

# 摩根士丹利华鑫量化多策略股票型证券投资 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 6 月 2 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>15</b>
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	15
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>16</b>
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	19
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>40</b>
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.....	41
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	59
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	62
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.....	62
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.....	62

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	62
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	62
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	62
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63
8.12	投资组合报告附注	63
<b>§9</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>65</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65
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	65
<b>§10</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>65</b>
<b>§11</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>66</b>
11.1	基金份额持有人大会决议	66
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	66
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	66
11.4	基金投资策略的改变	66
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	66
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	66
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	67
11.8	其他重大事件	69
<b>§12</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>71</b>
12.1	备查文件目录	71
12.2	存放地点	71
12.3	查阅方式	72

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	摩根士丹利华鑫量化多策略股票型证券投资基金
基金简称	大摩量化多策略股票
基金主代码	001291
交易代码	001291
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月2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	1,701,243,243.63份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	运用多种策略的量化投资模型，从不同投资维度，在不同市场情况下捕捉市场定价失效的投资机会，力争有效控制风险的基础上，实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>量化多策略体系的理念主要有两个：增强收益、分散风险。量化策略是基于市场历史数据实现的，不同市场信号需要采用不同策略和交易手段，因此建立多种策略可以弥补单一策略失效的可能并形成互补，保证整体投资业绩的持续性和增强。另一方面，策略间相关性越低，越能分散组合的整体风险，这是配置多个策略，并在策略之间设定适当比例的基本原理。本基金的投资策略主要包括：</p> <p>1) 股票投资策略</p> <p>通过基金管理人开发的“多因子阿尔法模型”、“行业轮动模型”、“事件驱动模型”等各类量化模型进行股票选择并据此构建股票投资组合。在实际运行过程中，将定期或不定期地进行修正，优化股票投资组合。</p> <p>2) 固定收益投资策略</p> <p>本基金债券等固定收益类证券以及可转换债券的投资策略主要为：久期管理策略、收益率曲线策略、个券选择策略、跨市场套利策略等，并择机把握市场有效性不足情况下的交易机会。</p> <p>3) 衍生品投资策略</p> <p>本基金的衍生品投资原则上为有利于基金资产保值增值。本基金将严格遵守相关法律法规的约束，合理利用股指期货、权证等衍生工具，通过量化工具控制下行风险。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×85%+标普中国债券指数收益率×15%
风险收益特征	本基金为股票型证券投资基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

注：自 2015 年 9 月 29 日起，本基金的业绩基准由原来的“沪深 300 指数收益率×85%+中信标普全债指数收益率×15%”变更为“沪深 300 指数收益率×85%+标普中国债券指数收益率×15%”。

上述事项已于 2015 年 9 月 29 日在指定媒体上公告。

## 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	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ms funds.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 6 月 2 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-30,579,614.53

本期利润	64,311,541.36
加权平均基金份额本期利润	0.0271
本期加权平均净值利润率	2.88%
本期基金份额净值增长率	5.50%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>2015 年末</b>
期末可供分配利润	28,370,435.28
期末可供分配基金份额利润	0.0167
期末基金资产净值	1,794,884,099.80
期末基金份额净值	1.055
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>2015 年末</b>
基金份额累计净值增长率	5.50%

注：1.本基金基金合同于 2015 年 6 月 2 日正式生效，截至报告期末未满一年；

2. 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；

3. 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）；

4. 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。

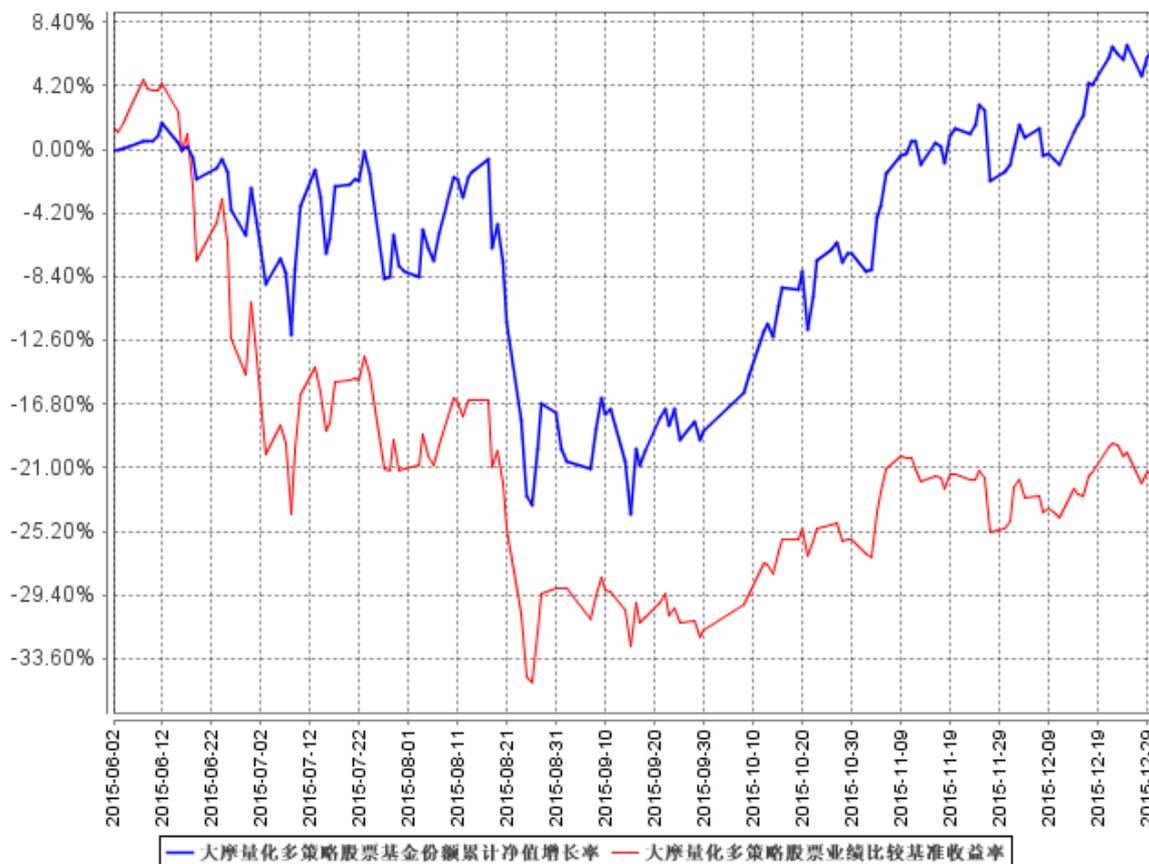
## 3.2 基金净值表现

### 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	29.61%	1.53%	14.42%	1.42%	15.19%	0.11%
过去六个月	8.21%	2.36%	-13.20%	2.28%	21.41%	0.08%
自基金合同生效起至今	5.50%	2.24%	-21.91%	2.36%	27.41%	-0.12%

### 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

大摩量化多策略股票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

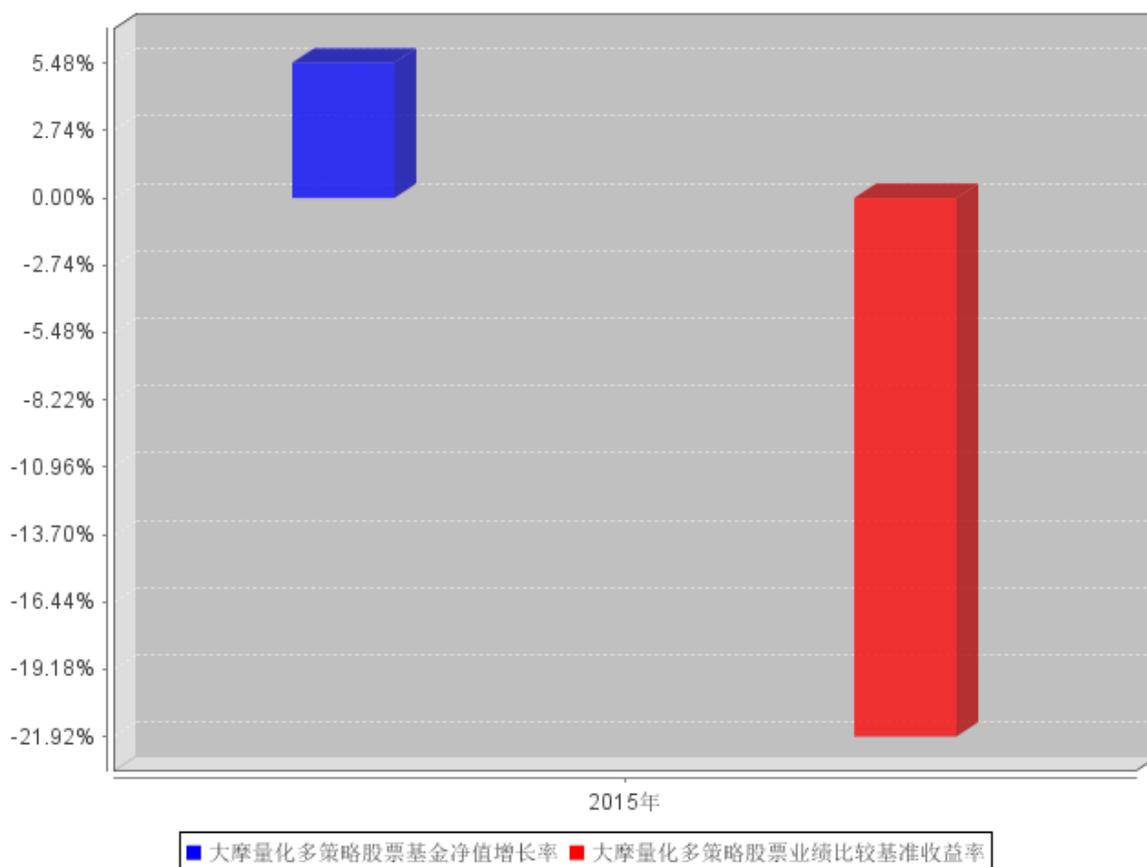


注：1. 本基金基金合同于 2015 年 6 月 2 日正式生效，截至本报告期末未满一年。

2. 按照本基金基金合同的规定，基金管理人自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

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

大摩量化多策略股票自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金基金合同于 2015 年 6 月 2 日正式生效，截至本报告期末未满一年。上述指标在基金合同生效当年按照实际存续期进行计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日（2015 年 6 月 2 日）至本报告期末未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

摩根士丹利华鑫基金管理有限公司（以下简称“公司”）是一家中外合资基金管理公司，前身为经中国证监会证监基金字[2003]33 号文批准设立并于 2003 年 3 月 14 日成立的巨田基金管理有限公司。公司的主要股东包括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		
杨雨龙	基金经理	2015 年 6 月 26 日	-	6	北京大学金融数学硕士。曾任招商银行总行计划财务部管理会计，博时基金管理有限公司交易员，兴业证券股份有限公司研究所金融工程高级分析师。2014 年 7 月份加入本公司，历任量化投资部投资经理，2015 年 6 月起任摩根士丹利华鑫多因子精选策略混合型证券投资基金及摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 7 月起任本基金基金经理。
刘钊	助理总经理、量化投资部总监、基金经理	2015 年 6 月 2 日	2015 年 8 月 12 日	7	中国科学技术大学管理学博士，曾任职于深交所博士后工作站，五矿证券有限责任公司，历任总裁助理、研究部负责人、董事会秘书。2010 年 1 月加入本公司，从事数

