

# 摩根士丹利华鑫新兴产业股票型证券投资 基金 2022 年年度报告

2022 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2023 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 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 2022 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>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
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	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
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>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
<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 净资产（基金净值）变动表	19
7.4 报表附注	22
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>50</b>

8.1 期末基金资产组合情况 .....	50
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	50
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	55
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	56
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 .....	56
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 .....	57
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 .....	57
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 .....	57
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	57
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	57
8.12 投资组合报告附注 .....	57
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>58</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	58
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	58
9.3 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 .....	58
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>58</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>59</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	59
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 .....	59
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	59
11.4 基金投资策略的改变 .....	59
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	59
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 .....	60
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	60
11.8 其他重大事件 .....	63
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>66</b>
12.1 备查文件目录 .....	66
12.2 存放地点 .....	66
12.3 查阅方式 .....	66

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	摩根士丹利华鑫新兴产业股票型证券投资基金
基金简称	大摩新兴产业股票
基金主代码	010322
交易代码	010322
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 2 月 24 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	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	205,162,776.56 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点关注新兴产业的投资机会，精选与新兴产业相关的优质企业进行投资，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>（一）大类资产配置</p> <p>本基金将通过研究宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素，对股票、债券和货币资产的风险收益特征进行深入分析，合理预测各类资产的价格变动趋势，确定不同资产类别的投资比例。在此基础上，积极跟踪由于市场短期波动引起的各类资产的价格偏差和风险收益特征的相对变化，动态调整各大类资产之间的投资比例，在保持总体风险水平相对平稳的基础上，获取相对较高的基金投资收益。</p> <p>（二）股票投资策略</p> <p>1、新兴产业的界定</p> <p>新兴产业代表新一轮科技革命和产业变革的方向，是培育发展新动能、获取未来竞争新优势的关键领域。本基金所指的“新兴产业”，指关系到国民经济和社会发展和产业结构优化升级，具有全局性、长远性、导向性和动态性特征的产业。与传统产业相比，具有高技术含量、高附加值、资源集约等特点，也是促使国民经济和企业发展走上创新驱动、内生增长轨道的根本途径。</p> <p>2、个股选择</p> <p>本基金在对新兴产业主题相关行业进行识别和配置之后，对新兴产业主题相关的上市公司使用定性与定量相结合的方法精选股票进行投资。</p> <p>（三）其他金融工具投资策略</p> <p>1、债券投资策略</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</p>

	<p>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、国债期货投资策略</p> <p>本基金对国债期货的投资以套期保值为目的。本基金将结合国债交易市场和期货交易市场的收益性、流动性的情况，通过多头或空头套期保值等投资策略进行套期保值，以获取超额收益。</p> <p>4、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、支持资产的构成及质量等基本面研究，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> <p>5、可转债投资策略</p> <p>本基金将对可转换债券对应的正股进行分析，从行业背景、公司基本面、市场情绪、期权价值等因素综合考虑可转换债券的投资机会，在价值权衡和风险评估的基础上审慎进行可转换债券的投资。</p>
业绩比较基准	中证新兴产业指数收益率*85%+中证综合债券指数收益率*15%
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其长期平均预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	许菲菲	王小飞
	联系电话	(0755)88318883	021-60637103
	电子邮箱	xxpl@msfunds.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8888-668	021-60637228
传真		(0755)82990384	021-60635778
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	北京市西城区金融大街25号
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	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		518048	100033
法定代表人		王鸿嫔	田国立

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.msfnunds.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	摩根士丹利华鑫基金管理有限公司	深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第二座17楼

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2022 年	2021 年 2 月 24 日（基金合同生效日） -2021 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-21,583,544.42	122,524,586.65
本期利润	-64,721,759.11	152,715,226.86
加权平均基金份额本期利润	-0.2871	0.2881
本期加权平均净值利润率	-27.25%	26.60%
本期基金份额净值增长率	-21.39%	27.98%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	1,222,132.04	68,942,877.82
期末可供分配基金份额利润	0.0060	0.2676
期末基金资产净值	206,384,908.60	329,778,513.13
期末基金份额净值	1.0060	1.2798
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率	0.60%	27.98%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2. 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，而非当期发生数）；

3. 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	6.04%	1.69%	3.47%	1.16%	2.57%	0.53%

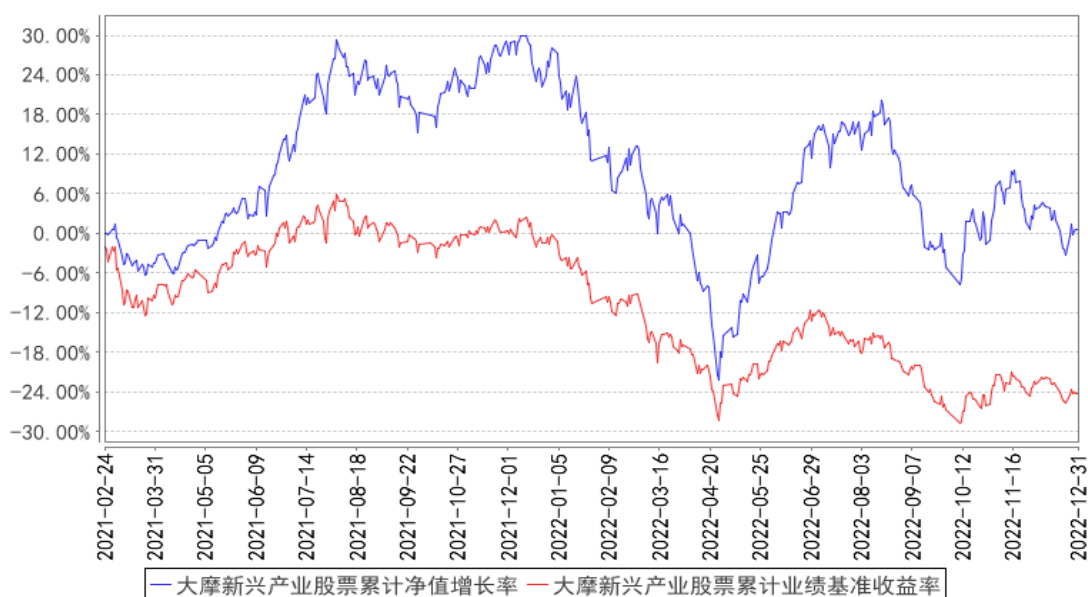
过去六个月	-11.60%	1.57%	-13.67%	1.07%	2.07%	0.50%
过去一年	-21.39%	1.80%	-24.08%	1.26%	2.69%	0.54%
自基金合同生效起至今	0.60%	1.56%	-24.19%	1.20%	24.79%	0.36%

