

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 年年度报告

2020 年 12 月 31 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：2021 年 3 月 30 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 2021 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 2020 年 01 月 01 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	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	23
§8 投资组合报告	50
8.1 期末基金资产组合情况	50
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	50
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	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62
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	62
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	62

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	62
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	62
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	63
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63
8.12 投资组合报告附注	63
§9 基金份额持有人信息	65
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
9.2 期末上市基金前十名持有人	65
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65
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的情况	65
§10 开放式基金份额变动	66
§11 重大事件揭示	67
11.1 基金份额持有人大会决议	67
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	67
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
11.4 基金投资策略的改变	67
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	67
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	67
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	67
11.8 其他重大事件	70
§12 备查文件目录	75
12.1 备查文件目录	75
12.2 存放地点	75
12.3 查阅方式	75

§ 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	385,571,885.68 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	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。 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。
投资策略	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。 (1) 股票投资策略 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。 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。 (2) 债券投资策略 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。 (3) 权证投资策略 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。 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 $\times$ 70%+标普中国债券指数收益率 $\times$ 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	xxpl@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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.msfunds.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	2020 年	2019 年	2018 年
本期已实现收益	334,236,228.98	63,582,344.50	-111,075,114.26
本期利润	360,166,063.92	117,973,048.72	-192,372,045.80
加权平均基金份额本期利润	0.8235	0.2097	-0.3298
本期加权平均净值利润率	54.28%	19.50%	-27.65%
本期基金份额净值增长率	71.02%	21.07%	-25.16%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	301,116,093.95	13,453,862.65	-50,595,187.08
期末可供分配基金份额利润	0.7810	0.0257	-0.0863
期末基金资产净值	780,288,632.92	627,080,420.08	580,742,119.54
期末基金份额净值	2.0237	1.1988	0.9902
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
基金份额累计净值增长率	1,296.72%	716.71%	574.60%

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。

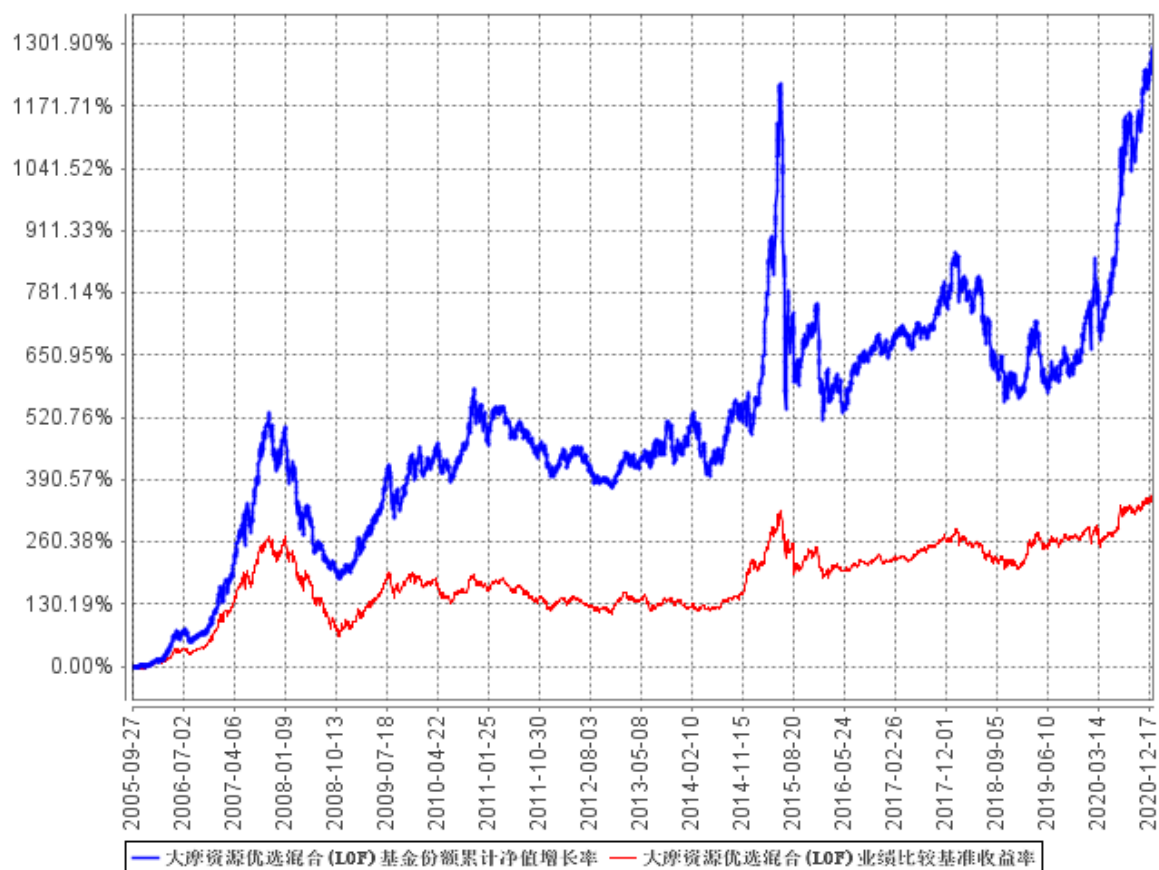
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	19.90%	1.10%	9.80%	0.70%	10.10%	0.40%
过去六个月	33.44%	1.54%	17.50%	0.94%	15.94%	0.60%
过去一年	71.02%	1.69%	19.94%	1.00%	51.08%	0.69%
过去三年	54.94%	1.44%	26.58%	0.94%	28.36%	0.50%
过去五年	65.04%	1.35%	35.16%	0.87%	29.88%	0.48%
自基金合同 生效起至今	1,296.72%	1.53%	361.09%	1.19%	935.63%	0.34%

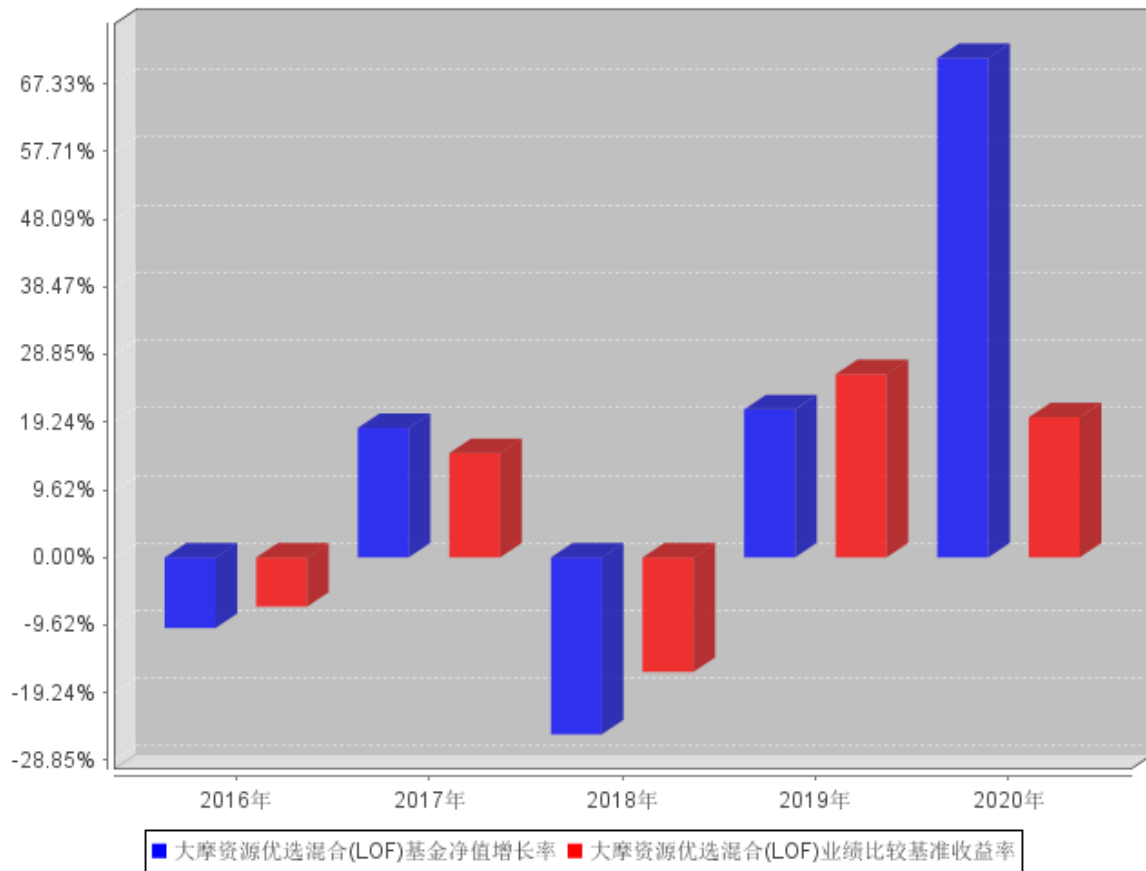
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



