

# 摩根士丹利华鑫资源优选混合型证券投资 基金(LOF) 2021 年年度报告

2021 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：2022 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 2022 年 3 月 28 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 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>14</b>
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>16</b>
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
7.4 报表附注	19
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>46</b>

8.1 期末基金资产组合情况 .....	46
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	46
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	47
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	50
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	59
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 .....	59
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 .....	59
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 .....	59
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 .....	60
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	60
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	60
8.12 投资组合报告附注 .....	60
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>61</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	61
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	61
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	61
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	61
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>61</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>62</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	62
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 .....	62
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	62
11.4 基金投资策略的改变 .....	62
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	62
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 .....	62
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	62
11.8 其他重大事件 .....	65
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>67</b>
12.1 备查文件目录 .....	67
12.2 存放地点 .....	67
12.3 查阅方式 .....	67

## § 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LOF
基金主代码	163302
交易代码	163302
基金运作方式	契约型上市开放式(LOF)
基金合同生效日	2005年9月27日
基金管理人	摩根士丹利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	421,478,727.51份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2007年7月5日

### 2.2 基金产品说明

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

	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×70%+标普中国债券指数收益率×30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，长期平均风险介于股票型和债券型基金之间，适于能承担一定风险、追求较高收益和长期资本增值的投资者投资。

### 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		王鸿嫔	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	2021 年	2020 年	2019 年

指标			
本期已实现收益	154,255,995.09	334,236,228.98	63,582,344.50
本期利润	107,300,137.03	360,166,063.92	117,973,048.72
加权平均基金份额本期利润	0.2492	0.8235	0.2097
本期加权平均净值利润率	14.13%	54.28%	19.50%
本期基金份额净值增长率	15.34%	71.02%	21.07%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	288,473,829.03	301,116,093.95	13,453,862.65
期末可供分配基金份额利润	0.6844	0.7810	0.0257
期末基金资产净值	769,152,228.49	780,288,632.92	627,080,420.08
期末基金份额净值	1.8249	2.0237	1.1988
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	1,510.93%	1,296.72%	716.71%

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

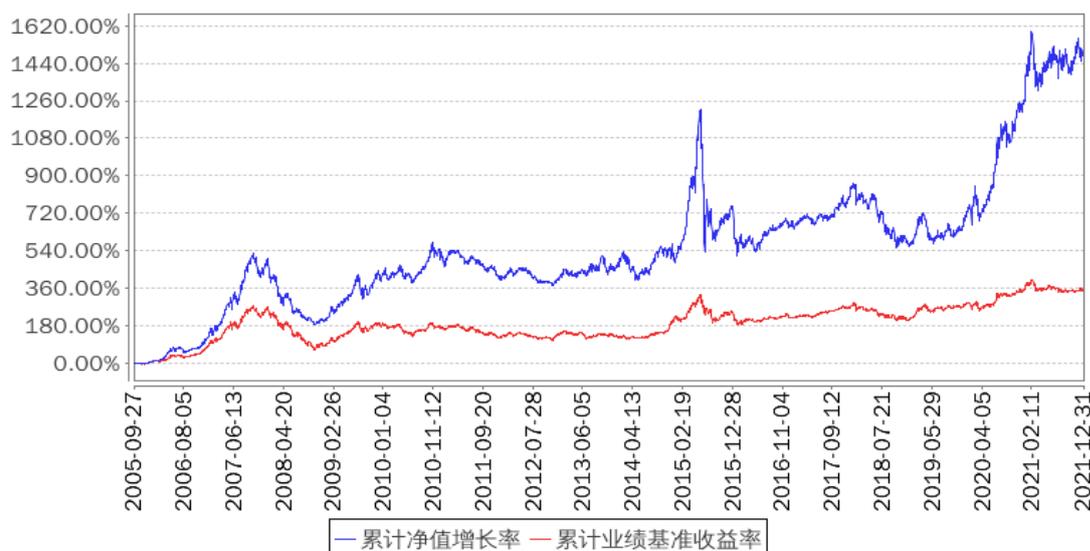
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净	份额净值	业绩比较基	业绩比较基准	①—③	②—④
----	-----	------	-------	--------	-----	-----

	值增长率①	增长率标准差②	准收益率③	收益率标准差④		
过去三个月	5.47%	1.04%	1.44%	0.55%	4.03%	0.49%
过去六个月	-0.22%	1.26%	-2.92%	0.71%	2.70%	0.55%
过去一年	15.34%	1.39%	-1.98%	0.82%	17.32%	0.57%
过去三年	138.80%	1.44%	48.21%	0.90%	90.59%	0.54%
过去五年	111.59%	1.32%	42.46%	0.84%	69.13%	0.48%
自基金合同生效起至今	1,510.93%	1.52%	351.98%	1.17%	1,158.95%	0.35%

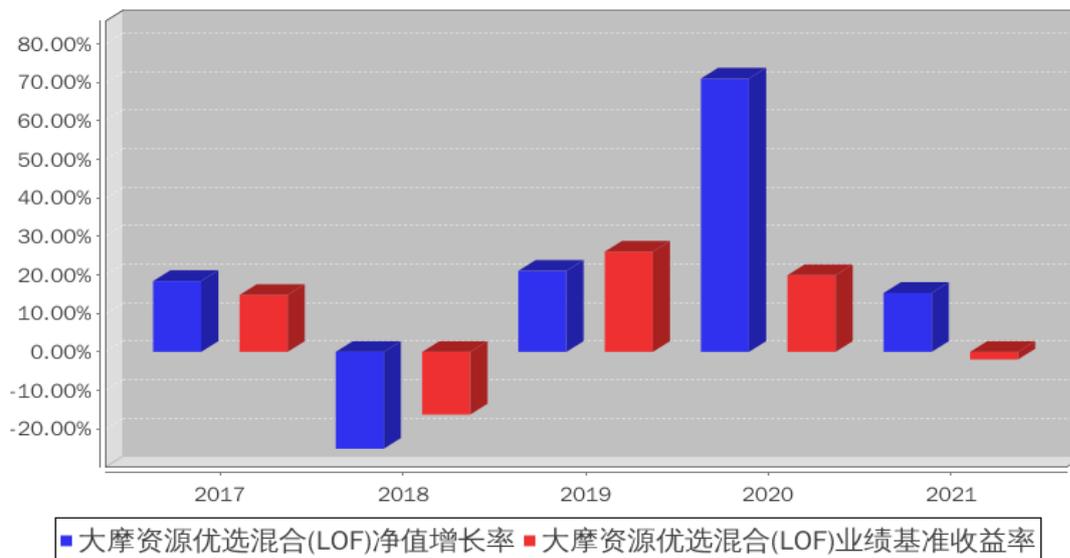
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021 年	4.6860	80,752,419.31	97,550,224.68	178,302,643.99	-
2020 年	0.1600	3,687,965.52	4,530,206.11	8,218,171.63	-
2019 年	-	-	-	-	-
合计	4.8460	84,440,384.83	102,080,430.79	186,520,815.62	-

## § 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2021年12月31日，公司旗下共管理34只公募基金，其中股票型基金4只，混合型基金19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	2016年6月17日	-	9年	美国弗吉尼亚大学经济学和商业学学士。2012年7月加入本公司，历任研究管理部

	理、基金经理				研究员、基金经理助理，现任权益投资部总监助理、基金经理。2016年6月起担任摩根士丹利华鑫资源优选混合型证券投资基金(LOF)基金经理，2017年1月至2019年9月担任摩根士丹利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。
--	--------	--	--	--	---

注：1、基金经理的任职日期为根据本公司决定确定的聘任日期；

2、基金经理的任职已按规定在中国证券投资基金业协会办理完毕基金经理注册；

3、证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，基金管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在认真控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

