

摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券 投资基金 2014 年年度报告

2014 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：2015 年 3 月 26 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 2015 年 3 月 24 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 2014 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
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
§4 管理人报告	9
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	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§5 托管人报告	14
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	15
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	15
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§7 年度财务报表	16
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
§8 投资组合报告	42
8.1 期末基金资产组合情况	42
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	42
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	44
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
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	54
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	54

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	54
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	54
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	54
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
8.12 投资组合报告附注	55
§9 基金份额持有人信息	56
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
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的情况	56
§10 开放式基金份额变动	56
§11 重大事件揭示	57
11.1 基金份额持有人大会决议	57
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	57
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
11.4 基金投资策略的改变	58
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	58
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
11.8 其他重大事件	61
§12 备查文件目录	62
12.1 备查文件目录	62
12.2 存放地点	63
12.3 查阅方式	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金
基金简称	大摩深证 300 指数增强
基金主代码	233010
交易代码	233010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 11 月 15 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	65,773,140.13 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，以深证 300 指数作为本基金投资组合跟踪的目标指数。本基金在有效跟踪深证 300 指数的基础上，通过运用增强型投资策略，力争获取超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增长。本基金对业绩比较基准的跟踪目标是：力求控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。
投资策略	本基金以深证 300 指数为目标指数，采用指数化投资为主要投资策略，适度增强型投资策略为辅助投资策略。 1、股票投资策略 本基金股票投资策略由指数化投资策略和增强型投资策略组成。 （1）指数化投资策略 指数化投资策略是本基金主要股票投资策略，通过采用复制指数的方法，根据目标指数即深证 300 指数的成份股及其权重构建指数投资组合。 （2）增强型主动投资策略 增强型主动投资策略是本基金辅助股票投资策略，包括：成份股增强策略和非成份股增强策略。管理人将以对当前及未来国内外宏观经济形势的判断和经济景气周期预测作为基础，从多个方面把握不同行业的景气度变化情况和上市公司业绩增长的趋势，以“自下而上”与“自上而下”相结合的方法，重点投资价值被市场低估的指数成分股，并适度投资一些具有估值优势、持续成长能力的非成分股，对指数投资组合进行优化增强。 2、债券投资策略

	本基金债券投资的目的是基金资产流动性管理，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。本基金将根据国内外宏观经济形势、货币政策、债券市场供求状况以及市场利率走势等因素，合理预期债券市场利率变动趋势，制定以久期控制下的债券资产配置策略，主要投资于到期日在一年以内的政府债券、金融债等。 3、股指期货投资策略 本基金可运用股指期货，以提高投资效率，有效控制指数的跟踪误差，更好地实现投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，本着审慎原则，适度参与股指期货投资，改善投资组合风险收益特征。另外，本基金将利用股指期货流动性好、杠杆交易的特点，进行现金管理，以应对大额申购赎回、大额现金分红等，管理流动性风险，优化投资组合对目标指数的跟踪效果，提高投资组合的运作效率等。
业绩比较基准	深证 300 价格指数收益率 $\times 95\%$ +银行活期存款利率(税后) $\times 5\%$
风险收益特征	本基金为股票指数型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金，属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的基金产品

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	李锦	田青
	联系电话	(0755) 88318883	(010) 67595096
	电子邮箱	xxpl@msfunds.com.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8888-668	(010) 67595096
传真		(0755) 82990384	(010) 66275853
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		YU HUA(于华)	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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、基金托管人处

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）	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 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 层

§ 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	2014 年	2013 年	2012 年
本期已实现收益	8,280,235.38	7,076,526.17	-11,607,070.27
本期利润	18,691,627.26	11,307,062.48	6,646,572.01
加权平均基金份额本期利润	0.2333	0.0814	0.0320
本期加权平均净值利润率	23.07%	8.60%	3.42%
本期基金份额净值增长率	30.49%	7.74%	-3.32%
3.1.2 期末数据和指标	2014 年末	2013 年末	2012 年末
期末可供分配利润	6,729,187.11	-3,326,844.95	-15,705,036.46
期末可供分配基金份额利润	0.1023	-0.0313	-0.0962
期末基金资产净值	83,596,121.59	103,610,111.67	147,556,880.72
期末基金份额净值	1.271	0.974	0.904
3.1.3 累计期末指标	2014 年末	2013 年末	2012 年末
基金份额累计净值增长率	27.10%	-2.60%	-9.60%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

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

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

3.2 基金净值表现

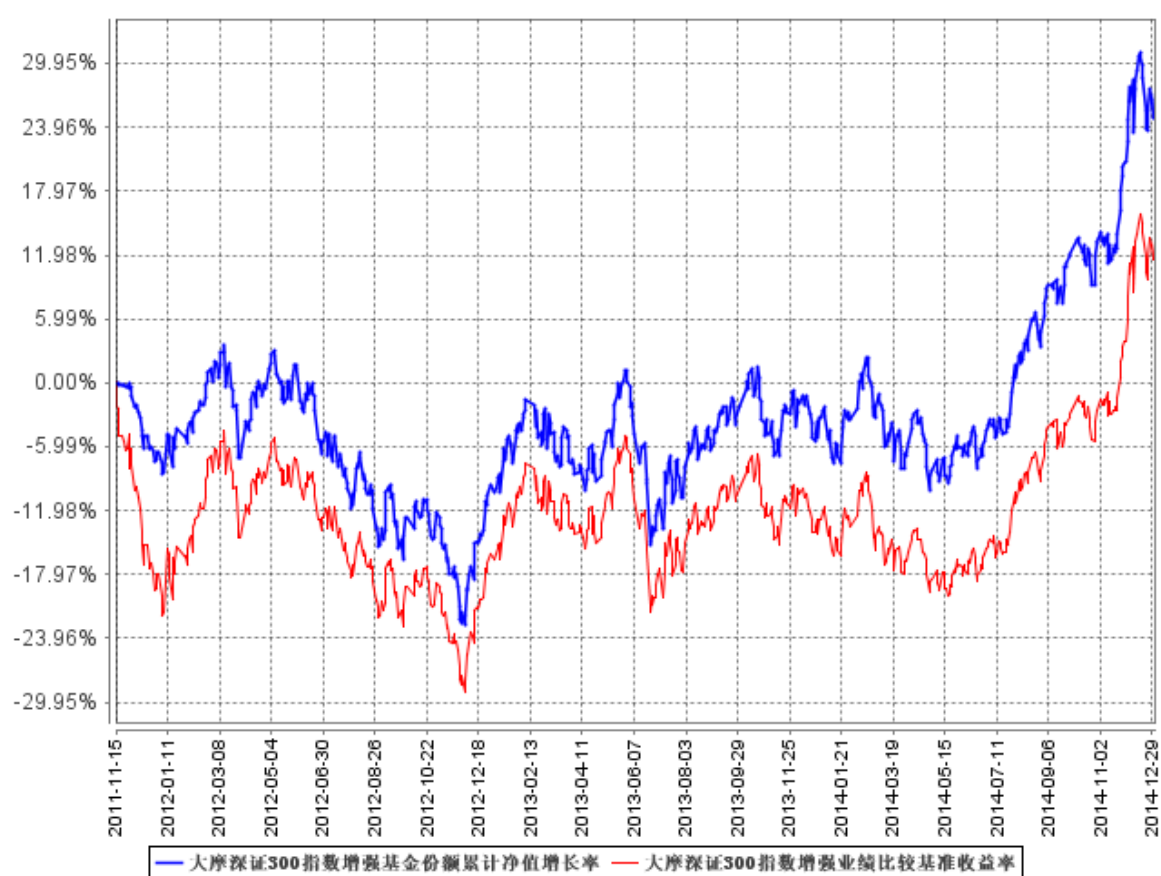
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	13.48%	1.29%	16.75%	1.31%	-3.27%	-0.02%

过去六个月	33.09%	1.10%	34.19%	1.11%	-1.10%	-0.01%
过去一年	30.49%	1.13%	29.05%	1.12%	1.44%	0.01%
过去三年	35.94%	1.22%	38.18%	1.27%	-2.24%	-0.05%
自基金合同 生效起至今	27.10%	1.20%	13.37%	1.28%	13.73%	-0.08%

