

摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：摩根士丹利华鑫基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
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	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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	33
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	37
7.6 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	37
7.7 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	37
7.8 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	37
7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	37
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	38
7.11 投资组合报告附注	38
§8 基金份额持有人信息	39

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	39
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	39
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	39
§9 开放式基金份额变动.....	39
§10 重大事件揭示.....	40
10.1 基金份额持有人大会决议	40
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	40
10.4 基金投资策略的改变	40
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	40
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	40
10.8 其他重大事件	42
§11 备查文件目录.....	43
11.1 备查文件目录	43
11.2 存放地点	43
11.3 查阅方式	43

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金
基金简称	大摩基础行业混合
基金主代码	233001
交易代码	233001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004 年 3 月 26 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	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	154,314,096.83 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	分享中国经济持续发展过程所带来的基础行业的稳定增长，为基金份额持有人谋求长期、稳定的投资回报。
投资策略	(1) 股票投资策略 基于宏观经济的自上而下方式，结合自下而上个股精选，形成动态股票组合，追求持续稳定收益。 (2) 债券投资策略 我们以“类别资产配置、久期管理”为核心，通过“自上而下”的投资策略，以长期利率趋势分析为基础，兼顾中短期经济周期、政策方向等因素在类别资产配置、不同市场间的资产配置、券种选择三个层面进行投资管理；并结合使用“自下而上”的投资策略，即收益率曲线分析，久期管理，新债分析，信用分析，流动性分析等方法，实施动态投资管理，动态调整组合的投资品种，以达到预期投资目标。 (3) 权证投资策略 对权证的投资建立在对标的证券和组合收益风险进行分析的基础之上，权证在基金的投资中将主要起到锁定收益和控制风险的作用。以 BS 模型和二叉树模型为基础来对权证进行定价，并根据市场情况对定价模型和参数进行适当修正。在组合构建和操作中运用的投资策略主要包括但不限于保护性看跌策略、抛补的认购权证、双限策略等。
业绩比较基准	沪深 300 指数×55% + 中证综合债券指数×45%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期收益和风险高于货币型基金、债券型基金，而低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险、中高收益品种。

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	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李锦	张建春
	联系电话	(0755) 88318883	(010) 63639180
	电子邮箱	xxpl@msfunds.com.cn	zhangjianchun@cebbank.com
客户服务电话		400-8888-668	95595
传真		(0755) 82990384	(010) 63639132
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	北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心
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	北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心
邮政编码		518048	100033
法定代表人		YU HUA(于华)	唐双宁

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.msfunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	摩根士丹利华鑫基金管理有限公司	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第二座第 17 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	291,802.66
本期利润	-6,541,671.78
加权平均基金份额本期利润	-0.0406

本期加权平均净值利润率	-5.37%
本期基金份额净值增长率	-4.83%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配利润	-24,901,337.23
期末可供分配基金份额利润	-0.1614
期末基金资产净值	129,412,759.60
期末基金份额净值	0.8386
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	121.60%

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
过去一个月	8.43%	1.38%	-0.09%	0.54%	8.52%	0.84%
过去三个月	10.94%	1.41%	-0.55%	0.55%	11.49%	0.86%
过去六个月	-4.83%	2.12%	-7.47%	1.01%	2.64%	1.11%
过去一年	-2.82%	2.36%	-14.44%	1.27%	11.62%	1.09%
过去三年	104.99%	1.82%	33.68%	1.01%	71.31%	0.81%
自基金合同 生效起至 2012年3月 4日	13.08%	1.53%	59.27%	1.37%	-46.19%	0.16%
2012年3月 5日至2016 年6月30日	97.04%	1.61%	24.08%	0.94%	72.96%	0.67%

注：1. 本基金自 2012 年 3 月 5 日起修改了基金合同中基础行业定义及投资比例，并相应调整基金业绩比较基准为：

沪深 300 指数×55% + 中证综合债券指数×45%

沪深 300 指数是由中证指数有限公司编制，在上海和深圳证券市场中选取 300 只 A 股作为样本编

制而成的成份股指数。该指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值，具有良好的市场代表性，是目前中国证券市场中公允性较好的股票指数，适合作为本基金的业绩比较基准。

中证综合债券指数是中证指数有限公司编制的综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短期融资券的跨市场债券指数。该指数的推出旨在更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势，为债券投资人提供更切合的市场基准，适合作为本基金的业绩比较基准。