2021年，市场高开低走后反弹，指数走势跌宕起伏，板块快速轮动，最终上证综指收涨4.6%，深证综指收涨8.6%。行业方面，电新、化工和有色排名前三，煤炭和钢铁指数紧随其后，涨幅均超过40%。餐饮旅游、非银行金融和家电排名垫底，其中旅游和非银的跌幅超过20%，地产、农业和食品饮料指数也表现不佳。总体看，以电新为代表的成长行业和受益于大宗商品涨价的周期行业跑赢市场，而消费大幅跑输，行业指数表现出现剧烈分化，市场风格趋于极致。

本基金平均仓位在2021年一直处于中高水平。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白酒、家电和家居，而在成长板块中主要关注以电子、通信、汽车为代表的先进制造业。一季度本基金主要的加仓方向是顺周期和低估值的品种，如银行，家居等。一季度本基金净值表现较好，主要是抓住了经济复苏预期下中游制造行业的机会，如建材，化工等。二三季度本基金排名有所下滑，主要是1.在医药，食品饮料为代表的消费蓝筹上有所损失；2.对于成长板块配置不足。四季度本基金把握住了一些中小盘个股的机会，主要在汽车，机械等行业，净值增长跑赢大市。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期截至2021年12月31日，本基金份额净值为1.8249元，累计份额净值为5.1361元，报告期内基金份额净值增长率为15.34%，同期业绩比较基准收益率为-1.98%。

### 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2022年，我们对于市场保持谨慎乐观，结构性行情仍然可期，前期极致的行业分化大概率将得到缓解，同时稳增长政策可能使得现阶段过于悲观的经济预期有所修复。

### 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、基金运营等方面。同时，开展合规管理有效性评估、公司治理情况自查、公募基金投资管理自查、从业人员管理自查、投诉处理工作自查、投资者保护工作自查、人行资管产品统计工作自查等监管机构要求的自查工作。

(2) 做好日常监控工作。通过监控基金投资运作、优化关键业务流程、审核宣传推介材料、监督后台运营业务等工作，加强日常风险监控，规范基金投资、销售以及运营等各项业务管理，保障公司和基金运作合法合规。(3) 通过制度定期回顾机制持续完善公司内控制度体系；同时，适时解读监管政策与要求，组织落实侧袋机制、基金信息披露、新股网下询价、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。

2022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 178,302,643.99 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遵规守信情况声明

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

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

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《摩根士丹利华鑫资源优选混合型证券

投资基金 (LOF) 2021 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(2022)第 24344 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	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>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 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 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。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会 (以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会 (以下简称“中国基金业协会”) 发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了摩根士丹利华鑫资源优选基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于摩根士丹利华鑫资源优选基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>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</p>

	<p>表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估摩根士丹利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。</p> <p>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。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对摩根士丹利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。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	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	2022年3月24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：2021年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	68,659,321.40	54,964,224.69
结算备付金		9,230,200.23	7,005,244.68
存出保证金		768,640.89	898,241.62
交易性金融资产	7.4.7.2	696,933,052.40	728,914,721.35
其中：股票投资		696,933,052.40	728,914,721.35
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		6,202.30	-
应收利息	7.4.7.5	16,281.54	12,076.21
应收股利		-	-
应收申购款		111,074.86	78,441.42
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		775,724,773.62	791,872,949.97
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年12月31日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
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
应付赎回款		647,897.57	2,136,413.37
应付管理人报酬		972,445.20	963,032.75
应付托管费		162,074.18	160,505.46
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	4,393,416.92	2,928,562.94
应交税费		191,147.20	191,147.20

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	205,564.06	205,477.58
负债合计		6,572,545.13	11,584,317.05
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	421,478,727.51	385,571,885.68
未分配利润	7.4.7.10	347,673,500.98	394,716,747.24
所有者权益合计		769,152,228.49	780,288,632.92
负债和所有者权益总计		775,724,773.62	791,872,949.97

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.8249 元，基金份额总额 421,478,727.51 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		152,351,077.00	396,666,758.44
1. 利息收入		632,657.35	491,060.48
其中：存款利息收入	7.4.7.11	632,482.69	490,263.67
债券利息收入		174.66	796.81
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）		198,476,862.94	370,127,903.31
其中：股票投资收益	7.4.7.12	195,234,599.33	363,381,240.19
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	347,031.26	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	2,895,232.35	5,457,597.16
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-46,955,858.06	25,929,834.94

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	197,414.77	117,959.71
减：二、费用		45,050,939.97	36,500,694.52
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	11,406,486.39	9,907,995.95
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,901,081.13	1,651,332.66
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	31,451,171.82	24,649,163.01
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.63	2.90
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）		107,300,137.03	360,166,063.92
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		107,300,137.03	360,166,063.92

### 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：2021年1月1日至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021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）	385,571,885.68	394,716,747.24	780,288,632.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	107,300,137.03	107,300,137.03
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）	35,906,841.83	23,959,260.70	59,866,102.53
其中：1. 基金申购款	147,776,583.47	112,700,334.63	260,476,918.10
2. 基金赎回款	-111,869,741.64	-88,741,073.93	-200,610,815.57
四、本期向基金	-	-178,302,643.99	-178,302,643.99

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)	421,478,727.51	347,673,500.98	769,152,228.49
项目	上年度可比期间 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

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：

王鸿嫔

邓寰乐

谢先斌

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 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)

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2022年3月24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 2021 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 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 14 号—收入》，本基金于 2021 年 1 月 1 日起执行。本基金在编制 2021 年度财务报表时已采用该准则，该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

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

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017

年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

(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	上年度末
	2021年12月31日	2020年12月31日
活期存款	68,659,321.40	54,964,224.69
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	68,659,321.40	54,964,224.69

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末		
	2021年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	665,382,115.93	696,933,052.40	31,550,936.47
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	665,382,115.93	696,933,052.40	31,550,936.47
项目	上年度末 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

#### 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 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	11,782.04	8,519.71
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	4,153.60	3,152.30
应收债券利息	-	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	345.90	404.20
合计	16,281.54	12,076.21

#### 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 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	4,393,416.92	2,927,862.94
银行间市场应付交易费用	-	700.00
合计	4,393,416.92	2,928,562.94

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	864.06	1,477.58
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	204,000.00	204,000.00
其他	700.00	-
合计	205,564.06	205,477.58

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	385,571,885.68	385,571,885.68
本期申购	147,776,583.47	147,776,583.47
本期赎回(以“-”号填列)	-111,869,741.64	-111,869,741.64
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	421,478,727.51	421,478,727.51

注：1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 截至2021年12月31日止，本基金于深交所上市的基金份额为15,825,257.00份(2020年12月31日：8,057,569.00份)，托管在场外未上市交易的基金份额为405,653,470.51份(2020年12月31日：377,514,316.68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	301,116,093.95	93,600,653.29	394,716,747.24
本期利润	154,255,995.09	-46,955,858.06	107,300,137.03
本期基金份额交易产生的变动数	11,404,383.98	12,554,876.72	23,959,260.70
其中：基金申购款	79,702,411.42	32,997,923.21	112,700,334.63
基金赎回款	-68,298,027.44	-20,443,046.49	-88,741,073.93
本期已分配利润	-178,302,643.99	-	-178,302,643.99
本期末	288,473,829.03	59,199,671.95	347,673,500.98

## 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
活期存款利息收入	482,989.95	373,591.92
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	136,143.48	102,879.18
其他	13,349.26	13,792.57
合计	632,482.69	490,263.67

## 7.4.7.12 股票投资收益

## 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	195,234,599.33	363,381,240.19
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	195,234,599.33	363,381,240.19