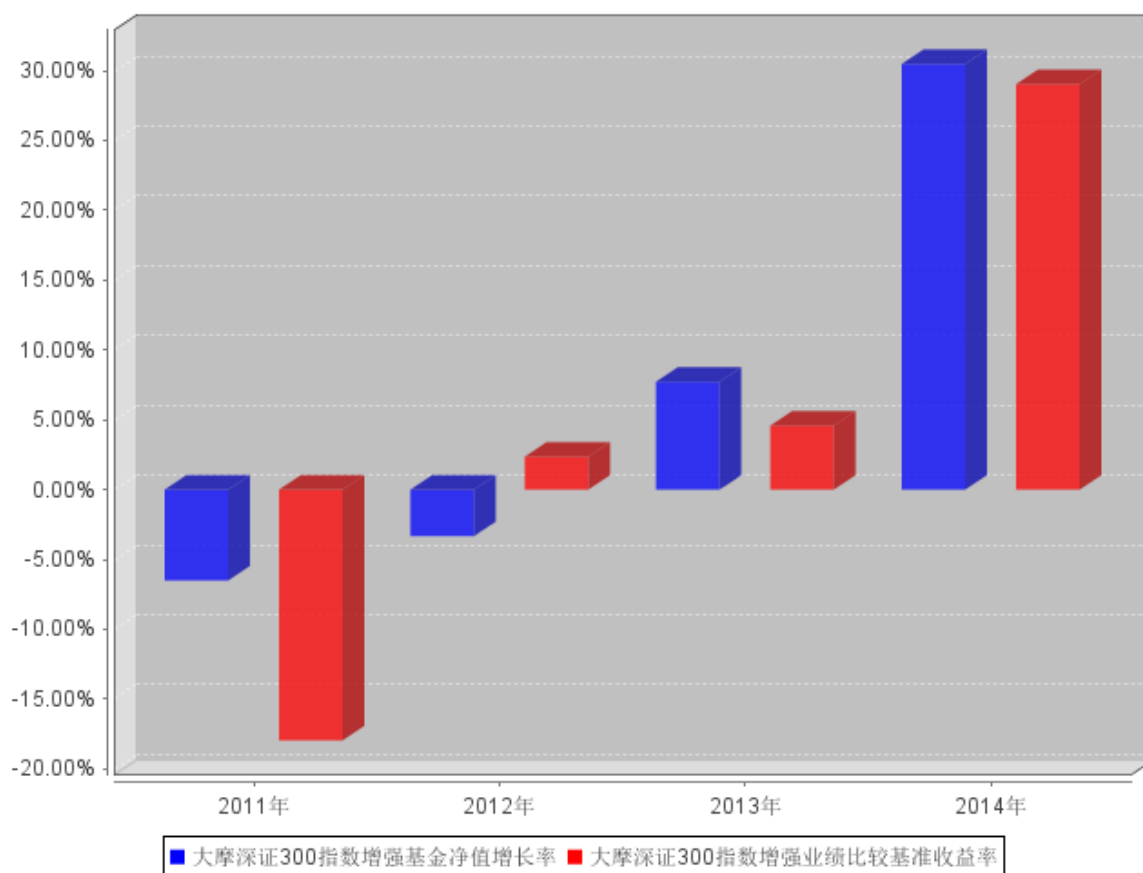
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

大摩深证300指数增强基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



3.2.3 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

大摩深证300指数增强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对比图



注：本基金基金合同于 2011 年 11 月 15 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

本基金过去三年无利润分配的情况。

§ 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华鑫证券有限责任公司、摩根士丹利国际控股公司、深圳市招融投资控股有限公司等国内外机构。

截止 2014 年 12 月 31 日, 公司旗下共管理十八只开放式基金, 包括摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金、摩根士丹利华鑫资源优选混合型证券投资基金 (LOF)、摩根士丹利华鑫货币市场基金、摩根士丹利华鑫领先优势股票型证券投资基金、摩根士丹利华鑫强收益债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫卓越成长股票型证券投资基金、摩根士丹利华鑫消费领航混合型证券投资基金、摩根士丹利华鑫多因子精选策略股票型证券投资基金、摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金、摩根士丹利华鑫主题优选股票型证券投资基金、摩根士丹利华鑫多元收益债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫量化配置股票型证券投资基金、摩根士丹利华鑫双利增强债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫纯债稳定增利 18 个月定期开放债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫品质生活精选股票型证券投资基金、摩根士丹利华鑫进取优选股票型证券投资基金、摩根士丹利华鑫纯债稳定添利 18 个月定期开放债券型证券投资基金和摩根士丹利华鑫优质信价纯债债券型证券投资基金。同时, 公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合。

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		
周宁	基金 经理	2014 年 12 月 9 日	-	6	首都经济贸易大学会计学硕士。曾任东兴证券股份有限公司行业研究员。2010 年 9 月加入本公司, 历任研究员、基金经理助理, 2014 年 12 月起任本基金基金经理。
刘钊	数 量 化 投 资 部 总 监、基 金 经 理	2013 年 4 月 15 日	2014 年 12 月 9 日	6	中国科学技术大学管理学博士, 曾任职于深交所博士后工作站, 五矿证券有限责任公司, 历任总裁助理、研究部负责人、董事会秘书。2010 年 1 月加入本公司, 从事量化投资工作, 2012 年 7 月起任摩根士丹利华鑫多因子精选策略股票型证券投资基金基金经理, 2013 年 4 月至 2014 年 12 月任本基金基金经理, 2014 年 1 月起担任摩根士丹利华鑫量化配置股票型证券投资基金基金经理。
周志超	基 金 经 理	2013 年 11 月 22 日	2014 年 12 月 9 日	8	南开大学经济学硕士。曾任诺安基金管理有限公司研究部行业分析师, 信达澳银基金管理有限公司研究部高级分析师, 广发基金管理有限公司行业分析师。2011 年 5 月加入本公司, 历任研究员、基金经理助理, 2013 年 11 月至 2014 年 12 月期间任本基金基金经理, 2014 年 3 月起担任摩根士丹利华鑫主

					题优选股票型证券投资基金基金经理，2014 年 6 月起担任摩根士丹利华鑫卓越成长股票型证券投资基金基金经理，2014 年 8 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。
官泽帆	基金 经理 助理	2013 年 10 月 16 日	2014 年 11 月 7 日	4	约翰霍普金斯大学金融数学硕士。曾于 2010 年 5 月至 2011 年 4 月期间任职于招商基金管理有限公司担任投资开发员，2011 年 5 月加入我司，历任程序员、基金经理助理。

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

2、基金经理任职、离任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、变更；

3、证券从业的含义遵从行业协会《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，本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 1 次，为量化投资基金因执行投资策略和其他组合发生的反向交易，基金管理人未发现其他异常交易行为。

4.4 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

本基金的投资运作分为两部分，一部分为指数部分，主要以量化模型作为投资交易决策的依据，其中“指数跟踪模型”用于跟踪指数，“日内择时交易模型”用于辅助判断日内交易时点。通过科学的量化模型研究体系、严格的风险管理机制、高效的量化投资执行制度，本基金在本报告期内较好地跟踪了标的指数的波动，控制了跟踪误差，并取得一定的超额收益。

另一部分为增强部分，属于主动型选股部分，以基金经理对宏观经济、行业和个股的判断为依据，通过“自上而下”与“自下而上”相结合的方法精选了少量个股，对基金资产的增强部分进行适当投资，力争增强投资组合整体收益水平。2014 年国内房地产市场销售放缓压制房屋新开工及固定资产投资增长，内需增长乏力，而外围经济复苏不平衡导致外需增长并不稳定，经济增长总体稳中趋降，此外大宗商品价格持续走弱，输入性通缩压力明显上升。在此背景下，新一届政府在大力深化改革的同时，通过放宽房地产市场限购、降息等系列措施维稳经济增长。受此影响，A 股市场在下半年展开了一轮由增量资金入市推动的估值修复行情，蓝筹股大幅上涨带动指数大幅上升。2014 年多数时间内，我们坚守于行业前景相对较好、估值相对较低的精选标的中，并取得了较好的超额收益，而四季度受市场风格大幅逆转，加大了主动增强部分的操作难度，为适应市场的变化我们对主动增强部分进行了适当的均衡配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期截至 2014 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.271 元，累计份额净值为 1.271 元，报告期内基金份额净值增长率为 30.49%，同期业绩比较基准收益率为 29.05%。

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 2015 年，我们认为当前形势下国内宏观经济依然有下行压力，但经济增速放缓趋稳属“新常态”，政府 2015 年的主基调是稳定增长及全面深化改革，预计财政政策力度或将加码，货币政策有望保持实质性宽松，无风险利率仍有望继续下行。外围形势来看，全球主要经济体经济复苏形势及政策显著分化，2015 年海外形势虽然依然复杂，但对中国而言有利因素和机会要强于不利因素和风险。受益于刺激性政策及经济环境变化，2015 年非金融企业盈利将较 2014 年进一步改善。

