

摩根士丹利华鑫消费领航混合型证券投资 基金 2016 年年度报告摘要

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：摩根士丹利华鑫基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

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

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	大摩消费领航混合
基金主代码	233008
交易代码	233008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 12 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	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	212,042,077.94 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过深入研究，致力挖掘并投资于消费行业和受消费数量增长及结构变革引领而快速发展的相关行业中，具有竞争优势和估值优势的优秀上市公司，把握消费数量增长和结构变革所带来的投资机会，在严格控制投资风险的前提下，追求基金资产长期稳定增值。
投资策略	本基金将采取积极、主动的资产配置策略，重点关注在消费数量增长及结构变革的背景下，中国消费行业企业和受消费数量增长及结构变革引领而快速发展的相关企业，并从中寻找具有良好财务状况、较高核心价值与估值优势的优质上市公司进行投资。 1. 大类资产配置：采取“自上而下”的多因素分析决策支持，结合定性分析和定量分析，对权益类资产和固定收益类资产的风险收益特征进行分析预测，在完全遵照基金合同的基础上，确定未来一段时间的大类资产配置方案。 2. 股票投资策略：本基金将在资产配置方案确定后，根据投资主题及其辐射消费链，进行行业配置，并从中精选具备持续成长能力并有一定估值优势的上市公司，即主营业务收入和市场占有率不断提升的企业、有形或无形资产持续增长的企业、产品技术或服务水平超越行业平均水平的企业、以及在所覆盖行业中有垄断地位的企业。 3. 固定收益投资策略：本基金采用的主要固定收益投资策略包括：利率预期策略、收益率曲线策略、信用利差策略、公司/企业债券策略、可转换债券策略、资产支持证券策略等。 4. 权证等其他金融工具投资策略：本基金对权证的投

	资建立在对标的证券和组合收益风险分析的基础上，以 Black-Scholes 模型和二叉树期权定价模型为基础对权证进行分析定价，并根据市场情况对定价模型和参数进行适当修正。
业绩比较基准	沪深 300 指数×55% + 中证综合债券指数×45%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期收益和风险高于货币型基金、债券型基金，而低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险、中高收益品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		摩根士丹利华鑫基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李锦	田青
	联系电话	(0755) 88318883	(010) 67595096
	电子邮箱	xxpl@msfunds.com.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8888-668	(010) 67595096
传真		(0755) 82990384	(010) 66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.msfunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处。

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-127,783,475.63	267,699,164.18	511,888,536.12
本期利润	-125,088,460.80	269,565,102.43	193,237,913.25
加权平均基金份额本期利润	-0.5065	0.7023	0.1486
本期基金份额净值增长率	-35.01%	43.64%	8.54%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0639	0.4403	0.0027
期末基金资产净值	198,502,964.07	363,677,249.90	658,885,193.06
期末基金份额净值	0.9361	1.4403	1.0027

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣

除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2. 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，而非当期发生数）；

3. 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

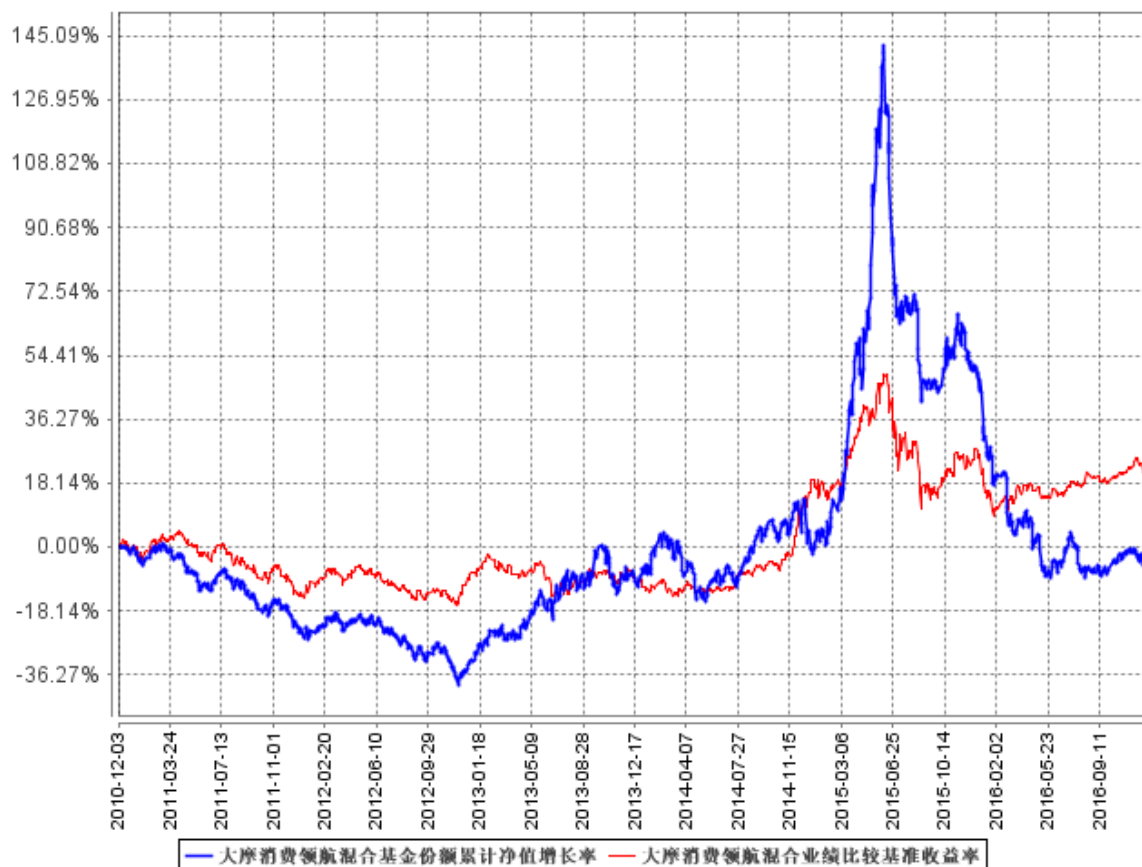
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	-0.13%	0.78%	1.46%	0.39%	-1.59%	0.39%
过去六个月	-6.01%	0.92%	3.75%	0.42%	-9.76%	0.50%
过去一年	-35.01%	1.36%	-4.00%	0.77%	-31.01%	0.59%
过去三年	1.33%	1.62%	32.80%	0.98%	-31.47%	0.64%
过去五年	22.02%	1.47%	38.52%	0.89%	-16.50%	0.58%
自基金合同 生效起至今	-6.39%	1.38%	20.50%	0.86%	-26.89%	0.52%

