摩根士丹利华鑫深证300指数增强型证券投资基金2015年年度报告

2015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：2016年3月30日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计并出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2015 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 6
§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遵规守信情况的说明 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 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遵规守信情况声明 14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 14
§6 审计报告 14
6.1 审计报告基本信息 14
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 40
8.1 期末基金资产组合情况 40
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 40
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 42
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 50
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 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 57
§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 57
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 60
§12 备查文件目录 63
12.1 备查文件目录 63
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	32,219,866.91 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×95%+银行活期存款利率(税后)×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	tianqing1.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）	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
注册登记机构	摩根士丹利华鑫基金管理有限公司	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第二座 17 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	2015 年	2014 年	2013 年
本期已实现收益	26,714,288.39	8,280,235.38	7,076,526.17
本期利润	27,524,909.41	18,691,627.26	11,307,062.48
加权平均基金份额本期利润	0.6771	0.2333	0.0814
本期加权平均净值利润率	41.03%	23.07%	8.60%
本期基金份额净值增长率	36.43%	30.49%	7.74%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配利润	21,507,149.78	6,729,187.11	-3,326,844.95
期末可供分配基金份额利润	0.6675	0.1023	-0.0313
期末基金资产净值	55,869,760.74	83,596,121.59	103,610,111.67
期末基金份额净值	1.734	1.271	0.974
3.1.3 累计期末指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
基金份额累计净值增长率	73.40%	27.10%	-2.60%

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。

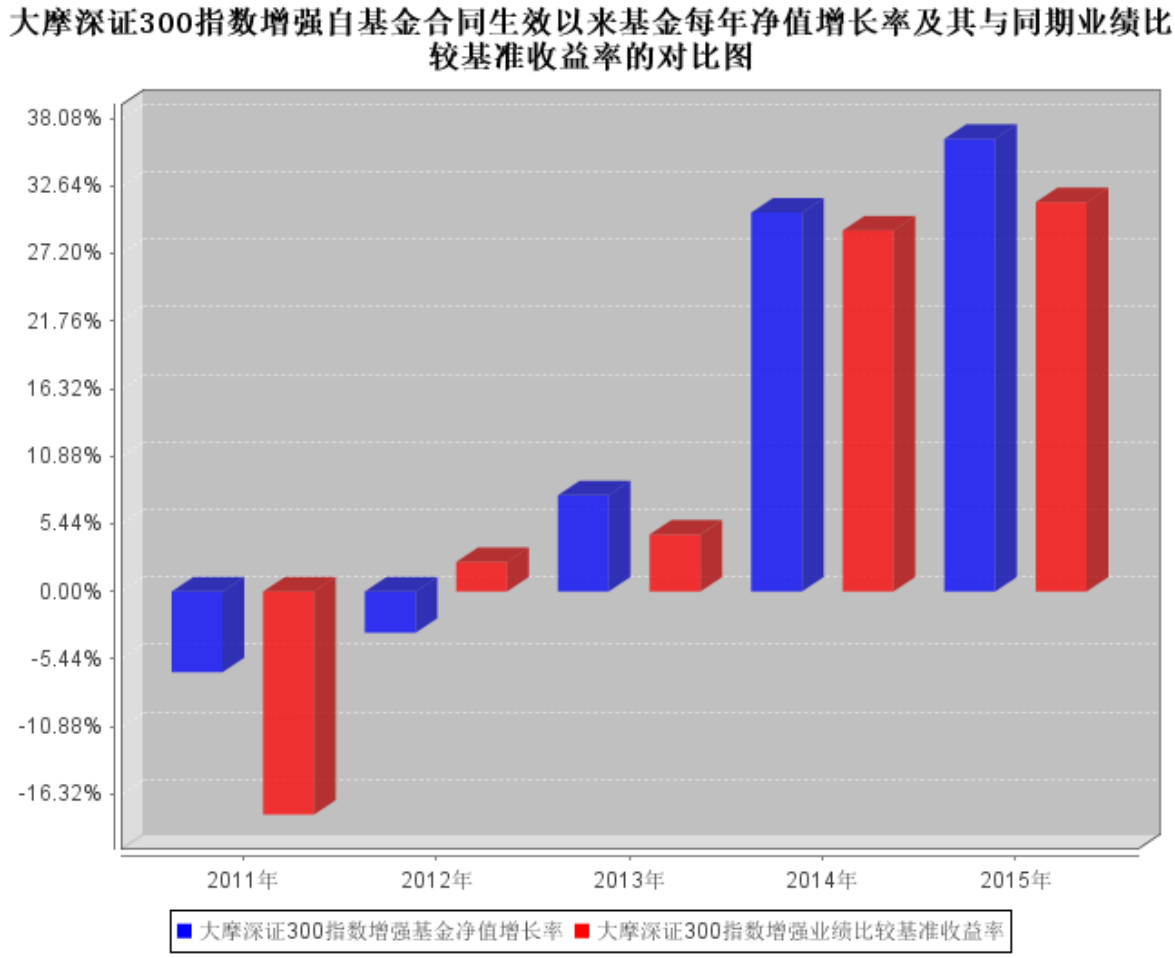
3.2 基金净值表现

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	28.64%	2.06%	24.09%	1.92%	4.55%	0.14%
过去六个月	-12.64%	3.39%	-12.11%	2.82%	-0.53%	0.57%
过去一年	36.43%	2.88%	31.33%	2.51%	5.10%	0.37%
过去三年	91.81%	1.94%	77.27%	1.76%	14.54%	0.18%
自基金合同生效起至今	73.40%	1.76%	48.90%	1.66%	24.50%	0.10%

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

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金基金合同于 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 2015 年 12 月 31 日，公司旗下共管理二十只开放式基金，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混合型证券投资基金、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混合型证券投资基金、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混合型证券投资基金、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混合型证券投资基金、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混合型证券投资基金、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、摩根士丹利华鑫新机遇灵活配置混合型证券投资基金和摩根士丹利华鑫多元收益 18 个月定期开放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	-	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，2015 年 11 月起担任摩根士丹利华鑫卓越成长混合型证券投资基金基金经理。

注：1、基金经理的任职日期为根据本公司决定确定的聘任日期；

2、基金经理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遵规守信情况的说明

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

4.3 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 5 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

本基金投资由两部分组成：一是“指数部分”被用于跟踪指数，该部分资产占基金资产比例不低于 80%；二是“增强个股部分”，该部分进行成份股增强以及以“自上而下”与“自下而上”相结合的方法精选个股；两部分股票组合合计占基金资产的比例为 90%-95%。报告期，“指数部

分”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，较好地跟踪了标的指数的波动，控制了跟踪误差；“个股增强部分”通过对市场的判断和精选个股，取得一定程度的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期截至 2015 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.734 元，累计份额净值为 1.734 元，报告期内基金份额净值增长率为 36.43%，同期业绩比较基准收益率为 31.33%。

