

摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券 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	大摩深证 300 指数增强
基金主代码	233010
交易代码	233010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 11 月 15 日
基金管理人	摩根士丹利华鑫基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	32,134,864.54 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		摩根士丹利华鑫基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李锦	田青
	联系电话	(0755) 88318883	(010) 67595096
	电子邮箱	xxpl@msfunds.com.cn	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。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
注册登记机构	摩根士丹利华鑫基金管理有限公司	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第二座 17 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	1,837,303.50	26,714,288.39	8,280,235.38
本期利润	-10,121,818.57	27,524,909.41	18,691,627.26
加权平均基金份额本期利润	-0.3119	0.6771	0.2333
本期基金份额净值增长率	-18.28%	36.43%	30.49%
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	0.4166	0.6675	0.1023
期末基金资产净值	45,522,614.36	55,869,760.74	83,596,121.59
期末基金份额净值	1.417	1.734	1.271

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。

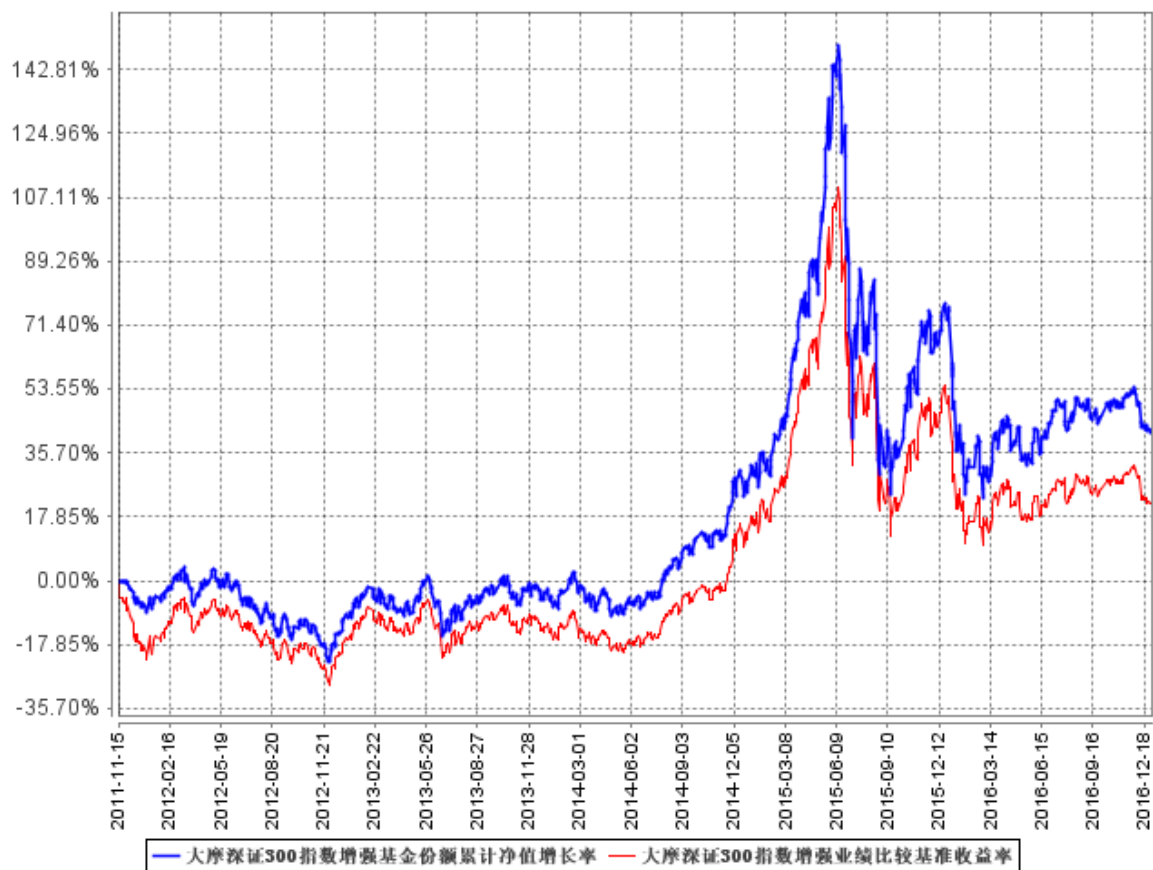
3.2 基金净值表现

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	-3.08%	0.80%	-3.29%	0.80%	0.21%	0.00%
过去六个月	-1.67%	0.89%	-2.21%	0.88%	0.54%	0.01%
过去一年	-18.28%	1.76%	-18.35%	1.66%	0.07%	0.10%
过去三年	45.48%	2.05%	38.39%	1.85%	7.09%	0.20%
过去五年	51.55%	1.78%	48.17%	1.67%	3.38%	0.11%
自基金合同生效起至今	41.70%	1.76%	21.57%	1.66%	20.13%	0.10%

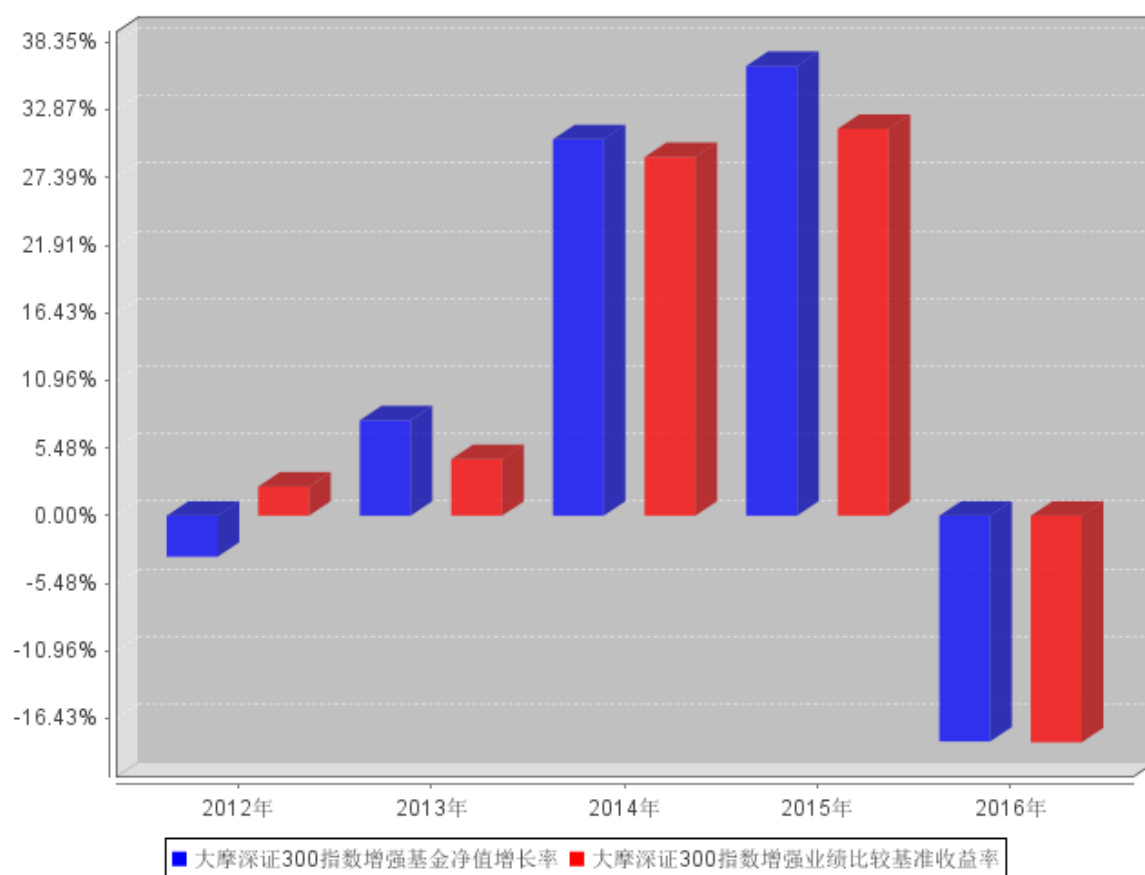
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



