

摩根士丹利华鑫资源优选混合型证券投资 基金 (LOF) 证券投资基金 2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：摩根士丹利华鑫基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 01 月 01 日起至 06 月 30 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 | 6 |
| 2.1 基金基本情况..... | 6 |
| 2.2 基金产品说明..... | 6 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 7 |
| 2.4 信息披露方式..... | 7 |
| 2.5 其他相关资料..... | 7 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 8 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 8 |
| 3.2 基金净值表现..... | 8 |
| §4 管理人报告 | 10 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 10 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 11 |
| 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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 13 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明..... | 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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见..... | 14 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 15 |
| 6.1 资产负债表..... | 15 |
| 6.2 利润表..... | 16 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 17 |

| | |
|--|-----------|
| 6.4 报表附注..... | 18 |
| §7 投资组合报告..... | 38 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 38 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 38 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细..... | 39 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 40 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 46 |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细..... | 46 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细..... | 47 |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细..... | 47 |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细..... | 47 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 47 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 47 |
| 7.12 市场中性策略执行情况..... | 47 |
| 7.13 投资组合报告附注..... | 47 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 49 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 49 |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人..... | 49 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 49 |
| 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况..... | 49 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 50 |
| §10 重大事件揭示..... | 51 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 51 |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动..... | 51 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 51 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 51 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 51 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况..... | 51 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 51 |
| 10.8 其他重大事件..... | 53 |

| | |
|-------------------------|-----------|
| §11 备查文件目录 | 54 |
| 11.1 备查文件目录..... | 54 |
| 11.2 存放地点..... | 54 |
| 11.3 查阅方式..... | 54 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|--------------|---------------------------|
| 基金名称 | 摩根士丹利华鑫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 |
| 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 | 摩根士丹利华鑫基金管理有限公司 |
| 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 | 440,005,946.62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</p> |

| | |
|--------|---|
| | <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> |
| 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。 |

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 | | 摩根士丹利华鑫基金管理有限公司 | 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 | xxp1@msfunds.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 | | 周熙 | 李晓鹏 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 中国证券报 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.ms funds.com.cn |
| 基金中期报告备置地点 | 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 |
|--------|----------------|------------------|
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京市西城区太平桥大街 17 号 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2020年1月1日 - 2020年6月30日) |
|---------------|-----------------------------|
| 本期已实现收益 | 139,056,832.28 |
| 本期利润 | 152,798,125.97 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.3218 |
| 本期加权平均净值利润率 | 25.36% |
| 本期基金份额净值增长率 | 28.16% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2020年6月30日) |
| 期末可供分配利润 | 134,978,518.71 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.3068 |
| 期末基金资产净值 | 667,292,668.43 |
| 期末基金份额净值 | 1.5166 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2020年6月30日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 946.73% |

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。

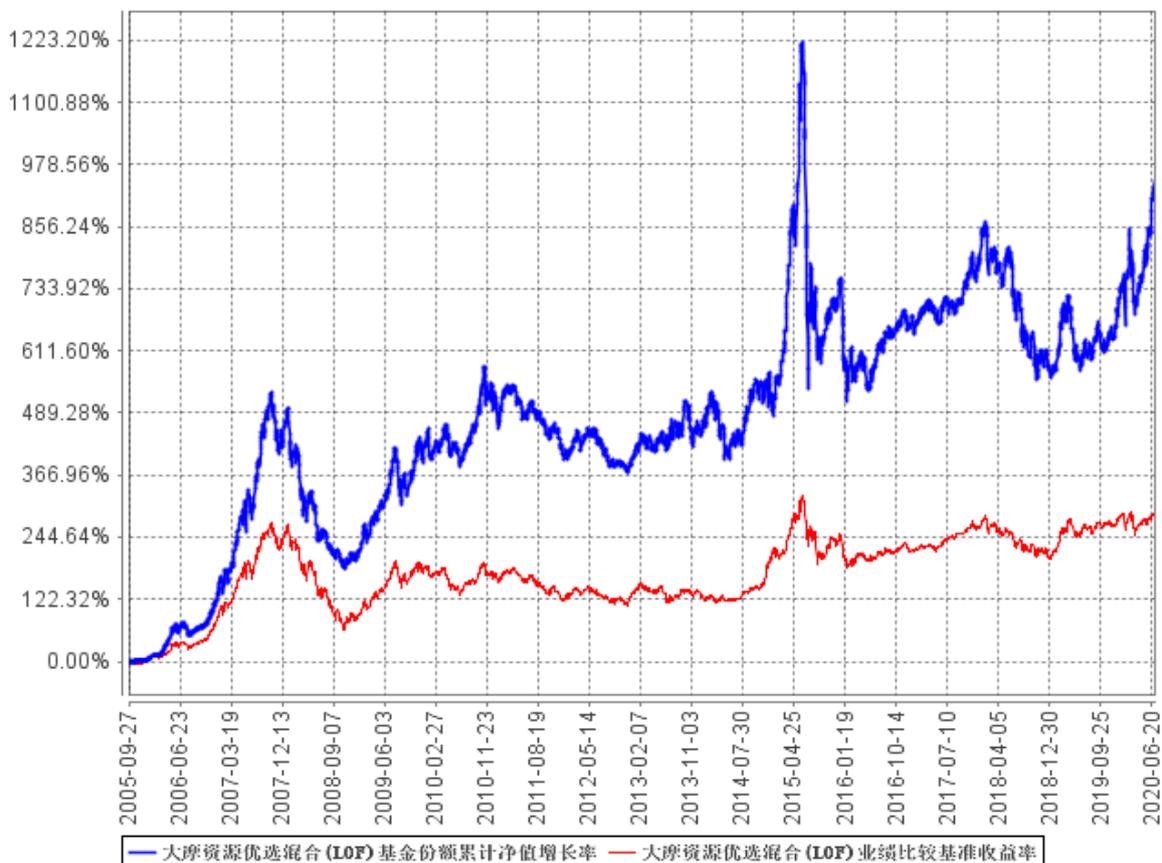
3.2 基金净值表现

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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去一个月 | 12.32% | 1.27% | 5.10% | 0.62% | 7.22% | 0.65% |
| 过去三个月 | 29.58% | 1.22% | 8.85% | 0.63% | 20.73% | 0.59% |
| 过去六个月 | 28.16% | 1.86% | 2.08% | 1.06% | 26.08% | 0.80% |
| 过去一年 | 47.10% | 1.46% | 8.00% | 0.85% | 39.10% | 0.61% |
| 过去三年 | 28.21% | 1.34% | 15.27% | 0.88% | 12.94% | 0.46% |
| 自基金合同生效起至今 | 946.73% | 1.53% | 292.43% | 1.19% | 654.30% | 0.34% |

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)基金份额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



§ 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

摩根士丹利华鑫基金管理有限公司（以下简称“公司”）是一家中外合资基金管理公司，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。公司的主要股东包括摩根士丹利国际控股公司、华鑫证券有限责任公司等国内外机构。

截止 2020 年 6 月 30 日，公司旗下共管理二十五只开放式基金，其中股票型基金 4 只，混合型基金 13 只，指数型基金 1 只，债券型基金 7 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 | | |
| 徐达 | 权益投资部总监助理、基金经理 | 2016 年 6 月 17 日 | - | 8 | 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。2016 年 6 月起担任本基金基金经理。2017 年 1 月至 2019 年 9 月担任摩根士丹利华鑫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 月担任摩根士丹利华鑫科技领先灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 |
| 齐兴方 | 研究管理部总监助理、基金经理助理 | 2017 年 11 月 17 日 | - | 5 | 北京大学工商管理硕士。曾任深圳市朗科科技股份有限公司产品开发部硬件主管工程师，联想集团 Think 事业部中国开发实验室开发工程师及项目经理。2015 年 7 月加入本公司，历任研究员，2017 年 11 月起担任本基金基金经理助理，2020 年 5 月起担任摩根士丹利华鑫领先优势混合型证券投资基金 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---------|
| | | | | | 基金经理助理。 |
|--|--|--|--|--|---------|

