

# 摩根士丹利华鑫优悦安和混合型证券投资 基金

## 2023 年第 1 季度报告

2023 年 3 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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 4 月 21 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 4 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                       |
|------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 大摩优悦安和混合                                                                                                                                                                              |
| 基金主代码      | 009893                                                                                                                                                                                |
| 交易代码       | 009893                                                                                                                                                                                |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                                                                |
| 基金合同生效日    | 2020 年 9 月 24 日                                                                                                                                                                       |
| 报告期末基金份额总额 | 412,406,217.26 份                                                                                                                                                                      |
| 投资目标       | 本基金采取主动管理的投资策略，通过大类资产配置和个股精选，力争实现基金资产的长期稳定增值。                                                                                                                                         |
| 投资策略       | 1、资产配置策略<br>本基金将通过研究宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素，对股票、债券和货币资产的风险收益特征进行深入分析，合理预测各类资产的价格变动趋势，确定不同资产类别的投资比例。在此基础上，积极跟踪由于市场短期波动引起的各类资产的价格偏差和风险收益特征的相对变化，动态调整各大类资产之间的投资比例，在保持总体风险水平相对平稳的基础上，获取相对 |

|                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |                  |
|-----------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|
|                 | <p>较高的基金投资收益。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金通过“自上而下”及“自下而上”相结合的方法挖掘优质的上市公司，构建股票投资组合：自上而下地分析行业的增长潜在空间、竞争结构、增长节奏、潜在风险等方面，把握投资机会；自下而上地评判企业的核心科技和创新优势、管理层、治理结构等，通过对企业基本面和估值水平进行综合研判，深度挖掘优质个股。</p> <p>3、衍生品投资策略</p> <p>本基金的衍生品投资将严格遵守相关法律法规的规定，合理利用股指期货、国债期货等衍生工具，充分考虑衍生品的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，追求稳定的当期收益或降低投资组合的整体风险。</p> <p>4、债券投资策略</p> <p>本投资组合对于债券的投资主要为久期管理策略、收益率曲线策略、个券选择策略、跨市场套利策略等，并择机把握市场有效性不足情况下的交易机会。</p> |                  |
| 业绩比较基准          | 沪深 300 指数收益率*75%+中证综合债券指数收益率*25%                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |                  |
| 风险收益特征          | 本基金为混合型基金，理论上其长期平均预期风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |                  |
| 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           | 中国农业银行股份有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |                  |
| 下属分级基金的基金简称     | 大摩优悦安和混合 A                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | 大摩优悦安和混合 C       |
| 下属分级基金的交易代码     | 009893                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | 014867           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 180,111,694.28 份                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | 232,294,522.98 份 |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2023 年 1 月 1 日-2023 年 3 月 31 日） |                   |
|-----------------|-------------------------------------|-------------------|
|                 | 大摩优悦安和混合 A                          | 大摩优悦安和混合 C        |
| 1. 本期已实现收益      | -3, 048, 424. 78                    | -3, 226, 401. 22  |
| 2. 本期利润         | -9, 909, 789. 33                    | -11, 527, 724. 03 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0. 0561                            | -0. 0615          |
| 4. 期末基金资产净值     | 144, 693, 108. 78                   | 185, 726, 233. 90 |
| 5. 期末基金份额净值     | 0. 8034                             | 0. 7995           |

注：1. 以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2. 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。

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

大摩优悦安和混合 A

| 阶段         | 净值增长率①   | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③      | ②－④    |
|------------|----------|-----------|------------|---------------|----------|--------|
| 过去三个月      | -5. 38%  | 1. 45%    | 3. 71%     | 0. 64%        | -9. 09%  | 0. 81% |
| 过去六个月      | 5. 10%   | 2. 00%    | 5. 39%     | 0. 82%        | -0. 29%  | 1. 18% |
| 过去一年       | -20. 78% | 2. 07%    | -1. 95%    | 0. 86%        | -18. 83% | 1. 21% |
| 自基金合同生效起至今 | -19. 66% | 1. 86%    | -7. 13%    | 0. 88%        | -12. 53% | 0. 98% |