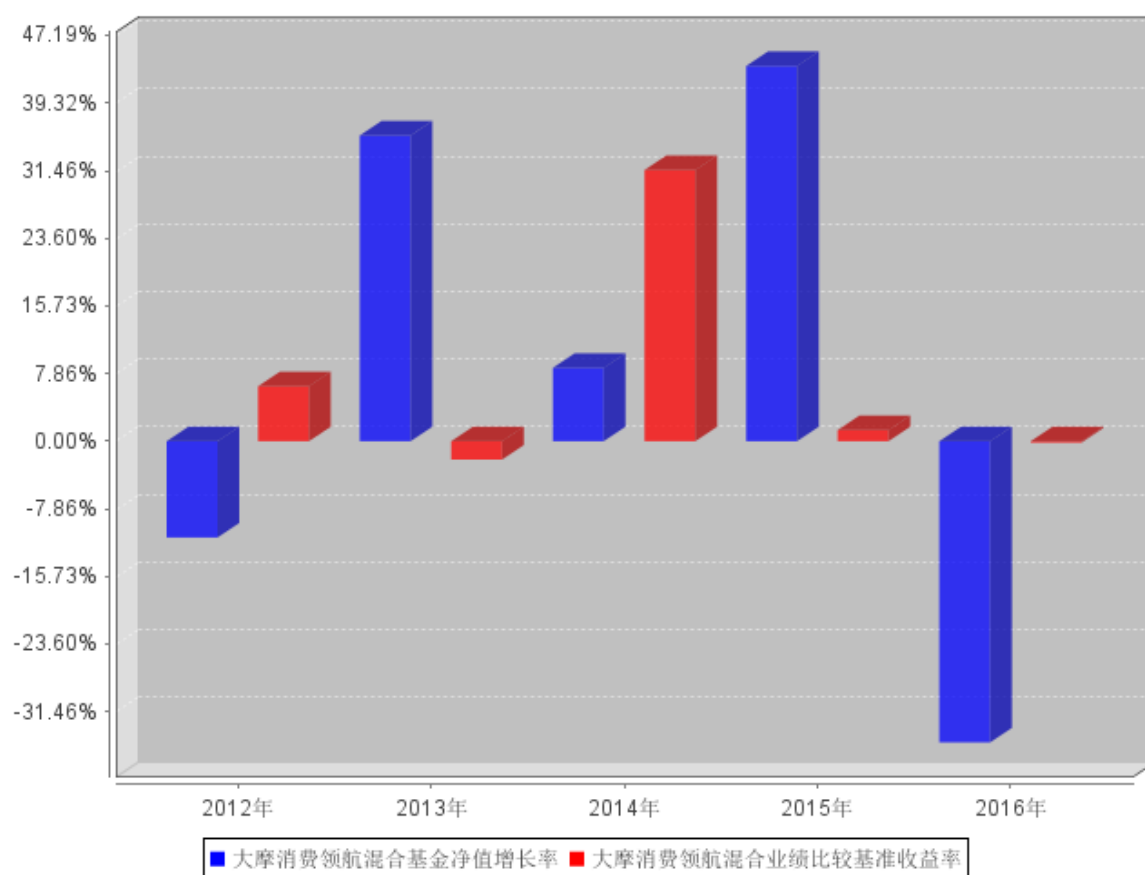
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

大摩消费领航混合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



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

大摩消费领航混合过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年无利润分配的情况。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止 2016 年 12 月 31 日，公司旗下共管理二十四只基金产品，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、摩根士丹利华鑫健康产业混合型证券投资基金和摩根士丹利华鑫多元兴利 18 个月定期开放债券型证券投资基金。同时，公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
司巍	基金经理	2015 年 1 月 22 日	-	6	浙江大学电子信息工程硕士。曾任华西证券有限责任公司自营部投资经理助理，东源嘉盈资产管理有限公司研究员。2012 年 9 月加入本公司，历任研究员、基金经理助理，2015 年 1 月起任本基金基金经理。

注：1、基金经理的任职日期为根据本公司决定确定的聘任日期；

2、基金经理任职已按规定在中国证券投资基金业协会办理完毕基金经理注册；

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况有 28 次，为量化投资基金因执行投资策略和其他组合发生的反向交易，基金管理人未发现其他异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，本基金对组合进行了均衡化操作，将部分成长股的仓位置换成价值型股票和周期板块个股。截至 2016 年末，本基金的股票仓位为 74.52%，未配置债券资产。

2016 年，市场在年初迅速调整后呈现震荡上行的走势。从结构上看，市场资金整体上呈现从

成长股流出，并进入价值股和周期股的趋势。本基金在上半年持有较多的成长股仓位，对净值带来一定影响，因此从下半年开始，对组合进行了均衡化的操作，增加了价值型股票和周期板块个股的配置，净值表现有所改善。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期截至 2016 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.9361 元，累计份额净值为 0.9361 元，报告期内基金份额净值增长率为-35.01%，同期业绩比较基准收益率为-4.00%。

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 2017 年，虽然国内外形势依旧复杂，但中国的国家竞争力在全球范围内还在加强。经过去年年末的系列流动性事件冲击及风险释放，短期市场资金紧张局面正在缓解。今年年初以来的人民币汇率表现，也使得市场对人民币持续贬值的预期有所缓和。但是从中长期来看，监管层对于资产泡沫的担忧仍会使得货币政策呈现收紧状态。而新股的大量供给，再融资以及解禁的持续压力，都成为制约市场大幅上行的制约因素。因此，我们认为 2017 全年市场走势仍以震荡为主，本基金的投资策略将以挖掘结构性机会为主。

面对复杂的市场环境，本基金将采取适度均衡的投资策略，重点将集中在三大方向：第一，着力于寻找具有广阔发展空间的行业和个股，特别关注消费升级、智能驾驶、科教文卫、军工、互联网金融、大数据、基因治疗等；第二，关注受益涨价的周期性行业；第三，关注以效率增进为目标的国企改革相关标的。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

