

# 摩根士丹利 ESG 量化先行混合型证券投资 基金 2023 年第 3 季度报告

2023 年 9 月 30 日

基金管理人：摩根士丹利基金管理（中国）有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 10 月 24 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 20 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
|------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 大摩 ESG 量化混合                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 基金主代码      | 009246                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 交易代码       | 009246                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 基金合同生效日    | 2020 年 7 月 16 日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 报告期末基金份额总额 | 250,247,858.75 份                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 投资目标       | 本基金通过大类资产配置和量化优选的方法,精选符合 ESG 要求的股票进行投资，力争获取超越比较基准的投资回报与长期资本增值。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 投资策略       | <p>本基金遴选出在 ESG 相关概念指数中起显著解释作用的因子,并按照成熟方法对之进行评价、赋权，以筛选出符合 ESG 要求的股票；从风险和收益的角度出发，构建出互补性较强的多因子模型，按照既定比例进行加权，综合策略适应不同市场。</p> <p>1. 股票投资策略</p> <p>本基金以“量化投资”为主要投资策略，该“量化投资”是运用建立在已为国际市场上广泛应用的多因子阿尔法模型（Multiple Factors Alpha Model）的基础上，根据中国资本市场的实际情况，由本基金管理人的数量化投资团队开发的更具针对性和实用性的修正的多因子阿尔法选股模型。在符合 ESG 要求的股票中通过基金管理人自主开发的多因子阿尔法模型进行股票选择并据此构建股票投资组合。该多因子阿尔法模型在实际运行过程中将定期或不定期地进行修正，优化股票投资组合。</p> <p>2. 资产配置策略</p> <p>本基金实行在管理人投资决策委员会统一指导下的资产配置机制。投资决策委员会定期或针对特定事件临时召开，讨论、确定具体的基金</p> |

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>资产未来一段时期内在权益类资产及固定收益类资产之间的配置比例范围，形成资产配置相关决议。基金经理根据投资决策委员会关于资产配置的决议具体执行并实施资产配置方案。</p> <p>数量化投资策略是本基金的主要投资策略，为了有效实施数量化投资策略，本基金将在投资决策委员会关于资产配置决议的允许范围内，采取相对稳定的股票持仓比例控制措施，降低由于股票持仓比例波动过于频繁影响到数量化投资策略的效果。</p> <p>3. 其他金融工具投资策略</p> <p>(1) 债券投资策略</p> <p>管理人通过评估货币政策、财政政策和国际环境等因素，分析市场价格中隐含的对经济增长、通货膨胀、违约概率、提前偿付速度等因素的预测，根据债券市场中存在的各种投资机会的相对投资价值和相关风险决定总体的投资策略及类属（政府、企业/公司、可转换债券等）和期限（短期、中期和长期）等部分的投资比例，并基于价值分析精选投资品种构建债券投资组合。</p> <p>本基金采用的主要债券投资策略包括：利率预期策略、收益率曲线策略、信用利差策略、公司/企业债券策略、可转换债券策略等。</p> <p>(2) 股指期货投资策略</p> <p>本基金将以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。</p> <p>(3) 资产支持证券投资策略</p> <p>本基金通过对资产支持证券的发行条款、基础资产的构成及质量等基本面的研究，结合相关定价模型评估其内在价值，谨慎参与资产支持证券投资。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证中财沪深 100ESG 领先指数收益率*80%+中证综合债券指数收益率*20%                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，理论上其长期平均预期风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 基金管理人  | 摩根士丹利基金管理（中国）有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 基金托管人  | 中国建设银行股份有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |

### § 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 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日） |
|-----------------|-------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | -10,481,132.47                      |
| 2. 本期利润         | -13,893,584.52                      |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0547                             |
| 4. 期末基金资产净值     | 201,917,456.39                      |
| 5. 期末基金份额净值     | 0.8069                              |