- 注：1、基金经理和基金经理助理的任职日期为根据本公司决定确定的聘任日期；
- 2、基金经理的任职已按规定在中国证券投资基金业协会办理完毕基金经理注册；
- 3、证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未出现基金管理人管理的所有投资组合参与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，基金管理人未发现异常交易行为。

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

2020 年一季度，市场高开低走，走势跌宕起伏。新年伊始。随着中美第一阶段贸易协议签署和 12 月金融和经济数据超预期，市场走势强劲，外盘更是屡创新高，但随着新冠疫情在国内，尤其二月后在全球范围内爆发，市场出现了戏剧性的反转，加之 OPEC 减产协议未能达成导致油价暴跌，风险资产遭到全面抛售，全球主要权益市场的跌幅均创下 08 年金融危机以来的记录。最终上证综指收跌 9.8%，深证综指收跌 3.3%，结构上看中小创显著跑赢，表现在创业板综指逆势收涨 2.1%。行业方面，农业，医药，计算机涨幅居前。通信，建材，军工也表现较好。TMT 板块虽然 3 月大幅调整，但由于前期涨幅巨大，整体还是有明显的相对收益。表现最差的行业为石化，家电，非银。石化板块受到油价下行拖累，而家电板块主要是权重白电龙头受疫情影响业绩不断下调所

致。

进入二季度，市场在深度回调后实现反转，创出年内新高。三月开局，随着新冠疫情在全球范围内持续发酵，全球金融市场陷入危机模式，油价更一度跌入负值，黄金等避险资产也出现暴跌，美元飙升，直至3月23号美联储宣布开始购买包括ETF在内的企业债券，流动性危机才得以缓解，权益市场逐步修复。A股年初以来显著跑赢外盘，主要原因在于疫情一季度就得到了有效控制，二季度叠加两会的政策利好，总体涨幅可观，最终上证综指收涨8.5%，深证综指收涨18.6%，结构上看中小创显著跑赢，表现在创业板指涨幅高达30.3%，远超大市。行业方面，餐饮旅游，医药，食品饮料涨幅居前。电子，传媒，电力设备也表现较好。疫情带来的不确定性下，市场主线集中在消费和科技板块，周期板块普遍严重跑输，比如石化，建筑，煤炭等。

本基金在上半年平均仓位维持在85%以上。从持仓结构来看，本基金倾向于均衡配置，自下而上精选个股，着重考察个股业绩增长与估值的匹配情况，周期板块中主要关注竞争格局较好的中游行业，如建材、化工等，以及具备稳定盈利能力的金融、交运和公用事业等，在消费板块中主要关注白酒、家电和家居，而在成长板块中主要关注以电子、通信、汽车为代表的先进制造业。一季度本基金主要的加仓方向是成长类行业和竣工与投资相关行业，主要是观测到：1. 全球央行进入放水模式，国内货币政策空间相应打开，无风险利率下行，成长类行业相对受益；2. 经济下行压力加大，托底政策预期提升，基建和地产产业链可能因此受益。二季度本基金主要的加仓方向是大消费板块，尤其新兴和可选消费，主要是观测到：1. 经济数据大概率在见到了底部，可选消费景气度明显回升；2. 疫情使得新兴渠道在居民消费中的占比进一步提升。本基金在半年度跑赢比较基准，主要是配置倾向于具备长期逻辑的消费和成长类行业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期截至2020年6月30日，本基金份额净值为1.5166元，累计份额净值为4.3592元，报告期内基金份额净值增长率为28.16%，同期业绩比较基准收益率为2.08%。

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2020年，我们对于市场保持谨慎乐观。短期看，虽然新冠疫情在全球范围加速扩散令市场始料未及，但随着全球央行已经正式重启放水模式，短期的流动性危机已基本解除，虽然后续可能仍有经济数据带来的二次冲击，但由于短期回调幅度巨大，系统性风险大幅降低，对于A股的不利影响也将边际减弱。中长期看，由于经济下行压力加大，通胀风险可控，国内货币政策空间进一步打开，而保险，外资，银行理财等场外资金体量仍然庞大，随着我国资本市场改革和开放的不断推进，增量资金可期。本基金短期将维持中性偏高仓位，持仓结构上维持一定弹性，以估值合理、季报数据相对靓丽的中大盘消费属性个股为主体，配合景气度相对高或有翻转潜力的

板块，如 5G，新能源汽车，消费电子，竣工和投资链条等。

4.6 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（分管基金运营部的公司领导）以及相关成员（包括研究管理部负责人、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、债券信用分析师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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人于 2020 年 1 月 14 日实施了 2019 年度分红：2019 年 12 月 31 日为收益分配基准日，利润分配权益登记日为 2020 年 1 月 14 日，每 10 份基金份额派发红利 0.160 元，分红金额为 8,218,171.63 元。本次分红金额已超过已实现收益的 60%，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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华鑫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 托管人对本中期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《摩根士丹利华鑫资源优选混合型证券投资基金(LOF)2020 年中期报告》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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：摩根士丹利华鑫资源优选混合型证券投资基金(LOF)

报告截止日：2020年6月30日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2020年6月30日 | 上年度末 2019年12月31日 |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 63,303,014.14 | 37,468,326.49 |
| 结算备付金 | | 5,038,582.50 | 3,257,150.40 |
| 存出保证金 | | 768,889.53 | 1,076,196.78 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 628,909,855.63 | 574,777,567.36 |
| 其中：股票投资 | | 628,909,855.63 | 574,346,867.36 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | 430,700.00 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | - | 15,496,623.28 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 9,641.51 | 10,449.80 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 1,479,586.66 | 296,348.60 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 699,509,569.97 | 632,382,662.71 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2020年6月30日 | 上年度末 2019年12月31日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | 22,129,433.92 | 1,235.40 |
| 应付赎回款 | | 5,176,432.31 | 2,148,858.08 |
| 应付管理人报酬 | | 777,862.54 | 769,258.91 |
| 应付托管费 | | 129,643.73 | 128,209.84 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 3,671,926.26 | 1,977,210.81 |
| 应交税费 | | 191,147.20 | 191,149.08 |

| | | | |
|---------------|----------|----------------|----------------|
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 140,455.58 | 86,320.51 |
| 负债合计 | | 32,216,901.54 | 5,302,242.63 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 440,005,946.62 | 523,090,142.72 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 227,286,721.81 | 103,990,277.36 |
| 所有者权益合计 | | 667,292,668.43 | 627,080,420.08 |
| 负债和所有者权益总计 | | 699,509,569.97 | 632,382,662.71 |

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.5166 元，基金份额总额 440,005,946.62 份。