2. 基金合同修改前本基金的业绩比较基准计算公式为：

上证综指与深证综指的复合指数 $\times 75\%$ +中信全债指数 $\times 20\%$ +同业存款利率 $\times 5\%$ ；

其中：上证综指与深证综指的复合指数 $=$ （上证 A 股流通市值/A 股总流通市值） $\times$ 上证综指 $+$ （深证 A 股流通市值/A 股总流通市值） $\times$ 深证综指

基准指数的构建考虑了三个原则：

（1）由于当前并不存在一个为投资者广泛接受的基础行业指数，所以以自定义方式来构建业绩比较基准，若将来出现一个能得到市场认可的基础行业指数，我们将在研究对比的基础上选择更为合理的业绩比较基准。

（2）投资者认同度。选择被市场广泛认同的上证综指、深证综指、中信标普全债指数作为计算的基础指数，并以流通市值比例为权数对上证综指、深证综指作加权计算。

（3）业绩比较的合理性。基金投资业绩受到资产配置比例限制的影响，根据基金资产配置比例来确定加权计算的权数，使业绩比较更具有合理性。

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合合同要求，基准指数每日按照 75%、20%、5%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

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

自基金合同生效以来至基金合同修改前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

摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2004 年 3 月 26 日至 2012 年 3 月 4 日）

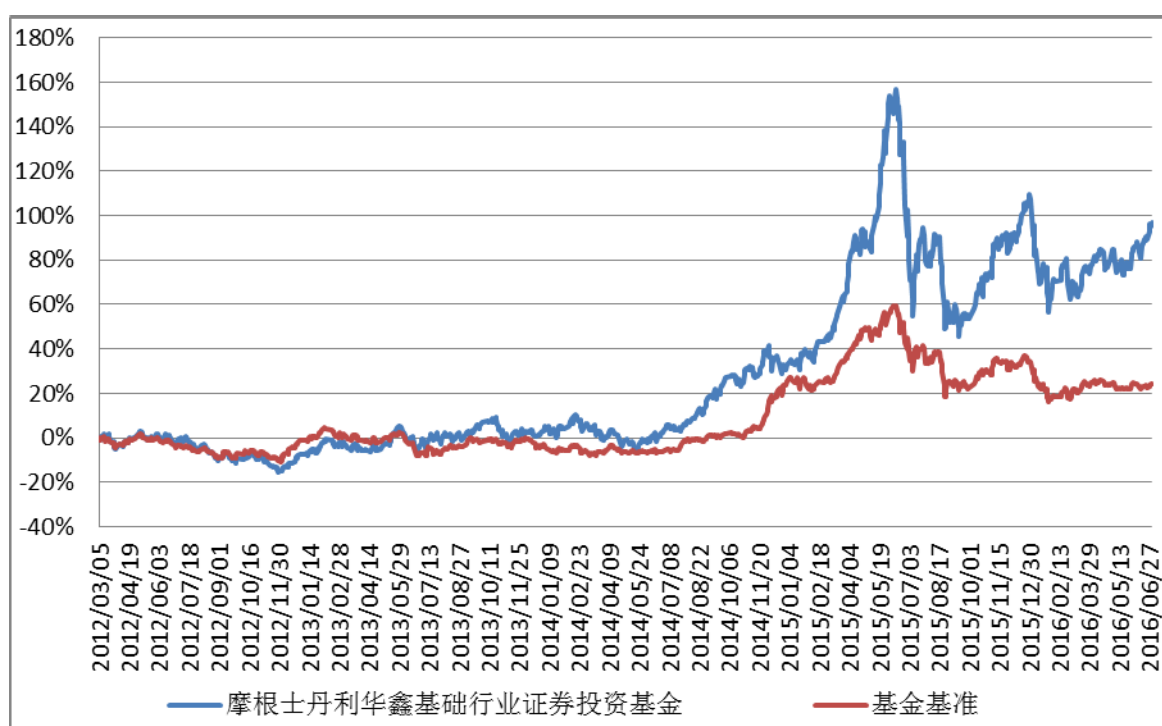


自基金合同修改以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012 年 3 月 5 日至 2016 年 6 月 30 日)