## 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
卖出股票成交总额	11,683,285,372.88	8,656,568,357.22
减: 卖出股票成本总额	11,488,050,773.55	8,293,187,117.03
买卖股票差价收入	195,234,599.33	363,381,240.19

#### 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 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	347,031.26	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	347,031.26	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 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	1,202,411.20	5,719,946.29
减: 卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	855,200.00	4,430,000.00
减: 应收利息总额	179.94	880.33
买卖债券差价收入	347,031.26	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	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,895,232.35	5,457,597.16
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	2,895,232.35	5,457,597.16

## 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	-46,955,858.06	25,929,834.94
股票投资	-46,955,858.06	25,929,834.94
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	-46,955,858.06	25,929,834.94

## 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
基金赎回费收入	197,414.77	117,830.76
其他	-	128.95
合计	197,414.77	117,959.71

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	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	31,451,171.82	24,649,163.01
银行间市场交易费用	-	-
合计	31,451,171.82	24,649,163.01

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020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	-	-
债券账户维护费	36,000.00	36,000.00
上市费	60,000.00	60,000.00
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2022年1月7日宣告2021年度第1次分红，向截至2022年1月11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4.1070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：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	1,583,815,150.36	6.83	1,967,076,649.95	11.53

## 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 2021年1月1日至2021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	1,284,055.37	7.26	369,667.21	8.41
关联方名称	上年度可比期间 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

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 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	11,406,486.39
其中：支付销售机构的客户维护费	4,700,966.49	2,184,608.55

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：

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

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,901,081.13	1,651,332.66

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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

#### 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自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自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		上年度可比期间	
	2021年1月1日至2021年12月31日		2020年1月1日至2020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	68,659,321.40	482,989.95	54,964,224.69	373,591.92

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

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	2021年1月12日	2021年1月13日	2021年1月12日	4.6860	80,752,419.31	97,550,224.68	178,302,643.99	-
合计	-	-	-	4.6860	80,752,419.31	97,550,224.68	178,302,643.99	-

## 7.4.12 期末(2021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										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300774	倍杰特	2021年7月26日	2022年02月16日	新股流通受限	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
300814	中富电路	2021年8月4日	2022年2月14日	新股流通受限	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
300854	中兰环保	2021年9月8日	2022年3月16日	新股流通受限	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
300994	久祺股份	2021年8月2日	2022年2月14日	新股流通受限	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-
301018	申菱环境	2021年6月28日	2022年1月7日	新股流通受限	8.29	26.06	782	6,482.78	20,378.92	-
301025	读客文化	2021年7月6日	2022年01月24日	新股流通受限	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
301026	浩通科技	2021年7月8日	2022年1月17日	新股流通受限	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-
301027	华蓝集团	2021年7月8日	2022年01月19日	新股流通受限	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-

301029	怡合达	2021年 7月14 日	2022年 1月24 日	新股流 通受限	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-
301030	仕净科技	2021年 7月15 日	2022年 1月24 日	新股流 通受限	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301036	双乐股份	2021年 7月21 日	2022年 02月 16日	新股流 通受限	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301037	保立佳	2021年 7月21 日	2022年 2月7 日	新股流 通受限	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301040	中环海陆	2021年 7月26 日	2022年 2月7 日	新股流 通受限	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301041	金百泽	2021年 8月2 日	2022年 2月11 日	新股流 通受限	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301046	能辉科技	2021年 8月10 日	2022年 2月17 日	新股流 通受限	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301048	金鹰重工	2021年 8月11 日	2022年 02月 28日	新股流 通受限	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-
301049	超越科技	2021年 8月17 日	2022年 2月24 日	新股流 通受限	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301050	雷电微力	2021年 8月17 日	2022年 2月24 日	新股流 通受限	60.64	234.74	203	12,309.92	47,652.22	-
301053	远信工业	2021年 8月25 日	2022年 3月1 日	新股流 通受限	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301055	张小泉	2021年 8月26 日	2022年 3月7 日	新股流 通受限	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-
301056	森赫股份	2021年 8月27 日	2022年 3月7 日	新股流 通受限	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301057	汇隆新材	2021年 8月31 日	2022年 3月9 日	新股流 通受限	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301059	金三江	2021年 9月3 日	2022年 3月14 日	新股流 通受限	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-

		日	日							
301060	兰卫医学	2021年 9月6日	2022年 3月14日	新股流 通受限	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-
301063	海锅股份	2021年 9月9日	2022年 3月24日	新股流 通受限	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
301068	大地海洋	2021年 9月16日	2022年 3月28日	新股流 通受限	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301069	凯盛新材	2021年 9月16日	2022年 3月28日	新股流 通受限	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301072	中捷精工	2021年 9月22日	2022年 3月29日	新股流 通受限	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
301073	君亭酒店	2021年 9月22日	2022年 3月30日	新股流 通受限	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301079	邵阳液压	2021年 10月11日	2022年 4月19日	新股流 通受限	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-
301083	百胜智能	2021年 10月13日	2022年 4月21日	新股流 通受限	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-
301089	拓新药业	2021年 10月20日	2022年 4月27日	新股流 通受限	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301091	深城交	2021年 10月20日	2022年 4月29日	新股流 通受限	36.50	31.31	524	19,126.00	16,406.44	-
301100	风光股份	2021年 12月10日	2022年 6月17日	新股流 通受限	27.81	31.14	599	16,658.19	18,652.86	-
301101	明月镜片	2021年 12月9日	2022年 6月16日	新股流 通受限	26.91	43.36	371	9,983.61	16,086.56	-
301118	恒光股份	2021年 11月9日	2022年 5月18日	新股流 通受限	22.70	49.02	315	7,150.50	15,441.30	-
301133	金钟股份	2021年 11月19日	2022年 5月26日	新股流 通受限	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70	-
301166	优宁	2021年	2022年	新股流	86.06	94.50	253	21,773.18	23,908.50	-

	维	12月21日	6月28日	通受限						
301177	迪阿股份	2021年12月8日	2022年6月15日	新股流通受限	116.88	116.08	344	40,206.72	39,931.52	-
301179	泽宇智能	2021年12月1日	2022年6月8日	新股流通受限	43.99	50.77	295	12,977.05	14,977.15	-
301185	鸥玛软件	2021年11月11日	2022年5月19日	新股流通受限	11.88	21.16	578	6,866.64	12,230.48	-
301190	善水科技	2021年12月17日	2022年6月24日	新股流通受限	27.85	27.46	575	16,013.75	15,789.50	-
301198	喜悦智行	2021年11月25日	2022年6月2日	新股流通受限	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-
301211	亨迪药业	2021年12月14日	2022年6月22日	新股流通受限	25.80	33.65	967	24,948.60	32,539.55	-
301221	光庭信息	2021年12月15日	2022年6月22日	新股流通受限	69.89	88.72	280	19,569.20	24,841.60	-
688103	国力股份	2021年9月2日	2022年3月10日	新股流通受限	12.04	66.10	1,595	19,203.80	105,429.50	-
688176	亚虹医药	2021年12月29日	2022年01月07日	新股未上市	22.98	22.98	23,698	544,580.04	544,580.04	-
688509	正元地信	2021年7月22日	2022年2月7日	新股流通受限	1.97	6.17	15,433	30,403.01	95,221.61	-
688722	同益中	2021年10月8日	2022年4月19日	新股流通受限	4.51	10.19	3,687	16,628.37	37,570.53	-
688793	倍轻松	2021年7月7日	2022年1月17日	新股流通受限	27.40	101.73	1,454	39,839.60	147,915.42	-