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。

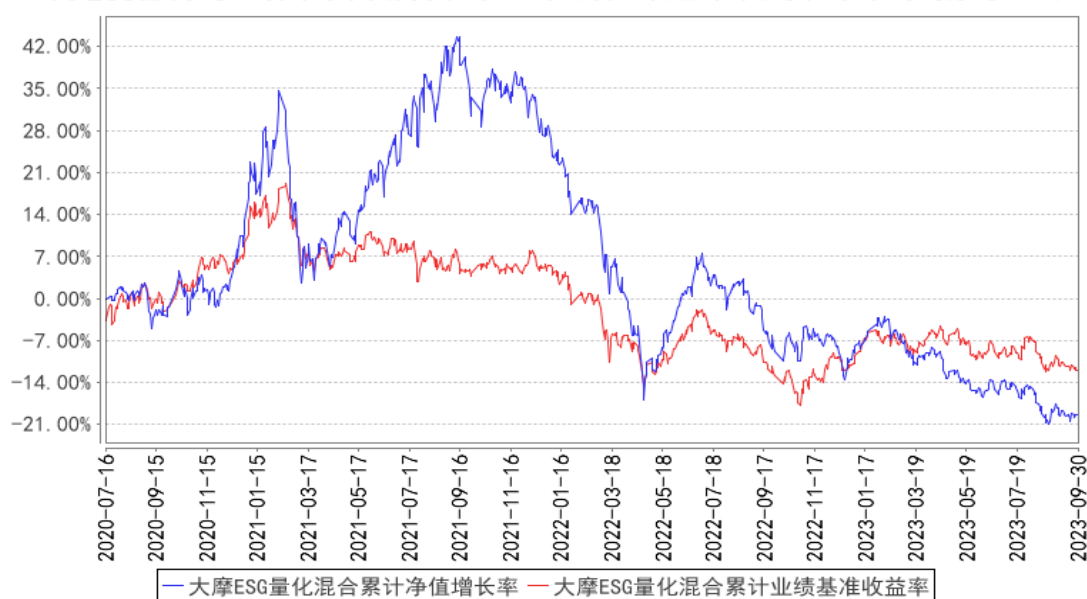
## 3.2 基金净值表现

### 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

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③     | ②—④   |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|---------|-------|
| 过去三个月          | -6.32%     | 0.78%         | -3.18%         | 0.73%                 | -3.14%  | 0.05% |
| 过去六个月          | -11.18%    | 0.73%         | -5.50%         | 0.71%                 | -5.68%  | 0.02% |
| 过去一年           | -11.41%    | 0.84%         | 1.17%          | 0.78%                 | -12.58% | 0.06% |
| 过去三年           | -18.17%    | 1.37%         | -10.55%        | 0.89%                 | -7.62%  | 0.48% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | -19.31%    | 1.34%         | -11.92%        | 0.91%                 | -7.39%  | 0.43% |

### 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ESG量化混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2020 年 7 月 16 日正式生效；

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

## § 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 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 余斌 | 数量化投资部总监、基金经理 | 2020 年 7 月 16 日 | -    | 16 年   | 南开大学经济学硕士,金融风险管理师(FRM)。曾任招商证券股份有限公司风险管理部风险分析师、鹏华基金管理有限公司量化及衍生品投资部基金经理。2019 年 5 月加入本公司,现任数量化投资部总监、基金经理。2019 年 8 月起担任摩根士丹利深证 300 指数增强型证券投资基金、摩根士丹利量化多策略股票型证券投资基金、摩根士丹利多因子精选策略混合型证券投资基金基金经理,2020 年 7 月起担任摩根士丹利 ESG 量化先行混合型证券投资基金基金经理,2020 年 7 月至 2023 年 4 月担任摩根士丹利华鑫 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金经理。 |

注: 1、基金经理的任职日期为基金合同生效之日;