§ 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 2016 年 6 月 30 日，公司旗下共管理二十三只开放式基金，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、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、摩根士丹利华鑫沪港深新价值灵活配置混合型证券投资基金、摩根士丹利华鑫纯债稳定增值 18 个月定期开放债券型证券投资基金和摩根士丹利华鑫健康产业混合型证券投资基金。同时，公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王增财	基金经理	2013 年 10 月 23 日	-	9	西南财经大学经济学硕士。曾任职于平安证券有限责任公司资产管理事业部投资部，历任研究员、投资经理助理、投资经理。2013 年 9 月加入本公司，

					2013 年 10 月起任本基金基金经理，2014 年 8 月起任摩根士丹利华鑫领先优势混合型证券投资基金基金经理，2015 年 11 月起任摩根士丹利华鑫主题优选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、基金经理的任职已按规定在中国证券投资基金业协会办理完毕基金经理注册；

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金管理人所有投资组合参与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 14 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

报告期内，A 股市场经历了较大波动。年初一周市场的快速大幅下跌，给基金的风险控制带

来了挑战，表现为基金的减仓和持股结构调整难度加大。本基金年初股票持仓较高，开年净值出现了较大回撤。市场下跌后，本基金在一季度及时优化了投资组合，减持了业绩增长不确定的个股，以及前期累积涨幅较大、估值偏高的个股，并在相对低位增持了内生增长较快和外延扩张有潜力的个股。二季度，市场经历大幅调整后进入震荡整理行情，个股走势分化严重，结构性投资机会明显，具有价值支撑和业绩高速增长的行业和个股表现较好，例如电子、新能源汽车、白酒和家电板块。本基金在二季度保持了股票持仓比例相对平稳且处于较高水平。二季度主要减持了业绩低于预期的个股，增持了景气度较好且市值或估值较低的个股。从投资绩效看，一季度股票仓位未能及时降低导致了基金净值回撤较大，但我们自下而上选择的个股多数都取得了好于市场的回报。二季度调仓的投资策略也取得了较好的成效，基金净值回升明显超越市场指数。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期截至 2016 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.8386 元，累计份额净值为 2.3836 元，报告期内基金份额净值增长率为-4.83%，同期业绩比较基准收益率为-7.47%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们对于后市的展望是：国内经济或仍呈现“L”型走势，货币政策稳健，进一步大幅放松可能性较低。海外方面，美国经济复苏缓慢，加息预期不明确。市场一年来经过数次大幅调整后，整体风险得到大幅释放，上证指数和深圳成指的估值接近合理水平，创业板估值略高。由于市场估值水平并非很低，且市场整体 ROE 与无风险利率都不会出现大的变化，因此我们判断未来市场很可能处于震荡筑底阶段，下一阶段的行情或将呈现结构化特征：景气行业和个股继续上行，低估行业和个股逐步企稳或者回升，高估行业和个股震荡寻底以达到均衡。

本基金将动态调整资产配置比例并寻求结构性投资机会，根据市场估值水平调整股票持仓的中枢水平，以逆向投资思维调整仓位。本基金重点关注以下个股的投资机会：1、业务质地优良、竞争力强，内生增长强劲的优秀公司；2、财务健康、市值和估值较低，积极开拓新业务或者有拓展新业务预期的公司；3、景气向上的成长性行业；4、市场阶段性预期偏低的低估值板块。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

基金管理人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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2016 年上半年度，中国光大银行在摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定，依法安全托管了基金的全部资产，对摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

2016 年上半年度，中国光大银行依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证

券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人——摩根士丹利华鑫基金管理有限公司的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规的要求。该基金在运作中遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规的要求；各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行依法对基金管理人——摩根士丹利华鑫基金管理有限公司编制的“摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金 2016 年半年度报告”进行了复核，报告中相关财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容是真实、准确的。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	23,027,808.94	28,158,845.36
结算备付金		356,398.51	1,391,444.52
存出保证金		140,412.18	200,038.88
交易性金融资产	6.4.7.2	102,619,188.10	107,554,062.38
其中：股票投资		102,619,188.10	107,554,062.38
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	6,400,000.00	-
应收证券清算款		-	3,069,041.98
应收利息	6.4.7.5	5,545.93	5,990.41
应收股利		-	-
应收申购款		105,341.39	1,050,214.61
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-

资产总计		132,654,695.05	141,429,638.14
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		720,404.35	3,208,650.38
应付赎回款		1,467,012.70	494,074.08
应付管理人报酬		154,504.55	165,511.72
应付托管费		25,750.77	27,585.31
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	268,890.11	488,855.80
应交税费		358,034.67	358,034.67
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	247,338.30	170,624.89
负债合计		3,241,935.45	4,913,336.85
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	154,314,096.83	154,921,128.10
未分配利润	6.4.7.10	-24,901,337.23	-18,404,826.81
所有者权益合计		129,412,759.60	136,516,301.29
负债和所有者权益总计		132,654,695.05	141,429,638.14