6.2 利润表

会计主体：摩根士丹利华鑫资源优选混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|--|---|
| 一、收入 | | 169,781,474.18 | 54,011,050.02 |
| 1.利息收入 | | 234,871.65 | 360,204.48 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 234,844.13 | 360,204.48 |
| 债券利息收入 | | 27.52 | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | - |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 155,750,700.43 | 34,483,648.05 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 150,249,273.09 | 29,850,314.22 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | 140,339.52 | - |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.13.5 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.16 | 5,361,087.82 | 4,633,333.83 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 13,741,293.69 | 19,139,543.40 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18 | 54,608.41 | 27,654.09 |
| 减：二、费用 | | 16,983,348.21 | 19,201,382.03 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 4,499,229.98 | 4,589,023.43 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 749,871.64 | 764,837.20 |

| | | | |
|----------------------------|------------|----------------|---------------|
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 11,588,843.45 | 13,703,201.16 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 税金及附加 | | 0.10 | - |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.20 | 145,403.04 | 144,320.24 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 152,798,125.97 | 34,809,667.99 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 152,798,125.97 | 34,809,667.99 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：摩根士丹利华鑫资源优选混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2020年1月1日至2020年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 | | |
|--|---------------------------------|----------------|-----------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 523,090,142.72 | 103,990,277.36 | 627,080,420.08 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 152,798,125.97 | 152,798,125.97 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | -83,084,196.10 | -21,283,509.89 | -104,367,705.99 |
| 其中：1.基金申购款 | 34,376,092.11 | 8,912,752.89 | 43,288,845.00 |
| 2.基金赎回款 | -117,460,288.21 | -30,196,262.78 | -147,656,550.99 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | -8,218,171.63 | -8,218,171.63 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 440,005,946.62 | 227,286,721.81 | 667,292,668.43 |
| 项目 | 上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日 | | |

| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
|--|----------------|---------------|----------------|
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 586,466,741.94 | -5,724,622.40 | 580,742,119.54 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 34,809,667.99 | 34,809,667.99 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | -20,926,509.22 | -3,896,746.34 | -24,823,255.56 |
| 其中：1.基金申购款 | 34,719,616.01 | 2,441,388.68 | 37,161,004.69 |
| 2.基金赎回款 | -55,646,125.23 | -6,338,135.02 | -61,984,260.25 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | - | - | - |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 565,540,232.72 | 25,188,299.25 | 590,728,531.97 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

王鸿嫔
 邓寰乐
 谢先斌

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

摩根士丹利华鑫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),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,由原巨田基金管理有限公司(现已更名为摩根士丹利华鑫基金管理有限公司)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》)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华鑫基金管理有限公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

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《摩根士丹利华鑫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。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《摩根士丹利华鑫资源优选混合型证券投资基金基金合同》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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020年6月30日 |
|--------------|-------------------|
| 活期存款 | 63,303,014.14 |
| 定期存款 | - |
| 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 | - |
| 合计： | 63,303,014.14 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020年6月30日 | | |
|-------------------|-------------------|----------------|---------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 562,591,602.35 | 628,909,855.63 | 66,318,253.28 |
| 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 | 562,591,602.35 | 628,909,855.63 | 66,318,253.28 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 7,289.54 |
| 应收定期存款利息 | - |
| 应收其他存款利息 | - |
| 应收结算备付金利息 | 2,040.57 |
| 应收债券利息 | - |
| 应收资产支持证券利息 | - |
| 应收买入返售证券利息 | - |
| 应收申购款利息 | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 应收出借证券利息 | - |
| 其他 | 311.40 |
| 合计 | 9,641.51 |

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 3,671,226.26 |
| 银行间市场应付交易费用 | 700.00 |
| 合计 | 3,671,926.26 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 4,652.54 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 预提费用 | 135,803.04 |
| 合计 | 140,455.58 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|-----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 523,090,142.72 | 523,090,142.72 |
| 本期申购 | 34,376,092.11 | 34,376,092.11 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -117,460,288.21 | -117,460,288.21 |
| 本期末 | 440,005,946.62 | 440,005,946.62 |

注：1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 截至2020年6月30日止，本基金于深交所上市的基金份额为9,194,963.00份，托管在场外未上市交易的基金份额为430,810,983.62。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。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 上年度末 | 13,453,862.65 | 90,536,414.71 | 103,990,277.36 |
| 本期利润 | 139,056,832.28 | 13,741,293.69 | 152,798,125.97 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -9,314,004.59 | -11,969,505.30 | -21,283,509.89 |
| 其中：基金申购款 | 3,840,457.54 | 5,072,295.35 | 8,912,752.89 |
| 基金赎回款 | -13,154,462.13 | -17,041,800.65 | -30,196,262.78 |
| 本期已分配利润 | -8,218,171.63 | - | -8,218,171.63 |
| 本期末 | 134,978,518.71 | 92,308,203.10 | 227,286,721.81 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入 | 182,927.78 |
| 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 | 45,252.80 |
| 其他 | 6,663.55 |
| 合计 | 234,844.13 |

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 4,004,772,544.62 |
| 减：卖出股票成本总额 | 3,854,523,271.53 |
| 买卖股票差价收入 | 150,249,273.09 |

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|-------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 140,339.52 |
| 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 | 140,339.52 |

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 571,127.31 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 430,700.00 |
| 减：应收利息总额 | 87.79 |

| | |
|----------|------------|
| 买卖债券差价收入 | 140,339.52 |
|----------|------------|

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 5,361,087.82 |
| 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 | 5,361,087.82 |

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|----------------------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 13,741,293.69 |
| ——股票投资 | 13,741,293.69 |
| ——债券投资 | - |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——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 | 13,741,293.69 |

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 54,608.41 |
| 基金转换费收入 | - |
| 合计 | 54,608.41 |

注：本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。不低于赎回费用的 25% 归入基金资产，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 11,588,843.45 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 合计 | 11,588,843.45 |

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用 | 37,295.44 |
| 信息披露费 | 59,672.34 |
| 证券出借违约金 | - |
| 上市费 | 29,835.26 |
| 债券账户维护费 | 18,000.00 |
| 其他 | 600.00 |
| 合计 | 145,403.04 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|------------------------|-----------------|
| 摩根士丹利华鑫基金管理有限公司 | 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 |
| 华鑫证券有限责任公司（“华鑫证券”） | 基金管理人的股东、基金销售机构 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 | | 上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30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 | 628,782,514.35 | 7.97% | 950,743,046.53 | 10.08% |

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30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 | 585,585.94 | 8.55% | 585,585.94 | 15.95% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30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 | 885,425.58 | 10.86% | 101,365.94 | 2.83% |
|------|------------|--------|------------|-------|

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日至2020年6月 30日 | 上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 4,499,229.98 | 4,589,023.43 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,000,610.71 | 1,019,189.71 |

注：支付基金管理人摩根士丹利华鑫基金管理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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 | 上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日 |
|----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 749,871.64 | 764,837.20 |

注：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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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。

6.4.10.4 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

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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 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 2020年1月1日至2020年6月30日 | | 上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日 | |
|--------|----------------------------|------------|---------------------------------|------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国光大银行 | 63,303,014.14 | 182,927.78 | 47,508,321.72 | 286,266.98 |

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。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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。

6.4.10.8 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。

6.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 权益登记日 | 除息日 | | 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 | 本期利润分配 合计 | 备注 |
|----|------------|------------|------------|---------------------|--------------|---------------|--------------|----|
| | | 场内 | 场外 | | | | | |
| 1 | 2020年1月14日 | 2020年1月15日 | 2020年1月14日 | 0.1600 | 3,687,965.52 | 4,530,206.11 | 8,218,171.63 | |
| 合计 | - | - | - | 0.1600 | 3,687,965.52 | 4,530,206.11 | 8,218,171.63 | |