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2021年12月31日，本基金无债券投资（2020年12月31日，同）。

#### 7.4.13.3 流动性风险

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

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

于2021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时间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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15% (完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2021 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 2021 年 12 月 31 日，本基金最近工作日确认的净赎回金额未超过组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	68,659,321.40	-	-	-	68,659,321.40
结算备付金	9,230,200.23	-	-	-	9,230,200.23
存出保证金	768,640.89	-	-	-	768,640.89
交易性金融资产	-	-	-	696,933,052.40	696,933,052.40
应收利息	-	-	-	16,281.54	16,281.54
应收申购款	-	-	-	111,074.86	111,074.86
应收证券清算款	-	-	-	6,202.30	6,202.30
<b>资产总计</b>	<b>78,658,162.52</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>697,066,611.10</b>	<b>775,724,773.62</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	647,897.57	647,897.57
应付管理人报酬	-	-	-	972,445.20	972,445.20
应付托管费	-	-	-	162,074.18	162,074.18
应付交易费用	-	-	-	4,393,416.92	4,393,416.92
应交税费	-	-	-	191,147.20	191,147.20
其他负债	-	-	-	205,564.06	205,564.06
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>6,572,545.13</b>	<b>6,572,545.13</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>78,658,162.52</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-690,494,065.97</b>	<b>769,152,228.49</b>
<b>上年度末 2020年12月31日</b>	<b>1年以内</b>	<b>1-5年</b>	<b>5年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
<b>资产</b>					
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
<b>资产总计</b>	<b>62,867,710.99</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>729,005,238.98</b>	<b>791,872,949.97</b>
<b>负债</b>					
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

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 2021 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 (2020 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2020 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。此外，本基金的基金管理人日常对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量、跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		上年度末 2020 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	696,933,052.40	90.61	728,914,721.35	93.42
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	696,933,052.40	90.61	728,914,721.35	93.42

#### 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		
	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(2021年12月31日)	上年度末(2020年12月31日)
分析	业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	46,070,000.00	52,670,000.00
	业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-46,070,000.00	-52,670,000.00

#### 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 2021 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 695,399,242.64 元，属于第二层次的余额为 544,580.04 元，属于第三层次

的余额为989,229.72元(2020年12月31日:第一层次724,425,745.79元,第二层次4,488,975.56元,无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

于2021年12月31日,本基金持有公允价值归属于第三层次的金融工具989,229.72元(2020年12月31日:无)。本基金本年度购买第三层次的金融工具412,554.91元(2020年度:无),计入损益的第三层次的金融工具公允价值变动或当期投资收益576,674.81元(2020年度:无)。于2021年12月31日,本基金持有的第三层次的交易性金融资产(均为股票投资)公允价值为989,229.72元,采用平均价格亚式期权模型进行估值,不可观察输入值为预期波动率,与公允价值之间为负相关关系。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021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(2020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) 根据财政部发布的《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》和《企业会计准则第37号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定,以及财政部、银保监会于2020年12月30日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金应当自2022年1月1日起执行新金融工具准则。截至2021年12月31日,本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质,新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自2022年1月1日起追溯执行相关新规定,并采用准则允许的实务简便方法,调整期初所有者权益,2021年的比较数据将不作重述。

(3) 除公允价值和执行新金融工具准则外，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	696,933,052.40	89.84
	其中：股票	696,933,052.40	89.84
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	77,889,521.63	10.04
8	其他各项资产	902,199.59	0.12
9	合计	775,724,773.62	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	20,332.12	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	654,576,929.77	85.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	23,328.03	0.00
F	批发和零售业	459,735.58	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,860,611.76	2.32
J	金融业	-	-
K	房地产业	23,345,000.00	3.04
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	557,761.71	0.07

N	水利、环境和公共设施管理业	58,169.01	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	18,161.78	0.00
R	文化、体育和娱乐业	8,414.64	0.00
S	综合	-	-
	合计	696,933,052.40	90.61

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300737	科顺股份	2,246,299	36,502,358.75	4.75
2	002859	洁美科技	905,500	33,684,600.00	4.38
3	603228	景旺电子	974,110	33,636,018.30	4.37
4	300760	迈瑞医疗	83,400	31,758,720.00	4.13
5	300408	三环集团	686,600	30,622,360.00	3.98
6	000887	中鼎股份	1,326,280	28,926,166.80	3.76
7	688208	道通科技	345,404	27,425,077.60	3.57
8	600887	伊利股份	632,400	26,219,304.00	3.41
9	300122	智飞生物	202,800	25,268,880.00	3.29
10	603086	先达股份	2,034,200	25,203,738.00	3.28
11	601012	隆基股份	289,200	24,929,040.00	3.24
12	600529	山东药玻	544,312	23,895,296.80	3.11
13	600522	中天科技	1,396,100	23,677,856.00	3.08
14	001979	招商蛇口	1,750,000	23,345,000.00	3.04
15	688626	翔宇医疗	407,651	23,203,494.92	3.02
16	600745	闻泰科技	174,800	22,601,640.00	2.94
17	600873	梅花生物	2,723,800	20,891,546.00	2.72
18	002637	赞宇科技	1,069,900	20,199,712.00	2.63
19	603337	杰克股份	768,683	18,025,616.35	2.34
20	300571	平治信息	288,900	16,917,984.00	2.20
21	300219	鸿利智汇	1,064,200	16,825,002.00	2.19
22	688608	恒玄科技	50,677	15,456,485.00	2.01
23	600732	爱旭股份	654,500	15,289,120.00	1.99
24	688121	卓然股份	388,804	14,949,513.80	1.94
25	000550	江铃汽车	882,500	14,393,575.00	1.87
26	002879	长缆科技	539,900	12,741,640.00	1.66
27	688071	华依科技	176,841	11,634,369.39	1.51
28	300054	鼎龙股份	460,700	11,213,438.00	1.46
29	601636	旗滨集团	598,600	10,236,060.00	1.33
30	300243	瑞丰高材	734,000	9,784,220.00	1.27

31	605555	德昌股份	201,400	8,217,120.00	1.07
32	000049	德赛电池	124,988	7,289,300.16	0.95
33	000657	中钨高新	451,000	7,252,080.00	0.94
34	688499	利元亨	20,371	5,968,703.00	0.78
35	688323	瑞华泰	127,232	4,902,248.96	0.64
36	688667	菱电电控	20,827	3,585,368.05	0.47
37	603960	克来机电	95,500	3,474,290.00	0.45
38	688176	亚虹医药	23,698	544,580.04	0.07
39	688167	炬光科技	2,014	441,066.00	0.06
40	301211	亨迪药业	9,664	359,633.72	0.05
41	688798	艾为电子	1,600	345,600.00	0.04
42	688776	国光电气	1,447	282,787.21	0.04
43	688248	南网科技	11,763	271,725.30	0.04
44	301221	光庭信息	2,791	264,566.77	0.03
45	301069	凯盛新材	5,386	260,217.38	0.03
46	301166	优宁维	2,528	258,233.50	0.03
47	688206	概伦电子	6,000	220,140.00	0.03
48	301100	风光股份	5,985	218,204.16	0.03
49	688049	炬芯科技	3,260	198,892.60	0.03
50	301101	明月镜片	3,703	197,280.72	0.03
51	688257	新锐股份	2,899	191,913.80	0.02
52	301118	恒光股份	3,142	190,856.65	0.02
53	301091	深城交	5,240	171,845.80	0.02
54	301190	善水科技	5,741	171,802.70	0.02
55	301179	泽宇智能	2,941	161,592.01	0.02
56	301185	鸥玛软件	5,776	151,069.06	0.02
57	688793	倍轻松	1,454	147,915.42	0.02
58	301015	百洋医药	4,614	139,804.20	0.02
59	688227	品高股份	4,164	133,581.12	0.02
60	688236	春立医疗	4,052	110,984.28	0.01
61	688103	国力股份	1,595	105,429.50	0.01
62	301133	金钟股份	2,860	102,096.28	0.01
63	688509	正元地信	15,433	95,221.61	0.01
64	301198	喜悦智行	2,613	95,084.09	0.01
65	688314	康拓医疗	1,085	71,588.30	0.01
66	301050	雷电微力	203	47,652.22	0.01
67	301029	怡合达	462	41,519.94	0.01
68	301177	迪阿股份	344	39,931.52	0.01
69	688722	同益中	3,687	37,570.53	0.00
70	600935	华塑股份	4,812	36,763.68	0.00
71	300982	苏文电能	317	23,328.03	0.00
72	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.00

