

摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§7 投资组合报告	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	34
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	45
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	45
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	45
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	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.12 投资组合报告附注	46

§8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
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	47
§9 开放式基金份额变动	48
§10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议	48
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	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4 基金投资策略的改变	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	48
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	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
10.8 其他重大事件	51
§11 备查文件目录	53
11.1 备查文件目录	53
11.2 存放地点	53
11.3 查阅方式	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金
基金简称	大摩深证 300 指数增强
基金主代码	233010
交易代码	233010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 11 月 15 日
基金管理人	摩根士丹利华鑫基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	32,623,232.99 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		摩根士丹利华鑫基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李锦	田青
	联系电话	(0755) 88318883	(010) 67595096
	电子邮箱	xxpl@msfunds.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8888-668	(010) 67595096
传真		(0755) 82990384	(010) 66275853
注册地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第二座第 17 层 01-04 室	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第二座第 17 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		518048	100033
法定代表人		YU HUA(于华)	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ms funds.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	-976,252.17
本期利润	-9,400,530.51
加权平均基金份额本期利润	-0.2876
本期加权平均净值利润率	-20.84%
本期基金份额净值增长率	-16.90%
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	14,396,758.66
期末可供分配基金份额利润	0.4413
期末基金资产净值	47,019,991.65
期末基金份额净值	1.441
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	44.10%

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

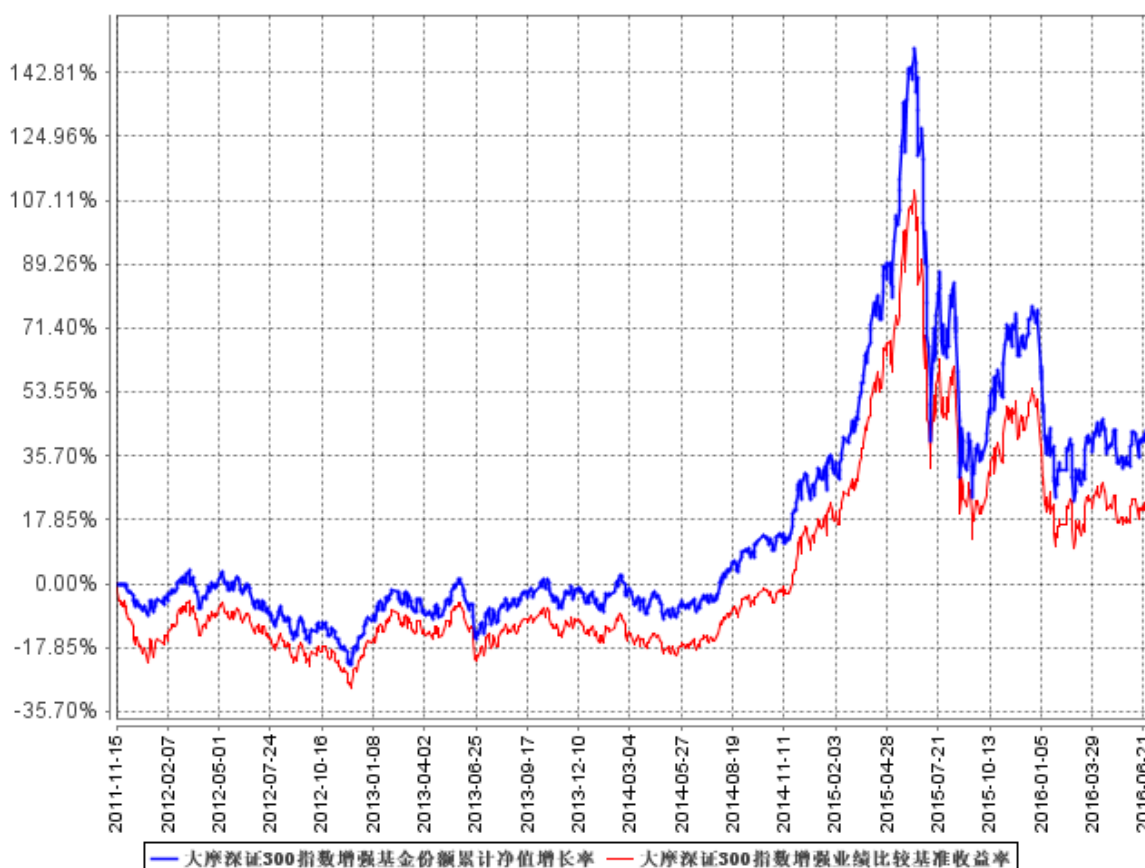
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	4.19%	1.44%	2.30%	1.32%	1.89%	0.12%
过去三个月	1.62%	1.49%	-0.37%	1.37%	1.99%	0.12%
过去六个月	-16.90%	2.35%	-16.50%	2.20%	-0.40%	0.15%
过去一年	-27.41%	2.92%	-26.62%	2.53%	-0.79%	0.39%
过去三年	67.17%	2.08%	55.76%	1.88%	11.41%	0.20%
自基金合同	44.10%	1.83%	24.32%	1.73%	19.78%	0.10%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

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

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



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

摩根士丹利华鑫基金管理有限公司（以下简称“公司”）是一家中外合资基金管理公司，前身为经中国证监会证监基金字[2003]33 号文批准设立并于 2003 年 3 月 14 日成立的巨田基金管理有限公司。公司的主要股东包括华鑫证券有限责任公司、摩根士丹利国际控股公司、深圳市招融投资控股有限公司等国内外机构。

截止 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		
周宁	基金投资部副总监、基金经理	2014 年 12 月 9 日	—	8	首都经济贸易大学会计学硕士。曾任东兴证券股份有限公司行业研究员。2010 年 9 月加入本公司，历任研究员、基金经理助理。2014 年 12 月至 2016 年 7 月任本基金基金经理，2015 年 6 月至 2016 年 7 月任摩根士丹利华鑫新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 11 月至 2016 年 7 月担任摩根士丹利华鑫卓越成长混合型证券投资基金基金经理。
缪东航	基金经理助理	2016 年 2 月 23 日	—	7	北京大学金融学硕士。曾任华安基金管理有限公司建材行业研究员，2012 年 9 月加入本公司，现任基金经理助理兼研