注：1、本基金基金合同于 2021 年 2 月 24 日正式生效；

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

### 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

大摩新兴产业股票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

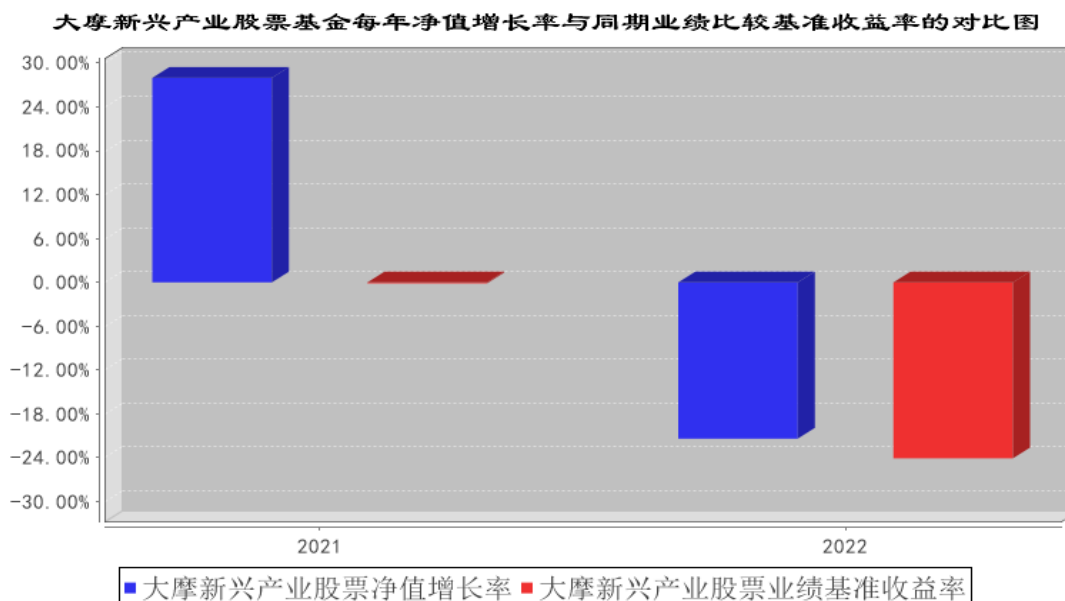


注：1、本基金基金合同于 2021 年 2 月 24 日正式生效；

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



### 3.2.3 自基金合同生效以来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



注：本基金基金合同于 2021 年 2 月 24 日正式生效。上述指标在基金合同生效当年按照实际存续期进行计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日（2021年2月24日）至本报告期末未进行利润分配。

## § 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 2022 年 12 月 31 日，公司旗下共管理 35 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，基金中基金 1 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		
何晓春	助理总经理、权益	2021 年 2 月 24 日	-	12 年	中南财经政法大学产业经济学博士。曾任金鹰基金管理有限公司权益投资部总监、

	投资部总监、基金经理				研究部副总监兼基金经理。2017 年 12 月加入本公司，现任本公司助理总经理、权益投资部总监兼基金经理。2018 年 2 月起担任摩根士丹利华鑫品质生活精选股票型证券投资基金基金经理，2019 年 9 月起担任摩根士丹利华鑫领先优势混合型证券投资基金基金经理，2020 年 9 月起担任摩根士丹利华鑫优悦安和混合型证券投资基金基金经理，2021 年 2 月起担任摩根士丹利华鑫新兴产业股票型证券投资基金基金经理，2021 年 7 月起担任摩根士丹利华鑫优享臻选六个月持有期混合型证券投资基金基金经理。
雷志勇	研究管理部副总监、基金经理	2021 年 3 月 12 日	-	10 年	北京大学计算机软件与理论硕士。曾任中国移动通信集团公司总部项目经理、中国移动通信集团广东有限公司中级网络运行支撑主管、东莞证券股份有限公司研究所通讯行业研究员、南方基金管理有限公司产品经理。2014 年 10 月加入本公司，历任研究管理部研究员、基金经理助理，现任研究管理部副总监、基金经理。2019 年 4 月起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，2019 年 4 月至 2021 年 1 月担任摩根士丹利华鑫品质生活精选股票型证券投资基金基金经理，2020 年 5 月起担任摩根士丹利华鑫万众创新灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 3 月起担任摩根士丹利华鑫新兴产业股票型证券投资基金基金经理。

注：1、基金经理的任职日期为基金合同生效之日和根据本公司决定的聘任日期；

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、经本公司第七届董事会第十六次会议审议通过，并按有关规定向中国证券监督管理委员会深圳监管局、中国证券投资基金业协会备案，何晓春先生于 2023 年 1 月 1 日起担任本公司副总经理。

#### 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

2022 年，国内外面临的不确定风险上行——海外欧洲军事冲突爆发，国内疫情阶段性加剧——全球资本市场风险偏好下行，A 股主要指数均录得下跌，其中上证综指下跌 15.13%，沪深 300 指数下跌 21.63%，创业板指下跌 29.37%；从结构上来看，受益于危机冲突导致价格上涨的能源板块涨幅较好，而 TMT 和高端制造等成长行业涨幅靠后。本基金聚焦新兴产业，在策略上选择景气度较好的电力新能源、信息技术和医疗创新等方向进行重点配置，相关行业 2022 年表现较差，

基金净值有一定的下跌。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金份额净值为 1.0060 元，累计份额净值为 1.0060 元，报告期内基金份额净值增长率为-21.39%，同期业绩比较基准收益率为-24.08%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

去年国内经济受到地产调控、疫情加剧等多种因素拖累，增速欠佳。展望 2023 年，随着各项政策的陆续推出、以及防疫政策的放松，经济有望企稳复苏；展望海外，主要发达经济体进入衰退周期的风险加大，国内出口增速阶段性可能下滑；另外居民消费信心仍将受到疫情复苏节奏影响，地产类大宗消费预计恢复缓慢，全年来看国内经济大概率处于弱复苏态势。

展望证券市场，从基本面来看，国内经济增速大概率触底回升，上市公司业绩增速同比有望上行；从流动性来看，海外发达经济体 2023 年有望停止加息，人民币贬值压力缓解，外资有望重启流入趋势。在基本面和流动性双重催化下，预计 2023 年国内证券市场具备业绩、估值双升的基础。

基于前述宏观经济和证券市场走势的分析，本基金预计 2023 年资本市场的核心驱动力有望由估值和业绩共同驱动、行业的景气度较好、业绩增长较高的新兴产业构成，如电力新能源、信息技术和创新医疗，有望成为全年主线之一。本基金将围绕上述方向筛选挖掘、配置业绩和估值匹配的优质公司，力争实现基金资产的增值。

#### 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情况、廉洁从业管理、新法规落实情况自查、网络安全专项治理工作自查、公司股权质押情况自查、个人信息安全管理和自查、重复投诉专项治理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，组织落实公司治理、人员管理、考核与薪酬管理、声誉风险管理、基金关联交易管理、反洗钱等法律法规的相关要求。公司已建立起覆盖公司业务各个方面，更为