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 2016 年，国内经济方面，尽管 2015 年房地产销售略有回暖但其传导效应极为有限，制造业 PMI 连续多月处于荣枯线下方，显示实体经济依然较为疲弱，产能过剩造成的通缩压力依旧，2015 年年末中央经济工作会议政策定调着力于供给端改革，产能出清过程对于经济运行产生的阵痛难免，预计 2016 年国内经济依然面临一定的增速下行压力。与此同时，得益于居民收入增长、产业结构的升级、政策对于创新的大力支持，中国经济也正经历着深刻的转型升级，结构性亮点仍将不断呈现。外围形势方面，全球经济复苏依然较弱和不平衡，美联储 2015 年 12 月正式重启加息操作，2016 年全球流动性依然将面临美元持续加息的考验，对全球经济的向好形成负面压制。在此背景下，预计人民币仍面临一定的贬值压力，全球的资金流动可能对全球金融市场稳定造成一定的冲击。

国内证券市场方面，客观来讲 2016 年的市场形势将大不如 2015 年：一是市场估值总体较 2015 年初要高出不少，诸多行业板块仍有较大的估值泡沫；二是 2016 年流动性环境前景和改善空间也不能与 2015 年持续宽松的货币环境相提并论；三是 2015 年股市异动以来，市场机制仍处恢复过程中，对二级市场股票供需仍将形成一定压力，降低收益预期是 2016 年应有的准备。从更长的时间跨度预期来看，中国如此大的经济体量，其转型过程之中也孕育着巨大的新市场，优秀企业家带领下的优秀企业也必将深受其益。我们坚信，对优秀企业股权的持续投资其预期收益在大类资产中将会是最佳的。

后阶段，我们将继续跟踪基准指数的同时，着眼于各产业的发展趋势并基于公司基本面研究，对企业进行价值评估后择优对基金进行增强配置，我们看好受益于产业转型、消费升级、技术品牌领先、管理水平先进的优势企业。

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，检查内控制度的执行情况、基金运作的合法合规情况，及时发现问题，提出改进建议并跟踪落实。

本报告期，基金管理人完成的主要监察稽核工作如下：

（1）完成专项检查工作。检查范围覆盖投资研究交易、基金销售、特定客户资产管理业务、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，建立并完善公司旗下投资组合流动性风险管理机制，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。

2016 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。

4.8 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

本报告期内，本基金自 8 月 24 日起存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。基金管理人已按相关法规规定将上述事项报告中国证监会。本报告期内，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(2016)第 21662 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 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 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”）、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，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、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了摩根士丹利华鑫深证 300 基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 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	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2016 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： 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	3,181,998.46	7,701,896.94
结算备付金		91,503.18	-
存出保证金		33,842.51	16,618.49
交易性金融资产	7.4.7.2	52,979,448.95	79,017,907.25
其中：股票投资		52,979,448.95	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	757,306.32
应收利息	7.4.7.5	797.79	1,447.71
应收股利		-	-
应收申购款		13,091.77	740,837.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		56,300,682.66	88,236,013.71
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2015 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
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		193,341.32	2,625,945.82

应付管理人报酬		47,071.58	69,658.18
应付托管费		7,060.75	10,448.73
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	75,509.11	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	7.4.7.8	107,939.16	126,268.26
负债合计		430,921.92	4,639,892.12
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	32,219,866.91	65,773,140.13
未分配利润	7.4.7.10	23,649,893.83	17,822,981.46
所有者权益合计		55,869,760.74	83,596,121.59
负债和所有者权益总计		56,300,682.66	88,236,013.71

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.734 元，基金份额总额 32,219,866.91 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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入		29,632,169.95	20,662,706.02
1.利息收入		37,902.14	122,993.83
其中：存款利息收入	7.4.7.11	37,902.14	21,591.40
债券利息收入		-	94,081.82
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	7,320.61
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		28,634,209.15	10,065,775.16
其中：股票投资收益	7.4.7.12	28,241,963.08	9,147,724.01
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-10,701.60
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	392,246.07	928,752.75
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	810,621.02	10,411,391.88
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	149,437.64	62,545.15
减：二、费用		2,107,260.54	1,971,078.76
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	670,186.44	811,623.10
2．托管费	7.4.10.2.2	100,527.97	121,743.49
3．销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4．交易费用	7.4.7.19	976,651.79	522,876.88
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	359,894.34	514,835.29
三、利润总额 （亏损总额以“-”号填列）		27,524,909.41	18,691,627.26
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		27,524,909.41	18,691,627.26

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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	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）	-	27,524,909.41	27,524,909.41
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）	-33,553,273.22	-21,697,997.04	-55,251,270.26
其中：1.基金申购款	55,703,746.28	40,335,139.28	96,038,885.56
2.基金赎回款	-89,257,019.50	-62,033,136.32	-151,290,155.82
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）	32,219,866.91	23,649,893.83	55,869,760.74
项目	**上年度可比期间 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

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：

高潮生	张力	谢先斌
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

摩根士丹利华鑫深证 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%。

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 2016 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(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《摩根士丹利华鑫深证 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、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2015 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中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券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。

（4）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)，按照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》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、 财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》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。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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25%计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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

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 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
活期存款	3,181,998.46	7,701,896.94
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	3,181,998.46	7,701,896.94

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2015 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		42,183,530.15	52,979,448.95	10,795,918.80
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		42,183,530.15	52,979,448.95	10,795,918.80

项目		上年度末 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

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	735.73	1,439.57
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	45.32	-
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	0.02	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	16.72	8.14
合计	797.79	1,447.71

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 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	75,509.11	87,263.22
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	75,509.11	87,263.22

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	716.19	9,045.29
预提费用	44,500.00	54,500.00
指数使用费	50,000.00	50,000.00
其他	12,722.97	12,722.97
合计	107,939.16	126,268.26

7.4.7.9 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 12 月 31 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	55,703,746.28	55,703,746.28
本期赎回(以"-"号填列)	-89,257,019.50	-89,257,019.50
本期末	32,219,866.91	32,219,866.91

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	6,729,187.11	11,093,794.35	17,822,981.46
本期利润	26,714,288.39	810,621.02	27,524,909.41
本期基金份额交易产生	-11,936,325.72	-9,761,671.32	-21,697,997.04

的变动数			
其中：基金申购款	26,996,120.02	13,339,019.26	40,335,139.28
基金赎回款	-38,932,445.74	-23,100,690.58	-62,033,136.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	21,507,149.78	2,142,744.05	23,649,893.83

7.4.7.11 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	33,066.94	19,374.67
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	4,243.99	1,791.42
其他	591.21	425.31
合计	37,902.14	21,591.40

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	340,650,389.54	184,255,482.94
减：卖出股票成本总额	312,408,426.46	175,107,758.93
买卖股票差价收入	28,241,963.08	9,147,724.01