					究管理部研究员。
--	--	--	--	--	----------

注：1、基金经理、基金经理助理的任职日期为根据本公司决定确定的聘任日期；根据本公司决议，自 2016 年 7 月 16 日起，周宁先生不再担任本基金基金经理，吴国雄先生自该日起担任本基金基金经理，本公司已于 2016 年 7 月 16 日披露有关变更事项。

2、基金经理任职已按规定在中国证券投资基金业协会办理完毕基金经理注册；

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金管理人所有投资组合参与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

本基金主要通过量化模型作为投资交易决策的依据，通过科学的量化模型研究体系、严格的风险管理机制、高效的量化投资执行制度跟踪指数控制跟踪误差，并争取获得超额收益。本基金投资由两部分组合管理组成：一是“指数部分”被用于跟踪指数，该组合资产占基金净值比例不低于 80%；二是“个股增强部分”，该组合通过量化模型精选具有超额收益的个股，两部分股票

组合合计占基金资产的比例为 90%-95%。

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 1.441 元，累计份额净值为 1.441 元，报告期内基金份额净值增长率为-16.90%，同期业绩比较基准收益率为-16.50%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年上半年，在积极财政政策、货币政策以及房地产新政作用下，经济运行平稳。上半年投资增速回落，房地产投资虽有下降，但仍起到支撑作用；消费方面，受到房地产、汽车和原油消费带动而稳中有升；外贸方面，因受制于内外需求的持续疲软而表现低迷。全球经济在上半年维持弱势稳定，英国脱欧预示着全球金融市场和大类资产的不确定性上升，下半年依然需警惕全球黑天鹅事件的发生。

总体来看，A 股市场在一月份大幅下挫之后进入市场分化的震荡行情。新能源汽车、充电桩等热点概念板块在 1 月大跌之后涨幅超过 50%，但热点频发的同时板块轮动迅速。政府工作重心转向供给侧改革，改革方向逐步清晰。资金面上，市场仍处于存量博弈中，没有明显的资金流入。2016 年下半年，深港开通、养老金入市、国企改革等消息有望公布，预期将给市场注入新的持续性题材和资金流入；但是与此同时，改革带来的经济增长压力、人民币贬值压力以及外围边缘政治风险等，都将增加市场的不确定性。

后阶段，在投资管理方面，本基金将在严格控制跟踪误差的同时争取超额收益。

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

本基金合同约定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年度最多分配 4 次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 25%。

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金自 2016 年 1 月 7 日起至 2016 年 6 月 30 日止存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。基金管理人已根据相关法规及基金合同规定向中国证监会报告并提出解决方案。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金

报告截止日：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	3,732,365.32	3,181,998.46
结算备付金		28,713.11	91,503.18
存出保证金		8,720.60	33,842.51
交易性金融资产	6.4.7.2	43,285,020.94	52,979,448.95
其中：股票投资		43,285,020.94	52,979,448.95
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		265,034.01	-
应收利息	6.4.7.5	797.90	797.79
应收股利		-	-
应收申购款		65,081.16	13,091.77
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		47,385,733.04	56,300,682.66
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		-	-
应付赎回款		127,733.78	193,341.32
应付管理人报酬		37,789.28	47,071.58
应付托管费		5,668.40	7,060.75
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	17,331.29	75,509.11
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	177,218.64	107,939.16
负债合计		365,741.39	430,921.92
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	32,623,232.99	32,219,866.91
未分配利润	6.4.7.10	14,396,758.66	23,649,893.83
所有者权益合计		47,019,991.65	55,869,760.74
负债和所有者权益总计		47,385,733.04	56,300,682.66

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.441 元，基金份额总额 32,623,232.99 份。

6.2 利润表

会计主体：摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：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		-8,908,407.43	38,066,080.37
1.利息收入		16,328.53	22,682.31
其中：存款利息收入	6.4.7.11	12,040.31	22,682.31
债券利息收入		4,288.22	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-510,934.86	32,278,338.51
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-744,337.53	32,028,584.73
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-652.00	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-	-
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	234,054.67	249,753.78
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-8,424,278.34	5,653,628.81
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	10,477.24	111,430.74
减：二、费用		492,123.08	1,395,012.50
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	224,509.55	407,738.61
2. 托管费	6.4.10.2.2	33,676.39	61,160.78
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-

4. 交易费用	6.4.7.19	54,967.68	741,728.39
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	178,969.46	184,384.72
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-9,400,530.51	36,671,067.87
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-9,400,530.51	36,671,067.87

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：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）	32,219,866.91	23,649,893.83	55,869,760.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-9,400,530.51	-9,400,530.51
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）	403,366.08	147,395.34	550,761.42
其中：1.基金申购款	7,081,726.51	2,668,248.88	9,749,975.39
2.基金赎回款	-6,678,360.43	-2,520,853.54	-9,199,213.97
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	32,623,232.99	14,396,758.66	47,019,991.65
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）	65,773,140.13	17,822,981.46	83,596,121.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	36,671,067.87	36,671,067.87
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 （净值减少以“-”号填列）	-30,993,818.49	-20,243,441.38	-51,237,259.87
其中：1.基金申购款	36,905,332.45	28,254,629.48	65,159,961.93
2.基金赎回款	-67,899,150.94	-48,498,070.86	-116,397,221.80
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值	-	-	-

减少以“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	34,779,321.64	34,250,607.95	69,029,929.59

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]第 1218 号《关于核准摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金募集的批复》核准,由摩根士丹利华鑫基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 421,871,132.46 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 439 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2011 年 11 月 15 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 421,922,840.88 份基金份额,其中认购资金利息折合 51,708.42 份基金份额。本基金的基金管理人为摩根士丹利华鑫基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例范围为 90%—95%,其中投资于深证 300 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产的 80%;除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 5%—10%,保持现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,股指期货、权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金力求控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%,年化跟踪误差不得超过 7.75%。本基金的业绩比较基准为:深证 300 价格指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 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	3,732,365.32
定期存款	—
其中：存款期限 1-3 个月	—
其他存款	—
合计：	3,732,365.32