全面、完善的内控制度体系，保障公司合规、安全、高效运营。（4）加强员工合规行为管理。根据法律法规和业务环境的变化不断修订、充实培训材料并组织开展培训工作，进一步提升员工风控意识及合规意识。（5）加强新产品和新业务的风险管理。组织对新产品、新业务的合规性进行评估，保障新产品和新业务合规落地。

2023 年，基金管理人将继续本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，加强风险控制，保障公司和基金的合法合规运作，保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，则及时就所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见。

本基金管理人设有基金估值委员会，委员会由主任委员（分管基金运营部的公司领导）以及相关成员（包括研究管理部负责人、基金运营部负责人、基金会计、风险管理部及监察稽核部相关业务人员）构成。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会的相关人员均具有一定年限的专业从业经验，具有良好的专业能力，并能在相关工作中保持独立性。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和估值方法的最终决策和日常估值的执行。

由于基金经理、相关投资研究人员、债券信用分析师对特定投资品种的估值有深入的理解，经估值委员会主任委员同意，在需要时可以列席估值委员会议并提出估值建议，估值委员会对特定品种估值方法需经委员充分讨论后确定。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、基金合同的相关规定以及本基金的实际运作情况，本基金本报告期末未实施利润分配。

#### 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

## § 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(2023)第 22025 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	摩根士丹利华鑫新兴产业股票型证券投资基金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新兴产业股票型证券投资基金(以下简称“摩根士丹利华鑫新兴产业基金”)的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表和净资产(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新兴产业基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况。</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新兴产业基金，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>摩根士丹利华鑫新兴产业基金的基金管理人摩根士丹利华鑫基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</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新兴产业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新兴产业基金、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新兴产业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新兴产业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</p>

	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新兴产业基金不能持续经营。 (五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	单峰 仲文渊
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	2023 年 03 月 21 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：摩根士丹利华鑫新兴产业股票型证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	11,135,244.77	22,352,498.93
结算备付金		305,540.79	377,997.98
存出保证金		54,244.35	164,126.91
交易性金融资产	7.4.7.2	192,872,908.35	310,341,058.37
其中：股票投资		192,871,910.12	310,341,058.37
基金投资		-	-
债券投资		998.23	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-



应收清算款		2,750,876.78	-
应收股利		-	-
应收申购款		90,673.53	808,394.93
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	2,195.05
资产总计		207,209,488.57	334,046,272.17
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年12月31日</b>	<b>上年度末 2021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		-	-
应付清算款		-	2,357,542.86
应付赎回款		165,539.48	963,910.01
应付管理人报酬		266,619.08	423,427.43
应付托管费		44,436.49	70,571.26
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	347,984.92	452,307.48
负债合计		824,579.97	4,267,759.04
<b>净资产:</b>			
实收基金	7.4.7.10	205,162,776.56	257,680,155.16
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	1,222,132.04	72,098,357.97
净资产合计		206,384,908.60	329,778,513.13
负债和净资产总计		207,209,488.57	334,046,272.17

注：1. 报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0060 元，基金份额总额 205,162,776.56 份。

2. 本基金基金合同生效日为 2021 年 2 月 24 日，2021 年度实际报告期间为 2021 年 2 月 24 日至 2021 年 12 月 31 日。

## 7.2 利润表

会计主体：摩根士丹利华鑫新兴产业股票型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022	上年度可比期间 2021 年 2 月 24 日（基金
-----	-----	----------------------------	-------------------------------

		年 12 月 31 日	合同生效日) 至 2021 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-60,383,587.37	165,486,865.58
1. 利息收入		54,289.25	1,774,257.78
其中：存款利息收入	7.4.7.13	54,289.25	1,268,260.61
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	505,997.17
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-17,492,238.78	131,300,992.03
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-19,030,654.68	127,303,320.03
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	166,129.74	-
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	1,372,286.16	3,997,672.00
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	-43,138,214.69	30,190,640.21
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	192,576.85	2,220,975.56
<b>减：二、营业总支出</b>		4,338,171.74	12,771,638.72
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,563,684.06	7,299,278.12
2. 托管费	7.4.10.2.2	593,947.31	1,216,546.34
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.37	-
8. 其他费用	7.4.7.23	180,540.00	4,255,814.26
<b>三、利润总额（亏损总额</b>		-64,721,759.11	152,715,226.86

以“-”号填列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列)		-64,721,759.11	152,715,226.86
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-64,721,759.11	152,715,226.86

注：本基金基金合同生效日为 2021 年 2 月 24 日，2021 年度实际报告期间为 2021 年 2 月 24 日至 2021 年 12 月 31 日。

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：摩根士丹利华鑫新兴产业股票型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	257,680,155.16	-	72,098,357.97	329,778,513.13
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	257,680,155.16	-	72,098,357.97	329,778,513.13
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-52,517,378.60	-	-70,876,225.93	-123,393,604.53
(一)、综合收益总额	-	-	-64,721,759.11	-64,721,759.11
(二)、本期基	-52,517,378.60	-	-6,154,466.82	-58,671,845.42

金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）				
其中：1. 基金申购款	59,705,191.12	-	3,229,243.82	62,934,434.94
2. 基金赎回款	-112,222,569.72	-	-9,383,710.64	-121,606,280.36
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	205,162,776.56	-	1,222,132.04	206,384,908.60
项目	上年度可比期间 2021年2月24日（基金合同生效日）至2021年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	-	-	-	-
加：会计政策变	-	-	-	-

更				
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产(基金净值)	856,352,968.46	-	-	856,352,968.46
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-598,672,813.30	-	72,098,357.97	-526,574,455.33
(一)、综合收益总额	-	-	152,715,226.86	152,715,226.86
(二)、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)	-598,672,813.30	-	-80,616,868.89	-679,289,682.19
其中:1.基金申购款	141,027,701.88	-	27,351,903.90	168,379,605.78
2.基金赎回款	-739,700,515.18	-	-107,968,772.79	-847,669,287.97
(三)、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)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	257,680,155.16	-	72,098,357.97	329,778,513.13

注：本基金基金合同生效日为 2021 年 2 月 24 日，2021 年度实际报告期间为 2021 年 2 月 24 日至 2021 年 12 月 31 日。

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：

<u>王鸿嫔</u>	<u>贺草</u>	<u>杜志强</u>
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

摩根士丹利华鑫新兴产业股票型证券投资基金(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”)证监许可[2020]第 2248 号《关于准予摩根士丹利华鑫新兴产业股票型证券投资基金注册的批复》核准，由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《摩根士丹利华鑫新兴产业股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，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 856,254,743.22 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第 0224 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《摩根士丹利华鑫新兴产业股票型证券投资基金基金合同》于 2021 年 2 月 24 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 856,352,968.46 份基金份额，其中认购资金利息折合 98,225.24 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《摩根士丹利华鑫新兴产业股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票)、债券(包括国债、

