

摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券 投资基金 2015 年半年度报告

2015 年 6 月 30 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 8 月 25 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。本半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 8 月 21 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 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	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	34
7.3 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	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
7.6 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	47
7.7 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	47
7.8 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	47
7.9 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	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	48

§8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
8.3 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	49
§9 开放式基金份额变动	50
§10 重大事件揭示	50
10.1 基金份额持有人大会决议	50
10.2 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	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	51
10.8 其他重大事件	53
§11 备查文件目录	54
11.1 备查文件目录	54
11.2 存放地点	55
11.3 查阅方式	55

§ 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	34,779,321.64 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份股，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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.msfnunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	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
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第 17 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	31,017,439.06
本期利润	36,671,067.87
加权平均基金份额本期利润	0.7479
本期加权平均净值利润率	44.57%
本期基金份额净值增长率	56.18%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	27,762,744.13
期末可供分配基金份额利润	0.7983
期末基金资产净值	69,029,929.59
期末基金份额净值	1.985
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	98.50%

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。

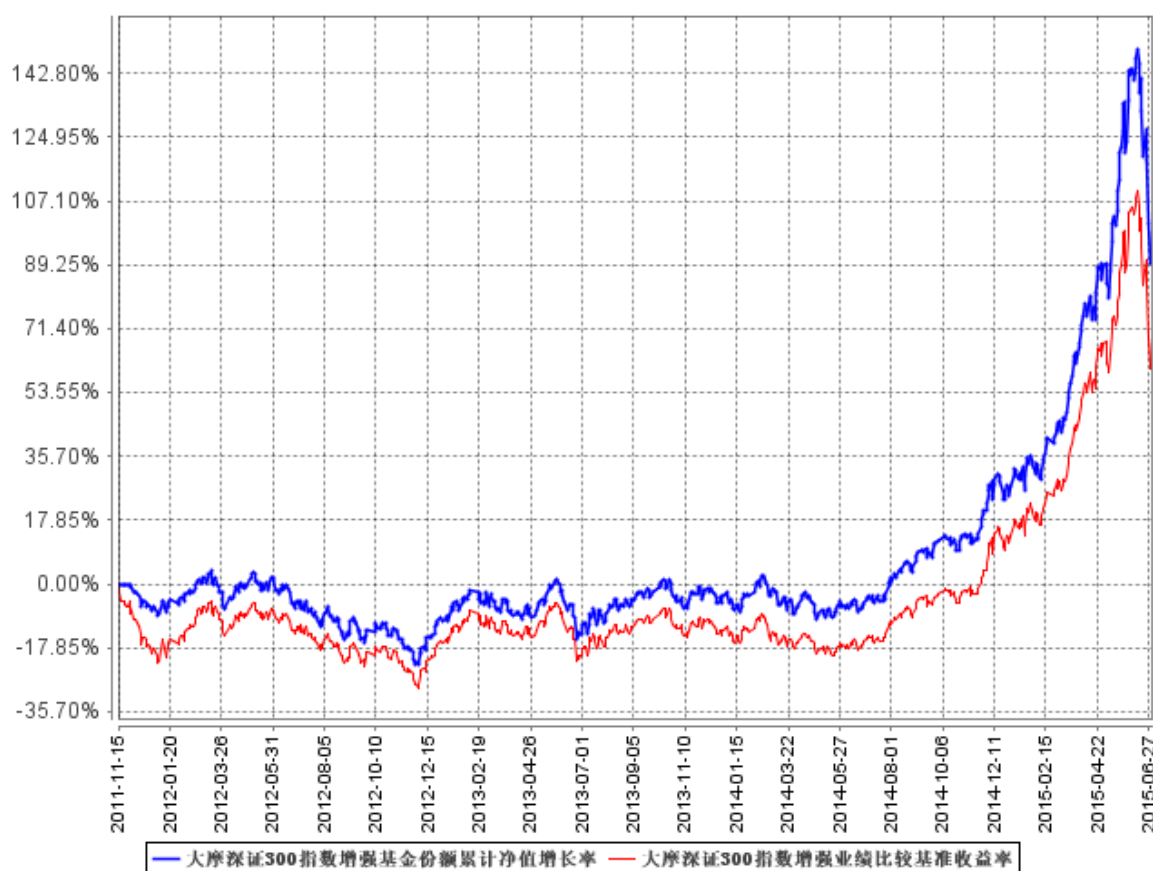
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	-11.30%	3.47%	-10.34%	3.46%	-0.96%	0.01%
过去三个月	18.79%	2.72%	15.44%	2.62%	3.35%	0.10%
过去六个月	56.18%	2.21%	49.43%	2.12%	6.75%	0.09%
过去一年	107.85%	1.73%	100.52%	1.67%	7.33%	0.06%
过去三年	110.05%	1.44%	94.10%	1.42%	15.95%	0.02%
自基金合同 生效起至今	98.50%	1.38%	69.41%	1.43%	29.09%	-0.05%

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



§ 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 2015 年 6 月 30 日，公司旗下共管理十九只开放式基金，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、摩根士丹利华鑫优质信价纯债债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫量化多策略股票型证券投资基金和摩根士丹利华鑫新机遇灵活配置混合型证券投资基金。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	-	7	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，2015 年 6 月起任摩根士丹利华鑫新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注：1、基金经理的任职日期均为根据本公司决定确定的聘任日期；

2、基金经理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 公平交易制度的执行情况

基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及内部相关制度和流程，通过流程和系统控制保证有效实现公平交易管理要求，并通过对投资交易行为的监控和分析，确保基金管理人旗下各投资组合在研究、决策、交易执行等各方面均得到公平对待。本报告期，基金管理人严格执行各项公平交易制度及流程。

经对报告期内公司管理所有投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异，连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况有 1 次，为量化投资基金之间因执行投资策略而发生的反向交易，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

本基金主要通过量化模型作为投资交易决策的依据：其中“指数跟踪模型”被用于跟踪指数，“日内择时交易模型”被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，本基金较好的跟踪了标的指数的波动，控制了跟踪误差，并取得一定程度的超额收益。此外，本基金通过以“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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期截至 2015 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.985 元，累计份额净值为 1.985 元，报告期内基金份额净值增长率为 56.18%，同期业绩比较基准收益率为 49.43%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年上半年国内经济增长缓中趋稳，在宽货币、稳增长政策环境下，房地产销售持续改善，消费增长有所企稳，但总体经济复苏并不稳固，需求局部回暖向生产面的传导效应并不顺畅，主要工业品生产增长依然较弱，经济下行压力依然存在。预计下半年稳增长压力的加大将推动宽松政策加码，伴随需求面改善向上游的传导，经济有望在 3、4 季度出现企稳。