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至 2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至 2014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
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	-	10,438,311.70
减：应收利息总额	-	354,406.23
买卖债券差价收入	-	-10,701.60

7.4.7.13.1 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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	392,246.07	928,752.75
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	392,246.07	928,752.75

7.4.7.17 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	810,621.02	10,411,391.88
——股票投资	810,621.02	10,401,261.88
——债券投资	-	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	810,621.02	10,411,391.88

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

基金赎回费收入	115,028.31	37,233.21
基金转换费收入	34,409.33	5,311.94
其他	-	20,000.00
合计	149,437.64	62,545.15

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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	976,651.79	522,876.88
银行间市场交易费用	-	-
合计	976,651.79	522,876.88

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
审计费用	40,000.00	50,000.00
信息披露费	100,000.00	240,000.00
银行费用	1,694.34	1,935.29
债券账户维护费	18,000.00	22,500.00
指数使用费	200,000.00	200,000.00
其他	200.00	400.00
合计	359,894.34	514,835.29

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

截至财务报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
摩根士丹利华鑫基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金销售机构
华鑫证券有限责任公司(“华鑫证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
摩根士丹利国际控股公司	基金管理人的股东
深圳市招融投资控股有限公司	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

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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	45,116,118.99	7.24%	47,855,356.59	14.52%

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 2015年1月1日至2015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	41,073.77	7.21%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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%

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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	670,186.44	811,623.10
其中：支付销售机构的客户维护费	320,735.37	372,570.58

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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	100,527.97	121,743.49

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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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	3,181,998.46	33,066.94	7,701,896.94	19,374.67

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（2015 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
300025	华星创业	2015 年 11 月 26 日	重大资产重组	30.15	-	-	50,000	880,319.00	1,507,500.00	-
000002	万　科A	2015 年 12 月 18 日	重大资产重组	24.43	-	-	24,902	333,766.04	608,355.86	-
300104	乐视网	2015 年 12 月 7 日	重大资产重组	58.80	-	-	9,844	179,663.09	578,827.20	-
002465	海格通信	2015 年 12 月 30 日	重大事项	16.69	2016 年 2 月 4 日	15.02	17,400	176,945.32	290,406.00	-
002065	东华软件	2015 年 12 月 21 日	重大事项	25.10	-	-	10,510	298,290.70	263,801.00	-
000982	中银绒业	2014 年 8 月 25 日	重大事项	8.69	2016 年 2 月 25 日	5.10	23,307	113,207.87	202,537.83	-
000876	新 希 望	2015 年 8 月 17 日	重大事项	18.99	2016 年 3 月 2 日	17.09	10,004	142,808.60	189,975.96	-

000748	长城信息	2015 年 6 月 18 日	重大资产重组	24.68	2016 年 3 月 10 日	31.39	5,800	109,910.00	143,144.00	-
002242	九阳股份	2015 年 12 月 24 日	重大事项	22.68	2016 年 1 月 11 日	20.41	5,718	56,124.48	129,684.24	-
002219	恒康医疗	2015 年 7 月 8 日	重大资产重组	18.18	-	-	6,487	42,440.08	117,933.66	-
000901	航天科技	2015 年 8 月 19 日	重大资产重组	52.88	2016 年 2 月 18 日	47.59	2,063	43,619.76	109,091.44	-
002049	同方国芯	2015 年 12 月 11 日	重大资产重组	60.15	2016 年 3 月 11 日	54.14	1,800	47,194.04	108,270.00	-
002011	盾安环境	2015 年 12 月 28 日	重大事项	16.72	2016 年 2 月 22 日	15.05	5,900	60,513.27	98,648.00	-
300088	长信科技	2015 年 12 月 14 日	重大资产重组	14.03	2016 年 2 月 29 日	12.63	7,000	57,137.72	98,210.00	-
002340	格林美	2015 年 12 月 29 日	重大事项	15.20	2016 年 1 月 6 日	14.35	6,451	54,851.55	98,055.20	-
000028	国药一致	2015 年 10 月 21 日	重大资产重组	66.15	2016 年 3 月 25 日	63.05	1,375	52,992.55	90,956.25	-
000829	天音控股	2015 年 11 月 9 日	重大资产重组	12.22	-	-	6,327	47,425.82	77,315.94	-
002048	宁波华翔	2015 年 11 月 19 日	重大资产重组	17.40	-	-	3,138	34,285.64	54,601.20	-
300043	互动娱乐	2015 年 12 月 17 日	重大事项	15.80	-	-	100	1,593.00	1,580.00	-

注：本基金截至 2015 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，前者负责合规及运营风险管理，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监督管理；基金经理、投资总监以及投资决策委员会负责对基金投资业务风险进行直接管理。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

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 12 月 31 日，本基金未持有债券投资(2014 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发行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 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 2015 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、结算备付金及存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 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	3,181,998.46	-	-	-	3,181,998.46
结算备付金	91,503.18	-	-	-	91,503.18
存出保证金	33,842.51	-	-	-	33,842.51
交易性金融资产	-	-	-	52,979,448.95	52,979,448.95
应收利息	-	-	-	797.79	797.79
应收申购款	-	-	-	13,091.77	13,091.77
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,307,344.15	-	-	52,993,338.51	56,300,682.66
负债					
应付赎回款	-	-	-	193,341.32	193,341.32
应付管理人报酬	-	-	-	47,071.58	47,071.58
应付托管费	-	-	-	7,060.75	7,060.75
应付交易费用	-	-	-	75,509.11	75,509.11
其他负债	-	-	-	107,939.16	107,939.16
负债总计	-	-	-	430,921.92	430,921.92
利率敏感度缺口	3,307,344.15	-	-	52,562,416.59	55,869,760.74
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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2015 年 12 月 31 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)。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，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 2015 年 12 月 31 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	52,979,448.95	94.83	79,017,907.25	94.52
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	52,979,448.95	94.83	79,017,907.25	94.52

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（2015 年 12 月 31 日 ）	上年度末（2014 年 12 月 31 日 ）
	业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	2,980,000.00	4,130,000.00
	业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-2,980,000.00	-4,130,000.00

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 2015 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 48,210,555.17 元，属于第二层次的余额为 4,768,893.78

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，无第三层次的余额)。

(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。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 7.4.5.2)，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(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 2015 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(2014 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	52,979,448.95	94.10
	其中：股票	52,979,448.95	94.10
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	3,273,501.64	5.81
7	其他各项资产	47,732.07	0.08
8	合计	56,300,682.66	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境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值