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

大摩深证300指数增强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		
吴国雄	基金经理	2016 年 7 月 16 日	-	9	金融风险管理师（FRM），香港科技大学金融数学与统计专业硕士，曾任职于安信证券股份有限公司风险管理部。2013 年 5 月加入本公司，历任风险管理部风险管理经理、量化投资部基金经理助理、量化投资部投资经理。2016 年 6 月起担任摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 7 月起任本基金基金经理，2017 年 1 月起任摩根士丹利华鑫睿成中小盘弹性股票型证券投资基金基金经理。
周宁	基金投资部副总监、基金经理	2014 年 12 月 9 日	2016 年 7 月 16 日	8	首都经济贸易大学会计学硕士。曾任东兴证券股份有限公司行业研究员。2010 年 9 月加入本公司，历任研究员、基金经理助理。2014

					年 12 月至 2016 年 7 月任本基金基金经理，2015 年 6 月至 2016 年 7 月任摩根士丹利华鑫新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 11 月至 2016 年 7 月担任摩根士丹利华鑫卓越成长混合型证券投资基金基金经理。
缪东航	基金经理助理	2016 年 2 月 23 日	2016 年 7 月 19 日	7	北京大学金融学硕士。曾任华安基金管理有限公司建材行业研究员，2012 年 9 月加入本公司，历任研究管理部研究员、基金经理助理。

注：1、基金经理、基金经理助理的任职日期、离任日期均为根据本公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

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

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

现公平交易管理控制目标。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

2016 年中国经济平稳收官，四个季度的经济增速分别为 6.7%、6.7%、6.7%、6.8%，全年增速 6.7%，PPI（生产物价指数）在历经 54 个月的通缩后转正，带动企业盈利改善，经济步入补库存周期。房地产方面，中央经济会议明确提升了防控风险的战略地位，并将抑制房地产泡沫视为未来的重点工作，预计地产销售端的降温和政策调控的预期对于房地产投资端的负面效应将逐步显现。消费方面，汽车和房地产消费分项仍然有所支撑，消费者信心稳步上行。国际环境方面，全球主要经济体通胀超预期，特朗普上台后的政策不确定性和欧洲“黑天鹅”事件都将持续加剧汇率市场的波动。

本基金主要通过量化模型作为投资交易决策的依据，通过科学的量化模型研究体系、严格的风险管理机制、高效的量化投资执行制度跟踪指数控制跟踪误差，并争取获得超额收益。本基金投资由三部分组成：一是“指数复制部分”，完全跟踪指数；二是“指数内增强部分”，精选指数内成分股，力争获得超额收益；三是“个股增强部分”，该部分通过量化模型精选指数成分股外具有超额收益的个股，其中第一第二部分资产占基金净值比例不低于 80%，三部分股票合计占基金资产的比例为 90%-95%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期截至 2016 年 12 月 31 日, 本基金份额净值为 1.417 元, 份额累计净值为 1.417 元, 报告期内基金份额净值增长率为-18.28%, 同期业绩比较基准收益率为-18.35%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年底, 在监管出台对保险“举牌”的限制政策、IPO 加速、美联储加息资本外流压力等一系列事件影响下, 资本市场流动性紧张, 股市债市一同下跌。债券市场在经历大幅下调后, 逐渐平稳。“一行三会”加强金融机构监管力度是中央经济改革工作安排的重要组成部分, 也是未来金融改革的长期工作方向, 去杠杆或将成为 2017 年供给侧改革重心。近期中央和地方的国企改革都有加速迹象, 中央经济工作会议首次提出了“农业供给侧改革”, 展望 2017 年, 我们认为“改革”带来的投资机会多于 2016 年, 政策相关的主题、行业或将带动 A 股的市场走势。