上半年证券市场在各路入市资金一度推动下大幅上行，市场估值高企，投机气氛浓重，市场呈现出泡沫化特征，进入 6 月以来受 IPO 扩容、大小非疯狂减持、监管层查处场外配资等多重因素影响，股市开始出现回落，并引发场外配置等杠杆资金的被动平仓，市场快速崩塌。我们认为，经历此次市场的下跌和投资者风险教育，未来市场格局将出现新的变化，投资者风险偏好或将显著下降，股市在下阶段将进入逐渐降杠杆的过程，经历过去一段时期的风险释放和估值回落，后阶段 A 股或将进入宽幅震荡的局面。

基于经济的进一步企稳预期及估值差异，我们预计以金融、消费为代表的蓝筹股有望表现相对稳健，而新兴成长领域个股将在消化估值泡沫后显著分化，优质企业有望获得基本面的支撑，而前期纯题材炒作型个股预计仍将面临较大的估值回归。后阶段，在投资管理上，我们将在跟踪指数的基础上，适当精选个股。对于增强部分，我们将着眼于公司基本面研究，基于对企业的价值评估和判断进行择优配置。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

基金管理人对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。

4.7 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，本基金本报告期末未实施利润分配。

4.8 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 托管人对本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	5,267,497.17	7,701,896.94
结算备付金		319,349.97	-
存出保证金		40,525.26	16,618.49
交易性金融资产	6.4.7.2	65,493,324.81	79,017,907.25
其中：股票投资		65,493,324.81	79,017,907.25
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,286,738.66	757,306.32
应收利息	6.4.7.5	1,275.89	1,447.71
应收股利		-	-
应收申购款		958,468.87	740,837.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		73,367,180.63	88,236,013.71
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	1,720,307.91
应付赎回款		3,833,346.55	2,625,945.82
应付管理人报酬		70,805.54	69,658.18
应付托管费		10,620.83	10,448.73
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	218,029.76	87,263.22
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	204,448.36	126,268.26
负债合计		4,337,251.04	4,639,892.12
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	34,779,321.64	65,773,140.13

未分配利润	6.4.7.10	34,250,607.95	17,822,981.46
所有者权益合计		69,029,929.59	83,596,121.59
负债和所有者权益总计		73,367,180.63	88,236,013.71

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.985 元，基金份额总额 34,779,321.64 份。

6.2 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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		38,066,080.37	-225,580.36
1.利息收入		22,682.31	65,683.32
其中：存款利息收入	6.4.7.11	22,682.31	9,383.75
债券利息收入		-	51,767.51
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	4,532.06
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		32,278,338.51	2,055,504.31
其中：股票投资收益	6.4.7.12	32,028,584.73	1,372,936.53
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	2,348.30
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	249,753.78	680,219.48
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	5,653,628.81	-2,371,024.83
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	111,430.74	24,256.84
减：二、费用		1,395,012.50	1,069,018.90
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	407,738.61	444,241.96
2. 托管费	6.4.10.2.2	61,160.78	66,636.28
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	741,728.39	299,547.30
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	184,384.72	258,593.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		36,671,067.87	-1,294,599.26

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		36,671,067.87	-1,294,599.26

6.3 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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 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）	65,773,140.13	17,822,981.46	83,596,121.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	36,671,067.87	36,671,067.87
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）	-30,993,818.49	-20,243,441.38	-51,237,259.87
其中：1.基金申购款	36,905,332.45	28,254,629.48	65,159,961.93
2.基金赎回款	-67,899,150.94	-48,498,070.86	-116,397,221.80
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）	34,779,321.64	34,250,607.95	69,029,929.59
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 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）	-	-1,294,599.26	-1,294,599.26
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）	-18,286,339.65	105,731.44	-18,180,608.21
其中：1.基金申购款	4,059,779.27	-198,142.54	3,861,636.73
2.基金赎回款	-22,346,118.92	303,873.98	-22,042,244.94
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）	88,098,674.83	-3,963,770.63	84,134,904.20
-----------------	---------------	---------------	---------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>高潮生</u>	<u>张力</u>	<u>谢先斌</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

6.4 报表附注

6.4.1 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×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

6.4.2 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年上半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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

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、资产支持证券和私募债券除外), 鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息, 本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《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》所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	5,267,497.17
定期存款	-
其中:存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计:	5,267,497.17

6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	49,854,398.22	65,493,324.81	15,638,926.59
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	49,854,398.22	65,493,324.81	15,638,926.59

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,113.09
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	143.70
应收债券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	0.90
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	18.20
合计	1,275.89

注：“其他”为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	218,029.76
银行间市场应付交易费用	—
合计	218,029.76

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	12,914.71
其他	12,722.97
预提费用	128,810.68
指数使用费	50,000.00
合计	204,448.36

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	65,773,140.13	65,773,140.13
本期申购	36,905,332.45	36,905,332.45
本期赎回(以“-”号填列)	-67,899,150.94	-67,899,150.94
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	34,779,321.64	34,779,321.64

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 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	6,729,187.11	11,093,794.35	17,822,981.46
本期利润	31,017,439.06	5,653,628.81	36,671,067.87
本期基金份额交易产生的变动数	-9,983,882.04	-10,259,559.34	-20,243,441.38
其中：基金申购款	13,889,479.14	14,365,150.34	28,254,629.48
基金赎回款	-23,873,361.18	-24,624,709.68	-48,498,070.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	27,762,744.13	6,487,863.82	34,250,607.95

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	19,541.50
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	2,875.83
其他	264.98
合计	22,682.31

注：“其他”为申购款利息收入和结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	261,757,091.80
减：卖出股票成本总额	229,728,507.07
买卖股票差价收入	32,028,584.73

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	249,753.78

基金投资产生的股利收益	-
合计	249,753.78

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	5,653,628.81
——股票投资	5,653,628.81
——债券投资	-
——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	5,653,628.81

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	85,479.35
基金转出费收入	25,951.39
合计	111,430.74

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。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	741,728.39
银行间市场交易费用	-
合计	741,728.39

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	49,588.57
银行费用	874.04
债券帐户维护费	8,926.92
指数使用费	100,000.00
其他	200.00
合计	184,384.72

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。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 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。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系**6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 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	45,116,118.99	9.61%	18,020,590.36	9.49%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 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	41,073.77	9.61%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 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	16,405.95	9.49%	-	-

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日 至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日 至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	407,738.61	444,241.96
其中：支付销售机构的客户维护费	191,798.56	203,798.70

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日 至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日 至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	61,160.78	66,636.28

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。

6.4.10.3 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未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 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基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 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	5,267,497.17	19,541.50	2,014,467.86	7,828.23