			比例（%）
A	农、林、牧、渔业	501,181.03	0.90
B	采矿业	641,161.70	1.15
C	制造业	26,495,442.41	47.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	846,344.01	1.51
E	建筑业	628,887.98	1.13
F	批发和零售业	915,480.31	1.64
G	交通运输、仓储和邮政业	40,401.62	0.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,838,722.05	8.66
J	金融业	4,158,429.56	7.44
K	房地产业	1,982,247.98	3.55
L	租赁和商务服务业	1,924,339.65	3.44
M	科学研究和技术服务业	1,326.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	871,827.91	1.56
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	103,557.22	0.19
R	文化、体育和娱乐业	825,202.90	1.48
S	综合	259,629.76	0.46
	合计	45,034,182.09	80.61

8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	44,804.80	0.08
B	采矿业	52,920.00	0.09
C	制造业	3,136,127.90	5.61
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	3,072,449.16	5.50

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	1,638,965.00	2.93
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	7,945,266.86	14.22

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	002450	康得新	58,574	2,231,669.40	3.99
2	000001	平安银行	165,711	1,986,874.89	3.56
3	002594	比亚迪	27,037	1,741,182.80	3.12
4	000625	长安汽车	76,082	1,291,111.54	2.31
5	000651	格力电器	51,280	1,146,108.00	2.05
6	002183	怡 亚 通	22,400	1,031,744.00	1.85
7	300059	东方财富	12,100	629,563.00	1.13
8	000333	美的集团	18,832	618,066.24	1.11
9	000002	万　科A	24,902	608,355.86	1.09
10	300104	乐视网	9,844	578,827.20	1.04
11	000063	中兴通讯	27,019	503,363.97	0.90
12	000776	广发证券	23,000	447,350.00	0.80
13	002415	海康威视	12,503	429,978.17	0.77
14	300024	机器人	6,085	416,822.50	0.75

15	002230	科大讯飞	11,218	415,626.90	0.74
16	002202	金风科技	17,100	389,709.00	0.70
17	000858	五 粮 液	13,240	361,187.20	0.65
18	300027	华谊兄弟	8,220	340,965.60	0.61
19	000100	TCL 集团	79,364	338,090.64	0.61
20	000783	长江证券	26,374	327,565.08	0.59
21	300070	碧水源	5,973	309,222.21	0.55
22	001979	招商蛇口	14,407	300,530.02	0.54
23	002292	奥飞动漫	5,704	294,953.84	0.53
24	002465	海格通信	17,400	290,406.00	0.52
25	002673	西部证券	8,700	286,317.00	0.51
26	002405	四维图新	7,355	285,374.00	0.51
27	000503	海虹控股	8,502	284,731.98	0.51
28	000423	东阿阿胶	5,210	272,483.00	0.49
29	002241	歌尔声学	7,649	264,655.40	0.47
30	002065	东华软件	10,510	263,801.00	0.47
31	000963	华东医药	3,185	261,042.60	0.47
32	000009	中国宝安	14,456	259,629.76	0.46
33	000623	吉林敖东	7,700	238,315.00	0.43
34	000630	铜陵有色	66,500	238,070.00	0.43
35	000768	中航飞机	9,500	235,315.00	0.42
36	000538	云南白药	3,204	232,674.48	0.42
37	000826	启迪桑德	5,705	226,032.10	0.40
38	002153	石基信息	1,491	225,141.00	0.40
39	300017	网宿科技	3,712	222,682.88	0.40
40	002368	太极股份	3,300	221,430.00	0.40
41	002304	洋河股份	3,220	220,698.80	0.40
42	000839	中信国安	10,800	219,780.00	0.39
43	000062	深圳华强	6,000	219,600.00	0.39
44	000559	万向钱潮	9,582	216,840.66	0.39
45	300124	汇川技术	4,563	215,373.60	0.39
46	000917	电广传媒	8,100	215,136.00	0.39
47	000725	京东方A	72,300	214,731.00	0.38
48	002081	金 螳 螂	11,459	214,054.12	0.38
49	000157	中联重科	39,400	210,790.00	0.38
50	000977	浪潮信息	6,496	205,988.16	0.37
51	000895	双汇发展	10,050	205,120.50	0.37
52	000069	华侨城A	23,100	203,280.00	0.36
53	000982	中银绒业	23,307	202,537.83	0.36

54	000887	中鼎股份	8,222	194,039.20	0.35
55	002152	广电运通	6,253	193,780.47	0.35
56	000338	潍柴动力	20,000	193,200.00	0.35
57	002252	上海莱士	4,852	192,964.04	0.35
58	000876	新 希 望	10,004	189,975.96	0.34
59	002142	宁波银行	12,120	187,981.20	0.34
60	002030	达安基因	4,559	187,739.62	0.34
61	002500	山西证券	12,100	184,404.00	0.33
62	000060	中金岭南	13,108	183,905.24	0.33
63	000425	徐工机械	43,200	183,600.00	0.33
64	000166	申万宏源	17,119	183,344.49	0.33
65	000728	国元证券	8,100	182,979.00	0.33
66	300003	乐普医疗	4,640	179,104.00	0.32
67	002007	华兰生物	4,043	177,892.00	0.32
68	000718	苏宁环球	13,390	176,614.10	0.32
69	000778	新兴铸管	27,200	176,528.00	0.32
70	002008	大族激光	6,368	164,867.52	0.30
71	000997	新 大 陆	6,468	163,769.76	0.29
72	000402	金 融 街	14,100	162,573.00	0.29
73	002236	大华股份	4,394	162,138.60	0.29
74	300315	掌趣科技	11,470	160,580.00	0.29
75	002456	欧菲光	5,132	159,194.64	0.28
76	000738	中航动控	4,900	154,938.00	0.28
77	000793	华闻传媒	10,300	154,809.00	0.28
78	000883	湖北能源	25,200	154,728.00	0.28
79	000750	国海证券	11,994	154,122.90	0.28
80	000792	盐湖股份	6,000	154,080.00	0.28
81	000061	农 产 品	8,680	153,549.20	0.27
82	000046	泛海控股	12,200	153,110.00	0.27
83	000661	长春高新	1,269	152,851.05	0.27
84	002312	三泰控股	5,485	152,483.00	0.27
85	000686	东北证券	8,600	150,500.00	0.27
86	000566	海南海药	3,808	147,978.88	0.26
87	002038	双鹭药业	4,396	147,266.00	0.26
88	002129	中环股份	11,951	146,041.22	0.26
89	300251	光线传媒	4,800	145,392.00	0.26
90	002223	鱼跃医疗	3,766	144,802.70	0.26
91	000540	中天城投	15,850	144,552.00	0.26
92	000748	长城信息	5,800	143,144.00	0.26