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8386 元，基金份额总额 154,314,096.83 份。

6.2 利润表

会计主体：摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年6月30日
一、收入		-4,678,464.10	39,627,047.73
1.利息收入		123,221.48	115,213.37
其中：存款利息收入	6.4.7.11	114,311.90	79,061.29
债券利息收入		-	19,757.02
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		8,909.58	16,395.06
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,996,277.79	52,081,906.16
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,354,785.45	54,550,056.27

基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-3,120,474.49
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	641,492.34	652,324.38
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-6,833,474.44	-12,871,622.97
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	35,511.07	301,551.17
减：二、费用		1,863,207.68	2,383,828.52
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	908,741.35	912,326.06
2. 托管费	6.4.10.2.2	151,456.93	152,054.34
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	719,269.58	1,232,311.77
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	83,739.82	87,136.35
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-6,541,671.78	37,243,219.21
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-6,541,671.78	37,243,219.21

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	154,921,128.10	-18,404,826.81	136,516,301.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-6,541,671.78	-6,541,671.78
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）	-607,031.27	45,161.36	-561,869.91
其中：1.基金申购款	25,525,579.10	-5,963,724.70	19,561,854.40
2. 基金赎回款	-26,132,610.37	6,008,886.06	-20,123,724.31
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）	154,314,096.83	-24,901,337.23	129,412,759.60
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	159,728,222.27	-69,396,153.12	90,332,069.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	37,243,219.21	37,243,219.21
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）	11,922,335.73	8,623,471.10	20,545,806.83
其中：1.基金申购款	232,726,703.50	-32,107,158.28	200,619,545.22
2.基金赎回款	-220,804,367.77	40,730,629.38	-180,073,738.39
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）	171,650,558.00	-23,529,462.81	148,121,095.19

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>高潮生</u>	<u>张力</u>	<u>谢先斌</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金(原名为巨田基础行业证券投资基金,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”)证监基金字[2004]第 11 号《关于同意巨田基础行业证券投资基金设立的批复》核准,由巨田基金管理有限公司(现已更名为摩根士丹利华鑫基金管理有限公司)依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《巨田基础行业证券投资基金基金契约》(后更名为《摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金基金合同》)发起,并于 2004 年 3 月 26 日募集成立。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,854,428,324.58 元,业经深圳天健信德会计师事务所信德验资字(2004)第 8 号验资报告予以验证。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,基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下,本基金的投资组合范围为:股票投资占基

金净值的 50%-75%；债券投资占基金净值的 20%-45%；现金资产占基金净值的 5%-20%。其中投资于基础行业类股票的比例不低于股票资产的 80%。本基金的业绩比较基准为：上证综指与深证综指的复合指数 $\times 75\%$ +中信标普全债指数 $\times 20\%$ +同业存款利率 $\times 5\%$ 。

经中国证券监督管理委员会证监许可[2012]277 号文《关于核准摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》的核准，本基金自 2012 年 3 月 5 日起修改了基金合同中基础行业定义，并相应修改投资比例、业绩比较基准及收益分配条款。

2012 年 3 月 5 日本基金修改合同后，本基金的投资组合比例变更为：股票等权益类资产占基金资产的 30%-80%，其中投资于基础行业的上市公司股票市值不低于股票等权益类资产的 80%，持有权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现金、债券等固定收益类资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 20%-70%，其中现金或者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%。本基金的业绩比较基准变更为：沪深 300 指数 $\times 55\%$ +中证综合债券指数 $\times 45\%$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通

知》、财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	23,027,808.94
定期存款	—
其中：存款期限 1-3 个月	—
其他存款	—
合计：	23,027,808.94

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	92,701,601.48	102,619,188.10	9,917,586.62
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	92,701,601.48	102,619,188.10	9,917,586.62

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	6,400,000.00	-
合计	6,400,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	5,344.69
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	144.36

应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	56.88
合计	5,545.93

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	268,190.16
银行间市场应付交易费用	699.95
合计	268,890.11

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,658.06
其他	14,640.42
预提费用	229,039.82
合计	247,338.30