央行票据、金融债、企业债、公司债、地方政府债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、政府支持机构债券、证券公司短期公司债券、可转换债券（包括可分离交易可转债、可交换债券）及其他中国证监会允许投资的债券）、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、资产支持证券、债券回购、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的规定）。本基金的投资组合范围为：股票投资占基金资产的比例范围为 80%-95%，投资于本基金界定的新兴产业的相关股票不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金的业绩比较基准为：中证新兴产业指数收益率\*85%+中证综合债券指数收益率\*15%。

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 2023 年 3 月 21 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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（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》、本基金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 2022 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 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产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。比较财务报表的实际编制期间为 2021 年 2 月 24 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日。

##### 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

#### 新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

#### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

#### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

#### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

#### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

#### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的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。



### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

#### (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

新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，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，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以

发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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净资产比例计算的金额。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净资产比例计算的金额。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

##### 新金融工具准则

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。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证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投资收益。

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扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，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。

##### 原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。债券投资和资产支持证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和资产支持证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。

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确认。

以摊余成本计量的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，但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。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净资产转出。

#### 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》及《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”),财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外,财政部于2022年颁布了《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》(财会[2022]14号),中国证监会于2022年颁布了修订后的《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>》,本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金财务报表,对本基金财务报表的影响列示如下:

##### (a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定,本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整2022年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额,2021年2月24日(基金合同生效日)至2021年12月31日止期间的比较财务报表未重列。于2021年12月31日及2022年1月1日,本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于2022年1月1日,本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下:

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息和应收申购款,金额分别为22,352,498.93元、377,997.98元、164,126.91元、2,195.05元和808,394.93元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存

出保证金、其他资产-应收利息和应收申购款，金额分别为 22,354,425.58 元、378,185.09 元、164,208.20 元、0.00 元和 808,394.93 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 310,341,058.37 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 310,341,058.37 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 2,357,542.86 元、963,910.01 元、423,427.43 元、70,571.26 元、289,458.99 元和 2,848.49 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 2,357,542.86 元、963,910.01 元、423,427.43 元、70,571.26 元、289,458.99 元和 2,848.49 元。

于 2021 年 12 月 31 日，“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，本基金无期初留存收益影响。

#### (b) 《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整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，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
活期存款	11,135,244.77	22,352,498.93
等于：本金	11,134,068.40	22,352,498.93
加：应计利息	1,176.37	-
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-



加：应计利息		-
减：坏账准备		-
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		-
等于：本金		-
加：应计利息		-
减：坏账准备		-
合计	11,135,244.77	22,352,498.93

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	205,819,581.71	-	192,871,910.12	-12,947,671.59	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	900.00	1.12	998.23	97.11
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	900.00	1.12	998.23	97.11
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	205,820,481.71	1.12	192,872,908.35	-12,947,574.48	
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	280,150,418.16	-	310,341,058.37	30,190,640.21	
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	280,150,418.16	-	310,341,058.37	30,190,640.21	

#### 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从买断式逆回购交易中取得的债券。

## 7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应收利息	-	2,195.05
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	2,195.05

## 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	162.31	2,848.49
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	167,822.61	289,458.99
其中：交易所市场	167,822.61	289,458.99
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	180,000.00	160,000.00
合计	347,984.92	452,307.48

## 7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	257,680,155.16	257,680,155.16
本期申购	59,705,191.12	59,705,191.12
本期赎回（以“-”号填列）	-112,222,569.72	-112,222,569.72
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	205,162,776.56	205,162,776.56

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

## 7.4.7.8 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
本期期初	68,942,877.82	3,155,480.15	72,098,357.97
本期利润	-21,583,544.42	-43,138,214.69	-64,721,759.11
本期基金份额交易产生的变动数	-11,259,401.35	5,104,934.53	-6,154,466.82
其中：基金申购款	11,821,024.03	-8,591,780.21	3,229,243.82
基金赎回款	-23,080,425.38	13,696,714.74	-9,383,710.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	36,099,932.05	-34,877,800.01	1,222,132.04

## 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年2月24日（基金合同生效日）至2021年12月31日
活期存款利息收入	47,453.74	209,987.01
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	5,530.86	1,055,651.68
其他	1,304.65	2,621.92
合计	54,289.25	1,268,260.61

## 7.4.7.10 股票投资收益

## 7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年2月24日（基金合同生效日）至2021年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-19,030,654.68	127,303,320.03
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	-19,030,654.68	127,303,320.03

## 7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年2月24日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出股票成交总额	529,246,713.31	1,394,122,529.57
减：卖出股票成本总额	546,926,471.02	1,266,819,209.54
减：交易费用	1,350,896.97	-
买卖股票差价收入	-19,030,654.68	127,303,320.03

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年2月24日（基金合同生效日）至2021年12月31日
债券投资收益——利息收入	108.21	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	166,021.53	-
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	166,129.74	-

##### 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年2月24日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	645,132.40	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	479,000.00	-
减：应计利息总额	110.24	-
减：交易费用	0.63	-
买卖债券差价收入	166,021.53	-

#### 7.4.7.12 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。

**7.4.7.13 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。

**7.4.7.14 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。

**7.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年2月24日(基金合同生效 日)至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,372,286.16	3,997,672.00
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	1,372,286.16	3,997,672.00

**7.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年2月24日(基金合 同生效日)至2021年12月31 日
1. 交易性金融资产	-43,138,214.69	30,190,640.21
股票投资	-43,138,311.80	30,190,640.21
债券投资	97.11	-
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	-43,138,214.69	30,190,640.21

**7.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年2月24日(基金合 同生效日)至2021年12月 31日
----	---------------------------------	--

基金赎回费收入	191,606.93	2,213,939.60
基金转换费收入	969.92	7,006.34
其他	-	29.62
合计	192,576.85	2,220,975.56

#### 7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间无信用减值损失。

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年2月24日（基金合同生效日）至2021年12月31日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	100,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	540.00	21,780.95
交易费用	-	4,073,633.31
其他	-	400.00
合计	180,540.00	4,255,814.26

#### 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

截至财务报表报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 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、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	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 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年2月24日（基金合同生效日） 至2021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	18,221,357.05	1.83	360,430,964.09	12.31

#### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期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 2022年1月1日至2022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	13,324.97	1.83	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2021年2月24日（基金合同生效日）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	293,027.15	12.24	25,549.91	8.83

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 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 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年2月24日（基金合同生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,563,684.06	7,299,278.12
其中：支付销售机构的客户维护费	1,586,707.98	3,357,618.22