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)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
2020	0.1600	3,687,965.52	4,530,206.11	8,218,171.63	
2019	—	—	—	—	
2018	1.5360	35,938,940.26	48,702,976.43	84,641,916.69	
合计	1.6960	39,626,905.78	53,233,182.54	92,860,088.32	

§ 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 12 月 31 日，公司旗下共管理 29 只公募基金，其中股票型基金 3 只，混合型基金 15 只，指数型基金 2 只，债券型基金 9 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	2020 年 12 月 31 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，历任研究管理部研究员，现任研究管理部总监助理兼基金经理助理。2017 年 11

					月至 2020 年 12 月担任本基金基金经理助理，2020 年 5 月至 2020 年 12 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助理。
--	--	--	--	--	--

注：1、基金经理、基金经理助理的任职日期和离任日期为根据本公司决定确定的聘任日期和离任日期；

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，制订了《摩根士丹利华鑫基金管理有限公司公平交易管理办法》、《摩根士丹利华鑫基金管理有限公司异常交易报告管理办法》、《摩根士丹利华鑫基金管理有限公司公平交易分析报告实施细则》等内部制度，形成较为完备的公平交易制度及异常交易分析体系。

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金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，资本市场接受新冠疫情洗礼，走势跌宕起伏。最终，天量流动性的释放完全抵消了疫情带来的经济低谷，全球范围内风险资产普遍走出深 V 走势，全年大幅收涨。从 A 股来看，除一季度外，二三四季度都有持续的上升行情，但结构差异较大。二季度行情主线集中在消费和科技板块，周期板块普遍严重跑输。三季度疫情局势有所缓和，尤其是国内生产生活逐渐恢复常态，具备顺周期属性的龙头公司普遍大幅反弹，而随着 8 月美国对于华为制裁升级，电子，计算机等成长版块在三季度跑输市场。四季度，海外疫情的三次爆发和美国大选的不确定性给市场带来扰动，但随着大选结果落地和疫苗研发成功，内外盘向上共振，低估值权重板块普遍补涨，拉动指数向上，但因机构资金坚守核心资产，中小盘股普遍承压。

本基金 2020 年的仓位始终维持在较高水平。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食品饮料、医药，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。本基金在疫情爆发前后着重于配置成长板块和竣工与投资产业链，相关公司受到疫情影响较小，而在疫情见顶后则加大了对消费行业的配置力度，尤其是新兴和可选消费，随着疫苗研发成功和国内防疫常态化，经济复苏的总体趋势基本确认，本基金适度增持了中游制造行业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期截至 2020 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 2.0237 元，累计份额净值为 4.8663 元，报告期内基金份额净值增长率为 71.02%，同期业绩比较基准收益率为 19.94%。

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 2021 年，我们对于市场保持谨慎乐观。从基本面来看，随着疫苗大规模接种，群体免疫可期，全球经济有望向上形成共振，基数效应使得盈利实现较高增长确定性较强，龙头公司利润均创新高。资金面看，虽然部分投资者担心流动性边际收紧，但我们认为就当前的复苏高度和未

来进度来看言之尚早，断崖式“钱荒”出现的概率较小，盈利增长将消化估值提升。

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，提出改进建议并跟踪落实。

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。检查范围覆盖投资研究交易、基金销售、私募资产管理业务、巨额赎回评估等方面。同时开展对金融营销宣传行为、网下投资者询价、数据报送质量等监管自查工作。(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，组织落实基金销售机构监督管理、信息披露管理、信息技术管理、反洗钱等法律法规的相关要求。公司已建立起覆盖公司业务各个方面，更为全面、完善的内控制度体系，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。

2021 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（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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益每年至少分配一次，最多 6 次，基金每次收益分配比例最低不低于已实现收益的 60%。

报告期内，本基金实施利润分配金额 8,218,171.63 元。

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合规守信情况声明

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，诚实守信、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合规守信、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《摩根士丹利华鑫资源优选混合型证券投资基金(LOF)2020 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(2021)第 22202 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	摩根士丹利华鑫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 我们审计了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“摩根士丹利华鑫资源优选基金”)的财务报表,包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表,2020 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。 (二)我们的意见 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了摩根士丹利华鑫资源优选基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。 按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于摩根士丹利华鑫资源优选基金,并履行了职业道德方面的其他责任。
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	—
管理层和治理层对财务报表的责任	摩根士丹利华鑫资源优选基金的基金管理人摩根士丹利华鑫基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

	在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估摩根士丹利华鑫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华鑫资源优选基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督摩根士丹利华鑫资源优选基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作: (一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对摩根士丹利华鑫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

	能导致摩根士丹利华鑫资源优选基金不能持续经营。 (五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
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	单峰	施翊洲
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	2021 年 3 月 23 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	54,964,224.69	37,468,326.49
结算备付金		7,005,244.68	3,257,150.40
存出保证金		898,241.62	1,076,196.78
交易性金融资产	7.4.7.2	728,914,721.35	574,777,567.36
其中：股票投资		728,914,721.35	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	15,496,623.28
应收利息	7.4.7.5	12,076.21	10,449.80
应收股利		-	-
应收申购款		78,441.42	296,348.60
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		791,872,949.97	632,382,662.71
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		4,999,177.75	1,235.40
应付赎回款		2,136,413.37	2,148,858.08
应付管理人报酬		963,032.75	769,258.91
应付托管费		160,505.46	128,209.84
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	2,928,562.94	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	7.4.7.8	205,477.58	86,320.51
负债合计		11,584,317.05	5,302,242.63
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	385,571,885.68	523,090,142.72
未分配利润	7.4.7.10	394,716,747.24	103,990,277.36
所有者权益合计		780,288,632.92	627,080,420.08
负债和所有者权益总计		791,872,949.97	632,382,662.71

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.0237 元，基金份额总额 385,571,885.68 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		396,666,758.44	152,021,496.65
1. 利息收入		491,060.48	608,110.56
其中：存款利息收入	7.4.7.11	490,263.67	608,052.77
债券利息收入		796.81	57.79
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）		370,127,903.31	96,963,236.33
其中：股票投资收益	7.4.7.12	363,381,240.19	90,499,779.51
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	1,289,065.96	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	5,457,597.16	6,463,456.82
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	25,929,834.94	54,390,704.22
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	117,959.71	59,445.54
减：二、费用		36,500,694.52	34,048,447.93
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	9,907,995.95	9,063,217.79
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,651,332.66	1,510,536.23