					量化投资工作，2012 年 7 月至 2015 年 8 月任摩根士丹利华鑫多因子精选策略混合型证券投资基金基金经理，2013 年 4 月至 2014 年 12 月任摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金基金经理，2014 年 1 月至 2015 年 8 月任摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 6 月至 2015 年 8 月担任本基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、基金经理刘钊的任职日期为基金合同生效之日，基金经理杨雨龙的任职日期为根据本公司决定确定的聘任日期；基金经理刘钊的离任日期为根据本公司决定确定的解聘日期；

2、基金经理任职、离任已按规定在中国证券投资基金业协会办理完毕基金经理注册、注销；

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

基金管理人遵照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规的要求，制订了《摩根士丹利华鑫基金管理有限公司公平交易管理办法》、《摩根士丹利华鑫基金管理有限公司异常交易报告管理办法》、《摩根士丹利华鑫基金管理有限公司公平交易分析报告实施细则》等内部制度，形成较为完备的公平交易制度及异常交易分析体系。

基金管理人的公平交易管理涵盖了所管理的所有投资组合，管理的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时也包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资管理活动相关的各个环节。基金管理人通过投资交易以及其他相关系统实现了有效系统控制，通过投资交易行为的监控、异常交易的识别与分析、公平交易的分析与报告等方式实现了有效的人工控制，并通过定期及不定期的回顾不断完善相关制度及流程，实现公平交易管理控制目标。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

经对报告期内公司管理所有投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异，连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）不同投资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与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

对于 A 股市场来说，2015 年是波澜壮阔的一年，股市上半年高歌猛进，大部分股票涨幅翻倍，市场情绪极度亢奋。然而自 6 月 12 日指数达到高位后，市场开始大幅回落。9 月中旬以来，市场又一路上冲，有的股票估值甚至接近了之前的高点。全年来看，虽然市场波动剧烈，但指数涨幅仍然不错，沪深 300 全年涨幅 5.58%，中证 500 全年涨幅 43.12%。

本基金于 2015 年 6 月 2 日成立，成立不久市场便经历市场的快速下跌，而本基金净值的最大累计跌幅仅有 24.1%，好于大盘指数，这主要归功于以下的建仓原则和投资方法。我们遵循：一、逢低逐步建立仓位，尽量不追高加仓；二、在局部高位进行适当减仓，留足“弹药”；三、谨慎对待前期涨幅较大的小盘股，并采用短期低配中小盘股策略；四、多种量化策略搭配运用，分散风险。坚守量化投资的原则，避免集中投资，减少非系统性风险。另外，为了应对市场黑天鹅事件频发导致的流动性危机，我们对整体仓位进行了调整，留出适当的现金及其等价物应对可能出现的赎回申请。

总体来说，在这样大风大浪的一年中，我们应对得当，本基金也取得了较为理想的投资业绩。

### 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 1.055 元，累计份额净值为 1.055 元，基金份额净值增长率为 5.50%，同期业绩比较基准收益率为-21.91%。

#### 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,我们认为,中国宏观经济有望呈“先探底,后回升”态势。A 股市场方面,2016 年 1 月份各种利空因素叠加,市场大幅调整,风险得到了较好的释放,因此,我们预计接下来市场的机会将多于风险。

2016 年 1 月,中国制造业采购经理指数(PMI)为 49.4%,低于上月 0.3 个百分点,但大部分工业品原材料价格自 2015 年 12 月止跌回稳后并未创新低,原材料库存有所降低,采购表现出价升量缩的特点,显示下游需求依然低迷;需求端表现平平,但国内持续去产能引发的供给收缩、美元升值不及预期等因素可能改变大宗商品价格的通缩预期,企业或将由去库存转向补库存,预计补库存周期将于一季度开启。库存周期的变化可能为经济带来短暂动能。

上市公司最新发布的 2015 年业绩快报显示,2015 年大部分 A 股公司利润增长减速,低于市场预期。其中,服务业的整体表现要略优于制造业。市场基于业绩数据对上市公司重新估值,或是诱发 1 月份快速调整的原因之一。在市场泥沙俱下的时候,优质股票也被错杀,但后期将会得到估值修复的机会,这也是运用量化选股模型从中掘金的好时机。

2016 年初,汇率贬值导致年初资金面明显偏紧,此后,央行频繁通过逆回购、中期借贷便利(MLF)、短期流动性调节(SLO)以及国库现金定存等货币政策工具向市场投放了大量基础货币,并临时增加公开市场操作次数,使市场流动性逐渐变得充裕。由于宏观经济仍未好转,我们预期央行将维持宽松的货币政策,以配合决策层稳增长思路。

总体看来,A 股在 1 月份经历了急速调整后,投资风险也随之降低。此外,美联储加息节奏放缓的预期有助于人民币汇率的稳定。在汇率保持稳定的前提下,我们对 2016 年的行情持谨慎乐观态度,并将依托于多因子、行业轮动、事件驱动等数量化模型构建投资组合。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期,基金管理人通过开展专项检查、加强日常监控、完善管理制度等方式,检查内部控制制度的执行情况、基金运作的合法合规情况,及时发现问题,提出改进建议并跟踪落实。

本报告期,基金管理人完成的主要监察稽核工作如下:

(1) 完成专项检查工作。检查范围覆盖投资研究交易、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

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

基金管理人成立基金估值委员会，委员会由主任委员（分管基金运营部的助理总经理）以及相关成员（包括基金运营部负责人、基金会计、风险管理部及监察稽核部相关业务人员）构成。估值委员会的相关人员均具有一定年限的专业从业经验，具有良好的专业能力，并能在相关工作中保持独立性。其中基金运营部负责具体执行公允价值估值、提供估值建议、跟踪长期停牌股票对资产净值的影响并就调整估值方法与托管行、会计师事务所进行沟通；风险管理部负责评估公允价值估值数据模型，计算并向基金运营部提供使用数据模型估值的证券价格；监察稽核部负责与监管机构的沟通、协调以及检查公允价值估值业务的合法、合规性。

由于基金经理及相关投资研究人员对特定投资品种的估值有深入的理解，经估值委员会主任委员同意，在需要时可以参加估值委员会会议并提出估值的建议。估值委员会对特定品种估值方法需经委员充分讨论后确定。

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2016)第 21671 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	摩根士丹利华鑫量化多策略股票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量化多策略股票型证券投资基金(以下简称“摩根士丹利华鑫量化多策略基金”)的财务报表，包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 年 6 月 2 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间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量化多策略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量化多策略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量化多策略基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 6 月 2 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间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: 摩根士丹利华鑫量化多策略股票型证券投资基金

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
资产:		
银行存款	7.4.7.1	206, 037, 759. 77

结算备付金		10,263,068.25
存出保证金		2,323,181.02
交易性金融资产	7.4.7.2	1,603,804,398.81
其中：股票投资		1,603,804,398.81
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		-
应收利息	7.4.7.5	60,604.03
应收股利		-
应收申购款		641,750.18
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		1,823,130,762.06
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015年12月31日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		18,987,208.44
应付管理人报酬		2,529,477.02
应付托管费		421,579.51
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	6,124,394.18
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	184,003.11
负债合计		28,246,662.26
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	1,701,243,243.63
未分配利润	7.4.7.10	93,640,856.17
所有者权益合计		1,794,884,099.80
负债和所有者权益总计		1,823,130,762.06

注：1. 报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.055 元，基金份额总额 1,701,243,243.63 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2015 年 6 月 2 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间,且无上年度可比数据。

## 7.2 利润表

会计主体: 摩根士丹利华鑫量化多策略股票型证券投资基金

本报告期: 2015 年 6 月 2 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 6 月 2 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		111,182,357.20
1. 利息收入		3,486,231.95
其中: 存款利息收入	7.4.7.11	2,746,761.85
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		739,470.10
其他利息收入		-
2. 投资收益(损失以“-”填列)		11,421,408.27
其中: 股票投资收益	7.4.7.12	-3,824,453.06
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
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	15,245,861.33
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	94,891,155.89
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	1,383,561.09
<b>减: 二、费用</b>		46,870,815.84
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	19,345,024.07
2. 托管费	7.4.10.2.2	3,224,170.72
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.19	24,023,121.52
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	278,499.53
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		64,311,541.36
减: 所得税费用		-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		64,311,541.36

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：摩根士丹利华鑫量化多策略股票型证券投资基金

本报告期：2015 年 6 月 2 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 6 月 2 日(基金合同生效日)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)	2,576,611,172.81	-	2,576,611,172.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	64,311,541.36	64,311,541.36
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)	-875,367,929.18	29,329,314.81	-846,038,614.37
其中：1. 基金申购款	44,031,152.83	-1,312,778.74	42,718,374.09
2. 基金赎回款	-919,399,082.01	30,642,093.55	-888,756,988.46
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)	1,701,243,243.63	93,640,856.17	1,794,884,099.80

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>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

### 7.4 报表附注

#### 7.4.1 基金基本情况

摩根士丹利华鑫量化多策略股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]737号《关于核准摩根士丹利华鑫量化多策略股票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《摩根士丹利华鑫量化多策略股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式证券投资基金,存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集2,575,896,377.40元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第661号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《摩根士丹利华鑫量化多策略股票型证券投资基金基金合同》于2015年6月2日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,576,611,172.81份,其中认购资金利息折合714,795.41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（以下简称“中国建设银行”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《摩根士丹利华鑫量化多策略股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资于股票（包含中小板、创业板及其他依法发行、上市的股票），股指期货、权证，债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产以及现金，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 80%-95%；权证投资占基金资产净值的比例不高于 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金，基金保留的现金或者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。自基金合同生效日至 2015 年 9 月 28 日止期间，本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 $\times$ 85%+中信标普全债指数收益率 $\times$ 15%。根据本基金的基金管理人于 2015 年 9 月 29 日发布的《摩根士丹利华鑫基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金变更业绩比较基准及修改相关基金合同的公告》，自 2015 年 9 月 29 日起，本基金业绩比较基准变更为：沪深 300 指数收益率 $\times$ 85%+标普中国债券指数收益率 $\times$ 15%。

本财务报表由本基金的基金管理人摩根士丹利华鑫基金管理有限公司于 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》、《摩根士丹利华鑫量化多策略股票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 6 月 2 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止期间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 6 月 2 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止期间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。本期财务报表的实际编制期间为 2015 年 6 月 2 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间。

### 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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》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
活期存款	206,037,759.77
定期存款	-
其中：存款期限1-3个月	-
其他存款	-
合计：	206,037,759.77

**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	1,508,913,242.92	1,603,804,398.81	94,891,155.89
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	1,508,913,242.92	1,603,804,398.81	94,891,155.89

**7.4.7.3 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。

**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
应收活期存款利息	54,373.72
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	5,080.24
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	1,150.05
合计	60,604.03

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 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
交易所市场应付交易费用	6,124,249.19
银行间市场应付交易费用	144.99
合计	6,124,394.18

#### 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
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	14,503.11
预提费用	169,500.00
合计	184,003.11

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 6 月 2 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	2,576,611,172.81	2,576,611,172.81
本期申购	44,031,152.83	44,031,152.83
本期赎回(以“-”号填列)	-919,399,082.01	-919,399,082.01
本期末	1,701,243,243.63	1,701,243,243.63

注：1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 本基金自 2015 年 5 月 21 日至 2015 年 5 月 29 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 2,575,896,377.40 元。根据《摩根士丹利华鑫量化多策略股票型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 714,795.41 元在本基金成立后，折算为 714,795.41 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

3. 根据《摩根士丹利华鑫量化多策略股票型证券投资基金基金合同》和《摩根士丹利华鑫量化多

策略股票型证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金于 2015 年 6 月 2 日(基金合同生效日)至 2015 年 8 月 31 日(含)止期间暂不向投资人开放基金交易。申购业务、赎回业务和转换业务自 2015 年 9 月 1 日起开始办理。