本报告期，基金管理人完成的主要监察稽核工作如下：

(1) 完成专项检查工作。检查范围覆盖投资研究交易、基金销售、特定客户资产管理业务、业务持续性计划、自有资金投资及风险准备金、反洗钱业务等方面。(2) 做好日常监控工作。规范基金投资、销售以及运营等各项业务管理，通过监控基金投资运作、优化关键业务流程、审核宣传推介材料、监督后台运营业务等工作，加强日常风险监控，保障公司和基金运作合法合规。(3) 通过制度定期回顾机制持续完善公司内控制度体系，同时，适时以合规指引方式解读监管政策与要求，加强各项业务流程控制。公司已建立起覆盖公司业务各个方面，更为全面、完善的内控制度体系，保障公司合规、安全、高效运营。(4) 加强员工合规行为管理。根据法律法规和业务环境的变化不断修订并充实培训材料，改进合规培训形式，进一步提升员工风控意识及合规意

识。(5) 有效地推进投资风险管理系统等合规监控系统的建设, 加强风险管理手段, 提高工作效率。(6) 加强新产品和新业务的风险管理。

2017 年, 基金管理人将继续本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产, 加强风险控制, 保障公司和基金的合法合规运作, 保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

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

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

本基金本报告期财务会计报告经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计并出具了标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：摩根士丹利华鑫消费领航混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	48,049,849.16	154,797,778.47
结算备付金	2,068,279.05	8,964,302.95
存出保证金	360,044.38	1,732,223.52
交易性金融资产	147,922,297.27	210,565,491.76

其中：股票投资	147,922,297.27	210,565,491.76
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	8,738,644.98	-
应收利息	12,984.04	42,353.73
应收股利	-	-
应收申购款	50,461.74	851,466.85
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	207,202,560.62	376,953,617.28
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2016 年 12 月 31 日	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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	3,914,778.20	4,076,720.14
应付赎回款	446,207.99	410,691.65
应付管理人报酬	260,769.92	488,199.71
应付托管费	43,461.66	81,366.62
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,103,176.49	5,162,959.34
应交税费	2,677,142.45	2,677,142.45
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	254,059.84	379,287.47
负债合计	8,699,596.55	13,276,367.38
所有者权益：		
实收基金	212,042,077.94	252,498,597.22
未分配利润	-13,539,113.87	111,178,652.68
所有者权益合计	198,502,964.07	363,677,249.90
负债和所有者权益总计	207,202,560.62	376,953,617.28

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9361 元，基金份额总额 212,042,077.94 份。

7.2 利润表

会计主体：摩根士丹利华鑫消费领航混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入	-106,495,060.33	309,441,611.49
1. 利息收入	754,440.42	1,842,542.00
其中：存款利息收入	752,718.60	1,488,190.20
债券利息收入	-	308,089.20
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,721.82	46,262.60
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-109,993,253.11	304,853,719.27
其中：股票投资收益	-111,059,635.38	324,622,073.88
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-21,474,100.61
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	1,066,382.27	1,705,746.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	2,695,014.83	1,865,938.25
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	48,737.53	879,411.97
减：二、费用	18,593,400.47	39,876,509.06
1. 管理人报酬	3,797,961.28	8,597,866.71
2. 托管费	632,993.50	1,432,977.80
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	13,749,365.57	29,411,358.03
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	413,080.12	434,306.52
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-125,088,460.80	269,565,102.43
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-125,088,460.80	269,565,102.43

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：摩根士丹利华鑫消费领航混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	252,498,597.22	111,178,652.68	363,677,249.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-125,088,460.80	-125,088,460.80
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-40,456,519.28	370,694.25	-40,085,825.03
其中：1. 基金申购款	47,844,892.75	810,422.35	48,655,315.10
2. 基金赎回款	-88,301,412.03	-439,728.10	-88,741,140.13
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）	212,042,077.94	-13,539,113.87	198,502,964.07
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	657,090,585.36	1,794,607.70	658,885,193.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	269,565,102.43	269,565,102.43
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）	-404,591,988.14	-160,181,057.45	-564,773,045.59
其中：1. 基金申购款	442,443,663.22	366,079,009.76	808,522,672.98
2. 基金赎回款	-847,035,651.36	-526,260,067.21	-1,373,295,718.57
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）	252,498,597.22	111,178,652.68	363,677,249.90

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

摩根士丹利华鑫消费领航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[2010]第 1201 号《关于核准摩根士丹利华鑫消费领航混合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《摩根士丹利华鑫消费领航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 3,756,261,778.69 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(2010)第 357 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《摩根士丹利华鑫消费领航混合型证券投资基金基金合同》于 2010 年 12 月 3 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 3,757,272,435.76 份基金份额,其中认购资金利息折合 1,010,657.07 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《摩根士丹利华鑫消费领航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,包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下,本基金的投资组合范围为:股票资产占基金资产的 30%-80%,其中投资于消费行业和受消费数量增长及结构变革引领而快速发展的相关行业的上市公司股票市值不低于股票资产的 80%;基金持有权证的市值不得超过基金资产净值的 3%;现金、债券等固定收益类资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 20%-70%,其中现金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%。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数×55% + 中证综合债券指数×45%。

本财务报表由本基金的基金管理人摩根士丹利华鑫基金管理有限公司于 2017 年 3 月 15 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投

资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《摩根士丹利华鑫消费领航混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 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 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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。

7.4.5 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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政策的补充通知》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,对国债、地方政府债以及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,股票的股息、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,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,

解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

7.4.7 关联方关系

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
华鑫证券	151,990,909.70	1.67%	-	-

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
华鑫证券	141,549.17	1.68%	-	-

关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
华鑫证券	-	-	-	-

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

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

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,797,961.28	8,597,866.71
其中：支付销售机构的客户维护费	1,725,152.05	3,993,927.86

注：支付基金管理人摩根士丹利华鑫基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值

1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31 日
当期发生的基金应支付的托管费	632,993.50	1,432,977.80

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

7.4.8.3 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。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况**7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期内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。

7.4.8.4.2 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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

7.4.8.5 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

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	48,049,849.16	666,992.36	154,797,778.47	1,344,447.68

