

# 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 2016 年半年度报告摘要

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：交通银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 29 日

## § 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。

基金托管人交通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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 2 月 3 日（基金合同生效日）起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                 |
|------------|-----------------|
| 基金简称       | 大摩沪港深           |
| 基金主代码      | 001737          |
| 交易代码       | 001737          |
| 基金运作方式     | 契约型开放式          |
| 基金合同生效日    | 2016 年 2 月 3 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      | 交通银行股份有限公司      |
| 报告期末基金份额总额 | 50,742,719.26 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期             |

### 2.2 基金产品说明

|      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 本基金采取主动管理的投资策略，在严控风险的基础上，力争为投资人获取稳健回报。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 投资策略 | <p>本基金为灵活配置混合型基金，根据各类资产的市场趋势和预期收益风险的比较判别，对股票、债券及货币市场工具等类别资产的配置比例进行动态调整，以期在投资中达到风险和收益的优化平衡。</p> <p>1、股票投资策略</p> <p>（1）大类资产配置</p> <p>本基金将基于大类资产配置轮动方向，制定各阶段股票类资产投资额度，结合对股票基本面和股市趋势的研究，通过自上而下精选行业和自下而上精选个股策略，分享股票市场成长收益。</p> <p>（2）行业配置策略</p> <p>在行业选择中，本基金将根据宏观经济产业结构变化趋势、新兴技术创新方向、社会经济人口变化趋势等变化，动态分析行业发展所处阶段，筛选经济转型过程中、技术创新浪潮中未来有望受益程度较高或景气有望持续提升的行业；本基金也将根据宏观经济周期、上下游行业联动关系等，选择行业景气有望反转、或其在产业链中地位由弱转强或优势扩大的行业。</p> <p>（3）个股精选策略：“自下而上”精选个股</p> <p>在个股选择中，本基金将通过定性和定量相结合的方法，依据稳健投资、风险第一的原则，在 A 股与包含在沪港股票市场交易互联互通机制之内的香港股票市场中精选优质个股，构建股票组合。</p> <p>（4）港股通标的股票投资策略</p> <p>本基金将仅通过沪港股票市场交易互联互通机制，遵</p> |

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>循沪港通规定投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。在不同标的股票投资中，本基金除采用上述“自下而上”精选个股策略外，将重点投资于受惠于中国经济转型、升级，且处于合理价位的具备核心竞争力股票。</p> <p>本基金将充分发挥时机选择能力，控制股票市场下跌风险。与此同时，本基金将通过分散投资、组合投资和流动性管理等手段，降低股票组合中个股集中性风险和流动性风险。</p> <p>2、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，控制下跌风险。将严格遵守相关法律法规的约束，合理利用股指期货、权证、资产支持证券等衍生工具。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金定位于主动管理灵活配置型基金，在股票市场投资风险和不确定性增大时，增加债券资产比例，以此降低基金组合系统性风险。本投资组合对于债券的投资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> |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×40%+中证综合债券指数收益率×40%+恒生综合指数收益率×20%                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，理论上其长期平均风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。此外，相比不投资于境外市场的其他混合型基金，本基金将投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |

## 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     | 交通银行股份有限公司          |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 李锦                  | 汤嵩彦                 |
|         | 联系电话 | (0755) 88318883     | 95559               |
|         | 电子邮箱 | xxpl@msfunds.com.cn | tangsy@bankcomm.com |
| 客户服务电话  |      | 400-8888-668        | 95559               |
| 传真      |      | (0755) 82990384     | (021) 62701216      |

## 2.4 信息披露方式

|                      |                    |
|----------------------|--------------------|
| 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2月3日 - 2016年6月30日) |
|---------------|-----------------------------|
| 本期已实现收益       | 2,314,225.05                |
| 本期利润          | 2,744,707.02                |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0245                      |
| 本期基金份额净值增长率   | 2.70%                       |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2016年6月30日)            |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0192                      |
| 期末基金资产净值      | 52,108,303.44               |
| 期末基金份额净值      | 1.027                       |