#### 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-30,579,614.53	94,891,155.89	64,311,541.36
本期基金份额交易产生的变动数	58,950,049.81	-29,620,735.00	29,329,314.81
其中：基金申购款	-3,262,805.13	1,950,026.39	-1,312,778.74
基金赎回款	62,212,854.94	-31,570,761.39	30,642,093.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	28,370,435.28	65,270,420.89	93,640,856.17

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 6 月 2 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	2,591,084.62
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	140,338.48
其他	15,338.75
合计	2,746,761.85

注：“其他”为基金申购款利息收入及结算保证金利息收入。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 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 6 月 2 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	7,401,846,204.89
减：卖出股票成本总额	7,405,670,657.95
买卖股票差价收入	-3,824,453.06

**7.4.7.13 债券投资收益****7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

本基金本报告期无债券投资收益。

**7.4.7.13.2 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。

**7.4.7.14 贵金属投资收益**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**7.4.7.15 衍生工具收益**

本基金本报告期无衍生工具收益。

**7.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2015年6月2日(基金合同生效日)至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	15,245,861.33
基金投资产生的股利收益	-
合计	15,245,861.33

**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6月2日(基金合同生效日)至2015年12月31日
1. 交易性金融资产	94,891,155.89
——股票投资	94,891,155.89
——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	94,891,155.89

**7.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2015年6月2日(基金合同生效日)至2015年12月31日
基金赎回费收入	1,371,751.89
基金转换费收入	11,740.99
其他	68.21
合计	1,383,561.09

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。不低于赎回费用的 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 25% 的部分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6月2日(基金合同生效日)至2015年12月31日
交易所市场交易费用	24,023,121.52
银行间市场交易费用	-
合计	24,023,121.52

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015年6月2日(基金合同生效日)至2015年12月31日
审计费用	115,000.00
信息披露费	150,000.00
银行费用	5,639.53
债券账户维护费	7,500.00
其他	360.00
合计	278,499.53

### 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

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的交易。

### 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6月2日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	19,345,024.07
其中：支付销售机构的客户维护费	10,064,679.14

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年6月2日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,224,170.72

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 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**

本报告期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**

本报告期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6月2日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	206,037,759.77	2,591,084.62

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**

本基金本报告期末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/增发证券而流通受限的证券。

**7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单价	复牌日期	复牌 开盘单价	数量 (股)	期末 成本总额	期末估值总 额	备注
600603	大洲兴 业	2015年9月 11日	重大资产重 组	18.60	2016年1月 14日	13.55	210,000	2,782,787.50	3,906,000.00	-
000876	新希 望	2015年8月 17日	重大事项	18.99	2016年3月 2日	17.09	204,127	3,712,969.11	3,876,371.73	-

601137	博威合金	2015年12月21日	重大资产重组	24.85	2016年2月29日	22.37	144,300	3,281,195.92	3,585,855.00	-
600429	三元股份	2015年9月21日	重大资产重组	7.29	2016年1月27日	7.49	485,200	3,505,260.84	3,537,108.00	-
600455	博通股份	2015年10月23日	重大资产重组	46.03	2016年2月23日	43.23	76,100	3,089,522.00	3,502,883.00	-
601000	唐山港	2015年10月29日	重大资产重组	8.25	2016年2月17日	7.98	421,700	2,998,251.00	3,479,025.00	-
600271	航天信息	2015年10月12日	重大资产重组	55.91	-	-	61,000	4,179,518.92	3,410,510.00	-
300365	恒华科技	2015年11月16日	重大资产重组	42.87	2016年1月27日	38.58	79,168	1,794,342.42	3,393,932.16	-
600690	青岛海尔	2015年10月19日	重大资产重组	9.92	2016年2月1日	8.93	325,929	3,138,612.95	3,233,215.68	-
600122	宏图高科	2015年12月25日	重大事项	19.42	-	-	161,000	2,806,058.91	3,126,620.00	-
300043	互动娱乐	2015年12月17日	重大事项	15.80	-	-	195,100	2,953,195.10	3,082,580.00	-
002567	唐人神	2015年11月23日	重大事项	12.84	2016年2月25日	11.56	229,300	2,540,364.00	2,944,212.00	-
000553	沙隆达A	2015年8月5日	重大资产重组	10.70	-	-	250,900	3,287,160.55	2,684,630.00	-
300069	金利华电	2015年10月29日	重大资产重组	29.85	2016年2月16日	26.87	68,500	1,778,259.00	2,044,725.00	-
000002	万科A	2015年12月18日	重大资产重组	24.43	-	-	83,572	1,199,946.38	2,041,663.96	-
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	86,100	1,778,800.84	1,952,748.00	-
600219	南山铝业	2015年9月29日	重大事项	6.58	2016年1月25日	7.00	280,700	1,758,658.18	1,847,006.00	-
300194	福安药业	2015年10月8日	重大资产重组	18.95	2016年1月4日	20.85	90,700	1,651,060.61	1,718,765.00	-
300355	蒙草抗旱	2015年12月14日	重大事项	17.84	2016年2月16日	16.06	95,700	1,123,167.78	1,707,288.00	-
600771	广誉远	2015年11月17日	重大资产重组	31.98	2016年3月9日	28.78	52,400	1,448,063.00	1,675,752.00	-
600714	金瑞矿业	2015年12月1日	重大资产重组	11.84	2016年3月4日	13.02	135,536	1,475,324.52	1,604,746.24	-
603889	新澳股份	2015年12月1日	重大资产重组	31.55	-	-	50,760	1,021,653.52	1,601,478.00	-
600389	江山股份	2015年12月28日	重大事项	26.49	-	-	57,800	1,357,345.50	1,531,122.00	-
601678	滨化股	2015年12	重大事项	8.02	2016年1月	7.22	176,000	1,424,291.31	1,411,520.00	-

	份	月 31 日			5 日						
600746	江苏索普	2015 年 10 月 13 日	重大资产重组	9.42	2016 年 1 月 20 日	8.61	149,000	1,285,836.00	1,403,580.00	-	-
300306	远方光电	2015 年 11 月 2 日	重大资产重组	18.67	2016 年 2 月 24 日	20.54	74,800	1,270,358.58	1,396,516.00	-	-
002209	达意隆	2015 年 11 月 24 日	重大资产重组	22.91	-	-	60,200	1,069,137.00	1,379,182.00	-	-
600847	万里股份	2015 年 8 月 18 日	重大资产重组	33.09	-	-	38,800	1,036,144.00	1,283,892.00	-	-
002201	九鼎新材	2015 年 11 月 17 日	重大资产重组	16.01	-	-	74,700	987,624.00	1,195,947.00	-	-
600990	四创电子	2015 年 8 月 31 日	重大资产重组	62.75	2016 年 3 月 25 日	69.03	16,600	1,234,864.00	1,041,650.00	-	-
002065	东华软件	2015 年 12 月 21 日	重大事项	25.10	-	-	37,800	769,902.16	948,780.00	-	-
002691	冀凯股份	2015 年 12 月 14 日	重大事项	23.76	2016 年 2 月 16 日	21.80	38,700	858,642.85	919,512.00	-	-
002696	百洋股份	2015 年 12 月 2 日	重大资产重组	24.97	-	-	36,100	600,823.01	901,417.00	-	-
002537	海立美达	2015 年 8 月 17 日	重大资产重组	16.59	2016 年 2 月 18 日	18.25	41,200	651,309.00	683,508.00	-	-
002040	南京港	2015 年 7 月 27 日	重大资产重组	12.53	2016 年 2 月 15 日	13.64	47,600	619,668.00	596,428.00	-	-
600859	王府井	2015 年 12 月 21 日	重大事项	27.22	2016 年 1 月 4 日	27.22	12,100	252,206.44	329,362.00	-	-
300313	天山生物	2015 年 11 月 3 日	重大资产重组	17.70	-	-	12,300	185,169.65	217,710.00	-	-
300351	永贵电器	2015 年 10 月 19 日	重大资产重组	31.30	2016 年 2 月 18 日	29.80	99	1,955.18	3,098.70	-	-
002582	好想你	2015 年 9 月 17 日	重大资产重组	15.62	2016 年 2 月 24 日	17.18	100	1,846.54	1,562.00	-	-
300038	梅泰诺	2015 年 12 月 16 日	重大资产重组	56.68	-	-	21	712.15	1,190.28	-	-
600578	京能电力	2015 年 11 月 5 日	重大资产重组	6.07	2016 年 2 月 24 日	5.49	97	568.98	588.79	-	-
002082	栋梁新材	2015 年 9 月 18 日	重大资产重组	10.21	2016 年 3 月 23 日	11.23	37	557.12	377.77	-	-

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重大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

本基金为股票型证券投资基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、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运用多种策略的量化投资模型，从不同投资维度，在不同市场情况下捕捉市场定价失效的投资机会，力争在控制风险的基础上，实现基金资产的长期稳定增值。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任，其下设的风险控制和审计委员会负责制定风险管理政策，检查公司和基金运作的合法合规情况；公司经营层对内部控制制度的有效执行承担责任，其下设的风险管理委员会负责讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；督察长监督检查基金和公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况；监察稽核部、风险管理部分工负责风险监督与控制，前者负责合规及运营风险管理，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。

#### **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证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。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。

#### **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	206,037,759.77	-	-	-	206,037,759.77
结算备付金	10,263,068.25	-	-	-	10,263,068.25
存出保证金	2,323,181.02	-	-	-	2,323,181.02
交易性金融资产	-	-	-	1,603,804,398.81	1,603,804,398.81
应收利息	-	-	-	60,604.03	60,604.03
应收申购款	417.50	-	-	641,332.68	641,750.18
资产总计	218,624,426.54	-	-	1,604,506,335.52	1,823,130,762.06
负债					
应付赎回款	-	-	-	18,987,208.44	18,987,208.44
应付管理人报酬	-	-	-	2,529,477.02	2,529,477.02
应付托管费	-	-	-	421,579.51	421,579.51
应付交易费用	-	-	-	6,124,394.18	6,124,394.18
其他负债	-	-	-	184,003.11	184,003.11
负债总计	-	-	-	28,246,662.26	28,246,662.26
利率敏感度缺口	218,624,426.54	-	-	1,576,259,673.26	1,794,884,099.80

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，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过开发各类量化模型进行股票选择并据此构建投资组合。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产占基金资产的80%-95%；权证投资占基金资产净值的比例不高于3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金，基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券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	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	1,603,804,398.81	89.35
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	1,603,804,398.81	89.35

##### 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: 人民币万元)
		2015 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	69,470,000.00
	2. 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-69,470,000.00

#### 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 1,528,600,340.50 元，属于第二层次的余额为 75,204,058.31 元，无属于第三层次的余额。

###### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

###### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

###### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 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。

###### (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	1,603,804,398.81	87.97
	其中：股票	1,603,804,398.81	87.97
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	216,300,828.02	11.86
7	其他各项资产	3,025,535.23	0.17
8	合计	1,823,130,762.06	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	16,198,601.38	0.90
B	采矿业	55,587,742.90	3.10
C	制造业	785,360,325.17	43.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	58,344,618.21	3.25
E	建筑业	60,908,967.23	3.39
F	批发和零售业	76,369,684.30	4.25
G	交通运输、仓储和邮政业	63,299,643.52	3.53
H	住宿和餐饮业	15,746,320.34	0.88
I	信息传输、软件和信息技术服务业	80,086,928.88	4.46
J	金融业	206,813,958.79	11.52
K	房地产业	70,840,827.11	3.95

L	租赁和商务服务业	23,709,903.20	1.32
M	科学研究和技术服务业	29,693,060.73	1.65
N	水利、环境和公共设施管理业	20,836,810.50	1.16
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	593,704.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	31,397,855.55	1.75
S	综合	8,015,447.00	0.45
	合计	1,603,804,398.81	89.35