2017 年本基金将在继续跟踪基准指数的同时, 采用量化因子选股策略对“增强部分”进行管理, 通过科学的量化模型研究体系、严格的风险管理机制对组合的跟踪误差和投资限制进行控制。本基金将在控制跟踪误差的前提下, 力争超越基准, 取得超额收益。

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

本报告期内，本基金自 2016 年 1 月 7 日起存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，基金管理人已根据相关法规及基金合同规定向中国证监会报告并提出解决方案。本报告期内，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：摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金

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	3,325,951.14	3,181,998.46
结算备付金	180,218.42	91,503.18
存出保证金	4,416.07	33,842.51

交易性金融资产	42,231,136.31	52,979,448.95
其中：股票投资	42,231,136.31	52,979,448.95
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	849.24	797.79
应收股利	-	-
应收申购款	16,628.55	13,091.77
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	45,759,199.73	56,300,682.66
负债和所有者权益	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	2,326.76	193,341.32
应付管理人报酬	39,456.51	47,071.58
应付托管费	5,918.47	7,060.75
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	81,655.09	75,509.11
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	107,228.54	107,939.16
负债合计	236,585.37	430,921.92
所有者权益：		
实收基金	32,134,864.54	32,219,866.91
未分配利润	13,387,749.82	23,649,893.83
所有者权益合计	45,522,614.36	55,869,760.74
负债和所有者权益总计	45,759,199.73	56,300,682.66

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.417 元，基金份额总额 32,134,864.54 份。

7.2 利润表

会计主体：摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 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	-8,852,684.57	29,632,169.95
1.利息收入	29,194.17	37,902.14
其中：存款利息收入	24,905.95	37,902.14
债券利息收入	4,288.22	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	3,060,116.90	28,634,209.15
其中：股票投资收益	2,646,059.14	28,241,963.08
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-652.00	-
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	414,709.76	392,246.07
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-11,959,122.07	810,621.02
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	17,126.43	149,437.64
减：二、费用	1,269,134.00	2,107,260.54
1. 管理人报酬	464,106.66	670,186.44
2. 托管费	69,615.97	100,527.97
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	376,257.74	976,651.79
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	359,153.63	359,894.34
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-10,121,818.57	27,524,909.41
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-10,121,818.57	27,524,909.41

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 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）	32,219,866.91	23,649,893.83	55,869,760.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-10,121,818.57	-10,121,818.57
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）	-85,002.37	-140,325.44	-225,327.81
其中：1. 基金申购款	11,679,335.00	4,853,041.25	16,532,376.25
2. 基金赎回款	-11,764,337.37	-4,993,366.69	-16,757,704.06
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	32,134,864.54	13,387,749.82	45,522,614.36
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）	65,773,140.13	17,822,981.46	83,596,121.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	27,524,909.41	27,524,909.41
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）	-33,553,273.22	-21,697,997.04	-55,251,270.26
其中：1. 基金申购款	55,703,746.28	40,335,139.28	96,038,885.56
2. 基金赎回款	-89,257,019.50	-62,033,136.32	-151,290,155.82
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	32,219,866.91	23,649,893.83	55,869,760.74

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

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

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

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》、《摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强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	59,563,593.46	24.12%	45,116,118.99	7.24%

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	55,471.37	24.12%	-	-
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	41,073.77	7.21%	-	-

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	464,106.66	670,186.44
其中：支付销售机构的客户维护费	229,224.94	320,735.37

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

1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.00% / 当年天数。

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	69,615.97	100,527.97

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

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无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 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**

本基金本报告期及上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.8.5 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	3,325,951.14	23,170.71	3,181,998.46	33,066.94

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
002840	华统股份	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 10 日	新股流通受限	6.55	6.55	1,391	9,111.05	9,111.05	-
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	455	6,952.40	6,952.40	-
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	531	4,938.30	4,938.30	-
300591	万里	2016 年	2017 年	新股流通	3.07	3.07	1,040	3,192.80	3,192.80	-

	马	12 月 30 日	1 月 10 日	受限						
--	---	-----------	----------	----	--	--	--	--	--	--