6.4.12 期末（2020年6月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|----|----|----|----|----|-----|----|----|--------|----|
| 证券 | 证券 | 成功 | 可流 | 流通 | 认购 | 期末估 | 数量 | 期末 | 期末估值总额 | 备注 |

| 代码 | 名称 | 认购日 | 通日 | 受限类型 | 价格 | 值单价 | (单位:股) | 成本总额 | | |
|--------|------|------------|-------------|--------|-------|-------|--------|--------------|--------------|---|
| 688266 | 泽璟制药 | 2020年1月16日 | 2020年7月23日 | 新股流通受限 | 33.76 | 81.66 | 31,016 | 1,047,100.16 | 2,532,766.56 | - |
| 688106 | 金宏气体 | 2020年6月9日 | 2020年12月16日 | 新股流通受限 | 15.48 | 41.36 | 23,914 | 370,188.72 | 989,083.04 | - |
| 688159 | 有方科技 | 2020年1月16日 | 2020年7月23日 | 新股流通受限 | 20.35 | 52.73 | 3,341 | 67,989.35 | 176,170.93 | - |
| 688377 | 迪威尔 | 2020年6月29日 | 2020年7月8日 | 新股流通受限 | 16.42 | 16.42 | 7,894 | 129,619.48 | 129,619.48 | - |
| 300847 | 中船汉光 | 2020年6月29日 | 2020年7月9日 | 新股流通受限 | 6.94 | 6.94 | 1,421 | 9,861.74 | 9,861.74 | - |
| 300845 | 捷安高科 | 2020年6月24日 | 2020年7月3日 | 新股流通受限 | 17.63 | 17.63 | 470 | 8,286.10 | 8,286.10 | - |
| 300843 | 胜蓝股份 | 2020年6月23日 | 2020年7月2日 | 新股流通受限 | 10.01 | 10.01 | 751 | 7,517.51 | 7,517.51 | - |
| 300846 | 首都在线 | 2020年6月22日 | 2020年7月1日 | 新股流通受限 | 3.37 | 3.37 | 1,131 | 3,811.47 | 3,811.47 | - |

注：根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，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信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是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，前者负责合规及运营风险管理，后者主要负责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。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人

出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国光大银行，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 2020 年 6 月 30 日，本基金无债券投资 (2019 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占基金资产净值的比例为 0.07%)。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2020 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司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 6.4.12。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2020 年 6 月 30 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 2020 年 6 月 30 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。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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、存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2020年6月30 日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|-------------------------|---------------|------|------------|----------------|----------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 63,303,014.14 | - | - | - | 63,303,014.14 |
| 结算备付金 | 5,038,582.50 | - | - | - | 5,038,582.50 |
| 存出保证金 | 768,889.53 | - | - | - | 768,889.53 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 628,909,855.63 | 628,909,855.63 |
| 应收利息 | - | - | - | 9,641.51 | 9,641.51 |
| 应收申购款 | - | - | - | 1,479,586.66 | 1,479,586.66 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 69,110,486.17 | - | - | 630,399,083.80 | 699,509,569.97 |
| 负债 | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 22,129,433.92 | 22,129,433.92 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 5,176,432.31 | 5,176,432.31 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 777,862.54 | 777,862.54 |
| 应付托管费 | - | - | - | 129,643.73 | 129,643.73 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 3,671,926.26 | 3,671,926.26 |
| 应交税费 | - | - | - | 191,147.20 | 191,147.20 |
| 其他负债 | - | - | - | 140,455.58 | 140,455.58 |
| 负债总计 | - | - | - | 32,216,901.54 | 32,216,901.54 |
| 利率敏感度缺口 | 69,110,486.17 | - | - | 598,182,182.26 | 667,292,668.43 |
| 上年度末 2019年12月31 日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 37,468,326.49 | - | - | - | 37,468,326.49 |
| 结算备付金 | 3,257,150.40 | - | - | - | 3,257,150.40 |
| 存出保证金 | 1,076,196.78 | - | - | - | 1,076,196.78 |
| 交易性金融资 | - | - | 430,700.00 | 574,346,867.36 | 574,777,567.36 |

| | | | | | |
|---------|---------------|---|------------|----------------|----------------|
| 产 | | | | | |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 15,496,623.28 | 15,496,623.28 |
| 应收利息 | - | - | - | 10,449.80 | 10,449.80 |
| 应收申购款 | 497.02 | - | - | 295,851.58 | 296,348.60 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 41,802,170.69 | - | 430,700.00 | 590,149,792.02 | 632,382,662.71 |
| 负债 | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 1,235.40 | 1,235.40 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 2,148,858.08 | 2,148,858.08 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 769,258.91 | 769,258.91 |
| 应付托管费 | - | - | - | 128,209.84 | 128,209.84 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 1,977,210.81 | 1,977,210.81 |
| 应交税费 | - | - | - | 191,149.08 | 191,149.08 |
| 其他负债 | - | - | - | 86,320.51 | 86,320.51 |
| 负债总计 | - | - | - | 5,302,242.63 | 5,302,242.63 |
| 利率敏感度缺口 | 41,802,170.69 | - | 430,700.00 | 584,847,549.39 | 627,080,420.08 |

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2020 年 6 月 30 日，本基金无债券投资(2019 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占基金资产净值的比例为 0.07%)。因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2019 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2019 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 | 628,909,855.63 | 94.25 | 574,346,867.36 | 91.59 |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—债券投资 | - | - | - | - |
| 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 | 628,909,855.63 | 94.25 | 574,346,867.36 | 91.59 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩比较基准(附注 6.4.1)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) | |
| | | 本期末(2020年6月30日) | 上年度末(2019年12月31日) |
| | 业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5% | 45,600,000.00 | 35,420,000.00 |
| 业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5% | -45,600,000.00 | -35,420,000.00 | |

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 6 月 30 日，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中属于第一层次的余额为 625,052,738.80 元，属于第二层次的余额为 3,857,116.83 元，无属于第三层次的余额(2019 年 12 月 31 日：第一层次 571,385,997.50 元，第二层次 3,391,569.86 元，无属于第三层次的余额)。

(ii) 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。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2019 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 628,909,855.63 | 89.91 |
| | 其中：股票 | 628,909,855.63 | 89.91 |
| 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 | 68,341,596.64 | 9.77 |
| 8 | 其他各项资产 | 2,258,117.70 | 0.32 |
| 9 | 合计 | 699,509,569.97 | 100.00 |

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|----------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 33,711,797.83 | 5.05 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 560,599,336.41 | 84.01 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 12,766.32 | 0.00 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 27,762,426.07 | 4.16 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 6,823,529.00 | 1.02 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |

| | | | |
|---|-----------|----------------|-------|
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 628,909,855.63 | 94.25 |