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601166	兴业银行	2,730,300	46,606,221.00	2.60
2	601288	农业银行	13,492,200	43,579,806.00	2.43
3	601318	中国平安	751,532	27,055,152.00	1.51
4	600030	中信证券	926,800	17,933,580.00	1.00
5	000776	广发证券	853,444	16,599,485.80	0.92
6	600999	招商证券	760,224	16,496,860.80	0.92
7	600816	安信信托	529,289	12,051,910.53	0.67
8	601668	中国建筑	1,642,900	10,415,986.00	0.58
9	600054	黄山旅游	430,246	10,158,108.06	0.57
10	600297	广汇汽车	752,135	9,657,413.40	0.54
11	300123	太阳鸟	571,200	9,053,520.00	0.50
12	000415	渤海租赁	968,400	8,734,968.00	0.49
13	600015	华夏银行	706,089	8,571,920.46	0.48
14	600685	中船防务	210,226	8,343,869.94	0.46
15	002186	全聚德	351,739	8,089,997.00	0.45
16	601328	交通银行	1,220,200	7,858,088.00	0.44
17	600830	香溢融通	561,400	7,708,022.00	0.43
18	000524	岭南控股	386,098	7,656,323.34	0.43
19	000708	大冶特钢	620,300	7,573,863.00	0.42
20	600051	宁波联合	566,500	7,500,460.00	0.42
21	601003	柳钢股份	1,754,200	7,244,846.00	0.40
22	603111	康尼机电	242,436	6,970,035.00	0.39

23	000898	鞍钢股份	1,452,100	6,926,517.00	0.39
24	000070	特发信息	215,600	6,918,604.00	0.39
25	000561	烽火电子	484,100	6,864,538.00	0.38
26	601006	大秦铁路	755,917	6,516,004.54	0.36
27	002431	棕榈园林	241,600	6,484,544.00	0.36
28	002194	武汉凡谷	377,401	6,415,817.00	0.36
29	000421	南京中北	660,246	6,364,771.44	0.35
30	300312	邦讯技术	145,000	6,220,500.00	0.35
31	300071	华谊嘉信	431,360	6,125,312.00	0.34
32	300008	上海佳豪	218,915	5,823,139.00	0.32
33	603099	长白山	247,400	5,813,900.00	0.32
34	601766	中国南车	450,800	5,792,780.00	0.32
35	600029	南方航空	673,300	5,770,181.00	0.32
36	600507	方大特钢	941,065	5,740,496.50	0.32
37	002023	海特高新	304,400	5,582,696.00	0.31
38	000521	美菱电器	758,600	5,537,780.00	0.31
39	600883	博闻科技	304,511	5,490,333.33	0.31
40	601111	中国国航	638,700	5,480,046.00	0.31
41	601890	亚星锚链	442,656	5,431,389.12	0.30
42	600739	辽宁成大	233,700	5,281,620.00	0.29
43	002469	三维工程	326,518	5,273,265.70	0.29
44	601226	华电重工	415,300	5,253,545.00	0.29
45	601398	工商银行	1,145,400	5,245,932.00	0.29
46	603366	日出东方	484,984	5,140,830.40	0.29
47	600050	中国联通	824,654	5,096,361.72	0.28
48	000665	湖北广电	258,800	5,067,304.00	0.28
49	601801	皖新传媒	153,900	5,029,452.00	0.28
50	000529	广弘控股	411,500	4,966,805.00	0.28
51	601799	星宇股份	131,428	4,956,149.88	0.28
52	601566	九牧王	214,535	4,904,270.10	0.27
53	300061	康耐特	195,876	4,894,941.24	0.27
54	600997	开滦股份	875,620	4,885,959.60	0.27
55	000716	黑芝麻	284,000	4,833,680.00	0.27
56	002400	省广股份	191,900	4,826,285.00	0.27
57	600233	大杨创世	191,900	4,822,447.00	0.27
58	000552	靖远煤电	477,829	4,816,516.32	0.27
59	600298	安琪酵母	158,100	4,809,402.00	0.27
60	600438	通威股份	335,900	4,773,139.00	0.27
61	600356	恒丰纸业	373,200	4,750,836.00	0.26

62	600295	鄂尔多斯	480,285	4,750,018.65	0.26
63	600291	西水股份	162,500	4,730,375.00	0.26
64	002032	苏泊尔	169,122	4,704,974.04	0.26
65	002116	中国海诚	263,100	4,672,656.00	0.26
66	600809	山西汾酒	241,400	4,651,778.00	0.26
67	002572	索菲亚	106,000	4,568,600.00	0.25
68	000663	永安林业	269,800	4,538,036.00	0.25
69	603017	中衡设计	97,819	4,535,867.03	0.25
70	300288	朗玛信息	73,380	4,529,013.60	0.25
71	002674	兴业科技	227,300	4,511,905.00	0.25
72	603518	维格娜丝	133,700	4,511,038.00	0.25
73	000729	燕京啤酒	547,500	4,505,925.00	0.25
74	000885	同力水泥	310,100	4,496,450.00	0.25
75	002507	涪陵榨菜	237,740	4,462,379.80	0.25
76	002333	罗普斯金	206,100	4,460,004.00	0.25
77	600188	兖州煤业	469,041	4,432,437.45	0.25
78	601969	海南矿业	312,848	4,408,028.32	0.25
79	002295	精艺股份	186,610	4,402,129.90	0.25
80	002641	永高股份	442,500	4,398,450.00	0.25
81	300182	捷成股份	180,634	4,335,216.00	0.24
82	000628	高新发展	244,930	4,256,883.40	0.24
83	600081	东风科技	189,200	4,249,432.00	0.24
84	600308	华泰股份	734,540	4,238,295.80	0.24
85	002259	升达林业	382,080	4,164,672.00	0.23
86	600066	宇通客车	181,800	4,088,682.00	0.23
87	600350	山东高速	569,500	4,049,145.00	0.23
88	603166	福达股份	149,101	4,031,691.04	0.22
89	600337	美克家居	255,900	3,997,158.00	0.22
90	601857	中国石油	475,300	3,968,755.00	0.22
91	601965	中国汽研	418,097	3,925,930.83	0.22
92	600603	大洲兴业	210,000	3,906,000.00	0.22
93	600104	上汽集团	183,670	3,897,477.40	0.22
94	600897	厦门空港	168,101	3,886,495.12	0.22
95	000876	新希望	204,127	3,876,371.73	0.22
96	000625	长安汽车	228,200	3,872,554.00	0.22
97	600398	海澜之家	276,700	3,862,732.00	0.22
98	600190	锦州港	672,579	3,860,603.46	0.22
99	002225	濮耐股份	497,705	3,807,443.25	0.21
100	600609	金杯汽车	757,900	3,804,658.00	0.21

101	601633	长城汽车	314,212	3,783,112.48	0.21
102	000921	海信科龙	395,874	3,772,679.22	0.21
103	000022	深赤湾 A	195,400	3,771,220.00	0.21
104	000429	粤高速 A	538,100	3,718,271.00	0.21
105	601238	广汽集团	164,030	3,702,157.10	0.21
106	000030	富奥股份	361,600	3,688,320.00	0.21
107	000903	云内动力	443,400	3,680,220.00	0.21
108	300134	大富科技	121,800	3,666,180.00	0.20
109	000713	丰乐种业	278,517	3,659,713.38	0.20
110	600189	吉林森工	281,600	3,629,824.00	0.20
111	002100	天康生物	359,300	3,614,558.00	0.20
112	601137	博威合金	144,300	3,585,855.00	0.20
113	002153	石基信息	23,655	3,571,905.00	0.20
114	600377	宁沪高速	408,100	3,570,875.00	0.20
115	000719	大地传媒	174,841	3,566,756.40	0.20
116	000100	TCL 集团	831,200	3,540,912.00	0.20
117	002731	萃华珠宝	108,700	3,538,185.00	0.20
118	600429	三元股份	485,200	3,537,108.00	0.20
119	002311	海大集团	251,724	3,516,584.28	0.20
120	002128	露天煤业	414,986	3,506,631.70	0.20
121	600455	博通股份	76,100	3,502,883.00	0.20
122	600195	中牧股份	163,800	3,502,044.00	0.20
123	600060	海信电器	177,300	3,487,491.00	0.19
124	601000	唐山港	421,700	3,479,025.00	0.19
125	603009	北特科技	88,575	3,442,024.50	0.19
126	000858	五粮液	126,000	3,437,280.00	0.19
127	600386	北巴传媒	194,500	3,423,200.00	0.19
128	000568	泸州老窖	125,901	3,414,435.12	0.19
129	600271	航天信息	61,000	3,410,510.00	0.19
130	600987	航民股份	259,700	3,407,264.00	0.19
131	300365	恒华科技	79,168	3,393,932.16	0.19
132	600038	中直股份	64,298	3,390,433.54	0.19
133	002563	森马服饰	266,700	3,307,080.00	0.18
134	600510	黑牡丹	273,700	3,292,611.00	0.18
135	002304	洋河股份	47,956	3,286,904.24	0.18
136	300042	朗科科技	78,600	3,285,480.00	0.18
137	002528	英飞拓	241,189	3,275,346.62	0.18
138	601628	中国人寿	115,500	3,269,805.00	0.18
139	600690	青岛海尔	325,929	3,233,215.68	0.18

140	600519	贵州茅台	14,800	3,229,212.00	0.18
141	600850	华东电脑	62,200	3,212,630.00	0.18
142	601999	出版传媒	252,600	3,208,020.00	0.18
143	300284	苏文科	147,600	3,199,968.00	0.18
144	002703	浙江世宝	95,200	3,198,720.00	0.18
145	600338	西藏珠峰	152,300	3,183,070.00	0.18
146	000798	中水渔业	232,100	3,156,560.00	0.18
147	600122	宏图高科	161,000	3,126,620.00	0.17
148	002410	广联达	171,971	3,126,432.78	0.17
149	002401	中海科技	120,500	3,120,950.00	0.17
150	600983	惠而浦	227,210	3,110,504.90	0.17
151	600197	伊力特	211,600	3,099,940.00	0.17
152	600757	长江传媒	281,700	3,093,066.00	0.17
153	300043	互动娱乐	195,100	3,082,580.00	0.17
154	600068	葛洲坝	389,766	3,067,458.42	0.17
155	002013	中航机电	135,000	3,059,100.00	0.17
156	600612	老凤祥	70,700	3,058,482.00	0.17
157	002314	南山控股	358,400	3,035,648.00	0.17
158	002238	天威视讯	135,900	3,016,980.00	0.17
159	601669	中国电建	374,400	3,006,432.00	0.17
160	601186	中国铁建	222,900	3,004,692.00	0.17
161	601390	中国中铁	274,300	2,995,356.00	0.17
162	601800	中国交建	223,300	2,994,453.00	0.17
163	000637	茂化实华	361,500	2,993,220.00	0.17
164	300262	巴安水务	159,900	2,969,343.00	0.17
165	600655	豫园商城	183,500	2,965,360.00	0.17
166	600600	青岛啤酒	89,300	2,964,760.00	0.17
167	603609	禾丰牧业	218,158	2,960,404.06	0.16
168	002567	唐人神	229,300	2,944,212.00	0.16
169	600804	鹏博士	124,092	2,943,462.24	0.16
170	002155	湖南黄金	324,900	2,920,851.00	0.16
171	601958	金钼股份	351,900	2,913,732.00	0.16
172	600688	上海石化	448,700	2,907,576.00	0.16
173	002646	青青稞酒	127,170	2,902,019.40	0.16
174	002152	广电运通	93,500	2,897,565.00	0.16
175	601098	中南传媒	120,998	2,891,852.20	0.16
176	300287	飞利信	159,500	2,886,950.00	0.16
177	002041	登海种业	170,900	2,879,665.00	0.16
178	300346	南大光电	77,500	2,873,700.00	0.16