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	40,913,380.48	43,285,020.94	2,371,640.46
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	40,913,380.48	43,285,020.94	2,371,640.46

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	780.98
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	12.90
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	4.00
合计	797.90

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	17,331.29
银行间市场应付交易费用	-
合计	17,331.29

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	428.09
预提费用	114,067.58
指数使用费	50,000.00
其他	12,722.97
合计	177,218.64

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	32,219,866.91	32,219,866.91
本期申购	7,081,726.51	7,081,726.51
本期赎回(以“-”号填列)	-6,678,360.43	-6,678,360.43
本期末	32,623,232.99	32,623,232.99

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	21,507,149.78	2,142,744.05	23,649,893.83
本期利润	-976,252.17	-8,424,278.34	-9,400,530.51
本期基金份额交易产生的变动数	278,480.88	-131,085.54	147,395.34
其中：基金申购款	4,608,911.08	-1,940,662.20	2,668,248.88
基金赎回款	-4,330,430.20	1,809,576.66	-2,520,853.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	20,809,378.49	-6,412,619.83	14,396,758.66

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	11,588.11
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	345.94

其他	106.26
合计	12,040.31

注：“其他”为申购款利息收入和结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	18,211,776.36
减：卖出股票成本总额	18,956,113.89
买卖股票差价收入	-744,337.53

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-652.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-652.00

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,060,200.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,000,652.00
减：应收利息总额	60,200.00
买卖债券差价收入	-652.00

6.4.7.13.3 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	234,054.67
基金投资产生的股利收益	-
合计	234,054.67

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	-8,424,278.34
——股票投资	-8,424,278.34
——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	-8,424,278.34

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	9,485.61
基金转换费收入	991.63
合计	10,477.24

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

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

归入转出基金的基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	54,812.68
银行间市场交易费用	155.00
合计	54,967.68

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	19,890.78
信息披露费	49,726.04
银行费用	401.88
债券帐户维护费	8,950.76
指数使用费	100,000.00
合计	178,969.46

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

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
摩根士丹利华鑫基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金销售机构
华鑫证券有限责任公司(“华鑫证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
华鑫证券	1,836,416.20	5.12%	45,116,118.99	9.61%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
华鑫证券	1,710.28	5.12%	1,710.28	9.87%
关联方名称	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
华鑫证券	41,073.77	9.61%	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	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	224,509.55	407,738.61
其中：支付销售机构的客户维护费	111,037.33	191,798.56

注：支付基金管理人摩根士丹利华鑫基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.00% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	33,676.39	61,160.78

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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
中国建设银行	3,732,365.32	11,588.11	5,267,497.17	19,541.50

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

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
000651	格力电器	2016 年 2 月 22 日	重大 事项	22.07	-	-	51,280	1,056,713.22	1,131,749.60	-
000002	万 科 A	2015 年 12 月 18 日	重大 资产 重组	18.20	2016 年 7 月 4 日	21.99	24,902	333,766.04	453,216.40	-
002465	海格通信	2016 年 6 月 13 日	重大 事项	12.44	-	-	17,400	176,945.32	216,456.00	-
002065	东华软件	2015 年 12 月 21 日	重大 事项	18.71	2016 年 7 月 4 日	22.59	10,510	298,290.70	196,642.10	-
000718	苏宁环球	2016 年 1 月 4 日	重大 事项	13.09	2016 年 7 月 18 日	11.78	13,390	64,985.32	175,275.10	-
000728	国元证券	2016 年 6 月 8 日	重大 事项	16.72	2016 年 7 月 8 日	17.37	8,100	132,752.44	135,432.00	-
002129	中环股份	2016 年 4 月 25 日	重大 事项	8.29	-	-	11,951	98,571.67	99,073.79	-
000415	渤海金控	2016 年 2 月 1 日	重大 资产 重组	6.82	2016 年 8 月 11 日	7.50	12,500	71,587.43	85,250.00	-
002190	成飞集成	2016 年 4 月 21 日	重大 事项	35.44	2016 年 7 月 12 日	38.98	2,191	53,101.23	77,649.04	-
000511	*ST 烯碳	2016 年 4 月 26 日	重大 事项	8.92	-	-	7,271	41,103.15	64,857.32	-
000975	银泰资源	2016 年 4 月	重大	15.00	-	-	4,208	47,868.27	63,120.00	-

		19 日	资产 重组							
000401	冀东水泥	2016 年 4 月 6 日	重大 资产 重组	10.90	2016 年 7 月 14 日	11.32	5,000	62,765.14	54,500.00	-
300166	东方国信	2016 年 6 月 8 日	重大 资产 重组	27.47	-	-	1,800	44,973.00	49,446.00	-
002266	浙富控股	2016 年 5 月 25 日	重大 事项	5.35	-	-	8,890	58,332.08	47,561.50	-
002052	同洲电子	2016 年 1 月 12 日	重大 事项	10.03	-	-	4,000	45,839.91	40,120.00	-
300052	中青宝	2016 年 6 月 8 日	重大 资产 重组	22.03	-	-	1,800	48,855.40	39,654.00	-
002280	联络互动	2016 年 4 月 25 日	重大 资产 重组	19.71	-	-	1,000	16,212.00	19,710.00	-
002555	三七互娱	2016 年 3 月 10 日	重大 资产 重组	18.10	2016 年 8 月 16 日	19.91	1,000	17,955.00	18,100.00	-
000693	ST 华泽	2016 年 3 月 1 日	重大 事项	12.50	-	-	900	22,171.00	11,250.00	-
000547	航天发展	2016 年 4 月 19 日	重大 资产 重组	15.36	-	-	100	2,796.00	1,536.00	-

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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票指数增强型基金，以深证 300 指数作为本基金投资组合跟踪的目标指数。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风

险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“谋求超过业绩比较基准的投资业绩”的风险收益目标。

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的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 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超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 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。