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。

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 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。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300147	香雪制药	2015 年 6 月 11 日	2015 年 7 月 2 日	配股流通受限	10.46	30.80	1,230	12,865.80	37,884.00	-

6.4.12.2 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	复牌开盘价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002183	怡亚通	2015 年 6 月 1 日	重大事项	65.78	-	-	42,900	1,689,728.77	2,821,962.00	-
000778	新兴铸管	2015 年 6 月 15 日	重大事项	12.96	-	-	27,200	133,580.72	352,512.00	-
000917	电广传媒	2015 年 5 月 28 日	重大事项	42.89	-	-	8,100	143,229.67	347,409.00	-
000024	招商地产	2015 年 4 月 3 日	重大资产重组	31.64	-	-	9,000	192,033.79	284,760.00	-
000839	中信国安	2015 年 6 月 29 日	重大事项	23.57	-	-	10,800	93,638.92	254,556.00	-
002223	鱼跃医疗	2015 年 6 月 25 日	重大事项	67.20	2015 年 7 月 13 日	60.48	3,766	74,914.45	253,075.20	-
000878	云南铜业	2015 年 6 月 8 日	重大事项	24.50	-	-	10,020	156,692.75	245,490.00	-
000709	河北钢铁	2015 年 6 月 30 日	重大事项	7.00	-	-	33,300	95,428.34	233,100.00	-
000963	华东医药	2015 年 6 月 26 日	重大事项	71.48	2015 年 8 月 5 日	69.20	3,185	135,625.20	227,663.80	-
000539	粤电力 A	2015 年 6 月 8 日	重大事项	11.94	2015 年 7 月 21 日	10.75	18,840	110,049.05	224,949.60	-
000630	铜陵有色	2015 年 3 月 9 日	重大事项	8.44	-	-	26,600	222,227.67	224,504.00	-
002269	美邦服饰	2015 年 5 月 22 日	重大事项	11.86	2015 年 7 月 2 日	10.67	18,432	85,639.94	218,603.52	-

002368	太极股份	2015 年 5 月 14 日	重大资产重组	65.52	-	-	3,300	89,419.69	216,216.00	-
002292	奥飞动漫	2015 年 5 月 18 日	重大事项	37.85	-	-	5,704	60,781.97	215,896.40	-
000793	华闻传媒	2015 年 5 月 26 日	重大事项	20.75	-	-	10,300	97,982.40	213,725.00	-
002375	亚厦股份	2015 年 6 月 17 日	重大事项	29.21	2015 年 7 月 20 日	26.29	7,282	96,180.87	212,707.22	-
000887	中鼎股份	2015 年 6 月 30 日	重大资产重组	24.75	-	-	8,222	88,936.28	203,494.50	-
000748	长城信息	2015 年 6 月 18 日	重大事项	34.88	-	-	5,800	109,910.00	202,304.00	-
000786	北新建材	2015 年 4 月 10 日	重大资产重组	18.58	-	-	10,376	98,715.40	192,786.08	-
000566	海南海药	2015 年 6 月 18 日	重大事项	49.97	-	-	3,808	50,197.77	190,285.76	-
002353	杰瑞股份	2015 年 6 月 3 日	重大事项	44.35	-	-	4,127	134,283.61	183,032.45	-
000592	平潭发展	2015 年 6 月 30 日	重大事项	29.76	2015 年 7 月 14 日	30.00	6,096	62,879.91	181,416.96	-
002191	劲嘉股份	2015 年 6 月 18 日	重大事项	19.22	-	-	9,218	78,347.89	177,169.96	-
002308	威创股份	2015 年 6 月 12 日	重大事项	31.00	-	-	5,700	50,797.99	176,700.00	-
002416	爱施德	2015 年 5 月 5 日	重大事项	20.67	2015 年 7 月 29 日	18.60	8,476	111,713.36	175,198.92	-
300212	易华录	2015 年 6 月 30 日	重大事项	59.94	2015 年 7 月 13 日	54.00	2,800	89,822.29	167,832.00	-
002203	海亮股份	2015 年 4 月 27 日	重大资产重组	12.71	-	-	13,000	98,771.72	165,230.00	-
002310	东方园林	2015 年 5 月 27 日	重大资产重组	38.30	-	-	4,300	84,847.71	164,690.00	-
000543	皖能电力	2015 年 6 月 15 日	重大事项	21.36	2015 年 7 月 14 日	19.22	7,700	127,796.07	164,472.00	-
000996	中国中期	2014 年 12 月 8 日	重大资产重组	46.43	-	-	3,381	56,724.55	156,979.83	-
002414	高德红外	2015 年 5 月 13 日	重大事项	39.36	-	-	3,700	77,714.18	145,632.00	-
002577	雷柏科技	2015 年 6 月 10 日	重大事项	80.60	-	-	1,800	50,643.55	145,080.00	-
000979	中弘股份	2015 年 5 月 25 日	重大资产重组	6.04	-	-	22,720	58,632.78	137,228.80	-
002001	新 和 成	2015 年 6 月	重大事项	17.09	2015 年 7	18.49	7,620	109,727.53	130,225.80	-

		30 日			月 13 日					
002242	九阳股份	2015 年 6 月 15 日	重大事项	19.45	2015 年 7 月 7 日	17.51	5,718	56,124.48	111,215.10	-
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	-
001696	宗申动力	2015 年 6 月 30 日	重大事项	17.25	-	-	6,195	45,389.69	106,863.75	-
002106	莱宝高科	2015 年 4 月 7 日	重大资产重组	16.42	-	-	6,219	84,683.81	102,115.98	-
300228	富瑞特装	2015 年 6 月 24 日	重大事项	90.91	2015 年 7 月 30 日	81.82	1,100	73,215.83	100,001.00	-
002091	江苏国泰	2015 年 6 月 1 日	重大资产重组	26.22	-	-	2,899	37,649.75	76,011.78	-
000697	炼石有色	2015 年 5 月 18 日	重大资产重组	33.83	-	-	2,200	40,172.00	74,426.00	-
002069	獐子岛	2015 年 6 月 1 日	重大事项	19.76	-	-	3,280	72,365.49	64,812.80	-
300074	华平股份	2015 年 6 月 29 日	重大事项	15.39	2015 年 7 月 14 日	16.00	3,320	31,908.74	51,094.80	-
000693	华泽钴镍	2015 年 6 月 30 日	重大事项	20.57	2015 年 8 月 18 日	22.63	900	22,171.00	18,513.00	-
000650	仁和药业	2015 年 6 月 12 日	重大事项	17.17	-	-	40	229.53	686.80	-