在上述大环境下，从居民大类资产配置角度来看，我们认为 2015 年居民大类资产配置资金仍有利于流入 A 股市场，海内外增量资金仍有望对 A 股市场产生积极推动。但考虑到不确定性因素的存在以及市场中存在巨额高杠杆资金，市场仍存在大幅波动风险。

基于以上形势判断，我们仍相对看好 2015 年 A 股市场的投资机会。本基金增强部分将重点关注以下四大类机会：1) 受益原材料价格下降、业绩有望显著改善的中游制造；2) 受益于转型发展的低估值传统企业的边际改善；3) 受益于改革推进的领域，如国企改革、简政放权、“一路一带”战略等；4) 优质成长企业，在新技术、新商业模式、经济转型升级推动下有望卓越成长的领域和卓越企业，如移动互联网、教育、养老、体育等。

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，基金管理人通过开展专项检查、加强日常监控、完善管理制度等方式，检查内部控制制度的执行情况、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) 完成专项检查工作。检查范围覆盖投资交易、基金销售、投资管理人员管理、系统开发、自有资金投资及风险准备金、反洗钱业务等方面。(2) 做好日常监控工作。严格规范基金投资、销售以及运营等各项业务管理，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，确保公司和基金运作合法合规。(3) 持续完善公司内控制度体系，同时，适时以合规指引方式及时清晰地解读监管政策与要求，加强各项业务流程控制。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并充实培训材料，改进合规培训形式，进一步提升员工风控意识及合规意识。(5) 有效地推进投资风险管理系统等合规监控系统的建设，加强风险管理手段，提高工作效率。(6) 积极深入参与新产品设计、新业务拓展工作，就相关的合规及风控问题提供意见和建议。

2015 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

基金管理人旗下基金持有的资产按规定以公允价值进行估值。对于相关品种，特别是长期停牌股票等没有市价的投资品种，基金管理人根据中国证监会发布的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的要求进行估值，具体采用的估值政策和程序说明如下：

基金管理人成立基金估值委员会，委员会由主任委员（分管基金运营部的助理总经理）以及相关成员（包括基金运营部负责人、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。其中基金运营部负责具体执行公允价值估值、提供估值建议、跟踪长期停牌股票对资产净值的影响并就调整估值方法与托管行、会计师事务所进行沟通；风险管理部负责评估公允价值估值数据模型、计算，并向基金运营部提供使用数据模型估值的证券价格；监察稽核部负责与监管机构的沟通、协调以及检查公允价值估值业务的合法、合规性。

由于基金经理及相关投资研究人员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，在需要时可以参加估值委员会会议并提出估值的建议。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。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，估值过程中基金经理并未参与。报告期内，本基金管理人未与任何第三方签订与估值相关的任何定价服务。

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，本基金收益每年度最多分配 4 次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 25%。

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，本基金未实施利润分配。

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

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(2015)第 20049 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	摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人：
引言段	我们审计了后附的摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金(以下简称“摩根士丹利华鑫深证 300 基金”)的财务报表，包括 2014 年 12 月 31 日的资产负债表、2014 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。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是摩根士丹利华鑫深证 300 基金的基金管理人 摩根士丹利华鑫基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括： (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)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，并使其实现公允反映； (2) 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。

注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。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。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，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。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。 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。	
审计意见段	我们认为，上述摩根士丹利华鑫深证 300 基金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监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深证 300 基金 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年度的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	单峰	俞伟敏
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)	
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼	
审计报告日期	2015 年 3 月 18 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	7,701,896.94	878,895.76
结算备付金		-	255,969.88
存出保证金		16,618.49	39,531.81
交易性金融资产	7.4.7.2	79,017,907.25	102,775,638.13
其中：股票投资		79,017,907.25	98,388,868.13

基金投资		-	-
债券投资		-	4,386,770.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	400,000.00
应收证券清算款		757,306.32	100,474.49
应收利息	7.4.7.5	1,447.71	92,399.64
应收股利		-	-
应收申购款		740,837.00	51,412.58
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		88,236,013.71	104,594,322.29
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,720,307.91	328,429.71
应付赎回款		2,625,945.82	112,392.59
应付管理人报酬		69,658.18	88,567.57
应付托管费		10,448.73	13,285.14
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	87,263.22	148,791.95
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	126,268.26	292,743.66
负债合计		4,639,892.12	984,210.62
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	65,773,140.13	106,385,014.48
未分配利润	7.4.7.10	17,822,981.46	-2,774,902.81
所有者权益合计		83,596,121.59	103,610,111.67
负债和所有者权益总计		88,236,013.71	104,594,322.29

注：报告截止日 2014 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.271 元，基金份额总额 65,773,140.13 份。

7.2 利润表

会计主体：摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
一、收入		20,662,706.02	14,346,025.03
1.利息收入		122,993.83	162,710.80
其中：存款利息收入	7.4.7.11	21,591.40	40,430.42
债券利息收入		94,081.82	94,938.59
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		7,320.61	27,341.79
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		10,065,775.16	9,893,970.61
其中：股票投资收益	7.4.7.12	9,147,724.01	8,455,340.05
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-10,701.60	873.21
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.1	-	-
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	928,752.75	1,437,757.35
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	10,411,391.88	4,230,536.31
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	62,545.15	58,807.31
减：二、费用		1,971,078.76	3,038,962.55
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	811,623.10	1,320,666.65
2.托管费	7.4.10.2.2	121,743.49	198,100.01
3.销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4.交易费用	7.4.7.19	522,876.88	1,002,850.57
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	7.4.7.20	514,835.29	517,345.32
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		18,691,627.26	11,307,062.48
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		18,691,627.26	11,307,062.48

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2014 年 1 月 1 日至 2014 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）	106,385,014.48	-2,774,902.81	103,610,111.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	18,691,627.26	18,691,627.26
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）	-40,611,874.35	1,906,257.01	-38,705,617.34
其中：1. 基金申购款	56,355,042.74	12,340,233.27	68,695,276.01
2. 基金赎回款	-96,966,917.09	-10,433,976.26	-107,400,893.35
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	65,773,140.13	17,822,981.46	83,596,121.59
项目	上年度可比期间		
	2013 年 1 月 1 日至 2013 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）	163,261,917.18	-15,705,036.46	147,556,880.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	11,307,062.48	11,307,062.48
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）	-56,876,902.70	1,623,071.17	-55,253,831.53
其中：1. 基金申购款	23,566,817.86	-1,391,997.94	22,174,819.92
2. 基金赎回款	-80,443,720.56	3,015,069.11	-77,428,651.45
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	106,385,014.48	-2,774,902.81	103,610,111.67

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：

于华

基金管理人负责人

张力

主管会计工作负责人

谢先斌

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金（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[2011]第 1218 号《关于核准摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金募集的批复》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《摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强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基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 421,871,132.46 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 439 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2011 年 11 月 15 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 421,922,840.88 份基金份额，其中认购资金利息折合 51,708.42 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《摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强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(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例范围为 90%-95%，其中投资于深证 300 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产的 80%；除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 5%-10%，保持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%，股指期货、权证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。本基金力求控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。本基金的业绩比较基准为：深证 300 价格指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

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 2015 年 3 月 18 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<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2014 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 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 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、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)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公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表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、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)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, 但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的, 按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具, 如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化, 参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素, 调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场, 采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时, 尽可能最大程度使用市场参数, 减少使用与本基金特定相关的参数。

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，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[2008]38 号《关于进一步规范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，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

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 2014 年颁布《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号——合营安排》、《企业会计准则第 41 号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第 2 号——长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号——职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》、《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》以及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》，要求除《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》自 2014 年度财务报表起施行外，其他准则自 2014 年 7 月 1 日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(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，股权的股息、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。自 2013 年 1 月 1 日起，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，暂减按 25% 计入应纳税所得额。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。

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 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
活期存款	7,701,896.94	878,895.76
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	7,701,896.94	878,895.76

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2014 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		69,032,609.47	79,017,907.25	9,985,297.78
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		69,032,609.47	79,017,907.25	9,985,297.78
项目		上年度末 2013 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		98,804,832.23	98,388,868.13	-415,964.10
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	4,396,900.00	4,386,770.00	-10,130.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	4,396,900.00	4,386,770.00	-10,130.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		103,201,732.23	102,775,638.13	-426,094.10

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

单位：人民币元

项目		本期末 2014 年 12 月 31 日	
		账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场		-	-

银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2013 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	400,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	400,000.00	-

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 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	1,439.57	219.30
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	-	126.89
应收债券利息	-	92,033.87
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孖息	-	-
其他	8.14	19.58
合计	1,447.71	92,399.64