179	600373	中文传媒	121,835	2,861,904.15	0.16
180	600551	时代出版	125,755	2,860,926.25	0.16
181	600004	白云机场	201,000	2,860,230.00	0.16
182	600559	老白干酒	47,400	2,852,058.00	0.16
183	600028	中国石化	574,400	2,849,024.00	0.16
184	300150	世纪瑞尔	196,100	2,843,450.00	0.16
185	300138	晨光生物	133,300	2,840,623.00	0.16
186	300076	GQY 视讯	84,300	2,834,166.00	0.16
187	300315	掌趣科技	202,100	2,829,400.00	0.16
188	300319	麦捷科技	78,500	2,826,000.00	0.16
189	601928	凤凰传媒	176,935	2,818,574.55	0.16
190	600778	友好集团	225,000	2,760,750.00	0.15
191	600505	西昌电力	251,500	2,758,955.00	0.15
192	601677	明泰铝业	172,200	2,755,200.00	0.15
193	002151	北斗星通	52,500	2,739,450.00	0.15
194	600764	中电广通	138,900	2,739,108.00	0.15
195	600617	国新能源	177,800	2,725,674.00	0.15
196	002187	广百股份	166,100	2,717,396.00	0.15
197	300375	鹏翎股份	112,620	2,716,394.40	0.15
198	002341	新纶科技	163,000	2,713,950.00	0.15
199	000692	惠天热电	389,000	2,703,550.00	0.15
200	601116	三江购物	210,500	2,702,820.00	0.15
201	600432	吉恩镍业	208,500	2,687,565.00	0.15
202	000553	沙隆达 A	250,900	2,684,630.00	0.15
203	600361	华联综超	331,994	2,672,551.70	0.15
204	300102	乾照光电	252,600	2,657,352.00	0.15
205	300059	东方财富	50,400	2,622,312.00	0.15
206	002323	雅百特	69,895	2,618,266.70	0.15
207	600261	阳光照明	292,707	2,572,894.53	0.14
208	300283	温州宏丰	178,440	2,569,536.00	0.14
209	300146	汤臣倍健	66,600	2,564,100.00	0.14
210	300330	华虹计通	118,362	2,547,150.24	0.14
211	600393	东华实业	203,100	2,544,843.00	0.14
212	000899	赣能股份	219,800	2,540,888.00	0.14
213	601991	大唐发电	493,001	2,534,025.14	0.14
214	002372	伟星新材	141,400	2,528,232.00	0.14
215	000759	中百集团	292,591	2,519,208.51	0.14
216	603123	翠微股份	228,660	2,508,400.20	0.14
217	000951	中国重汽	138,100	2,499,610.00	0.14

218	000539	粤电力 A	339,300	2,493,855.00	0.14
219	600887	伊利股份	151,695	2,492,348.85	0.14
220	600475	华光股份	120,200	2,486,938.00	0.14
221	600686	金龙汽车	129,547	2,486,006.93	0.14
222	002354	天神娱乐	25,900	2,485,882.00	0.14
223	000600	建投能源	232,912	2,482,841.92	0.14
224	002267	陕天然气	196,800	2,479,680.00	0.14
225	601001	大同煤业	445,900	2,474,745.00	0.14
226	002350	北京科锐	121,600	2,472,128.00	0.14
227	002403	爱仕达	155,100	2,470,743.00	0.14
228	002076	雪莱特	136,500	2,461,095.00	0.14
229	000736	中房地产	132,180	2,457,226.20	0.14
230	600007	中国国贸	130,608	2,452,818.24	0.14
231	000966	长源电力	162,400	2,450,616.00	0.14
232	600674	川投能源	227,500	2,447,900.00	0.14
233	000895	双汇发展	118,702	2,422,707.82	0.13
234	000862	银星能源	241,800	2,381,730.00	0.13
235	600795	国电电力	603,200	2,370,576.00	0.13
236	300316	晶盛机电	161,200	2,361,580.00	0.13
237	600027	华电国际	346,300	2,354,840.00	0.13
238	002557	洽洽食品	125,727	2,353,609.44	0.13
239	603288	海天味业	66,557	2,352,789.95	0.13
240	600023	浙能电力	313,800	2,350,362.00	0.13
241	600886	国投电力	279,500	2,333,825.00	0.13
242	002237	恒邦股份	233,718	2,332,505.64	0.13
243	002300	太阳电缆	193,557	2,322,684.00	0.13
244	601231	环旭电子	160,512	2,321,003.52	0.13
245	002729	好利来	30,520	2,313,721.20	0.13
246	300296	利亚德	92,200	2,305,000.00	0.13
247	600468	百利电气	129,900	2,301,828.00	0.13
248	600724	宁波富达	304,000	2,301,280.00	0.13
249	002534	杭锅股份	118,690	2,293,090.80	0.13
250	002661	克明面业	42,600	2,287,620.00	0.13
251	000620	新华联	225,900	2,283,849.00	0.13
252	601179	中国西电	333,400	2,270,454.00	0.13
253	000603	盛达矿业	125,294	2,261,556.70	0.13
254	300020	银江股份	92,000	2,255,840.00	0.13
255	000608	阳光股份	361,000	2,238,200.00	0.12
256	600033	福建高速	524,300	2,233,518.00	0.12

257	000582	北部湾港	98,446	2,216,019.46	0.12
258	000543	皖能电力	259,300	2,196,271.00	0.12
259	300360	炬华科技	61,829	2,170,197.90	0.12
260	000732	泰禾集团	87,929	2,154,260.50	0.12
261	600858	银座股份	194,300	2,148,958.00	0.12
262	600322	天房发展	400,000	2,144,000.00	0.12
263	600885	宏发股份	71,700	2,143,113.00	0.12
264	002180	艾派克	45,600	2,104,440.00	0.12
265	603167	渤海轮渡	169,200	2,101,464.00	0.12
266	600888	新疆众和	235,100	2,066,529.00	0.12
267	002540	亚太科技	205,900	2,054,882.00	0.11
268	300069	金利华电	68,500	2,044,725.00	0.11
269	000002	万科A	83,572	2,041,663.96	0.11
270	002017	东信和平	105,200	2,040,880.00	0.11
271	600658	电子城	145,400	2,031,238.00	0.11
272	300224	正海磁材	87,500	2,026,500.00	0.11
273	002050	三花股份	189,200	2,014,980.00	0.11
274	600463	空港股份	107,783	2,012,308.61	0.11
275	000333	美的集团	61,100	2,005,302.00	0.11
276	002543	万和电气	109,000	1,984,890.00	0.11
277	601872	招商轮船	278,200	1,972,438.00	0.11
278	600259	广晟有色	49,800	1,972,080.00	0.11
279	600535	天士力	48,155	1,970,502.60	0.11
280	001896	豫能控股	161,800	1,959,398.00	0.11
281	601899	紫金矿业	555,900	1,956,768.00	0.11
282	002242	九阳股份	86,100	1,952,748.00	0.11
283	000423	东阿阿胶	37,300	1,950,790.00	0.11
284	600332	白云山	64,322	1,947,026.94	0.11
285	002724	海洋王	69,558	1,944,841.68	0.11
286	600845	宝信软件	33,560	1,940,439.20	0.11
287	600566	济川药业	70,019	1,936,725.54	0.11
288	000623	吉林敖东	62,317	1,928,711.15	0.11
289	000651	格力电器	85,750	1,916,512.50	0.11
290	002317	众生药业	144,600	1,914,504.00	0.11
291	002077	大港股份	95,700	1,909,215.00	0.11
292	000537	广宇发展	163,132	1,908,644.40	0.11
293	002214	大立科技	119,200	1,892,896.00	0.11
294	600011	华能国际	213,441	1,863,339.93	0.10
295	300039	上海凯宝	134,200	1,860,012.00	0.10

296	000538	云南白药	25,600	1,859,072.00	0.10
297	600219	南山铝业	280,700	1,847,006.00	0.10
298	000671	阳光城	204,000	1,842,120.00	0.10
299	300317	珈伟股份	74,575	1,837,528.00	0.10
300	600518	康美药业	108,400	1,837,380.00	0.10
301	600684	珠江实业	181,200	1,837,368.00	0.10
302	300357	我武生物	36,132	1,831,892.40	0.10
303	000709	河北钢铁	546,400	1,819,512.00	0.10
304	000042	中洲控股	86,317	1,804,888.47	0.10
305	002677	浙江美大	82,700	1,804,514.00	0.10
306	002478	常宝股份	126,200	1,798,350.00	0.10
307	600488	天药股份	242,500	1,787,225.00	0.10
308	002305	南国置业	276,800	1,768,752.00	0.10
309	002302	西部建设	98,900	1,762,398.00	0.10
310	601588	北辰实业	328,500	1,760,760.00	0.10
311	000404	华意压缩	188,200	1,759,670.00	0.10
312	600657	信达地产	253,079	1,758,899.05	0.10
313	600426	华鲁恒升	121,785	1,757,357.55	0.10
314	000069	华侨城A	199,500	1,755,600.00	0.10
315	300030	阳普医疗	89,600	1,752,576.00	0.10
316	600019	宝钢股份	313,243	1,747,895.94	0.10
317	600814	杭州解百	141,700	1,747,161.00	0.10
318	000999	华润三九	63,949	1,745,807.70	0.10
319	600240	华业地产	115,700	1,741,285.00	0.10
320	000718	苏宁环球	131,500	1,734,485.00	0.10
321	600340	华夏幸福	56,416	1,733,099.52	0.10
322	300412	迦南科技	38,000	1,729,000.00	0.10
323	300194	福安药业	90,700	1,718,765.00	0.10
324	002007	华兰生物	38,955	1,714,020.00	0.10
325	300355	蒙草抗旱	95,700	1,707,288.00	0.10
326	002450	康得新	44,800	1,706,880.00	0.10
327	300406	九强生物	36,100	1,692,368.00	0.09
328	002262	恩华药业	57,800	1,691,806.00	0.09
329	600048	保利地产	158,700	1,688,568.00	0.09
330	002561	徐家汇	103,486	1,687,856.66	0.09
331	600376	首开股份	134,500	1,681,250.00	0.09
332	000961	中南建设	108,400	1,675,864.00	0.09
333	600771	广誉远	52,400	1,675,752.00	0.09
334	002460	赣锋锂业	26,600	1,673,938.00	0.09