注：本基金截至 2015 年 6 月 30 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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同责任，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 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资 (2014 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 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%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注 6.4.12 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 2015 年 6 月 30 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(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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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、结算备付金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
------------------------	-------	-------	-------	-----	----

资产					
银行存款	5,267,497.17	-	-	-	5,267,497.17
结算备付金	319,349.97	-	-	-	319,349.97
存出保证金	40,525.26	-	-	-	40,525.26
交易性金融资产	-	-	-	65,493,324.81	65,493,324.81
应收证券清算款	-	-	-	1,286,738.66	1,286,738.66
应收利息	-	-	-	1,275.89	1,275.89
应收申购款	-	-	-	958,468.87	958,468.87
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	5,627,372.40	-	-	67,739,808.23	73,367,180.63
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,833,346.55	3,833,346.55
应付管理人报酬	-	-	-	70,805.54	70,805.54
应付托管费	-	-	-	10,620.83	10,620.83
应付交易费用	-	-	-	218,029.76	218,029.76
其他负债	-	-	-	204,448.36	204,448.36
负债总计	-	-	-	4,337,251.04	4,337,251.04
利率敏感度缺口	5,627,372.40	-	-	63,402,557.19	69,029,929.59
上年度末 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

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资(2014 年 12 月 31 日：同)。因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2014 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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%；基金持有权证的市场价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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 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	65,493,324.81	94.88	79,017,907.25	94.52
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-

交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	65,493,324.81	94.88	79,017,907.25	94.52

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 6.4.1)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(2015年6月30日)	上年度末(2014年12月31日)
	业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%	3,260,000.00	4,130,000.00
	业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-3,260,000.00	-4,130,000.00

6.4.14 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 2015 年 6 月 30 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 55,072,550.52 元，属于第二层次的余额为 10,420,774.29 元，无属于第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第一层次 74,933,362.22 元，第二层次 4,084,545.03 元，无第三层次)。于 2015 年 6 月 30 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负债均属于第一层次(2014 年 12 月 31 日：同)。

(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，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,确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。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、资产支持证券和私募债券除外),本基金于 2015 年 3 月 25 日起改为采用中证指数有限公司根据《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》所独立提供的估值结果确定公允价值(附注 6.4.5),并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	65,493,324.81	89.27
	其中:股票	65,493,324.81	89.27
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	5,586,847.14	7.61
7	其他各项资产	2,287,008.68	3.12
8	合计	73,367,180.63	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	684,573.34	0.99
B	采矿业	1,021,271.88	1.48
C	制造业	32,731,757.27	47.42
D	电力、热力、燃气及水生产和	1,097,410.31	1.59

	供应业		
E	建筑业	951, 140. 59	1. 38
F	批发和零售业	1, 777, 426. 38	2. 57
G	交通运输、仓储和邮政业	69, 398. 16	0. 10
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5, 698, 862. 65	8. 26
J	金融业	3, 443, 484. 19	4. 99
K	房地产业	2, 792, 971. 84	4. 05
L	租赁和商务服务业	3, 966, 601. 15	5. 75
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, 000, 015. 92	1. 45
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	105, 135. 34	0. 15
R	文化、体育和娱乐业	845, 831. 80	1. 23
S	综合	252, 087. 36	0. 37
	合计	56, 437, 968. 18	81. 76

7.2.2 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（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	3, 712, 186. 80	5. 38
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	167, 599. 83	0. 24
G	交通运输、仓储和邮政业	1, 128, 000. 00	1. 63
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2, 192, 980. 00	3. 18
J	金融业	-	-
K	房地产业	1, 834, 300. 00	2. 66
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	20, 290. 00	0. 03
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	9,055,356.63	13.12

7.3 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

7.3.1 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	002183	怡亚通	42,900	2,821,962.00	4.09
2	000800	一汽轿车	87,206	2,169,685.28	3.14
3	000550	江铃汽车	51,719	1,898,087.30	2.75
4	000651	格力电器	22,140	1,414,746.00	2.05
5	000002	万科A	81,002	1,176,149.04	1.70
6	002304	洋河股份	13,420	930,811.20	1.35
7	300059	东方财富	12,900	813,861.00	1.18
8	000333	美的集团	20,132	750,520.96	1.09
9	000001	平安银行	47,311	687,901.94	1.00
10	002415	海康威视	13,303	595,974.40	0.86
11	000063	中兴通讯	24,016	571,820.96	0.83
12	000776	广发证券	24,600	557,190.00	0.81
13	300104	乐视网	10,444	540,581.44	0.78
14	300024	机器人	6,485	501,031.10	0.73
15	002024	苏宁云商	32,400	495,720.00	0.72
16	000100	TCL 集团	85,064	480,611.60	0.70
17	002450	康得新	15,674	479,624.40	0.69
18	000858	五粮液	14,140	448,238.00	0.65
19	000768	中航飞机	10,100	440,158.00	0.64
20	000503	海虹控股	8,502	416,598.00	0.60
21	002230	科大讯飞	11,918	416,414.92	0.60
22	002594	比亚迪	7,437	410,745.51	0.60
23	000725	京东方A	77,500	402,225.00	0.58
24	000783	长江证券	28,174	393,027.30	0.57
25	000062	深圳华强	6,400	365,248.00	0.53
26	002202	金风科技	18,300	356,301.00	0.52
27	000778	新兴铸管	27,200	352,512.00	0.51
28	000917	电广传媒	8,100	347,409.00	0.50

29	002081	金 螳 螂	12,159	342,762.21	0.50
30	000157	中联重科	42,200	342,242.00	0.50
31	002405	四维图新	7,755	339,669.00	0.49
32	000338	潍柴动力	10,700	338,762.00	0.49
33	300027	华谊兄弟	8,720	332,580.80	0.48
34	000728	国元证券	8,600	326,628.00	0.47
35	002065	东华软件	11,210	322,287.50	0.47
36	000069	华侨城 A	24,700	320,606.00	0.46
37	300070	碧水源	6,373	310,938.67	0.45
38	000423	东阿阿胶	5,510	300,295.00	0.44
39	002465	海格通信	9,300	299,367.00	0.43
40	000166	申万宏源	18,319	297,683.75	0.43
41	000538	云南白药	3,404	293,663.08	0.43
42	002241	歌尔声学	8,149	292,549.10	0.42
43	000024	招商地产	9,000	284,760.00	0.41
44	000623	吉林敖东	8,200	275,520.00	0.40
45	002673	西部证券	9,300	263,841.00	0.38
46	000060	中金岭南	14,008	260,408.72	0.38
47	000839	中信国安	10,800	254,556.00	0.37
48	002223	鱼跃医疗	3,766	253,075.20	0.37
49	000009	中国宝安	15,456	252,087.36	0.37
50	000878	云南铜业	10,020	245,490.00	0.36
51	000826	桑德环境	6,105	237,423.45	0.34
52	002129	中环股份	11,951	236,510.29	0.34
53	000883	湖北能源	26,900	234,568.00	0.34
54	300124	汇川技术	4,863	233,424.00	0.34
55	002500	山西证券	12,900	233,361.00	0.34
56	000709	河北钢铁	33,300	233,100.00	0.34
57	000895	双汇发展	10,750	229,297.50	0.33
58	002142	宁波银行	10,800	228,420.00	0.33
59	000963	华东医药	3,185	227,663.80	0.33
60	000539	粤电力 A	18,840	224,949.60	0.33
61	000559	万向钱潮	10,282	224,764.52	0.33
62	000630	铜陵有色	26,600	224,504.00	0.33
63	002269	美邦服饰	18,432	218,603.52	0.32
64	002312	三泰控股	5,785	216,706.10	0.31
65	002368	太极股份	3,300	216,216.00	0.31
66	002292	奥飞动漫	5,704	215,896.40	0.31
67	002030	达安基因	4,859	215,253.70	0.31