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 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	87,263.22	148,791.95
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	87,263.22	148,791.95

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	9,045.29	20.69
预提费用	54,500.00	230,000.00
指数使用费	50,000.00	50,000.00
其它	12,722.97	12,722.97
合计	126,268.26	292,743.66

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	106,385,014.48	106,385,014.48
本期申购	56,355,042.74	56,355,042.74
本期赎回(以“-”号填列)	-96,966,917.09	-96,966,917.09
本期末	65,773,140.13	65,773,140.13

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

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	-3,326,844.95	551,942.14	-2,774,902.81
本期利润	8,280,235.38	10,411,391.88	18,691,627.26
本期基金份额交易产生的变动数	1,775,796.68	130,460.33	1,906,257.01
其中：基金申购款	2,887,408.65	9,452,824.62	12,340,233.27
基金赎回款	-1,111,611.97	-9,322,364.29	-10,433,976.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,729,187.11	11,093,794.35	17,822,981.46

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	19,374.67	34,083.53

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	1,791.42	5,559.48
其他	425.31	787.41
合计	21,591.40	40,430.42

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	184,255,482.94	348,264,053.94
减：卖出股票成本总额	175,107,758.93	339,808,713.89
买卖股票差价收入	9,147,724.01	8,455,340.05

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 2014年1月1日至 2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013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	-10,701.60	873.21
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	-10,701.60	873.21

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 2014年1月1日至 2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	10,782,016.33	7,877,684.28
减：卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	10,438,311.70	7,663,488.80
减：应收利息总额	354,406.23	213,322.27
买卖债券差价收入	-10,701.60	873.21

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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	928,752.75	1,437,757.35
基金投资产生的股利收益	—	—
合计	928,752.75	1,437,757.35

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	10,411,391.88	4,230,536.31
——股票投资	10,401,261.88	4,240,666.31
——债券投资	10,130.00	-10,130.00
——资产支持证券投资	—	—
——贵金属投资	—	—
——其他	—	—
2. 衍生工具	—	—
——权证投资	—	—
3. 其他	—	—
合计	10,411,391.88	4,230,536.31

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
----	----	---------

	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	37,233.21	56,040.63
基金转换费收入	5,311.94	2,760.55
其他	20,000.00	6.13
合计	62,545.15	58,807.31

注：1. 本基金的赎回费用按基金份额持有人持有时间的增加而递减。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。赎回费中不低于赎回费总额的 25% 归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	522,876.88	1,002,850.57
银行间市场交易费用	-	-
合计	522,876.88	1,002,850.57

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	60,000.00
信息披露费	240,000.00	240,000.00
银行费用	1,935.29	3,445.32
债券帐户维护费	22,500.00	13,500.00
指数使用费	200,000.00	200,000.00
其他	400.00	400.00
合计	514,835.29	517,345.32

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度（自然季度）人民币 50,000 元。

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

截至财务报表批准日，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
深圳市中技实业(集团)有限公司	基金管理人的股东
汉唐证券有限责任公司	基金管理人的股东
深圳市招融投资控股有限公司	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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 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	47,855,356.59	14.52%	45,965,939.12	7.16%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间无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 2014 年 1 月 1 日至 2014 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	43,567.75	14.52%	18,712.82	21.44%

关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013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	41,847.74	7.21%	41,847.74	28.13%

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 2014年1月1日至 2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	811,623.10	1,320,666.65
其中：支付销售机构的客户维护费	372,570.58	605,798.27

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

1.00%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 × 1.00% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	121,743.49	198,100.01

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 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.15% / 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 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 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	7,701,896.94	19,374.67	878,895.76	34,083.53

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。

7.4.10.6 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。

7.4.10.7 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（2014 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限的证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单 价	复牌日 期	复牌 开盘单 价	数量 (股)	期末 成本总额	期末估值总 额	备注
000562	宏源证券	2014 年 12 月 10 日	重大事项	36.38	2015 年 1 月 26 日	17.77	37,972	547,676.85	1,381,421.36	1
000009	中国宝安	2014 年 12 月 29 日	重大事项	12.95	2015 年 1 月 7 日	13.88	29,956	340,190.97	387,930.20	-
002152	广电运通	2014 年 12 月 17 日	重大事项	22.15	2015 年 3 月 11 日	24.37	12,553	178,570.01	278,048.95	-

000977	浪潮信息	2014 年 12 月 22 日	重大事项	41.18	2015 年 1 月 19 日	45.30	6,298	133,210.91	259,351.64	-
300315	掌趣科技	2014 年 7 月 14 日	重大事项	15.83	2015 年 2 月 16 日	17.41	14,000	245,071.35	221,620.00	-
000883	湖北能源	2014 年 11 月 18 日	重大事项	6.43	-	-	27,100	71,356.81	174,253.00	-
000612	焦作万方	2014 年 12 月 29 日	重大事项	10.10	2015 年 1 月 16 日	10.20	16,271	131,765.44	164,337.10	-
000413	东旭光电	2014 年 11 月 25 日	重大事项	7.67	2015 年 1 月 28 日	8.44	17,700	134,252.63	135,759.00	-
000938	紫光股份	2014 年 12 月 22 日	重大事项	29.13	-	-	3,800	109,722.69	110,694.00	-
000982	中银绒业	2014 年 8 月 25 日	重大事项	4.64	-	-	23,307	113,207.87	108,144.48	-
002050	三花股份	2014 年 10 月 27 日	重大事项	13.57	2015 年 1 月 27 日	14.93	7,497	56,971.06	101,734.29	-
000996	中国中期	2014 年 12 月 8 日	重大事项	28.60	-	-	3,381	56,724.55	96,696.60	-
000616	亿城投资	2014 年 12 月 1 日	重大事项	4.77	-	-	19,994	64,590.88	95,371.38	2
002123	荣信股份	2014 年 12 月 22 日	重大资产重 组	9.22	-	-	9,839	115,750.66	90,715.58	-
002312	三泰电子	2014 年 12 月 3 日	重大资产重 组	22.55	2015 年 3 月 6 日	26.28	3,920	82,863.17	88,396.00	3
000501	鄂武商 A	2014 年 12 月 24 日	重大事项	15.82	2015 年 1 月 16 日	17.20	5,530	74,463.74	87,484.60	-
002396	星网锐捷	2014 年 10 月 20 日	重大事项	27.31	2015 年 2 月 9 日	30.04	3,172	49,929.02	86,627.32	-
002168	深圳惠程	2014 年 11 月 28 日	重大资产重 组	10.13	2015 年 1 月 28 日	9.51	7,759	71,161.28	78,598.67	-
002308	威创股份	2014 年 12 月 29 日	重大事项	8.25	2015 年 2 月 4 日	9.08	8,500	75,751.40	70,125.00	-
002577	雷柏科技	2014 年 12 月 26 日	重大事项	27.31	2015 年 1 月 9 日	26.00	2,400	67,524.73	65,544.00	-
300156	神雾环保	2014 年 11 月 20 日	重大资产重 组	23.18	2015 年 1 月 28 日	23.17	38	473.19	880.84	-
002171	精诚铜业	2014 年 11 月 24 日	重大资产重 组	13.07	-	-	29	326.93	379.03	-
000426	兴业矿业	2014 年 12 月 11 日	重大资产重 组	11.95	-	-	24	269.64	286.80	-
002006	*ST 精功	2014 年 9 月 10 日	重大资产重 组	8.75	-	-	15	212.64	131.25	4
000506	中润资源	2014 年 11 月	重大资产重	6.97	2015 年 2	6.27	2	11.82	13.94	-

		4 日	组		月 16 日					
--	--	-----	---	--	--------	--	--	--	--	--

注：1. 根据宏源证券股份有限公司(以下简称“宏源证券”)于 2014 年 12 月 2 日公布的《申银万国证券股份有限公司换股吸收合并宏源证券股份有限公司报告书》和《关于申银万国证券股份有限公司换股吸收合并本公司事宜的提示性公告》，申银万国证券股份有限公司将向宏源证券全体股东发行 A 股股票，以换股比例 2.049:1 取得宏源证券股东持有的宏源证券全部股票，吸收合并宏源证券；宏源证券自 2014 年 12 月 10 日起连续停牌。合并后的申万宏源于 2015 年 1 月 26 日复牌，当日复牌开盘单价为 17.77 元。宏源证券人民币普通股股票自 2015 年 1 月 26 日起终止上市并摘牌。

