

摩根士丹利资源优选混合型证券投资基金
(LOF)
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：中国光大银行股份有限公司

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。

基金托管人中国光大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

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作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	12
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
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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
§ 6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
§ 7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	18
7.3 净资产变动表	19
7.4 报表附注	21
§ 8 投资组合报告	46

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	47
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	49
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
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	56
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	56
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	56
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	56
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	56
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
8.12 投资组合报告附注	57
§ 9 基金份额持有人信息	57
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
9.2 期末上市基金前十名持有人	57
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	58
§ 10 开放式基金份额变动	58
§ 11 重大事件揭示	58
11.1 基金份额持有人大会决议	58
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	58
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
11.4 基金投资策略的改变	59
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	59
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	59
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
11.8 其他重大事件	61
§ 12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录	64
12.2 存放地点	64
12.3 查阅方式	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	摩根士丹利资源优选混合型证券投资基金(LOF)
基金简称	大摩资源优选混合(LOF)
场内简称	大摩资源LOF
基金主代码	163302
交易代码	163302
基金运作方式	契约型上市开放式(LOF)
基金合同生效日	2005年9月27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	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	543,152,652.74份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2007年7月5日

2.2 基金产品说明

投资目标	<p>将中国资源的经济价值转换为持续的投资收益，为基金份额持有人谋求长期、稳定的投资回报。</p> <p>本基金将把握资源的价值变化规律，对各类资源的现状和发展进行分析判断，及时适当调整各类资源行业的配置比例，重点投资于各类资源行业中的优势企业，分享资源长期价值提升所带来的投资收益。</p>
投资策略	<p>本基金将中长期持有以资源类股票为主的股票投资组合，并注重资产在资源类各相关行业的配置，适当进行时机选择。采用“自上而下”为主、结合“自下而上”的投资方法，将资产管理策略体现在资产配置、行业配置、股票及债券选择的过程中。</p> <p>(1) 股票投资策略</p> <p>A、根据资源的经济价值，注重对资源类上市公司所拥有的资源价值评估和公司证券价值的估值分析；对于精选个股将坚持中长期持有为主的策略。</p> <p>B、我国证券市场处于新兴加转轨的阶段，市场的波动性较强，所以本基金将依据市场判断和政策分析，同时根据类别行业的周期性特点，采取适当的时机选择策略，以优化组合表现。</p> <p>(2) 债券投资策略</p> <p>本基金采取“自上而下”为主，“自下而上”为辅的投资策略，以长期利率趋势分析为基础，兼顾中短期经济周期、政策方向等因素在类别资产配置、市场资产配置、券种选择3个层面进行主动性投资管理。积极运用“久期管理”，动态调整组合的投资品种，以达到预期投资目标。</p> <p>(3) 权证投资策略</p> <p>对权证的投资建立在对标的证券和组合收益风险进行分析的基础之</p>

	上，权证在基金的投资中将主要起到锁定收益和控制风险的作用。以BS模型和二叉树模型为基础来对权证进行定价，并根据市场情况对定价模型和参数进行适当修正。 在组合构建和操作中运用的投资策略主要包括但不限于保护性看跌策略、抛补的认购权证、双限策略等。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×70%+标普中国债券指数收益率×30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，长期平均风险介于股票型和债券型基金之间，适于能承担一定风险、追求较高收益和长期资本增值的投资人投资。

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	中国光大银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	许菲菲	石立平
	联系电话	(0755)88318883	(010)63639180
	电子邮箱	im-disclosure@morganstanley.com.cn	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		400-8888-668	95595
传真		(0755)82990384	(010)63639132
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	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
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	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码		518048	100033
法定代表人		王鸿嫔	王江

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	https://www.morganstanleyfunds.com.cn
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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间 数据和指标	2023年	2022年	2021年
本期已实现 收益	-99,238,156.87	-240,332,816.46	154,255,995.09
本期利润	-112,893,488.76	-271,268,483.93	107,300,137.03

加权平均基金份额本期利润	-0.2074	-0.5045	0.2492
本期加权平均净值利润率	-25.06%	-46.06%	14.13%
本期基金份额净值增长率	-22.74%	-35.01%	15.34%
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	-189,750,111.38	-90,543,987.54	288,473,829.03
期末可供分配基金份额利润	-0.3493	-0.1673	0.6844
期末基金资产净值	381,399,126.60	491,879,624.81	769,152,228.49
期末基金份额净值	0.7022	0.9089	1.8249
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	708.86%	946.96%	1,510.93%

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

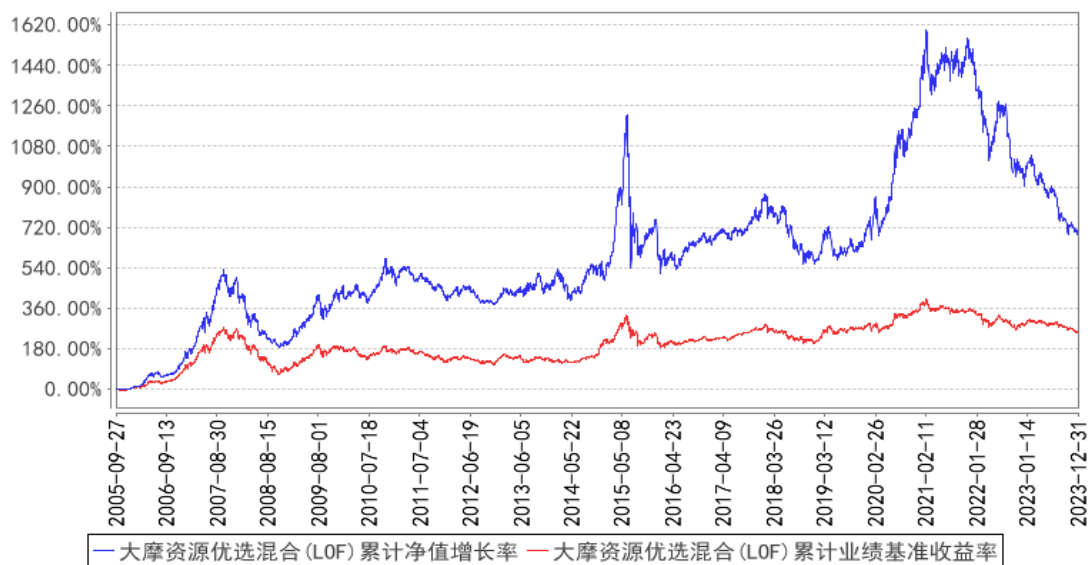
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-5.77%	0.81%	-4.56%	0.55%	-1.21%	0.26%
过去六个月	-18.80%	0.84%	-7.04%	0.59%	-11.76%	0.25%
过去一年	-22.74%	0.88%	-6.78%	0.59%	-15.96%	0.29%

