理人网站查阅

或下载。

摩根士丹利基金管理（中国）有限公司

2024 年 3 月 28 日