2. 根据亿城投资公告，亿城投资自 2015 年 2 月 6 日变更为海航投资，证券代码不变。
3. 根据三泰电子公告，三泰电子自 2015 年 3 月 2 日变更为三泰控股，证券代码不变。
4. 根据*ST 精功公告，*ST 精功自 2015 年 3 月 2 日开市时起撤销退市风险警示，变更为精工科技，证券代码不变。
5. 本基金截至 2014 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票指数增强型基金，以深证 300 指数作为本基金投资组合跟踪的目标指数。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信用风险、流动性风险及市场风险。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，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，前者负责协调并与各部门合作完成运营及合规风险管理，后者主要负责基金投资的信用风险、市场风险以及流动性风险的管理；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。本基金的活期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。

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 2014 年 12 月 31 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券（2013 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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。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。

于 2014 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。

7.4.13.4 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、结算备付金及债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2014 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	7,701,896.94	-	-	-	7,701,896.94

存出保证金	16,618.49	-	-	-	16,618.49
交易性金融资产	-	-	-	79,017,907.25	79,017,907.25
应收证券清算款	-	-	-	757,306.32	757,306.32
应收利息	-	-	-	1,447.71	1,447.71
应收申购款	-	-	-	740,837.00	740,837.00
资产总计	7,718,515.43	-	-	80,517,498.28	88,236,013.71
负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	1,720,307.91	1,720,307.91
应付赎回款	-	-	-	2,625,945.82	2,625,945.82
应付管理人报酬	-	-	-	69,658.18	69,658.18
应付托管费	-	-	-	10,448.73	10,448.73
应付交易费用	-	-	-	87,263.22	87,263.22
其他负债	-	-	-	126,268.26	126,268.26
负债总计	-	-	-	4,639,892.12	4,639,892.12
利率敏感度缺口	7,718,515.43	-	-	75,877,606.16	83,596,121.59
上年度末 2013 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	878,895.76	-	-	-	878,895.76
结算备付金	255,969.88	-	-	-	255,969.88
存出保证金	39,531.81	-	-	-	39,531.81
交易性金融资产	4,386,770.00	-	-	98,388,868.13	102,775,638.13
买入返售金融资产	400,000.00	-	-	-	400,000.00
应收证券清算款	-	-	-	100,474.49	100,474.49
应收利息	-	-	-	92,399.64	92,399.64
应收申购款	-	-	-	51,412.58	51,412.58
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	5,961,167.45	-	-	98,633,154.84	104,594,322.29
负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	328,429.71	328,429.71
应付赎回款	-	-	-	112,392.59	112,392.59
应付管理人报酬	-	-	-	88,567.57	88,567.57
应付托管费	-	-	-	13,285.14	13,285.14
应付交易费用	-	-	-	148,791.95	148,791.95
其他负债	-	-	-	292,743.66	292,743.66
负债总计	-	-	-	984,210.62	984,210.62
利率敏感度缺口	5,961,167.45	-	-	97,648,944.22	103,610,111.67

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 2014 年 12 月 31 日，本基金未持有债券投资(2013 年 12 月 31 日：本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 4.23%)。因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2013 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。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券，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，在有效跟踪深证 300 指数的基础上，通过运用增强型投资策略，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。本基金的投资组合范围为：股票资产占基金资产的 90%-95%，其中投资于深证 300 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产的 80%；基金持有权证市值不得超过基金资产净值的 3%；除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 5%-10%，其中现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。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，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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 2014 年 12 月 31 日		上年度末 2013 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	79,017,907.25	94.52	98,388,868.13	94.96
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	79,017,907.25	94.52	98,388,868.13	94.96

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末(2014 年 12 月 31 日)	上年度末(2013 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	4,130,000.00	5,130,000.00
	业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-4,130,000.00	-5,130,000.00

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 2014 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 74,933,362.22 元,属于第二层次的余额为 4,084,545.03 元,无属于第三层次的余额(2013 年 12 月 31 日:第一层次 98,032,045.29 元,第二层次 4,743,592.84 元,无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期

间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2014 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(2013 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	79,017,907.25	89.55
	其中：股票	79,017,907.25	89.55
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	7,701,896.94	8.73
7	其他各项资产	1,516,209.52	1.72
8	合计	88,236,013.71	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,021,483.24	1.22

B	采矿业	1,653,049.58	1.98
C	制造业	39,287,791.94	47.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,107,944.84	1.33
E	建筑业	1,038,872.81	1.24
F	批发和零售业	2,474,191.25	2.96
G	交通运输、仓储和邮政业	352,289.28	0.42
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,910,925.70	5.87
J	金融业	6,927,017.54	8.29
K	房地产业	5,012,156.18	6.00
L	租赁和商务服务业	1,345,532.44	1.61
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,331,011.15	1.59
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	119,567.00	0.14
R	文化、体育和娱乐业	1,053,629.40	1.26
S	综合	451,930.20	0.54
	合计	68,087,392.55	81.45

8.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	286.80	0.00
C	制造业	5,831,691.12	6.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,591,095.00	1.90
J	金融业	1,770,920.00	2.12
K	房地产业	1,736,521.78	2.08
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	10,930,514.70	13.08

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

8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000002	万 科 A	188,502	2,620,177.80	3.13
2	000338	潍柴动力	69,100	1,885,739.00	2.26
3	000858	五 粮 液	84,140	1,809,010.00	2.16
4	000001	平安银行	103,626	1,641,435.84	1.96
5	000651	格力电器	42,240	1,567,948.80	1.88
6	000562	宏源证券	37,972	1,381,421.36	1.65
7	000776	广发证券	45,900	1,191,105.00	1.42
8	000012	南 玻 A	125,800	1,118,362.00	1.34
9	000333	美的集团	33,732	925,606.08	1.11
10	000783	长江证券	46,074	774,964.68	0.93
11	002024	苏宁云商	81,100	729,900.00	0.87
12	000625	长安汽车	41,382	679,906.26	0.81
13	000063	中兴通讯	35,616	643,224.96	0.77
14	000157	中联重科	89,400	631,164.00	0.76
15	000069	华侨城 A	71,100	586,575.00	0.70
16	000725	京东方 A	171,000	574,560.00	0.69
17	000100	TCL 集团	145,164	551,623.20	0.66
18	000538	云南白药	8,704	549,657.60	0.66
19	000800	一汽轿车	35,206	533,018.84	0.64
20	002450	康得新	18,088	524,009.36	0.63
21	002415	海康威视	22,903	512,340.11	0.61
22	000623	吉林敖东	14,100	490,821.00	0.59
23	000728	国元证券	15,600	486,252.00	0.58
24	000024	招商地产	18,200	480,298.00	0.57
25	300027	华谊兄弟	17,020	448,817.40	0.54
26	000503	海虹控股	14,102	441,110.56	0.53
27	002202	金风科技	30,800	435,204.00	0.52
28	000423	东阿阿胶	11,510	429,092.80	0.51
29	300059	东方财富	15,200	424,992.00	0.51

30	000402	金 融 街	33,600	414,288.00	0.50
31	000895	双汇发展	13,100	413,305.00	0.49
32	002241	歌尔声学	16,649	408,399.97	0.49
33	002230	科大讯飞	15,079	401,855.35	0.48
34	300024	机器人	10,185	401,187.15	0.48
35	000009	中国宝安	29,956	387,930.20	0.46
36	002594	比亚迪	10,137	386,726.55	0.46
37	300070	碧水源	10,973	381,860.40	0.46
38	000768	中航飞机	19,800	375,012.00	0.45
39	000039	中集集团	16,300	356,807.00	0.43
40	002304	洋河股份	4,500	355,725.00	0.43
41	002142	宁波银行	22,200	349,206.00	0.42
42	002081	金 螳 螂	20,559	345,391.20	0.41
43	000686	东北证券	16,800	335,664.00	0.40
44	000581	威孚高科	12,002	322,013.66	0.39
45	000559	万向钱潮	25,652	304,489.24	0.36
46	002456	欧菲光	16,032	303,966.72	0.36
47	002465	海格通信	15,700	303,324.00	0.36
48	000831	五矿稀土	10,100	302,899.00	0.36
49	002008	大族激光	18,868	301,321.96	0.36
50	000970	中科三环	20,288	300,059.52	0.36
51	002236	大华股份	13,594	298,388.30	0.36
52	000792	盐湖股份	13,700	297,290.00	0.36
53	002065	东华软件	16,510	295,694.10	0.35
54	000793	华闻传媒	26,000	293,800.00	0.35
55	000917	电广传媒	17,200	290,336.00	0.35
56	300104	乐视网	8,929	289,656.76	0.35
57	002152	广电运通	12,553	278,048.95	0.33
58	000568	泸州老窖	13,557	276,562.80	0.33
59	002353	杰瑞股份	9,027	275,955.39	0.33
60	000400	许继电气	13,580	275,674.00	0.33
61	000960	锡业股份	15,700	273,180.00	0.33
62	000998	隆平高科	13,850	272,706.50	0.33
63	002405	四维图新	13,655	266,682.15	0.32
64	002252	上海莱士	5,826	262,810.86	0.31
65	000629	攀钢钒钛	73,079	262,353.61	0.31
66	000963	华东医药	4,985	262,260.85	0.31
67	000061	农 产 品	19,880	260,428.00	0.31
68	002038	双鹭药业	6,555	259,578.00	0.31