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 000333 | 美的集团 | 555,279 | 33,200,131.41 | 4.98 |
| 2 | 600132 | 重庆啤酒 | 440,927 | 32,187,671.00 | 4.82 |
| 3 | 000513 | 丽珠集团 | 626,637 | 30,084,842.37 | 4.51 |
| 4 | 000895 | 双汇发展 | 541,600 | 24,962,344.00 | 3.74 |
| 5 | 600745 | 闻泰科技 | 189,000 | 23,804,550.00 | 3.57 |
| 6 | 002242 | 九阳股份 | 614,232 | 22,892,426.64 | 3.43 |
| 7 | 002609 | 捷顺科技 | 1,690,454 | 21,553,288.50 | 3.23 |
| 8 | 002511 | 中顺洁柔 | 946,857 | 21,114,911.10 | 3.16 |
| 9 | 300750 | 宁德时代 | 120,400 | 20,992,944.00 | 3.15 |
| 10 | 002299 | 圣农发展 | 709,670 | 20,580,430.00 | 3.08 |
| 11 | 600966 | 博汇纸业 | 2,005,892 | 20,359,803.80 | 3.05 |
| 12 | 300737 | 科顺股份 | 1,011,022 | 19,947,464.06 | 2.99 |
| 13 | 002798 | 帝欧家居 | 608,517 | 19,758,546.99 | 2.96 |
| 14 | 600309 | 万华化学 | 344,854 | 17,239,251.46 | 2.58 |
| 15 | 688208 | 道通科技 | 299,554 | 16,939,778.70 | 2.54 |
| 16 | 600600 | 青岛啤酒 | 207,291 | 15,857,761.50 | 2.38 |
| 17 | 603596 | 伯特利 | 433,426 | 15,256,595.20 | 2.29 |
| 18 | 300558 | 贝达药业 | 108,900 | 15,243,822.00 | 2.28 |
| 19 | 300014 | 亿纬锂能 | 315,738 | 15,108,063.30 | 2.26 |
| 20 | 002241 | 歌尔股份 | 498,700 | 14,641,832.00 | 2.19 |
| 21 | 600862 | 中航高科 | 837,106 | 14,163,833.52 | 2.12 |
| 22 | 002601 | 龙蟠佰利 | 753,400 | 13,937,900.00 | 2.09 |
| 23 | 002332 | 仙琚制药 | 821,350 | 13,831,534.00 | 2.07 |
| 24 | 002007 | 华兰生物 | 274,900 | 13,775,239.00 | 2.06 |
| 25 | 603369 | 今世缘 | 344,738 | 13,717,125.02 | 2.06 |
| 26 | 600584 | 长电科技 | 438,200 | 13,702,514.00 | 2.05 |
| 27 | 002938 | 鹏鼎控股 | 267,300 | 13,381,038.00 | 2.01 |
| 28 | 002982 | 湘佳股份 | 127,353 | 13,131,367.83 | 1.97 |
| 29 | 603801 | 志邦家居 | 453,100 | 12,093,239.00 | 1.81 |
| 30 | 000860 | 顺鑫农业 | 188,660 | 10,749,846.80 | 1.61 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 31 | 600315 | 上海家化 | 206,200 | 9,876,980.00 | 1.48 |
| 32 | 000915 | 山大华特 | 282,052 | 9,237,203.00 | 1.38 |
| 33 | 002214 | 大立科技 | 311,200 | 8,769,616.00 | 1.31 |
| 34 | 688396 | 华润微 | 159,881 | 6,945,230.64 | 1.04 |
| 35 | 601888 | 中国中免 | 44,300 | 6,823,529.00 | 1.02 |
| 36 | 002414 | 高德红外 | 230,800 | 6,757,824.00 | 1.01 |
| 37 | 600346 | 恒力石化 | 467,000 | 6,538,000.00 | 0.98 |
| 38 | 600183 | 生益科技 | 214,375 | 6,274,756.25 | 0.94 |
| 39 | 600037 | 歌华有线 | 407,700 | 6,197,040.00 | 0.93 |
| 40 | 688200 | 华峰测控 | 11,441 | 3,274,986.25 | 0.49 |
| 41 | 688266 | 泽璟制药 | 31,016 | 2,532,766.56 | 0.38 |
| 42 | 688106 | 金宏气体 | 23,914 | 989,083.04 | 0.15 |
| 43 | 688159 | 有方科技 | 3,341 | 176,170.93 | 0.03 |
| 44 | 688377 | 迪威尔 | 7,894 | 129,619.48 | 0.02 |
| 45 | 603087 | 甘李药业 | 1,076 | 107,922.80 | 0.02 |
| 46 | 300824 | 北鼎股份 | 1,954 | 26,789.34 | 0.00 |
| 47 | 600956 | 新天绿能 | 2,533 | 12,766.32 | 0.00 |
| 48 | 300847 | 中船汉光 | 1,421 | 9,861.74 | 0.00 |
| 49 | 300845 | 捷安高科 | 470 | 8,286.10 | 0.00 |
| 50 | 300843 | 胜蓝股份 | 751 | 7,517.51 | 0.00 |
| 51 | 300846 | 首都在线 | 1,131 | 3,811.47 | 0.00 |

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1 | 000895 | 双汇发展 | 93,831,218.96 | 14.96 |
| 2 | 603596 | 伯特利 | 86,322,178.57 | 13.77 |
| 3 | 300059 | 东方财富 | 75,116,684.22 | 11.98 |
| 4 | 002241 | 歌尔股份 | 73,117,849.97 | 11.66 |
| 5 | 600183 | 生益科技 | 71,267,154.84 | 11.36 |
| 6 | 000513 | 丽珠集团 | 71,198,464.93 | 11.35 |
| 7 | 002299 | 圣农发展 | 70,791,547.35 | 11.29 |
| 8 | 000333 | 美的集团 | 60,916,109.79 | 9.71 |
| 9 | 002332 | 仙琚制药 | 59,894,425.43 | 9.55 |
| 10 | 300737 | 科顺股份 | 59,352,777.25 | 9.46 |

| | | | | |
|----|--------|--------|---------------|------|
| 11 | 600315 | 上海家化 | 59,271,746.53 | 9.45 |
| 12 | 600862 | 中航高科 | 57,775,905.68 | 9.21 |
| 13 | 300316 | 晶盛机电 | 57,608,093.00 | 9.19 |
| 14 | 000063 | 中兴通讯 | 57,213,890.37 | 9.12 |
| 15 | 002648 | 卫星石化 | 56,820,053.81 | 9.06 |
| 16 | 300623 | 捷捷微电 | 55,720,652.65 | 8.89 |
| 17 | 002798 | 帝欧家居 | 53,855,116.40 | 8.59 |
| 18 | 000739 | 普洛药业 | 53,163,375.69 | 8.48 |
| 19 | 002511 | 中顺洁柔 | 52,287,952.21 | 8.34 |
| 20 | 002127 | 南极电商 | 50,780,469.64 | 8.10 |
| 21 | 002242 | 九阳股份 | 48,744,503.44 | 7.77 |
| 22 | 600640 | 号百控股 | 48,145,703.93 | 7.68 |
| 23 | 002609 | 捷顺科技 | 47,525,491.62 | 7.58 |
| 24 | 300750 | 宁德时代 | 46,912,573.00 | 7.48 |
| 25 | 002602 | 世纪华通 | 46,901,680.69 | 7.48 |
| 26 | 600132 | 重庆啤酒 | 45,196,695.06 | 7.21 |
| 27 | 603369 | 今世缘 | 43,876,492.49 | 7.00 |
| 28 | 300590 | 移为通信 | 43,420,162.00 | 6.92 |
| 29 | 000100 | TCL 科技 | 43,291,491.16 | 6.90 |
| 30 | 600600 | 青岛啤酒 | 41,835,741.37 | 6.67 |
| 31 | 600309 | 万华化学 | 41,398,354.37 | 6.60 |
| 32 | 600276 | 恒瑞医药 | 39,338,970.44 | 6.27 |
| 33 | 688368 | 晶丰明源 | 37,964,365.65 | 6.05 |
| 34 | 601888 | 中国中免 | 37,540,692.66 | 5.99 |
| 35 | 600597 | 光明乳业 | 36,415,257.00 | 5.81 |
| 36 | 603801 | 志邦家居 | 36,142,314.75 | 5.76 |
| 37 | 688020 | 方邦股份 | 35,843,509.09 | 5.72 |
| 38 | 600699 | 均胜电子 | 35,662,178.36 | 5.69 |
| 39 | 002705 | 新宝股份 | 35,014,402.72 | 5.58 |
| 40 | 000002 | 万 科 A | 34,778,051.36 | 5.55 |
| 41 | 603606 | 东方电缆 | 34,123,835.74 | 5.44 |
| 42 | 000975 | 银泰黄金 | 33,346,183.82 | 5.32 |
| 43 | 002959 | 小熊电器 | 32,655,096.00 | 5.21 |
| 44 | 002982 | 湘佳股份 | 31,682,758.59 | 5.05 |
| 45 | 002007 | 华兰生物 | 31,484,574.93 | 5.02 |
| 46 | 300327 | 中颖电子 | 30,424,333.72 | 4.85 |