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券**7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601375	中原证券	2016 年 12 月 20 日	2017 年 1 月 3 日	新股流通受限	4.00	4.00	16,344	65,376.00	65,376.00	-
603877	太平鸟	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 9 日	新股流通受限	21.30	21.30	2,671	56,892.30	56,892.30	-
002838	道恩股份	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 6 日	新股流通受限	15.28	15.28	682	10,420.96	10,420.96	-
300586	美联新材	2016 年 12 月 26 日	2017 年 1 月 4 日	新股流通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-

300591	万里马	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	新股流 通受限	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-
--------	-----	------------------------	-----------------------	------------	------	------	-------	----------	----------	---

7.4.9.2 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。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

7.4.10 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 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 147,772,893.42 元，属于第二层次的余额为 149,403.85 元，无属于第三层次的余额（2015 年 12 月 31 日：第一层次 197,562,586.00 元，第二层次 13,002,905.76 元，无属于第三层次的余额）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(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。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	147,922,297.27	71.39
	其中：股票	147,922,297.27	71.39
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	50,118,128.21	24.19
7	其他各项资产	9,162,135.14	4.42
8	合计	207,202,560.62	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	33,219,360.00	16.73
C	制造业	97,695,175.27	49.22

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	12,966,366.00	6.53
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	65,376.00	0.03
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,976,020.00	2.00
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	147,922,297.27	74.52

8.3 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	002570	贝因美	800,000	10,496,000.00	5.29
2	000822	山东海化	1,329,904	9,429,019.36	4.75
3	600759	洲际油气	940,000	9,230,800.00	4.65
4	600547	山东黄金	235,000	8,579,850.00	4.32
5	002068	黑猫股份	1,000,000	8,380,000.00	4.22
6	300200	高盟新材	440,000	7,876,000.00	3.97
7	600489	中金黄金	649,000	7,846,410.00	3.95
8	002697	红旗连锁	960,000	7,756,800.00	3.91
9	002353	杰瑞股份	380,000	7,714,000.00	3.89
10	002456	欧菲光	225,000	7,713,000.00	3.89

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.msfunds.com.cn>)的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600395	盘江股份	74,920,488.52	20.60
2	000933	*ST 神火	68,458,535.22	18.82
3	000983	西山煤电	66,374,784.56	18.25
4	000776	广发证券	64,865,153.39	17.84
5	300059	东方财富	62,324,545.72	17.14
6	601198	东兴证券	62,120,565.72	17.08
7	600030	中信证券	57,576,997.90	15.83
8	600547	山东黄金	55,786,476.95	15.34
9	600546	*ST 山煤	54,449,922.88	14.97
10	601628	中国人寿	47,406,596.24	13.04
11	601328	交通银行	44,907,137.32	12.35
12	601988	中国银行	44,141,946.56	12.14
13	002570	贝因美	43,504,671.70	11.96
14	002673	西部证券	39,005,313.60	10.73
15	601699	潞安环能	38,146,193.54	10.49
16	600489	中金黄金	37,305,064.60	10.26
17	002780	三夫户外	36,529,237.49	10.04
18	002500	山西证券	36,405,914.62	10.01
19	601688	华泰证券	34,989,230.80	9.62
20	002235	安妮股份	33,868,087.51	9.31
21	601998	中信银行	33,629,588.56	9.25
22	603799	华友钴业	33,288,837.71	9.15
23	601336	新华保险	31,938,929.37	8.78
24	300496	中科创达	29,524,607.70	8.12
25	300085	银之杰	29,008,976.12	7.98
26	300081	恒信移动	28,025,893.45	7.71
27	600081	东风科技	27,848,235.33	7.66
28	300431	暴风集团	27,424,241.69	7.54
29	600837	海通证券	27,398,249.00	7.53

30	600519	贵州茅台	27,093,616.66	7.45
31	600036	招商银行	26,992,930.96	7.42
32	300104	乐视网	25,914,928.90	7.13
33	000858	五 粮 液	25,897,992.68	7.12
34	002488	金固股份	25,730,238.85	7.08
35	002284	亚太股份	25,665,744.00	7.06
36	603999	读者传媒	25,205,500.75	6.93
37	002035	华帝股份	25,074,068.12	6.89
38	002656	摩登大道	24,784,157.31	6.81
39	600136	当代明诚	24,571,455.77	6.76
40	002779	中坚科技	24,502,708.80	6.74
41	600392	盛和资源	24,449,259.05	6.72
42	603936	博敏电子	24,042,540.88	6.61
43	002188	巴士在线	23,451,429.85	6.45
44	600358	国旅联合	23,347,647.88	6.42
45	002456	欧菲光	23,036,758.32	6.33
46	002467	二六三	22,962,082.00	6.31
47	603398	邦宝益智	22,801,669.50	6.27
48	600446	金证股份	22,586,444.23	6.21
49	300061	康耐特	21,987,914.41	6.05
50	600199	金种子酒	21,957,733.56	6.04
51	002094	青岛金王	21,433,585.18	5.89
52	300031	宝通科技	21,363,542.10	5.87
53	002655	共达电声	21,334,479.16	5.87
54	601398	工商银行	21,314,922.00	5.86
55	300352	北信源	21,302,220.00	5.86
56	600109	国金证券	21,178,200.14	5.82
57	300302	同有科技	21,137,739.14	5.81
58	600005	武钢股份	20,964,976.89	5.76
59	600699	均胜电子	20,432,774.00	5.62
60	000980	金马股份	20,222,679.54	5.56
61	000066	长城电脑	20,219,693.04	5.56
62	600158	中体产业	20,164,199.64	5.54
63	002055	得润电子	19,798,483.00	5.44
64	600809	山西汾酒	19,742,786.00	5.43
65	002425	凯撒文化	19,624,070.75	5.40