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	154,921,128.10	154,921,128.10
本期申购	25,525,579.10	25,525,579.10
本期赎回(以“-”号填列)	-26,132,610.37	-26,132,610.37
本期末	154,314,096.83	154,314,096.83

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-11,638,348.50	-6,766,478.31	-18,404,826.81
本期利润	291,802.66	-6,833,474.44	-6,541,671.78
本期基金份额交易产生的变动数	88,077.83	-42,916.47	45,161.36
其中：基金申购款	-2,127,936.58	-3,835,788.12	-5,963,724.70
基金赎回款	2,216,014.41	3,792,871.65	6,008,886.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-11,258,468.01	-13,642,869.22	-24,901,337.23

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	109,172.83
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	3,769.81
其他	1,369.26
合计	114,311.90

注：“其他”为申购款利息收入和结算保证金利息收入。

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

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	251,860,759.39
减：卖出股票成本总额	250,505,973.94
买卖股票差价收入	1,354,785.45

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	641,492.34
基金投资产生的股利收益	-
合计	641,492.34

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-6,833,474.44
——股票投资	-6,833,474.44
——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	-6,833,474.44

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	33,785.53
基金转换费收入	1,725.54
合计	35,511.07

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。赎回费用的 40% 归入基金财产，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

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

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	719,269.58
银行间市场交易费用	-
合计	719,269.58

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
审计费用	24,863.02
信息披露费	49,726.04
债券账户维护费	8,950.76
银行费用	-
其他	200.00
合计	83,739.82

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
摩根士丹利华鑫基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司（“中国光大银行”）	基金托管人、基金销售机构

华鑫证券有限责任公司（“华鑫证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
--------------------	-----------------

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	908,741.35	912,326.06
其中：支付销售机构的客户维护费	223,006.95	188,776.75

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 1.5% 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 × 1.5% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	151,456.93	152,054.34

注：支付基金托管人中国光大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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2004 年 3 月 26 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	8,090,552.04	8,090,552.04
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	8,090,552.04	8,090,552.04
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	5.24%	4.71%

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国光大银行	23,027,808.94	109,172.83	24,558,747.93	72,502.25

注：本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300332	天壕环境	2016年4月11日	重大事项	9.37	2016年7月29日	9.91	145,200	1,365,844.00	1,360,524.00	-

注：本基金截至 2016 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型证券投资基金。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争取将相对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，前者负责运营及合规风险管理，后者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，日常报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对

各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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光大银行，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 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资 (2015 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不得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交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2016 年 6 月 30 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。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有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、结算备付金及买入返售金融资产等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	23,027,808.94	-	-	-	23,027,808.94
结算备付金	356,398.51	-	-	-	356,398.51
存出保证金	140,412.18	-	-	-	140,412.18
交易性金融资产	-	-	-	102,619,188.10	102,619,188.10
买入返售金融资产	6,400,000.00	-	-	-	6,400,000.00
应收利息	-	-	-	5,545.93	5,545.93
应收申购款	-	-	-	105,341.39	105,341.39
资产总计	29,924,619.63	-	-	102,730,075.42	132,654,695.05
负债					
应付证券清算款	-	-	-	720,404.35	720,404.35
应付赎回款	-	-	-	1,467,012.70	1,467,012.70
应付管理人报酬	-	-	-	154,504.55	154,504.55
应付托管费	-	-	-	25,750.77	25,750.77
应付交易费用	-	-	-	268,890.11	268,890.11
应交税费	-	-	-	358,034.67	358,034.67

其他负债	-	-	-	247,338.30	247,338.30
负债总计	-	-	-	3,241,935.45	3,241,935.45
利率敏感度缺口	29,924,619.63	-	-	99,488,139.97	129,412,759.60
上年度末 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	28,158,845.36	-	-	-	28,158,845.36
结算备付金	1,391,444.52	-	-	-	1,391,444.52
存出保证金	200,038.88	-	-	-	200,038.88
交易性金融资产	-	-	-	107,554,062.38	107,554,062.38
应收证券清算款	-	-	-	3,069,041.98	3,069,041.98
应收利息	-	-	-	5,990.41	5,990.41
应收申购款	-	-	-	1,050,214.61	1,050,214.61
资产总计	29,750,328.76	-	-	111,679,309.38	141,429,638.14
负债					
应付证券清算款	-	-	-	3,208,650.38	3,208,650.38
应付赎回款	-	-	-	494,074.08	494,074.08
应付管理人报酬	-	-	-	165,511.72	165,511.72
应付托管费	-	-	-	27,585.31	27,585.31
应付交易费用	-	-	-	488,855.80	488,855.80
应交税费	-	-	-	358,034.67	358,034.67
其他负债	-	-	-	170,624.89	170,624.89
负债总计	-	-	-	4,913,336.85	4,913,336.85
利率敏感度缺口	29,750,328.76	-	-	106,765,972.53	136,516,301.29