注：1. 本基金基金合同于 2016 年 2 月 3 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

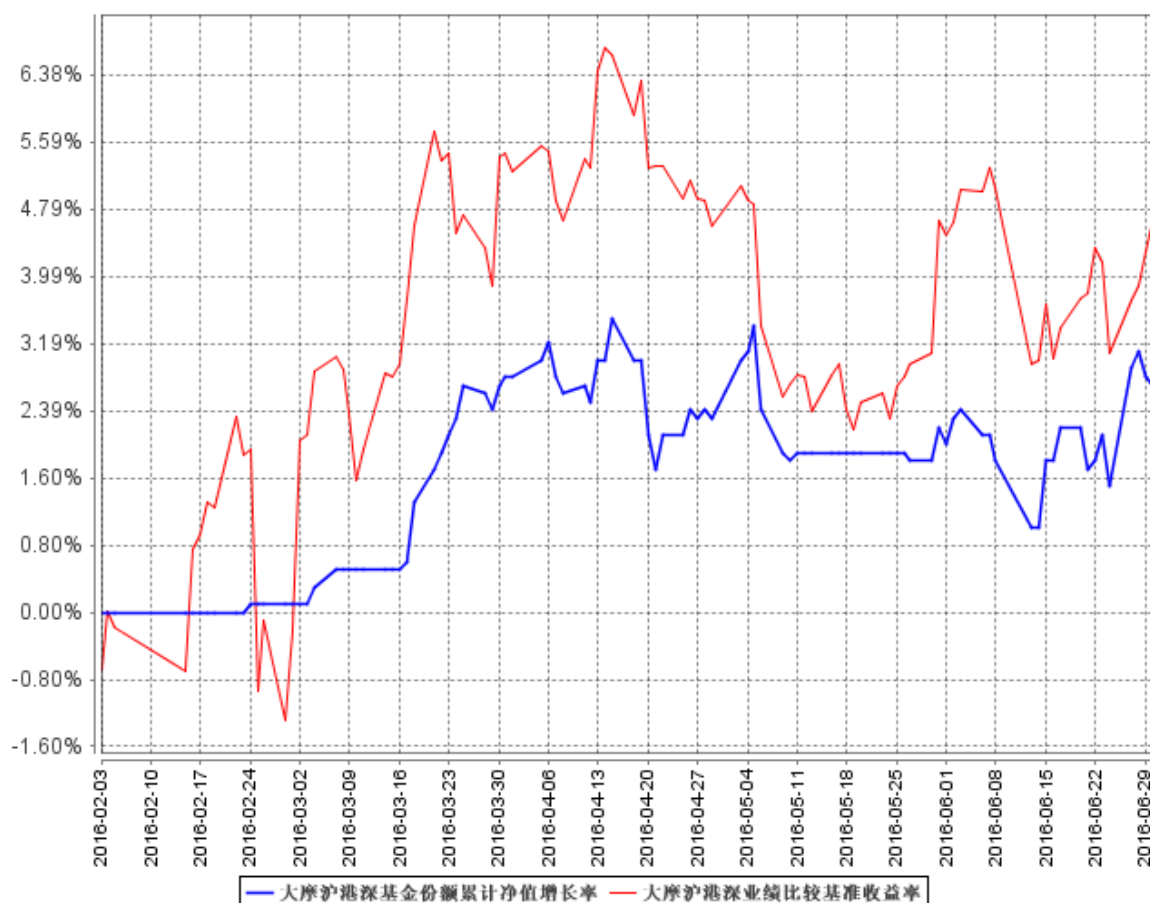
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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    |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去一个月 | 0.49%    | 0.48%       | 0.01%      | 0.62%         | 0.48% | -0.14% |
| 过去三个月 | -0.10%   | 0.38%       | -0.74%     | 0.54%         | 0.64% | -0.16% |

|                |       |       |       |       |        |        |
|----------------|-------|-------|-------|-------|--------|--------|
| 自基金合同<br>生效起至今 | 2.70% | 0.31% | 4.68% | 0.70% | -1.98% | -0.39% |
|----------------|-------|-------|-------|-------|--------|--------|

### 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

大摩沪港深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 2016 年 2 月 3 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。截至本报告期末，本基金仍处于建仓期。

## § 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 |        |                                                                                                                                                                                    |
| 王大鹏 | 研究管理部总监、基金经理 | 2016 年 2 月 3 日  | -    | 8      | 中山大学金融学博士。曾任长春工业大学工商管理学院金融学专业教师，宝盈基金管理有限公司研究员。2010 年 12 月加入本公司，历任研究员、研究管理部总监助理。2015 年 1 月起任摩根士丹利华鑫资源优选混合型证券投资基金(LOF)基金经理，2016 年 2 月起任本基金基金经理，2016 年 6 月起任摩根士丹利华鑫健康产业混合型证券投资基金基金经理。 |
| 孙海波 | 基金投          | 2016 年 6 月 18   | -    | 9      | 南开大学政治经济学博                                                                                                                                                                         |

|  |                     |   |  |  |                                                                                                                                                                                                                            |
|--|---------------------|---|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | 资 部 总<br>监、基金<br>经理 | 日 |  |  | 士。曾任职于华泰联合证券研究所及民生加银基金管理有限公司，担任研究员。2010 年 9 月加入本公司，历任研究员、基金经理助理。2014 年 7 月起担任摩根士丹利华鑫进取优选股票型证券投资基金基金经理，2015 年 1 月至 2016 年 6 月担任摩根士丹利华鑫资源优选混合型证券投资基金（LOF）基金经理，2016 年 6 月起担任本基金基金经理，2016 年 7 月起担任摩根士丹利华鑫新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 |
|--|---------------------|---|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

注：1、基金经理王大鹏的任职日期为基金合同生效日；基金经理孙海波的任职日期为根据本公司决定确定的聘任日期；

2、基金经理任职已按规定在中国证券投资基金业协会办理完毕基金经理注册；

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作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

本基金成立时即遇到市场的大幅下挫，为保证持有人利益，本基金采取了极为保守的仓位策略，以尽可能避免净值损失。三月份开始，我们以低仓位参与了部分主题投资机会。进入五月份，我们预判市场有企稳可能，遂开始逐步加仓，重点集中在安全边际较高的食品饮料和医药板块。六月份，我们基于对国内国际形势的判断，加大了军工行业板块的配置。