66	000768	中航飞机	19,245,295.56	5.29
67	002582	好想你	19,139,007.52	5.26
68	000050	深天马 A	18,967,981.84	5.22
69	600366	宁波韵升	18,802,298.69	5.17
70	002543	万和电气	18,680,461.23	5.14
71	600026	中海发展	18,492,970.90	5.08
72	000006	深振业 A	18,492,132.74	5.08
73	000728	国元证券	18,343,227.88	5.04
74	600759	洲际油气	18,245,983.10	5.02
75	002190	成飞集成	18,241,924.00	5.02
76	002177	御银股份	18,219,136.03	5.01
77	601872	招商轮船	18,030,822.90	4.96
78	600685	中船防务	17,788,370.00	4.89
79	600536	中国软件	17,393,066.62	4.78
80	300235	方直科技	17,374,779.16	4.78
81	300314	戴维医疗	17,310,432.20	4.76
82	300311	任子行	17,221,167.55	4.74
83	600117	西宁特钢	17,024,676.55	4.68
84	000045	深纺织 A	16,892,330.80	4.64
85	000799	酒鬼酒	16,796,818.00	4.62
86	600597	光明乳业	16,723,546.50	4.60
87	600409	三友化工	16,619,609.72	4.57
88	300493	润欣科技	16,545,819.04	4.55
89	002025	航天电器	16,424,008.17	4.52
90	300364	中文在线	16,325,681.45	4.49
91	002155	湖南黄金	16,247,559.66	4.47
92	300494	盛天网络	16,231,973.76	4.46
93	002253	川大智胜	16,205,251.69	4.46
94	601233	桐昆股份	15,984,531.35	4.40
95	600336	澳柯玛	15,861,099.00	4.36
96	300109	新开源	15,762,971.04	4.33
97	000970	中科三环	15,758,846.00	4.33
98	002364	中恒电气	15,017,558.14	4.13
99	600232	金鹰股份	14,913,333.55	4.10
100	600138	中青旅	14,831,556.48	4.08
101	300073	当升科技	14,739,451.53	4.05

102	000937	冀中能源	14,694,676.92	4.04
103	600197	伊力特	14,663,856.66	4.03
104	002762	金发拉比	14,580,547.00	4.01
105	600019	宝钢股份	14,578,189.00	4.01
106	002245	澳洋顺昌	14,396,707.75	3.96
107	000818	方大化工	14,041,647.53	3.86
108	300146	汤臣倍健	13,896,667.20	3.82
109	000065	北方国际	13,786,400.50	3.79
110	601088	中国神华	13,731,764.32	3.78
111	601001	大同煤业	13,413,923.22	3.69
112	002340	格林美	13,220,100.44	3.64
113	000915	山大华特	13,159,055.00	3.62
114	603869	北部湾旅	13,077,417.24	3.60
115	600188	兖州煤业	13,057,437.65	3.59
116	600332	白云山	12,860,362.00	3.54
117	600754	锦江股份	12,838,119.16	3.53
118	002468	申通快递	12,744,441.00	3.50
119	601601	中国太保	12,294,082.99	3.38
120	600528	中铁二局	12,293,835.56	3.38
121	600475	华光股份	12,213,600.00	3.36
122	603000	人民网	12,060,840.60	3.32
123	601788	光大证券	12,034,650.96	3.31
124	002343	慈文传媒	12,017,978.00	3.30
125	002786	银宝山新	12,002,194.00	3.30
126	002371	七星电子	11,965,078.32	3.29
127	002304	洋河股份	11,646,020.59	3.20
128	000829	天音控股	11,017,893.81	3.03
129	002594	比亚迪	10,979,690.00	3.02
130	000016	深康佳 A	10,961,609.00	3.01
131	300007	汉威电子	10,878,542.74	2.99
132	300377	赢时胜	10,869,629.44	2.99
133	300348	长亮科技	10,844,209.39	2.98
134	000568	泸州老窖	10,739,482.00	2.95
135	600589	广东榕泰	10,715,728.72	2.95
136	002341	新纶科技	10,691,379.60	2.94
137	600476	湘邮科技	10,685,071.44	2.94

138	300134	大富科技	10,637,132.00	2.92
139	002494	华斯股份	10,621,932.00	2.92
140	000889	茂业通信	10,600,473.36	2.91
141	600533	栖霞建设	10,591,509.74	2.91
142	000971	高升控股	10,585,039.10	2.91
143	002174	游族网络	10,560,446.00	2.90
144	002624	完美世界	10,472,425.82	2.88
145	601566	九牧王	10,470,195.00	2.88
146	002446	盛路通信	10,401,634.78	2.86
147	600525	长园集团	10,401,598.79	2.86
148	600986	科达股份	10,385,056.66	2.86
149	603299	井神股份	10,360,955.00	2.85
150	601799	星宇股份	10,335,477.00	2.84
151	300166	东方国信	10,280,434.00	2.83
152	300368	汇金股份	10,266,812.30	2.82
153	300491	通合科技	10,229,079.50	2.81
154	601288	农业银行	10,208,000.00	2.81
155	300397	天和防务	10,106,871.00	2.78
156	002133	广宇集团	10,089,526.38	2.77
157	000998	隆平高科	10,064,029.92	2.77
158	600855	航天长峰	10,058,748.99	2.77
159	601899	紫金矿业	9,930,027.50	2.73
160	002313	日海通讯	9,927,789.00	2.73
161	002142	宁波银行	9,907,019.74	2.72
162	002609	捷顺科技	9,877,567.50	2.72
163	002659	中泰桥梁	9,868,554.00	2.71
164	600645	中源协和	9,817,464.00	2.70
165	002625	龙生股份	9,742,953.61	2.68
166	600779	水井坊	9,637,289.00	2.65
167	600850	华东电脑	9,574,646.88	2.63
168	002405	四维图新	9,567,763.00	2.63
169	600410	华胜天成	9,533,727.22	2.62
170	600029	南方航空	9,529,509.00	2.62
171	600006	东风汽车	9,506,752.02	2.61
172	000566	海南海药	9,471,638.00	2.60
173	002181	粤传媒	9,459,067.28	2.60