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300496	中科创达	2016 年 10 月 11 日	重大资产重组	52.28	2017 年 1 月 6 日	47.49	7,300	395,666.89	381,644.00	-
000166	申万宏源	2016 年 12 月 21 日	重大事项	6.25	2017 年 1 月 26 日	6.29	55,311	370,562.81	345,693.75	-
000540	中天城投	2016 年 11 月 28 日	重大资产重组	6.93	2017 年 1 月 3 日	7.00	40,100	275,989.00	277,893.00	-
300088	长信科技	2016 年 9 月 12 日	重大资产重组	15.80	-	-	16,100	193,006.65	254,380.00	-
300104	乐视网	2016 年 12 月 7 日	重大资产重组	35.80	2017 年 1 月 16 日	36.88	6,644	273,568.51	237,855.20	-
002129	中环股份	2016 年 4 月 25 日	重大事项	8.27	-	-	11,951	98,571.67	98,834.77	-
002400	省广股份	2016 年 11 月 28 日	重大事项	13.79	-	-	5,700	79,998.00	78,603.00	-
000887	中鼎股份	2016 年 11 月 18 日	重大资产重组	25.94	2017 年 2 月 15 日	23.99	3,000	72,450.00	77,820.00	-
000750	国海证券	2016 年 12 月 15 日	重大事项	6.97	2017 年 1 月 20 日	6.27	10,791	89,609.72	75,213.27	-
000748	长城信息	2016 年 11 月 1 日	重大资产重组	20.31	-	-	3,400	70,278.00	69,054.00	-

300123	太阳鸟	2016 年 9 月 28 日	重大资产重组	15.08	2017 年 2 月 15 日	16.59	4,300	68,486.00	64,844.00	-
000516	国际医学	2016 年 12 月 5 日	重大资产重组	7.90	-	-	7,700	52,591.00	60,830.00	-
603399	新华龙	2016 年 10 月 20 日	重大资产重组	11.21	-	-	4,600	43,286.00	51,566.00	-
300367	东方网力	2016 年 12 月 15 日	重大资产重组	20.04	-	-	2,200	54,340.00	44,088.00	-
002491	通鼎互联	2016 年 12 月 22 日	重大事项	15.54	2017 年 1 月 3 日	15.89	2,700	47,425.61	41,958.00	-
300212	易华录	2016 年 11 月 30 日	重大资产重组	34.00	-	-	1,100	37,675.00	37,400.00	-
002629	仁智股份	2016 年 10 月 10 日	重大资产重组	13.11	2017 年 2 月 17 日	12.31	2,700	32,935.00	35,397.00	-
000697	炼石有色	2016 年 11 月 17 日	重大资产重组	23.51	-	-	1,400	32,298.00	32,914.00	-
002159	三特索道	2016 年 12 月 29 日	重大事项	32.00	2017 年 1 月 6 日	31.60	1,000	31,960.00	32,000.00	-
002681	奋达科技	2016 年 12 月 19 日	重大资产重组	12.93	-	-	1,500	20,805.00	19,395.00	-
000693	ST 华泽	2016 年 3 月 1 日	重大事项	12.50	-	-	900	22,171.00	11,250.00	-
000547	航天发展	2016 年 4 月 19 日	重大资产重组	15.36	2017 年 1 月 3 日	16.90	100	2,796.00	1,536.00	-

注：1. 本基金截至 2016 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，除长城信息外该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

2. 根据长城信息产业股份有限公司(以下简称“长城信息”)于 2016 年 10 月 25 日公布的《关于中国长城计算机深圳股份有限公司换股合并公司事宜的提示性公告》和中国长城计算机深圳股份有限公司(以下简称“长城电脑”)于 2017 年 1 月 20 日公布的《中国长城计算机深圳股份有限公司换股合并长城信息产业股份有限公司及重大资产置换和发行股份购买资产并募集配套资金暨关联交易报告书(修订稿)》,长城电脑将向长城信息全体股东发行 A 股股票,以换股比例 1: 0.5424 取得长城信息股东持有的长城信息全部股票,吸收合并长城信息;长城信息自 2016 年 11 月 1 日起连续停牌。换股合并后新增的长城电脑股票于 2017 年 1 月 18 日上市流通,当日开盘单价为 10.63 元。长城信息人民币普通股股票自 2017 年 1 月 18 日起终止上市并摘牌。