3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	24,649,163.01	23,182,493.71
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		2.90	0.20
7. 其他费用	7.4.7.20	292,200.00	292,200.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		360,166,063.92	117,973,048.72
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		360,166,063.92	117,973,048.72

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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）	-	360,166,063.92	360,166,063.92
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）	-137,518,257.04	-61,221,422.41	-198,739,679.45
其中：1. 基金申购款	71,628,594.40	37,893,204.25	109,521,798.65
2. 基金赎回款	-209,146,851.44	-99,114,626.66	-308,261,478.10
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）	385,571,885.68	394,716,747.24	780,288,632.92
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 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）	-	117,973,048.72	117,973,048.72
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）	-63,376,599.22	-8,258,148.96	-71,634,748.18
其中：1. 基金申购款	62,572,374.81	4,582,025.78	67,154,400.59
2. 基金赎回款	-125,948,974.03	-12,840,174.74	-138,789,148.77
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）	523,090,142.72	103,990,277.36	627,080,420.08

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 王鸿斌	_____ 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

7.4 报表附注

7.4.1 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。

本财务报表由本基金的基金管理人摩根士丹利华鑫基金管理有限公司于 2021 年 3 月 23 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(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《摩根士丹利华鑫资源优选混合型证券投资基金(LOF)基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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 2020 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 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值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

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。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。本基金持有的其他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于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的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，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的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。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

或者(3) 该金融资产已转移, 虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬, 但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时, 其账面价值与收到的对价的差额, 计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时, 终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额, 计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值:

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

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

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基金净值比例计算的金额。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基金净值比例计算的金额。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。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债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利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

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。

其他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所有者权益转出。

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(可转换债券和私募债券除外)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《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	54,964,224.69	37,468,326.49
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:	54,964,224.69	37,468,326.49

7.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	650,407,926.82	728,914,721.35	78,506,794.53
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	650,407,926.82	728,914,721.35	78,506,794.53
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	521,769,907.77	574,346,867.36	52,576,959.59
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	430,700.00	430,700.00
	银行间市场	-	-
	合计	430,700.00	430,700.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	522,200,607.77	574,777,567.36	52,576,959.59

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

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

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

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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	8,519.71	8,440.32
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	3,152.30	1,465.70
应收债券利息	-	59.47
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	-	0.01
应收黄金合约拆借孳息	-	-

应收出借证券利息	-	-
其他	404.20	484.30
合计	12,076.21	10,449.80

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	2,927,862.94	1,976,510.81
银行间市场应付交易费用	700.00	700.00
合计	2,928,562.94	1,977,210.81

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1,477.58	2,320.51
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	204,000.00	84,000.00
合计	205,477.58	86,320.51

7.4.7.9 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 12 月 31 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	71,628,594.40	71,628,594.40
本期赎回（以“-”号填列）	-209,146,851.44	-209,146,851.44
本期末	385,571,885.68	385,571,885.68

注：1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 截至 2020 年 12 月 31 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 8,057,569.00 份（2019 年 12 月 31 日：11,345,756.00 份），托管在场外未上市交易的基金份额为 377,514,316.68 份（2019

年 12 月 31 日：511,744,386.72 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。

7.4.7.10 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	334,236,228.98	25,929,834.94	360,166,063.92
本期基金份额交易产生的变动数	-38,355,826.05	-22,865,596.36	-61,221,422.41
其中：基金申购款	26,406,992.69	11,486,211.56	37,893,204.25
基金赎回款	-64,762,818.74	-34,351,807.92	-99,114,626.66
本期已分配利润	-8,218,171.63	-	-8,218,171.63
本期末	301,116,093.95	93,600,653.29	394,716,747.24

7.4.7.11 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	373,591.92	480,949.23
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	102,879.18	104,455.23
其他	13,792.57	22,648.31
合计	490,263.67	608,052.77

7.4.7.12 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	8,656,568,357.22	7,997,314,474.53

减：卖出股票成本总额	8,293,187,117.03	7,906,814,695.02
买卖股票差价收入	363,381,240.19	90,499,779.51

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 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12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31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	1,289,065.96	-
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	1,289,065.96	-

7.4.7.13.2 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12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	5,719,946.29	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	4,430,000.00	-
减：应收利息总额	880.33	-
买卖债券差价收入	1,289,065.96	-

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

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。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	5,457,597.16	6,463,456.82
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	5,457,597.16	6,463,456.82

7.4.7.17 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	25,929,834.94	54,390,704.22
——股票投资	25,929,834.94	54,390,704.22
——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	25,929,834.94	54,390,704.22

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	117,830.76	59,445.54
基金转换费收入	-	-
其他	128.95	-
合计	117,959.71	59,445.54

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。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	24,649,163.01	23,182,493.71
银行间市场交易费用	-	-
合计	24,649,163.01	23,182,493.71

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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	-	-
上市费	60,000.00	60,000.00
债券账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他	1,200.00	1,200.00
合计	292,200.00	292,200.00

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

本基金的基金管理人于 2021 年 1 月 9 日宣告 2020 年度第 1 次分红，向截至 2021 年 1 月 12 日止在本基金注册登记人登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 4.686 元。

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
摩根士丹利国际控股公司	基金管理人的股东
深圳市基石创业投资有限公司	基金管理人的股东

注：1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 因深圳市中技实业(集团)有限公司涉及与第三方的债权债务纠纷，经广州市中级人民法院裁定，将深圳市中技实业(集团)有限公司股东所持有的基金管理人股权依法冻结。根据《摩根士丹利华鑫基金管理有限公司关于股权变更及增加注册资本的公告》，并经中国证券监督管理委员会证监许可[2020]923 号《关于核准摩根士丹利华鑫基金管理有限公司变更股权的批复》核准，摩根士丹利国际控股公司受让原股东深圳市中技实业(集团)有限公司持有的公司股权。上述股权转让相关的工商变更登记手续已于2020年7月17日办理完毕。深圳市中技实业(集团)有限公司自2020年7月17日起不再为本基金关联方。

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 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	1,967,076,649.95	11.53%	1,345,420,826.26	8.45%

7.4.10.1.2 权证交易

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 2020年1月1日至2020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	1,831,935.79	12.72%	407,897.01	13.93%
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	1,252,986.85	9.14%	0.00	0.00%
------	--------------	-------	------	-------

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 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	9,907,995.95	9,063,217.79
其中：支付销售机构的客户维护费	2,184,608.55	2,018,057.90

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,651,332.66	1,510,536.23

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。

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

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

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**

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

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 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	54,964,224.69	373,591.92	37,468,326.49	480,949.23

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

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

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	

7.4.12 期末（2020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**

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券	证券	成功	可流	流通受	认购	期末估	数量	期末	期末估值总	备注