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	3,732,365.32	-	-	-	3,732,365.32
结算备付金	28,713.11	-	-	-	28,713.11
存出保证金	8,720.60	-	-	-	8,720.60
交易性金融资产	-	-	-	-43,285,020.94	-43,285,020.94
应收证券清算款	-	-	-	265,034.01	265,034.01
应收利息	-	-	-	797.90	797.90
应收申购款	-	-	-	65,081.16	65,081.16
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,769,799.03	-	-	-43,615,934.01	47,385,733.04
负债					
应付赎回款	-	-	-	127,733.78	127,733.78
应付管理人报酬	-	-	-	37,789.28	37,789.28
应付托管费	-	-	-	5,668.40	5,668.40
应付交易费用	-	-	-	17,331.29	17,331.29
其他负债	-	-	-	177,218.64	177,218.64
负债总计	-	-	-	365,741.39	365,741.39
利率敏感度缺口	3,769,799.03	-	-	-43,250,192.62	47,019,991.65
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	3,181,998.46	-	-	-	3,181,998.46
结算备付金	91,503.18	-	-	-	91,503.18
存出保证金	33,842.51	-	-	-	33,842.51
交易性金融资产	-	-	-	-52,979,448.95	-52,979,448.95
应收利息	-	-	-	797.79	797.79
应收申购款	-	-	-	13,091.77	13,091.77
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,307,344.15	-	-	-52,993,338.51	56,300,682.66
负债					
应付赎回款	-	-	-	193,341.32	193,341.32
应付管理人报酬	-	-	-	47,071.58	47,071.58
应付托管费	-	-	-	7,060.75	7,060.75
应付交易费用	-	-	-	75,509.11	75,509.11
其他负债	-	-	-	107,939.16	107,939.16
负债总计	-	-	-	430,921.92	430,921.92
利率敏感度缺口	3,307,344.15	-	-	-52,562,416.59	55,869,760.74

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 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，在有效跟踪深证 300 指数的基础上，通过运用增强型投资策略，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合范围为：股票资产占基金资产的 90%-95%，其中投资于深证 300 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产的 80%；基金持有权证的市场价值不得超过基金资产净值的 3%；除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 5%-10%，其中现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人日常对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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

		(%)		例 (%)
交易性金融资产—股票投资	43,285,020.94	92.06	52,979,448.95	94.83
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	43,285,020.94	92.06	52,979,448.95	94.83

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%	2,450,000.00	2,980,000.00
	业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-2,450,000.00	-2,980,000.00

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 40,304,422.09 元，属于第二层次的余额为 2,980,598.85 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 48,210,555.17 元，第二层次 4,768,893.78 元，无第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

于本期末，本基金未持有公允价值归属于第三层次的金融工具(2015 年 12 月 31 日：同)。

(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	43,285,020.94	91.35
	其中：股票	43,285,020.94	91.35
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	3,761,078.43	7.94
7	其他各项资产	339,633.67	0.72
8	合计	47,385,733.04	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	448,520.53	0.95
B	采矿业	475,260.13	1.01
C	制造业	22,895,039.37	48.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	607,926.56	1.29
E	建筑业	536,267.26	1.14
F	批发和零售业	1,322,250.81	2.81
G	交通运输、仓储和邮政业	29,630.44	0.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,251,059.51	9.04
J	金融业	2,994,791.38	6.37
K	房地产业	1,488,447.15	3.17
L	租赁和商务服务业	1,737,523.30	3.70
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	641,651.27	1.36
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	117,681.67	0.25
R	文化、体育和娱乐业	662,581.13	1.41
S	综合	198,047.20	0.42
	合计	38,406,677.71	81.68

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	3,805,543.23	8.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,072,800.00	2.28
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	-	-
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	4,878,343.23	10.38

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002594	比亚迪	27,037	1,649,527.37	3.51
2	000858	五粮液	48,440	1,575,753.20	3.35
3	002450	康得新	89,285	1,526,773.50	3.25
4	000651	格力电器	51,280	1,131,749.60	2.41
5	000568	泸州老窖	37,957	1,127,322.90	2.40
6	002183	怡亚通	75,800	1,085,456.00	2.31
7	000001	平安银行	113,053	983,561.10	2.09
8	000028	国药一致	11,275	734,002.50	1.56
9	000333	美的集团	28,248	670,042.56	1.43
10	300104	乐视网	9,844	520,846.04	1.11
11	000776	广发证券	31,000	519,560.00	1.10
12	300059	东方财富	21,780	483,516.00	1.03
13	000002	万科A	24,902	453,216.40	0.96
14	002415	海康威视	18,754	402,460.84	0.86
15	000063	中兴通讯	27,019	387,452.46	0.82
16	002230	科大讯飞	11,218	368,511.30	0.78
17	000503	海虹控股	8,502	341,865.42	0.73
18	300024	机器人	13,387	339,895.93	0.72
19	000783	长江证券	26,374	305,938.40	0.65

20	000423	东阿阿胶	5,210	275,244.30	0.59
21	002405	四维图新	11,032	271,387.20	0.58
22	000100	TCL 集团	79,364	261,107.56	0.56
23	002202	金风科技	17,100	258,723.00	0.55
24	300017	网宿科技	3,712	249,446.40	0.53
25	002304	洋河股份	3,220	231,582.40	0.49
26	000839	中信国安	10,800	230,148.00	0.49
27	002673	西部证券	8,700	224,982.00	0.48
28	300027	华谊兄弟	16,433	222,502.82	0.47
29	002241	歌尔股份	7,649	219,373.32	0.47
30	300070	碧水源	14,719	219,018.72	0.47
31	002465	海格通信	17,400	216,456.00	0.46
32	000963	华东医药	3,185	214,669.00	0.46
33	000895	双汇发展	10,050	209,844.00	0.45
34	000538	云南白药	3,204	206,017.20	0.44
35	001979	招商蛇口	14,407	205,299.75	0.44
36	002007	华兰生物	6,469	203,126.60	0.43
37	002500	山西证券	12,100	200,376.00	0.43
38	000009	中国宝安	14,456	198,047.20	0.42
39	002065	东华软件	10,510	196,642.10	0.42
40	000623	吉林敖东	7,700	192,115.00	0.41
41	000768	中航飞机	9,500	187,055.00	0.40
42	002252	上海莱士	4,852	182,823.36	0.39
43	000887	中鼎股份	8,222	181,788.42	0.39
44	002142	宁波银行	12,120	179,133.60	0.38
45	300124	汇川技术	9,125	177,025.00	0.38
46	000718	苏宁环球	13,390	175,275.10	0.37
47	000826	启迪桑德	5,705	174,287.75	0.37
48	002081	金螳螂	17,188	172,223.76	0.37
49	002292	奥飞娱乐	5,704	170,834.80	0.36
50	300003	乐普医疗	9,280	169,267.20	0.36
51	000630	铜陵有色	66,500	168,910.00	0.36
52	000725	京东方 A	72,300	167,013.00	0.36
53	000876	新希望	20,008	166,466.56	0.35
54	300072	三聚环保	5,939	164,153.96	0.35
55	300033	同花顺	2,000	162,900.00	0.35
56	000157	中联重科	39,400	162,722.00	0.35
57	000062	深圳华强	6,000	162,000.00	0.34
58	002001	新和成	7,620	161,010.60	0.34