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遵规守信情况的说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内，全球多数股票指数均录得下跌，A 股主要宽基指数均出现下跌，其中创业板和科创板指数下跌幅度较大，超过-9%。报告期内，美国 10 年期国债利率快速上行，由期初 3.86% 上升至 4.59%。美债利率作为全球资产定价的锚，通常其上行阶段，全球股票资产风险偏好难以扩张，甚至下行。风险偏好的变化也影响长期投资者的投资决策，报告期内，北上资金流出超过 700 亿元，与一季度的持续大额流入形成了鲜明对比。

当前高企的欧美经济体通胀水平具有长期性、复杂性特点。全球传统能源和大宗商品资本开支长期不足，以及普遍存在的欧美经济体“通胀-工资”螺旋现象，使得通胀水平很难被快速压制。除非全球经济陷入衰退，否则当前的通胀水平将可能在高位维持较长时间。然而，长期通胀必然会对经济体产生严重负面影响，居民和企业将背负沉重的负担，并恶化资产负债表，削弱消费和投资意愿，最终导致难以预料的一系列严重后果。尽管我国经济在疫情期间受损，但得益于较低的通胀水平和持续的经济复苏势头，我国的居民和企业资产负债表保持持续改善。

如果当前内外部的宏观经济环境未发生明显变化，我们有理由相信部分因子表现仍有望持续，也将是投资组合超额收益的主要来源。但是，我们倾向于认为我国经济最差的阶段已然渡过，A 股市场可能会在接下来几个季度可能迎来风格的重要转变阶段。为了应对市场可能存在的潜在变化，我们正准备将部分逻辑扩展性不强的 Alpha 因子设定为风险因子，进而减少其相对暴露，力争实现更为稳健的超额收益回报。

本组合始终坚持将 ESG 投资理念融入量化投资实践。在过去的一个季度，基金管理人进一步梳理了 ESG 的数据、方法论和投资管理实践范式，以帮助基金经理以更好的方式践行 ESG 投资理念，并将 ESG 投资方法贯穿至投资流程的全部过程。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期截至 2023 年 9 月 30 日，本基金份额净值为 0.8069 元，累计份额净值为 0.8069 元，基金份额净值增长率为-6.32%，同期业绩比较基准收益率为-3.18%。

#### 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              | 187,447,132.79 | 92.37        |
|    | 其中：股票             | 187,447,132.79 | 92.37        |
| 2  | 基金投资              | —              | —            |
| 3  | 固定收益投资            | 1,112,833.67   | 0.55         |
|    | 其中：债券             | 1,112,833.67   | 0.55         |
|    | 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      | 14,315,049.74  | 7.05         |
| 8  | 其他资产              | 56,666.96      | 0.03         |
| 9  | 合计                | 202,931,683.16 | 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         | 1,048.50       | 0.00         |
| B  | 采矿业              | 6,561,200.00   | 3.25         |
| C  | 制造业              | 125,290,111.30 | 62.05        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 3,439,613.50   | 1.70         |
| E  | 建筑业              | 4,237,849.64   | 2.10         |
| F  | 批发和零售业           | 2,349,715.68   | 1.16         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 6,141,856.00   | 3.04         |
| H  | 住宿和餐饮业           | —              | —            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 13,538,942.17  | 6.71         |
| J  | 金融业              | 11,583,999.00  | 5.74         |
| K  | 房地产业             | 5,356,009.00   | 2.65         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 2,932,741.00   | 1.45         |