335	601126	四方股份	125,400	1,665,312.00	0.09
336	002756	永兴特钢	30,700	1,657,800.00	0.09
337	600743	华远地产	244,277	1,656,198.06	0.09
338	600266	北京城建	113,100	1,655,784.00	0.09
339	600738	兰州民百	147,700	1,654,240.00	0.09
340	002244	滨江集团	207,700	1,653,292.00	0.09
341	600717	天津港	146,494	1,650,987.38	0.09
342	002628	成都路桥	221,400	1,649,430.00	0.09
343	601158	重庆水务	176,301	1,644,888.33	0.09
344	600828	成商集团	171,600	1,637,064.00	0.09
345	300292	吴通控股	38,500	1,628,550.00	0.09
346	000656	金科股份	308,000	1,626,240.00	0.09
347	600853	龙建股份	211,800	1,611,798.00	0.09
348	000150	宜华健康	42,200	1,607,820.00	0.09
349	600714	金瑞矿业	135,536	1,604,746.24	0.09
350	603889	新澳股份	50,760	1,601,478.00	0.09
351	600606	金丰投资	97,754	1,596,322.82	0.09
352	600211	西藏药业	36,240	1,586,587.20	0.09
353	600790	轻纺城	192,500	1,565,025.00	0.09
354	600459	贵研铂业	74,600	1,563,616.00	0.09
355	002653	海思科	71,200	1,558,568.00	0.09
356	600218	全柴动力	114,300	1,551,051.00	0.09
357	600111	北方稀土	110,586	1,550,415.72	0.09
358	600196	复星医药	65,900	1,547,991.00	0.09
359	601208	东材科技	164,600	1,542,302.00	0.09
360	600018	上港集团	237,300	1,537,704.00	0.09
361	601139	深圳燃气	168,600	1,534,260.00	0.09
362	600389	江山股份	57,800	1,531,122.00	0.09
363	600533	栖霞建设	225,500	1,526,635.00	0.09
364	600648	外高桥	58,100	1,526,287.00	0.09
365	000609	绵世股份	100,000	1,521,000.00	0.08
366	600705	中航资本	97,500	1,519,050.00	0.08
367	600378	天科股份	73,100	1,516,825.00	0.08
368	002635	安洁科技	54,300	1,509,540.00	0.08
369	002038	双鹭药业	45,050	1,509,175.00	0.08
370	603011	合锻股份	59,100	1,499,367.00	0.08
371	000949	新乡化纤	280,900	1,491,579.00	0.08
372	300177	中海达	77,700	1,490,286.00	0.08
373	002146	荣盛发展	155,578	1,482,658.34	0.08

374	000661	长春高新	12,300	1,481,535.00	0.08
375	000536	华映科技	100,400	1,479,896.00	0.08
376	300261	雅本化学	97,866	1,477,776.60	0.08
377	600823	世茂股份	120,655	1,475,610.65	0.08
378	000693	华泽钴镍	79,046	1,472,626.98	0.08
379	002436	兴森科技	76,200	1,466,850.00	0.08
380	000540	中天城投	160,300	1,461,936.00	0.08
381	603993	洛阳钼业	327,675	1,461,430.50	0.08
382	002347	泰尔重工	61,800	1,460,334.00	0.08
383	000046	泛海控股	116,300	1,459,565.00	0.08
384	002414	高德红外	47,900	1,459,513.00	0.08
385	002352	鼎泰新材	45,400	1,453,254.00	0.08
386	002344	海宁皮城	94,030	1,442,420.20	0.08
387	600971	恒源煤电	229,181	1,441,548.49	0.08
388	300196	长海股份	40,500	1,441,395.00	0.08
389	601678	滨化股份	176,000	1,411,520.00	0.08
390	000597	东北制药	136,000	1,410,320.00	0.08
391	000550	江铃汽车	46,844	1,404,383.12	0.08
392	600746	江苏索普	149,000	1,403,580.00	0.08
393	002648	卫星石化	129,400	1,398,814.00	0.08
394	300306	远方光电	74,800	1,396,516.00	0.08
395	603699	纽威股份	63,880	1,393,861.60	0.08
396	601369	陕鼓动力	159,000	1,389,660.00	0.08
397	002209	达意隆	60,200	1,379,182.00	0.08
398	002645	华宏科技	55,600	1,359,976.00	0.08
399	000525	红太阳	80,250	1,359,435.00	0.08
400	603688	石英股份	56,476	1,350,905.92	0.08
401	300389	艾比森	27,499	1,347,725.99	0.08
402	300218	安利股份	77,000	1,347,500.00	0.08
403	000916	华北高速	221,400	1,335,042.00	0.07
404	000880	潍柴重机	80,700	1,333,164.00	0.07
405	300398	飞凯材料	16,700	1,328,986.00	0.07
406	600841	上柴股份	87,700	1,326,901.00	0.07
407	300180	华峰超纤	87,647	1,306,816.77	0.07
408	601798	蓝科高新	91,400	1,291,482.00	0.07
409	600123	兰花科创	160,300	1,287,209.00	0.07
410	600847	万里股份	38,800	1,283,892.00	0.07
411	000528	柳工	154,150	1,277,903.50	0.07
412	300158	振东制药	62,800	1,271,700.00	0.07

413	300233	金城医药	38,900	1,270,474.00	0.07
414	000571	新大洲A	153,059	1,270,389.70	0.07
415	002595	豪迈科技	55,817	1,266,487.73	0.07
416	002258	利尔化学	49,500	1,262,250.00	0.07
417	600557	康缘药业	50,300	1,258,506.00	0.07
418	600285	羚锐制药	94,700	1,254,775.00	0.07
419	000983	西山煤电	206,300	1,254,304.00	0.07
420	600879	航天电子	70,100	1,252,687.00	0.07
421	300405	科隆精化	21,100	1,244,689.00	0.07
422	002449	国星光电	73,300	1,238,770.00	0.07
423	600062	华润双鹤	54,295	1,238,468.95	0.07
424	600320	振华重工	206,500	1,232,805.00	0.07
425	002051	中工国际	48,600	1,231,038.00	0.07
426	600161	天坛生物	35,000	1,222,550.00	0.07
427	601088	中国神华	81,550	1,220,803.50	0.07
428	300255	常山药业	69,700	1,220,447.00	0.07
429	601100	恒立油缸	73,500	1,220,100.00	0.07
430	000908	景峰医药	75,600	1,218,672.00	0.07
431	600118	中国卫星	28,600	1,216,644.00	0.07
432	300298	三诺生物	33,800	1,215,448.00	0.07
433	601177	杭齿前进	110,076	1,207,533.72	0.07
434	600856	长百集团	44,800	1,205,120.00	0.07
435	300396	迪瑞医疗	24,997	1,200,105.97	0.07
436	600348	阳泉煤业	185,500	1,198,330.00	0.07
437	002201	九鼎新材	74,700	1,195,947.00	0.07
438	600496	精工钢构	198,200	1,191,182.00	0.07
439	600970	中材国际	99,555	1,189,682.25	0.07
440	002233	塔牌集团	80,400	1,177,860.00	0.07
441	002437	誉衡药业	38,364	1,160,511.00	0.06
442	601117	中国化学	167,000	1,150,630.00	0.06
443	002324	普利特	36,300	1,146,354.00	0.06
444	300032	金龙机电	37,600	1,143,040.00	0.06
445	600143	金发科技	132,900	1,142,940.00	0.06
446	300107	建新股份	138,200	1,113,892.00	0.06
447	002745	木林森	27,100	1,109,203.00	0.06
448	002061	江山化工	119,400	1,105,644.00	0.06
449	300285	国瓷材料	24,200	1,101,100.00	0.06
450	600585	海螺水泥	64,290	1,099,359.00	0.06
451	002501	利源精制	87,100	1,095,718.00	0.06

452	600668	尖峰集团	61,700	1,087,154.00	0.06
453	000997	新大陆	42,900	1,086,228.00	0.06
454	002037	久联发展	39,100	1,085,416.00	0.06
455	600363	联创光电	53,000	1,083,850.00	0.06
456	000818	方大化工	115,300	1,083,820.00	0.06
457	000789	万年青	127,263	1,079,190.24	0.06
458	000523	广州浪奇	71,400	1,076,712.00	0.06
459	603188	亚邦股份	48,000	1,074,240.00	0.06
460	002203	海亮股份	96,900	1,065,900.00	0.06
461	600623	双钱股份	56,000	1,061,200.00	0.06
462	300067	安诺其	102,300	1,060,851.00	0.06
463	601607	上海医药	52,900	1,053,239.00	0.06
464	002391	长青股份	59,100	1,053,162.00	0.06
465	600362	江西铜业	66,900	1,053,006.00	0.06
466	002177	御银股份	97,000	1,052,450.00	0.06
467	600056	中国医药	63,200	1,051,016.00	0.06
468	002382	蓝帆医疗	37,500	1,048,500.00	0.06
469	600486	扬农化工	35,717	1,047,936.78	0.06
470	600703	三安光电	43,100	1,046,468.00	0.06
471	000725	京东方A	352,100	1,045,737.00	0.06
472	600990	四创电子	16,600	1,041,650.00	0.06
473	000758	中色股份	69,400	1,032,672.00	0.06
474	600985	雷鸣科化	75,056	1,029,768.32	0.06
475	300343	联创股份	10,500	1,028,790.00	0.06
476	002616	长青集团	38,235	1,018,198.05	0.06
477	002415	海康威视	29,495	1,014,333.05	0.06
478	000963	华东医药	12,346	1,011,878.16	0.06
479	002554	惠博普	77,700	1,010,100.00	0.06
480	300115	长盈精密	29,600	993,672.00	0.06
481	300082	奥克股份	119,700	988,722.00	0.06
482	002453	天马精化	87,600	985,500.00	0.05
483	000021	深科技	81,200	979,272.00	0.05
484	600639	浦东金桥	43,400	971,726.00	0.05
485	002236	大华股份	26,307	970,728.30	0.05
486	002293	罗莱生活	53,200	970,368.00	0.05
487	601028	玉龙股份	103,480	969,607.60	0.05
488	600782	新钢股份	171,584	969,449.60	0.05
489	600583	海油工程	107,460	961,767.00	0.05
490	002376	新北洋	51,971	960,424.08	0.05

491	601666	平煤股份	204,900	954,834.00	0.05
492	300127	银河磁体	52,339	951,523.02	0.05
493	300386	飞天诚信	19,226	950,725.70	0.05
494	002065	东华软件	37,800	948,780.00	0.05
495	002150	通润装备	74,400	943,392.00	0.05
496	300002	神州泰岳	71,900	941,890.00	0.05
497	601808	中海油服	60,300	935,856.00	0.05
498	300384	三联虹普	11,100	934,620.00	0.05
499	002202	金风科技	41,000	934,390.00	0.05
500	600487	亨通光电	58,200	927,708.00	0.05
501	002691	冀凯股份	38,700	919,512.00	0.05
502	600521	华海药业	36,200	919,118.00	0.05
503	300209	天泽信息	35,086	905,218.80	0.05
504	300440	运达科技	10,500	904,260.00	0.05
505	002696	百洋股份	36,100	901,417.00	0.05
506	000530	大冷股份	47,225	896,330.50	0.05
507	002609	捷顺科技	42,900	894,894.00	0.05
508	002158	汉钟精机	40,281	893,432.58	0.05
509	600979	广安爱众	114,200	877,056.00	0.05
510	002421	达实智能	40,000	876,000.00	0.05
511	002195	二三四五	23,600	873,200.00	0.05
512	300170	汉得信息	43,800	869,430.00	0.05
513	002281	光迅科技	13,300	862,239.00	0.05
514	002672	东江环保	42,600	859,242.00	0.05
515	603806	福斯特	17,153	857,478.47	0.05
516	600843	上工申贝	51,000	855,270.00	0.05
517	002663	普邦园林	107,100	850,374.00	0.05
518	300271	华宇软件	17,903	850,034.44	0.05
519	000513	丽珠集团	14,800	849,964.00	0.05
520	002099	海翔药业	35,600	849,060.00	0.05
521	000998	隆平高科	35,600	845,500.00	0.05
522	000826	启迪桑德	21,300	843,906.00	0.05
523	002373	千方科技	18,400	841,800.00	0.05
524	300112	万讯自控	43,400	839,790.00	0.05
525	600064	南京高科	44,300	839,485.00	0.05
526	300079	数码视讯	69,100	837,492.00	0.05
527	002649	博彦科技	14,700	827,316.00	0.05
528	000063	中兴通讯	44,360	826,426.80	0.05
529	002245	澳洋顺昌	82,131	822,952.62	0.05