代码	名称	认购日	通日	限类型	价格	值单价	(单位: 股)	成本总额	额	
688339	亿华通	2020 年 7 月 31 日	2021 年 2 月 10 日	新股流 通受限	76.65	257.95	2,761	211,630.65	712,199.95	-
688390	固德威	2020 年 8 月 27 日	2021 年 3 月 4 日	新股流 通受限	37.93	221.72	2,585	98,049.05	573,146.20	-
688017	绿的谐波	2020 年 8 月 21 日	2021 年 3 月 1 日	新股流 通受限	35.06	137.81	4,138	145,078.28	570,257.78	-
688586	江航装备	2020 年 7 月 24 日	2021 年 2 月 1 日	新股流 通受限	10.27	30.20	16,436	168,797.72	496,367.20	-
688055	龙腾光电	2020 年 8 月 10 日	2021 年 2 月 18 日	新股流 通受限	1.22	8.04	45,228	55,178.16	363,633.12	-
300999	金龙鱼	2020 年 9 月 29 日	2021 年 4 月 15 日	新股流 通受限	25.70	88.29	3,210	82,497.00	283,410.90	-
688658	悦康药业	2020 年 12 月 16 日	2021 年 6 月 24 日	新股流 通受限	24.36	22.31	11,890	289,640.40	265,265.90	-
688488	艾迪药业	2020 年 7 月 9 日	2021 年 1 月 20 日	新股流 通受限	13.99	24.48	9,934	138,976.66	243,184.32	-
688127	蓝特光学	2020 年 9 月 14 日	2021 年 3 月 22 日	新股流 通受限	15.41	33.60	5,322	82,012.02	178,819.20	-
300896	爱美客	2020 年 9 月 21 日	2021 年 3 月 29 日	新股流 通受限	118.27	603.36	209	24,718.43	126,102.24	-
688617	惠泰医疗	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 7 日	新股未 上市	74.46	74.46	1,673	124,571.58	124,571.58	-
688577	浙海德曼	2020 年 9 月 8 日	2021 年 3 月 16 日	新股流 通受限	33.13	42.01	1,503	49,794.39	63,141.03	-
300867	圣元环保	2020 年 8 月 12 日	2021 年 3 月 3 日	新股流 通受限	19.34	31.97	1,498	28,971.32	47,891.06	-
300919	中伟股份	2020 年 12 月 15 日	2021 年 6 月 23 日	新股流 通受限	24.60	61.51	601	14,784.60	36,967.51	-

300900	广联航空	2020 年 10 月 19 日	2021 年 4 月 29 日	新股流 通受限	17.87	33.16	879	15,707.73	29,147.64	-
300877	金春股份	2020 年 8 月 17 日	2021 年 3 月 3 日	新股流 通受限	30.54	50.85	569	17,377.26	28,933.65	-
300927	江天化学	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 7 日	新股未 上市	13.39	13.39	1,946	26,056.94	26,056.94	-
300868	杰美特	2020 年 8 月 12 日	2021 年 2 月 24 日	新股流 通受限	41.26	43.28	593	24,467.18	25,665.04	-
300910	瑞丰新材	2020 年 11 月 20 日	2021 年 5 月 27 日	新股流 通受限	30.26	47.87	474	14,343.24	22,690.38	-
300878	维康药业	2020 年 8 月 17 日	2021 年 3 月 3 日	新股流 通受限	41.34	48.72	401	16,577.34	19,536.72	-
300891	惠云钛业	2020 年 9 月 10 日	2021 年 3 月 17 日	新股流 通受限	3.64	16.40	1,143	4,160.52	18,745.20	-
300908	仲景食品	2020 年 11 月 13 日	2021 年 5 月 24 日	新股流 通受限	39.74	60.44	285	11,325.90	17,225.40	-
300884	狄耐克	2020 年 11 月 5 日	2021 年 5 月 12 日	新股流 通受限	24.87	33.51	499	12,410.13	16,721.49	-
300898	熊猫乳品	2020 年 10 月 9 日	2021 年 4 月 16 日	新股流 通受限	10.78	33.03	496	5,346.88	16,382.88	-
300892	品渥食品	2020 年 9 月 11 日	2021 年 3 月 24 日	新股流 通受限	26.66	60.01	272	7,251.52	16,322.72	-
300909	汇创达	2020 年 11 月 11 日	2021 年 5 月 18 日	新股流 通受限	29.57	40.67	386	11,414.02	15,698.62	-
300887	谱尼测试	2020 年 9 月 9 日	2021 年 3 月 16 日	新股流 通受限	44.47	74.52	210	9,338.70	15,649.20	-
300889	爱克股份	2020 年 9 月 9 日	2021 年 3 月 16 日	新股流 通受限	27.97	30.12	479	13,397.63	14,427.48	-
300902	国安达	2020 年 10 月 22 日	2021 年 4 月	新股流 通受限	15.38	24.26	551	8,474.38	13,367.26	-

		日	29 日							
300925	C 法本	2020 年 12 月 21 日	2021 年 6 月 30 日	新股流 通受限	20.08	37.33	353	7,088.24	13,177.49	-
300895	铜牛 信息	2020 年 9 月 17 日	2021 年 3 月 24 日	新股流 通受限	12.65	45.30	283	3,579.95	12,819.90	-
300876	蒙泰 高新	2020 年 8 月 14 日	2021 年 2 月 25 日	新股流 通受限	20.09	36.62	350	7,031.50	12,817.00	-
300893	松原 股份	2020 年 9 月 17 日	2021 年 3 月 24 日	新股流 通受限	13.47	35.08	276	3,717.72	9,682.08	-
300918	南山 智尚	2020 年 12 月 15 日	2021 年 6 月 22 日	新股流 通受限	4.97	8.94	1,063	5,283.11	9,503.22	-
300922	C 天 秦	2020 年 12 月 18 日	2021 年 6 月 25 日	新股流 通受限	16.05	31.58	287	4,606.35	9,063.46	-
300917	特发 服务	2020 年 12 月 14 日	2021 年 6 月 21 日	新股流 通受限	18.78	31.94	281	5,277.18	8,975.14	-
605277	新亚 电子	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 6 日	新股未 上市	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-
003030	祖名 股份	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 6 日	新股未 上市	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-
300886	华业 香料	2020 年 9 月 8 日	2021 年 3 月 16 日	新股流 通受限	18.59	45.67	147	2,732.73	6,713.49	-
003031	中瓷 电子	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 4 日	新股未 上市	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-
300927	江天 化学	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股未 上市	13.39	13.39	217	2,905.63	2,905.63	-

注：1、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

2、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；

3、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 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。

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

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

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 2020 年 12 月 31 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%）。

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 2020 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(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。

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 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 2020 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 2020 年 12 月 31 日，本基金最近工作日确认的净赎回金额未超过组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 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	54,964,224.69	-	-	-	54,964,224.69
结算备付金	7,005,244.68	-	-	-	7,005,244.68
存出保证金	898,241.62	-	-	-	898,241.62
交易性金融资产	-	-	-	728,914,721.35	728,914,721.35
应收利息	-	-	-	12,076.21	12,076.21
应收申购款	-	-	-	78,441.42	78,441.42
资产总计	62,867,710.99	-	-	729,005,238.98	791,872,949.97
负债					
应付证券清算款	-	-	-	4,999,177.75	4,999,177.75
应付赎回款	-	-	-	2,136,413.37	2,136,413.37
应付管理人报酬	-	-	-	963,032.75	963,032.75
应付托管费	-	-	-	160,505.46	160,505.46
应付交易费用	-	-	-	2,928,562.94	2,928,562.94
应交税费	-	-	-	191,147.20	191,147.20
其他负债	-	-	-	205,477.58	205,477.58
负债总计	-	-	-	11,584,317.05	11,584,317.05
利率敏感度缺口	62,867,710.99	-	-	717,420,921.93	780,288,632.92
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2019 年 12 月 31 日					
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
交易性金融资产	-	-	430,700.00	574,346,867.36	574,777,567.36
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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2020 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(2019 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券投资公允价值占基金资产净值的比例为 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)。

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公司的证券不得超过该证券的 10%。此外，本基金的基金管理人日常对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量、跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 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	728,914,721.35	93.42	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	728,914,721.35	93.42	574,346,867.36	91.59

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)	
		本期末(2020 年 12 月 31 日)	上年度末(2019 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	52,670,000.00	35,420,000.00
	业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-52,670,000.00	-35,420,000.00

7.4.14 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 12 月 31 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 724,425,745.79 元，属于第二层次的余额为 4,488,975.56 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 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(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。

§ 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	728,914,721.35	92.05
	其中：股票	728,914,721.35	92.05
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	61,969,469.37	7.83
8	其他各项资产	988,759.25	0.12
9	合计	791,872,949.97	100.00