73	603216	梦天家居	772	19,523.88	0.00
74	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
75	603213	镇洋发展	799	18,504.84	0.00
76	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
77	300997	欢乐家	928	16,082.24	0.00
78	300968	格林精密	1,162	15,977.50	0.00
79	300614	百川畅银	329	15,792.00	0.00
80	001218	丽臣实业	350	15,267.00	0.00
81	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
82	301009	可靠股份	801	14,778.45	0.00
83	300985	致远新能	295	14,460.90	0.00
84	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
85	300967	晓鸣股份	507	13,516.62	0.00
86	605566	福莱茵特	435	13,350.15	0.00
87	605599	菜百股份	980	13,190.80	0.00
88	300942	易瑞生物	443	12,784.98	0.00
89	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
90	605365	立达信	645	12,364.65	0.00
91	301013	利和兴	471	12,104.70	0.00
92	300987	川网传媒	301	11,678.80	0.00
93	300962	中金辐照	576	11,422.08	0.00
94	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
95	301002	崧盛股份	201	10,813.80	0.00
96	300978	东箭科技	593	10,709.58	0.00
97	603219	富佳股份	528	10,449.12	0.00
98	001288	运机集团	537	9,563.97	0.00
99	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
100	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
101	300950	德固特	219	9,143.25	0.00
102	300975	商络电子	492	8,575.56	0.00
103	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
104	300991	创益通	254	8,359.14	0.00
105	001219	青岛食品	272	8,323.20	0.00
106	300958	建工修复	300	8,103.00	0.00
107	300961	深水海纳	394	8,017.90	0.00
108	300956	英力股份	371	7,965.37	0.00
109	300952	恒辉安防	340	7,956.00	0.00
110	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
111	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
112	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
113	300927	江天化学	217	7,354.13	0.00
114	301016	雷尔伟	275	7,128.00	0.00

115	300963	中洲特材	283	6,888.22	0.00
116	300972	万辰生物	430	6,815.50	0.00
117	300998	宁波方正	201	6,699.33	0.00
118	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
119	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
120	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
121	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
122	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
123	301007	德迈仕	303	6,035.76	0.00
124	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
125	300960	通业科技	234	5,833.62	0.00
126	300886	华业香料	191	5,794.94	0.00
127	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
128	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
129	300995	奇德新材	191	5,292.61	0.00
130	301010	晶雪节能	218	5,227.64	0.00
131	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
132	300992	泰福泵业	200	4,950.00	0.00
133	300929	华骐环保	183	4,904.40	0.00
134	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
135	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
136	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
137	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
138	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
139	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
140	301079	邵阳液压	140	3,474.80	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	300122	智飞生物	266,613,934.83	34.17
2	000001	平安银行	236,502,148.42	30.31
3	300737	科顺股份	210,544,635.18	26.98
4	601012	隆基股份	193,308,395.17	24.77
5	600346	恒力石化	181,986,605.69	23.32
6	603801	志邦家居	168,749,821.79	21.63
7	000568	泸州老窖	152,418,814.70	19.53
8	688033	天宜上佳	141,212,193.69	18.10
9	000739	普洛药业	140,345,995.32	17.99
10	300760	迈瑞医疗	132,969,342.00	17.04
11	600732	爱旭股份	132,445,095.94	16.97

12	688208	道通科技	129,431,593.63	16.59
13	000550	江铃汽车	127,281,812.80	16.31
14	600803	新奥股份	126,231,027.92	16.18
15	600600	青岛啤酒	126,025,550.20	16.15
16	603833	欧派家居	124,004,244.39	15.89
17	688499	利元亨	122,343,122.37	15.68
18	600132	重庆啤酒	116,762,213.67	14.96
19	688518	联赢激光	115,046,002.42	14.74
20	600966	博汇纸业	109,165,345.07	13.99
21	600754	锦江酒店	108,232,370.36	13.87
22	000913	钱江摩托	107,718,938.78	13.81
23	603129	春风动力	104,703,938.01	13.42
24	000002	万科A	104,529,919.47	13.40
25	688390	固德威	103,154,971.31	13.22
26	002466	天齐锂业	101,575,476.84	13.02
27	601888	中国中免	100,876,758.47	12.93
28	600741	华域汽车	100,711,714.84	12.91
29	002271	东方雨虹	100,654,694.00	12.90
30	601233	桐昆股份	97,750,920.34	12.53
31	600176	中国巨石	97,650,724.70	12.51
32	002340	格林美	94,720,581.13	12.14
33	688626	翔宇医疗	93,421,750.62	11.97
34	601636	旗滨集团	92,050,335.91	11.80
35	002299	圣农发展	91,976,009.48	11.79
36	000333	美的集团	90,721,651.52	11.63
37	600196	复星医药	89,466,134.83	11.47
38	600276	恒瑞医药	87,372,901.71	11.20
39	300347	泰格医药	85,594,294.50	10.97
40	601318	中国平安	82,172,565.86	10.53
41	002230	科大讯飞	79,673,630.86	10.21
42	688076	诺泰生物	78,983,974.63	10.12
43	002241	歌尔股份	77,991,106.26	10.00
44	002572	索菲亚	77,059,589.72	9.88
45	601689	拓普集团	76,241,832.99	9.77
46	603228	景旺电子	75,045,125.36	9.62
47	600309	万华化学	73,758,092.32	9.45
48	601100	恒立液压	73,654,124.03	9.44
49	300408	三环集团	72,728,296.00	9.32
50	600409	三友化工	72,381,962.99	9.28
51	601222	林洋能源	72,155,736.87	9.25
52	603986	兆易创新	71,294,040.82	9.14
53	002245	蔚蓝锂芯	69,587,305.50	8.92