截至报告期末，本基金仍处于建仓期，股票仓位为 48.74%，持仓主要集中在食品饮料、医药、军工等行业。截至报告期末，本基金未持有债券。

### 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 1.027 元，累计份额净值为 1.027 元，报告期内基金份额净值增长率为 2.70%，同期业绩比较基准收益率为 4.68%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，综观世界政治经济形势，中国仍然是最具吸引力的新兴市场国家，这也意味着国内的长期国债收益率仍有下行空间，国内的货币财政等各项宏观以及产业政策仍有较大腾挪余地。然而在总需求不振的情形下，风险偏好降低、追求确定性成为投资者的首选，这使得市场呈现整体区间震荡、结构性行情和板块轮动共生的特点。本基金将继续坚持大类资产配置策略优先原则，“自上而下”对大类资产前景进行评估并制定配置策略，充分发挥本基金的灵活配置优势，为投资者寻求稳健收益。在个股选择方面更多考虑公司 ROE 提升的方式、业绩确定性以及成长空间，同时更加关注业绩的确定性和估值的安全边际。对同时满足上述条件的公司我们将采取集中持仓、买入持有策略；对新兴产业龙头公司，鉴于其估值普遍偏高，我们将结合市场风险偏好的波动采取波段操作的策略。

## 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**

根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，本报告期内，本基金未进行利润分配。

#### **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**

报告期内，基金托管人在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的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

#### **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**

报告期内，摩根士丹利华鑫基金管理有限公司在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、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

### 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

报告期内，由摩根士丹利华鑫基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关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的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 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：摩根士丹利华鑫沪港深新价值灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产             | 本期末<br>2016 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日         |
|-----------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>     |                                |                                  |
| 银行存款            | 1,180,686.64                   | -                                |
| 结算备付金           | 25,682,052.16                  | -                                |
| 存出保证金           | 47,147.08                      | -                                |
| 交易性金融资产         | 25,396,170.00                  | -                                |
| 其中：股票投资         | 25,396,170.00                  | -                                |
| 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          | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产        | -                              | -                                |
| 应收证券清算款         | 1,705,437.79                   | -                                |
| 应收利息            | 16,101.10                      | -                                |
| 应收股利            | -                              | -                                |
| 应收申购款           | 77,707.06                      | -                                |
| 递延所得税资产         | -                              | -                                |
| 其他资产            | -                              | -                                |
| 资产总计            | 54,105,301.83                  | -                                |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末<br/>2016 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>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          | -                              | -                                |

|               |               |   |
|---------------|---------------|---|
| 卖出回购金融资产款     | -             | - |
| 应付证券清算款       | -             | - |
| 应付赎回款         | 1,633,716.12  | - |
| 应付管理人报酬       | 45,137.39     | - |
| 应付托管费         | 11,284.34     | - |
| 应付销售服务费       | -             | - |
| 应付交易费用        | 240,113.31    | - |
| 应交税费          | -             | - |
| 应付利息          | -             | - |
| 应付利润          | -             | - |
| 递延所得税负债       | -             | - |
| 其他负债          | 66,747.23     | - |
| 负债合计          | 1,996,998.39  | - |
| <b>所有者权益：</b> |               |   |
| 实收基金          | 50,742,719.26 | - |
| 未分配利润         | 1,365,584.18  | - |
| 所有者权益合计       | 52,108,303.44 | - |
| 负债和所有者权益总计    | 54,105,301.83 | - |

注：1. 报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.027 元，基金份额总额 50,742,719.26 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2016 年 2 月 3 日(基金合同生效日)起至 2016 年 6 月 30 日止期间，且无上年度可比数据。

## 6.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2016 年 2 月 3 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目              | 本期<br>2016 年 2 月 3 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|------------------|------------------------------------------------|--------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>      | 3,906,235.58                                   | -                                          |
| 1.利息收入           | 896,896.97                                     | -                                          |
| 其中：存款利息收入        | 308,810.53                                     | -                                          |
| 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       | 588,086.44                                     | -                                          |
| 其他利息收入           | -                                              | -                                          |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | 1,771,982.55                                   | -                                          |
| 其中：股票投资收益        | 1,726,662.55                                   | -                                          |
| 基金投资收益           | -                                              | -                                          |
| 债券投资收益           | -                                              | -                                          |
| 资产支持证券投资收益       | -                                              | -                                          |
| 贵金属投资收益          | -                                              | -                                          |

|                            |                     |          |
|----------------------------|---------------------|----------|
| 衍生工具收益                     | -                   | -        |
| 股利收益                       | 45,320.00           | -        |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 430,481.97          | -        |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          | -                   | -        |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 806,874.09          | -        |
| <b>减：二、费用</b>              | <b>1,161,528.56</b> | <b>-</b> |
| 1. 管理人报酬                   | 474,328.66          | -        |
| 2. 托管费                     | 118,582.14          | -        |
| 3. 销售服务费                   | -                   | -        |
| 4. 交易费用                    | 505,520.18          | -        |
| 5. 利息支出                    | -                   | -        |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | -                   | -        |
| 6. 其他费用                    | 63,097.58           | -        |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | <b>2,744,707.02</b> | <b>-</b> |
| 减：所得税费用                    | -                   | -        |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   | <b>2,744,707.02</b> | <b>-</b> |