注：支付基金管理人摩根士丹利华鑫基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年2月24日（基金合同生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	593,947.31	1,216,546.34

注：支付基金托管人中国建设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固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2022年1月1日至2022年12月31日		2021年2月24日（基金合同生效日）至2021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
中国建设银行	11,135,244.77	47,453.74	22,352,498.93	209,987.01

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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交易。

#### 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

本基金本报告期无利润分配事项。



## 7.4.12 期末（2022 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	受限期	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
301269	华大九天	2022 年 7 月 21 日	6 个月	新股流通受限	32.69	87.94	203	6,636.07	17,851.82	-
301239	普瑞眼科	2022 年 6 月 22 日	6 个月	新股流通受限	33.65	69.68	240	8,076.00	16,723.20	-
301095	广立微	2022 年 7 月 28 日	6 个月	新股流通受限	58.00	86.49	185	10,730.00	16,000.65	-
301327	华宝新能	2022 年 9 月 8 日	6 个月	新股流通受限	237.50	176.97	85	20,187.50	15,042.45	-
301297	富乐德	2022 年 12 月 23 日	6 个月	新股流通受限	8.48	12.99	790	6,699.20	10,262.10	-
301367	怡和嘉业	2022 年 10 月 21 日	6 个月	新股流通受限	119.88	175.78	55	6,593.40	9,667.90	-
301267	华夏眼科	2022 年 10 月 26 日	6 个月	新股流通受限	50.88	66.20	124	6,309.12	8,208.80	-
301306	西测测试	2022 年 7 月 19 日	6 个月	新股流通受限	43.23	42.29	160	6,916.80	6,766.40	-
301277	新天地	2022 年 11 月 9 日	6 个月	新股流通受限	27.00	25.78	240	6,480.00	6,187.20	-
301328	维峰电子	2022 年 8 月 30 日	6 个月	新股流通受限	78.80	76.96	80	6,304.00	6,156.80	-
301339	通行宝	2022 年 9 月 2 日	6 个月	新股流通受限	18.78	15.59	393	7,380.54	6,126.87	-
301391	卡莱特	2022 年 11 月 24 日	6 个月	新股流通受限	96.00	80.97	75	7,200.00	6,072.75	-
301227	森鹰窗业	2022 年 9 月 16 日	6 个月	新股流通受限	38.25	29.49	204	7,803.00	6,015.96	-

		日								
301318	维海德	2022 年 8 月 3 日	6 个月	新股流 通受限	64.68	41.74	108	6,985.44	4,507.92	-

注：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。

#### 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的股票。

#### 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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

#### 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

本基金为进行主动投资的股票型基金。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以上风险控制在限定的范围之内，重点关注新兴产业的投资机会，精选与新兴产业相关的优质企业进行投资，力争实现基金资产的长期稳定增值。

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建设银行，因而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 2022 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券投资和资产支持证券投资占基金净资产比例为 0.0005%（2021 年 12 月 31 日：本基金未持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券投资和资产支持证券投资）。

#### 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 2022 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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 2022 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 2022 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 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	11,135,244.77	-	-	-	11,135,244.77
结算备付金	305,540.79	-	-	-	305,540.79
存出保证金	54,244.35	-	-	-	54,244.35
交易性金融资产	-	-	998.23	192,871,910.12	192,872,908.35
应收申购款	-	-	-	90,673.53	90,673.53
应收清算款	-	-	-	2,750,876.78	2,750,876.78
资产总计	11,495,029.91	-	998.23	195,713,460.43	207,209,488.57
负债					
应付赎回款	-	-	-	165,539.48	165,539.48
应付管理人报酬	-	-	-	266,619.08	266,619.08
应付托管费	-	-	-	44,436.49	44,436.49
其他负债	-	-	-	347,984.92	347,984.92
负债总计	-	-	-	824,579.97	824,579.97
利率敏感度缺口	11,495,029.91	-	998.23	194,888,880.46	206,384,908.60
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	22,352,498.93	-	-	-	22,352,498.93
结算备付金	377,997.98	-	-	-	377,997.98
存出保证金	164,126.91	-	-	-	164,126.91
交易性金融资产	-	-	-	310,341,058.37	310,341,058.37
应收申购款	-	-	-	808,394.93	808,394.93
其他资产	-	-	-	2,195.05	2,195.05
资产总计	22,894,623.82	-	-	311,151,648.35	334,046,272.17
负债					
应付赎回款	-	-	-	963,910.01	963,910.01

应付管理人报酬	-	-	-	423,427.43	423,427.43
应付托管费	-	-	-	70,571.26	70,571.26
应付清算款	-	-	-	2,357,542.86	2,357,542.86
其他负债	-	-	-	452,307.48	452,307.48
负债总计	-	-	-	4,267,759.04	4,267,759.04
利率敏感度缺口	22,894,623.82	-	-	-306,883,889.31	329,778,513.13

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

注：于 2022 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券投资公允价值占基金净资产的比例为 0.0005%（2021 年 12 月 31 日，本基金未持有的交易性债券投资和资产支持证券投资），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（2021 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，结合定性分析和定量分析方法的结论，以实现大类资产的动态配置。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

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

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 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	192,871,910.12	93.45	310,341,058.37	94.11
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	192,871,910.12	93.45	310,341,058.37	94.11

#### 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(2022年12月31日)	上年度末(2021年12月31日)
分析	业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	12,440,000.00	13,650,000.00
	业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-12,440,000.00	-13,650,000.00

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	192,737,317.53	306,912,825.87

第二层次	-	232,787.40
第三层次	135,590.82	3,195,445.10
合计	192,872,908.35	310,341,058.37

#### 7.4.14.2.2 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。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	3,195,445.10	3,195,445.10
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,533,359.11	1,533,359.11
转出第三层次	-	5,054,657.42	5,054,657.42
当期利得或损失总额	-	461,444.03	461,444.03
其中：计入损益的利得或损失	-	461,444.03	461,444.03
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	135,590.82	135,590.82
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	21,289.75	21,289.75
项目	上年度可比同期 2021年2月24日（基金合同生效日）至2021年12月31日		
	交易性金融资产		合计



	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	2,586,129.01	2,586,129.01
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	609,316.09	609,316.09
其中：计入损益的利得或损失	-	609,316.09	609,316.09
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	3,195,445.10	3,195,445.10
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	609,316.09	609,316.09

注：于 2022 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证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于 2022 年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	135,590.82	平均价格亚式期权模型	预期波动率	23.19%-165%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	3,195,445.10	平均价格亚式期权模型	预期波动率	17.17%-224.71%	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 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工具(2021 年 12 月