|   |               |                |       |
|---|---------------|----------------|-------|
| M | 科学研究和技术服务业    | 1,180,677.00   | 0.58  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 958,492.00     | 0.47  |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | —              | —     |
| P | 教育            | —              | —     |
| Q | 卫生和社会工作       | 938,262.00     | 0.46  |
| R | 文化、体育和娱乐业     | 1,036,912.00   | 0.51  |
| S | 综合            | 1,899,704.00   | 0.94  |
|   | 合计            | 187,447,132.79 | 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  | 600519 | 贵州茅台 | 2,400   | 4,316,520.00 | 2.14         |
| 2  | 688111 | 金山办公 | 6,197   | 2,297,847.60 | 1.14         |
| 3  | 300750 | 宁德时代 | 9,360   | 1,900,360.80 | 0.94         |
| 4  | 600673 | 东阳光  | 286,100 | 1,899,704.00 | 0.94         |
| 5  | 601318 | 中国平安 | 37,500  | 1,811,250.00 | 0.90         |
| 6  | 000858 | 五粮液  | 10,400  | 1,623,440.00 | 0.80         |
| 7  | 600028 | 中国石化 | 264,200 | 1,603,694.00 | 0.79         |
| 8  | 002027 | 分众传媒 | 219,100 | 1,566,565.00 | 0.78         |
| 9  | 600941 | 中国移动 | 16,100  | 1,558,802.00 | 0.77         |
| 10 | 000568 | 泸州老窖 | 7,000   | 1,516,550.00 | 0.75         |

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|--------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | —            | —            |
| 2  | 央行票据      | —            | —            |
| 3  | 金融债券      | —            | —            |
|    | 其中：政策性金融债 | —            | —            |
| 4  | 企业债券      | —            | —            |
| 5  | 企业短期融资券   | —            | —            |
| 6  | 中期票据      | —            | —            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 1,112,833.67 | 0.55         |
| 8  | 同业存单      | —            | —            |
| 9  | 其他        | —            | —            |
| 10 | 合计        | 1,112,833.67 | 0.55         |

### 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

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元）    | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-------|------------|--------------|
| 1  | 113664 | 大元转债 | 2,600 | 345,937.84 | 0.17         |
| 2  | 113659 | 莱克转债 | 1,840 | 216,313.07 | 0.11         |



|   |        |         |       |            |      |
|---|--------|---------|-------|------------|------|
| 3 | 113062 | 常银转债    | 1,390 | 163,608.60 | 0.08 |
| 4 | 113660 | 寿 22 转债 | 880   | 124,773.87 | 0.06 |
| 5 | 123169 | 正海转债    | 992   | 120,326.39 | 0.06 |

## 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

注：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

注：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

注：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

注：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

根据本基金基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：根据本基金基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

### 5.10.3 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。

## 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江苏常熟农村商业银行股份有限公司（以下简称“常熟银行”）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。

2023 年 7 月，苏州银保监分局发布《行政处罚信息公开表》（苏州银保监罚决字〔2023〕12 号）对常熟银行贴现资金转存银票保证金、个人贷款业务贷后管理不到位的违法违规行为，处以罚款。

本基金投资常银转债（113062）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，认为上述事件对常银转债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   | 45,851.78 |
| 2  | 应收证券清算款 | —         |
| 3  | 应收股利    | —         |
| 4  | 应收利息    | —         |
| 5  | 应收申购款   | 10,815.18 |
| 6  | 其他应收款   | —         |
| 7  | 其他      | —         |
| 8  | 合计      | 56,666.96 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称    | 公允价值（元）    | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|---------|------------|--------------|
| 1  | 113664 | 大元转债    | 345,937.84 | 0.17         |
| 2  | 113659 | 莱克转债    | 216,313.07 | 0.11         |
| 3  | 113062 | 常银转债    | 163,608.60 | 0.08         |
| 4  | 113660 | 寿 22 转债 | 124,773.87 | 0.06         |
| 5  | 123169 | 正海转债    | 120,326.39 | 0.06         |
| 6  | 118030 | 睿创转债    | 107,775.62 | 0.05         |

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |                |
|---------------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 257,232,438.37 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 4,041,864.35   |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 11,026,443.97  |
| 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               | 250,247,858.75 |

## § 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 备查文件目录

### 8.1 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。

### 8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

### 8.3 查阅方式

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

摩根士丹利基金管理（中国）有限公司

2023 年 10 月 24 日