注：本基金自基金合同生效日（2016年2月3日）至本报告期末未满一年，无上年度对比数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：摩根士丹利华鑫沪港深新价值灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016年2月3日（基金合同生效日）至2016年6月30日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2016年2月3日(基金合同生效日)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）                        | 272,945,460.49                      | -             | 272,945,460.49  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                   | 2,744,707.02  | 2,744,707.02    |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数<br>（净值减少以“-”号填列）  | -222,202,741.23                     | -1,379,122.84 | -223,581,864.07 |
| 其中：1.基金申购款                             | 683,411.08                          | 15,939.86     | 699,350.94      |
| 2. 基金赎回款                               | -222,886,152.31                     | -1,395,062.70 | -224,281,215.01 |
| 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）                        | 50,742,719.26                       | 1,365,584.18  | 52,108,303.44   |

| 项目                                     | 上年度可比期间<br>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）                        | -                                          | -     | -       |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                          | -     | -       |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数<br>（净值减少以“-”号填列）  | -                                          | -     | -       |
| 其中：1.基金申购款                             | -                                          | -     | -       |
| 2.基金赎回款                                | -                                          | -     | -       |
| 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）                        | -                                          | -     | -       |

注：本基金自基金合同生效日（2016 年 2 月 3 日）至本报告期末未满一年，无上年度对比数据。

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

摩根士丹利华鑫沪港深新价值灵活配置混合型证券投资基金（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]第 1684 号《关于准予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注册的批复》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《摩根士丹利华鑫沪港深新价值灵活配置混合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，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 272,822,792.08 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(2016)第 159 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《摩根士丹利华鑫沪港深新价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 2 月 3 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 272,945,460.49 份基金份额，其中认购资金利息折合 122,668.41 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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《摩根士丹利华鑫沪港深新价值灵活配置混合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，包括国内依法上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票）、沪港股票市

场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、次级债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、资产支持证券及其他中国证监会允许投资的债券）、债券回购、银行存款、权证、股指期货、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金投资组合范围为：股票资产（包含投资于国内依法发行上市的股票、及投资于港股通标的股票的总和）占基金资产的比例范围为 0%-95%；权证投资比例不高于基金资产净值的 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后，本基金持有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%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×40%+中证综合债券指数收益率×40%+恒生综合指数收益率×20%。

### 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（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》、《摩根士丹利华鑫沪港深新价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、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。

### 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 2 月 3 日（基金合同生效日）起至 2016 年 6 月 30 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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 6.4.4 重要会计政策和会计估计

### 6.4.4.1 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 2016 年 2 月 3 日（基金合同生效日）起至 2016 年 6 月 30 日止期间。

### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 6.4.4.3 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。

### 6.4.4.4 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。

#### 6.4.4.5 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。

#### 6.4.4.6 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。当本基金依法 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。

#### 6.4.4.7 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。

#### 6.4.4.8 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)。

#### 6.4.4.9 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。

#### **6.4.4.10 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。

#### **6.4.4.11 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。

#### **6.4.4.12 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。

#### **6.4.4.13 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。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间没有需作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 关联方关系

### 6.4.7.1 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。

### 6.4.7.2 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 |
| 交通银行股份有限公司(“交通银行”) | 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。

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2016年2月3日(基金合同生效日)<br>至2016年6月30日 |                  | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |                  |
|-------|-----------------------------------------|------------------|---------------------------------|------------------|
|       | 成交金额                                    | 占当期股票<br>成交总额的比例 | 成交金额                            | 占当期股票<br>成交总额的比例 |
| 华鑫证券  | 391,767,925.12                          | 100.00%          | -                               | -                |

注：本基金基金合同于 2016 年 2 月 3 日正式生效，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的权证交易。本基金基金合同于 2016 年 2 月 3 日正式生效，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2016年2月3日(基金合同生效日)至2016年6月30日 |                |            |                  |
|-------|-------------------------------------|----------------|------------|------------------|
|       | 当期佣金                                | 占当期佣金总量<br>的比例 | 期末应付佣金余额   | 占期末应付佣金<br>总额的比例 |
| 华鑫证券  | 286,499.34                          | 100.00%        | 240,113.31 | 100.00%          |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年6月30日     |                |            |                  |
|       | 当期佣金                                | 占当期佣金总量<br>的比例 | 期末应付佣金余额   | 占期末应付佣金<br>总额的比例 |
| -     | -                                   | -              | -          | -                |

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。

3. 本基金基金合同于 2016 年 2 月 3 日正式生效，无上年度可比期间数据。

### 6.4.8.2 关联方报酬

#### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2016 年 2 月 3 日(基金合同生效<br>日)至 2016 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至<br>2015年6月30日 |
|-----------------|----------------------------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 474,328.66                                         | -                                   |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 134,952.60                                         | -                                   |

注: 1、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。

2、本基金基金合同于 2016 年 2 月 3 日正式生效,无上年度可比期间数据。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目             | 本期<br>2016年2月3日(基金合同生效日)<br>至2016年6月30日 | 上年度可比期间<br>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 | 118,582.14                              | -                               |