68	002152	广电运通	6,653	215,158.02	0.31
69	000750	国海证券	12,794	214,939.20	0.31
70	000793	华闻传媒	10,300	213,725.00	0.31
71	000540	中天城投	16,950	213,570.00	0.31
72	000402	金融街	15,100	213,363.00	0.31
73	002375	亚厦股份	7,282	212,707.22	0.31
74	000876	新希望	10,704	207,764.64	0.30
75	000977	浪潮信息	6,896	203,776.80	0.30
76	000887	中鼎股份	8,222	203,494.50	0.29
77	000748	长城信息	5,800	202,304.00	0.29
78	300003	乐普医疗	4,940	200,415.80	0.29
79	000039	中集集团	6,200	200,260.00	0.29
80	002008	大族激光	6,768	194,376.96	0.28
81	002153	石基信息	1,491	193,815.09	0.28
82	000786	北新建材	10,376	192,786.08	0.28
83	000425	徐工机械	14,400	191,088.00	0.28
84	000046	泛海控股	13,000	190,450.00	0.28
85	000566	海南海药	3,808	190,285.76	0.28
86	000061	农产品	9,280	189,312.00	0.27
87	002007	华兰生物	4,243	187,922.47	0.27
88	002353	杰瑞股份	4,127	183,032.45	0.27
89	000997	新大陆	6,868	182,688.80	0.26
90	000792	盐湖股份	6,400	181,632.00	0.26
91	300017	网宿科技	3,912	181,595.04	0.26
92	000592	平潭发展	6,096	181,416.96	0.26
93	000686	东北证券	9,100	177,177.00	0.26
94	002191	劲嘉股份	9,218	177,169.96	0.26
95	002416	爱施德	8,476	175,198.92	0.25
96	002456	欧菲光	5,132	173,153.68	0.25
97	000738	中航动控	5,200	172,432.00	0.25
98	002038	双鹭药业	3,031	171,706.15	0.25
99	300212	易华录	2,800	167,832.00	0.24
100	000629	攀钢钒钛	31,179	167,119.44	0.24
101	002252	上海莱士	2,526	165,301.44	0.24
102	002203	海亮股份	13,000	165,230.00	0.24
103	000661	长春高新	1,269	164,970.00	0.24
104	300315	掌趣科技	12,170	164,903.50	0.24
105	002310	东方园林	4,300	164,690.00	0.24
106	000543	皖能电力	7,700	164,472.00	0.24

107	000998	隆平高科	5,950	161,245.00	0.23
108	000718	苏宁环球	11,000	158,730.00	0.23
109	300253	卫宁软件	3,050	158,600.00	0.23
110	000625	长安汽车	7,382	156,129.30	0.23
111	002385	大北农	11,449	154,790.48	0.22
112	300058	蓝色光标	9,715	153,594.15	0.22
113	000825	太钢不锈	21,600	153,576.00	0.22
114	000960	锡业股份	7,600	153,140.00	0.22
115	000568	泸州老窖	4,657	151,864.77	0.22
116	002400	省广股份	5,950	150,297.00	0.22
117	002236	大华股份	4,694	149,832.48	0.22
118	000581	威孚高科	4,802	148,813.98	0.22
119	000970	中科三环	7,188	148,144.68	0.21
120	002414	高德红外	3,700	145,632.00	0.21
121	002475	立讯精密	4,300	145,383.00	0.21
122	002577	雷柏科技	1,800	145,080.00	0.21
123	000901	航天科技	2,163	142,217.25	0.21
124	300072	三聚环保	4,190	141,203.00	0.20
125	002570	贝因美	7,190	139,557.90	0.20
126	000979	中弘股份	22,720	137,228.80	0.20
127	000012	南玻A	10,200	136,068.00	0.20
128	000729	燕京啤酒	12,900	134,160.00	0.19
129	000690	宝新能源	10,529	133,191.85	0.19
130	000983	西山煤电	13,895	131,724.60	0.19
131	000078	海王生物	5,957	131,054.00	0.19
132	002573	清新环境	6,340	131,047.80	0.19
133	002001	新和成	7,620	130,225.80	0.19
134	300133	华策影视	4,800	129,600.00	0.19
135	300002	神州泰岳	8,462	128,960.88	0.19
136	000831	五矿稀土	5,000	127,900.00	0.19
137	000999	华润三九	4,186	127,212.54	0.18
138	300251	光线传媒	5,100	126,990.00	0.18
139	000415	渤海租赁	13,400	126,764.00	0.18
140	300079	数码视讯	4,558	126,666.82	0.18
141	002261	拓维信息	2,600	126,282.00	0.18
142	002022	科华生物	2,958	126,188.28	0.18
143	000027	深圳能源	10,200	125,970.00	0.18
144	002470	金正大	5,800	125,918.00	0.18
145	300147	香雪制药	4,030	124,124.00	0.18