59	000338	潍柴动力	20,000	156,200.00	0.33
60	002152	广电运通	9,379	154,190.76	0.33
61	000977	浪潮信息	6,496	152,331.20	0.32
62	002456	欧菲光	5,132	151,394.00	0.32
63	000559	万向钱潮	9,582	149,479.20	0.32
64	000069	华侨城 A	23,100	147,840.00	0.31
65	002008	大族激光	6,368	145,445.12	0.31
66	000166	申万宏源	17,119	143,970.79	0.31
67	002236	大华股份	10,985	143,903.50	0.31
68	002030	达安基因	5,015	139,417.00	0.30
69	000402	金融街	14,100	137,052.00	0.29
70	000060	中金岭南	13,108	136,716.44	0.29
71	000728	国元证券	8,100	135,432.00	0.29
72	000661	长春高新	1,269	135,376.92	0.29
73	000917	电广传媒	8,100	133,893.00	0.28
74	000750	国海证券	17,991	132,953.49	0.28
75	002038	双鹭药业	4,396	132,671.28	0.28
76	000425	徐工机械	43,200	132,192.00	0.28
77	002385	大北农	16,123	129,951.38	0.28
78	000997	新大陆	6,468	129,618.72	0.28
79	000738	中航动控	4,900	129,360.00	0.28
80	002179	中航光电	2,980	129,093.60	0.27
81	000792	盐湖股份	6,000	126,600.00	0.27
82	000778	新兴铸管	27,200	126,208.00	0.27
83	000988	华工科技	6,212	124,550.60	0.26
84	000046	泛海控股	12,200	123,342.00	0.26
85	002475	立讯精密	6,150	120,847.50	0.26
86	300315	掌趣科技	11,470	120,320.30	0.26
87	002223	鱼跃医疗	3,766	119,457.52	0.25
88	002153	石基信息	4,473	117,997.74	0.25
89	002311	海大集团	7,414	116,918.78	0.25
90	000883	湖北能源	25,200	116,676.00	0.25
91	000748	长城信息	5,800	113,796.00	0.24
92	002273	水晶光电	4,050	113,359.50	0.24
93	002340	格林美	12,902	113,150.54	0.24
94	300133	华策影视	7,200	112,104.00	0.24
95	300015	爱尔眼科	3,059	111,745.27	0.24
96	300251	光线传媒	9,600	110,976.00	0.24
97	300498	温氏股份	3,040	110,108.80	0.23

98	000012	南 玻 A	9,600	110,016.00	0.23
99	000998	隆平高科	5,650	107,237.00	0.23
100	002191	劲嘉股份	9,218	106,836.62	0.23
101	000983	西山煤电	12,995	105,909.25	0.23
102	000061	农 产 品	8,680	105,548.80	0.22
103	300134	大富科技	3,511	105,189.56	0.22
104	000078	海王生物	14,142	105,075.06	0.22
105	300088	长信科技	7,000	104,090.00	0.22
106	002312	三泰控股	5,485	103,940.75	0.22
107	002400	省广股份	7,345	103,784.85	0.22
108	002310	东方园林	4,300	102,856.00	0.22
109	000878	云南铜业	10,020	102,003.60	0.22
110	000793	华闻传媒	10,300	101,764.00	0.22
111	002203	海亮股份	13,000	101,010.00	0.21
112	002573	清新环境	5,940	100,504.80	0.21
113	002129	中环股份	11,951	99,073.79	0.21
114	000540	中天城投	15,850	98,745.50	0.21
115	300253	卫宁健康	3,990	98,553.00	0.21
116	000970	中科三环	6,788	98,493.88	0.21
117	002466	天齐锂业	2,280	97,333.20	0.21
118	000999	华润三九	3,986	96,540.92	0.21
119	300115	长盈精密	4,640	95,584.00	0.20
120	000625	长安汽车	6,982	95,443.94	0.20
121	000539	粤电力 A	18,840	94,576.80	0.20
122	000786	北新建材	10,376	94,214.08	0.20
123	000543	皖能电力	13,090	93,462.60	0.20
124	002470	金正大	11,600	93,380.00	0.20
125	000709	河钢股份	33,300	92,241.00	0.20
126	000729	燕京啤酒	12,100	91,839.00	0.20
127	000581	威孚高科	4,502	90,760.32	0.19
128	300077	国民技术	4,542	89,931.60	0.19
129	002294	信立泰	3,285	89,352.00	0.19
130	300058	蓝色光标	9,115	88,506.65	0.19
131	002701	奥瑞金	9,840	86,887.20	0.18
132	002570	贝因美	6,790	86,844.10	0.18
133	000758	中色股份	11,200	86,800.00	0.18
134	000413	东旭光电	10,000	85,900.00	0.18
135	002050	三花股份	8,894	85,827.10	0.18
136	000415	渤海金控	12,500	85,250.00	0.18