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予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2015 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（2015 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于股票和债券，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，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，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。本基金投资组合中股票等权益类资产占基金资产的 30%-80%；现金、债券等固定收益类资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 20%-70%；其中现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人日常对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 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	102,619,188.10	79.30	107,554,062.38	78.78
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	102,619,188.10	79.30	107,554,062.38	78.78

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 6.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末(2016 年 6 月 30 日)	上年度末(2015 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%	8,570,000.00	7,920,000.00
	业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-8,570,000.00	-7,920,000.00

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 101,258,664.10 元，属于第二层次的余额为 1,360,524.00 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 107,554,062.38 元，无属于第二层次及第三层次的余额)。于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债均属于第一层次(2015 年 12 月 31 日：同)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

(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 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 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。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	102,619,188.10	77.36
	其中：股票	102,619,188.10	77.36
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	6,400,000.00	4.82
	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	23,384,207.45	17.63
7	其他各项资产	251,299.50	0.19
8	合计	132,654,695.05	100.00

7.2 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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	96,259,338.00	74.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,339,724.00	4.90
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
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	20,126.10	0.02

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	102,619,188.10	79.30

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	000910	大亚科技	550,000	8,497,500.00	6.57
2	002367	康力电梯	530,000	8,162,000.00	6.31
3	002394	联发股份	520,000	7,852,000.00	6.07
4	002543	万和电气	420,000	7,765,800.00	6.00
5	300258	精锻科技	400,000	6,464,000.00	4.99
6	000650	仁和药业	680,000	5,548,800.00	4.29
7	300072	三聚环保	200,000	5,528,000.00	4.27
8	600702	沱牌舍得	219,000	5,527,560.00	4.27
9	600563	法拉电子	110,000	5,007,200.00	3.87
10	601199	江南水务	640,000	4,979,200.00	3.85
11	000967	盈峰环境	215,200	4,775,288.00	3.69
12	002001	新 和 成	210,000	4,437,300.00	3.43
13	002403	爱仕达	230,000	3,714,500.00	2.87
14	002271	东方雨虹	200,000	3,446,000.00	2.66
15	600285	羚锐制药	310,000	3,344,900.00	2.58
16	600197	伊力特	200,000	3,008,000.00	2.32
17	300360	炬华科技	120,000	2,715,600.00	2.10
18	603100	川仪股份	170,000	2,713,200.00	2.10
19	002662	京威股份	170,000	2,568,700.00	1.98
20	603006	联明股份	100,000	2,483,000.00	1.92
21	002048	宁波华翔	78,000	1,783,860.00	1.38
22	300332	天壕环境	145,200	1,360,524.00	1.05
23	600419	天润乳业	17,000	916,130.00	0.71
24	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.02

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002662	京威股份	11,811,515.40	8.65
2	002543	万和电气	8,983,704.00	6.58
3	002367	康力电梯	7,793,838.51	5.71
4	002533	金杯电工	6,535,403.42	4.79
5	600487	亨通光电	6,532,036.30	4.78
6	600240	华业资本	6,142,658.34	4.50
7	000958	东方能源	6,076,397.87	4.45
8	002056	横店东磁	6,034,910.25	4.42
9	000650	仁和药业	5,546,228.20	4.06
10	300258	精锻科技	5,418,874.35	3.97
11	002403	爱仕达	5,287,001.94	3.87
12	002001	新 和 成	5,284,566.00	3.87
13	002311	海大集团	5,202,422.50	3.81
14	600702	沱牌舍得	5,178,407.00	3.79
15	601199	江南水务	5,126,299.78	3.76
16	300360	炬华科技	4,955,598.25	3.63
17	000910	大亚科技	4,867,297.97	3.57
18	002183	怡 亚 通	4,774,529.42	3.50
19	600261	阳光照明	4,626,322.91	3.39
20	600563	法拉电子	4,432,163.19	3.25
21	002048	宁波华翔	4,100,061.43	3.00
22	600285	羚锐制药	3,892,657.00	2.85
23	601607	上海医药	3,749,700.60	2.75
24	300027	华谊兄弟	3,617,524.00	2.65
25	300032	金龙机电	3,574,286.00	2.62
26	000418	小天鹅 A	3,542,843.32	2.60
27	002271	东方雨虹	3,455,678.79	2.53
28	002177	御银股份	3,293,624.00	2.41
29	002394	联发股份	3,267,426.96	2.39
30	600804	鹏博士	3,232,874.00	2.37
31	002006	精功科技	3,078,828.00	2.26