					%	
过去三年	-42.09%	1.24%	-21.93%	0.78%	-20.16%	0.46%
过去五年	19.90%	1.34%	18.04%	0.85%	1.86%	0.49%
自基金合同生效起至今	708.86%	1.49%	259.98%	1.13%	448.88%	0.36%

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

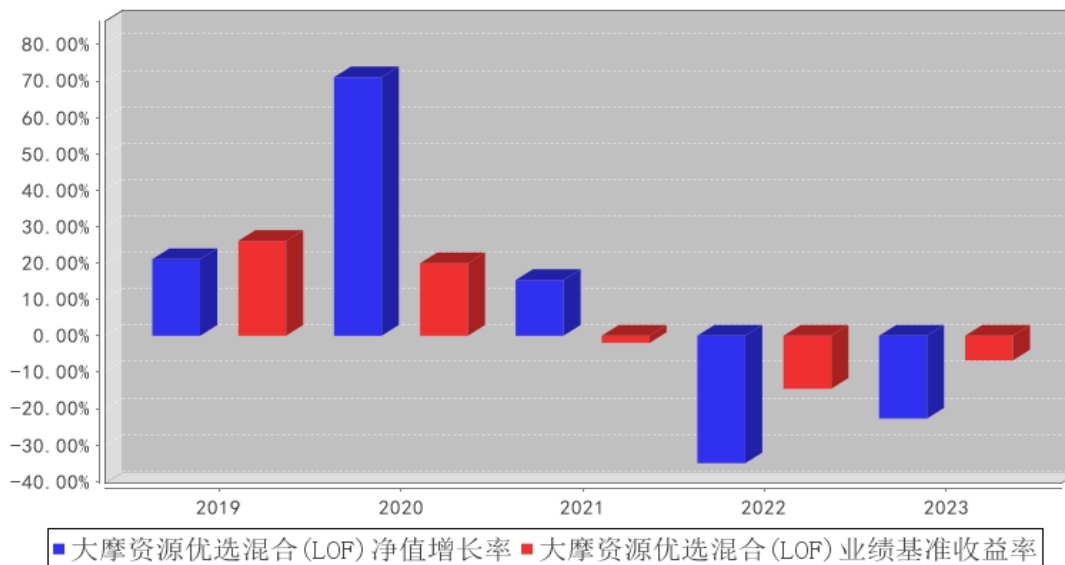
大摩资源优选混合 (LOF) 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同于 2005 年 9 月 27 日正式生效。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。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

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

大摩资源优选混合 (LOF) 基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2023 年	-	-	-	-	-
2022 年	4.1070	99,737,615.21	99,990,003.40	199,727,618.61	-
2021 年	4.6860	80,752,419.31	97,550,224.68	178,302,643.99	-
合计	8.7930	180,490,034.52	197,540,228.08	378,030,262.60	-

§ 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		
沈菁	基金经理	2023 年 2 月 28 日	-	10 年	英国曼彻斯特大学会计与金融专业硕士。曾任招商证券股份有限公司机构业务部机

					构销售、研究发展部煤炭行业分析师。2017年6月加入本公司，历任研究员、基金经理助理，现任基金经理。2023年2月起担任摩根士丹利资源优选混合型证券投资基金(LOF)的基金经理，2023年12月担任摩根士丹利现代服务业混合型证券投资基金基金经理。
徐达	权益投资部总监助理、基金经理	2016年6月17日	2023年12月11日	11年	美国弗吉尼亚大学经济学和商业学学士。2012年7月加入本公司，历任研究管理部研究员、基金经理助理、基金经理、权益投资部总监助理兼基金经理。2016年6月至2023年12月担任摩根士丹利资源优选混合型证券投资基金(LOF)基金经理，2017年1月至2019年9月担任摩根士丹利领先优势混合型证券投资基金基金经理，2017年12月至2019年9月担任摩根士丹利科技领先灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2022年2月至2023年12月担任摩根士丹利现代服务业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

2023年是疫后复苏之年，A股市场经历了年初强复苏预期下的大幅反弹，以及复苏预期回落后的明显调整。海外美联储加息周期结束，地缘冲突仍持续。2023年主要指数均录得下跌，上证指数下跌3.70%，沪深300指数下跌11.38%，中证800指数下跌10.37%，创业板指下跌19.41%，国证2000指数小幅下跌1.16%，红利指数上涨2.67%。行业指数间分化较大，市场风险偏好下行叠加对地产行业的悲观情绪有所蔓延，地产、地产链以及顺周期方向调整较多，新能源因行业格局问题调整较多；TMT板块因AI主题爆发大幅领涨市场，煤炭、家电等具有防御属性且高股息的板块也表现较好。

本基金2023年维持较高仓位，自上而下考虑宏观和中观变量，结合自下而上选股，考察个股业绩增长与估值的匹配情况，主要关注以机械，电子和电新为代表的先进制造业，全年基金跑输基准，主要是在电新、机械、地产链等板块承受损失较大。本基金在四季度进行部分调仓，策略上倾向于进一步均衡配置，降低行业和个股集中度，力求降低净值波动。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金份额净值为0.7022元，累计份额净值为4.4241元，报告期内基金份额净值增长率为-22.74%，同期业绩比较基准收益率为-6.78%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2024年，本基金认为国内经济稳中向好的大方向没有改变，政策仍在持续加码中，静待数据改善。对于市场亦不必过度悲观，随着美国降息预期的抬升，国内降息周期开启，市场流动性仍将保持充裕。具体来看，我们认为政策对于经济的托底作用仍将有效，弱复苏的格局将持续，经济结构转型还是主旋律，积极筛选国产替代逻辑以及出海方向的高端制造业龙头；上游资源品在海外降息预期和国内复苏趋势的背景下或有机会，供给约束较强的资源品标的值得重点关注；同时利率下行的大背景下，部分盈利持续稳定，低估值高分红的公司具有长期配置价值。本基金将围绕上述方向进行重点布局，坚持价值投资理念，积极寻找具备优质成长潜力的公司，力争为持有人取得基金资产的增值。

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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在摩根士丹利资源优选混合型证券投资基金（LOF）（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《摩根士丹利资源优选混合型证券投资基金(LOF)2023年年度报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