146	002410	广联达	5,300	124,020.00	0.18
147	000006	深振业 A	8,900	120,773.00	0.17
148	002146	荣盛发展	9,600	120,000.00	0.17
149	002219	恒康医疗	2,695	119,819.70	0.17
150	002004	华邦颖泰	9,185	119,221.30	0.17
151	000758	中色股份	6,000	117,780.00	0.17
152	000988	华工科技	6,612	117,759.72	0.17
153	002190	成飞集成	2,291	116,818.09	0.17
154	002161	远望谷	5,337	116,133.12	0.17
155	000598	兴蓉环境	11,982	114,667.74	0.17
156	002344	海宁皮城	5,800	113,854.00	0.16
157	002701	奥瑞金	4,300	111,929.00	0.16
158	300273	和佳股份	3,752	111,772.08	0.16
159	002242	九阳股份	5,718	111,215.10	0.16
160	000400	许继电气	4,380	110,200.80	0.16
161	000516	国际医学	5,100	110,109.00	0.16
162	002311	海大集团	7,914	109,134.06	0.16
163	000652	泰达股份	10,638	108,294.84	0.16
164	000982	中银绒业	23,307	108,144.48	0.16
165	300274	阳光电源	3,500	106,995.00	0.15
166	001696	宗申动力	6,195	106,863.75	0.15
167	002073	软控股份	4,606	106,398.60	0.15
168	002424	贵州百灵	1,700	106,352.00	0.15
169	002104	恒宝股份	4,482	106,178.58	0.15
170	000021	深科技	6,941	105,850.25	0.15
171	300146	汤臣倍健	2,692	105,741.76	0.15
172	300226	上海钢联	1,300	105,300.00	0.15
173	300015	爱尔眼科	3,259	105,135.34	0.15
174	300202	聚龙股份	2,600	105,040.00	0.15
175	002179	中航光电	3,180	104,940.00	0.15
176	000413	东旭光电	10,700	104,646.00	0.15
177	002340	格林美	6,851	104,203.71	0.15
178	300115	长盈精密	3,100	103,261.00	0.15
179	000028	国药一致	1,375	102,451.25	0.15
180	002095	生意宝	1,600	102,224.00	0.15
181	002050	三花股份	8,894	102,192.06	0.15
182	002106	莱宝高科	6,219	102,115.98	0.15
183	300077	国民技术	2,371	100,862.34	0.15
184	002467	二六三	5,151	100,186.95	0.15

185	300228	富瑞特装	1,100	100,001.00	0.14
186	000829	天音控股	6,727	99,895.95	0.14
187	002266	浙富控股	7,300	99,864.00	0.14
188	002294	信立泰	3,485	99,671.00	0.14
189	000685	中山公用	3,384	99,591.12	0.14
190	000777	中核科技	3,000	98,550.00	0.14
191	002051	中工国际	3,300	98,274.00	0.14
192	300134	大富科技	3,511	98,132.45	0.14
193	000939	凯迪电力	6,624	97,041.60	0.14
194	300257	开山股份	4,000	96,800.00	0.14
195	300088	长信科技	3,500	96,250.00	0.14
196	000511	烯碳新材	7,771	95,194.75	0.14
197	002029	七匹狼	4,507	94,647.00	0.14
198	002005	德豪润达	8,237	94,560.76	0.14
199	300026	红日药业	4,200	94,248.00	0.14
200	000848	承德露露	5,150	93,730.00	0.14
201	002185	华天科技	5,200	93,704.00	0.14
202	000528	柳 工	7,800	92,196.00	0.13
203	000587	金叶珠宝	3,971	91,849.23	0.13
204	000969	安泰科技	6,345	91,241.10	0.13
205	002049	同方国芯	1,900	91,200.00	0.13
206	000031	中粮地产	4,800	90,672.00	0.13
207	002063	远光软件	2,899	90,651.73	0.13
208	000898	鞍钢股份	12,400	90,520.00	0.13
209	000050	深天马 A	3,826	89,796.22	0.13
210	002250	联化科技	4,000	89,600.00	0.13
211	002273	水晶光电	2,800	87,500.00	0.13
212	000671	阳 光 城	4,200	87,276.00	0.13
213	002428	云南锗业	3,700	86,987.00	0.13
214	000933	神火股份	9,100	85,722.00	0.12
215	002092	中泰化学	8,390	85,494.10	0.12
216	002011	盾安环境	5,900	85,491.00	0.12
217	002603	以岭药业	4,200	84,672.00	0.12
218	002064	华峰氨纶	9,310	84,441.70	0.12
219	002399	海普瑞	2,472	84,023.28	0.12
220	000612	焦作万方	7,571	82,675.32	0.12
221	002155	湖南黄金	6,624	82,336.32	0.12
222	000572	海马汽车	9,597	80,518.83	0.12
223	000816	智慧农业	7,663	79,235.42	0.11

224	000049	德赛电池	1,657	79,038.90	0.11
225	002396	星网锐捷	2,458	78,901.80	0.11
226	000541	佛山照明	6,810	78,110.70	0.11
227	002429	兆驰股份	6,050	78,045.00	0.11
228	000513	丽珠集团	1,137	77,122.71	0.11
229	002041	登海种业	4,340	76,774.60	0.11
230	300005	探路者	2,800	76,720.00	0.11
231	002440	闰土股份	3,200	76,704.00	0.11
232	002091	江苏国泰	2,899	76,011.78	0.11
233	000975	银泰资源	4,408	75,949.84	0.11
234	000961	中南建设	3,800	75,886.00	0.11
235	300039	上海凯宝	4,860	75,573.00	0.11
236	002168	深圳惠程	4,859	75,411.68	0.11
237	002176	江特电机	2,691	75,132.72	0.11
238	000807	云铝股份	9,107	74,859.54	0.11
239	000697	炼石有色	2,200	74,426.00	0.11
240	002025	航天电器	2,831	74,172.20	0.11
241	002477	雏鹰农牧	3,827	73,478.40	0.11
242	002138	顺络电子	4,800	73,200.00	0.11
243	000877	天山股份	6,200	72,664.00	0.11
244	002277	友阿股份	4,174	71,625.84	0.10
245	002408	齐翔腾达	4,153	71,182.42	0.10
246	300090	盛运环保	3,200	71,104.00	0.10
247	000401	冀东水泥	5,300	69,695.00	0.10
248	000937	冀中能源	8,690	69,693.80	0.10
249	002299	圣农发展	3,426	69,547.80	0.10
250	000088	盐田港	4,901	69,398.16	0.10
251	002048	宁波华翔	3,338	69,397.02	0.10
252	002056	横店东磁	2,187	68,409.36	0.10
253	002237	恒邦股份	5,600	67,032.00	0.10
254	002151	北斗星通	1,300	66,105.00	0.10
255	002556	辉隆股份	3,300	66,033.00	0.10
256	000762	西藏矿业	3,454	65,626.00	0.10
257	000851	高鸿股份	3,800	65,398.00	0.09
258	002069	獐子岛	3,280	64,812.80	0.09
259	300014	亿纬锂能	2,400	63,600.00	0.09
260	000938	紫光股份	700	63,343.00	0.09
261	000563	陕国投 A	4,500	63,315.00	0.09
262	002028	思源电气	3,434	63,185.60	0.09