注: 1、支付基金托管人中国民生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。

2、本基金基金合同于 2016 年 2 月 3 日正式生效,无上年度可比期间数据。

#### 6.4.8.3 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。本基金基金合同于 2016 年 2 月 3 日正式生效,无上年度可比期间数据。

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。本基金基金合同于 2016 年 2 月 3 日正式生效,无上年度可比期间数据。

##### 6.4.8.4.2 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

本基金本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。本基金基金合同于 2016 年 2 月 3 日正式生效,无上年度可比期间数据。

#### 6.4.8.5 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<br>名称 | 本期                                          |           | 上年度可比期间                         |        |
|-----------|---------------------------------------------|-----------|---------------------------------|--------|
|           | 2016 年 2 月 3 日(基金合同生效日)至<br>2016 年 6 月 30 日 |           | 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 |
| 交通银行      | 1,180,686.64                                | 16,233.96 | -                               | -      |

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.8.6 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。本基金基金合同于 2016 年 2 月 3 日正式生效，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.8.7 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。本基金基金合同于 2016 年 2 月 3 日正式生效，无上年度可比期间数据。

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

##### 6.4.9.1 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。

##### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.9.3.1 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交易中作为抵押的债券。

###### 6.4.9.3.2 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交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.10 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 25,396,170.00 元，无属于第二层次和第三层次的余额。

(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 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。

(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    | 25,396,170.00 | 46.94         |
|    | 其中：股票   | 25,396,170.00 | 46.94         |
| 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      | 26,862,738.80 | 49.65  |
| 7 | 其他各项资产            | 1,846,393.03  | 3.41   |
| 8 | 合计                | 54,105,301.83 | 100.00 |

注：本基金本报告期末未通过沪港通交易机制投资港股。

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末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         | 556,500.00    | 1.07         |
| B  | 采矿业              | -             | -            |
| C  | 制造业              | 23,436,120.00 | 44.98        |
| 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           | 922,500.00    | 1.77         |
| 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  | 481,050.00    | 0.92         |
| 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               | 25,396,170.00 | 48.74        |

## 7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未通过沪港通交易机制投资港股。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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  | 002394 | 联发股份 | 200,000 | 3,020,000.00 | 5.80         |
| 2  | 000650 | 仁和药业 | 270,000 | 2,203,200.00 | 4.23         |
| 3  | 600597 | 光明乳业 | 170,000 | 2,155,600.00 | 4.14         |
| 4  | 600343 | 航天动力 | 87,500  | 2,080,750.00 | 3.99         |
| 5  | 600118 | 中国卫星 | 60,000  | 2,016,000.00 | 3.87         |
| 6  | 300429 | 强力新材 | 12,000  | 1,675,920.00 | 3.22         |
| 7  | 000070 | 特发信息 | 50,000  | 1,311,000.00 | 2.52         |
| 8  | 600480 | 凌云股份 | 90,000  | 1,269,000.00 | 2.44         |
| 9  | 300363 | 博腾股份 | 50,000  | 1,241,000.00 | 2.38         |
| 10 | 000901 | 航天科技 | 27,000  | 1,084,050.00 | 2.08         |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站（<http://www.msfnfunds.com.cn>）的半年度报告正文。

## 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  | 002006 | 精功科技 | 4,938,564.00 | 9.48           |
| 2  | 000028 | 国药一致 | 4,936,513.26 | 9.47           |
| 3  | 600257 | 大潮股份 | 4,776,997.66 | 9.17           |
| 4  | 600395 | 盘江股份 | 3,952,500.67 | 7.59           |
| 5  | 002123 | 荣信股份 | 3,816,999.64 | 7.33           |
| 6  | 002590 | 万安科技 | 3,521,820.75 | 6.76           |
| 7  | 002648 | 卫星石化 | 3,499,816.38 | 6.72           |
| 8  | 600028 | 中国石化 | 3,438,049.00 | 6.60           |
| 9  | 002371 | 七星电子 | 3,286,992.20 | 6.31           |
| 10 | 002394 | 联发股份 | 3,024,521.00 | 5.80           |
| 11 | 600104 | 上汽集团 | 3,006,493.35 | 5.77           |
| 12 | 002245 | 澳洋顺昌 | 2,955,401.00 | 5.67           |