大摩优悦安和混合 C

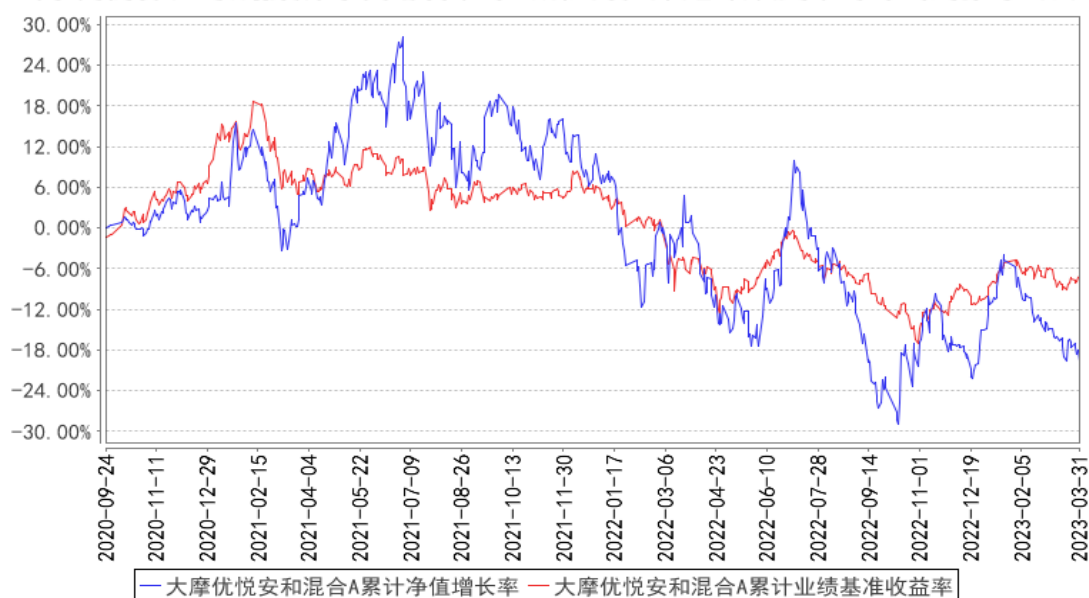
| 阶段         | 净值增长率①   | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③      | ②－④    |
|------------|----------|-----------|------------|---------------|----------|--------|
| 过去三个月      | -5. 49%  | 1. 46%    | 3. 71%     | 0. 64%        | -9. 20%  | 0. 82% |
| 过去六个月      | 4. 88%   | 2. 01%    | 5. 39%     | 0. 82%        | -0. 51%  | 1. 19% |
| 过去一年       | -21. 10% | 2. 07%    | -1. 95%    | 0. 86%        | -19. 15% | 1. 21% |
| 自基金合同生效起至今 | -17. 36% | 2. 11%    | -8. 97%    | 0. 92%        | -8. 39%  | 1. 19% |

|       |  |  |  |  |  |  |
|-------|--|--|--|--|--|--|
| 生效起至今 |  |  |  |  |  |  |
|-------|--|--|--|--|--|--|