69	000977	浪潮信息	6,298	259,351.64	0.31
70	300058	蓝色光标	12,112	255,805.44	0.31
71	002422	科伦药业	8,567	250,413.41	0.30
72	000709	河北钢铁	65,300	250,099.00	0.30
73	002007	华兰生物	7,443	247,851.90	0.30
74	300124	汇川技术	8,463	247,034.97	0.30
75	000060	中金岭南	25,708	243,968.92	0.29
76	300003	乐普医疗	10,240	243,712.00	0.29
77	000826	桑德环境	8,905	243,551.75	0.29
78	000778	新兴铸管	39,300	242,874.00	0.29
79	000425	徐工机械	16,200	242,514.00	0.29
80	002385	大北农	17,966	241,103.72	0.29
81	000598	兴蓉投资	31,482	240,522.48	0.29
82	000983	西山煤电	29,195	239,982.90	0.29
83	300002	神州泰岳	14,300	237,380.00	0.28
84	002500	山西证券	14,800	236,800.00	0.28
85	000592	平潭发展	13,496	228,487.28	0.27
86	300017	网宿科技	4,697	226,395.40	0.27
87	000997	新大陆	7,949	223,684.86	0.27
88	000661	长春高新	2,569	222,732.30	0.27
89	002570	贝因美	13,690	221,641.10	0.27
90	300315	掌趣科技	14,000	221,620.00	0.27
91	000046	泛海控股	22,200	219,558.00	0.26
92	002400	省广股份	10,100	218,867.00	0.26
93	000825	太钢不锈	41,000	216,070.00	0.26
94	002190	成飞集成	6,691	214,112.00	0.26
95	002022	科华生物	10,058	213,229.60	0.26
96	300253	卫宁软件	3,000	209,910.00	0.25
97	002673	西部证券	5,600	209,720.00	0.25
98	000750	国海证券	11,994	208,575.66	0.25
99	000887	中鼎股份	15,022	207,303.60	0.25
100	000729	燕京啤酒	25,700	205,343.00	0.25
101	000878	云南铜业	14,220	203,061.60	0.24
102	002073	软控股份	16,506	199,887.66	0.24
103	000839	中信国安	17,800	199,716.00	0.24
104	002030	达安基因	9,766	196,003.62	0.23
105	000511	烯碳新材	23,571	193,517.91	0.23
106	000630	铜陵有色	12,500	193,500.00	0.23
107	000876	新希望	13,504	189,056.00	0.23

108	000999	华润三九	8,286	187,760.76	0.22
109	002183	怡亚通	12,100	179,806.00	0.22
110	002129	中环股份	8,505	179,030.25	0.21
111	002146	荣盛发展	11,200	177,744.00	0.21
112	300079	数码视讯	14,258	177,512.10	0.21
113	002475	立讯精密	6,400	177,152.00	0.21
114	002155	辰州矿业	17,324	176,531.56	0.21
115	002051	中工国际	6,400	174,848.00	0.21
116	000988	华工科技	14,612	174,467.28	0.21
117	000883	湖北能源	27,100	174,253.00	0.21
118	002063	远光软件	8,499	170,404.95	0.20
119	002005	德豪润达	21,437	169,995.41	0.20
120	002153	石基信息	2,591	169,969.60	0.20
121	002701	奥瑞金	8,200	167,854.00	0.20
122	002250	联化科技	11,300	167,240.00	0.20
123	000758	中色股份	11,200	164,528.00	0.20
124	300072	三聚环保	6,800	164,424.00	0.20
125	000612	焦作万方	16,271	164,337.10	0.20
126	002001	新和成	10,720	162,622.40	0.19
127	002104	恒宝股份	13,382	161,922.20	0.19
128	000939	凯迪电力	14,224	160,020.00	0.19
129	300026	红日药业	6,600	159,060.00	0.19
130	300273	和佳股份	6,840	158,346.00	0.19
131	001696	宗申动力	19,595	156,172.15	0.19
132	300133	华策影视	6,200	155,496.00	0.19
133	000566	海南海药	10,208	155,365.76	0.19
134	000851	高鸿股份	13,800	154,422.00	0.18
135	000848	承德露露	7,000	153,930.00	0.18
136	002185	华天科技	12,300	153,627.00	0.18
137	002344	海宁皮城	9,600	152,736.00	0.18
138	000652	泰达股份	20,838	152,117.40	0.18
139	000027	深圳能源	13,600	151,776.00	0.18
140	002375	亚厦股份	7,988	151,452.48	0.18
141	300077	国民技术	5,671	151,302.28	0.18
142	002340	格林美	11,585	149,678.20	0.18
143	002368	太极股份	3,400	149,260.00	0.18
144	002410	广联达	6,600	147,840.00	0.18
145	002092	中泰化学	18,990	147,172.50	0.18
146	002219	恒康医疗	7,695	146,589.75	0.18

147	000786	北新建材	5,788	146,320.64	0.18
148	000050	深天马 A	7,626	146,114.16	0.17
149	300146	汤臣倍健	5,592	145,392.00	0.17
150	002049	同方国芯	6,000	144,000.00	0.17
151	000690	宝新能源	22,729	143,647.28	0.17
152	002106	莱宝高科	11,219	142,256.92	0.17
153	000031	中粮地产	16,700	141,282.00	0.17
154	002294	信立泰	3,978	141,020.10	0.17
155	000528	柳 工	11,200	140,896.00	0.17
156	000735	罗 牛 山	18,302	139,461.24	0.17
157	000816	江淮动力	22,963	138,007.63	0.17
158	000028	国药一致	2,875	137,223.75	0.16
159	000540	中天城投	11,600	136,648.00	0.16
160	002191	劲嘉股份	9,959	136,537.89	0.16
161	000413	东旭光电	17,700	135,759.00	0.16
162	000898	鞍钢股份	21,900	134,685.00	0.16
163	000762	西藏矿业	10,054	134,623.06	0.16
164	000671	阳 光 城	9,700	134,539.00	0.16
165	002048	宁波华翔	9,338	134,187.06	0.16
166	300257	开山股份	3,800	133,760.00	0.16
167	000415	渤海租赁	9,600	131,232.00	0.16
168	002004	华邦颖泰	7,534	130,940.92	0.16
169	000685	中山公用	5,884	130,801.32	0.16
170	002440	闰土股份	7,200	129,024.00	0.15
171	000541	佛山照明	12,600	128,646.00	0.15
172	300088	长信科技	8,300	128,401.00	0.15
173	002310	东方园林	6,900	127,443.00	0.15
174	000975	银泰资源	8,308	127,029.32	0.15
175	300212	易华录	4,600	126,684.00	0.15
176	300274	阳光电源	7,800	126,048.00	0.15
177	002399	海普瑞	4,872	125,697.60	0.15
178	002223	鱼跃医疗	5,005	124,924.80	0.15
179	000829	天音控股	15,527	124,681.81	0.15
180	000937	冀中能源	14,900	124,266.00	0.15
181	000969	安泰科技	13,545	123,530.40	0.15
182	000088	盐 田 港	12,401	122,521.88	0.15
183	000788	北大医药	8,700	121,626.00	0.15
184	000901	航天科技	3,563	120,251.25	0.14
185	300015	爱尔眼科	4,340	119,567.00	0.14