|    |        |       |                 |       |
|----|--------|-------|-----------------|-------|
| 13 | 300093 | 金刚玻璃  | 2, 771, 003. 14 | 5. 32 |
| 14 | 002177 | 御银股份  | 2, 600, 549. 50 | 4. 99 |
| 15 | 601233 | 桐昆股份  | 2, 594, 947. 00 | 4. 98 |
| 16 | 600036 | 招商银行  | 2, 514, 900. 00 | 4. 83 |
| 17 | 600409 | 三友化工  | 2, 263, 476. 00 | 4. 34 |
| 18 | 000593 | 大通燃气  | 2, 255, 066. 26 | 4. 33 |
| 19 | 002446 | 盛路通信  | 2, 249, 218. 00 | 4. 32 |
| 20 | 300429 | 强力新材  | 2, 165, 746. 00 | 4. 16 |
| 21 | 002385 | 大北农   | 2, 154, 976. 63 | 4. 14 |
| 22 | 600597 | 光明乳业  | 2, 153, 425. 52 | 4. 13 |
| 23 | 002736 | 国信证券  | 2, 147, 177. 00 | 4. 12 |
| 24 | 601169 | 北京银行  | 2, 127, 101. 59 | 4. 08 |
| 25 | 000650 | 仁和药业  | 2, 088, 613. 19 | 4. 01 |
| 26 | 002025 | 航天电器  | 2, 086, 074. 60 | 4. 00 |
| 27 | 002727 | 一心堂   | 2, 082, 131. 65 | 4. 00 |
| 28 | 600188 | 兖州煤业  | 2, 054, 889. 00 | 3. 94 |
| 29 | 300148 | 天舟文化  | 2, 053, 642. 30 | 3. 94 |
| 30 | 002444 | 巨星科技  | 2, 012, 756. 00 | 3. 86 |
| 31 | 600118 | 中国卫星  | 2, 010, 838. 00 | 3. 86 |
| 32 | 002301 | 齐心集团  | 1, 988, 328. 00 | 3. 82 |
| 33 | 300088 | 长信科技  | 1, 986, 600. 00 | 3. 81 |
| 34 | 600343 | 航天动力  | 1, 966, 788. 00 | 3. 77 |
| 35 | 600358 | 国旅联合  | 1, 952, 911. 96 | 3. 75 |
| 36 | 601318 | 中国平安  | 1, 949, 739. 03 | 3. 74 |
| 37 | 002462 | 嘉事堂   | 1, 926, 090. 00 | 3. 70 |
| 38 | 600466 | 蓝光发展  | 1, 914, 529. 99 | 3. 67 |
| 39 | 002076 | 雪 莱 特 | 1, 896, 409. 00 | 3. 64 |
| 40 | 000971 | 高升控股  | 1, 882, 247. 00 | 3. 61 |
| 41 | 000703 | 恒逸石化  | 1, 835, 365. 00 | 3. 52 |
| 42 | 002339 | 积成电子  | 1, 823, 281. 60 | 3. 50 |
| 43 | 600568 | 中珠医疗  | 1, 807, 622. 00 | 3. 47 |
| 44 | 300009 | 安科生物  | 1, 799, 609. 00 | 3. 45 |
| 45 | 603601 | 再升科技  | 1, 789, 205. 28 | 3. 43 |
| 46 | 000615 | 京汉股份  | 1, 785, 598. 50 | 3. 43 |
| 47 | 002040 | 南 京 港 | 1, 771, 886. 36 | 3. 40 |
| 48 | 603528 | 多伦科技  | 1, 767, 645. 40 | 3. 39 |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 49 | 002133 | 广宇集团 | 1,766,112.00 | 3.39 |
| 50 | 002100 | 天康生物 | 1,752,796.05 | 3.36 |
| 51 | 300264 | 佳创视讯 | 1,745,155.00 | 3.35 |
| 52 | 600391 | 成发科技 | 1,719,569.00 | 3.30 |
| 53 | 002655 | 共达电声 | 1,715,621.00 | 3.29 |
| 54 | 600436 | 片仔癀  | 1,675,358.00 | 3.22 |
| 55 | 600037 | 歌华有线 | 1,672,450.00 | 3.21 |
| 56 | 300252 | 金信诺  | 1,635,484.00 | 3.14 |
| 57 | 002347 | 泰尔重工 | 1,622,451.00 | 3.11 |
| 58 | 300433 | 蓝思科技 | 1,599,400.00 | 3.07 |
| 59 | 000537 | 广宇发展 | 1,597,604.00 | 3.07 |
| 60 | 000807 | 云铝股份 | 1,597,081.00 | 3.06 |
| 61 | 600688 | 上海石化 | 1,584,567.00 | 3.04 |
| 62 | 601208 | 东材科技 | 1,557,899.28 | 2.99 |
| 63 | 600422 | 昆药集团 | 1,557,284.11 | 2.99 |
| 64 | 600199 | 金种子酒 | 1,549,915.00 | 2.97 |
| 65 | 300474 | 景嘉微  | 1,534,261.60 | 2.94 |
| 66 | 600595 | 中孚实业 | 1,504,882.00 | 2.89 |
| 67 | 000810 | 创维数字 | 1,473,911.00 | 2.83 |
| 68 | 300508 | 维宏股份 | 1,472,753.00 | 2.83 |
| 69 | 000513 | 丽珠集团 | 1,471,178.00 | 2.82 |
| 70 | 002182 | 云海金属 | 1,454,834.00 | 2.79 |
| 71 | 000625 | 长安汽车 | 1,435,000.00 | 2.75 |
| 72 | 600094 | 大名城  | 1,415,803.12 | 2.72 |
| 73 | 300406 | 九强生物 | 1,370,934.00 | 2.63 |
| 74 | 000070 | 特发信息 | 1,368,084.00 | 2.63 |
| 75 | 002007 | 华兰生物 | 1,333,197.00 | 2.56 |
| 76 | 600198 | 大唐电信 | 1,294,878.00 | 2.48 |
| 77 | 600480 | 凌云股份 | 1,235,896.98 | 2.37 |
| 78 | 601777 | 力帆股份 | 1,229,915.94 | 2.36 |
| 79 | 002335 | 科华恒盛 | 1,229,700.00 | 2.36 |
| 80 | 300363 | 博腾股份 | 1,215,000.00 | 2.33 |
| 81 | 002664 | 信质电机 | 1,201,434.58 | 2.31 |
| 82 | 603799 | 华友钴业 | 1,199,746.00 | 2.30 |
| 83 | 600855 | 航天长峰 | 1,157,334.00 | 2.22 |
| 84 | 300275 | 梅安森  | 1,144,506.00 | 2.20 |