263	002317	众生药业	2,229	62,835.51	0.09
264	002262	恩华药业	1,905	61,607.70	0.09
265	300052	中青宝	1,900	60,610.00	0.09
266	000860	顺鑫农业	2,586	59,245.26	0.09
267	002474	榕基软件	3,000	58,290.00	0.08
268	000735	罗牛山	6,102	57,297.78	0.08
269	000869	张裕A	1,173	57,230.67	0.08
270	002431	棕榈园林	1,958	56,821.16	0.08
271	002052	同洲电子	4,000	55,560.00	0.08
272	000422	湖北宜化	5,980	55,195.40	0.08
273	002204	大连重工	4,000	53,440.00	0.08
274	002079	苏州固锟	4,787	52,130.43	0.08
275	300074	华平股份	3,320	51,094.80	0.07
276	002167	东方锆业	4,038	48,415.62	0.07
277	000554	泰山石油	2,600	47,970.00	0.07
278	300157	恒泰艾普	3,200	47,328.00	0.07
279	000525	红太阳	2,100	46,977.00	0.07
280	002181	粤传媒	3,100	45,570.00	0.07
281	002128	露天煤业	2,661	43,853.28	0.06
282	000823	超声电子	3,221	43,354.66	0.06
283	000156	华数传媒	1,200	42,936.00	0.06
284	002229	鸿博股份	1,700	40,596.00	0.06
285	002653	海思科	1,500	40,500.00	0.06
286	002313	日海通讯	2,100	40,236.00	0.06
287	002681	奋达科技	1,440	39,542.40	0.06
288	000596	古井贡酒	800	37,344.00	0.05
289	002148	北纬通信	1,500	34,215.00	0.05
290	300191	潜能恒信	1,200	29,880.00	0.04
291	002476	宝莫股份	1,850	25,918.50	0.04
292	000693	华泽钴镍	900	18,513.00	0.03

7.3.2 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	600476	湘邮科技	58,000	2,192,980.00	3.18
2	300329	海伦钢琴	60,000	2,100,000.00	3.04
3	000926	福星股份	130,000	1,834,300.00	2.66

4	000089	深圳机场	100,000	1,128,000.00	1.63
5	002215	诺普信	60,000	1,035,000.00	1.50
6	300314	戴维医疗	10,000	399,800.00	0.58
7	002308	威创股份	5,700	176,700.00	0.26
8	000996	中国中期	3,381	156,979.83	0.23
9	002776	柏堡龙	500	20,290.00	0.03
10	002462	嘉事堂	200	10,620.00	0.02
11	000650	仁和药业	40	686.80	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	000776	广发证券	7,437,278.00	8.90
2	300329	海伦钢琴	7,106,208.99	8.50
3	002230	科大讯飞	6,055,553.74	7.24
4	002183	怡亚通	5,706,959.85	6.83
5	000550	江铃汽车	5,576,876.12	6.67
6	000783	长江证券	5,200,801.00	6.22
7	002038	双鹭药业	5,027,020.65	6.01
8	002594	比亚迪	4,177,924.30	5.00
9	601166	兴业银行	3,715,500.00	4.44
10	002381	双箭股份	3,691,156.40	4.42
11	002304	洋河股份	3,657,714.20	4.38
12	000001	平安银行	3,655,850.82	4.37
13	600476	湘邮科技	3,625,763.70	4.34
14	000926	福星股份	3,568,886.80	4.27
15	600340	华夏幸福	3,380,492.03	4.04
16	000625	长安汽车	3,146,000.00	3.76
17	603898	好莱客	3,112,522.00	3.72
18	300399	京天利	2,946,521.00	3.52
19	000002	万科A	2,835,708.00	3.39
20	300166	东方国信	2,757,242.18	3.30
21	601288	农业银行	2,695,000.00	3.22
22	300165	天瑞仪器	2,689,662.00	3.22

23	300225	金力泰	2,428,854.00	2.91
24	300033	同花顺	2,404,871.00	2.88
25	600780	通宝能源	2,390,954.00	2.86
26	000417	合肥百货	2,386,038.00	2.85
27	000089	深圳机场	2,296,240.00	2.75
28	002065	东华软件	2,275,089.00	2.72
29	000961	中南建设	2,232,101.88	2.67
30	002155	湖南黄金	2,227,483.25	2.66
31	000800	一汽轿车	2,208,868.00	2.64
32	300343	联创节能	2,199,256.00	2.63
33	002538	司尔特	2,153,730.00	2.58
34	002215	诺普信	2,127,437.31	2.54
35	000503	海虹控股	2,026,257.00	2.42
36	002593	日上集团	1,988,636.00	2.38
37	002657	中科金财	1,956,235.00	2.34
38	002462	嘉事堂	1,892,644.20	2.26
39	000062	深圳华强	1,868,308.00	2.23
40	002191	劲嘉股份	1,867,798.90	2.23
41	600697	欧亚集团	1,821,002.00	2.18
42	002450	康得新	1,774,277.08	2.12
43	600739	辽宁成大	1,735,153.00	2.08
44	600150	中国船舶	1,728,966.00	2.07

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。

7.4.2 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	000776	广发证券	8,370,500.00	10.01
2	002230	科大讯飞	6,421,225.43	7.68
3	300329	海伦钢琴	6,255,308.73	7.48
4	002183	怡亚通	5,815,515.10	6.96
5	002038	双鹭药业	5,410,123.60	6.47
6	000783	长江证券	5,360,643.42	6.41
7	000001	平安银行	4,513,024.07	5.40
8	002594	比亚迪	4,430,690.50	5.30
9	600340	华夏幸福	4,186,605.00	5.01