93	002203	海亮股份	13,000	143,000.00	0.26
94	002400	省广股份	5,650	142,097.50	0.25
95	002191	劲嘉股份	9,218	141,588.48	0.25
96	000878	云南铜业	10,020	138,777.00	0.25
97	000539	粤电力A	18,840	138,474.00	0.25
98	000078	海王生物	5,657	135,541.72	0.24
99	300072	三聚环保	3,990	135,540.30	0.24
100	300058	蓝色光标	9,115	134,263.95	0.24
101	000998	隆平高科	5,650	134,187.50	0.24
102	300133	华策影视	4,500	134,055.00	0.24
103	002573	清新环境	5,940	133,293.60	0.24
104	002001	新 和 成	7,620	132,892.80	0.24
105	000988	华工科技	6,212	131,570.16	0.24
106	002385	大北农	10,749	131,245.29	0.23
107	002475	立讯精密	4,100	130,995.00	0.23
108	300212	易华录	2,800	129,276.00	0.23
109	000012	南 玻A	9,600	128,160.00	0.23
110	000786	北新建材	10,376	123,474.40	0.22
111	300257	开山股份	4,000	123,400.00	0.22
112	002424	贵州百灵	4,800	123,168.00	0.22
113	000039	中集集团	5,800	121,800.00	0.22
114	000592	平潭发展	6,096	121,798.08	0.22
115	002004	华邦健康	8,585	121,477.75	0.22
116	300253	卫宁软件	2,850	119,358.00	0.21
117	000568	泸州老窖	4,357	118,161.84	0.21
118	002470	金正大	5,800	117,972.00	0.21
119	002219	恒康医疗	6,487	117,933.66	0.21
120	002269	美邦服饰	17,332	116,297.72	0.21
121	002701	奥瑞金	4,100	115,866.00	0.21
122	002375	亚厦股份	7,282	114,837.14	0.21
123	002310	东方园林	4,300	113,778.00	0.20
124	002179	中航光电	2,980	113,120.80	0.20
125	000415	渤海租赁	12,500	112,750.00	0.20
126	002414	高德红外	3,700	112,739.00	0.20
127	002161	远 望 谷	5,037	112,325.10	0.20
128	000581	威孚高科	4,502	111,469.52	0.20
129	000800	一汽轿车	6,806	111,414.22	0.20
130	000709	河北钢铁	33,300	110,889.00	0.20
131	000543	皖能电力	13,090	110,872.30	0.20

132	002095	生 意 宝	1,500	110,385.00	0.20
133	002273	水晶光电	2,700	109,620.00	0.20
134	000901	航天科技	2,063	109,091.44	0.20
135	000999	华润三九	3,986	108,817.80	0.19
136	002049	同方国芯	1,800	108,270.00	0.19
137	000629	攀钢钒钛	29,179	107,086.93	0.19
138	000541	佛山照明	6,410	107,047.00	0.19
139	300134	大富科技	3,511	105,681.10	0.19
140	000516	国际医学	4,800	105,600.00	0.19
141	002353	杰瑞股份	4,127	104,743.26	0.19
142	300002	神州泰岳	7,962	104,302.20	0.19
143	002311	海大集团	7,414	103,573.58	0.19
144	300079	数码视讯	8,516	103,213.92	0.18
145	002104	恒宝股份	4,282	102,725.18	0.18
146	300077	国民技术	2,271	102,603.78	0.18
147	002467	二六三	4,851	101,822.49	0.18
148	002570	贝因美	6,790	101,374.70	0.18
149	300146	汤臣倍健	2,592	99,792.00	0.18
150	000729	燕京啤酒	12,100	99,583.00	0.18
151	002294	信立泰	3,285	98,944.20	0.18
152	002011	盾安环境	5,900	98,648.00	0.18
153	300088	长信科技	7,000	98,210.00	0.18
154	002340	格林美	6,451	98,055.20	0.18
155	300115	长盈精密	2,900	97,353.00	0.17
156	000831	五矿稀土	4,700	97,290.00	0.17
157	000006	深振业A	8,400	96,684.00	0.17
158	300015	爱尔眼科	3,059	96,603.22	0.17
159	000690	宝新能源	9,829	96,127.62	0.17
160	002190	成飞集成	2,191	95,878.16	0.17
161	300147	香雪制药	3,830	95,788.30	0.17
162	000960	锡业股份	7,100	95,566.00	0.17
163	000970	中科三环	6,788	95,235.64	0.17
164	000671	阳 光 城	10,500	94,815.00	0.17
165	002050	三花股份	8,894	94,721.10	0.17
166	000027	深圳能源	9,600	94,176.00	0.17
167	000028	国药一致	1,375	90,956.25	0.16
168	002410	广联达	5,000	90,900.00	0.16
169	000979	中弘股份	22,720	90,880.00	0.16
170	000413	东旭光电	10,000	90,800.00	0.16

171	300274	阳光电源	3,300	90,486.00	0.16
172	000939	凯迪生态	6,224	89,625.60	0.16
173	000777	中核科技	2,800	87,892.00	0.16
174	002185	华天科技	4,900	87,857.00	0.16
175	002146	荣盛发展	9,000	85,770.00	0.15
176	001696	宗申动力	6,195	85,614.90	0.15
177	000762	西藏矿业	3,254	85,580.20	0.15
178	000511	烯碳新材	7,271	85,143.41	0.15
179	300026	红日药业	4,000	84,400.00	0.15
180	002344	海宁皮城	5,500	84,370.00	0.15
181	002399	海普瑞	2,372	83,897.64	0.15
182	300202	聚龙股份	2,600	83,694.00	0.15
183	000758	中色股份	5,600	83,328.00	0.15
184	002022	科华生物	2,858	83,167.80	0.15
185	002106	莱宝高科	6,219	82,961.46	0.15
186	000825	太钢不锈	20,200	82,820.00	0.15
187	000400	许继电气	4,180	81,217.40	0.15
188	000685	中山公用	5,731	81,093.65	0.15
189	000598	兴蓉环境	11,282	80,327.84	0.14
190	000848	承德露露	4,850	80,025.00	0.14
191	000983	西山煤电	12,995	79,009.60	0.14
192	000021	深科技	6,541	78,884.46	0.14
193	002051	中工国际	3,100	78,523.00	0.14
194	002005	德豪润达	7,737	78,453.18	0.14
195	300273	和佳股份	3,752	78,416.80	0.14
196	000829	天音控股	6,327	77,315.94	0.14
197	000050	深天马Ａ	3,626	76,907.46	0.14
198	002063	远光软件	3,576	75,596.64	0.14
199	002073	软控股份	4,306	72,771.40	0.13
200	002603	以岭药业	4,000	72,520.00	0.13
201	002266	浙富控股	8,890	72,364.60	0.13
202	002250	联化科技	3,800	71,706.00	0.13
203	002429	兆驰股份	5,650	71,698.50	0.13
204	002428	云南锗业	3,500	70,980.00	0.13
205	002299	圣农发展	3,226	70,939.74	0.13
206	000652	泰达股份	9,938	70,857.94	0.13
207	300090	盛运环保	6,000	70,260.00	0.13
208	002041	登海种业	4,140	69,759.00	0.12
209	002474	榕基软件	2,900	69,455.00	0.12