| | | | | |
|----|--------|-------|---------------|------|
| 47 | 600258 | 首旅酒店 | 30,205,437.58 | 4.82 |
| 48 | 002384 | 东山精密 | 29,721,917.63 | 4.74 |
| 49 | 002084 | 海鸥住工 | 29,427,534.01 | 4.69 |
| 50 | 601233 | 桐昆股份 | 28,526,246.10 | 4.55 |
| 51 | 603019 | 中科曙光 | 28,493,663.00 | 4.54 |
| 52 | 688200 | 华峰测控 | 28,088,550.45 | 4.48 |
| 53 | 600745 | 闻泰科技 | 27,879,879.16 | 4.45 |
| 54 | 600887 | 伊利股份 | 27,603,318.90 | 4.40 |
| 55 | 002515 | 金字火腿 | 27,240,467.60 | 4.34 |
| 56 | 002815 | 崇达技术 | 27,161,297.86 | 4.33 |
| 57 | 600703 | 三安光电 | 26,831,327.36 | 4.28 |
| 58 | 600966 | 博汇纸业 | 26,754,278.80 | 4.27 |
| 59 | 002695 | 煌上煌 | 26,424,058.05 | 4.21 |
| 60 | 601231 | 环旭电子 | 26,391,374.55 | 4.21 |
| 61 | 002508 | 老板电器 | 25,747,917.25 | 4.11 |
| 62 | 000860 | 顺鑫农业 | 25,657,529.00 | 4.09 |
| 63 | 300558 | 贝达药业 | 25,562,270.75 | 4.08 |
| 64 | 688208 | 道通科技 | 24,307,484.09 | 3.88 |
| 65 | 603737 | 三棵树 | 23,758,285.11 | 3.79 |
| 66 | 300010 | 立思辰 | 23,198,538.93 | 3.70 |
| 67 | 002291 | 星期六 | 23,196,334.00 | 3.70 |
| 68 | 002597 | 金禾实业 | 23,164,229.50 | 3.69 |
| 69 | 002601 | 龙麟佰利 | 22,786,382.10 | 3.63 |
| 70 | 300580 | 贝斯特 | 20,911,083.00 | 3.33 |
| 71 | 600456 | 宝钛股份 | 20,779,444.00 | 3.31 |
| 72 | 000011 | 深物业 A | 20,011,250.00 | 3.19 |
| 73 | 688111 | 金山办公 | 19,971,126.22 | 3.18 |
| 74 | 300136 | 信维通信 | 19,062,656.00 | 3.04 |
| 75 | 002970 | 锐明技术 | 18,962,236.82 | 3.02 |
| 76 | 603816 | 顾家家居 | 18,860,034.00 | 3.01 |
| 77 | 603661 | 恒林股份 | 18,769,063.00 | 2.99 |
| 78 | 300014 | 亿纬锂能 | 18,277,011.49 | 2.91 |
| 79 | 300033 | 同花顺 | 17,868,693.30 | 2.85 |
| 80 | 300258 | 精锻科技 | 17,824,532.73 | 2.84 |
| 81 | 300398 | 飞凯材料 | 17,603,700.12 | 2.81 |
| 82 | 600419 | 天润乳业 | 17,456,367.90 | 2.78 |

| | | | | |
|-----|--------|------|---------------|------|
| 83 | 300284 | 苏交科 | 17,288,080.43 | 2.76 |
| 84 | 600933 | 爱柯迪 | 16,643,106.00 | 2.65 |
| 85 | 601933 | 永辉超市 | 16,549,623.18 | 2.64 |
| 86 | 002032 | 苏泊尔 | 16,329,735.72 | 2.60 |
| 87 | 002460 | 赣锋锂业 | 16,198,021.00 | 2.58 |
| 88 | 002425 | 凯撒文化 | 16,061,000.56 | 2.56 |
| 89 | 603883 | 老百姓 | 15,953,410.00 | 2.54 |
| 90 | 688388 | 嘉元科技 | 15,748,463.83 | 2.51 |
| 91 | 002938 | 鹏鼎控股 | 15,672,618.00 | 2.50 |
| 92 | 300450 | 先导智能 | 15,396,792.00 | 2.46 |
| 93 | 300383 | 光环新网 | 15,165,079.00 | 2.42 |
| 94 | 300113 | 顺网科技 | 15,044,745.00 | 2.40 |
| 95 | 002859 | 洁美科技 | 14,938,778.00 | 2.38 |
| 96 | 300673 | 佩蒂股份 | 14,928,729.40 | 2.38 |
| 97 | 000915 | 山大华特 | 14,904,624.36 | 2.38 |
| 98 | 002212 | 南洋股份 | 14,873,712.00 | 2.37 |
| 99 | 000028 | 国药一致 | 14,553,941.00 | 2.32 |
| 100 | 000538 | 云南白药 | 14,498,502.16 | 2.31 |
| 101 | 002449 | 国星光电 | 14,349,118.51 | 2.29 |
| 102 | 002507 | 涪陵榨菜 | 14,338,437.39 | 2.29 |
| 103 | 600584 | 长电科技 | 12,887,573.90 | 2.06 |
| 104 | 600522 | 中天科技 | 12,747,593.78 | 2.03 |
| 105 | 300122 | 智飞生物 | 12,600,189.27 | 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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|--------|---------------|----------------|
| 1 | 300623 | 捷捷微电 | 83,747,840.15 | 13.36 |
| 2 | 002648 | 卫星石化 | 83,392,815.92 | 13.30 |
| 3 | 000895 | 双汇发展 | 83,085,584.21 | 13.25 |
| 4 | 000100 | TCL 科技 | 75,802,696.96 | 12.09 |
| 5 | 300059 | 东方财富 | 74,873,420.49 | 11.94 |
| 6 | 603596 | 伯特利 | 71,868,032.43 | 11.46 |
| 7 | 002602 | 世纪华通 | 65,593,554.38 | 10.46 |
| 8 | 002241 | 歌尔股份 | 65,205,078.81 | 10.40 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|-------|
| 9 | 600183 | 生益科技 | 64,387,968.64 | 10.27 |
| 10 | 000063 | 中兴通讯 | 63,890,273.40 | 10.19 |
| 11 | 600315 | 上海家化 | 58,874,347.71 | 9.39 |
| 12 | 300316 | 晶盛机电 | 56,918,966.85 | 9.08 |
| 13 | 000002 | 万科A | 56,086,729.22 | 8.94 |
| 14 | 000513 | 丽珠集团 | 54,360,985.17 | 8.67 |
| 15 | 000739 | 普洛药业 | 53,604,401.98 | 8.55 |
| 16 | 300750 | 宁德时代 | 53,296,255.10 | 8.50 |
| 17 | 002299 | 圣农发展 | 52,186,546.48 | 8.32 |
| 18 | 002332 | 仙琚制药 | 50,153,635.67 | 8.00 |
| 19 | 002127 | 南极电商 | 47,940,115.47 | 7.64 |
| 20 | 002695 | 煌上煌 | 46,155,957.89 | 7.36 |
| 21 | 600132 | 重庆啤酒 | 45,424,105.56 | 7.24 |
| 22 | 600640 | 号百控股 | 45,372,081.49 | 7.24 |
| 23 | 600862 | 中航高科 | 44,913,838.10 | 7.16 |
| 24 | 300737 | 科顺股份 | 43,812,894.00 | 6.99 |
| 25 | 300590 | 移为通信 | 42,433,752.93 | 6.77 |
| 26 | 000651 | 格力电器 | 41,400,706.70 | 6.60 |
| 27 | 002597 | 金禾实业 | 41,280,733.22 | 6.58 |
| 28 | 600276 | 恒瑞医药 | 40,926,656.51 | 6.53 |
| 29 | 002212 | 南洋股份 | 40,149,196.30 | 6.40 |
| 30 | 002798 | 帝欧家居 | 39,370,869.10 | 6.28 |
| 31 | 002511 | 中顺洁柔 | 39,275,956.76 | 6.26 |
| 32 | 600258 | 首旅酒店 | 38,771,003.07 | 6.18 |
| 33 | 002959 | 小熊电器 | 38,430,568.05 | 6.13 |
| 34 | 600597 | 光明乳业 | 38,326,720.77 | 6.11 |
| 35 | 002353 | 杰瑞股份 | 38,150,020.95 | 6.08 |
| 36 | 688368 | 晶丰明源 | 37,206,713.72 | 5.93 |
| 37 | 600699 | 均胜电子 | 36,218,439.30 | 5.78 |
| 38 | 300136 | 信维通信 | 35,396,607.56 | 5.64 |
| 39 | 603606 | 东方电缆 | 34,537,276.98 | 5.51 |
| 40 | 002705 | 新宝股份 | 34,497,700.89 | 5.50 |
| 41 | 688020 | 方邦股份 | 34,189,286.73 | 5.45 |
| 42 | 002084 | 海鸥住工 | 33,938,373.64 | 5.41 |
| 43 | 000975 | 银泰黄金 | 33,496,608.48 | 5.34 |
| 44 | 000538 | 云南白药 | 33,170,124.35 | 5.29 |
| 45 | 600383 | 金地集团 | 33,159,039.15 | 5.29 |
| 46 | 601888 | 中国中免 | 32,189,053.04 | 5.13 |