8.2 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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	15,882,624.14	2.04
B	采矿业	—	—
C	制造业	564,480,215.02	72.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	16,322.72	0.00
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	194,256.13	0.02
J	金融业	41,827,526.98	5.36
K	房地产业	8,975.14	0.00
L	租赁和商务服务业	31,469,508.00	4.03
M	科学研究和技术服务业	63,348,908.40	8.12
N	水利、环境和公共设施管理业	47,891.06	0.01
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	11,638,493.76	1.49
S	综合	-	-
	合计	728,914,721.35	93.42

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300737	科顺股份	2,430,700	52,162,822.00	6.69
2	300750	宁德时代	123,192	43,253,943.12	5.54
3	000001	平安银行	2,162,747	41,827,526.98	5.36
4	300760	迈瑞医疗	93,500	39,831,000.00	5.10
5	600346	恒力石化	1,316,083	36,810,841.51	4.72
6	600600	青岛啤酒	356,400	35,426,160.00	4.54
7	603259	药明康德	262,860	35,412,499.20	4.54
8	600132	重庆啤酒	287,033	34,154,056.67	4.38
9	000333	美的集团	324,519	31,945,650.36	4.09
10	002027	分众传媒	3,188,400	31,469,508.00	4.03
11	600872	中炬高新	470,500	31,358,825.00	4.02
12	600276	恒瑞医药	253,908	28,300,585.68	3.63
13	300759	康龙化成	231,900	27,920,760.00	3.58
14	002241	歌尔股份	640,628	23,908,236.96	3.06
15	000651	格力电器	378,215	23,426,637.10	3.00
16	300558	贝达药业	202,478	21,740,062.86	2.79
17	601233	桐昆股份	1,007,694	20,748,419.46	2.66
18	600741	华域汽车	706,373	20,357,669.86	2.61
19	600966	博汇纸业	1,310,300	19,693,809.00	2.52
20	600176	中国巨石	896,620	17,896,535.20	2.29
21	600309	万华化学	186,200	16,951,648.00	2.17
22	300616	尚品宅配	200,000	15,932,000.00	2.04
23	002299	圣农发展	598,441	15,882,624.14	2.04
24	300888	稳健医疗	83,900	13,927,400.00	1.78
25	300450	先导智能	144,822	12,163,599.78	1.56
26	002739	万达电影	643,722	11,638,493.76	1.49
27	002601	龙麟佰利	370,100	11,387,977.00	1.46
28	603659	璞泰来	71,130	7,994,300.70	1.02

29	688339	亿华通	2,761	712,199.95	0.09
30	688390	固德威	2,585	573,146.20	0.07
31	688017	绿的谐波	4,138	570,257.78	0.07
32	688686	奥普特	2,292	496,905.60	0.06
33	688586	江航装备	16,436	496,367.20	0.06
34	688055	龙腾光电	45,228	363,633.12	0.05
35	300999	金龙鱼	3,210	283,410.90	0.04
36	688658	悦康药业	11,890	265,265.90	0.03
37	688488	艾迪药业	9,934	243,184.32	0.03
38	688127	蓝特光学	5,322	178,819.20	0.02
39	300925	C 法本	3,528	162,719.99	0.02
40	300896	爱美客	209	126,102.24	0.02
41	688617	惠泰医疗	1,673	124,571.58	0.02
42	688698	伟创电气	4,751	84,995.39	0.01
43	688577	浙海德曼	1,503	63,141.03	0.01
44	688618	三旺通信	1,117	59,938.22	0.01
45	300867	圣元环保	1,498	47,891.06	0.01
46	300919	中伟股份	601	36,967.51	0.00
47	300900	广联航空	879	29,147.64	0.00
48	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.00
49	300877	金春股份	569	28,933.65	0.00
50	300868	杰美特	593	25,665.04	0.00
51	300910	瑞丰新材	474	22,690.38	0.00
52	300878	维康药业	401	19,536.72	0.00
53	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.00
54	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.00
55	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.00
56	605186	健麾信息	626	17,609.38	0.00
57	300908	仲景食品	285	17,225.40	0.00
58	300884	狄耐克	499	16,721.49	0.00
59	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.00
60	300898	熊猫乳品	496	16,382.88	0.00
61	300892	品渥食品	272	16,322.72	0.00
62	300909	汇创达	386	15,698.62	0.00
63	300887	谱尼测试	210	15,649.20	0.00
64	605377	华旺科技	750	14,977.50	0.00
65	300889	爱克股份	479	14,427.48	0.00
66	300902	国安达	551	13,367.26	0.00
67	300895	铜牛信息	283	12,819.90	0.00

68	300876	蒙泰高新	350	12,817.00	0.00
69	300922	C 天秦	363	12,008.46	0.00
70	003023	彩虹集团	296	11,262.80	0.00
71	605155	西大门	350	10,668.00	0.00
72	300893	松原股份	276	9,682.08	0.00
73	300918	南山智尚	1,063	9,503.22	0.00
74	300917	特发服务	281	8,975.14	0.00
75	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
76	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
77	300886	华业香料	147	6,713.49	0.00
78	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00

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	300737	科顺股份	185,556,530.67	29.59
2	600745	闻泰科技	172,208,653.59	27.46
3	300750	宁德时代	169,808,056.11	27.08
4	600183	生益科技	169,344,705.01	27.01
5	002241	歌尔股份	167,392,108.43	26.69
6	000333	美的集团	159,980,414.78	25.51
7	601233	桐昆股份	155,527,632.21	24.80
8	603596	伯特利	128,804,879.74	20.54
9	002299	圣农发展	127,389,714.34	20.31
10	600346	恒力石化	126,604,514.47	20.19
11	002242	九阳股份	121,111,860.02	19.31
12	600176	中国巨石	118,021,922.05	18.82
13	002798	帝欧家居	117,121,065.03	18.68
14	600258	首旅酒店	115,633,270.27	18.44
15	000513	丽珠集团	107,575,756.24	17.16
16	000001	平安银行	102,976,916.59	16.42
17	002332	仙琚制药	102,908,781.35	16.41
18	600741	华域汽车	97,213,145.00	15.50
19	600600	青岛啤酒	95,930,391.37	15.30

20	000895	双汇发展	93,831,218.96	14.96
21	603801	志邦家居	93,554,069.15	14.92
22	002511	中顺洁柔	91,449,295.18	14.58
23	600597	光明乳业	89,523,494.39	14.28
24	300623	捷捷微电	88,681,694.53	14.14
25	601888	中国中免	85,264,201.01	13.60
26	600132	重庆啤酒	83,021,261.70	13.24
27	603589	口子窖	82,060,823.74	13.09
28	600862	中航高科	79,622,707.68	12.70
29	688368	晶丰明源	78,838,704.35	12.57
30	300059	东方财富	78,795,950.82	12.57
31	600309	万华化学	78,728,190.34	12.55
32	688111	金山办公	75,143,023.49	11.98
33	600966	博汇纸业	74,664,669.52	11.91
34	002982	湘佳股份	73,841,210.59	11.78
35	002601	龙蟠佰利	71,592,036.48	11.42
36	002949	华阳国际	69,915,837.30	11.15
37	000002	万科A	68,903,101.53	10.99
38	600315	上海家化	68,606,188.28	10.94
39	600276	恒瑞医药	66,700,757.82	10.64
40	002027	分众传媒	65,355,928.67	10.42
41	300760	迈瑞医疗	62,739,353.04	10.00
42	600887	伊利股份	62,682,478.91	10.00
43	603259	药明康德	61,813,237.00	9.86
44	002609	捷顺科技	60,344,223.62	9.62
45	300450	先导智能	59,256,879.97	9.45
46	002930	宏川智慧	57,661,977.97	9.20
47	300316	晶盛机电	57,608,093.00	9.19
48	600456	宝钛股份	57,594,541.67	9.18
49	688089	嘉必优	57,505,694.33	9.17
50	000063	中兴通讯	57,213,890.37	9.12
51	000650	仁和药业	57,048,928.92	9.10
52	002648	卫星石化	56,820,053.81	9.06
53	002212	天融信	56,751,531.40	9.05
54	603369	今世缘	53,373,230.27	8.51
55	300888	稳健医疗	53,275,101.26	8.50