10	000002	万 科 A	4,079,906.57	4.88
11	601166	兴业银行	4,079,200.00	4.88
12	000625	长安汽车	3,906,544.59	4.67
13	300165	天瑞仪器	3,855,206.52	4.61
14	603898	好莱客	3,708,640.19	4.44
15	002381	双箭股份	3,702,214.89	4.43
16	000550	江铃汽车	3,539,480.34	4.23
17	300166	东方国信	3,479,511.82	4.16
18	300399	京天利	3,306,800.00	3.96
19	002304	洋河股份	3,257,728.14	3.90
20	601288	农业银行	2,765,000.00	3.31
21	300225	金力泰	2,718,108.16	3.25
22	000961	中南建设	2,685,014.75	3.21
23	600476	湘邮科技	2,676,965.00	3.20
24	002065	东华软件	2,654,783.00	3.18
25	000858	五 粮 液	2,637,461.00	3.16
26	000417	合肥百货	2,611,091.00	3.12
27	002593	日上集团	2,598,934.87	3.11
28	002462	嘉事堂	2,375,735.00	2.84
29	300033	同花顺	2,328,537.00	2.79
30	002155	湖南黄金	2,309,616.30	2.76
31	600780	通宝能源	2,300,533.00	2.75
32	300343	联创节能	2,232,895.00	2.67
33	002191	劲嘉股份	2,193,176.98	2.62
34	002657	中科金财	2,078,283.00	2.49
35	002538	司尔特	2,050,235.94	2.45
36	002450	康得新	2,046,971.00	2.45
37	601318	中国平安	1,977,552.00	2.37
38	000503	海虹控股	1,879,319.00	2.25
39	600697	欧亚集团	1,853,050.00	2.22
40	000651	格力电器	1,848,204.00	2.21
41	002081	金 螳 螂	1,827,766.00	2.19
42	002023	海特高新	1,794,837.00	2.15
43	000062	深圳华强	1,746,268.00	2.09
44	002630	华西能源	1,730,030.00	2.07
45	600739	辽宁成大	1,724,103.00	2.06
46	000024	招商地产	1,713,832.00	2.05
47	002035	华帝股份	1,707,757.00	2.04

48	002467	二六三	1,707,263.00	2.04
49	000926	福星股份	1,696,954.00	2.03
50	000733	振华科技	1,683,536.00	2.01
51	000338	潍柴动力	1,672,154.16	2.00

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。

7.4.3 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	210,550,295.82
卖出股票收入（成交）总额	261,757,091.80

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。

7.5 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。

7.6 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。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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。

7.12.2

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。

7.12.3 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	40,525.26
2	应收证券清算款	1,286,738.66
3	应收股利	—
4	应收利息	1,275.89
5	应收申购款	958,468.87
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	2,287,008.68

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002183	怡亚通	2,821,962.00	4.09	重大事项

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息**8.1 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
2,379	14,619.30	247,529.75	0.71%	34,531,791.89	99.29%

8.2 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	-	-

8.3 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

§ 9 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	65,773,140.13
本报告期基金总申购份额	36,905,332.45
减:本报告期基金总赎回份额	67,899,150.94
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	34,779,321.64

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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：

本报告期内，中国证券监督管理委员会核准 Sheldon Gao（高潮生）先生担任本公司总经理职务，公司于 2015 年 4 月 16 日公告了上述事项。

本报告期内，徐卫先生不再担任基金管理人副总经理，公司于 2015 年 5 月 30 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未发生重大人事变动。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金未改变投资策略。

10.5 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。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
长江证券	2	79,954,910.57	17.02%	72,791.34	17.03%	-
中信建投	1	70,941,687.57	15.11%	64,585.51	15.11%	-
安信证券	2	61,753,010.25	13.15%	56,219.77	13.15%	-
中金公司	1	59,279,905.15	12.62%	53,968.80	12.62%	-
国泰君安	1	56,381,536.90	12.01%	51,329.85	12.01%	-
华鑫证券	2	45,116,118.99	9.61%	41,073.77	9.61%	-
华创证券	1	23,305,802.45	4.96%	21,217.66	4.96%	-
民生证券	1	18,080,311.12	3.85%	16,460.16	3.85%	-
中银国际	2	16,482,247.47	3.51%	15,005.60	3.51%	-
国金证券	1	16,162,614.00	3.44%	14,714.69	3.44%	-
方正证券	2	10,267,853.19	2.19%	9,347.92	2.19%	-
兴业证券	1	6,638,943.00	1.41%	6,044.03	1.41%	-
国信证券	1	5,268,250.00	1.12%	4,796.24	1.12%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	2	-	-	-	-	-

瑞银证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中信证券（山东）	2	-	-	-	-	-
中信证券（浙江）	2	-	-	-	-	-

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，本基金减少了东海证券的 1 个专用交易单元。

10.7.2 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
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

国金证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券（山东）	-	-	-	-	-	-
中信证券（浙江）	-	-	-	-	-	-

10.8 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	本公司关于旗下基金调整停牌股票“宏源证券”估值方法的公告	《上海证券报》	2015 年 1 月 5 日
2	本公司关于旗下部分基金参与中国工商银行 2015 年定投申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2015 年 1 月 15 日
3	本基金 2014 年 4 季度报告	《上海证券报》	2015 年 1 月 22 日
4	本公司关于旗下部分基金增加中国民生银行为销售机构公告	《上海证券报》	2015 年 2 月 9 日
5	本公司关于旗下基金调整停牌股票“华侨城 A”估值方法的公告	《上海证券报》	2015 年 2 月 10 日
6	本公司关于旗下基金参与杭州数米基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2015 年 3 月 3 日

7	本公司关于旗下基金调整停牌股票“大北农”估值方法的公告	《上海证券报》	2015 年 3 月 3 日
8	本公司关于旗下基金调整停牌股票“海伦钢琴”估值方法的公告	《上海证券报》	2015 年 3 月 23 日
9	本公司关于旗下部分基金在浦发银行开通定投业务的公告	《上海证券报》	2015 年 3 月 23 日
10	本基金 2014 年年度报告	《上海证券报》	2015 年 3 月 26 日
11	本公司关于旗下基金调整停牌股票“硕贝德”及“安利股份”估值方法的公告	《上海证券报》	2015 年 3 月 26 日
12	本公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	《上海证券报》	2015 年 3 月 26 日
13	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	《上海证券报》	2015 年 3 月 31 日
14	本公司关于高级管理人员变更的公告	《上海证券报》	2015 年 4 月 16 日
15	本基金 2015 年 1 季度报告	《上海证券报》	2015 年 4 月 21 日
16	本公司关于旗下基金调整停牌股票“华西能源”估值方法的公告	《上海证券报》	2015 年 4 月 23 日
17	本公司关于增加北京创金启富投资管理有限公司为销售机构的公告	《上海证券报》	2015 年 4 月 29 日
18	本公司高级管理人员变更公告	《上海证券报》	2015 年 5 月 30 日
19	本公司关于旗下部分基金参与中国农业银行网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2015 年 6 月 1 日
20	本公司关于旗下基金调整停牌股票“通策医疗”、“比亚迪”及“山河智能”估值方法的公告	《上海证券报》	2015 年 6 月 2 日
21	本公司关于旗下基金调整停牌股票“怡亚通”及“荃银高科”估值方法的公告	《上海证券报》	2015 年 6 月 9 日
22	本基金招募说明书（更新）（2015 年第 1 号）	《上海证券报》	2015 年 6 月 26 日
23	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	《上海证券报》	2015 年 6 月 30 日

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

§ 11 备查文件目录

11.1 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。

11.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

11.3 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 8 月 25 日