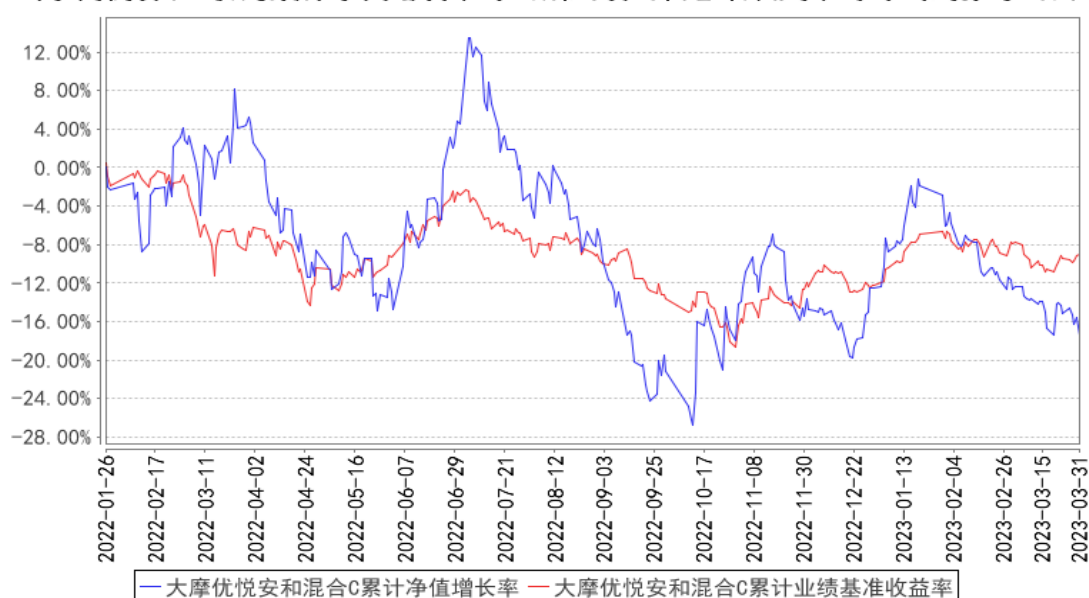
注：本基金从 2022 年 1 月 26 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2022 年 1 月 26 日起存续。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

大摩优悦安和混合A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



大摩优悦安和混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2020 年 9 月 24 日正式生效；

2、按照本基金基金合同的规定，基金管理人自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

3、本基金自 2022 年 1 月 26 日起新增 C 类份额。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务                | 任本基金的基金经理期限     |      | 证券从业年限 | 说明                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|-----|-------------------|-----------------|------|--------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                   | 任职日期            | 离任日期 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 何晓春 | 副总经理、权益投资部总监、基金经理 | 2020 年 9 月 24 日 | —    | 12 年   | 中南财经政法大学产业经济学博士。曾任金鹰基金管理有限公司权益投资部总监、研究部副总监兼基金经理。2017 年 12 月加入本公司，现任本公司副总经理、权益投资部总监兼基金经理。2018 年 2 月起担任摩根士丹利华鑫品质生活精选股票型证券投资基金基金经理，2019 年 9 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，2020 年 9 月起担任摩根士丹利华鑫优悦安和混合型证券投资基金基金经理，2021 年 2 月起担任摩根士丹利华鑫新兴产业股票型证券投资基金基金经理，2021 年 7 月起担任摩根士丹利华鑫优享臻选六个月持有期混合型证券投资基金基金经理。 |
| 赵伟捷 | 研究管理部总监助理、基金经理    | 2021 年 3 月 4 日  | —    | 6 年    | 中山大学财务与投资管理博士。曾任金鹰基金管理有限公司研究员。2017 年 8 月加入基金管理人，历任研究管理部研究员、基金经理助理，现任研究管理部总监助理兼基金经理，2021 年 3 月起担任摩根士丹利华鑫优悦安和混合型证券投资基金基金经理，2023 年 2 月起担任摩根士丹利华鑫优享臻选六个月持有期混合型证券投资基金基金经理。                                                                                                                          |

注：1、基金经理的任职日期为基金合同生效之日和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 公平交易专项说明