56	000739	普洛药业	53,163,375.69	8.48
57	300558	贝达药业	52,532,167.82	8.38
58	002271	东方雨虹	52,498,107.52	8.37
59	000651	格力电器	51,899,714.90	8.28
60	688208	道通科技	51,435,899.03	8.20
61	002127	南极电商	50,780,469.64	8.10
62	000100	TCL 科技	50,308,496.16	8.02
63	600640	号百控股	48,145,703.93	7.68
64	300580	贝斯特	47,029,304.00	7.50
65	002602	世纪华通	46,901,680.69	7.48
66	300999	金龙鱼	44,740,923.29	7.13
67	300014	亿纬锂能	44,660,323.47	7.12
68	688200	华峰测控	44,595,810.21	7.11
69	300590	移为通信	43,420,162.00	6.92
70	600585	海螺水泥	43,056,621.00	6.87
71	000858	五 粮 液	42,476,980.77	6.77
72	600999	招商证券	42,261,386.45	6.74
73	000568	泸州老窖	42,013,230.06	6.70
74	002597	金禾实业	41,843,958.50	6.67
75	002389	航天彩虹	41,796,241.84	6.67
76	002739	万达电影	36,727,654.42	5.86
77	000625	长安汽车	36,442,316.59	5.81
78	688020	方邦股份	35,843,509.09	5.72
79	600699	均胜电子	35,662,178.36	5.69
80	002705	新宝股份	35,014,402.72	5.58
81	600036	招商银行	34,251,891.00	5.46
82	603606	东方电缆	34,123,835.74	5.44
83	000975	银泰黄金	33,346,183.82	5.32
84	600398	海澜之家	33,227,588.49	5.30
85	600030	中信证券	33,215,338.00	5.30
86	002959	小熊电器	32,655,096.00	5.21
87	600872	中炬高新	32,472,442.22	5.18
88	002507	涪陵榨菜	31,949,507.65	5.09
89	002007	华兰生物	31,484,574.93	5.02
90	300327	中颖电子	30,424,333.72	4.85
91	002460	赣锋锂业	30,388,256.80	4.85

92	002384	东山精密	29,721,917.63	4.74
93	002214	大立科技	29,714,682.00	4.74
94	002084	海鸥住工	29,427,534.01	4.69
95	603019	中科曙光	28,493,663.00	4.54
96	600419	天润乳业	28,454,025.50	4.54
97	000860	顺鑫农业	28,336,396.00	4.52
98	300033	同花顺	28,166,970.74	4.49
99	002515	金字火腿	27,240,467.60	4.34
100	002815	崇达技术	27,161,297.86	4.33
101	600703	三安光电	26,831,327.36	4.28
102	002970	锐明技术	26,508,463.82	4.23
103	002695	煌上煌	26,424,058.05	4.21
104	601231	环旭电子	26,391,374.55	4.21
105	300783	三只松鼠	26,225,066.60	4.18
106	002508	老板电器	25,747,917.25	4.11
107	600352	浙江龙盛	25,108,083.34	4.00
108	000915	山大华特	24,961,074.36	3.98
109	002989	中天精装	24,579,273.54	3.92
110	603833	欧派家居	24,414,340.46	3.89
111	300759	康龙化成	24,191,781.52	3.86
112	603737	三棵树	23,758,285.11	3.79
113	000538	云南白药	23,252,942.46	3.71
114	300010	豆神教育	23,198,538.93	3.70
115	002291	星期六	23,196,334.00	3.70
116	003006	百亚股份	23,014,239.29	3.67
117	002466	天齐锂业	22,876,732.00	3.65
118	688396	华润微	22,846,399.77	3.64
119	300575	中旗股份	22,312,526.00	3.56
120	300258	精锻科技	21,265,171.73	3.39
121	300144	宋城演艺	20,926,740.96	3.34
122	002081	金螳螂	20,542,848.00	3.28
123	603179	新泉股份	20,254,456.88	3.23
124	000671	阳光城	20,234,062.00	3.23
125	000011	深物业A	20,011,250.00	3.19
126	600185	格力地产	19,753,728.72	3.15
127	300136	信维通信	19,062,656.00	3.04

128	300616	尚品宅配	18,927,744.26	3.02
129	603816	顾家家居	18,860,034.00	3.01
130	603661	恒林股份	18,769,063.00	2.99
131	300398	飞凯材料	17,603,700.12	2.81
132	688357	建龙微纳	17,396,857.86	2.77
133	300284	苏交科	17,288,080.43	2.76
134	300663	科蓝软件	16,940,123.79	2.70
135	600933	爱柯迪	16,643,106.00	2.65
136	601933	永辉超市	16,549,623.18	2.64
137	603353	和顺石油	16,427,570.31	2.62
138	002032	苏泊尔	16,329,735.72	2.60
139	600584	长电科技	16,245,414.90	2.59
140	600048	保利地产	16,160,801.85	2.58
141	002425	凯撒文化	16,061,000.56	2.56
142	603883	老百姓	15,953,410.00	2.54
143	688388	嘉元科技	15,748,463.83	2.51
144	002938	鹏鼎控股	15,672,618.00	2.50
145	688085	三友医疗	15,572,762.22	2.48
146	600867	通化东宝	15,292,856.22	2.44
147	300383	光环新网	15,165,079.00	2.42
148	300113	顺网科技	15,044,745.00	2.40
149	002859	洁美科技	14,938,778.00	2.38
150	300673	佩蒂股份	14,928,729.40	2.38
151	000028	国药一致	14,553,941.00	2.32
152	603659	璞泰来	14,371,860.00	2.29
153	605009	豪悦护理	14,362,493.02	2.29
154	002449	国星光电	14,349,118.51	2.29
155	600415	小商品城	14,143,494.27	2.26
156	300347	泰格医药	13,991,006.00	2.23
157	688389	普门科技	13,738,004.72	2.19
158	601688	华泰证券	13,484,372.61	2.15
159	600522	中天科技	12,747,593.78	2.03
160	002376	新北洋	12,664,771.00	2.02
161	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。

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	175,675,093.56	28.01
2	600745	闻泰科技	173,282,496.06	27.63
3	600183	生益科技	168,045,530.28	26.80
4	002241	歌尔股份	153,901,840.90	24.54
5	000333	美的集团	148,799,919.64	23.73
6	601233	桐昆股份	148,408,840.57	23.67
7	300737	科顺股份	140,425,606.99	22.39
8	600258	首旅酒店	130,198,380.88	20.76
9	603596	伯特利	127,897,016.97	20.40
10	002798	帝欧家居	125,363,491.63	19.99
11	002242	九阳股份	123,885,621.81	19.76
12	300623	捷捷微电	123,652,665.75	19.72
13	600176	中国巨石	123,145,712.98	19.64
14	000513	丽珠集团	120,370,202.28	19.20
15	002299	圣农发展	112,190,181.56	17.89
16	600346	恒力石化	109,340,196.38	17.44
17	000895	双汇发展	108,155,082.31	17.25
18	002332	仙琚制药	102,006,052.56	16.27
19	002511	中顺洁柔	99,856,621.05	15.92
20	600132	重庆啤酒	99,640,710.95	15.89
21	601888	中国中免	93,412,324.22	14.90
22	000002	万科A	90,713,977.42	14.47
23	603801	志邦家居	89,128,315.40	14.21
24	600597	光明乳业	88,578,007.13	14.13
25	600862	中航高科	86,212,619.74	13.75
26	603589	口子窖	83,843,863.53	13.37
27	002648	卫星石化	83,392,815.92	13.30
28	000100	TCL 科技	82,891,585.22	13.22
29	688368	晶丰明源	79,704,910.25	12.71
30	300059	东方财富	78,564,448.49	12.53
31	002601	龙蟠佰利	77,890,596.42	12.42
32	600315	上海家化	77,062,501.67	12.29
33	600600	青岛啤酒	76,660,783.02	12.23
34	002212	天融信	75,844,616.74	12.09