174	601555	东吴证券	9,451,429.00	2.60
175	600661	新南洋	9,450,049.92	2.60
176	002736	国信证券	9,448,668.16	2.60
177	600889	南京化纤	9,420,199.46	2.59
178	600073	上海梅林	9,408,561.44	2.59
179	000524	岭南控股	9,402,718.00	2.59
180	600691	阳煤化工	9,397,856.54	2.58
181	300458	全志科技	9,397,065.40	2.58
182	002684	猛狮科技	9,348,592.00	2.57
183	000538	云南白药	9,343,193.15	2.57
184	600048	保利地产	9,332,432.00	2.57
185	600527	江南高纤	9,258,102.00	2.55
186	600559	老白干酒	9,248,119.82	2.54
187	600016	民生银行	9,240,356.96	2.54
188	002385	大北农	9,229,059.75	2.54
189	600523	贵航股份	9,209,292.26	2.53
190	300127	银河磁体	9,165,806.00	2.52
191	300131	英唐智控	9,161,051.00	2.52
192	300106	西部牧业	9,126,785.05	2.51
193	600085	同仁堂	9,114,682.00	2.51
194	002701	奥瑞金	9,099,893.72	2.50
195	600428	中远航运	9,076,747.00	2.50
196	600702	沱牌舍得	9,037,928.15	2.49
197	600119	长江投资	8,992,158.21	2.47
198	002149	西部材料	8,985,348.00	2.47
199	300465	高伟达	8,820,239.10	2.43
200	000651	格力电器	8,816,508.16	2.42
201	000060	中金岭南	8,798,743.00	2.42
202	600429	三元股份	8,769,612.74	2.41
203	002048	宁波华翔	8,765,495.31	2.41
204	000822	山东海化	8,756,813.84	2.41
205	002642	荣之联	8,723,266.24	2.40
206	300413	快乐购	8,718,831.75	2.40
207	600885	宏发股份	8,666,812.65	2.38
208	000422	湖北宜化	8,664,815.06	2.38
209	600782	新钢股份	8,657,207.78	2.38

210	002247	帝龙文化	8,635,762.71	2.37
211	600596	新安股份	8,626,507.77	2.37
212	002308	威创股份	8,609,194.00	2.37
213	000565	渝三峡 A	8,540,435.50	2.35
214	002386	天原集团	8,473,415.40	2.33
215	002648	卫星石化	8,447,586.22	2.32
216	002068	黑猫股份	8,442,084.07	2.32
217	300141	和顺电气	8,431,372.50	2.32
218	600369	西南证券	8,412,223.00	2.31
219	601668	中国建筑	8,400,000.00	2.31
220	300484	蓝海华腾	8,370,933.60	2.30
221	300200	高盟新材	8,287,807.44	2.28
222	300508	维宏股份	8,173,201.96	2.25
223	000069	华侨城 A	8,077,364.00	2.22
224	300432	富临精工	8,022,273.92	2.21
225	002353	杰瑞股份	7,995,823.91	2.20
226	600141	兴发集团	7,981,959.00	2.19
227	601766	中国中车	7,980,000.00	2.19
228	002697	红旗连锁	7,920,001.53	2.18
229	600352	浙江龙盛	7,855,342.00	2.16
230	000783	长江证券	7,763,260.00	2.13
231	600584	长电科技	7,664,563.50	2.11
232	601689	拓普集团	7,545,082.98	2.07

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

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	600395	盘江股份	74,360,499.56	20.45
2	000933	*ST 神火	68,849,840.76	18.93
3	000983	西山煤电	67,682,536.32	18.61
4	000776	广发证券	64,662,328.60	17.78
5	300059	东方财富	61,731,383.08	16.97
6	601198	东兴证券	60,178,549.36	16.55
7	600030	中信证券	55,860,320.40	15.36
8	600546	*ST 山煤	53,169,452.42	14.62

9	601328	交通银行	44,147,816.00	12.14
10	601628	中国人寿	44,112,374.12	12.13
11	600547	山东黄金	43,409,395.99	11.94
12	601988	中国银行	43,126,580.35	11.86
13	002673	西部证券	39,319,775.65	10.81
14	300061	康耐特	38,329,685.14	10.54
15	601699	潞安环能	37,705,040.54	10.37
16	002500	山西证券	36,850,932.89	10.13
17	002780	三夫户外	36,581,453.84	10.06
18	002467	二六三	34,775,527.54	9.56
19	601688	华泰证券	34,459,511.02	9.48
20	603799	华友钴业	32,990,288.69	9.07
21	002570	贝因美	32,399,042.27	8.91
22	300496	中科创达	32,294,501.10	8.88
23	601998	中信银行	31,528,716.05	8.67
24	601336	新华保险	30,902,818.00	8.50
25	300109	新开源	29,868,479.56	8.21
26	002655	共达电声	29,516,845.20	8.12
27	300085	银之杰	29,343,201.94	8.07
28	002456	欧菲光	28,635,851.73	7.87
29	002235	安妮股份	28,307,637.44	7.78
30	600081	东风科技	28,130,648.00	7.74
31	002035	华帝股份	28,012,989.25	7.70
32	600837	海通证券	27,817,374.00	7.65
33	600519	贵州茅台	27,102,317.21	7.45
34	600036	招商银行	26,853,444.85	7.38
35	600489	中金黄金	26,699,757.90	7.34
36	002488	金固股份	26,359,900.79	7.25
37	002284	亚太股份	25,618,927.97	7.04
38	000858	五粮液	25,095,377.44	6.90
39	002656	摩登大道	24,795,722.79	6.82
40	600392	盛和资源	24,666,326.10	6.78
41	002779	中坚科技	24,146,275.28	6.64
42	300081	恒信移动	24,094,579.27	6.63
43	300104	乐视网	23,898,867.59	6.57
44	300458	全志科技	23,676,675.30	6.51
45	002188	巴士在线	23,457,849.56	6.45
46	300431	暴风集团	23,323,349.00	6.41

47	603999	读者传媒	23,295,827.80	6.41
48	002094	青岛金王	23,254,547.80	6.39
49	600446	金证股份	23,060,283.57	6.34
50	300031	宝通科技	23,005,004.28	6.33
51	603936	博敏电子	22,602,262.51	6.21
52	600699	均胜电子	22,428,686.98	6.17
53	600136	当代明诚	22,259,157.85	6.12
54	600158	中体产业	21,969,305.47	6.04
55	600358	国旅联合	21,636,138.18	5.95
56	600109	国金证券	21,601,481.03	5.94
57	603398	邦宝益智	21,578,375.55	5.93
58	601398	工商银行	21,235,000.00	5.84
59	000768	中航飞机	20,971,757.17	5.77
60	000066	长城电脑	20,940,860.33	5.76
61	600645	中源协和	20,723,796.83	5.70
62	600199	金种子酒	20,611,683.62	5.67
63	002543	万和电气	20,393,463.41	5.61
64	002582	好想你	20,329,985.38	5.59
65	002055	得润电子	20,316,848.57	5.59
66	000050	深天马 A	20,316,206.41	5.59
67	600005	武钢股份	20,075,310.70	5.52
68	300352	北信源	19,232,886.62	5.29
69	000006	深振业 A	18,298,220.43	5.03
70	600809	山西汾酒	18,243,380.00	5.02
71	600366	宁波韵升	18,241,926.48	5.02
72	000728	国元证券	18,238,431.25	5.02
73	600026	中海发展	18,234,674.57	5.01
74	000799	酒鬼酒	18,155,952.23	4.99
75	002190	成飞集成	18,090,949.12	4.97
76	002177	御银股份	17,959,311.24	4.94
77	002425	凯撒文化	17,899,916.53	4.92
78	601872	招商轮船	17,763,787.00	4.88
79	600536	中国软件	17,489,663.00	4.81
80	300302	同有科技	17,142,719.88	4.71
81	600409	三友化工	17,046,615.10	4.69
82	300364	中文在线	16,776,669.24	4.61
83	000045	深纺织 A	16,506,856.33	4.54
84	300314	戴维医疗	16,476,173.00	4.53