530	002573	清新环境	36,600	821,304.00	0.05
531	002104	恒宝股份	34,224	821,033.76	0.05
532	600498	烽火通信	28,700	818,237.00	0.05
533	002552	宝鼎重工	48,500	816,740.00	0.05
534	600262	北方股份	19,300	816,390.00	0.05
535	002630	华西能源	55,200	815,304.00	0.05
536	002662	京威股份	37,000	814,000.00	0.05
537	600485	信威集团	30,300	810,525.00	0.05
538	002063	远光软件	38,300	809,662.00	0.05
539	002375	亚厦股份	51,130	806,320.10	0.04
540	300033	同花顺	11,200	795,760.00	0.04
541	300129	泰胜风能	85,700	795,296.00	0.04
542	601579	会稽山	57,485	795,017.55	0.04
543	002081	金螳螂	42,400	792,032.00	0.04
544	300118	东方日升	53,900	785,323.00	0.04
545	600290	华仪电气	50,900	784,369.00	0.04
546	300026	红日药业	36,900	778,590.00	0.04
547	002531	天顺风能	56,600	778,250.00	0.04
548	002479	富春环保	57,700	773,180.00	0.04
549	300055	万邦达	35,600	772,876.00	0.04
550	002396	星网锐捷	31,900	770,385.00	0.04
551	002692	远程电缆	38,600	768,140.00	0.04
552	603118	共进股份	16,300	766,915.00	0.04
553	600522	中天科技	33,300	762,570.00	0.04
554	300017	网宿科技	12,700	761,873.00	0.04
555	600676	交运股份	53,300	752,063.00	0.04
556	600461	洪城水业	45,700	739,883.00	0.04
557	600664	哈药股份	60,300	719,379.00	0.04
558	002275	桂林三金	30,600	712,980.00	0.04
559	002294	信立泰	23,600	710,832.00	0.04
560	600380	健康元	51,153	706,934.46	0.04
561	600270	外运发展	26,099	706,238.94	0.04
562	000685	中山公用	49,000	693,350.00	0.04
563	600884	杉杉股份	17,489	686,268.36	0.04
564	002537	海立美达	41,200	683,508.00	0.04
565	000418	小天鹅A	28,400	681,600.00	0.04
566	000598	兴蓉环境	95,400	679,248.00	0.04
567	603100	川仪股份	37,300	676,622.00	0.04
568	300124	汇川技术	14,200	670,240.00	0.04

569	300258	精锻科技	37,100	662,235.00	0.04
570	002454	松芝股份	34,400	660,136.00	0.04
571	002028	思源电气	41,400	657,846.00	0.04
572	601567	三星电气	43,200	655,344.00	0.04
573	601222	林洋电子	17,400	639,102.00	0.04
574	000887	中鼎股份	26,900	634,840.00	0.04
575	000919	金陵药业	36,800	632,960.00	0.04
576	600742	一汽富维	21,600	627,264.00	0.03
577	002241	歌尔声学	18,100	626,260.00	0.03
578	000581	威孚高科	25,000	619,000.00	0.03
579	600811	东方集团	71,200	618,016.00	0.03
580	600660	福耀玻璃	40,500	615,195.00	0.03
581	600741	华域汽车	36,482	615,086.52	0.03
582	300433	蓝思科技	7,328	611,008.64	0.03
583	600846	同济科技	50,900	608,764.00	0.03
584	600260	凯乐科技	40,600	606,564.00	0.03
585	600708	海博股份	47,150	603,048.50	0.03
586	002025	航天电器	23,200	602,968.00	0.03
587	000700	模塑科技	24,800	601,896.00	0.03
588	000338	潍柴动力	62,000	598,920.00	0.03
589	002040	南京港	47,600	596,428.00	0.03
590	300015	爱尔眼科	18,800	593,704.00	0.03
591	002179	中航光电	15,476	587,468.96	0.03
592	002033	丽江旅游	33,200	584,320.00	0.03
593	002126	银轮股份	31,300	577,485.00	0.03
594	002327	富安娜	47,400	570,222.00	0.03
595	002475	立讯精密	17,700	565,515.00	0.03
596	002154	报喜鸟	73,800	561,618.00	0.03
597	603901	永创智能	14,900	557,558.00	0.03
598	600177	雅戈尔	33,900	551,892.00	0.03
599	603611	诺力股份	13,800	537,372.00	0.03
600	600366	宁波韵升	24,400	532,896.00	0.03
601	603168	莎普爱思	9,300	512,244.00	0.03
602	601888	中国国旅	8,600	510,066.00	0.03
603	600138	中青旅	21,700	505,827.00	0.03
604	002509	天广消防	24,100	504,895.00	0.03
605	300382	斯莱克	10,600	502,970.00	0.03
606	600114	东睦股份	30,600	494,496.00	0.03
607	603012	创力集团	18,700	491,810.00	0.03

608	002430	杭氧股份	42,697	491,015.50	0.03
609	603686	龙马环卫	12,300	488,556.00	0.03
610	300210	森远股份	26,078	477,488.18	0.03
611	601038	一拖股份	34,500	477,135.00	0.03
612	600499	科达洁能	20,800	470,704.00	0.03
613	603969	银龙股份	23,500	469,060.00	0.03
614	603338	浙江鼎力	8,700	464,319.00	0.03
615	600835	上海机电	15,278	463,076.18	0.03
616	603001	奥康国际	13,700	460,594.00	0.03
617	600761	安徽合力	34,500	460,575.00	0.03
618	002367	康力电梯	27,200	456,144.00	0.03
619	600388	龙净环保	25,700	444,096.00	0.02
620	000039	中集集团	20,537	431,277.00	0.02
621	600894	广日股份	21,565	431,084.35	0.02
622	601313	江南嘉捷	27,000	423,360.00	0.02
623	300171	东富龙	14,100	422,718.00	0.02
624	600582	天地科技	60,500	413,215.00	0.02
625	601188	龙江交通	71,400	412,692.00	0.02
626	600780	通宝能源	56,974	403,945.66	0.02
627	600335	国机汽车	21,305	399,255.70	0.02
628	600287	江苏舜天	31,600	386,468.00	0.02
629	600697	欧亚集团	9,269	384,107.36	0.02
630	600529	山东药玻	19,200	371,136.00	0.02
631	300014	亿纬锂能	11,000	361,020.00	0.02
632	002056	横店东磁	12,800	359,808.00	0.02
633	000151	中成股份	14,700	359,268.00	0.02
634	300003	乐普医疗	9,300	358,980.00	0.02
635	002533	金杯电工	36,400	358,540.00	0.02
636	600419	天润乳业	10,100	355,621.00	0.02
637	000541	佛山照明	21,200	354,040.00	0.02
638	600694	大商股份	6,779	349,999.77	0.02
639	002223	鱼跃医疗	9,100	349,895.00	0.02
640	600723	首商股份	31,444	349,342.84	0.02
641	002441	众业达	15,500	343,325.00	0.02
642	601700	风范股份	33,800	337,662.00	0.02
643	600312	平高电气	17,300	337,350.00	0.02
644	300214	日科化学	30,600	333,846.00	0.02
645	600089	特变电工	28,349	333,667.73	0.02
646	601877	正泰电器	12,900	332,691.00	0.02

647	600470	六国化工	29,200	332,004.00	0.02
648	000501	鄂武商 A	15,500	331,700.00	0.02
649	002008	大族激光	12,800	331,392.00	0.02
650	600859	王府井	12,100	329,362.00	0.02
651	002277	友阿股份	23,600	327,804.00	0.02
652	600176	中国巨石	12,900	327,789.00	0.02
653	600973	宝胜股份	20,700	320,229.00	0.02
654	300301	长方照明	28,900	310,386.00	0.02
655	600182	S 佳通	13,800	306,774.00	0.02
656	002080	中材科技	11,500	306,130.00	0.02
657	002470	金正大	15,000	305,100.00	0.02
658	002597	金禾实业	27,700	304,700.00	0.02
659	000830	鲁西化工	43,900	304,227.00	0.02
660	002538	司尔特	24,100	303,901.00	0.02
661	002165	红宝丽	34,300	302,869.00	0.02
662	002440	闰土股份	15,880	302,514.00	0.02
663	300072	三聚环保	8,900	302,333.00	0.02
664	600803	新奥股份	19,000	301,340.00	0.02
665	600309	万华化学	16,733	298,684.05	0.02
666	002250	联化科技	15,800	298,146.00	0.02
667	600458	时代新材	16,600	293,820.00	0.02
668	002004	华邦健康	20,200	285,830.00	0.02
669	600352	浙江龙盛	23,900	278,196.00	0.02
670	002588	史丹利	8,400	273,252.00	0.02
671	300250	初灵信息	3,300	262,647.00	0.01
672	600409	三友化工	32,400	251,100.00	0.01
673	601216	内蒙君正	21,400	245,030.00	0.01
674	300183	东软载波	8,600	231,942.00	0.01
675	002185	华天科技	12,800	229,504.00	0.01
676	300373	扬杰科技	10,600	227,370.00	0.01
677	300313	天山生物	12,300	217,710.00	0.01
678	002444	巨星科技	9,900	204,930.00	0.01
679	002510	天汽模	11,300	200,349.00	0.01
680	002532	新界泵业	12,200	186,172.00	0.01
681	300145	南方泵业	3,900	185,718.00	0.01
682	002686	亿利达	10,400	183,248.00	0.01
683	000570	苏常柴 A	16,700	182,364.00	0.01
684	300193	佳士科技	13,600	181,016.00	0.01
685	002559	亚威股份	10,900	173,419.00	0.01

686	300154	瑞凌股份	12,500	172,500.00	0.01
687	600481	双良节能	18,700	169,422.00	0.01
688	600382	广东明珠	10,200	161,772.00	0.01
689	000018	神州长城	2,202	108,338.40	0.01
690	603555	贵人鸟	3,000	106,290.00	0.01
691	300270	中威电子	2,927	69,779.68	0.00
692	002113	天润控股	1,000	39,700.00	0.00
693	000563	陕国投 A	1,708	25,824.96	0.00
694	002419	天虹商场	1,600	21,600.00	0.00
695	000596	古井贡酒	96	3,504.00	0.00
696	300351	永贵电器	99	3,098.70	0.00
697	002582	好想你	100	1,562.00	0.00
698	300038	梅泰诺	21	1,190.28	0.00
699	000926	福星股份	35	589.40	0.00
700	600578	京能电力	97	588.79	0.00
701	002059	云南旅游	34	430.44	0.00
702	002082	栋梁新材	37	377.77	0.00
703	601818	光大银行	76	322.24	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600030	中信证券	261,643,361.30	14.58
2	601318	中国平安	199,645,308.34	11.12
3	601166	兴业银行	174,108,739.25	9.70
4	601288	农业银行	122,561,490.93	6.83
5	600999	招商证券	118,781,708.57	6.62
6	600036	招商银行	116,016,298.68	6.46
7	600015	华夏银行	115,590,846.49	6.44
8	000651	格力电器	114,811,109.15	6.40
9	601169	北京银行	110,643,615.52	6.16
10	600016	民生银行	109,396,619.71	6.09
11	600000	浦发银行	97,299,403.80	5.42
12	002480	新筑股份	90,900,514.00	5.06