35	600741	华域汽车	75,446,126.66	12.03
36	002949	华阳国际	75,302,241.00	12.01
37	688111	金山办公	74,898,116.33	11.94
38	002982	湘佳股份	74,582,757.97	11.89
39	000001	平安银行	67,589,037.73	10.78
40	600966	博汇纸业	66,733,648.88	10.64
41	002602	世纪华通	65,593,554.38	10.46
42	600309	万华化学	64,370,776.37	10.27
43	000063	中兴通讯	63,890,273.40	10.19
44	300450	先导智能	62,204,104.98	9.92
45	002609	捷顺科技	61,928,873.12	9.88
46	600887	伊利股份	61,384,648.10	9.79
47	002597	金禾实业	60,000,573.47	9.57
48	000651	格力电器	59,478,632.70	9.49
49	600456	宝钛股份	57,257,692.05	9.13
50	002930	宏川智慧	57,225,495.85	9.13
51	300316	晶盛机电	56,918,966.85	9.08
52	688089	嘉必优	56,789,052.48	9.06
53	300999	金龙鱼	56,415,376.69	9.00
54	603369	今世缘	56,109,033.33	8.95
55	000739	普洛药业	53,604,401.98	8.55
56	002271	东方雨虹	53,554,749.42	8.54
57	000650	仁和药业	53,291,766.54	8.50
58	688208	道通科技	52,864,396.40	8.43
59	300014	亿纬锂能	48,475,691.56	7.73
60	002507	涪陵榨菜	48,168,618.31	7.68
61	000568	泸州老窖	48,106,980.88	7.67
62	603259	药明康德	48,091,478.05	7.67
63	002127	南极电商	47,940,115.47	7.64
64	002695	煌上煌	46,155,957.89	7.36
65	000858	五 粮 液	45,748,712.05	7.30
66	002389	航天彩虹	45,374,830.08	7.24
67	600640	号百控股	45,372,081.49	7.24
68	300888	稳健医疗	44,597,679.24	7.11
69	300580	贝斯特	44,184,280.00	7.05
70	300558	贝达药业	43,865,825.12	7.00
71	688200	华峰测控	43,365,383.66	6.92
72	300590	移为通信	42,433,752.93	6.77

73	600999	招商证券	41,519,598.59	6.62
74	600585	海螺水泥	41,369,529.85	6.60
75	000538	云南白药	41,147,470.16	6.56
76	600276	恒瑞医药	40,926,656.51	6.53
77	000625	长安汽车	39,463,535.87	6.29
78	002027	分众传媒	39,029,219.61	6.22
79	002959	小熊电器	38,430,568.05	6.13
80	002353	杰瑞股份	38,150,020.95	6.08
81	002460	赣锋锂业	36,883,451.57	5.88
82	600036	招商银行	36,415,815.98	5.81
83	600699	均胜电子	36,218,439.30	5.78
84	002007	华兰生物	35,751,983.93	5.70
85	300136	信维通信	35,396,607.56	5.64
86	603606	东方电缆	34,537,276.98	5.51
87	002705	新宝股份	34,497,700.89	5.50
88	688020	方邦股份	34,189,286.73	5.45
89	002084	海鸥住工	33,938,373.64	5.41
90	000975	银泰黄金	33,496,608.48	5.34
91	600383	金地集团	33,159,039.15	5.29
92	600030	中信证券	32,922,983.51	5.25
93	002425	凯撒文化	31,658,119.79	5.05
94	300327	中颖电子	31,231,631.98	4.98
95	600703	三安光电	31,058,209.22	4.95
96	300760	迈瑞医疗	31,046,292.00	4.95
97	600398	海澜之家	30,422,712.64	4.85
98	603737	三棵树	30,029,211.04	4.79
99	300033	同花顺	29,703,310.21	4.74
100	002214	大立科技	29,631,708.40	4.73
101	600419	天润乳业	28,470,279.95	4.54
102	002384	东山精密	28,234,411.18	4.50
103	000860	顺鑫农业	27,839,610.45	4.44
104	603019	中科曙光	27,264,294.83	4.35
105	002515	金字火腿	27,086,340.96	4.32
106	002508	老板电器	26,237,601.79	4.18
107	601231	环旭电子	25,926,273.62	4.13
108	300783	三只松鼠	25,343,932.00	4.04
109	002815	崇达技术	25,068,053.96	4.00
110	688396	华润微	24,858,915.35	3.96

111	003006	百亚股份	24,853,904.16	3.96
112	000915	山大华特	24,624,630.32	3.93
113	603833	欧派家居	24,489,400.99	3.91
114	002739	万达电影	24,409,702.20	3.89
115	002989	中天精装	23,882,753.43	3.81
116	002291	星期六	23,882,193.73	3.81
117	600352	浙江龙盛	23,722,373.32	3.78
118	002449	国星光电	23,701,014.83	3.78
119	002970	锐明技术	23,242,808.40	3.71
120	600584	长电科技	23,207,527.15	3.70
121	000011	深物业 A	22,495,400.95	3.59
122	601688	华泰证券	22,442,596.41	3.58
123	002466	天齐锂业	21,354,322.78	3.41
124	300258	精锻科技	21,314,810.90	3.40
125	000028	国药一致	20,907,955.05	3.33
126	600185	格力地产	20,832,168.40	3.32
127	603179	新泉股份	20,520,802.28	3.27
128	300010	豆神教育	20,403,250.69	3.25
129	601636	旗滨集团	20,055,363.50	3.20
130	603661	恒林股份	19,917,033.00	3.18
131	300144	宋城演艺	19,708,261.49	3.14
132	603353	和顺石油	19,696,658.62	3.14
133	300575	中旗股份	19,616,161.40	3.13
134	300398	飞凯材料	19,259,771.24	3.07
135	002081	金螳螂	19,179,191.00	3.06
136	000671	阳光城	18,740,078.21	2.99
137	601933	永辉超市	18,350,113.62	2.93
138	300663	科蓝软件	18,014,257.00	2.87
139	603816	顾家家居	17,405,188.34	2.78
140	688357	建龙微纳	17,064,948.87	2.72
141	603883	老百姓	16,900,373.00	2.70
142	600583	海油工程	16,812,203.68	2.68
143	600486	扬农化工	16,710,724.00	2.66
144	300673	佩蒂股份	16,568,564.00	2.64
145	002938	鹏鼎控股	16,032,292.15	2.56
146	300284	苏交科	15,993,275.31	2.55
147	002032	苏泊尔	15,789,728.76	2.52
148	600867	通化东宝	15,362,975.62	2.45