32	300231	银信科技	3,044,187.00	2.23
33	600037	歌华有线	3,042,790.04	2.23
34	000666	经纬纺机	2,919,540.70	2.14
35	600658	电子城	2,919,424.00	2.14
36	600197	伊力特	2,889,536.00	2.12

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300100	双林股份	10,582,726.56	7.75
2	002533	金杯电工	8,810,461.00	6.45
3	002662	京威股份	8,391,367.20	6.15
4	000488	晨鸣纸业	8,118,461.83	5.95
5	002630	华西能源	7,638,863.75	5.60
6	002047	宝鹰股份	7,594,591.63	5.56
7	002539	新都化工	6,210,765.55	4.55
8	000958	东方能源	5,850,797.94	4.29
9	600487	亨通光电	5,791,275.53	4.24
10	600240	华业资本	5,750,079.91	4.21
11	002056	横店东磁	5,533,077.60	4.05
12	000666	经纬纺机	5,504,147.96	4.03
13	002183	怡亚通	5,054,703.50	3.70
14	600894	广日股份	5,000,896.22	3.66
15	600475	华光股份	4,963,326.40	3.64
16	600261	阳光照明	4,835,974.80	3.54
17	002311	海大集团	4,590,428.82	3.36
18	000042	中洲控股	4,551,911.54	3.33
19	002510	天汽模	4,543,482.03	3.33
20	002521	齐峰新材	4,460,958.90	3.27
21	000915	山大华特	4,334,902.00	3.18
22	000418	小天鹅A	4,121,012.50	3.02
23	300027	华谊兄弟	3,872,005.00	2.84
24	000018	神州长城	3,757,780.74	2.75
25	300032	金龙机电	3,738,772.30	2.74
26	002048	宁波华翔	3,736,771.23	2.74
27	601607	上海医药	3,630,491.83	2.66

28	000910	大亚科技	3,513,749.05	2.57
29	600731	湖南海利	3,463,617.60	2.54
30	002177	御银股份	3,455,097.00	2.53
31	600804	鹏博士	3,321,199.36	2.43
32	002006	精功科技	2,945,182.00	2.16
33	300231	银信科技	2,858,807.06	2.09
34	600037	歌华有线	2,835,855.00	2.08
35	002543	万和电气	2,826,249.01	2.07
36	600658	电子城	2,765,932.55	2.03

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	252,404,574.10
卖出股票收入（成交）总额	251,860,759.39

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

根据本基金基金合同规定，本基金不参与贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

根据本基金基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体未出现报告期内被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	140,412.18
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,545.93
5	应收申购款	105,341.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	251,299.50

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
8,762	17,611.74	12,382,217.07	8.02%	141,931,879.76	91.98%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	—	—

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2004年3月26日）基金份额总额	1,854,893,478.59
本报告期期初基金份额总额	154,921,128.10
本报告期基金总申购份额	25,525,579.10
减：本报告期基金总赎回份额	26,132,610.37
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	154,314,096.83

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金未改变投资策略。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
西南证券	1	234,710,810.28	46.55%	171,644.28	40.61%	-
渤海证券	1	112,279,276.92	22.27%	104,566.74	24.74%	-
光大证券	1	100,636,536.77	19.96%	93,716.46	22.17%	-
平安证券	1	38,241,920.47	7.58%	35,614.73	8.43%	-

海通证券	1	18,385,236.80	3.65%	17,121.79	4.05%	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 专用交易单元的选择标准和程序

- (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。

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。

2. 本基金本报告期内租用交易单元未发生变化。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
西南证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	87,800,000.00	100.00%	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