31 日：同)。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	192,871,910.12	93.08
	其中：股票	192,871,910.12	93.08
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	998.23	0.00
	其中：债券	998.23	0.00
	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	11,440,785.56	5.52
8	其他各项资产	2,895,794.66	1.40
9	合计	207,209,488.57	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	-	-
B	采矿业	16,063.74	0.01
C	制造业	121,807,005.03	59.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	15,628.10	0.01
F	批发和零售业	37,695.26	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	31,893.40	0.02
H	住宿和餐饮业	15,141.60	0.01

I	信息传输、软件和信息技术服务业	33,785,412.62	16.37
J	金融业	3,657,600.00	1.77
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	18,962.33	0.01
M	科学研究和技术服务业	33,333,808.01	16.15
N	水利、环境和公共设施管理业	61,723.93	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	44,196.99	0.02
R	文化、体育和娱乐业	46,779.11	0.02
S	综合	-	-
	合计	192,871,910.12	93.45

### 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	002609	捷顺科技	2,208,000	19,872,000.00	9.63
2	002376	新北洋	2,778,607	18,588,880.83	9.01
3	300151	昌红科技	874,000	16,876,940.00	8.18
4	688202	美迪西	78,899	16,875,707.11	8.18
5	300014	亿纬锂能	188,000	16,525,200.00	8.01
6	300347	泰格医药	156,400	16,390,720.00	7.94
7	002594	比亚迪	56,000	14,390,320.00	6.97
8	300101	振芯科技	458,900	11,243,050.00	5.45
9	300571	平治信息	388,800	10,886,400.00	5.27
10	300909	汇创达	248,250	7,397,850.00	3.58
11	300327	中颖电子	160,000	5,659,200.00	2.74
12	000063	中兴通讯	180,000	4,654,800.00	2.26
13	600586	金晶科技	496,600	4,325,386.00	2.10
14	300760	迈瑞医疗	13,000	4,107,610.00	1.99
15	300750	宁德时代	10,000	3,934,200.00	1.91
16	300803	指南针	80,000	3,657,600.00	1.77
17	603456	九洲药业	70,600	2,995,558.00	1.45
18	688339	亿华通	38,000	2,812,000.00	1.36
19	688018	乐鑫科技	30,000	2,704,500.00	1.31
20	688326	经纬恒润	18,000	2,687,400.00	1.30
21	603306	华懋科技	60,000	2,244,600.00	1.09
22	688311	盟升电子	18,888	1,534,083.36	0.74
23	688375	国博电子	1,550	148,474.50	0.07
24	301216	万凯新材	2,425	69,549.00	0.03
25	688207	格灵深瞳	2,976	68,448.00	0.03
26	688236	春立医疗	2,665	63,453.65	0.03

27	301391	卡莱特	741	63,015.75	0.03
28	301227	森鹰窗业	2,035	62,319.21	0.03
29	688296	和达科技	2,173	56,215.51	0.03
30	301222	浙江恒威	2,223	56,064.06	0.03
31	688737	中自科技	1,319	49,884.58	0.02
32	688787	海天瑞声	817	48,766.73	0.02
33	301318	维海德	1,080	45,817.92	0.02
34	301057	汇隆新材	2,173	43,742.49	0.02
35	001330	博纳影业	3,564	42,696.72	0.02
36	300834	星辉环材	1,693	42,054.12	0.02
37	300979	华利集团	671	38,320.81	0.02
38	605589	圣泉集团	1,750	37,432.50	0.02
39	301029	怡合达	554	36,419.96	0.02
40	600955	维远股份	1,694	35,184.38	0.02
41	300973	立高食品	360	34,624.80	0.02
42	301037	保立佳	2,115	33,988.05	0.02
43	301036	双乐股份	2,047	33,939.26	0.02
44	601156	东航物流	2,090	31,893.40	0.02
45	605507	国邦医药	1,202	31,816.94	0.02
46	300854	中兰环保	2,026	30,957.28	0.01
47	301196	唯科科技	892	29,953.36	0.01
48	688206	概伦电子	1,000	28,120.00	0.01
49	605089	味知香	370	27,039.60	0.01
50	601089	福元医药	1,749	26,812.17	0.01
51	301018	申菱环境	782	26,783.50	0.01
52	301079	邵阳液压	1,396	25,560.76	0.01
53	688038	中科通达	2,132	25,349.48	0.01
54	688272	富吉瑞	1,263	24,502.20	0.01
55	688067	爱威科技	1,259	23,581.07	0.01
56	603171	税友股份	637	23,186.80	0.01
57	301101	明月镜片	360	22,687.20	0.01
58	001318	阳光乳业	1,142	21,926.40	0.01
59	605167	利柏特	2,472	20,814.24	0.01
60	001308	康冠科技	667	20,703.68	0.01
61	001215	千味央厨	295	19,340.20	0.01
62	688701	卓锦股份	2,340	19,211.40	0.01
63	001323	慕思股份	573	18,977.76	0.01
64	001228	永泰运	383	18,962.33	0.01
65	301269	华大九天	203	17,851.82	0.01
66	603057	紫燕食品	549	17,277.03	0.01
67	301211	亨迪药业	498	17,255.70	0.01
68	001208	华菱线缆	1,754	17,171.66	0.01
69	301239	普瑞眼科	240	16,723.20	0.01

70	603235	天新药业	572	16,656.64	0.01
71	001339	智微智能	812	16,516.08	0.01
72	603051	鹿山新材	272	16,295.52	0.01
73	001217	华尔泰	1,239	16,206.12	0.01
74	603211	晋拓股份	1,287	16,164.72	0.01
75	603132	金徽股份	1,342	16,063.74	0.01
76	301095	广立微	185	16,000.65	0.01
77	301089	拓新药业	220	15,840.00	0.01
78	300982	苏文电能	317	15,628.10	0.01
79	603170	宝立食品	542	15,354.86	0.01
80	603237	五芳斋	325	15,323.75	0.01
81	301268	铭利达	302	15,163.42	0.01
82	301073	君亭酒店	216	15,141.60	0.01
83	301327	华宝新能	85	15,042.45	0.01
84	301069	凯盛新材	539	14,865.62	0.01
85	603070	万控智造	775	13,640.00	0.01
86	301286	侨源股份	513	12,676.23	0.01
87	301039	中集车辆	1,555	12,393.35	0.01
88	001256	炜冈科技	474	12,390.36	0.01
89	301263	泰恩康	366	11,895.00	0.01
90	001300	三柏硕	763	11,826.50	0.01
91	001313	粤海饲料	1,232	11,580.80	0.01
92	301060	兰卫医学	587	11,511.07	0.01
93	301302	华如科技	175	11,205.25	0.01
94	301015	百洋医药	462	11,014.08	0.01
95	001319	铭科精技	536	10,843.28	0.01
96	001238	浙江正特	374	10,797.38	0.01
97	001222	源飞宠物	434	10,758.86	0.01
98	301220	亚香股份	285	10,496.55	0.01
99	301297	富乐德	790	10,262.10	0.00
100	301030	仕净科技	242	10,093.82	0.00
101	301046	能辉科技	290	10,048.50	0.00
102	301091	深城交	415	9,877.00	0.00
103	603097	江苏华辰	577	9,860.93	0.00
104	603182	嘉华股份	546	9,778.86	0.00
105	001268	联合精密	409	9,697.39	0.00
106	301367	怡和嘉业	55	9,667.90	0.00
107	301177	迪阿股份	152	9,572.96	0.00
108	301118	恒光股份	315	9,516.15	0.00
109	001229	魅视科技	347	9,313.48	0.00
110	001266	宏英智能	345	9,128.70	0.00
111	603280	南方路机	363	8,893.50	0.00
112	301185	鸥玛软件	578	8,797.16	0.00