137	300002	神州泰岳	7,962	84,715.68	0.18
138	000829	天音控股	6,327	84,465.45	0.18
139	002095	生意宝	1,500	83,985.00	0.18
140	002299	圣农发展	3,226	83,553.40	0.18
141	300212	易华录	2,800	83,356.00	0.18
142	000566	海南海药	7,616	83,090.56	0.18
143	000901	航天科技	2,063	82,829.45	0.18
144	000592	平潭发展	12,192	82,661.76	0.18
145	002424	贵州百灵	4,800	82,560.00	0.18
146	002375	亚厦股份	7,282	82,286.60	0.18
147	000039	中集集团	5,800	82,186.00	0.17
148	000960	锡业股份	7,100	82,076.00	0.17
149	002155	湖南黄金	6,224	81,970.08	0.17
150	002138	顺络电子	4,500	81,585.00	0.17
151	002185	华天科技	6,370	81,090.10	0.17
152	300274	阳光电源	3,300	80,520.00	0.17
153	002739	万达院线	1,000	79,900.00	0.17
154	002353	杰瑞股份	4,127	79,568.56	0.17
155	002049	紫光国芯	1,800	79,110.00	0.17
156	002004	华邦健康	8,585	78,381.05	0.17
157	002190	成飞集成	2,191	77,649.04	0.17
158	002269	美邦服饰	17,332	76,260.80	0.16
159	000050	深天马 A	3,626	75,674.62	0.16
160	002161	远望谷	5,037	75,000.93	0.16
161	002467	二六三	4,851	74,753.91	0.16
162	000800	一汽轿车	6,806	74,049.28	0.16
163	002106	莱宝高科	6,219	73,881.72	0.16
164	002051	中工国际	3,720	73,172.40	0.16
165	300079	数码视讯	8,516	72,982.12	0.16
166	000021	深科技	6,541	72,016.41	0.15
167	300273	和佳股份	3,752	71,850.80	0.15
168	002219	恒康医疗	6,487	71,681.35	0.15
169	002410	广联达	5,000	71,500.00	0.15
170	002104	恒宝股份	4,282	70,396.08	0.15
171	000516	国际医学	12,000	70,200.00	0.15
172	300146	汤臣倍健	5,184	70,191.36	0.15
173	300026	红日药业	4,000	69,560.00	0.15
174	002261	拓维信息	5,000	69,150.00	0.15
175	001696	宗申动力	6,195	67,649.40	0.14

176	002092	中泰化学	7,890	66,749.40	0.14
177	000690	宝新能源	9,829	66,640.62	0.14
178	002011	盾安环境	5,900	66,552.00	0.14
179	002399	海普瑞	3,795	66,260.70	0.14
180	300257	开山股份	4,000	66,080.00	0.14
181	000777	中核科技	2,800	65,968.00	0.14
182	000541	佛山照明	6,410	65,958.90	0.14
183	002151	北斗星通	1,950	65,637.00	0.14
184	300226	上海钢联	1,300	65,520.00	0.14
185	002477	雏鹰农牧	10,881	64,959.57	0.14
186	000511	*ST 烯碳	7,271	64,857.32	0.14
187	000400	许继电气	4,180	64,539.20	0.14
188	002168	深圳惠程	4,559	64,190.72	0.14
189	000825	太钢不锈	20,200	63,832.00	0.14
190	002603	以岭药业	4,000	63,640.00	0.14
191	000975	银泰资源	4,208	63,120.00	0.13
192	300202	聚龙股份	2,600	62,946.00	0.13
193	000671	阳光城	10,500	62,370.00	0.13
194	000979	中弘股份	22,720	62,252.80	0.13
195	000006	深振业 A	8,400	61,908.00	0.13
196	000027	深圳能源	9,600	61,248.00	0.13
197	002022	科华生物	2,858	60,903.98	0.13
198	002146	荣盛发展	9,000	60,480.00	0.13
199	002428	云南锗业	3,500	60,130.00	0.13
200	000598	兴蓉环境	11,282	59,568.96	0.13
201	000685	中山公用	5,731	59,487.78	0.13
202	300147	香雪制药	3,830	56,415.90	0.12
203	000939	凯迪生态	6,224	55,704.80	0.12
204	002063	远光软件	3,576	55,249.20	0.12
205	002474	榕基软件	2,900	54,810.00	0.12
206	000401	冀东水泥	5,000	54,500.00	0.12
207	002250	联化科技	3,800	54,416.00	0.12
208	002501	利源精制	5,000	54,000.00	0.11
209	002344	海宁皮城	5,500	53,625.00	0.11
210	002431	棕榈股份	4,645	53,417.50	0.11
211	000861	海印股份	10,800	53,352.00	0.11
212	000627	天茂集团	6,800	52,564.00	0.11
213	002073	软控股份	4,306	51,887.30	0.11
214	000961	中南建设	9,000	50,490.00	0.11

215	000697	炼石有色	2,200	50,270.00	0.11
216	300166	东方国信	1,800	49,446.00	0.11
217	002681	奋达科技	2,880	48,614.40	0.10
218	002266	浙富控股	8,890	47,561.50	0.10
219	002429	兆驰股份	5,650	47,347.00	0.10
220	000528	柳 工	7,300	47,304.00	0.10
221	000572	海马汽车	8,997	46,694.43	0.10
222	002396	星网锐捷	2,358	46,452.60	0.10
223	000851	高鸿股份	3,600	46,404.00	0.10
224	300039	上海凯宝	4,560	46,375.20	0.10
225	300005	探路者	2,700	46,035.00	0.10
226	002005	德豪润达	7,737	45,725.67	0.10
227	000652	泰达股份	9,938	45,714.80	0.10
228	000712	锦龙股份	2,200	45,672.00	0.10
229	002440	闰土股份	3,000	44,550.00	0.09
230	000898	鞍钢股份	11,600	44,428.00	0.09
231	002029	七 匹 狼	4,307	43,716.05	0.09
232	000937	冀中能源	8,190	43,570.80	0.09
233	000031	中粮地产	4,500	42,435.00	0.09
234	000816	智慧农业	7,163	42,333.33	0.09
235	002052	同洲电子	4,000	40,120.00	0.09
236	300052	中青宝	1,800	39,654.00	0.08
237	000066	长城电脑	3,000	38,250.00	0.08
238	000686	东北证券	2,800	36,148.00	0.08
239	002736	国信证券	2,000	34,500.00	0.07
240	002018	华信国际	3,600	34,200.00	0.07
241	300157	恒泰艾普	3,000	32,370.00	0.07
242	002665	首航节能	4,100	32,349.00	0.07
243	002276	万马股份	1,500	29,715.00	0.06
244	000088	盐 田 港	4,601	29,630.44	0.06
245	002074	国轩高科	700	27,629.00	0.06
246	300267	尔康制药	1,800	25,776.00	0.05
247	300199	翰宇药业	1,200	24,420.00	0.05
248	000938	紫光股份	400	24,352.00	0.05
249	002130	沃尔核材	1,500	24,120.00	0.05
250	002653	海思科	1,500	24,030.00	0.05
251	000156	华数传媒	1,200	22,260.00	0.05
252	002024	苏宁云商	2,000	21,720.00	0.05
253	002489	浙江永强	2,700	21,384.00	0.05