186	002292	奥飞动漫	4,052	119,534.00	0.14
187	000926	福星股份	11,100	119,436.00	0.14
188	002299	圣农发展	9,426	119,238.90	0.14
189	300039	上海凯宝	9,400	119,192.00	0.14
190	002573	国电清新	4,300	119,024.00	0.14
191	000422	湖北宜化	15,880	118,941.20	0.14
192	000078	海王生物	12,157	118,773.89	0.14
193	000933	神火股份	19,700	118,003.00	0.14
194	002273	水晶光电	6,900	117,990.00	0.14
195	002428	云南锗业	8,100	117,531.00	0.14
196	300251	光线传媒	4,900	115,836.00	0.14
197	000550	江铃汽车	3,819	115,715.70	0.14
198	000513	丽珠集团	2,337	115,541.28	0.14
199	000877	天山股份	11,200	114,800.00	0.14
200	000516	开元投资	9,400	114,774.00	0.14
201	000006	深振业 A	16,100	113,505.00	0.14
202	002277	友阿股份	8,874	112,078.62	0.13
203	000563	陕国投 A	8,900	111,873.00	0.13
204	002167	东方锆业	8,092	111,831.44	0.13
205	002467	二六三	8,601	111,554.97	0.13
206	000938	紫光股份	3,800	110,694.00	0.13
207	000543	皖能电力	8,600	110,424.00	0.13
208	002041	登海种业	3,416	109,482.80	0.13
209	000572	海马汽车	20,697	109,073.19	0.13
210	000982	中银绒业	23,307	108,144.48	0.13
211	000718	苏宁环球	16,000	107,680.00	0.13
212	002052	同洲电子	11,800	107,616.00	0.13
213	000979	中弘股份	23,500	106,925.00	0.13
214	000650	仁和药业	13,832	106,783.04	0.13
215	000726	鲁 泰 A	8,900	106,711.00	0.13
216	002161	远 望 谷	13,137	106,409.70	0.13
217	002029	七 匹 狼	11,907	106,091.37	0.13
218	000900	现代投资	15,000	105,300.00	0.13
219	300157	恒泰艾普	10,400	104,936.00	0.13
220	002028	思源电气	8,334	103,758.30	0.12
221	000401	冀东水泥	7,900	103,253.00	0.12
222	300228	富瑞特装	2,100	102,480.00	0.12
223	000830	鲁西化工	18,840	101,736.00	0.12
224	002050	三花股份	7,497	101,734.29	0.12

225	002429	兆驰股份	13,350	101,460.00	0.12
226	000488	晨鸣纸业	16,400	101,188.00	0.12
227	300090	盛运股份	7,400	101,010.00	0.12
228	000021	长城开发	14,041	100,814.38	0.12
229	002237	恒邦股份	6,200	100,502.00	0.12
230	000539	粤电力 A	12,800	100,352.00	0.12
231	002151	北斗星通	2,900	99,064.00	0.12
232	002176	江特电机	6,791	98,673.23	0.12
233	000807	云铝股份	17,607	97,190.64	0.12
234	000860	顺鑫农业	5,186	96,874.48	0.12
235	000996	中国中期	3,381	96,696.60	0.12
236	000731	四川美丰	10,959	96,329.61	0.12
237	000616	亿城投资	19,994	95,371.38	0.11
238	000049	德赛电池	3,157	95,088.84	0.11
239	002064	华峰氨纶	8,705	93,143.50	0.11
240	002011	盾安环境	9,500	92,910.00	0.11
241	002056	横店东磁	4,187	91,904.65	0.11
242	002123	荣信股份	9,839	90,715.58	0.11
243	002262	恩华药业	3,654	90,619.20	0.11
244	002477	雏鹰农牧	10,327	90,464.52	0.11
245	000961	中南建设	6,600	90,420.00	0.11
246	002556	辉隆股份	7,000	89,460.00	0.11
247	000587	金叶珠宝	8,071	89,103.84	0.11
248	002317	众生药业	4,629	88,876.80	0.11
249	002312	三泰电子	3,920	88,396.00	0.11
250	300052	中青宝	4,300	87,505.00	0.10
251	000501	鄂武商 A	5,530	87,484.60	0.10
252	002148	北纬通信	4,800	87,312.00	0.10
253	002396	星网锐捷	3,172	86,627.32	0.10
254	002311	海大集团	7,010	86,082.80	0.10
255	002138	顺络电子	4,900	85,505.00	0.10
256	002203	海亮股份	9,700	85,457.00	0.10
257	000417	合肥百货	10,300	85,387.00	0.10
258	002025	航天电器	4,516	85,352.40	0.10
259	000089	深圳机场	14,533	84,291.40	0.10
260	002181	粤传媒	5,400	82,944.00	0.10
261	002079	苏州固锝	11,287	81,492.14	0.10
262	002653	海思科	4,700	80,558.00	0.10
263	000537	广宇发展	9,200	79,580.00	0.10

264	002168	深圳惠程	7,759	78,598.67	0.09
265	000869	张裕A	2,200	76,692.00	0.09
266	002431	棕榈园林	3,558	75,109.38	0.09
267	002055	得润电子	6,600	74,910.00	0.09
268	000525	红太阳	4,700	74,589.00	0.09
269	002140	东华科技	4,125	74,208.75	0.09
270	002229	鸿博股份	4,800	73,728.00	0.09
271	002408	齐翔腾达	4,500	73,530.00	0.09
272	002414	高德红外	3,600	73,080.00	0.09
273	000823	超声电子	6,621	72,301.32	0.09
274	000596	古井贡酒	1,900	70,205.00	0.08
275	002308	威创股份	8,500	70,125.00	0.08
276	002313	日海通讯	6,300	69,930.00	0.08
277	002646	青青稞酒	3,254	69,798.30	0.08
278	000989	九芝堂	3,980	69,451.00	0.08
279	002091	江苏国泰	4,799	69,441.53	0.08
280	002242	九阳股份	6,218	68,833.26	0.08
281	300074	华平股份	5,400	68,202.00	0.08
282	002577	雷柏科技	2,400	65,544.00	0.08
283	002244	滨江集团	8,100	65,124.00	0.08
284	002275	桂林三金	3,500	64,225.00	0.08
285	002603	以岭药业	2,200	64,152.00	0.08
286	002128	露天煤业	6,861	64,013.13	0.08
287	000551	创元科技	6,400	64,000.00	0.08
288	000062	深圳华强	4,200	63,714.00	0.08
289	002095	生意宝	2,000	63,160.00	0.08
290	002069	獐子岛	5,180	61,642.00	0.07
291	002681	奋达科技	2,100	57,561.00	0.07
292	002476	宝莫股份	7,150	56,556.50	0.07
293	002267	陕天然气	5,196	56,168.76	0.07
294	002269	美邦服饰	5,313	56,052.15	0.07
295	300191	潜能恒信	3,100	51,336.00	0.06
296	002416	爱施德	4,500	48,870.00	0.06
297	300152	燃控科技	3,700	48,063.00	0.06
298	000552	靖远煤电	4,300	43,430.00	0.05
299	000022	深赤湾A	1,800	40,176.00	0.05
300	000156	华数传媒	1,600	39,680.00	0.05

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002539	新都化工	80,000	1,392,000.00	1.67
2	300100	双林股份	120,000	1,245,600.00	1.49
3	600476	湘邮科技	49,900	950,595.00	1.14
4	601318	中国平安	12,000	896,520.00	1.07
5	601169	北京银行	80,000	874,400.00	1.05
6	600340	华夏幸福	20,000	872,000.00	1.04
7	002305	南国置业	119,904	864,507.84	1.03
8	601233	桐昆股份	80,000	848,000.00	1.01
9	600702	沱牌舍得	40,000	745,200.00	0.89
10	300101	振芯科技	30,000	659,700.00	0.79
11	000733	振华科技	40,000	557,200.00	0.67
12	600050	中国联通	100,000	495,000.00	0.59
13	300322	硕贝德	20,000	382,600.00	0.46
14	600406	国电南瑞	10,000	145,500.00	0.17
15	300156	神雾环保	38	880.84	0.00
16	002171	精诚铜业	29	379.03	0.00
17	000426	兴业矿业	24	286.80	0.00
18	002006	*ST 精功	15	131.25	0.00
19	000506	中润资源	2	13.94	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	002539	新都化工	6,842,984.94	6.60
2	002519	银河电子	6,073,532.15	5.86
3	002099	海翔药业	5,367,621.44	5.18
4	002524	光正集团	5,081,094.95	4.90
5	600589	广东榕泰	4,557,740.50	4.40
6	600476	湘邮科技	3,739,195.40	3.61
7	300100	双林股份	3,410,201.40	3.29

8	002089	新 海 宜	3,180,557.70	3.07
9	300256	星星科技	2,923,689.21	2.82
10	300141	和顺电气	2,482,751.12	2.40
11	300044	赛为智能	2,475,408.18	2.39
12	002440	闰土股份	2,430,387.49	2.35
13	600716	凤凰股份	2,143,869.19	2.07
14	002576	通达动力	2,084,404.05	2.01
15	000733	振华科技	2,061,612.00	1.99
16	600739	辽宁成大	1,922,197.04	1.86
17	002510	天汽模	1,889,422.00	1.82
18	600270	外运发展	1,771,557.00	1.71
19	601318	中国平安	1,756,250.00	1.70
20	601369	陕鼓动力	1,750,285.34	1.69