113	301298	东利机械	571	8,650.65	0.00
114	301026	浩通科技	203	8,526.00	0.00
115	603215	比依股份	575	8,423.75	0.00
116	300994	久祺股份	420	8,282.40	0.00
117	301198	喜悦智行	340	8,241.60	0.00
118	301267	华夏眼科	124	8,208.80	0.00
119	301103	何氏眼科	246	7,753.92	0.00
120	603272	联翔股份	443	7,646.18	0.00
121	301100	风光股份	345	7,645.20	0.00
122	300614	百川畅银	329	7,425.53	0.00
123	301048	金鹰重工	843	7,182.36	0.00
124	301207	华兰疫苗	159	7,088.22	0.00
125	301020	密封科技	421	7,026.49	0.00
126	001336	楚环科技	274	6,770.54	0.00
127	301306	西测测试	160	6,766.40	0.00
128	603150	万朗磁塑	250	6,492.50	0.00
129	301179	泽宇智能	167	6,374.39	0.00
130	301277	新天地	240	6,187.20	0.00
131	301328	维峰电子	80	6,156.80	0.00
132	301339	通行宝	393	6,126.87	0.00
133	301221	光庭信息	156	6,069.96	0.00
134	301133	金钟股份	286	5,988.84	0.00
135	301258	富士莱	151	5,926.75	0.00
136	300814	中富电路	328	5,923.68	0.00
137	301190	善水科技	321	5,771.58	0.00
138	301228	实朴检测	373	5,751.66	0.00
139	300991	创益通	406	5,464.76	0.00
140	301016	雷尔伟	275	5,423.00	0.00
141	301055	张小泉	355	5,403.10	0.00
142	301166	优宁维	114	5,213.22	0.00
143	301063	海锅股份	153	5,205.06	0.00
144	301123	奕东电子	237	5,192.67	0.00
145	301059	金三江	259	4,791.50	0.00
146	301040	中环海陆	241	4,607.92	0.00
147	301083	百胜智能	416	4,592.64	0.00
148	301056	森赫股份	572	4,352.92	0.00
149	301049	超越科技	196	4,129.72	0.00
150	301041	金百泽	215	4,112.95	0.00
151	301025	读客文化	403	4,082.39	0.00
152	301027	华蓝集团	286	3,861.00	0.00
153	301072	中捷精工	181	3,710.50	0.00
154	301068	大地海洋	144	3,536.64	0.00
155	301053	远信工业	155	3,144.95	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	688202	美迪西	22,018,777.77	6.68
2	300014	亿纬锂能	16,624,012.75	5.04
3	300750	宁德时代	15,518,967.56	4.71
4	300151	昌红科技	15,469,419.00	4.69
5	300059	东方财富	14,438,918.20	4.38
6	300347	泰格医药	13,282,394.86	4.03
7	300909	汇创达	12,973,212.90	3.93
8	688680	海优新材	12,527,812.28	3.80
9	000063	中兴通讯	12,500,244.00	3.79
10	002376	新北洋	12,417,180.00	3.77
11	300693	盛弘股份	11,779,882.00	3.57
12	300101	振芯科技	10,684,979.44	3.24
13	688063	派能科技	10,607,549.96	3.22
14	002609	捷顺科技	9,284,290.00	2.82
15	688390	固德威	9,233,505.66	2.80
16	300035	中科电气	8,655,794.95	2.62
17	300571	平治信息	8,568,506.00	2.60
18	688052	纳芯微	8,527,829.66	2.59
19	603799	华友钴业	8,022,286.00	2.43
20	600884	杉杉股份	7,720,692.39	2.34
21	000938	紫光股份	7,195,711.00	2.18
22	002466	天齐锂业	6,847,748.00	2.08
23	000776	广发证券	6,747,798.35	2.05

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	688390	固德威	31,120,325.33	9.44
2	002376	新北洋	19,385,698.79	5.88
3	002609	捷顺科技	18,652,124.00	5.66
4	688063	派能科技	17,580,747.64	5.33
5	300638	广和通	15,750,756.00	4.78
6	300693	盛弘股份	15,489,750.00	4.70
7	002466	天齐锂业	14,155,791.00	4.29
8	300122	智飞生物	13,718,287.00	4.16
9	300059	东方财富	12,699,984.45	3.85

10	000776	广发证券	12,603,262.00	3.82
11	688626	翔宇医疗	12,331,072.17	3.74
12	688680	海优新材	12,083,027.55	3.66
13	300438	鹏辉能源	11,294,527.00	3.42
14	300054	鼎龙股份	10,787,002.00	3.27
15	300750	宁德时代	10,457,084.00	3.17
16	300151	昌红科技	9,779,811.00	2.97
17	002594	比亚迪	9,290,022.00	2.82
18	688052	纳芯微	9,266,388.04	2.81
19	300571	平治信息	8,395,665.00	2.55
20	603960	克来机电	8,028,138.70	2.43
21	300035	中科电气	7,762,329.00	2.35
22	603799	华友钴业	7,648,028.15	2.32
23	601012	隆基绿能	7,605,228.36	2.31
24	000063	中兴通讯	7,292,608.00	2.21
25	688005	容百科技	7,119,645.29	2.16
26	002230	科大讯飞	7,115,761.00	2.16

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	472,595,634.57
卖出股票收入（成交）总额	529,246,713.31

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	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）	998.23	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	998.23	0.00

#### 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

金额单位：人民币元



序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	123155	中陆转债	9	998.23	0.00

### 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 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目的，有选择地投资于股指期货。套期保值本基金将以套期保值为目的，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。

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

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

#### 8.11.2 本期国债期货投资评价

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

### 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	54,244.35
2	应收清算款	2,750,876.78
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	90,673.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,895,794.66

#### 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 (%)
16,218	12,650.31	0.00	0.00	205,162,776.56	100.00

### 9.2 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	682.39	0.0003

### 9.3 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	0
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 (2021 年 2 月 24 日) 基金份额总额	856,352,968.46
本报告期期初基金份额总额	257,680,155.16
本报告期基金总申购份额	59,705,191.12