§ 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 26153 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	摩根士丹利资源优选混合型证券投资基金(LOF)全体基金份额持有人：
审计意见	(一) 我们审计的内容

	<p>我们审计了摩根士丹利资源优选混合型证券投资基金 (LOF) (以下简称“摩根士丹利资源优选基金”) 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资源优选基金 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资源优选基金, 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	<p>摩根士丹利资源优选基金的基金管理人摩根士丹利基金管理 (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资源优选基金 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。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>
管理层和治理层对财务报表的责任	<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资源优选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资源优选基金、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资源优选基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<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</p>

任	<p>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，就可能对摩根士丹利资源优选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资源优选基金不能持续经营。</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：摩根士丹利资源优选混合型证券投资基金 (LOF)

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	109,778,554.12	71,805,695.38
结算备付金		1,536,580.05	6,352,402.19
存出保证金		445,152.00	632,248.36
交易性金融资产	7.4.7.2	294,367,177.46	433,468,471.54
其中: 股票投资		294,367,177.46	433,468,471.54
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	-	-
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		151,190.45	92,064.95
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		406,278,654.08	512,350,882.42
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		22,756,396.47	16,242,688.41
应付赎回款		151,552.42	181,558.10
应付管理人报酬		388,013.88	635,515.43
应付托管费		64,668.97	105,919.25
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		191,147.20	191,147.20
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-

其他负债	7.4.7.6	1,327,748.54	3,114,429.22
负债合计		24,879,527.48	20,471,257.61
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	543,152,652.74	541,158,769.11
未分配利润	7.4.7.8	-161,753,526.14	-49,279,144.30
净资产合计		381,399,126.60	491,879,624.81
负债和净资产总计		406,278,654.08	512,350,882.42

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.7022 元，基金份额总额 543,152,652.74 份。

7.2 利润表

会计主体：摩根士丹利资源优选混合型证券投资基金 (LOF)

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		-105,039,302.09	-260,702,284.59
1. 利息收入		421,896.32	651,613.46
其中：存款利息收入	7.4.7.9	421,896.32	651,613.46
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）		-91,828,301.20	-230,539,561.31
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-97,383,592.37	-236,742,107.26
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	-	34,282.37
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
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	5,555,291.17	6,168,263.58
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	-13,655,331.89	-30,935,667.47
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”	7.4.7.17	22,434.68	121,330.73

号填列)			
减：二、营业总支出		7,854,186.67	10,566,199.34
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	6,532,555.52	8,857,713.71
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,088,759.15	1,476,285.63
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		-	-
8. 其他费用	7.4.7.19	232,872.00	232,200.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-112,893,488.76	-271,268,483.93
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-112,893,488.76	-271,268,483.93
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-112,893,488.76	-271,268,483.93

7.3 净资产变动表

会计主体：摩根士丹利资源优选混合型证券投资基金 (LOF)

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	541,158,769.11	-	-49,279,144.30	491,879,624.81
二、本期期初净资产	541,158,769.11	-	-49,279,144.30	491,879,624.81
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,993,883.63	-	-112,474,381.84	-110,480,498.21
（一）、综合收益总额	-	-	-112,893,488.76	-112,893,488.76
（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）	1,993,883.63	-	419,106.92	2,412,990.55

其中：1. 基金申购款	57,163,052.50	-	-9,145,960.68	48,017,091.82
2. 基金赎回款	-55,169,168.87	-	9,565,067.60	-45,604,101.27
(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	543,152,652.74	-	-161,753,526.14	381,399,126.60
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	421,478,727.51	-	347,673,500.98	769,152,228.49
二、本期期初净资产	421,478,727.51	-	347,673,500.98	769,152,228.49
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	119,680,041.60	-	-396,952,645.28	-277,272,603.68
(一)、综合收益总额	-	-	-271,268,483.93	-271,268,483.93
(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)	119,680,041.60	-	74,043,457.26	193,723,498.86
其中：1. 基金申购款	224,857,758.44	-	83,204,897.29	308,062,655.73
2. 基金赎回款	-105,177,716.84	-	-9,161,440.03	-114,339,156.87
(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)	-	-	-199,727,618.61	-199,727,618.61
四、本期期末净资产	541,158,769.11	-	-49,279,144.30	491,879,624.81

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：

<u>王鸿嫔</u>	<u>贺草</u>	<u>杜志强</u>
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

摩根士丹利资源优选混合型证券投资基金 (LOF) (原名为“巨田资源优选混合型证券投资基金 (LOF)”、“摩根士丹利华鑫资源优选混合型证券投资基金 (LOF)”，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”) 证监基金字[2005]第 79 号《关于同意巨田资源优选混合型证券投资基金募集的批复》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，曾为巨田基金管理有限公司) 依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《巨田资源优选混合型证券投资基金 (LOF) 基金合同》(后更名为《摩根士丹利华鑫资源优选混合型证券投资基金 (LOF) 基金合同》、《摩根士丹利资源优选混合型证券投资基金 (LOF) 基金合同》) 负责公开募集。本基金为上市契约型开放式，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 309,455,317.98 元，业经德勤华永会计师事务所有限公司德师报(验)字(05)第 SZ001 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《巨田资源优选混合型证券投资基金 (LOF) 基金合同》于 2005 年 9 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 309,568,999.66 份基金份额，其中认购资金利息折合 113,681.68 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，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

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，摩根士丹利华鑫资源优选混合型证券投资基金 (LOF) 更名为摩根士丹利资源优选混合型证券投资基金 (LOF)。

经深圳证券交易所 (以下简称“深交所”) 深证上字[2007]第 98 号文审核同意，本基金 7,579,696 份基金份额于 2007 年 7 月 5 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《摩根士丹利资源优选混合型证券投资基金 (LOF) 基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的 A 股、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下，本基金的投资组合范围为：股票投

资占基金净值的 30%-95%；债券投资占基金净值的 0%-65%；现金或到期日在一年以内的政府债券比例不低于基金资产净值的 5%。其中投资于资源类上市公司股票的比例不低于基金股票资产的 80%。自基金合同生效日至 2015 年 9 月 28 日止期间，本基金的业绩比较基准为：70%×中信标普 300 指数+30%×中信标普全债指数。根据本基金的基金管理人于 2015 年 9 月 29 日发布的《摩根士丹利华鑫基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金变更业绩比较基准及修改相关基金合同的公告》，自 2015 年 9 月 29 日起，本基金的业绩比较基准变更为：70%×沪深 300 指数收益率+30%×标普中国债券指数收益率。

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商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