85	300383	光环新网	16,357,771.00	4.50
86	300311	任子行	16,342,551.00	4.49
87	300235	方直科技	16,341,174.16	4.49
88	600685	中船防务	16,264,725.58	4.47
89	600197	伊力特	16,217,793.04	4.46
90	002025	航天电器	16,170,844.99	4.45
91	000818	方大化工	16,097,597.15	4.43
92	000065	北方国际	16,013,598.64	4.40
93	600117	西宁特钢	15,844,651.87	4.36
94	600597	光明乳业	15,741,487.91	4.33
95	002253	川大智胜	15,712,001.92	4.32
96	300493	润欣科技	15,566,102.16	4.28
97	002155	湖南黄金	15,450,036.52	4.25
98	601233	桐昆股份	15,266,936.74	4.20
99	300073	当升科技	15,265,759.19	4.20
100	000915	山大华特	15,244,634.55	4.19
101	300494	盛天网络	15,125,374.30	4.16
102	600138	中青旅	14,946,867.18	4.11
103	000513	丽珠集团	14,804,338.20	4.07
104	002517	恺英网络	14,781,012.67	4.06
105	000937	冀中能源	14,724,180.64	4.05
106	600232	金鹰股份	14,649,255.68	4.03
107	002364	中恒电气	14,509,361.69	3.99
108	000970	中科三环	14,366,727.19	3.95
109	002245	澳洋顺昌	13,969,556.00	3.84
110	300146	汤臣倍健	13,812,095.85	3.80
111	601088	中国神华	13,753,604.00	3.78
112	002762	金发拉比	13,664,281.48	3.76
113	601001	大同煤业	13,573,715.46	3.73
114	600019	宝钢股份	13,561,225.10	3.73
115	002340	格林美	13,266,896.75	3.65
116	603869	北部湾旅	13,211,865.37	3.63
117	600188	兖州煤业	12,946,994.00	3.56
118	600475	华光股份	12,861,771.09	3.54
119	600332	白云山	12,699,497.68	3.49
120	002371	七星电子	12,635,881.49	3.47
121	300491	通合科技	12,243,796.25	3.37
122	002468	申通快递	12,203,277.00	3.36

123	600528	中铁二局	12,077,193.72	3.32
124	600754	锦江股份	11,817,637.97	3.25
125	600718	东软集团	11,768,797.76	3.24
126	601601	中国太保	11,516,510.72	3.17
127	300016	北陆药业	11,438,269.80	3.15
128	601788	光大证券	11,097,002.76	3.05
129	603000	人民网	11,081,101.73	3.05
130	600559	老白干酒	11,073,996.66	3.05
131	002494	华斯股份	11,021,852.52	3.03
132	601566	九牧王	10,982,273.00	3.02
133	300377	赢时胜	10,959,301.68	3.01
134	002304	洋河股份	10,911,428.90	3.00
135	000980	金马股份	10,887,790.00	2.99
136	600702	沱牌舍得	10,851,803.22	2.98
137	600476	湘邮科技	10,793,712.97	2.97
138	601555	东吴证券	10,780,850.00	2.96
139	601799	星宇股份	10,751,666.50	2.96
140	600589	广东榕泰	10,711,457.00	2.95
141	002786	银宝山新	10,697,476.66	2.94
142	002624	完美世界	10,596,570.58	2.91
143	603299	井神股份	10,548,170.00	2.90
144	000971	高升控股	10,517,274.91	2.89
145	300348	长亮科技	10,495,473.20	2.89
146	002594	比亚迪	10,449,736.00	2.87
147	300134	大富科技	10,412,103.00	2.86
148	600525	长园集团	10,383,213.00	2.86
149	002446	盛路通信	10,344,491.84	2.84
150	601288	农业银行	10,262,000.00	2.82
151	002405	四维图新	10,235,938.98	2.81
152	300007	汉威电子	10,225,244.10	2.81
153	000568	泸州老窖	10,215,369.43	2.81
154	600527	江南高纤	10,179,978.80	2.80
155	300166	东方国信	10,166,349.00	2.80
156	600006	东风汽车	10,133,649.42	2.79
157	002341	新纶科技	10,131,662.14	2.79
158	002609	捷顺科技	10,102,110.00	2.78
159	600779	水井坊	10,071,463.50	2.77
160	002659	中泰桥梁	10,069,644.00	2.77