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	002519	银河电子	10,884,087.29	10.50
2	002539	新都化工	7,880,518.83	7.61
3	002524	光正集团	4,985,487.08	4.81
4	002099	海翔药业	4,692,481.45	4.53
5	600589	广东榕泰	4,688,531.85	4.53
6	002089	新 海 宜	3,875,821.30	3.74
7	300256	星星科技	3,229,644.36	3.12
8	002440	闰土股份	3,060,157.66	2.95
9	600791	京能置业	3,017,016.58	2.91
10	000651	格力电器	2,850,339.76	2.75
11	002144	宏达高科	2,694,519.00	2.60
12	600476	湘邮科技	2,528,907.12	2.44
13	300141	和顺电气	2,492,623.33	2.41
14	600716	凤凰股份	2,313,865.00	2.23
15	300100	双林股份	2,303,175.96	2.22
16	300044	赛为智能	2,294,981.48	2.22
17	002576	通达动力	2,273,959.80	2.19
18	002510	天汽模	2,193,331.19	2.12

19	000002	万 科 A	2,110,050.41	2.04
20	300151	昌红科技	2,024,490.00	1.95

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	145,335,536.17
卖出股票收入（成交）总额	184,255,482.94

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

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

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，本基金可运用股指期货，以提高投资效率，有效控制指数的跟踪误差，更好地实现投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，本着审慎原则，适度参与股指期货投资，改善投资组合风险收益特征。另外，本基金将利用股指期货流动性好、杠杆交易的特点，进行现金管理，以应对大额申购赎回、大额现金分红等，管理流动性风险，优化投资组合对目标指数的跟踪效果，提高投资组合的运作效率等。

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规定，本基金不参与国债期货交易。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

8.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体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

本基金投资的前十名股票没有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	16,618.49
2	应收证券清算款	757,306.32
3	应收股利	-
4	应收利息	1,447.71
5	应收申购款	740,837.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,516,209.52

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

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000562	宏源证券	1,381,421.36	1.65	重大资产重组

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告积极投资前五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
2,705	24,315.39	4,516,874.94	6.87%	61,256,265.19	93.13%

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	19,804.38	0.0301%

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的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	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（2011 年 11 月 15 日）基金份额总额	421,922,840.88
本报告期期初基金份额总额	106,385,014.48
本报告期基金总申购份额	56,355,042.74
减:本报告期基金总赎回份额	96,966,917.09
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	65,773,140.13

§ 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：

2014 年 1 月 14 日起，沈良先生不再担任基金管理人副总经理，公司于 2014 年 1 月 15 日公告了上述事项。

2014 年 3 月 6 日起，王文学先生不再担任基金管理人董事长，总经理于华先生代任董事长一职，公司于 2014 年 3 月 8 日公告了上述事项。

2014 年 3 月 14 日起，基金管理人增聘高见先生为公司副总经理，公司于 2014 年 3 月 15 日公告了上述事项。

2014 年 8 月 29 日起，秦红女士不再担任基金管理人副总经理，公司于 2014 年 8 月 30 日公告了上述事项。

2014 年 11 月 21 日，中国证券监督管理委员会核准于华先生担任基金管理人的法定代表人及董事长职务，公司于 2014 年 11 月 25 日公告了上述事项。

2014 年 12 月 29 日，基金管理人董事会批准于华先生辞去其担任的总经理职务，并决定由基金管理人董事长于华先生代行总经理职务，公司于 2014 年 12 月 31 日公告该调整事项。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

2014 年 2 月 7 日，基金托管人发布任免通知，解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。

2014 年 11 月 3 日，基金托管人发布公告，聘任赵观甫为中国建设银行投资托管业务部总经理。

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。本基金基金合同于 2011 年 11 月 15 日生效，2014 年度系第三次进行基金年度审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）系第三次向本基金提供审计服务。报告期内本基金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）2014 年度审计的报酬为 50,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	3	110,914,735.20	33.65%	100,976.86	33.65%	-
广发证券	1	52,294,498.01	15.87%	47,609.24	15.87%	-
华鑫证券	2	47,855,356.59	14.52%	43,567.75	14.52%	-
平安证券	1	25,747,289.35	7.81%	23,440.24	7.81%	-
方正证券	2	24,785,583.15	7.52%	22,565.19	7.52%	-
东海证券	1	19,747,499.49	5.99%	17,978.32	5.99%	-
国海证券	1	19,690,993.50	5.97%	17,926.61	5.97%	-
中信建投	1	7,923,996.07	2.40%	7,214.11	2.40%	-
长江证券	2	5,801,865.91	1.76%	5,281.97	1.76%	-
海通证券	1	5,525,672.24	1.68%	5,030.66	1.68%	-
宏源证券	1	4,493,820.73	1.36%	4,091.22	1.36%	-
瑞银证券	1	1,646,201.62	0.50%	1,499.28	0.50%	-

齐鲁证券	2	1,593,350.00	0.48%	1,450.57	0.48%	-
华创证券	1	1,555,451.80	0.47%	1,416.06	0.47%	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
中信证券（山东）	1	-	-	-	-	-
中信证券（浙江）	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
中信浙江证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
中信万通	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	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. 本基金本报告期新增长城证券、宏信证券、中信证券、中信证券（山东）、中信证券（浙江）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
中信证券	2,003,400.00	26.53%	27,000,000.00	52.22%	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	10,051.00	0.13%	12,200,000.00	23.60%	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	4,038,011.70	53.47%	7,500,000.00	14.51%	-	-
瑞银证券	1,500,559.10	19.87%	4,500,000.00	8.70%	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中信证券（山 东）	-	-	-	-	-	-
中信证券（浙 江）	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	500,000.00	0.97%	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
中信浙江证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信万通	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

国金证券	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---

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	本公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014 年 1 月 15 日
2	本基金 2013 年 4 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014 年 1 月 20 日
3	本公司关于旗下基金调整停牌股票“银河电子”估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014 年 1 月 23 日
4	本公司关于旗下基金在部分销售机构开通转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014 年 1 月 24 日
5	本公司关于旗下基金调整停牌股票“汤臣倍健”估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014 年 1 月 24 日
6	本公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014 年 3 月 8 日
7	本公司关于旗下基金参与光大证券手机客户端申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014 年 3 月 14 日
8	本公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014 年 3 月 15 日
9	本公司关于旗下基金调整停牌股票“远光软件”估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014 年 3 月 19 日
10	本基金 2013 年年度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014 年 3 月 27 日
11	本公司关于旗下部分基金参与工商银行电子银行申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014 年 3 月 31 日
12	本基金 2014 年 1 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014 年 4 月 22 日
13	本公司关于旗下基金调整停牌股票“华闻传媒”估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014 年 4 月 29 日
14	本公司关于旗下基金增加展恒为销售机构并参与申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014 年 5 月 26 日
15	本公司关于旗下基金增加长城证券为销售机构并参与申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014 年 6 月 20 日
16	本基金招募说明书（更新）（2014 年第 1 号）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014 年 6 月 27 日
17	本公司关于旗下部分基金参与交通银行网上银行、手机银行申购费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014 年 6 月 30 日
18	本公司关于旗下基金增加中国国际期货为销售机构并参与申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014 年 7 月 3 日
19	本公司关于旗下基金参与华龙证券申购	《中国证券报》、《上海证	2014 年 7 月 10 日

	费率优惠的公告	券报》、《证券时报》	
20	本基金 2014 年 2 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014 年 7 月 19 日
21	本公司关于旗下部分基金参与交通银行网上银行、手机银行基金营养组合申购费率折上折优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014 年 7 月 29 日
22	本公司关于旗下基金参与华龙证券定投申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014 年 8 月 7 日
23	本公司关于旗下基金增加宏信证券为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014 年 8 月 21 日
24	本基金 2014 年半年度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014 年 8 月 26 日
25	本公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014 年 8 月 30 日
26	本基金 2014 年 3 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014 年 10 月 24 日
27	本公司关于旗下基金调整停牌股票新都化工估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014 年 11 月 12 日
28	本公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014 年 11 月 25 日
29	本基金基金经理变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014 年 12 月 9 日
30	本公司关于旗下基金在海通证券开通转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014 年 12 月 12 日
31	本基金招募说明书（更新）（2014 年第 2 号）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014 年 12 月 29 日
32	本公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014 年 12 月 31 日

注：上述公告同时在公司网站 www.msfnfunds.com.cn 上披露。

§ 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、报告期内在指定报刊上披露的各项公告。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

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
2015 年 3 月 26 日