54	001979	招商蛇口	69,528,383.55	8.91
55	688389	普门科技	68,824,660.19	8.82
56	300373	扬杰科技	68,516,003.08	8.78
57	600031	三一重工	68,474,512.93	8.78
58	600745	闻泰科技	68,255,513.11	8.75
59	600519	贵州茅台	68,149,647.29	8.73
60	600522	中天科技	67,092,233.09	8.60
61	002511	中顺洁柔	64,163,000.00	8.22
62	688121	卓然股份	63,363,342.26	8.12
63	603960	克来机电	63,274,687.13	8.11
64	600887	伊利股份	62,760,035.86	8.04
65	600258	首旅酒店	62,001,787.76	7.95
66	002949	华阳国际	61,342,311.00	7.86
67	000887	中鼎股份	61,093,437.15	7.83
68	603086	先达股份	60,609,615.41	7.77
69	000661	长春高新	60,214,579.78	7.72
70	605005	合兴股份	60,214,154.60	7.72
71	300653	正海生物	60,092,822.98	7.70
72	300360	炬华科技	58,888,363.64	7.55
73	603606	东方电缆	58,145,499.78	7.45
74	002739	万达电影	57,082,100.73	7.32
75	600703	三安光电	56,989,144.14	7.30
76	002859	洁美科技	54,256,719.60	6.95
77	603882	金城医学	53,994,046.17	6.92
78	600166	福田汽车	53,952,779.33	6.91
79	002594	比亚迪	53,597,912.41	6.87
80	688789	宏华数科	53,179,420.21	6.82
81	300616	尚品宅配	51,897,713.35	6.65
82	603337	杰克股份	51,831,850.49	6.64
83	300601	康泰生物	51,727,659.80	6.63
84	600486	扬农化工	51,538,279.00	6.61
85	000012	南玻A	50,507,762.75	6.47
86	688596	正帆科技	50,420,766.25	6.46
87	300450	先导智能	49,390,536.61	6.33
88	688071	华依科技	49,310,500.86	6.32
89	002049	紫光国微	47,354,377.73	6.07
90	605305	中际联合	45,550,166.97	5.84
91	603877	太平鸟	44,254,779.10	5.67
92	600872	中炬高新	43,054,785.37	5.52
93	002487	大金重工	42,333,118.96	5.43
94	002425	凯撒文化	41,870,095.79	5.37
95	000895	双汇发展	41,719,111.30	5.35

96	000657	中钨高新	41,577,113.20	5.33
97	603218	日月股份	40,526,425.72	5.19
98	002539	云图控股	40,480,914.30	5.19
99	000858	五粮液	40,026,499.88	5.13
100	600699	均胜电子	39,690,702.42	5.09
101	601688	华泰证券	39,633,401.04	5.08
102	688103	国力股份	38,280,789.85	4.91
103	300623	捷捷微电	38,111,769.10	4.88
104	300219	鸿利智汇	37,726,774.00	4.83
105	600030	中信证券	37,676,870.00	4.83
106	688025	杰普特	37,583,471.31	4.82
107	603393	新天然气	37,464,929.28	4.80
108	688131	皓元医药	37,269,697.41	4.78
109	300033	同花顺	36,493,666.58	4.68
110	000630	铜陵有色	36,250,060.00	4.65
111	600529	山东药玻	36,211,326.00	4.64
112	600219	南山铝业	35,127,149.70	4.50
113	000650	仁和药业	34,113,076.00	4.37
114	603666	亿嘉和	33,966,033.42	4.35
115	600323	瀚蓝环境	33,865,998.56	4.34
116	603259	药明康德	33,643,057.64	4.31
117	300799	左江科技	33,509,200.50	4.29
118	001965	招商公路	33,314,998.62	4.27
119	300772	运达股份	32,482,411.48	4.16
120	002979	雷赛智能	32,363,246.50	4.15
121	300596	利安隆	31,886,044.50	4.09
122	600075	新疆天业	31,597,547.23	4.05
123	600377	宁沪高速	29,441,332.02	3.77
124	603517	绝味食品	28,987,787.55	3.72
125	688677	海泰新光	28,899,451.20	3.70
126	601678	滨化股份	28,567,151.00	3.66
127	300832	新产业	28,539,041.90	3.66
128	601877	正泰电器	28,515,029.67	3.65
129	002601	龙佰集团	28,318,933.84	3.63
130	603355	莱克电气	27,997,477.91	3.59
131	300843	胜蓝股份	27,682,694.00	3.55
132	002705	新宝股份	26,752,995.96	3.43
133	002027	分众传媒	26,692,983.00	3.42
134	603181	皇马科技	26,640,752.21	3.41
135	003043	华亚智能	26,578,396.00	3.41
136	000400	许继电气	26,429,025.10	3.39
137	600660	福耀玻璃	26,341,754.90	3.38

138	002064	华峰化学	26,273,784.28	3.37
139	000998	隆平高科	26,139,148.77	3.35
140	605089	味知香	25,881,328.85	3.32
141	002242	九阳股份	25,763,781.85	3.30
142	600438	通威股份	25,709,553.26	3.29
143	300750	宁德时代	25,625,045.78	3.28
144	688383	新益昌	25,256,365.80	3.24
145	600673	东阳光	24,948,485.00	3.20
146	688106	金宏气体	24,899,634.07	3.19
147	300327	中颖电子	24,779,526.48	3.18
148	688625	呈和科技	24,741,527.92	3.17
149	300853	申昊科技	24,719,612.60	3.17
150	002798	帝欧家居	24,470,103.88	3.14
151	603179	新泉股份	24,445,782.04	3.13
152	600809	山西汾酒	24,287,001.00	3.11
153	002092	中泰化学	22,888,514.41	2.93
154	688268	华特气体	22,750,730.01	2.92
155	300144	宋城演艺	22,724,758.00	2.91
156	000725	京东方A	22,610,345.28	2.90
157	002637	赞宇科技	22,498,423.00	2.88
158	300059	东方财富	21,610,905.93	2.77
159	002386	天原股份	21,366,446.79	2.74
160	601388	怡球资源	21,297,604.00	2.73
161	300124	汇川技术	20,754,521.26	2.66
162	603639	海利尔	20,747,200.14	2.66
163	002879	长缆科技	20,679,796.00	2.65
164	300582	英飞特	20,592,114.50	2.64
165	688202	美迪西	20,410,905.83	2.62
166	002283	天润工业	20,409,055.00	2.62
167	300558	贝达药业	20,283,627.48	2.60
168	300999	金龙鱼	20,215,739.45	2.59
169	600873	梅花生物	20,184,166.00	2.59
170	002430	杭氧股份	19,374,649.34	2.48
171	000625	长安汽车	19,162,144.60	2.46
172	002202	金风科技	18,683,905.00	2.39
173	001914	招商积余	18,610,216.32	2.39
174	300457	赢合科技	18,602,079.00	2.38
175	000792	盐湖股份	18,571,354.24	2.38
176	603659	璞泰来	17,997,474.40	2.31
177	600398	海澜之家	17,589,918.24	2.25
178	688575	亚辉龙	17,554,766.90	2.25
179	600183	生益科技	17,302,548.23	2.22

180	301087	可孚医疗	16,124,972.24	2.07
181	000488	晨鸣纸业	15,981,919.74	2.05
182	600597	光明乳业	15,797,456.00	2.02
183	000049	德赛电池	15,606,354.09	2.00

注：“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000001	平安银行	276,217,236.83	35.40
2	300737	科顺股份	244,134,873.67	31.29
3	600346	恒力石化	227,093,341.83	29.10
4	300122	智飞生物	222,921,430.97	28.57
5	601012	隆基股份	175,787,038.18	22.53
6	603801	志邦家居	173,602,051.05	22.25
7	600132	重庆啤酒	164,552,067.53	21.09
8	600600	青岛啤酒	162,458,499.19	20.82
9	000568	泸州老窖	153,195,381.84	19.63
10	000739	普洛药业	150,288,079.27	19.26
11	688033	天宜上佳	149,370,424.54	19.14
12	300760	迈瑞医疗	144,221,206.92	18.48
13	600966	博汇纸业	133,742,481.79	17.14
14	600803	新奥股份	129,667,340.17	16.62
15	603833	欧派家居	127,169,265.74	16.30
16	688518	联赢激光	125,493,906.80	16.08
17	600732	爱旭股份	124,173,669.74	15.91
18	000550	江铃汽车	120,812,877.45	15.48
19	600741	华域汽车	118,915,452.76	15.24
20	688499	利元亨	118,711,001.13	15.21
21	600176	中国巨石	117,069,298.86	15.00
22	601233	桐昆股份	116,620,136.64	14.95
23	000333	美的集团	116,339,959.34	14.91
24	600754	锦江酒店	111,057,427.82	14.23
25	600276	恒瑞医药	105,840,234.92	13.56
26	688390	固德威	105,282,687.84	13.49
27	603129	春风动力	104,636,903.05	13.41
28	002466	天齐锂业	103,844,559.30	13.31
29	688208	道通科技	101,736,705.46	13.04
30	002299	圣农发展	101,284,308.26	12.98
31	002271	东方雨虹	101,198,156.99	12.97
32	601888	中国中免	99,957,085.25	12.81
33	000913	钱江摩托	98,905,690.07	12.68