210	002092	中泰化学	7,890	69,432.00	0.12
211	002151	北斗星通	1,300	67,834.00	0.12
212	300226	上海钢联	1,300	65,910.00	0.12
213	000563	陕国投Ａ	4,300	65,016.00	0.12
214	002138	顺络电子	4,500	64,575.00	0.12
215	000031	中粮地产	4,500	63,225.00	0.11
216	300039	上海凯宝	4,560	63,201.60	0.11
217	002681	奋达科技	1,440	62,928.00	0.11
218	300005	探路者	2,700	61,830.00	0.11
219	002477	雏鹰农牧	3,627	61,332.57	0.11
220	000697	炼石有色	2,200	61,204.00	0.11
221	000807	云铝股份	8,507	61,165.33	0.11
222	000528	柳　　工	7,300	60,517.00	0.11
223	000816	智慧农业	7,163	59,739.42	0.11
224	002029	七 匹 狼	4,307	58,876.69	0.11
225	002056	横店东磁	2,087	58,665.57	0.11
226	002052	同洲电子	4,000	58,600.00	0.10
227	000572	海马汽车	8,997	57,580.80	0.10
228	002556	辉隆股份	3,100	57,319.00	0.10
229	002440	闰土股份	3,000	57,150.00	0.10
230	002396	星网锐捷	2,358	56,945.70	0.10
231	002064	华峰氨纶	8,710	56,527.90	0.10
232	000851	高鸿股份	3,600	56,268.00	0.10
233	002155	湖南黄金	6,224	55,953.76	0.10
234	000961	中南建设	3,600	55,656.00	0.10
235	000898	鞍钢股份	11,600	55,332.00	0.10
236	002277	友阿股份	3,974	55,198.86	0.10
237	002048	宁波华翔	3,138	54,601.20	0.10
238	000401	冀东水泥	5,000	54,500.00	0.10
239	000612	焦作万方	7,071	53,951.73	0.10
240	002168	深圳惠程	4,559	53,932.97	0.10
241	000869	张　裕Ａ	1,173	53,699.94	0.10
242	000860	顺鑫农业	2,486	52,951.80	0.09
243	002237	恒邦股份	5,300	52,894.00	0.09
244	000975	银泰资源	4,208	52,684.16	0.09
245	300052	中青宝	1,800	52,182.00	0.09
246	002028	思源电气	3,234	51,388.26	0.09
247	002431	棕榈园林	1,858	49,868.72	0.09
248	000550	江铃汽车	1,619	48,537.62	0.09

249	000877	天山股份	5,800	46,574.00	0.08
250	002181	粤 传 媒	2,900	45,965.00	0.08
251	000933	神火股份	9,100	45,318.00	0.08
252	000422	湖北宜化	5,580	43,356.60	0.08
253	000735	罗 牛 山	5,702	43,164.14	0.08
254	000937	冀中能源	8,190	41,277.60	0.07
255	000088	盐 田 港	4,601	39,660.62	0.07
256	000156	华数传媒	1,200	39,360.00	0.07
257	002204	大连重工	3,800	38,000.00	0.07
258	300157	恒泰艾普	3,000	36,630.00	0.07
259	002653	海思科	1,500	32,835.00	0.06
260	000596	古井贡酒	800	29,200.00	0.05
261	002128	露天煤业	2,561	21,640.45	0.04
262	000693	华泽钴镍	900	16,767.00	0.03
263	002657	中科金财	100	7,999.00	0.01
264	300033	同花顺	100	7,105.00	0.01
265	300244	迪安诊断	100	6,954.00	0.01
266	300144	宋城演艺	241	6,820.30	0.01
267	002642	荣之联	100	5,789.00	0.01
268	002024	苏宁云商	400	5,380.00	0.01
269	300216	千山药机	100	4,408.00	0.01
270	000681	视觉中国	100	3,801.00	0.01
271	002195	二三四五	100	3,700.00	0.01
272	300168	万达信息	100	3,313.00	0.01
273	002439	启明星辰	100	3,200.00	0.01
274	002437	誉衡药业	100	3,025.00	0.01
275	000410	沈阳机床	100	2,502.00	0.00
276	000732	泰禾集团	100	2,450.00	0.00
277	002013	中航机电	100	2,266.00	0.00
278	300055	万邦达	100	2,171.00	0.00
279	300170	汉得信息	100	1,985.00	0.00
280	002736	国信证券	100	1,975.00	0.00
281	000547	航天发展	100	1,905.00	0.00
282	002422	科伦药业	100	1,860.00	0.00
283	002285	世联行	100	1,623.00	0.00
284	300043	互动娱乐	100	1,580.00	0.00
285	000930	中粮生化	100	1,478.00	0.00
286	002178	延华智能	100	1,326.00	0.00
287	002501	利源精制	100	1,258.00	0.00

288	000627	天茂集团	100	1,076.00	0.00
289	000875	吉电股份	100	919.00	0.00
290	000507	珠海港	100	741.00	0.00
291	000751	锌业股份	100	642.00	0.00
292	000897	津滨发展	100	570.00	0.00
293	000667	美好集团	100	496.00	0.00

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	002462	嘉事堂	32,000	1,619,840.00	2.90
2	300025	华星创业	50,000	1,507,500.00	2.70
3	600865	百大集团	52,700	1,131,469.00	2.03
4	002123	荣信股份	40,000	1,026,000.00	1.84
5	000678	襄阳轴承	77,800	965,498.00	1.73
6	300073	当升科技	15,000	582,450.00	1.04
7	002416	爱施德	8,476	148,330.00	0.27
8	002308	威创股份	5,700	140,505.00	0.25
9	002242	九阳股份	5,718	129,684.24	0.23
10	002577	雷柏科技	1,800	102,996.00	0.18
11	002261	拓维信息	2,500	97,250.00	0.17
12	000996	中国中期	3,381	95,783.73	0.17
13	002091	江苏国泰	2,899	77,026.43	0.14
14	002025	航天电器	2,731	70,978.69	0.13
15	300228	富瑞特装	2,200	68,640.00	0.12
16	300191	潜能恒信	1,200	52,920.00	0.09
17	002079	苏州固锝	4,487	48,953.17	0.09
18	002069	獐 子 岛	3,280	44,804.80	0.08
19	002148	北纬通信	1,500	34,215.00	0.06
20	000650	仁和药业	40	422.80	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）