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

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

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

(2) 金融负债

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

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。

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(例如它们都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逐日确认。

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，其中场外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，场内基金份额持有人只能选择现金分红。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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让

2017年12月31日前取得的基金、非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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	109,778,554.12	71,805,695.38
等于: 本金	109,756,355.42	71,791,716.31
加: 应计利息	22,198.70	13,979.07
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	109,778,554.12	71,805,695.38

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	307,407,240.35	-	294,367,177.46	-13,040,062.89
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	307,407,240.35	-	294,367,177.46	-13,040,062.89
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	432,853,202.54	-	433,468,471.54	615,269.00
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	432,853,202.54	-	433,468,471.54	615,269.00

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	233.38	364.06
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	1,122,815.16	2,909,365.16
其中：交易所市场	1,122,815.16	2,909,365.16
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	204,000.00	204,000.00
其他	700.00	700.00
合计	1,327,748.54	3,114,429.22

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	541,158,769.11	541,158,769.11
本期申购	57,163,052.50	57,163,052.50
本期赎回（以“-”号填列）	-55,169,168.87	-55,169,168.87
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	543,152,652.74	543,152,652.74

注：截至2023年12月31日止，本基金于深交所上市的基金份额为31,140,381.00份（2022年12月31日：27,531,778.00份），托管在场外未上市交易的基金份额为512,012,271.74份（2022年12月31日：513,626,991.11份）。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

7.4.7.8 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	-90,543,987.54	41,264,843.24	-49,279,144.30

度末			
本期期初	-90,543,987.54	41,264,843.24	-49,279,144.30
本期利润	-99,238,156.87	-13,655,331.89	-112,893,488.76
本期基金份额交易产生的变动数	32,033.03	387,073.89	419,106.92
其中：基金申购款	-13,424,714.49	4,278,753.81	-9,145,960.68
金赎回款	13,456,747.52	-3,891,679.92	9,565,067.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-189,750,111.38	27,996,585.24	-161,753,526.14

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	360,774.67	531,924.21
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	52,792.84	105,682.19
其他	8,328.81	14,007.06
合计	421,896.32	651,613.46

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	-97,383,592.37	-236,742,107.26
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	-97,383,592.37	-236,742,107.26

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	4,540,652,625.40	8,730,943,067.22
减：卖出股票成本 总额	4,626,756,399.22	8,944,722,881.31
减：交易费用	11,279,818.55	22,962,293.17
买卖股票差价收 入	-97,383,592.37	-236,742,107.26

7.4.7.10.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

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	-	41,642.94
债券投资收益——买卖 债券（债转股及债券到 期兑付）差价收入	-	-7,360.57
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	-	34,282.37
----	---	-----------

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	-	21,458,635.82
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-	20,999,592.20
减：应计利息总额	-	466,373.82
减：交易费用	-	30.37
买卖债券差价收入	-	-7,360.57

7.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

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	5,555,291.17	6,168,263.58
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	5,555,291.17	6,168,263.58

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	-13,655,331.89	-30,935,667.47
股票投资	-13,655,331.89	-30,935,667.47
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	-13,655,331.89	-30,935,667.47

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	22,434.68	121,330.73
合计	22,434.68	121,330.73

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	75,000.00	75,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	672.00	-
债券账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他	1,200.00	1,200.00
合计	232,872.00	232,200.00

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、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司（“中国光大银行”）	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的关联方。

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	221,933,541.31	4.10	781,730,179.85	4.49

7.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有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	162,300.41	4.10	65,207.84	2.71

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	571,675.49	4.49	35,748.04	1.23

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后的净额列示。

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	6,532,555.52	8,857,713.71
其中：应支付销售机构的客户维护 费	2,578,893.28	3,373,503.09
应支付基金管理人的净管理费	3,953,662.24	5,484,210.62

注：自2005年09月27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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}。$$

根据《摩根士丹利基金管理（中国）有限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》，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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.20\% / \text{当年天数}。$$

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	1,088,759.15	1,476,285.63

注：自2005年09月27日至2023年10月15日，支付基金托管人中国光大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《摩根士丹利基金管理（中国）有限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》，自 2023 年 10 月 16 日起，支付基金托管人中国光大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		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
中国光大银行	109,778,554.12	360,774.67	71,805,695.38	531,924.21

注：本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行保管，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，风险和收益高于债券型基金而低于股票型基金。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相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡，以实现“谋求超过业绩比较基准的投资业绩”的风险收益目标。

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行中国光大银行，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，本基金无债券投资（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 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、结算备付金及存出保证金等。

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	109,778,554.12	-	-	-	109,778,554.12
结算备付金	1,536,580.05	-	-	-	1,536,580.05
存出保证金	445,152.00	-	-	-	445,152.00
交易性金融资产	-	-	-	-294,367,177.46	294,367,177.46
应收申购款	-	-	-	151,190.45	151,190.45
资产总计	111,760,286.17	-	-	-294,518,367.91	406,278,654.08
负债					
应付赎回款	-	-	-	151,552.42	151,552.42
应付管理人报酬	-	-	-	388,013.88	388,013.88
应付托管费	-	-	-	64,668.97	64,668.97
应付清算款	-	-	-	22,756,396.47	22,756,396.47
应交税费	-	-	-	191,147.20	191,147.20
其他负债	-	-	-	1,327,748.54	1,327,748.54
负债总计	-	-	-	24,879,527.48	24,879,527.48
利率敏感度缺口	111,760,286.17	-	-	-269,638,840.43	381,399,126.60
上年度末 2022年12月31日					
资产					
货币资金	71,805,695.38	-	-	-	71,805,695.38
结算备付金	6,352,402.19	-	-	-	6,352,402.19
存出保证金	632,248.36	-	-	-	632,248.36
交易性金融资产	-	-	-	-433,468,471.54	433,468,471.54
应收申购款	-	-	-	92,064.95	92,064.95
资产总计	78,790,345.93	-	-	-433,560,536.49	512,350,882.42
负债					
应付赎回款	-	-	-	181,558.10	181,558.10
应付管理人报酬	-	-	-	635,515.43	635,515.43
应付托管费	-	-	-	105,919.25	105,919.25
应付清算款	-	-	-	16,242,688.41	16,242,688.41
应交税费	-	-	-	191,147.20	191,147.20
其他负债	-	-	-	3,114,429.22	3,114,429.22
负债总计	-	-	-	20,471,257.61	20,471,257.61
利率敏感度缺口	78,790,345.93	-	-	-413,089,278.88	491,879,624.81