34	000002	万 科 A	98,636,176.77	12.64
35	002241	歌尔股份	98,436,404.62	12.62
36	600309	万华化学	96,127,720.58	12.32
37	002340	格林美	95,459,497.38	12.23
38	600196	复星医药	87,674,059.10	11.24
39	002230	科大讯飞	85,935,308.48	11.01
40	601689	拓普集团	85,221,911.60	10.92
41	601636	旗滨集团	83,340,250.99	10.68
42	688626	翔宇医疗	80,641,506.58	10.33
43	300347	泰格医药	80,134,255.14	10.27
44	688076	诺泰生物	79,245,643.30	10.16
45	601318	中国平安	77,740,724.58	9.96
46	002572	索菲亚	76,794,115.02	9.84
47	603986	兆易创新	75,920,123.90	9.73
48	601100	恒立液压	75,625,695.30	9.69
49	603259	药明康德	74,444,149.27	9.54
50	300750	宁德时代	73,006,712.92	9.36
51	601222	林洋能源	71,295,185.43	9.14
52	002245	蔚蓝锂芯	70,720,908.05	9.06
53	600409	三友化工	69,647,095.00	8.93
54	300373	扬杰科技	69,617,276.12	8.92
55	688389	普门科技	68,740,642.93	8.81
56	600519	贵州茅台	67,434,664.53	8.64
57	600872	中炬高新	66,951,096.22	8.58
58	002739	万达电影	66,916,386.04	8.58
59	300616	尚品宅配	66,735,696.56	8.55
60	002511	中顺洁柔	66,054,208.00	8.47
61	600258	首旅酒店	65,375,563.15	8.38
62	603606	东方电缆	64,466,203.03	8.26
63	600031	三一重工	64,287,833.73	8.24
64	600703	三安光电	64,114,451.19	8.22
65	002594	比亚迪	61,331,492.72	7.86
66	300653	正海生物	61,312,203.42	7.86
67	300450	先导智能	59,875,581.79	7.67
68	603960	克来机电	59,624,449.76	7.64
69	002949	华阳国际	59,532,059.16	7.63
70	000661	长春高新	58,826,676.60	7.54
71	605005	合兴股份	58,442,027.68	7.49
72	000012	南 玻 A	58,062,886.22	7.44
73	603882	金域医学	57,700,994.26	7.39
74	002027	分众传媒	57,175,046.69	7.33
75	300360	炬华科技	55,686,418.50	7.14

76	600166	福田汽车	53,223,896.00	6.82
77	300601	康泰生物	52,796,418.10	6.77
78	002049	紫光国微	52,560,131.00	6.74
79	002539	云图控股	52,260,181.00	6.70
80	688789	宏华数科	51,857,257.43	6.65
81	001979	招商蛇口	51,256,786.37	6.57
82	688596	正帆科技	50,715,575.02	6.50
83	605305	中际联合	50,142,299.00	6.43
84	603393	新天然气	50,081,508.35	6.42
85	600486	扬农化工	46,342,034.00	5.94
86	603228	景旺电子	46,107,706.18	5.91
87	600522	中天科技	45,289,465.42	5.80
88	600745	闻泰科技	44,572,510.00	5.71
89	688121	卓然股份	44,541,847.58	5.71
90	300408	三环集团	44,011,867.37	5.64
91	002601	龙佰集团	43,388,567.84	5.56
92	002487	大金重工	43,174,836.28	5.53
93	300558	贝达药业	43,072,630.38	5.52
94	603218	日月股份	42,828,011.30	5.49
95	300623	捷捷微电	42,413,188.62	5.44
96	688071	华依科技	41,852,518.59	5.36
97	002425	凯撒文化	41,578,619.06	5.33
98	601688	华泰证券	41,154,816.36	5.27
99	603877	太平鸟	40,427,298.40	5.18
100	000895	双汇发展	39,740,774.78	5.09
101	688131	皓元医药	39,290,633.30	5.04
102	688103	国力股份	38,274,038.08	4.91
103	600699	均胜电子	37,892,574.40	4.86
104	000887	中鼎股份	37,857,507.53	4.85
105	600030	中信证券	36,860,874.37	4.72
106	600887	伊利股份	36,752,658.60	4.71
107	300759	康龙化成	36,535,878.87	4.68
108	300033	同花顺	36,137,966.00	4.63
109	603086	先达股份	35,651,505.20	4.57
110	000858	五粮液	35,636,683.00	4.57
111	688025	杰普特	34,626,142.97	4.44
112	603666	亿嘉和	34,437,981.24	4.41
113	600219	南山铝业	34,333,434.00	4.40
114	000630	铜陵有色	33,948,951.00	4.35
115	600075	新疆天业	33,937,716.67	4.35
116	300799	左江科技	33,911,538.60	4.35
117	000650	仁和药业	33,286,159.79	4.27

118	000657	中钨高新	32,413,985.80	4.15
119	603337	杰克股份	32,097,076.00	4.11
120	603181	皇马科技	31,792,556.88	4.07
121	300772	运达股份	31,759,994.97	4.07
122	600323	瀚蓝环境	31,421,193.51	4.03
123	002979	雷赛智能	31,357,988.14	4.02
124	300596	利安隆	31,223,036.00	4.00
125	000651	格力电器	31,094,914.18	3.99
126	001965	招商公路	30,363,227.05	3.89
127	688383	新益昌	29,237,810.65	3.75
128	600377	宁沪高速	29,156,773.33	3.74
129	688677	海泰新光	28,415,175.13	3.64
130	601678	滨化股份	28,077,096.57	3.60
131	300832	新产业	27,989,158.44	3.59
132	603517	绝味食品	27,434,168.54	3.52
133	300327	中颖电子	27,231,801.56	3.49
134	603659	璞泰来	26,911,124.30	3.45
135	002283	天润工业	26,905,520.00	3.45
136	000400	许继电气	26,891,934.97	3.45
137	600673	东阳光	26,630,046.00	3.41
138	003043	华亚智能	26,452,835.22	3.39
139	603355	莱克电气	26,395,235.14	3.38
140	002064	华峰化学	26,008,176.46	3.33
141	601877	正泰电器	25,936,710.00	3.32
142	000998	隆平高科	25,934,771.55	3.32
143	300843	胜蓝股份	25,864,827.00	3.31
144	002242	九阳股份	25,731,562.00	3.30
145	002705	新宝股份	25,359,862.25	3.25
146	600660	福耀玻璃	25,267,446.81	3.24
147	600809	山西汾酒	24,406,953.20	3.13
148	300853	申昊科技	24,335,123.20	3.12
149	600438	通威股份	23,806,283.00	3.05
150	603179	新泉股份	23,413,797.41	3.00
151	300219	鸿利智汇	22,934,009.00	2.94
152	605089	味知香	22,884,120.19	2.93
153	688202	美迪西	22,873,847.63	2.93
154	300582	英飞特	22,819,494.00	2.92
155	688106	金宏气体	22,784,904.16	2.92
156	688625	呈和科技	22,746,145.53	2.92
157	300059	东方财富	22,733,546.98	2.91
158	002798	帝欧家居	22,473,438.64	2.88
159	002859	洁美科技	22,133,966.20	2.84