#### 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，本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况有 2 次，为量化投资基金因执行投资策略与其他组合发生的反向交易。基金管理人未发现其他异常交易行为。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2023 年一季度，本基金净值有一定幅度下跌。我们在年初重点配置了医药行业，主要考虑到医药行业天花板广阔，板块经过一年多调整，部分重点公司已经进入合理价格区间。另外，诊疗人次恢复预计是今年可期待的趋势。但 2023 年一季度行业整体表现不尽如人意，主要原因有：1）医院诊疗人次没有超预期的恢复；2）美联储在 2 月份表现出超预期的加息态度，此外硅谷银行事件加大了市场对海外衰退的担忧；3）二级市场缺乏新增资金，在行业比较方面，AI 等主题吸引了更多的资金关注。

在医药板块内部，基金重点配置 CXO 和科研试剂方向。理由是我们仍然看好我国工程师红利的长期优势，看好我国创新药产业发展的长期前景和重点细分行业的进口替代。但 2023 年一季度，部分重点公司调整较多，主要原因有：1）美联储在 2 月份表现出超预期的加息态度，此外硅谷银行事件加大了市场对海外衰退的担忧；2）国内一级市场投融资恢复不达预期。

本报告期我们加大了对科研试剂领域的配置。长期逻辑是，我们看好中国创新药和创新器械的发展。国内相关产业链的技术进步较快，有望在性价比优势下，实现逐步的进口替代。从中短期内来说，虽然一季度恢复情况一般，但是行业景气度再下行的可能性不大，部分公司估值性价比突出，进入较好长期布局区间。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 类份额净值为 0.8034 元，份额累计净值为 0.8034 元，基金份额净值增长率为-5.38%，同期业绩比较基准收益率为 3.71%；C 类份额净值为 0.7995 元，份额累计

净值为 0.7995 元，C 类基金份额净值增长率为-5.49%，同期业绩比较基准收益率为 3.71%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）          | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 306,728,928.71 | 91.31        |
|    | 其中：股票             | 306,728,928.71 | 91.31        |
| 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      | 27,164,443.93  | 8.09         |
| 8  | 其他资产              | 2,032,122.25   | 0.60         |
| 9  | 合计                | 335,925,494.89 | 100.00       |

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 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         | —              | —            |
| B  | 采矿业              | —              | —            |
| C  | 制造业              | 116,735,380.42 | 35.33        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | —              | —            |
| E  | 建筑业              | 32,822.90      | 0.01         |
| F  | 批发和零售业           | 46,333,108.48  | 14.02        |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | —              | —            |
| H  | 住宿和餐饮业           | —              | —            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | —              | —            |
| J  | 金融业              | —              | —            |

|   |               |                |       |
|---|---------------|----------------|-------|
| K | 房地产业          | —              | —     |
| L | 租赁和商务服务业      | —              | —     |
| M | 科学研究和技术服务业    | 143,618,553.75 | 43.47 |
| 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       | 9,063.16       | 0.00  |
| R | 文化、体育和娱乐业     | —              | —     |
| S | 综合            | —              | —     |
|   | 合计            | 306,728,928.71 | 92.83 |

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）   | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 603259 | 药明康德 | 375,775 | 29,874,112.50 | 9.04         |
| 2  | 300760 | 迈瑞医疗 | 88,900  | 27,711,019.00 | 8.39         |
| 3  | 300347 | 泰格医药 | 280,568 | 26,853,163.28 | 8.13         |
| 4  | 600079 | 人福医药 | 960,900 | 25,732,902.00 | 7.79         |
| 5  | 603456 | 九洲药业 | 730,000 | 24,294,400.00 | 7.35         |
| 6  | 603127 | 昭衍新药 | 391,145 | 20,480,352.20 | 6.20         |
| 7  | 301166 | 优宁维  | 392,400 | 19,129,500.00 | 5.79         |
| 8  | 002821 | 凯莱英  | 135,300 | 18,039,549.00 | 5.46         |
| 9  | 688426 | 康为世纪 | 423,704 | 17,185,434.24 | 5.20         |
| 10 | 600511 | 国药股份 | 416,000 | 15,496,000.00 | 4.69         |