161	000998	隆平高科	9,957,911.80	2.74
162	600759	洲际油气	9,946,701.00	2.74
163	300236	上海新阳	9,927,116.00	2.73
164	300369	绿盟科技	9,827,913.26	2.70
165	000566	海南海药	9,774,220.98	2.69
166	300106	西部牧业	9,694,534.06	2.67
167	002142	宁波银行	9,647,918.12	2.65
168	002343	慈文传媒	9,646,251.50	2.65
169	600850	华东电脑	9,637,223.69	2.65
170	600410	华胜天成	9,576,363.00	2.63
171	002181	粤传媒	9,526,217.00	2.62
172	600119	长江投资	9,514,624.57	2.62
173	300131	英唐智控	9,478,170.70	2.61
174	002313	日海通讯	9,426,137.00	2.59
175	600016	民生银行	9,425,415.34	2.59
176	600596	新安股份	9,419,019.70	2.59
177	000524	岭南控股	9,404,823.48	2.59
178	600029	南方航空	9,372,285.79	2.58
179	601899	紫金矿业	9,325,540.00	2.56
180	600048	保利地产	9,321,873.00	2.56
181	300508	维宏股份	9,304,865.80	2.56
182	600533	栖霞建设	9,303,164.03	2.56
183	002684	猛狮科技	9,289,915.94	2.55
184	000538	云南白药	9,285,169.20	2.55
185	600523	贵航股份	9,251,345.11	2.54
186	002149	西部材料	9,237,738.98	2.54
187	002133	广宇集团	9,208,523.16	2.53
188	600073	上海梅林	9,201,232.83	2.53
189	300368	汇金股份	9,194,281.00	2.53
190	300465	高伟达	9,179,367.00	2.52
191	002385	大北农	9,172,545.00	2.52
192	600986	科达股份	9,113,931.90	2.51
193	300127	银河磁体	9,066,788.97	2.49
194	000829	天音控股	9,043,332.20	2.49
195	002174	游族网络	9,031,094.70	2.48
196	600661	新南洋	8,993,307.45	2.47
197	002736	国信证券	8,966,309.66	2.47
198	300484	蓝海华腾	8,909,560.00	2.45

199	600428	中远航运	8,875,397.57	2.44
200	002642	荣之联	8,781,448.40	2.41
201	000651	格力电器	8,772,618.15	2.41
202	002625	龙生股份	8,762,596.16	2.41
203	000422	湖北宣化	8,748,169.62	2.41
204	600885	宏发股份	8,738,950.10	2.40
205	600085	同仁堂	8,676,961.49	2.39
206	300141	和顺电气	8,638,728.45	2.38
207	002701	奥瑞金	8,609,890.20	2.37
208	600855	航天长峰	8,558,872.92	2.35
209	000889	茂业通信	8,470,569.60	2.33
210	000060	中金岭南	8,441,877.75	2.32
211	600369	西南证券	8,388,111.61	2.31
212	000016	深康佳 A	8,361,928.00	2.30
213	002048	宁波华翔	8,360,130.59	2.30
214	002308	威创股份	8,307,642.62	2.28
215	600429	三元股份	8,274,453.68	2.28
216	300397	天和防务	8,267,154.00	2.27
217	002648	卫星石化	8,259,150.05	2.27
218	600782	新钢股份	8,251,066.78	2.27
219	600352	浙江龙盛	8,207,012.80	2.26
220	600141	兴发集团	8,075,083.92	2.22
221	002247	帝龙文化	7,862,772.78	2.16
222	601668	中国建筑	7,784,000.00	2.14
223	300432	富临精工	7,723,814.00	2.12
224	000783	长江证券	7,709,111.00	2.12
225	600336	澳柯玛	7,684,990.00	2.11
226	601689	拓普集团	7,675,843.75	2.11
227	600111	北方稀土	7,568,747.00	2.08
228	000969	安泰科技	7,548,262.00	2.08
229	601766	中国中车	7,541,791.00	2.07
230	000565	渝三峡 A	7,399,341.00	2.03
231	000069	华侨城 A	7,314,495.00	2.01

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	4,562,088,148.99
--------------	------------------

卖出股票收入（成交）总额	4,516,366,722.93
--------------	------------------

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

根据本基金基金合同规定，本基金不参与贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

根据本基金基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

8.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	360,044.38
2	应收证券清算款	8,738,644.98
3	应收股利	—
4	应收利息	12,984.04
5	应收申购款	50,461.74
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	9,162,135.14

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
12,746	16,635.97	475,292.77	0.22%	211,566,785.17	99.78%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	103,756.64	0.0489%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年12月3日）基金份额总额	3,757,272,435.76
本报告期期初基金份额总额	252,498,597.22
本报告期基金总申购份额	47,844,892.75
减:本报告期基金总赎回份额	88,301,412.03
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	212,042,077.94

§ 11 重大事件揭示**11.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金未改变投资策略。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。报告期内应支付给聘任会计师事务所——普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）2016 年度审计的报酬为 60,000.00 元。目前普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已连续六年向本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国信证券	1	1,037,515,920.07	11.43%	966,241.76	11.46%	-
中银国际	2	1,009,451,265.99	11.12%	940,102.84	11.15%	-
银河证券	1	906,993,625.96	9.99%	844,681.38	10.02%	-
海通证券	1	840,801,267.92	9.26%	783,039.06	9.29%	-
安信证券	2	768,933,439.07	8.47%	716,108.27	8.50%	-
中泰证券	1	706,258,167.44	7.78%	657,733.93	7.80%	-
广发证券	1	551,660,433.52	6.08%	513,762.04	6.10%	-
国金证券	1	371,048,424.67	4.09%	345,556.79	4.10%	-
中投证券	1	365,389,029.00	4.03%	340,286.30	4.04%	-
中信建投	1	322,482,509.33	3.55%	300,329.52	3.56%	-
华创证券	1	319,216,135.77	3.52%	297,286.24	3.53%	-
中信证券	3	307,129,824.45	3.38%	286,029.34	3.39%	-
民生证券	1	297,787,122.03	3.28%	277,329.23	3.29%	-
东方证券	2	282,743,122.84	3.11%	263,318.03	3.12%	-
平安证券	1	282,588,551.89	3.11%	263,174.57	3.12%	-
长江证券	2	255,249,402.21	2.81%	237,714.39	2.82%	-
华鑫证券	2	151,990,909.70	1.67%	141,549.17	1.68%	-

浙商证券	2	127,724,493.43	1.41%	93,405.36	1.11%	-
光大证券	1	103,468,826.18	1.14%	96,359.95	1.14%	-
兴业证券	1	54,393,654.95	0.60%	50,657.32	0.60%	-
瑞银证券	1	14,082,910.15	0.16%	13,115.44	0.16%	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
中信证券（山东）	2	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	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，本基金增加了 7 家证券公司的 9 个专用交易单元，其中浙商证券、川财证券各 2 个，信达证券、天风证券、华林证券、东吴证券、长城证券各 1 个；本基金减少了中信证券交易单元 2 个。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	20,000,000.00	100.00%	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

中信证券（山东）	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

摩根士丹利华鑫基金管理有限公司
2017 年 3 月 30 日