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交易中作为抵押的债券。

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交易中作为抵押的债券。

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 39,876,772.77 元,属于第二层次的余额为 2,354,363.54 元,无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日:第一层次 48,210,555.17 元,第二层次 4,768,893.78 元,无第三层次)。

(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	42,231,136.31	92.29
	其中:股票	42,231,136.31	92.29
2	固定收益投资	—	—
	其中:债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	3,506,169.56	7.66
7	其他各项资产	21,893.86	0.05
8	合计	45,759,199.73	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	249,706.92	0.55
B	采矿业	170,832.70	0.38
C	制造业	21,237,728.05	46.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,135,971.40	2.50
E	建筑业	649,753.50	1.43
F	批发和零售业	884,186.50	1.94
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	3,435,557.70	7.55
J	金融业	2,941,913.12	6.46
K	房地产业	2,995,572.83	6.58
L	租赁和商务服务业	863,597.55	1.90
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	1,084,580.88	2.38
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	224,556.10	0.49
R	文化、体育和娱乐业	855,018.00	1.88
S	综合	81,844.00	0.18
	合计	36,810,819.25	80.86

8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	102,156.00	0.22
B	采矿业	46,647.00	0.10
C	制造业	3,338,581.26	7.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	302,998.80	0.67

E	建筑业	61,600.00	0.14
F	批发和零售业	486,053.00	1.07
G	交通运输、仓储和邮政业	179,310.00	0.39
H	住宿和餐饮业	83,147.00	0.18
I	信息传输、软件和信息技术服务业	273,600.00	0.60
J	金融业	—	—
K	房地产业	118,537.00	0.26
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	88,214.00	0.19
N	水利、环境和公共设施管理业	154,683.00	0.34
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	62,384.00	0.14
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	122,406.00	0.27
	合计	5,420,317.06	11.91

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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	000002	万 科 A	39,702	815,876.10	1.79
2	000651	格力电器	32,480	799,657.60	1.76
3	000333	美的集团	24,400	687,348.00	1.51
4	000001	平安银行	60,453	550,122.30	1.21
5	000063	中兴通讯	32,900	524,755.00	1.15
6	000725	京东方 A	181,800	519,948.00	1.14
7	000858	五 粮 液	13,640	470,307.20	1.03
8	002736	国信证券	27,800	432,290.00	0.95
9	002415	海康威视	17,600	419,056.00	0.92
10	002310	东方园林	28,650	405,397.50	0.89

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.msfn.com.cn>)的年度报告正文。

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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	002593	日上集团	15,200	111,872.00	0.25
2	300395	菲利华	2,800	64,876.00	0.14
3	300123	太阳鸟	4,300	64,844.00	0.14
4	000909	数源科技	4,100	64,452.00	0.14
5	600333	长春燃气	8,200	64,452.00	0.14
6	000948	南天信息	3,600	63,720.00	0.14
7	300264	佳创视讯	6,000	63,600.00	0.14
8	300246	宝莱特	1,900	63,346.00	0.14
9	002039	黔源电力	3,817	62,598.80	0.14
10	000526	紫光学大	1,600	62,384.00	0.14

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	000002	万 科 A	2,792,438.00	5.00
2	000333	美的集团	2,030,043.00	3.63
3	000858	五 粮 液	1,734,323.00	3.10
4	000800	一汽轿车	1,631,271.00	2.92
5	000568	泸州老窖	1,602,432.00	2.87
6	002304	洋河股份	1,520,784.32	2.72
7	000651	格力电器	1,312,247.00	2.35
8	600409	三友化工	1,308,139.00	2.34
9	000028	国药一致	1,256,916.00	2.25
10	000581	威孚高科	1,183,150.00	2.12
11	002415	海康威视	1,113,440.00	1.99
12	002301	齐心集团	972,865.08	1.74
13	600594	益佰制药	963,375.00	1.72
14	002426	胜利精密	959,530.50	1.72