### 5.4 报告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。

### 5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

### 5.7 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。

### 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

报告期内，本基金未参与股指期货交易；截至报告期末，本基金未持有股指期货合约。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金对国债期货的投资以套期保值为目的。本基金将结合国债交易市场和 期货交易市场的收益性、流动性的情况，通过多头或空头套期保值等投资策略进行套期保值，以获取超额收益。

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

报告期内，本基金未参与国债期货交易；截至报告期末，本基金未持有国债期货合约。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

报告期内，本基金未参与国债期货交易；截至报告期末，本基金未持有国债期货合约。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体除人福医药集团股份有限公司（以下简称“人福医药”）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。

2023 年 2 月，上海证券交易所发布《上海证券交易所纪律处分决定书》（〔2023〕10 号）对人福医药集团股份有限公司定期报告财务数据披露不准确等违法违规行为予以公开谴责。

本基金投资人福医药（600079）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，认为上述事件对人福医药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。

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

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

#### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 138,624.81   |
| 2  | 应收证券清算款 | —            |
| 3  | 应收股利    | —            |
| 4  | 应收利息    | —            |
| 5  | 应收申购款   | 1,893,497.44 |
| 6  | 其他应收款   | —            |
| 7  | 其他      | —            |
| 8  | 合计      | 2,032,122.25 |

#### 5.11.4 报告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。

#### 5.11.5 报告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。

### § 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                        | 大摩优悦安和混合 A     | 大摩优悦安和混合 C     |
|---------------------------|----------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 138,010,772.29 | 177,754,184.73 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 65,198,396.52  | 241,646,435.66 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额            | 23,097,474.53  | 187,106,097.41 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | —              | —              |
| 报告期期末基金份额总额               | 180,111,694.28 | 232,294,522.98 |

### § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期，基金管理人未运用固有资金申购、赎回本基金。截至本报告期末，基金管理人未持有本基金份额。

### § 8 影响投资者决策的其他重要信息

#### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | 报告期内持有基金份额变化情况 |                                                                      |               |               |      | 报告期末持有基金情况    |         |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|----------------------------------------------------------------------|---------------|---------------|------|---------------|---------|
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间                                              | 期初份额          | 申购份额          | 赎回份额 | 持有份额          | 份额占比（%） |
| 机构                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | 1              | 2023 年 1 月 9 日至 2023 年 1 月 20 日；<br>2023 年 1 月 30 日至 2023 年 2 月 14 日 | 25,073,706.84 | 45,099,785.39 | 0.00 | 70,173,492.23 | 17.01   |
| 产品特有风险                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |                |                                                                      |               |               |      |               |         |
| 本基金存在单一投资者持有基金份额占比较大的情形。本基金属于开放式基金，在本基金存续期间，若上述投资者集中大额赎回本基金，可能会发生巨额赎回的情形，本基金投资者可能会面临以下风险：1. 基金份额净值波动风险由于我国证券市场的波动性较大，在市场价格下跌时会出现交易量急剧减少的情形，此时若出现巨额赎回可能会导致基金资产变现困难，从而产生流动性风险，甚至影响基金份额净值。此外，当出现巨额赎回时，因基金运作特点导致的费用计提、计入基金资产的赎回费以及基金持仓证券价格波动等因素，也可能影响基金份额净值，极端情况下可能会造成基金份额净值的大幅波动。2. 无法赎回基金的流动性风险当发生巨额赎回时，根据《基金合同》的约定，基金管理人可能决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能暂停接受基金的赎回申请，投资人将面临无法及时赎回所持有基金份额的风险。 |                |                                                                      |               |               |      |               |         |

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予本基金注册的批复文件；
- 2、本基金基金合同；
- 3、本基金托管协议；
- 4、本基金招募说明书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内在规定媒介上披露的各项公告。

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

### 9.3 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

2023 年 4 月 21 日