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

注：本基金本报告期租用的证券公司交易单元未进行权证及基金投资。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	本基金 2015 年 4 季度报告	《证券时报》	2016 年 1 月 21 日
2	本公司关于旗下基金参与诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司费率优惠活动的公告	《证券时报》	2016 年 1 月 22 日
3	本公司关于向汇付天下“天天盈”账户持有人开通基金网上直销业务的公告	《证券时报》	2016 年 1 月 28 日
4	本公司关于向农业银行借记卡持卡人开通基金网上直销业务的公告	《证券时报》	2016 年 1 月 28 日
5	本公司关于旗下基金参与上海陆金所资产管理有限公司认购费率优惠活动的公告	《证券时报》	2016 年 2 月 1 日
6	本公司关于提醒投资者谨防虚假客服电话、防范金融诈骗的提示性公告	《证券时报》	2016 年 2 月 25 日
7	本公司关于向工商银行借记卡持卡人开通基金网上直销业务的公告	《证券时报》	2016 年 3 月 25 日
8	本公司关于旗下基金参与浙江同花顺基金销售有限公司费率优惠活动的公告	《证券时报》	2016 年 3 月 30 日
9	本基金 2015 年年度报告	《证券时报》	2016 年 3 月 30 日
10	本公司关于旗下部分基金继续参与工商银行电子银行申购费率优惠活动的公告	《证券时报》	2016 年 3 月 31 日
11	本公司关于旗下基金参加深圳市新兰德证券投资咨询有限公司费率优惠活动的公告	《证券时报》	2016 年 3 月 31 日
12	本公司关于旗下基金增加上海联泰资产管理有限公司为销售机构的公告	《证券时报》	2016 年 4 月 1 日
13	本公司关于旗下基金参与上海联泰资产管理有限公司费率优惠活动的公告	《证券时报》	2016 年 4 月 1 日
14	本公司关于旗下基金增加上海凯石财富基金销售有限公司为销售机构的公告	《证券时报》	2016 年 4 月 11 日
15	本公司关于旗下基金参与上海凯石财富基金销售有限公司费率优惠活动的公告	《证券时报》	2016 年 4 月 11 日
16	本公司关于旗下基金关于增加深圳富济财富管理有限公司为销售机构的公告	《证券时报》	2016 年 4 月 12 日
17	本公司关于旗下基金参与深圳富济财富管理有限公司费率优惠活动的公告	《证券时报》	2016 年 4 月 12 日
18	本公司关于旗下基金调整停牌股票“宝鹰股份”估值方法的公告	《证券时报》	2016 年 4 月 12 日
19	本公司关于增加北京钱景财富投资管理有限公司为销售机构的公告	《证券时报》	2016 年 4 月 15 日
20	本公司关于旗下基金关于参与北京钱景财富投资管理有限公司费率优惠活动的公告	《证券时报》	2016 年 4 月 15 日

21	本基金 2016 年 1 季度报告	《证券时报》	2016 年 4 月 20 日
22	本公司关于旗下部分基金参加民生直销银行费率优惠活动的公告	《证券时报》	2016 年 5 月 5 日
23	本基金招募说明书更新（2016 年第 1 号）	《证券时报》	2016 年 5 月 9 日
24	本公司关于旗下基金参与上海好买基金销售有限公司费率优惠活动的公告	《证券时报》	2016 年 6 月 6 日
25	本公司关于增加上海利得基金销售有限公司为销售机构并参与申（认）购费率优惠活动的公告	《证券时报》	2016 年 6 月 8 日
26	本公司关于旗下基金关于增加申万宏源西部为销售机构的公告	《证券时报》	2016 年 6 月 16 日
27	本公司关于旗下基金参加申万宏源西部申购费率优惠活动的公告	《证券时报》	2016 年 6 月 16 日
28	本公司关于调整开立基金账户证件类型的公告	《证券时报》	2016 年 6 月 20 日
29	本公司关于增加盈米财富为销售机构的公告	《证券时报》	2016 年 6 月 22 日
30	本公司关于旗下基金关于参加盈米财富费率优惠活动的公告	《证券时报》	2016 年 6 月 22 日
31	本公司关于旗下部分基金在上海陆金所资产管理有限公司开通基金定期定额投资业务并参与定期定额投资申购费率优惠活动的公告	《证券时报》	2016 年 6 月 24 日

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

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准本基金募集的文件；
- 2、本基金基金合同；
- 3、本基金托管协议；
- 4、本基金招募说明书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内在指定报刊上披露的各项公告。

11.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件，还可以通过基金管理人网站查阅

或下载。

摩根士丹利华鑫基金管理有限公司
2016 年 8 月 29 日