149	600885	宏发股份	15,253,892.72	2.43
150	600048	保利地产	15,194,577.61	2.42
151	600415	小商品城	15,050,262.00	2.40
152	600519	贵州茅台	14,789,573.00	2.36
153	002859	洁美科技	14,686,390.50	2.34
154	300113	顺网科技	14,623,981.00	2.33
155	002709	天赐材料	14,607,238.84	2.33
156	600933	爱柯迪	14,341,722.85	2.29
157	688085	三友医疗	13,914,783.58	2.22
158	300347	泰格医药	13,904,561.00	2.22
159	688388	嘉元科技	13,721,614.45	2.19
160	688389	普门科技	13,551,772.71	2.16
161	300383	光环新网	13,381,609.50	2.13
162	605009	豪悦护理	13,317,642.58	2.12
163	603868	飞科电器	13,279,120.04	2.12
164	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。

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	8,421,825,136.08
卖出股票收入（成交）总额	8,656,568,357.22

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

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

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

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

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 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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平安银行股份有限公司（以下简称“平安银行”）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。

2020 年 2 月, 中国银保监会深圳监管局发布《中国银保监会深圳监管局行政处罚信息公开表》（深银保监罚决字（2020）7 号）对平安银行个人消费贷款风险分类结果不能反映真实风险水平等违法违规行为, 处以罚款。

2020 年 10 月, 中国银行保险监督管理委员会宁波监管局发布《宁波银保监局行政处罚信息公开表》（甬银保监罚决字（2020）66 号）对平安银行贷款资金用途管控不到位等违法违规行为, 处以罚款。

本基金投资平安银行（000001）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, 认为上述事件对平安银行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。

8.12.2 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。

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	898,241.62

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	12,076.21
5	应收申购款	78,441.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	988,759.25

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 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。

§ 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
32,823	11,747.00	621,428.15	0.16%	384,950,457.53	99.84%

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	王璜	525,100.00	6.52%
2	陈翠芳	400,144.00	4.97%
3	彭文华	245,700.00	3.05%
4	张泰昌	234,500.00	2.91%
5	孙志明	223,116.00	2.77%
6	吴建城	199,944.00	2.48%
7	周世勤	180,000.00	2.23%
8	徐忠实	150,582.00	1.87%
9	杨慎忠	125,000.00	1.55%
10	邓晓杰	123,242.00	1.53%

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	105,647.22	0.0274%

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

§ 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	523,090,142.72
本报告期基金总申购份额	71,628,594.40
减:本报告期基金总赎回份额	209,146,851.44
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	385,571,885.68

§ 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：

2020 年 10 月 20 日，ZHOU HAN（周涵）先生任职基金管理人首席信息官。基金管理人于 2020 年 10 月 21 日公告了上述事项。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动如下：

2020 年 7 月，中国光大银行股份有限公司聘任李守靖先生担任资产托管部总经理职务。

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）2020 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）已连续十五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

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。

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	3,468,103,354.20	20.33%	2,536,224.46	17.61%	-

华鑫证券	1	1,967,076,649.95	11.53%	1,831,935.79	12.72%	—
中信证券	1	1,889,037,729.93	11.08%	1,759,262.25	12.22%	—
国金证券	1	1,718,970,336.42	10.08%	1,600,879.18	11.12%	—
海通证券	1	1,402,987,340.14	8.23%	1,026,000.46	7.12%	—
东兴证券	1	1,135,975,569.46	6.66%	1,057,935.69	7.35%	—
信达证券	1	871,384,508.03	5.11%	637,244.18	4.43%	—
招商证券	1	803,151,311.47	4.71%	747,977.40	5.19%	—
国信证券	1	762,371,563.19	4.47%	709,998.92	4.93%	—
西南证券	1	726,936,084.86	4.26%	531,608.76	3.69%	—
平安证券	1	725,214,343.76	4.25%	530,350.36	3.68%	—
华泰证券	2	593,562,517.17	3.48%	552,784.68	3.84%	—
银河证券	1	575,546,275.48	3.37%	536,000.42	3.72%	—
华西证券	1	225,711,918.84	1.32%	165,063.82	1.15%	—
国海证券	1	97,715,408.38	0.57%	91,003.38	0.63%	—
新时代证券	1	79,489,333.33	0.47%	74,029.99	0.51%	—
安信证券	1	12,698,091.70	0.07%	11,825.24	0.08%	—
渤海证券	1	—	—	—	—	—
中金公司	1	—	—	—	—	—
国泰君安	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，本基金新增 4 家证券公司的 4 个交易单元：国泰君安证券、海通证券、信达证券、华西证券交易单元各 1 个。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例	成交金额	占当期债 券回购 成交总额 的比例	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例
国盛证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	2,573,240.80	44.99%	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	3,146,705.49	55.01%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

中投证券	-	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	本公司关于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	中国证监会规定报刊及网站	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	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 1 月 8 日
3	本基金 2019 收益分配公告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 1 月 10 日
4	本基金 2019 年 4 季度季报	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 1 月 21 日
5	本公司根据《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	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 1 月 21 日
6	本基金说明书更新	中国证监会规定报刊及网站	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	中国证监会规定报刊及网站	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	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 3 月 24 日
9	本公司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	中国证监会规定报刊及网站	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	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 3 月 26 日
11	本公司关于旗下基金增加大连网	中国证监会规定报	2020 年 4 月 3 日

	金为销售机构及参与费率优惠活动的公告	刊及网站	
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”	中国证监会规定的媒介	2020 年 4 月 15 日
13	本基金 2020 年第一季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 4 月 21 日
14	本基金 2019 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 4 月 28 日
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	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 5 月 6 日
16	关于本基金参与万联证券费率优惠活动	中国证监会规定报刊及网站	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	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 5 月 20 日
18	本公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司手机银行申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 7 月 1 日
19	本基金招募说明书更新	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 7 月 8 日
20	本公司关于股权变更及增加注册资本的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 7 月 18 日
21	本基金 2020 年第二季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 7 月 21 日
22	本公司关于旗下部分基金参与中国光大银行费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 7 月 24 日
23	本公司关于旗下部分基金参与招商银行费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 8 月 10 日

24	本公司关于旗下基金增加汇林保大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	2020 年 8 月 18 日
25	本公司关于旗下部分基金增加度小满基金为销售机构及参与费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 8 月 25 日
26	本基金产品资料概要	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 8 月 26 日
27	本基金 2020 年中期报告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 8 月 28 日
28	本公司关于旗下部分基金参与华鑫证券费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 9 月 7 日
29	本公司关于旗下部分基金参与中国银行费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 9 月 18 日
30	本公司关于直销网上交易停止受理招商银行直连支付渠道认购、申购及定期定额投资业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 9 月 19 日
31	本公司关于旗下基金增加玄元保险为销售机构及开通费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 9 月 24 日
32	本公司关于旗下部分基金参与中国建设银行费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 10 月 12 日
33	本公司关于旗下部分基金在上海证券开通定投业务并参与定投费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 10 月 19 日
34	本公司关于旗下部分基金参与平安证券费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 10 月 21 日
35	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	2020 年 10 月 21 日

36	本基金 2020 年第三季度报告及提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 10 月 28 日
37	本公司关于旗下部分基金增加普益基金为销售机构及开通费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 11 月 2 日
38	本公司 关于北京分公司办公地址变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 11 月 3 日
39	本公司关于旗下部分基金增加腾安基金销售（深圳）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	2020 年 11 月 13 日
40	本公司关于旗下基金增加奕丰金融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	2020 年 11 月 26 日
41	本公司关于旗下部分基金参与信达证券费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 12 月 15 日
42	本公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 12 月 22 日
43	本公司关于旗下部分基金参与工商银行电子银行、AI 投服务基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 12 月 31 日
44	本公司关于旗下部分基金继续参与中国工商银行股份有限公司 2021 年定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 12 月 31 日
45	本公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司手机银行申	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 12 月 31 日

	购及定期定额投资申购费率优惠 活动的公告		
--	-------------------------	--	--

§ 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。

摩根士丹利华鑫基金管理有限公司

2021 年 3 月 30 日