1	002594	比亚迪	9,122,943.91	10.91
2	000550	江铃汽车	8,149,886.12	9.75
3	000001	平安银行	7,777,971.16	9.30
4	000776	广发证券	7,437,278.00	8.90
5	000783	长江证券	7,401,801.00	8.85
6	000002	万　科Ａ	7,385,862.95	8.84
7	002183	怡 亚 通	7,366,730.19	8.81
8	002230	科大讯飞	7,153,332.74	8.56
9	300329	海伦钢琴	7,106,208.99	8.50
10	002450	康得新	6,369,097.08	7.62
11	002038	双鹭药业	5,027,020.65	6.01
12	000625	长安汽车	4,244,283.00	5.08
13	300359	全通教育	3,815,357.00	4.56
14	601166	兴业银行	3,715,500.00	4.44
15	002381	双箭股份	3,691,156.40	4.42
16	002304	洋河股份	3,657,714.20	4.38
17	600476	湘邮科技	3,625,763.70	4.34
18	000166	申万宏源	3,569,296.08	4.27
19	000926	福星股份	3,568,886.80	4.27
20	002462	嘉事堂	3,514,963.20	4.20
21	002568	百润股份	3,419,071.03	4.09
22	600340	华夏幸福	3,380,492.03	4.04
23	000800	一汽轿车	3,303,261.28	3.95
24	603898	好莱客	3,112,522.00	3.72
25	002215	诺 普 信	3,019,216.31	3.61
26	300399	京天利	2,946,521.00	3.52
27	000503	海虹控股	2,760,272.00	3.30
28	300166	东方国信	2,757,242.18	3.30
29	601288	农业银行	2,695,000.00	3.22
30	300165	天瑞仪器	2,689,662.00	3.22
31	000651	格力电器	2,556,420.00	3.06
32	300225	金力泰	2,428,854.00	2.91
33	300033	同花顺	2,412,459.00	2.89
34	600780	通宝能源	2,390,954.00	2.86
35	000417	合肥百货	2,386,038.00	2.85
36	000089	深圳机场	2,296,240.00	2.75

37	002065	东华软件	2,275,089.00	2.72
38	000961	中南建设	2,232,101.88	2.67
39	002155	湖南黄金	2,227,483.25	2.66
40	300343	联创股份	2,199,256.00	2.63
41	002538	司尔特	2,153,730.00	2.58
42	300314	戴维医疗	2,133,645.00	2.55
43	002593	日上集团	1,988,636.00	2.38
44	002657	中科金财	1,964,177.00	2.35
45	000623	吉林敖东	1,895,517.00	2.27
46	000062	深圳华强	1,868,308.00	2.23
47	002191	劲嘉股份	1,867,798.90	2.23
48	600697	欧亚集团	1,821,002.00	2.18
49	600739	辽宁成大	1,735,153.00	2.08
50	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。

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	000002	万　科A	9,480,429.57	11.34
2	002183	怡 亚 通	8,422,768.58	10.08
3	000776	广发证券	8,404,234.00	10.05
4	002594	比亚迪	8,184,969.50	9.79
5	000783	长江证券	7,605,571.51	9.10
6	002230	科大讯飞	7,554,166.63	9.04
7	300329	海伦钢琴	7,384,443.73	8.83
8	000550	江铃汽车	7,348,178.89	8.79
9	000001	平安银行	7,180,750.71	8.59
10	002038	双鹭药业	5,415,564.60	6.48
11	002450	康得新	5,400,325.71	6.46
12	600476	湘邮科技	4,317,421.00	5.16
13	600340	华夏幸福	4,186,605.00	5.01
14	601166	兴业银行	4,079,200.00	4.88
15	000625	长安汽车	3,914,580.59	4.68
16	002304	洋河股份	3,867,088.14	4.63
17	300165	天瑞仪器	3,855,206.52	4.61

18	603898	好莱客	3,708,640.19	4.44
19	002381	双箭股份	3,702,214.89	4.43
20	300166	东方国信	3,479,511.82	4.16
21	000800	一汽轿车	3,379,370.56	4.04
22	000926	福星股份	3,367,947.00	4.03
23	000651	格力电器	3,325,983.00	3.98
24	300399	京天利	3,306,800.00	3.96
25	000166	申万宏源	3,302,577.80	3.95
26	002568	百润股份	3,174,426.18	3.80
27	300359	全通教育	3,133,946.24	3.75
28	002215	诺 普 信	2,960,322.50	3.54
29	601288	农业银行	2,765,000.00	3.31
30	300225	金力泰	2,718,108.16	3.25
31	000961	中南建设	2,688,904.75	3.22
32	002065	东华软件	2,670,953.00	3.20
33	000858	五 粮 液	2,661,779.00	3.18
34	000503	海虹控股	2,613,319.00	3.13
35	000417	合肥百货	2,611,091.00	3.12
36	002593	日上集团	2,598,934.87	3.11
37	002462	嘉事堂	2,383,235.00	2.85
38	300033	同花顺	2,328,537.00	2.79
39	002155	湖南黄金	2,313,588.30	2.77
40	600780	通宝能源	2,300,533.00	2.75
41	300343	联创股份	2,232,895.00	2.67
42	002191	劲嘉股份	2,193,176.98	2.62
43	000623	吉林敖东	2,137,054.56	2.56
44	000024	招商地产	2,078,332.00	2.49
45	002657	中科金财	2,078,283.00	2.49
46	002538	司尔特	2,050,235.94	2.45
47	002189	利达光电	2,036,865.00	2.44
48	601318	中国平安	1,977,552.00	2.37
49	600697	欧亚集团	1,853,050.00	2.22
50	002081	金 螳 螂	1,847,093.00	2.21
51	002023	海特高新	1,794,837.00	2.15
52	000062	深圳华强	1,763,668.00	2.11
53	002630	华西能源	1,730,030.00	2.07
54	600739	辽宁成大	1,724,103.00	2.06
55	002467	二六三	1,711,703.00	2.05

56	002035	华帝股份	1,707,757.00	2.04
57	000338	潍柴动力	1,690,830.16	2.02
58	000733	振华科技	1,683,536.00	2.01

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	285,559,347.14
卖出股票收入（成交）总额	340,650,389.54

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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体除乐视网信息技术（北京）股份有限公司（以下简称“乐视网”）外，其余的没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

2015 年 7 月 21 日，乐视网公告其自首发上市以来被证券监管部门和交易所采取的监管措施，包括中国证监会北京监管局[2014]31 号行政监管措施决定书、中国证监会北京监管局[2015]30 号行政监管措施决定书的内容，以及公司相应整改的情况。

本基金投资乐视网（300104）的决策流程符合本基金管理人投资管理制度的相关规定。针对上述情况，本基金管理人进行了分析和研究，认为上述事件对乐视网的投资价值未造成实质性影响。本基金管理人将继续对上述公司进行跟踪研究。

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	33,842.51
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	797.79
5	应收申购款	13,091.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	47,732.07

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

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	000002	万　科A	608,355.86	1.09	重大资产重组
2	300104	乐视网	578,827.20	1.04	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

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	300025	华星创业	1,507,500.00	2.70	重大资产重组