15	000725	京东方 A	958,329.00	1.72
16	000001	平安银行	956,819.00	1.71
17	000415	渤海金控	933,134.00	1.67
18	002006	精功科技	907,561.00	1.62
19	002450	康得新	893,854.00	1.60
20	000686	东北证券	871,485.00	1.56

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 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002450	康得新	2,752,407.01	4.93
2	002594	比亚迪	2,336,030.25	4.18
3	000002	万 科 A	2,185,889.00	3.91
4	000001	平安银行	2,174,449.56	3.89
5	000858	五 粮 液	2,109,482.00	3.78
6	000333	美的集团	2,080,200.40	3.72
7	000651	格力电器	1,673,338.00	3.00
8	002304	洋河股份	1,627,589.20	2.91
9	000568	泸州老窖	1,574,308.50	2.82
10	000800	一汽轿车	1,482,899.04	2.65
11	000625	长安汽车	1,393,390.20	2.49
12	300025	华星创业	1,345,890.00	2.41
13	600409	三友化工	1,249,632.00	2.24
14	002462	嘉事堂	1,214,133.00	2.17
15	002415	海康威视	1,150,203.54	2.06
16	000028	国药一致	1,112,174.00	1.99
17	002183	怡 亚 通	1,058,250.00	1.89
18	000581	威孚高科	1,028,931.68	1.84
19	002006	精功科技	1,003,989.00	1.80
20	000910	大亚圣象	914,891.06	1.64

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	122,785,785.19
卖出股票收入（成交）总额	124,221,034.90

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

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

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

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没有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	4,416.07
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	849.24
5	应收申购款	16,628.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,893.86

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

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300123	太阳鸟	64,844.00	0.14	重大资产重组

§ 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
2, 147	14, 967. 33	247, 529. 75	0. 77%	31, 887, 334. 79	99. 23%

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	—	—

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（2011 年 11 月 15 日）基金份额总额	421, 922, 840. 88
本报告期期初基金份额总额	32, 219, 866. 91
本报告期基金总申购份额	11, 679, 335. 00
减:本报告期基金总赎回份额	11, 764, 337. 37
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—
本报告期期末基金份额总额	32, 134, 864. 54

§ 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、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

报告期内本基金未改聘会计师事务所。报告期内本基金应支付给聘任会计师事务所——普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）2016 年度审计的报酬为 40,000.00 元。目前普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已连续五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	
中银国际	2	93,984,534.29	38.06%	87,527.61	38.06%	—
华鑫证券	2	59,563,593.46	24.12%	55,471.37	24.12%	—
中信建投	1	24,477,114.45	9.91%	22,795.77	9.91%	—
广发证券	1	20,931,615.28	8.48%	19,493.73	8.48%	—
海通证券	1	15,570,269.62	6.31%	14,500.62	6.31%	—

中泰证券	1	8,912,468.24	3.61%	8,299.76	3.61%	-
东方证券	2	7,303,241.56	2.96%	6,801.48	2.96%	-
华创证券	1	3,661,787.65	1.48%	3,410.38	1.48%	-
兴业证券	1	3,276,222.00	1.33%	3,051.15	1.33%	-
中投证券	1	2,976,978.04	1.21%	2,772.55	1.21%	-
瑞银证券	1	2,491,177.00	1.01%	2,320.08	1.01%	-
银河证券	1	1,837,382.96	0.74%	1,711.14	0.74%	-
国泰君安	1	933,579.52	0.38%	869.42	0.38%	-
光大证券	1	812,689.00	0.33%	756.89	0.33%	-
中信证券	3	205,561.00	0.08%	191.46	0.08%	-
中信证券（山东）	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-

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
中银国际	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券(山东)	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-

方正证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末通过租用的证券公司交易单元进行其他证券投资。

摩根士丹利华鑫基金管理有限公司
2017 年 3 月 30 日