| | | | | |
|----|--------|-------|---------------|------|
| 47 | 600600 | 青岛啤酒 | 32,137,855.30 | 5.12 |
| 48 | 002425 | 凯撒文化 | 31,658,119.79 | 5.05 |
| 49 | 000333 | 美的集团 | 31,385,066.44 | 5.00 |
| 50 | 300327 | 中颖电子 | 31,231,631.98 | 4.98 |
| 51 | 600703 | 三安光电 | 31,058,209.22 | 4.95 |
| 52 | 002242 | 九阳股份 | 30,733,222.37 | 4.90 |
| 53 | 603369 | 今世缘 | 30,141,891.03 | 4.81 |
| 54 | 603737 | 三棵树 | 30,029,211.04 | 4.79 |
| 55 | 002609 | 捷顺科技 | 28,342,457.00 | 4.52 |
| 56 | 002384 | 东山精密 | 28,234,411.18 | 4.50 |
| 57 | 002507 | 涪陵榨菜 | 27,744,922.96 | 4.42 |
| 58 | 603019 | 中科曙光 | 27,264,294.83 | 4.35 |
| 59 | 600887 | 伊利股份 | 27,207,192.10 | 4.34 |
| 60 | 002515 | 金字火腿 | 27,086,340.96 | 4.32 |
| 61 | 002508 | 老板电器 | 26,237,601.79 | 4.18 |
| 62 | 601233 | 桐昆股份 | 26,120,421.48 | 4.17 |
| 63 | 601231 | 环旭电子 | 25,926,273.62 | 4.13 |
| 64 | 002815 | 崇达技术 | 25,068,053.96 | 4.00 |
| 65 | 600309 | 万华化学 | 24,634,868.79 | 3.93 |
| 66 | 688200 | 华峰测控 | 24,165,299.55 | 3.85 |
| 67 | 300450 | 先导智能 | 24,090,233.19 | 3.84 |
| 68 | 002291 | 星期六 | 23,882,193.73 | 3.81 |
| 69 | 002449 | 国星光电 | 23,701,014.83 | 3.78 |
| 70 | 002982 | 湘佳股份 | 23,372,384.81 | 3.73 |
| 71 | 002460 | 赣锋锂业 | 23,281,199.86 | 3.71 |
| 72 | 002007 | 华兰生物 | 22,675,200.18 | 3.62 |
| 73 | 000011 | 深物业 A | 22,495,400.95 | 3.59 |
| 74 | 603801 | 志邦家居 | 22,396,015.33 | 3.57 |
| 75 | 002601 | 龙麟佰利 | 22,239,960.06 | 3.55 |
| 76 | 300558 | 贝达药业 | 21,881,207.22 | 3.49 |
| 77 | 000028 | 国药一致 | 20,907,955.05 | 3.33 |
| 78 | 688111 | 金山办公 | 20,901,720.64 | 3.33 |
| 79 | 600456 | 宝钛股份 | 20,500,396.39 | 3.27 |
| 80 | 300010 | 立思辰 | 20,403,250.69 | 3.25 |
| 81 | 300580 | 贝斯特 | 20,184,759.00 | 3.22 |
| 82 | 601636 | 旗滨集团 | 20,055,363.50 | 3.20 |
| 83 | 603661 | 恒林股份 | 19,917,033.00 | 3.18 |
| 84 | 300033 | 同花顺 | 19,370,465.71 | 3.09 |

| | | | | |
|-----|--------|------|---------------|------|
| 85 | 300398 | 飞凯材料 | 19,259,771.24 | 3.07 |
| 86 | 600176 | 中国巨石 | 19,161,669.06 | 3.06 |
| 87 | 601933 | 永辉超市 | 18,350,113.62 | 2.93 |
| 88 | 600419 | 天润乳业 | 18,048,815.75 | 2.88 |
| 89 | 300258 | 精锻科技 | 17,757,346.90 | 2.83 |
| 90 | 603816 | 顾家家居 | 17,405,188.34 | 2.78 |
| 91 | 603883 | 老百姓 | 16,900,373.00 | 2.70 |
| 92 | 600583 | 海油工程 | 16,812,203.68 | 2.68 |
| 93 | 600486 | 扬农化工 | 16,710,724.00 | 2.66 |
| 94 | 300673 | 佩蒂股份 | 16,568,564.00 | 2.64 |
| 95 | 300284 | 苏交科 | 15,993,275.31 | 2.55 |
| 96 | 002970 | 锐明技术 | 15,940,047.40 | 2.54 |
| 97 | 002032 | 苏泊尔 | 15,789,728.76 | 2.52 |
| 98 | 600885 | 宏发股份 | 15,253,892.72 | 2.43 |
| 99 | 600519 | 贵州茅台 | 14,789,573.00 | 2.36 |
| 100 | 002859 | 洁美科技 | 14,686,390.50 | 2.34 |
| 101 | 300113 | 顺网科技 | 14,623,981.00 | 2.33 |
| 102 | 002709 | 天赐材料 | 14,607,238.84 | 2.33 |
| 103 | 000860 | 顺鑫农业 | 14,444,447.00 | 2.30 |
| 104 | 600933 | 爱柯迪 | 14,341,722.85 | 2.29 |
| 105 | 688388 | 嘉元科技 | 13,721,614.45 | 2.19 |
| 106 | 300383 | 光环新网 | 13,381,609.50 | 2.13 |
| 107 | 603868 | 飞科电器 | 13,279,120.04 | 2.12 |
| 108 | 300413 | 芒果超媒 | 12,794,619.20 | 2.04 |