|    |        |       |              |      |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 85 | 002039 | 黔源电力  | 1,140,278.00 | 2.19 |
| 86 | 002001 | 新 和 成 | 1,124,998.00 | 2.16 |
| 87 | 300306 | 远方光电  | 1,095,537.00 | 2.10 |
| 88 | 002104 | 恒宝股份  | 1,094,698.00 | 2.10 |
| 89 | 002090 | 金智科技  | 1,080,045.00 | 2.07 |
| 90 | 300486 | 东杰智能  | 1,079,734.00 | 2.07 |
| 91 | 300346 | 南大光电  | 1,062,556.80 | 2.04 |
| 92 | 603005 | 晶方科技  | 1,057,148.00 | 2.03 |

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<br>比例（%） |
|----|--------|-------|--------------|--------------------|
| 1  | 002006 | 精功科技  | 4,942,033.81 | 9.48               |
| 2  | 000028 | 国药一致  | 4,887,440.30 | 9.38               |
| 3  | 600257 | 大湖股份  | 4,378,594.00 | 8.40               |
| 4  | 600395 | 盘江股份  | 3,956,974.18 | 7.59               |
| 5  | 002123 | 荣信股份  | 3,784,667.00 | 7.26               |
| 6  | 002590 | 万安科技  | 3,683,378.41 | 7.07               |
| 7  | 600028 | 中国石化  | 3,489,204.00 | 6.70               |
| 8  | 002648 | 卫星石化  | 3,395,265.20 | 6.52               |
| 9  | 002371 | 七星电子  | 3,359,438.48 | 6.45               |
| 10 | 600104 | 上汽集团  | 3,055,887.00 | 5.86               |
| 11 | 300264 | 佳创视讯  | 3,028,000.00 | 5.81               |
| 12 | 002245 | 澳洋顺昌  | 2,946,843.00 | 5.66               |
| 13 | 300093 | 金刚玻璃  | 2,711,564.00 | 5.20               |
| 14 | 002177 | 御银股份  | 2,643,516.00 | 5.07               |
| 15 | 601233 | 桐昆股份  | 2,517,529.00 | 4.83               |
| 16 | 600036 | 招商银行  | 2,489,335.00 | 4.78               |
| 17 | 600409 | 三友化工  | 2,363,775.00 | 4.54               |
| 18 | 000593 | 大通燃气  | 2,269,959.72 | 4.36               |
| 19 | 002385 | 大北农   | 2,233,858.00 | 4.29               |
| 20 | 002025 | 航天电器  | 2,165,800.00 | 4.16               |
| 21 | 002446 | 盛路通信  | 2,162,556.00 | 4.15               |
| 22 | 601169 | 北京银行  | 2,124,365.75 | 4.08               |
| 23 | 002076 | 雪 莱 特 | 2,123,220.00 | 4.07               |
| 24 | 002736 | 国信证券  | 2,109,506.72 | 4.05               |