减：本报告期基金总赎回份额	112,222,569.72
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	205,162,776.56

## § 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：

1、自 2022 年 5 月 26 日起徐许女士担任公司财务负责人，基金管理人于 2022 年 5 月 28 日公告了上述事项；

2、自 2022 年 6 月 15 日起周熙先生不再担任公司董事长职务，基金管理人于 2022 年 6 月 16 日公告了上述事项；

3、自 2022 年 6 月 17 日起总经理王鸿嫔女士代为履行董事长职务，基金管理人于 2022 年 6 月 18 日公告了上述事项；

4、自 2022 年 9 月 6 日起高杰文（Todd Coltman）先生担任公司董事长职务，总经理王鸿嫔女士自 2022 年 9 月 6 日起不再代为履行董事长职务，基金管理人于 2022 年 9 月 8 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）2022 年度审计的报酬为 60,000.00 元。目前普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已连续两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

### 11.6.1 管理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及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未因托管业务受到任何稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
天风证券	1	141,256,899.88	14.20	103,301.61	14.20	-
广发证券	1	136,053,539.46	13.67	99,496.45	13.67	-
开源证券	1	118,184,923.84	11.88	86,428.49	11.88	-
申万宏源	2	85,731,968.29	8.62	62,695.90	8.62	-
东北证券	1	81,100,588.70	8.15	59,308.39	8.15	-
中信建投	2	59,769,905.45	6.01	43,709.87	6.01	-
长江证券	2	57,547,162.42	5.78	42,083.58	5.78	-
浙商证券	2	56,070,719.35	5.64	41,004.25	5.64	-
东吴证券	1	39,472,755.12	3.97	28,866.21	3.97	-
西部证券	1	33,564,032.47	3.37	24,545.27	3.37	-
国海证券	1	31,368,027.75	3.15	22,939.76	3.15	-
中信证券	2	27,536,875.39	2.77	20,137.67	2.77	-
华创证券	1	22,292,097.90	2.24	16,301.95	2.24	-
光大证券	1	18,358,986.19	1.85	13,425.65	1.85	-
华鑫证券	2	18,221,357.0	1.83	13,324.97	1.83	-

		5				
国泰君安	2	11,742,797.50	1.18	8,587.13	1.18	-
方正证券	2	10,301,146.44	1.04	7,533.37	1.04	-
中泰证券	1	8,949,997.01	0.90	6,545.15	0.90	-
国金证券	1	8,675,925.29	0.87	6,344.66	0.87	-
兴业证券	1	7,362,721.37	0.74	5,384.32	0.74	-
长城证券	1	7,191,584.00	0.72	5,259.10	0.72	-
中银国际	2	5,890,275.25	0.59	4,307.55	0.59	-
东方证券	2	4,227,053.36	0.42	3,091.25	0.42	-
国信证券	1	2,383,886.76	0.24	1,743.29	0.24	-
海通证券	1	1,756,887.00	0.18	1,284.80	0.18	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 专用交易单元的选择标准

- (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，本基金增加租用国泰君安 1 个交易单元，减少租用长城证券、宏信证券、川  
财证券各 1 个交易单元。

## 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(%)
天风证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	645,132.40	100.00	-	-	-	-
国金证	-	-	-	-	-	-

券						
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
长城证 券	-	-	-	-	-	-
中银国 际	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
中投证 券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-
安信证 券	-	-	-	-	-	-
川财证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	本公司关于旗下资产管理产品执行新金融工具相关会计准则的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022年1月1日
2	本公司关于提醒投资者警惕非法电子平台仿冒本公司员工名义进行不法活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022年1月6日
3	本公司关于旗下部分基金增加上海凯	中国证监会规定报刊及	2022年1月7日

	石财富基金销售有限公司为销售机构并参与费率优惠活动的公告	网站	
4	本公司旗下全部基金 2021 年 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 1 月 21 日
5	本基金 2021 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 1 月 21 日
6	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	2022 年 1 月 26 日
7	本基金招募说明书（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 1 月 26 日
8	本公司关于调整官方网站网上交易和查询服务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 2 月 22 日
9	本公司关于旗下部分基金参与光大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	2022 年 3 月 17 日
10	本公司旗下基金 2021 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 3 月 30 日
11	本基金 2021 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 3 月 30 日
12	本公司关于旗下部分基金增加交通银行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	2022 年 4 月 12 日
13	本公司关于旗下部分基金增加泰信财富基金销售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	2022 年 4 月 15 日
14	本公司旗下全部基金 2022 年 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 4 月 21 日
15	本基金 2022 年 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 4 月 21 日
16	本公司关于系统升级期间暂停电话自助语音服务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 5 月 19 日
17	本公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 5 月 28 日
18	本公司关于系统升级期间暂停电话自助语音服务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 6 月 3 日
19	本公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 6 月 16 日
20	本公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 6 月 18 日
21	本公司关于系统升级期间暂停电话自助语音服务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 6 月 21 日
22	本公司关于网上交易系统在 2022 年 7 月 9 日部分时段暂停服务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 7 月 7 日
23	本公司关于停止网上直销开户、认购、申购、转换、转托管转入及定期定额	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 7 月 12 日



	投资业务的公告		
24	本公司关于旗下部分基金增加九州证券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	2022 年 7 月 15 日
25	本公司关于旗下部分基金在诺亚正行基金销售有限公司开通基金转换业务并参与申购补差费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 7 月 19 日
26	本公司旗下全部基金 2022 年 2 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 7 月 20 日
27	本基金 2022 年 2 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 7 月 20 日
28	本公司关于暂停喜鹊财富基金销售有限公司办理旗下基金相关业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 7 月 22 日
29	本公司关于旗下部分基金参与北交所股票投资及相关风险提示的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 7 月 30 日
30	本公司关于暂停北京钱景基金销售有限公司办理旗下基金相关业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 8 月 27 日
31	本公司旗下基金 2022 年中期报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 8 月 29 日
32	本基金 2022 年中期报告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 8 月 29 日
33	本公司关于董事长变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 9 月 8 日
34	本公司关于公司网站、网上交易系统在 2022 年 9 月 26 日至 27 日部分时段暂停服务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 9 月 23 日
35	本公司关于旗下基金增加攀赢基金销售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	2022 年 9 月 30 日
36	本公司旗下全部基金 2022 年 3 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 10 月 25 日
37	本基金 2022 年 3 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 10 月 25 日
38	本公司关于旗下基金停牌股票估值调整情况的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 10 月 27 日
39	本公司关于网上交易系统在 2022 年 12 月 9 日至 10 日部分时段暂停服务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 12 月 8 日
40	本基金招募说明书（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 12 月 16 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	2022 年 12 月 16 日
42	本公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 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。

### 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

2023年3月30日