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：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，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。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发行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	294,367,177.46	77.18	433,468,471.54	88.12
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	294,367,177.46	77.18	433,468,471.54	88.12

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%	14,930,000.00	25,310,000.00
业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-14,930,000.00	-25,310,000.00	

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	294,367,177.46	432,266,185.74
第二层次	-	385,863.40
第三层次	-	816,422.40
合计	294,367,177.46	433,468,471.54

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	-	816,422.40	816,422.40
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	540,274.25	540,274.25
转出第三层次	-	1,541,974.37	1,541,974.37
当期利得或损失总额	-	185,277.72	185,277.72
其中:计入损益的利得或损失	-	185,277.72	185,277.72
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	-	989,229.72	989,229.72
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	2,023,105.63	2,023,105.63
转出第三层次	-	2,687,662.55	2,687,662.55
当期利得或损失总额	-	491,749.60	491,749.60
其中:计入损益的利得或损	-	491,749.60	491,749.60

失			
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	816,422.40	816,422.40
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	-	185,044.83	185,044.83

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	816,422.40	平均价格亚式期权模型	预期波动率	23.19%-207.13%	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	294,367,177.46	72.45
	其中：股票	294,367,177.46	72.45
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	111,315,134.17	27.40
8	其他各项资产	596,342.45	0.15
9	合计	406,278,654.08	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	4,387,056.00	1.15
B	采矿业	43,898,940.00	11.51
C	制造业	183,195,156.46	48.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,152,133.00	4.23
E	建筑业	10,011,055.00	2.62
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	14,815,587.00	3.88
K	房地产业	5,015,931.00	1.32
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	14,252,839.00	3.74
N	水利、环境和公共设施管理业	2,638,480.00	0.69
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	294,367,177.46	77.18

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	601899	紫金矿业	1,129,100	14,068,586.00	3.69
2	600583	海油工程	2,307,600	13,707,144.00	3.59
3	000568	泸州老窖	63,300	11,357,286.00	2.98
4	603737	三棵树	232,800	11,083,608.00	2.91
5	002648	卫星化学	735,455	10,847,961.25	2.84
6	300737	科顺股份	1,754,900	10,775,086.00	2.83
7	002371	北方华创	41,100	10,098,681.00	2.65
8	603619	中曼石油	540,100	10,002,652.00	2.62
9	002126	银轮股份	520,200	9,712,134.00	2.55
10	603259	药明康德	128,400	9,342,384.00	2.45
11	605368	蓝天燃气	753,300	8,113,041.00	2.13
12	000543	皖能电力	1,284,200	8,039,092.00	2.11
13	603556	海兴电力	271,300	7,875,839.00	2.06
14	600276	恒瑞医药	169,800	7,680,054.00	2.01
15	600919	江苏银行	1,133,200	7,581,108.00	1.99
16	300274	阳光电源	86,200	7,550,258.00	1.98
17	300833	浩洋股份	82,900	7,469,290.00	1.96
18	601233	桐昆股份	442,200	6,690,486.00	1.75
19	002241	歌尔股份	306,000	6,429,060.00	1.69
20	601636	旗滨集团	900,837	6,161,725.08	1.62
21	002444	巨星科技	264,804	5,963,386.08	1.56
22	603699	纽威股份	418,900	5,805,954.00	1.52
23	000837	秦川机床	535,400	5,755,550.00	1.51
24	300360	炬华科技	407,767	5,570,097.22	1.46
25	600183	生益科技	288,130	5,275,660.30	1.38
26	600458	时代新材	561,900	5,175,099.00	1.36
27	002949	华阳国际	351,500	4,910,455.00	1.29
28	002984	森麒麟	158,080	4,560,608.00	1.20
29	601857	中国石油	560,400	3,956,424.00	1.04
30	601882	海天精工	150,300	3,930,345.00	1.03
31	603179	新泉股份	77,100	3,909,741.00	1.03
32	601825	沪农商行	670,200	3,846,948.00	1.01
33	601117	中国化学	602,500	3,831,900.00	1.00
34	002262	恩华药业	140,300	3,804,936.00	1.00
35	601668	中国建筑	787,500	3,787,875.00	0.99
36	688295	中复神鹰	123,603	3,746,406.93	0.98
37	688012	中微公司	23,781	3,652,761.60	0.96
38	002463	沪电股份	161,500	3,572,380.00	0.94
39	600030	中信证券	166,300	3,387,531.00	0.89
40	603477	巨星农牧	79,200	2,967,624.00	0.78
41	002752	昇兴股份	562,100	2,911,678.00	0.76
42	001979	招商蛇口	298,300	2,842,799.00	0.75
43	600475	华光环能	253,700	2,638,480.00	0.69

44	601390	中国中铁	421,000	2,391,280.00	0.63
45	002271	东方雨虹	121,200	2,327,040.00	0.61
46	603062	麦加芯彩	36,800	2,297,792.00	0.60
47	001914	招商积余	181,700	2,173,132.00	0.57
48	600256	广汇能源	303,100	2,164,134.00	0.57
49	001201	东瑞股份	58,800	1,419,432.00	0.37
50	603833	欧派家居	17,300	1,204,253.00	0.32

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	603305	旭升集团	116,040,710.62	23.59
2	002126	银轮股份	110,269,238.87	22.42
3	688599	天合光能	76,277,047.08	15.51
4	002444	巨星科技	75,931,967.27	15.44
5	600475	华光环能	75,391,872.73	15.33
6	600584	长电科技	74,422,057.13	15.13
7	600011	华能国际	67,057,019.01	13.63
8	688121	卓然股份	66,318,067.86	13.48
9	300737	科顺股份	63,228,349.69	12.85
10	603699	纽威股份	62,832,579.00	12.77
11	603197	保隆科技	59,275,571.40	12.05
12	002648	卫星化学	56,885,352.69	11.56
13	688425	铁建重工	53,718,065.72	10.92
14	688059	华锐精密	53,708,700.02	10.92
15	688183	生益电子	48,790,642.73	9.92
16	603757	大元泵业	47,222,128.84	9.60
17	688333	铂力特	45,574,408.46	9.27
18	603556	海兴电力	45,040,323.54	9.16
19	603338	浙江鼎力	42,024,268.06	8.54
20	600977	中国电影	41,309,019.06	8.40
21	601117	中国化学	39,202,360.28	7.97
22	002459	晶澳科技	38,106,049.26	7.75
23	601688	华泰证券	37,756,367.24	7.68
24	002011	盾安环境	36,797,471.00	7.48
25	600050	中国联通	36,681,744.00	7.46
26	603050	科林电气	35,870,142.92	7.29
27	601231	环旭电子	34,704,061.00	7.06
28	603738	泰晶科技	33,400,781.51	6.79
29	603043	广州酒家	33,203,996.00	6.75
30	600975	新五丰	33,086,835.87	6.73
31	600419	天润乳业	31,745,006.34	6.45