§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
2,144	15,027.92	247,529.75	0.77%	31,972,337.16	99.23%

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	-	-

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	0

有本开放式基金	
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	65,773,140.13
本报告期基金总申购份额	55,703,746.28
减:本报告期基金总赎回份额	89,257,019.50
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	32,219,866.91

§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：

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，徐卫先生不再担任本公司副总经理，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的重大人事变动如下：

本基金托管人 2015 年 1 月 4 日发布任免通知，聘任张力铮为中国建设银行投资托管业务部副总经理。

本基金托管人 2015 年 9 月 18 日发布任免通知，解聘纪伟中国建设银行投资托管业务部副总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金未改变投资策略。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。报告期内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）2015 年度审计的报酬为 40,000.00 元。目前普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已连续四年向本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	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	
海通证券	1	96,244,755.15	15.45%	89,013.09	15.64%	-
长江证券	2	79,954,910.57	12.84%	72,791.34	12.79%	-
中信建投	1	70,941,687.57	11.39%	64,585.51	11.34%	-
国泰君安	1	65,328,307.25	10.49%	59,662.00	10.48%	-
安信证券	2	61,753,010.25	9.92%	56,219.77	9.87%	-
中金公司	1	59,279,905.15	9.52%	53,968.80	9.48%	-
华鑫证券	2	45,116,118.99	7.24%	41,073.77	7.21%	-
华创证券	1	29,340,594.45	4.71%	26,711.78	4.69%	-
国金证券	1	21,472,181.10	3.45%	19,659.60	3.45%	-
中银国际	2	18,997,442.47	3.05%	17,295.45	3.04%	-
民生证券	1	18,080,311.12	2.90%	16,460.16	2.89%	-
方正证券	2	13,587,543.19	2.18%	12,439.57	2.19%	-
宏信证券	1	9,872,344.04	1.59%	9,194.11	1.61%	-
光大证券	1	7,577,884.82	1.22%	7,057.46	1.24%	-
兴业证券	1	7,545,343.00	1.21%	6,888.15	1.21%	-
平安证券	1	5,700,142.06	0.92%	5,308.58	0.93%	-

国信证券	1	5,268,250.00	0.85%	4,796.24	0.84%	-
中投证券	1	3,549,676.54	0.57%	3,279.18	0.58%	-
中泰证券	1	3,196,132.00	0.51%	2,909.75	0.51%	-
中信证券	5	-	-	-	-	-
中信证券（山东）	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	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. 本基金本报告期较上期末减少 2 个交易单元，其中东海证券、中泰证券（原“齐鲁证券”）各 1 个。另外，申银万国与宏源证券合并后组建成立申万宏源，中信证券吸收合并中信证券（浙江），因此交易单元亦合并列示。

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
海通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

中金公司	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券（山东）	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期未通过租用的证券公司交易单元进行其他证券投资。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	本公司关于旗下基金调整停牌股票“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	《上海证券报》	2015 年 3 月 3 日

	售有限公司申购费率优惠活动的公告		
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
24	本公司关于旗下基金调整停牌股票“大立科技”及“电广传媒”估值方法的公告	《上海证券报》	2015 年 7 月 7 日
25	本公司关于旗下基金调整停牌股票“尤洛卡”、“新兴铸管”及“腾信股份”估值方法的公告	《上海证券报》	2015 年 7 月 8 日
26	本公司关于旗下基金调整停牌股票估值方法的公告	《上海证券报》	2015 年 7 月 9 日
27	本公司关于旗下基金调整所持有新增停牌股票估值方法的公告	《上海证券报》	2015 年 7 月 10 日
28	本公司关于旗下基金调整所持有新增停牌股票估值方法的公告	《上海证券报》	2015 年 7 月 11 日
29	本公司关于旗下基金调整所持有新增停牌	《上海证券报》	2015 年 7 月 13 日

	股票估值方法的公告		
30	本公司关于旗下基金调整所持有新增停牌股票估值方法的公告	《上海证券报》	2015 年 7 月 14 日
31	本公司关于向招行、银联通借记卡持卡人开通基金网上交易直销定期定额申购业务的公告	《上海证券报》	2015 年 7 月 16 日
32	本公司关于旗下基金参加数米基金网费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2015 年 7 月 16 日
33	本公司关于调整基金网上交易直销定期定额申购业务部分银联通支付渠道的公告	《上海证券报》	2015 年 7 月 18 日
34	本基金 2015 年 2 季度报告	《上海证券报》	2015 年 7 月 18 日
35	本公司关于部分基金参与平安证券申购费率优惠的公告	《上海证券报》	2015 年 7 月 20 日
36	本公司关于新增银联通部分银行卡网上直销业务的公告	《上海证券报》	2015 年 7 月 21 日
37	本公司关于增加上海汇付金融服务有限公司为销售机构的公告	《上海证券报》	2015 年 7 月 27 日
38	本公司关于旗下基金调整停牌股票“广联达”估值方法的公告	《上海证券报》	2015 年 7 月 30 日
39	本公司关于旗下部分基金参与浦发银行网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2015 年 8 月 3 日
40	本公司关于董事变更的公告	《上海证券报》	2015 年 8 月 20 日
41	本公司关于旗下基金参与上海天天基金销售有限公司费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2015 年 8 月 25 日
42	本基金 2015 年半年度报告	《上海证券报》	2015 年 8 月 25 日
43	关于本公司旗下基金继续参与河北银行电子渠道申购及定期定额申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2015 年 8 月 28 日
44	本公司关于增加上海陆金所资产管理有限公司为销售机构并参与其申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2015 年 9 月 1 日
45	本公司关于旗下基金参与招商证券定期定额申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2015 年 10 月 8 日
46	本公司关于旗下基金调整停牌股票“荣信股份”估值方法的公告	《上海证券报》	2015 年 10 月 12 日
47	本基金 2015 年 3 季度报告	《上海证券报》	2015 年 10 月 27 日
48	本公司关于旗下基金参加上海长量基金销售投资顾问有限公司费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2015 年 12 月 1 日
49	本公司关于旗下基金参与深圳众禄金融控股股份有限公司费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2015 年 12 月 11 日
50	本基金招募说明书（更新）（2015 年第 1 号）	《上海证券报》	2015 年 12 月 29 日
51	本公司关于指数熔断机制对公司旗下公募基金业务规则影响的公告	《上海证券报》	2015 年 12 月 31 日
52	本公司关于旗下部分基金参与平安银行申	《上海证券报》	2015 年 12 月 31 日

	购及定期定额申购费率优惠活动的公告		
53	本公司关于旗下部分基金继续参与中国工商银行 2016 年定投申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2015 年 12 月 31 日
54	本公司关于旗下部分基金参与农业银行定期定额申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2015 年 12 月 31 日

注:上述公告同时在公司网站 www.msfunds.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
2016 年 3 月 30 日