254	002368	太极股份	600	21,318.00	0.05
255	002491	通鼎互联	1,200	20,472.00	0.04
256	002280	联络互动	1,000	19,710.00	0.04
257	002390	信邦制药	2,000	18,480.00	0.04
258	002055	得润电子	600	18,372.00	0.04
259	002555	三七互娱	1,000	18,100.00	0.04
260	002625	龙生股份	400	17,592.00	0.04
261	300433	蓝思科技	600	16,872.00	0.04
262	300085	银之杰	520	15,548.00	0.03
263	002563	森马服饰	1,400	15,162.00	0.03
264	002568	百润股份	600	13,200.00	0.03
265	000693	ST 华泽	900	11,250.00	0.02
266	300001	特锐德	400	8,676.00	0.02
267	300144	宋城演艺	241	6,003.31	0.01
268	300244	迪安诊断	180	5,936.40	0.01
269	002318	久立特材	500	5,785.00	0.01
270	000158	常山股份	400	5,556.00	0.01
271	002657	中科金财	100	5,494.00	0.01
272	300291	华录百纳	200	4,706.00	0.01
273	002642	荣之联	150	3,946.50	0.01
274	002522	浙江众成	200	3,750.00	0.01
275	300216	千山药机	100	3,163.00	0.01
276	002437	誉衡药业	300	2,610.00	0.01
277	300168	万达信息	100	2,599.00	0.01
278	002439	启明星辰	100	2,583.00	0.01
279	002195	二三四五	200	2,458.00	0.01
280	000681	视觉中国	100	2,365.00	0.01
281	000656	金科股份	600	2,292.00	0.00
282	002013	中航机电	150	2,022.00	0.00
283	000732	泰禾集团	100	1,944.00	0.00
284	300055	万邦达	100	1,821.00	0.00
285	002498	汉缆股份	400	1,736.00	0.00
286	000410	沈阳机床	100	1,678.00	0.00
287	002422	科伦药业	100	1,541.00	0.00
288	000547	航天发展	100	1,536.00	0.00
289	300170	汉得信息	100	1,518.00	0.00
290	300043	互动娱乐	100	1,417.00	0.00
291	000930	中粮生化	100	1,098.00	0.00
292	002285	世联行	140	1,090.60	0.00

293	000875	吉电股份	100	561.00	0.00
294	000751	锌业股份	100	553.00	0.00
295	000897	津滨发展	100	387.00	0.00
296	000667	美好集团	100	357.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002462	嘉事堂	28,800	1,072,800.00	2.28
2	002006	精功科技	76,500	1,035,045.00	2.20
3	000910	大亚科技	57,627	890,337.15	1.89
4	600594	益佰制药	52,500	838,950.00	1.78
5	002664	信质电机	23,300	792,666.00	1.69
6	002123	荣信股份	10,000	207,900.00	0.44
7	000661	长春高新	381	40,645.08	0.09

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	000800	一汽轿车	1,576,281.00	2.82
2	600409	三友化工	1,308,139.00	2.34
3	002301	齐心集团	972,865.08	1.74
4	600594	益佰制药	963,375.00	1.72
5	000581	威孚高科	930,085.00	1.66
6	002304	洋河股份	919,733.90	1.65
7	000568	泸州老窖	917,784.00	1.64
8	002006	精功科技	907,561.00	1.62
9	000858	五粮液	851,476.00	1.52
10	002664	信质电机	818,139.00	1.46
11	002229	鸿博股份	815,808.00	1.46
12	600559	老白干酒	812,689.00	1.45
13	000910	大亚科技	796,155.60	1.43
14	600395	盘江股份	729,144.56	1.31

15	000028	国药一致	720,438.00	1.29
16	002296	辉煌科技	670,164.00	1.20
17	002594	比亚迪	640,996.00	1.15
18	002450	康得新	483,644.00	0.87
19	002183	怡亚通	433,065.00	0.78
20	300033	同花顺	135,785.00	0.24

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	000800	一汽轿车	1,400,996.00	2.51
2	300025	华星创业	1,345,890.00	2.41
3	600409	三友化工	1,249,632.00	2.24
4	002304	洋河股份	1,111,263.00	1.99
5	000625	长安汽车	1,089,707.00	1.95
6	002450	康得新	1,064,758.00	1.91
7	000581	威孚高科	933,579.52	1.67
8	002229	鸿博股份	820,046.00	1.47
9	002301	齐心集团	810,236.00	1.45
10	000001	平安银行	796,713.16	1.43
11	600559	老白干酒	750,646.00	1.34
12	600865	百大集团	731,871.00	1.31
13	600395	盘江股份	714,355.00	1.28
14	002296	辉煌科技	678,076.00	1.21
15	002594	比亚迪	611,499.00	1.09
16	000678	襄阳轴承	610,113.00	1.09
17	002123	荣信股份	595,276.00	1.07
18	300073	当升科技	393,855.66	0.70
19	002368	太极股份	151,701.00	0.27
20	000982	中银绒业	141,706.56	0.25

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	17,685,964.22
卖出股票收入（成交）总额	18,211,776.36