32	601636	旗滨集团	31,678,623.92	6.44
33	002965	祥鑫科技	30,802,945.18	6.26
34	603337	杰克股份	30,090,711.62	6.12
35	000543	皖能电力	29,913,800.58	6.08
36	300567	精测电子	29,784,016.00	6.06
37	001201	东瑞股份	29,648,852.73	6.03
38	002273	水晶光电	27,876,344.19	5.67
39	600863	内蒙华电	27,069,922.00	5.50
40	603081	大丰实业	26,840,657.00	5.46
41	600183	生益科技	26,808,067.30	5.45
42	001979	招商蛇口	25,470,415.93	5.18
43	300360	炬华科技	25,465,337.60	5.18
44	000913	钱江摩托	25,388,683.00	5.16
45	002984	森麒麟	25,182,292.72	5.12
46	688390	固德威	24,912,052.06	5.06
47	002949	华阳国际	23,862,819.00	4.85
48	002608	江苏国信	23,716,497.06	4.82
49	300260	新莱应材	23,548,199.56	4.79
50	601882	海天精工	23,076,025.00	4.69
51	601137	博威合金	22,909,567.35	4.66
52	001965	招商公路	22,463,792.02	4.57
53	003035	南网能源	22,407,353.00	4.56
54	688115	思林杰	22,073,562.44	4.49
55	600732	爱旭股份	21,707,919.71	4.41
56	600153	建发股份	21,556,118.38	4.38
57	002913	奥士康	21,437,083.92	4.36
58	688548	广钢气体	21,412,565.18	4.35
59	601390	中国中铁	21,364,373.00	4.34
60	603667	五洲新春	21,074,492.20	4.28
61	688167	炬光科技	20,840,439.96	4.24
62	600803	新奥股份	20,633,755.00	4.19
63	002997	瑞鹄模具	20,509,175.34	4.17
64	000988	华工科技	20,197,966.00	4.11
65	000657	中钨高新	20,008,203.20	4.07
66	601138	工业富联	19,933,887.00	4.05
67	300115	长盈精密	19,926,316.00	4.05
68	688025	杰普特	19,863,149.55	4.04
69	600461	洪城环境	19,534,910.20	3.97
70	002384	东山精密	19,451,384.00	3.95
71	688480	赛恩斯	19,381,309.16	3.94
72	300059	东方财富	19,089,894.54	3.88
73	600116	三峡水利	19,087,180.35	3.88
74	300274	阳光电源	19,041,163.00	3.87

75	688766	普冉股份	18,974,884.83	3.86
76	002156	通富微电	18,889,349.82	3.84
77	688558	国盛智科	18,871,379.11	3.84
78	300592	华凯易佰	18,317,713.00	3.72
79	603456	九洲药业	18,241,800.00	3.71
80	688032	禾迈股份	18,076,508.82	3.67
81	688308	欧科亿	18,030,682.69	3.67
82	002979	雷赛智能	17,812,323.00	3.62
83	688063	派能科技	17,542,981.19	3.57
84	003021	兆威机电	17,389,044.20	3.54
85	301030	仕净科技	17,334,502.75	3.52
86	300068	南都电源	17,016,109.00	3.46
87	600795	国电电力	16,587,695.00	3.37
88	688099	晶晨股份	16,521,184.42	3.36
89	600096	云天化	16,423,347.00	3.34
90	603565	中谷物流	15,995,383.01	3.25
91	002837	英维克	15,876,178.40	3.23
92	300476	胜宏科技	15,708,970.00	3.19
93	688378	奥来德	15,600,704.62	3.17
94	300763	锦浪科技	15,579,257.00	3.17
95	600966	博汇纸业	15,573,571.00	3.17
96	002463	沪电股份	15,536,825.80	3.16
97	002353	杰瑞股份	15,156,362.33	3.08
98	601985	中国核电	15,150,097.00	3.08
99	688048	长光华芯	15,012,147.66	3.05
100	601619	嘉泽新能	14,652,013.00	2.98
101	603737	三棵树	14,642,924.92	2.98
102	600114	东睦股份	14,616,836.52	2.97
103	600522	中天科技	14,566,172.84	2.96
104	300604	长川科技	14,515,946.02	2.95
105	300041	回天新材	14,209,515.28	2.89
106	688110	东芯股份	13,966,726.16	2.84
107	605368	蓝天燃气	13,943,083.20	2.83
108	000400	许继电气	13,921,237.00	2.83
109	601899	紫金矿业	13,751,623.00	2.80
110	600583	海油工程	13,639,346.00	2.77
111	688550	瑞联新材	13,506,690.31	2.75
112	002254	泰和新材	13,064,470.00	2.66
113	601827	三峰环境	13,054,136.00	2.65
114	688680	海优新材	12,993,618.76	2.64
115	603806	福斯特	12,586,973.20	2.56
116	002916	深南电路	12,532,404.60	2.55
117	603348	文灿股份	12,388,878.79	2.52

118	605090	九丰能源	12,386,829.10	2.52
119	002045	国光电器	12,347,729.99	2.51
120	002602	世纪华通	12,273,228.00	2.50
121	688045	必易微	12,199,823.89	2.48
122	300031	宝通科技	12,127,598.00	2.47
123	601186	中国铁建	12,060,794.00	2.45
124	688036	传音控股	11,905,378.39	2.42
125	300416	苏试试验	11,847,077.76	2.41
126	603018	华设集团	11,828,167.94	2.40
127	002993	奥海科技	11,720,906.20	2.38
128	000690	宝新能源	11,611,425.18	2.36
129	688226	威腾电气	11,585,154.31	2.36
130	603296	华勤技术	11,554,159.00	2.35
131	603129	春风动力	11,511,168.52	2.34
132	600048	保利发展	11,409,856.00	2.32
133	601800	中国交建	11,351,072.49	2.31
134	000568	泸州老窖	11,292,587.00	2.30
135	300806	斯迪克	11,270,525.67	2.29
136	603915	国茂股份	11,026,934.00	2.24
137	603619	中曼石油	10,899,775.00	2.22
138	000581	威孚高科	10,892,017.00	2.21
139	300833	浩洋股份	10,861,175.00	2.21
140	000837	秦川机床	10,626,050.00	2.16
141	603477	巨星农牧	10,603,917.28	2.16
142	300502	新易盛	10,433,061.00	2.12
143	300373	扬杰科技	10,318,547.06	2.10
144	600483	福能股份	10,229,836.91	2.08
145	000530	冰山冷热	10,226,636.00	2.08
146	688981	中芯国际	10,196,864.48	2.07
147	002555	三七互娱	10,103,363.00	2.05
148	002517	恺英网络	10,077,245.00	2.05
149	601615	明阳智能	10,064,965.00	2.05
150	002049	紫光国微	9,884,601.00	2.01