160	002092	中泰化学	21,965,572.76	2.82
161	300457	赢合科技	21,607,279.07	2.77
162	688268	华特气体	21,508,848.34	2.76
163	000725	京东方A	21,279,797.00	2.73
164	300888	稳健医疗	21,251,462.72	2.72
165	601388	怡球资源	20,716,162.00	2.65
166	300124	汇川技术	20,563,734.50	2.64
167	300144	宋城演艺	20,524,456.00	2.63
168	300999	金龙鱼	20,446,801.34	2.62
169	002386	天原股份	20,152,781.00	2.58
170	000792	盐湖股份	19,737,246.00	2.53
171	002430	杭氧股份	19,055,877.57	2.44
172	000625	长安汽车	18,910,312.73	2.42
173	001914	招商积余	18,787,883.00	2.41
174	603639	海利尔	18,432,200.99	2.36
175	600183	生益科技	17,773,670.00	2.28
176	600398	海澜之家	17,451,882.25	2.24
177	002202	金风科技	16,764,090.58	2.15
178	301087	可孚医疗	16,593,105.70	2.13
179	600596	新安股份	16,462,507.00	2.11
180	600426	华鲁恒升	16,167,892.70	2.07
181	000488	晨鸣纸业	15,692,555.00	2.01

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	11,503,024,962.66
卖出股票收入（成交）总额	11,683,285,372.88

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

本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本报告期内被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库**

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

**8.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	768,640.89
2	应收证券清算款	6,202.30
3	应收股利	-
4	应收利息	16,281.54
5	应收申购款	111,074.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	902,199.59

#### 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 (%)
31,838	13,238.23	949,339.05	0.23	420,529,388.46	99.77

#### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	张志中	5,524,922.00	34.91
2	王瑛	490,000.00	3.10
3	高德荣	454,870.00	2.87
4	陈翠芳	400,144.00	2.53
5	张泰昌	234,500.00	1.48
6	徐忠实	234,184.00	1.48
7	孙志明	223,116.00	1.41
8	吴建城	199,944.00	1.26
9	徐忠实	170,158.00	1.08
10	杨金香	169,700.00	1.07

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	193,103.09	0.0458

#### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研 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)	309,568,999.66
----------------------	----------------

基金份额总额	
本报告期期初基金份额总额	385,571,885.68
本报告期基金总申购份额	147,776,583.47
减：本报告期基金总赎回份额	111,869,741.64
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	421,478,727.51

## § 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：

2021年5月26日，基金管理人法定代表人变更为总经理王鸿嫔女士。基金管理人于2021年5月28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：

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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）2021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）已连续十六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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	-----	------	-----------	----

	元数量	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	4,153,362,894.63	17.92%	3,037,354.29	17.18%	-
海通证券	1	3,331,347,645.15	14.38%	2,436,209.36	13.78%	-
信达证券	1	3,281,218,952.58	14.16%	2,399,565.55	13.58%	-
华鑫证券	1	1,583,815,150.36	6.83%	1,284,055.37	7.26%	-
东兴证券	1	1,464,902,895.91	6.32%	1,245,614.77	7.05%	-
国泰君安	1	1,371,638,892.99	5.92%	1,003,082.07	5.68%	-
中信证券	1	1,342,796,987.52	5.79%	1,153,851.49	6.53%	-
国信证券	1	1,131,307,099.66	4.88%	902,207.17	5.10%	-
华泰证券	2	1,032,194,116.12	4.45%	870,426.12	4.92%	-
东吴证券	1	832,395,047.16	3.59%	608,725.81	3.44%	-
长江证券	1	819,083,230.33	3.53%	599,001.85	3.39%	-
西南证券	1	731,939,262.50	3.16%	535,269.44	3.03%	-
平安证券	1	645,787,104.79	2.79%	472,265.80	2.67%	-
华西证券	1	494,643,736.91	2.13%	361,734.22	2.05%	-
招商证券	1	389,026,796.23	1.68%	335,741.31	1.90%	-
国海证券	1	300,867,095.30	1.30%	227,897.32	1.29%	-
申万宏源	1	174,983,654.90	0.76%	127,964.49	0.72%	-
国金证券	1	79,051,153.40	0.34%	64,927.65	0.37%	-
银河证券	1	12,770,750.49	0.06%	9,339.78	0.05%	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
新时代证 券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-

注：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3家证券公司的3个交易单元：东吴证券、长江证券、申万宏源证券交易单元各1个；减少1家证券公司1个交易单元：中金公司。

### 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	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	1,202,411.20	100.00%	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

中投证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
新时代证 券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-

### 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	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	2021年1月7日
2	本基金2020年收益分配公告	中国证监会规定报刊及网站	2021年1月9日
3	本基金参与国金证券费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021年1月18日
4	本基金2020年第四季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021年1月21日
5	本基金2020年第四季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021年1月21日
6	本基金招募说明书(更新)、基金产品资料概要(更新)	中国证监会规定报刊及网站	2021年1月27日
7	关于本基金参与中国农业银行股份有限公司定投费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021年2月1日
8	本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	2021年3月9日
9	本基金增加和耕传承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	2021年3月10日
10	本基金参加北京度小满基金销售有限公司转换费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021年3月12日
11	关于本基金参与安信证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021年3月15日
12	关于本基金在西藏东方财富证券股份有限公司开通基金定期定额投资业务并参与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	2021年3月26日
13	本基金2020年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021年3月30日
14	本基金2020年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021年3月30日
15	关于调整本基金申购、定期定额申购、赎回、转换及最低持有份额数额限制的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021年3月31日
16	关于本基金增加中国人寿保险股份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	2021年4月12日

17	本基金2021年1季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021年4月21日
18	本基金2021年1季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021年4月21日
19	本基金参与招商证券费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021年4月29日
20	关于本基金参与中国建设银行股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021年5月6日
21	本公司关于直销网上交易停止受理工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	2021年5月25日
22	本公司关于法定代表人变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021年5月28日
23	关于本基金参与腾安基金销(深圳)有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021年5月28日
24	关于本基金参与部分销售机构费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021年6月8日
25	关于本基金参与交通银行股份有限公司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	2021年7月1日
26	本基金2021年2季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021年7月20日
27	本基金2021年2季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021年7月20日
28	关于本基金参与上海浦东发展银行股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021年7月29日
29	本基金新增扩位简称的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021年8月21日
30	本基金基金产品资料概要(更新)	中国证监会规定报刊及网站	2021年8月21日
31	关于本基金参与国泰君安证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021年8月23日
32	本基金2021年中期报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021年8月27日
33	本基金2021年中期报告	中国证监会规定报刊及网站	2021年8月27日
34	关于本基金参与中信证券华南股份有限公司、中信期货有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021年10月8日
35	关于本基金增加招商银行股份有限公司旗下招赢通平台为销售机构并参与申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021年10月18日
36	关于本基金参与中信建投证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021年10月26日

37	本基金 2021 年第三季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 10 月 26 日
38	本基金 2021 年第三季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 10 月 26 日
39	关于本基金增加宁波银行股份有限公司旗下同业易管家平台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	2021 年 10 月 27 日
40	本基金招募说明书（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 12 月 24 日
41	本基金基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 12 月 24 日
42	关于本基金参与交通银行股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 12 月 31 日
43	关于本基金参与中国工商银行股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 12 月 31 日

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准本基金募集的文件；
- 2、本基金基金合同；
- 3、本基金托管协议；
- 4、本基金招募说明书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内在规定媒介上披露的各项公告。

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

### 12.3 查阅方式

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

摩根士丹利华鑫基金管理有限公司

2022年3月30日