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

根据本基金基金合同规定，本基金不参与贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

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

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体除深圳市怡亚通供应链股份有限公司（以下简称“怡亚通”）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。

怡亚通于2016年3月25日公告，其于2016年2月2日收到中国证券监督管理委员会深圳监管局（以下简称“深圳证监局”）下达的《深圳证监局关于对深圳市怡亚通供应链股份有限公司采取出具警示函措施的决定》（【2016】10号），怡亚通在公告中陈述了警示函的内容以及公司相关整改情况。

本基金投资怡亚通（002183）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，认为上述事件对怡亚通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。

7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	8,720.60
2	应收证券清算款	265,034.01
3	应收股利	-
4	应收利息	797.90
5	应收申购款	65,081.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	339,633.67

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000651	格力电器	1,131,749.60	2.41	重大事项

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

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

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
2,280	14,308.44	247,529.75	0.76%	32,375,703.24	99.24%

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	—

本基金基金经理持有本开放式基金	—
-----------------	---

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011 年 11 月 15 日）基金份额总额	421,922,840.88
本报告期期初基金份额总额	32,219,866.91
本报告期基金总申购份额	7,081,726.51
减:本报告期基金总赎回份额	6,678,360.43
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—
本报告期期末基金份额总额	32,623,232.99

§ 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	
海通证券	1	15,570,269.62	43.39%	14,500.62	43.40%	-
东方证券	2	7,303,241.56	20.35%	6,801.48	20.35%	-
中泰证券	1	6,447,162.56	17.97%	6,003.82	17.97%	-
中投证券	1	2,976,978.04	8.30%	2,772.55	8.30%	-
华鑫证券	2	1,836,416.20	5.12%	1,710.28	5.12%	-
国泰君安	1	933,579.52	2.60%	869.42	2.60%	-
光大证券	1	812,689.00	2.26%	756.89	2.27%	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	5	-	-	-	-	-
中信证券（山	2	-	-	-	-	-

东)						
中银国际	2	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 专用交易单元的选择标准

- (1) 实力雄厚，信誉良好；
 - (2) 财务状况良好，经营行为规范；
 - (3) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
 - (4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需
要，并能为本基金提供全面的信息服
 - (5) 研究实力较强，能及时、定期、全面地为本基金提供研究服务；
 - (6) 为基金份额持有人提供高水平的综合服务。
2. 基金管理人根据以上标准进行考察后确定合作券商。基金管理人与被选择的证券经营机构签订《专用证券交易单元租用协议》，报证券交易所办理交易单元相关租用手续；
3. 本报告期内，本基金新增了 2 家证券公司的 3 个专用交易单元：浙商证券 2 个、信达证券 1 个。

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
海通证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-

平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券（山东）	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末通过租用的证券公司交易单元进行其他证券投资。

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	本公司关于旗下基金调整停牌股票“华星创业”估值方法的公告	《上海证券报》	2016 年 1 月 5 日
2	本公司关于旗下基金调整停牌股票“万科 A”、“乐视网”及“张家界”估值方法的公告	《上海证券报》	2016 年 1 月 12 日
3	本公司关于旗下基金参加平安证券申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2016 年 1 月 20 日
4	本基金 2015 年 4 季度报告	《上海证券报》	2016 年 1 月 21 日
5	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	《上海证券报》	2016 年 1 月 22 日
6	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	《上海证券报》	2016 年 1 月 28 日
7	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	《上海证券报》	2016 年 1 月 28 日
8	本公司关于旗下基金调整停牌股票“康得新”估值方法的公告	《上海证券报》	2016 年 1 月 29 日

9	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	《上海证券报》	2016 年 2 月 1 日
10	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	《上海证券报》	2016 年 2 月 25 日
11	本公司关于旗下基金调整停牌股票“格力电器”及“东华软件”估值方法的公告	《上海证券报》	2016 年 3 月 1 日
12	本公司关于旗下基金调整停牌股票“科大讯飞”估值方法的公告	《上海证券报》	2016 年 3 月 24 日
13	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	《上海证券报》	2016 年 3 月 25 日
14	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	《上海证券报》	2016 年 3 月 30 日
15	本基金 2015 年年度报告	《上海证券报》	2016 年 3 月 30 日
16	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	《上海证券报》	2016 年 3 月 31 日
17	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	《上海证券报》	2016 年 3 月 31 日
18	本公司关于旗下基金调整停牌股票“长安汽车”估值方法的公告	《上海证券报》	2016 年 3 月 31 日
19	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	《上海证券报》	2016 年 4 月 1 日
20	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	《上海证券报》	2016 年 4 月 1 日
21	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	《上海证券报》	2016 年 4 月 11 日
22	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	《上海证券报》	2016 年 4 月 11 日
23	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	《上海证券报》	2016 年 4 月 12 日
24	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	《上海证券报》	2016 年 4 月 12 日
25	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	《上海证券报》	2016 年 4 月 15 日
26	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	《上海证券报》	2016 年 4 月 15 日
27	本基金 2016 年 1 季度报告	《上海证券报》	2016 年 4 月 20 日
28	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	《上海证券报》	2016 年 5 月 5 日
29	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	《上海证券报》	2016 年 6 月 6 日
30	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	《上海证券报》	2016 年 6 月 8 日
31	本公司关于旗下基金关于增加申万宏源西部	《上海证券报》	2016 年 6 月 16 日

	为销售机构的公告		
32	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	《上海证券报》	2016 年 6 月 16 日
33	本公司关于调整开立基金账户证件类型的公告	《上海证券报》	2016 年 6 月 20 日
34	本公司关于增加盈米财富为销售机构的公告	《上海证券报》	2016 年 6 月 22 日
35	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	《上海证券报》	2016 年 6 月 22 日
36	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	《上海证券报》	2016 年 6 月 24 日
37	本基金招募说明书更新（2016 年第 1 号）	《上海证券报》	2016 年 6 月 27 日
38	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活动的公告	《上海证券报》	2016 年 6 月 30 日

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

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

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

11.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

11.3 查阅方式

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

摩根士丹利华鑫基金管理有限公司
2016 年 8 月 29 日