13	600369	西南证券	83,282,490.16	4.64
14	000600	建投能源	75,510,342.90	4.21
15	601818	光大银行	65,305,059.93	3.64
16	600236	桂冠电力	64,025,846.34	3.57
17	601088	中国神华	61,430,046.29	3.42
18	000776	广发证券	59,881,643.68	3.34
19	000001	平安银行	59,270,774.14	3.30
20	000550	江铃汽车	57,632,985.20	3.21
21	600519	贵州茅台	55,678,016.91	3.10
22	601328	交通银行	51,267,577.35	2.86
23	603993	洛阳钼业	50,956,920.83	2.84
24	600801	华新水泥	50,889,148.82	2.84
25	000789	万年青	49,394,850.51	2.75
26	000989	九芝堂	48,895,845.72	2.72
27	601117	中国化学	48,430,758.65	2.70
28	600720	祁连山	47,282,664.15	2.63
29	600585	海螺水泥	47,064,977.97	2.62
30	000623	吉林敖东	45,110,947.08	2.51
31	601668	中国建筑	44,931,731.88	2.50
32	600887	伊利股份	44,873,765.34	2.50
33	601601	中国太保	44,797,629.15	2.50
34	002025	航天电器	44,632,522.90	2.49
35	601398	工商银行	43,481,710.34	2.42
36	600029	南方航空	43,012,890.80	2.40
37	600048	保利地产	42,455,464.77	2.37
38	600823	世茂股份	42,219,044.94	2.35
39	601988	中国银行	42,142,070.00	2.35
40	002179	中航光电	41,888,740.59	2.33
41	000895	双汇发展	41,467,889.55	2.31
42	600252	中恒集团	41,165,560.46	2.29
43	600606	绿地控股	40,657,532.42	2.27
44	600297	广汇汽车	40,557,962.62	2.26
45	601098	中南传媒	40,267,597.90	2.24
46	000002	万科A	40,054,844.90	2.23
47	002013	中航机电	39,796,005.84	2.22
48	601788	光大证券	38,641,988.33	2.15

49	600350	山东高速	37,397,628.62	2.08
----	--------	------	---------------	------

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

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600030	中信证券	222,178,162.96	12.38
2	601318	中国平安	159,374,853.05	8.88
3	601166	兴业银行	127,358,105.09	7.10
4	601169	北京银行	112,015,801.32	6.24
5	600036	招商银行	109,032,260.95	6.07
6	600015	华夏银行	107,063,304.79	5.96
7	600016	民生银行	99,942,850.96	5.57
8	000651	格力电器	98,625,152.97	5.49
9	600000	浦发银行	96,709,097.70	5.39
10	600999	招商证券	78,900,341.05	4.40
11	601288	农业银行	77,593,677.00	4.32
12	002480	新筑股份	72,872,819.80	4.06
13	000600	建投能源	69,195,834.84	3.86
14	600369	西南证券	64,869,505.95	3.61
15	601818	光大银行	58,957,826.59	3.28
16	600236	桂冠电力	57,884,060.42	3.22
17	000001	平安银行	53,006,749.74	2.95
18	601088	中国神华	52,828,081.41	2.94
19	000550	江铃汽车	50,323,154.99	2.80
20	600519	贵州茅台	49,905,498.90	2.78
21	002025	航天电器	49,717,094.52	2.77
22	603993	洛阳钼业	48,617,106.39	2.71
23	000989	九芝堂	47,816,426.83	2.66
24	002179	中航光电	47,063,036.29	2.62
25	600801	华新水泥	46,894,615.85	2.61
26	000776	广发证券	46,516,898.33	2.59
27	000789	万年青	45,155,672.23	2.52
28	600720	祁连山	44,110,239.44	2.46
29	600585	海螺水泥	43,692,759.94	2.43
30	600252	中恒集团	41,882,160.08	2.33
31	601117	中国化学	41,633,731.68	2.32

32	600887	伊利股份	39,762,103.69	2.22
33	601788	光大证券	39,721,327.19	2.21
34	601601	中国太保	39,139,101.91	2.18
35	000623	吉林敖东	39,003,886.21	2.17
36	600823	世茂股份	38,526,874.09	2.15
37	000002	万科A	38,021,703.94	2.12
38	601328	交通银行	37,733,473.32	2.10
39	601988	中国银行	37,531,002.00	2.09
40	000895	双汇发展	37,090,947.69	2.07
41	600048	保利地产	36,792,665.30	2.05
42	601098	中南传媒	36,344,638.49	2.02

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	8,914,583,900.87
卖出股票收入（成交）总额	7,401,846,204.89

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的规定，本基金将本着谨慎原则，适度参与股指期货投资。通过对现货市场和期货市场运行趋势的研究，结合基金股票组合的实际情况及对股指期货的估值水平、基差水平、流动性等因素的分析，选择合适的期货合约构建相应的头寸，以调整投资组合的风险暴露，降低系统性风险。本基金还将利用股指期货作为组合流动性管理工具，降低现货市场流动性不足导致的冲击成本过高的风险，提高基金的建仓或变现效率。

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广发证券股份有限公司（以下简称“广发证券”）、中信证券股份有限公司（以下简称“中信证券”）、招商证券股份有限公司（以下简称“招商证券”）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 1 月 16 日，中国证监会通报 2014 年第四季度证券公司融资类业务现场检查情况，指出中信证券存在违规为到期融资融券合约展期问题，受过处理仍未改正，且涉及客户数量较多，对其采取暂停新开融资融券客户信用账户 3 个月的行政监管措施。招商证券存在向不符合条件的客户融资融券问题，并且受过处理仍未改正；广发证券存在向不符合条件的客户融资融券、违规为到期融资融券合约展期问题，且涉及客户数量较多，对 2 家公司采取责令限期改正的行政监管措施。

2015 年 6 月 2 日，中国证监会深圳证监局发布《深圳证监局关于对招商证券股份有限公司采取出具警示函、责令整改并处分有关责任人员措施的决定》（（2015）24 号），对招商证券给予出具警示函、责令整改的监督管理措施。

2015 年 9 月 12 日，广发证券公告其于 2015 年 8 月 24 日收到中国证监会《调查通知书》（鄂

证调查字 2015023 号)，并于 2015 年 9 月 10 日收到中国证监会《行政处罚事先告知书》（处罚字 [2015]71 号），广发证券在公告中陈述了《调查通知书》和《行政处罚事先告知书》的内容。

2015 年 11 月 27 日，中信证券公告其于 2015 年 11 月 26 日收到中国证监会《调查通知书》（稽查总队调查字 153121 号），中信证券在公告中说明，因公司涉嫌违反《证券公司监督管理条例》相关规定，中国证监会决定对公司进行立案调查。

本基金投资广发证券（000776）、中信证券（600030）、招商证券（600999）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，认为上述事件对广发证券、中信证券、招商证券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未超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,323,181.02
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	60,604.03
5	应收申购款	641,750.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,025,535.23

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
25,933	65,601.48	52,016,507.04	3.06%	1,649,226,736.59	96.94%

### 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	26,364.65	0.0015%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 ( 2015 年 6 月 2 日 ) 基金份额总额	2,576,611,172.81
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	44,031,152.83
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	919,399,082.01
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额 (份 额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	1,701,243,243.63

## § 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

本基金基金合同于 2015 年 6 月 2 日生效，2015 年度系首次进行基金年度审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）系首次向本基金提供审计服务。报告期内本基金应支付给聘任会计师事务所——普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）2015 年度审计的报酬为 115,000 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国信证券	1	3,480,918,417.50	21.33%	3,204,049.54	21.33%	-
银河证券	1	1,827,479,720.33	11.20%	1,682,794.00	11.20%	-
安信证券	2	1,719,385,365.57	10.54%	1,590,555.92	10.59%	-
国泰君安	1	1,207,812,441.09	7.40%	1,122,442.78	7.47%	-
兴业证券	1	1,176,988,942.29	7.21%	1,077,845.17	7.17%	-
海通证券	1	975,139,962.27	5.98%	898,624.91	5.98%	-
华创证券	1	861,733,078.62	5.28%	802,536.02	5.34%	-
民生证券	1	848,624,259.80	5.20%	784,181.07	5.22%	-
光大证券	1	828,461,941.37	5.08%	768,235.09	5.11%	-
东方证券	2	697,145,177.49	4.27%	649,252.88	4.32%	-
广发证券	1	576,279,005.05	3.53%	524,647.02	3.49%	-
中投证券	1	536,379,480.13	3.29%	494,721.78	3.29%	-
长江证券	2	408,228,278.66	2.50%	373,613.46	2.49%	-
宏信证券	1	332,577,152.44	2.04%	309,730.14	2.06%	-
中泰证券	2	217,553,204.46	1.33%	201,245.07	1.34%	-
方正证券	2	159,536,892.65	0.98%	148,576.93	0.99%	-
中信万通	2	154,580,749.06	0.95%	109,814.88	0.73%	-
中金公司	1	154,105,783.05	0.94%	140,298.56	0.93%	-
国金证券	1	78,731,817.08	0.48%	71,675.40	0.48%	-
国海证券	1	74,768,436.85	0.46%	68,069.46	0.45%	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
中信证券	5	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-

中信建投	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
  - (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. 本基金本报告期的交易单元均为新增交易单元。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
国信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	1,800,000,000.00	29.27%	-	-
兴业证券	-	-	3,750,000,000.00	60.98%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

方正证券	-	-	-	-	-	-
中信万通	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	600,000,000.00	9.76%	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

### 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	本基金募集信披文件	《证券时报》	2015年5月18日
2	关于本基金增加销售机构的公告	《证券时报》	2015年5月21日
3	关于本基金增加华泰证券为销售机构的公告	《证券时报》	2015年5月22日
4	关于本增加中信银行为销售机构的公告	《证券时报》	2015年5月25日
5	关于本基金增加浦发银行为销售机构的公告	《证券时报》	2015年5月27日
6	关于本基金提前结束募集的公告	《证券时报》	2015年5月29日
7	本公司高级管理人员变更公告	《证券时报》	2015年5月30日
8	本基金基金合同生效公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年6月3日
9	本公司关于旗下部分基金参与交通银行网上银行、手机银行申购费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年6月30日
10	本公司关于旗下基金调整停牌股票估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年7月9日
11	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年7月10日
12	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年7月11日
13	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年7月13日

14	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 7 月 14 日
15	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 7 月 16 日
16	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 7 月 16 日
17	本公司关于部分基金参与平安证券申购费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 7 月 20 日
18	本公司关于新增银联通部分银行卡网上直销业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 7 月 21 日
19	本基金基金经理变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 7 月 25 日
20	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 7 月 27 日
21	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 7 月 30 日
22	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 8 月 3 日
23	本基金基金经理变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 8 月 13 日
24	本公司关于旗下基金调整停牌股票“豫能控股”估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 8 月 14 日
25	本公司关于董事变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 8 月 20 日
26	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 8 月 25 日
27	关于本基金参与部分销售机构申购费率优惠活动公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 8 月 28 日
28	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 8 月 28 日
29	本基金开放日常申购（赎回、转换、定期定额投资）业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 8 月 28 日
30	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 9 月 1 日
31	本公司关于旗下基金调整停牌股票“大洲兴业”估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 9 月 7 日
32	本公司关于旗下基金调整停牌股票“南京港”估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 9 月 16 日
33	本公司关于旗下部分开放式基金变更业绩比较基准及修改相关基金合同的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 9 月 29 日

34	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 10 月 8 日
35	本公司关于旗下基金调整停牌股票“新南洋”估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 10 月 20 日
36	本公司关于旗下基金调整停牌股票“北京银行”估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 10 月 26 日
37	本基金 2015 年 3 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 10 月 27 日
38	本公司关于旗下基金调整停牌股票“大洲兴业”估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 11 月 11 日
39	本公司关于旗下部分基金增加上海长量基金销售投资顾问有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 12 月 1 日
40	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 12 月 1 日
41	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 12 月 11 日
42	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 12 月 31 日
43	本公司关于旗下部分基金参与平安银行申购及定期定额申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 12 月 31 日

注：上述公告同时在公司网站 [www.msfnunds.com.cn](http://www.msfnunds.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