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	002126	银轮股份	125,429,911.24	25.50
2	603305	旭升集团	108,374,153.05	22.03
3	688121	卓然股份	92,645,655.54	18.84
4	688599	天合光能	90,665,330.70	18.43
5	600475	华光环能	77,089,242.71	15.67

6	600584	长电科技	75,456,731.52	15.34
7	002444	巨星科技	75,323,675.00	15.31
8	600011	华能国际	63,605,058.00	12.93
9	603197	保隆科技	60,933,763.40	12.39
10	002648	卫星化学	60,927,319.55	12.39
11	603337	杰克股份	58,774,760.02	11.95
12	603699	纽威股份	56,900,339.00	11.57
13	688059	华锐精密	51,093,015.34	10.39
14	688425	铁建重工	50,016,073.75	10.17
15	603757	大元泵业	46,569,131.88	9.47
16	688183	生益电子	46,430,042.21	9.44
17	688333	铂力特	44,325,006.65	9.01
18	300737	科顺股份	43,667,484.00	8.88
19	601636	旗滨集团	42,116,220.42	8.56
20	601117	中国化学	41,931,925.34	8.52
21	603556	海兴电力	41,219,823.20	8.38
22	002011	盾安环境	40,875,755.75	8.31
23	600977	中国电影	39,884,949.05	8.11
24	603338	浙江鼎力	39,654,616.00	8.06
25	603043	广州酒家	38,859,513.45	7.90
26	600975	新五丰	37,481,836.04	7.62
27	002459	晶澳科技	37,429,116.77	7.61
28	601688	华泰证券	35,855,974.07	7.29
29	000657	中钨高新	35,141,255.76	7.14
30	601231	环旭电子	34,787,157.64	7.07
31	600050	中国联通	34,752,550.00	7.07
32	603738	泰晶科技	34,557,029.00	7.03
33	603050	科林电气	34,279,334.49	6.97
34	000069	华侨城 A	33,517,826.00	6.81
35	001965	招商公路	33,400,200.74	6.79
36	603806	福斯特	32,791,448.70	6.67
37	002965	祥鑫科技	31,877,090.00	6.48
38	600419	天润乳业	31,601,583.27	6.42
39	300041	回天新材	31,421,513.38	6.39
40	300567	精测电子	29,914,653.00	6.08
41	600966	博汇纸业	29,818,960.00	6.06
42	601222	林洋能源	29,648,877.32	6.03
43	002273	水晶光电	29,397,860.00	5.98
44	688680	海优新材	29,293,768.37	5.96
45	002734	利民股份	28,672,252.70	5.83
46	001201	东瑞股份	27,668,406.02	5.63
47	600863	内蒙华电	26,985,641.00	5.49
48	000913	钱江摩托	26,421,995.00	5.37

49	688390	固德威	25,213,324.87	5.13
50	603081	大丰实业	24,998,678.00	5.08
51	000543	皖能电力	23,772,067.00	4.83
52	000988	华工科技	23,487,973.00	4.78
53	300260	新莱应材	22,926,969.00	4.66
54	002608	江苏国信	22,857,987.00	4.65
55	300373	扬杰科技	22,821,381.15	4.64
56	600183	生益科技	22,111,026.82	4.50
57	002913	奥士康	22,104,843.29	4.49
58	688167	炬光科技	21,987,785.74	4.47
59	603667	五洲新春	21,272,828.76	4.32
60	601137	博威合金	21,241,135.00	4.32
61	688480	赛恩斯	21,218,228.34	4.31
62	600153	建发股份	21,208,546.00	4.31
63	003035	南网能源	21,108,174.00	4.29
64	300014	亿纬锂能	20,917,464.96	4.25
65	600803	新奥股份	20,865,976.00	4.24
66	688115	思林杰	20,851,278.13	4.24
67	002979	雷赛智能	20,731,027.00	4.21
68	002984	森麒麟	20,725,241.80	4.21
69	001979	招商蛇口	20,534,572.00	4.17
70	600732	爱旭股份	20,215,235.60	4.11
71	300592	华凯易佰	19,799,847.00	4.03
72	688766	普冉股份	19,643,185.39	3.99
73	688025	杰普特	19,525,287.46	3.97
74	600461	洪城环境	19,431,818.60	3.95
75	002997	瑞鹄模具	19,371,457.07	3.94
76	003021	兆威机电	19,031,206.54	3.87
77	300623	捷捷微电	18,933,676.00	3.85
78	300360	炬华科技	18,692,885.00	3.80
79	601138	工业富联	18,673,599.00	3.80
80	603456	九洲药业	18,631,297.00	3.79
81	688548	广钢气体	18,624,341.60	3.79
82	300115	长盈精密	18,531,018.00	3.77
83	002949	华阳国际	18,463,884.00	3.75
84	688558	国盛智科	18,442,159.97	3.75
85	600116	三峡水利	18,328,811.00	3.73
86	601882	海天精工	18,245,119.00	3.71
87	002156	通富微电	18,180,268.57	3.70
88	002384	东山精密	18,018,688.00	3.66
89	300059	东方财富	17,860,858.78	3.63
90	688308	欧科亿	17,077,833.29	3.47
91	601390	中国中铁	16,924,527.00	3.44