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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|--------------|------------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 3,895,344,966.11 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 4,004,772,544.62 |

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

根据本基金基金合同规定，本基金不参与贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

根据本基金基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.11.3 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。

7.12 市场中性策略执行情况

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体除闻泰科技股份有限公司（以下简称“闻泰科技”）外，其余的没有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。

2019年8月，上海证券交易所发布《纪律处分决定书》（〔2019〕62号），对闻泰科技实施重大资产重组未按规定履行内部决策程序、未按期披露重组预案等情形，处以通报批评。

基金投资闻泰科技（600745）的决策流程符合本基金管理人投资管理制度的相关规定。针对上述情况，本基金管理人进行了分析和研究，认为上述事件对闻泰科技的投资价值未造成实质性影响。本基金管理人将继续对上述公司进行跟踪研究。

7.13.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 768,889.53 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 9,641.51 |
| 5 | 应收申购款 | 1,479,586.66 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,258,117.70 |

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数 (户) | 户均持有的 基金份额 | 持有人结构 | | | |
|--------------|---------------|------------|------------|----------------|------------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份 额比例 | 持有份额 | 占总份 额比例 |
| 34,791 | 12,647.12 | 725,593.08 | 0.16% | 439,280,353.54 | 99.84% |

8.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额（份） | 占上市总份额 比例 |
|----|-------|------------|--------------|
| 1 | 王璞 | 525,100.00 | 5.71% |
| 2 | 周世英 | 479,400.00 | 5.21% |
| 3 | 陈翠芳 | 400,144.00 | 4.35% |
| 4 | 徐忠实 | 250,582.00 | 2.73% |
| 5 | 张泰昌 | 234,500.00 | 2.55% |
| 6 | 孙志明 | 223,116.00 | 2.43% |
| 7 | 吴建城 | 200,144.00 | 2.18% |
| 8 | 彭文华 | 195,700.00 | 2.13% |
| 9 | 周世勤 | 180,000.00 | 1.96% |
| 10 | 杨慎忠 | 125,000.00 | 1.36% |

注：持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 105,647.22 | 0.0240% |

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 10~50 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|----------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（ 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 | 523,090,142.72 |
| 本报告期基金总申购份额 | 34,376,092.11 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 117,460,288.21 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 440,005,946.62 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金未改变投资策略。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|------------------|--------------|--------------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 国盛证券 | 2 | 1,712,133,057.53 | 21.69% | 1,252,087.57 | 18.28% | - |
| 中信证券 | 1 | 1,253,576,884.68 | 15.88% | 1,167,457.44 | 17.04% | - |
| 国金证券 | 1 | 1,143,534,011.90 | 14.49% | 1,064,974.89 | 15.55% | - |
| 华鑫证券 | 1 | 628,782,514.35 | 7.97% | 585,585.94 | 8.55% | - |
| 西南证券 | 1 | 545,681,322.59 | 6.91% | 399,056.53 | 5.83% | - |
| 东兴证券 | 1 | 542,204,118.85 | 6.87% | 504,955.43 | 7.37% | - |
| 招商证券 | 1 | 510,842,320.40 | 6.47% | 475,748.97 | 6.95% | - |
| 国信证券 | 1 | 484,866,596.65 | 6.14% | 451,557.17 | 6.59% | - |
| 华泰证券 | 2 | 361,559,749.69 | 4.58% | 336,721.20 | 4.92% | - |

| | | | | | | |
|-------|---|----------------|-------|------------|-------|---|
| 银河证券 | 1 | 352,184,760.87 | 4.46% | 327,983.64 | 4.79% | - |
| 平安证券 | 1 | 247,044,199.39 | 3.13% | 180,664.32 | 2.64% | - |
| 新时代证券 | 1 | 79,489,333.33 | 1.01% | 74,029.99 | 1.08% | - |
| 国海证券 | 1 | 30,560,032.58 | 0.39% | 28,460.57 | 0.42% | - |
| 安信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 渤海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中投证券 | 1 | - | - | - | - | - |

注：1. 专用交易单元的选择标准和程序

- (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，本基金租用证券公司交易单元情况未发生变化。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 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 |
| 国盛证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 571,127.31 | 100.00% | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华鑫证券 | - | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|-------|---|---|---|---|---|---|
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 新时代证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 渤海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中投证券 | - | - | - | - | - | - |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|--|------------|-----------------|
| 1 | 本公司关于旗下部分基金参与中国农业银行股份有限公司申购及定投费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》 | 2020 年 1 月 7 日 |
| 2 | 关于本基金暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告 | 《中国证券报》 | 2020 年 1 月 8 日 |
| 3 | 本基金 2019 收益分配公告 | 《中国证券报》 | 2020 年 1 月 10 日 |
| 4 | 2019 年基金产品 4 季度季报 | 《中国证券报》 | 2020 年 1 月 21 日 |
| 5 | 根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订存量基金基金合同及托管协议的公告 | 《中国证券报》 | 2020 年 1 月 21 日 |
| 6 | 本公司旗下 25 只基金招募说明书更新 | 《中国证券报》 | 2020 年 1 月 23 日 |
| 7 | 本公司关于旗下部分基金参与兴业证券费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》 | 2020 年 2 月 11 日 |
| 8 | 本公司关于旗下基金股票估值调整情况的公告 | 《中国证券报》 | 2020 年 3 月 24 日 |
| 9 | 关于提醒投资者及时更新、完善身份资料信息以免影响业务办理的公告 | 《中国证券报》 | 2020 年 3 月 24 日 |
| 10 | 本公司关于推迟披露旗下基金 2019 年年度报告的公告 | 《中国证券报》 | 2020 年 3 月 26 日 |
| 11 | 本公司关于旗下基金增加大连网金为销售机构及参与费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》 | 2020 年 4 月 3 日 |
| 12 | 中国光大银行“投资与托管业务部”名称变更为“资产托管部” | 中国证监会指定的媒介 | 2020 年 4 月 15 日 |
| 13 | 本公司旗下 25 只基金 2020 年第 1 季度报告 | 《中国证券报》 | 2020 年 4 月 21 日 |
| 14 | 本公司旗下 25 只基金 2019 年年 | 《中国证券报》 | 2020 年 4 月 28 日 |

| | | | |
|----|--------------------------------|---------|-----------------|
| | 度报告 | | |
| 15 | 本公司关于旗下部分基金增加中信证券华南为销售机构的公告 | 《中国证券报》 | 2020 年 5 月 6 日 |
| 16 | 关于本基金参与万联证券费率优惠活动 | 《中国证券报》 | 2020 年 5 月 18 日 |
| 17 | 本公司关于旗下部分基金参与申万宏源、申万宏源西部费率优惠活动 | 《中国证券报》 | 2020 年 5 月 20 日 |

注：上述公告同时在中国证监会基金电子披露网站和公司网站 www.msfnunds.com.cn 上披露。

§ 11 备查文件目录

11.1 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。

11.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

11.3 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。

摩根士丹利华鑫基金管理有限公司

2020 年 8 月 28 日