|    |        |       |              |      |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 25 | 300088 | 长信科技  | 2,107,114.00 | 4.04 |
| 26 | 300148 | 天舟文化  | 2,103,869.67 | 4.04 |
| 27 | 600188 | 兖州煤业  | 2,041,921.14 | 3.92 |
| 28 | 600358 | 国旅联合  | 1,998,079.00 | 3.83 |
| 29 | 002727 | 一心堂   | 1,990,213.00 | 3.82 |
| 30 | 601318 | 中国平安  | 1,954,149.12 | 3.75 |
| 31 | 603601 | 再升科技  | 1,903,578.18 | 3.65 |
| 32 | 000971 | 高升控股  | 1,898,356.00 | 3.64 |
| 33 | 002462 | 嘉事堂   | 1,879,790.63 | 3.61 |
| 34 | 002301 | 齐心集团  | 1,876,149.00 | 3.60 |
| 35 | 000703 | 恒逸石化  | 1,870,374.00 | 3.59 |
| 36 | 300009 | 安科生物  | 1,842,080.00 | 3.54 |
| 37 | 002339 | 积成电子  | 1,826,358.04 | 3.50 |
| 38 | 002444 | 巨星科技  | 1,818,117.00 | 3.49 |
| 39 | 600688 | 上海石化  | 1,813,187.56 | 3.48 |
| 40 | 002655 | 共达电声  | 1,790,809.00 | 3.44 |
| 41 | 002040 | 南 京 港 | 1,769,730.00 | 3.40 |
| 42 | 600466 | 蓝光发展  | 1,768,103.87 | 3.39 |
| 43 | 002100 | 天康生物  | 1,765,538.00 | 3.39 |
| 44 | 002347 | 泰尔重工  | 1,758,169.00 | 3.37 |
| 45 | 000810 | 创维数字  | 1,747,653.00 | 3.35 |
| 46 | 600391 | 成发科技  | 1,727,772.67 | 3.32 |
| 47 | 600568 | 中珠医疗  | 1,718,904.00 | 3.30 |
| 48 | 603528 | 多伦科技  | 1,681,575.80 | 3.23 |
| 49 | 000615 | 京汉股份  | 1,668,535.00 | 3.20 |
| 50 | 600436 | 片仔癀   | 1,655,400.00 | 3.18 |
| 51 | 300433 | 蓝思科技  | 1,649,143.00 | 3.16 |
| 52 | 002133 | 广宇集团  | 1,627,613.00 | 3.12 |
| 53 | 300252 | 金信诺   | 1,615,759.36 | 3.10 |
| 54 | 000537 | 广宇发展  | 1,585,352.69 | 3.04 |
| 55 | 002182 | 云海金属  | 1,571,123.28 | 3.02 |
| 56 | 600199 | 金种子酒  | 1,562,477.51 | 3.00 |
| 57 | 600422 | 昆药集团  | 1,561,504.00 | 3.00 |
| 58 | 000807 | 云铝股份  | 1,558,676.00 | 2.99 |
| 59 | 300474 | 景嘉微   | 1,554,706.00 | 2.98 |
| 60 | 300508 | 维宏股份  | 1,538,866.00 | 2.95 |
| 61 | 600595 | 中孚实业  | 1,528,525.00 | 2.93 |
| 62 | 600094 | 大名城   | 1,526,360.00 | 2.93 |

|    |        |       |                 |       |
|----|--------|-------|-----------------|-------|
| 63 | 601208 | 东材科技  | 1, 522, 149. 00 | 2. 92 |
| 64 | 600037 | 歌华有线  | 1, 507, 260. 00 | 2. 89 |
| 65 | 000625 | 长安汽车  | 1, 445, 500. 00 | 2. 77 |
| 66 | 000513 | 丽珠集团  | 1, 428, 667. 34 | 2. 74 |
| 67 | 300406 | 九强生物  | 1, 373, 922. 73 | 2. 64 |
| 68 | 002007 | 华兰生物  | 1, 341, 399. 00 | 2. 57 |
| 69 | 600198 | 大唐电信  | 1, 269, 220. 00 | 2. 44 |
| 70 | 002335 | 科华恒盛  | 1, 243, 888. 92 | 2. 39 |
| 71 | 600855 | 航天长峰  | 1, 243, 761. 53 | 2. 39 |
| 72 | 601777 | 力帆股份  | 1, 208, 550. 04 | 2. 32 |
| 73 | 300486 | 东杰智能  | 1, 170, 696. 00 | 2. 25 |
| 74 | 002039 | 黔源电力  | 1, 162, 230. 00 | 2. 23 |
| 75 | 603799 | 华友钴业  | 1, 140, 700. 00 | 2. 19 |
| 76 | 002664 | 信质电机  | 1, 135, 540. 81 | 2. 18 |
| 77 | 300275 | 梅安森   | 1, 086, 605. 00 | 2. 09 |
| 78 | 002104 | 恒宝股份  | 1, 069, 523. 00 | 2. 05 |
| 79 | 300306 | 远方光电  | 1, 065, 903. 08 | 2. 05 |
| 80 | 002001 | 新 和 成 | 1, 060, 526. 00 | 2. 04 |

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 | 207, 503, 475. 30 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 184, 264, 449. 82 |

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前十名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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场 and 期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

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

### 7.12.2

本基金投资的前十名股票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   | 47,147.08    |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,705,437.79 |
| 3 | 应收股利    | -            |
| 4 | 应收利息    | 16,101.10    |
| 5 | 应收申购款   | 77,707.06    |
| 6 | 其他应收款   | -            |
| 7 | 待摊费用    | -            |
| 8 | 其他      | -            |
| 9 | 合计      | 1,846,393.03 |

#### 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债。

#### 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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额          | 占总份<br>额比例 |
| 672          | 75,510.00     | 7,983,945.07 | 15.73%     | 42,758,774.19 | 84.27%     |

#### 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（2016年2月3日）基金份额总额           | 272,945,460.49 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额              | 683,411.08     |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额            | 222,886,152.31 |
| 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                       | 50,742,719.26  |

## § 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 |    |
| 华鑫证券 | 2      | 391,767,925.12 | 100.00%      | 286,499.34 | 100.00%    | -  |

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，本基金的所有交易单元均为新增交易单元。

**10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 |              | 债券回购交易           |                | 权证交易 |              |
|------|------|--------------|------------------|----------------|------|--------------|
|      | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额             | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 华鑫证券 | -    | -            | 5,612,745,000.00 | 100.00%        | -    | -            |

摩根士丹利华鑫基金管理有限公司  
2016 年 8 月 29 日