92	301030	仕净科技	16,846,500.00	3.42
93	688032	禾迈股份	16,804,877.51	3.42
94	688063	派能科技	16,693,703.14	3.39
95	688099	晶晨股份	16,407,036.06	3.34
96	300327	中颖电子	16,234,721.53	3.30
97	600795	国电电力	16,195,254.00	3.29
98	300763	锦浪科技	16,112,311.60	3.28
99	600096	云天化	15,932,295.00	3.24
100	688378	奥来德	15,804,557.21	3.21
101	600114	东睦股份	15,730,499.00	3.20
102	300068	南都电源	15,538,392.00	3.16
103	601985	中国核电	15,402,622.00	3.13
104	301319	唯特偶	15,132,873.00	3.08
105	002353	杰瑞股份	14,920,828.00	3.03
106	300031	宝通科技	14,835,056.62	3.02
107	603565	中谷物流	14,805,620.04	3.01
108	002254	泰和新材	14,675,657.00	2.98
109	688048	长光华芯	14,503,630.06	2.95
110	300476	胜宏科技	13,936,353.85	2.83
111	601619	嘉泽新能	13,715,870.00	2.79
112	600522	中天科技	13,713,201.00	2.79
113	002837	英维克	13,684,613.92	2.78
114	688550	瑞联新材	13,682,381.35	2.78
115	688110	东芯股份	13,652,931.94	2.78
116	603915	国茂股份	13,612,253.00	2.77
117	300604	长川科技	13,132,082.15	2.67
118	601827	三峰环境	13,077,973.00	2.66
119	000400	许继电气	13,066,808.00	2.66
120	688226	威腾电气	12,423,512.41	2.53
121	603296	华勤技术	11,840,311.00	2.41
122	300416	苏试试验	11,725,089.00	2.38
123	688045	必易微	11,634,630.31	2.37
124	601877	正泰电器	11,620,071.90	2.36
125	603129	春风动力	11,575,341.00	2.35
126	002993	奥海科技	11,487,594.10	2.34
127	605090	九丰能源	11,358,807.80	2.31
128	002602	世纪华通	11,303,787.00	2.30
129	603348	文灿股份	11,240,199.00	2.29
130	002463	沪电股份	11,123,194.00	2.26
131	688608	恒玄科技	11,036,287.08	2.24
132	600048	保利发展	11,028,006.00	2.24
133	688036	传音控股	10,993,521.18	2.24
134	300274	阳光电源	10,951,209.00	2.23

135	002045	国光电器	10,848,987.00	2.21
136	000690	宝新能源	10,753,032.00	2.19
137	601800	中国交建	10,738,209.00	2.18
138	688981	中芯国际	10,673,553.89	2.17
139	002916	深南电路	10,622,010.00	2.16
140	601928	凤凰传媒	10,542,242.00	2.14
141	600483	福能股份	10,510,008.20	2.14
142	603018	华设集团	10,494,836.00	2.13
143	601186	中国铁建	10,411,692.00	2.12
144	000581	威孚高科	10,244,998.36	2.08
145	300806	斯迪克	10,209,917.32	2.08
146	000530	冰山冷热	9,859,137.00	2.00
147	300502	新易盛	9,842,021.60	2.00

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	4,501,310,437.03
卖出股票收入（成交）总额	4,540,652,625.40

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规定，本基金不参与股指期货交易。

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	445,152.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	151,190.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	596,342.45

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 (%)
28,954	18,759.16	1,937,938.20	0.36	541,214,714.54	99.64

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
----	-------	---------	-------------

1	张志中	16,436,503.00	52.7820
2	王瑛	490,000.00	1.5735
3	高德荣	464,870.00	1.4928
4	陈翠芳	400,144.00	1.2850
5	郭宁	343,100.00	1.1018
6	梁悦枝	253,160.00	0.8130
7	张泰昌	234,500.00	0.7530
8	夏建东	230,696.00	0.7408
9	孙志明	227,816.00	0.7316
10	彭惠华	222,400.00	0.7142

注：持有人为场内持有人。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	381,227.90	0.0702

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	-

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2005年9月27日） 基金份额总额	309,568,999.66
本报告期期初基金份额总额	541,158,769.11
本报告期基金总申购份额	57,163,052.50
减：本报告期基金总赎回份额	55,169,168.87
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	543,152,652.74

§ 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年度审计的报酬为75,000.00元。目前普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已连续十八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：本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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 (%)	
国盛证券	2	2,009,701,182.69	22.24	1,477,438.02	22.24	-
信达证券	1	1,496,726,068.07	16.56	1,098,619.40	16.54	-
西南证券	1	838,584,955.53	9.28	618,850.92	9.32	-
海通证券	1	772,635,710.64	8.55	569,753.93	8.58	-
国信证券	1	675,973,670.98	7.48	495,511.80	7.46	-
申万宏源	1	649,908,981.37	7.19	477,518.12	7.19	-
长江证券	1	485,077,244.	5.37	360,797.61	5.43	-

		79				
华鑫证券	1	475,102,643.70	5.26	347,438.95	5.23	-
东吴证券	1	438,804,021.03	4.86	321,127.46	4.83	-
招商证券	2	419,386,099.31	4.64	308,216.89	4.64	-
中信证券	1	314,858,774.58	3.48	230,255.07	3.47	-
银河证券	1	204,401,019.62	2.26	149,478.26	2.25	-
平安证券	1	112,550,814.33	1.25	82,307.60	1.24	-
华西证券	1	40,422,938.02	0.45	29,561.55	0.45	-
国泰君安	1	40,399,564.70	0.45	29,574.04	0.45	-
华泰证券	1	32,404,587.99	0.36	23,867.72	0.36	-
国金证券	1	30,254,388.60	0.33	22,125.15	0.33	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 专用交易单元的选择标准程序

- (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，本基金减少租用东兴证券 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

注：本基金本报告期租用证券公司交易单元未进行其他证券投资。

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	本基金基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2023年2月28日
8	本基金招募说明书（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2023年2月28日
9	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2月28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16日
11	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
12	本公司关于旗下部分基金增加嘉实财富管理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3月24日
13	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
14	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
15	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
16	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
17	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
18	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
19	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	中国证监会规定报刊及网站	2023年4月21日

	务暂停的公告		
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公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 4 月 26 日
21	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
22	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
23	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
24	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
25	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
26	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
27	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
28	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
29	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
30	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
31	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
32	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
33	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
34	本公司关于旗下部分基金参与中银国际证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 6 月 19 日
35	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
36	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
37	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
38	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
39	本基金 2023 年第二季度报告	中国证监会规定报刊及	2023 年 7 月 20 日

		网站	
40	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
41	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
42	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
43	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
44	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
45	本公司关于旗下部分基金参与金元证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 8 月 30 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 9 月 1 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 9 月 1 日
48	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
49	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
50	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
51	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
52	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
53	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
54	本公司关于旗下部分基金参与海通证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 10 月 23 日
55	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
56	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
57	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
58	本基金基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 12 月 13 日
59	本基金招募说明书 (更新)	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 12 月 13 日
60	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 12 月 13 日

61	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、中国证监会核准本基金募集的文件；
- 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