

摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券 投资基金 2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：摩根士丹利华鑫基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
§3 主要财务指标和基金净值表现	9
3.1 主要会计数据和财务指标	9
3.2 基金净值表现	9
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
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	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	20

6.4 报表附注.....	21
§7 投资组合报告.....	44
7.1 期末基金资产组合情况.....	44
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	62
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	64
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.....	64
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	64
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.....	64
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.....	64
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	64
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	65
7.12 投资组合报告附注.....	65
§8 基金份额持有人信息.....	67
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	67
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	67
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.....	67
§9 开放式基金份额变动.....	68
§10 重大事件揭示.....	69
10.1 基金份额持有人大会决议.....	69
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.....	69
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	69
10.4 基金投资策略的改变.....	69
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	69
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.....	69
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	69
10.8 其他重大事件.....	73
§11 备查文件目录.....	76
11.1 备查文件目录.....	76

11.2 存放地点.....	76
11.3 查阅方式.....	76

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金
基金简称	大摩深证 300 指数增强
基金主代码	233010
交易代码	233010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 11 月 15 日
基金管理人	摩根士丹利华鑫基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	31,881,342.43 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
注册地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第二座第 17 层 01-04 室	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第二座第 17 层	北京市西城区闹市口大街 1 号 院 1 号楼
邮政编码		518048	100033
法定代表人		YU HUA(于华)	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.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(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	122, 164. 75
本期利润	3, 283, 112. 43
加权平均基金份额本期利润	0. 1026
本期加权平均净值利润率	7. 08%
本期基金份额净值增长率	7. 13%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	16, 526, 432. 61
期末可供分配基金份额利润	0. 5184
期末基金资产净值	48, 407, 775. 04
期末基金份额净值	1. 518
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	51. 80%

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

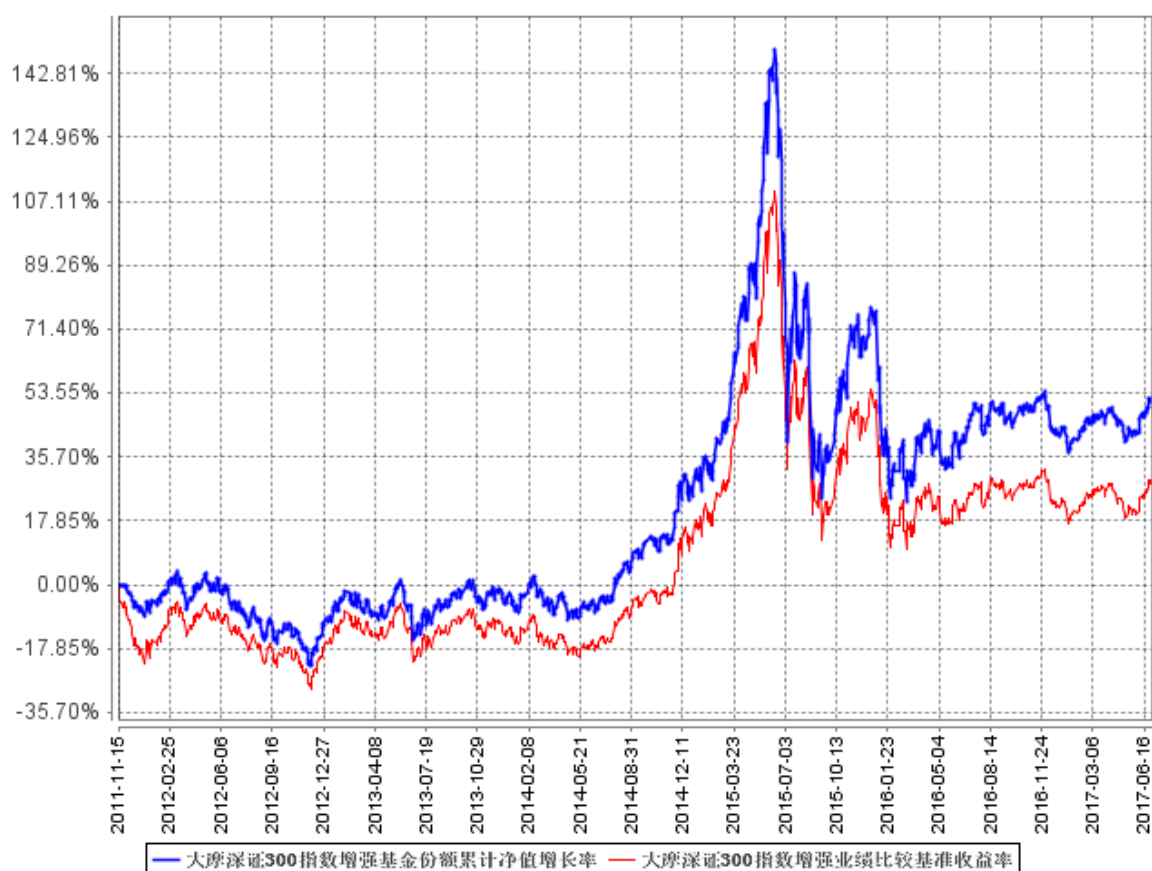
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标	业绩比较 基准收益	业绩比较基 准收益率标	①—③	②—④
----	--------------	--------------	--------------	----------------	-----	-----

		准差②	率③	准差④		
过去一个月	6.08%	0.69%	6.99%	0.77%	-0.91%	-0.08%
过去三个月	3.76%	0.70%	2.73%	0.81%	1.03%	-0.11%
过去六个月	7.13%	0.69%	6.27%	0.77%	0.86%	-0.08%
过去一年	5.34%	0.80%	3.92%	0.83%	1.42%	-0.03%
过去三年	58.95%	2.02%	52.91%	1.82%	6.04%	0.20%
自基金合同 生效起至今	51.80%	1.69%	29.19%	1.60%	22.61%	0.09%

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变动的比较

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



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止 2017 年 6 月 30 日，公司旗下共管理二十四只开放式基金，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、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、摩根士丹利华鑫睿成中小盘弹性股票型证券投资基金和摩根士丹利华鑫睿成大盘弹性股票型证券投资基金。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	-	10	金融风险管理师

		16 日			(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，2017 年 4 月起担任摩根士丹利华鑫睿成大盘弹性股票型证券投资基金基金经理。
--	--	------	--	--	---

注：1、基金经理的任职日期为根据本公司决定确定的聘任日期；

2、基金经理的任职已按规定在中国证券投资基金业协会办理完毕基金经理注册；

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，基金管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及其他相关法

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 40 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

2017 年上半年，经济虽于 4 月份走过高点，但 6 月制造业 PMI 从上月的 51.2% 明显上升至 51.7%，生产指数和新订单指数又双双提升。进出口方面，在经历 4 月意外回落后，5 月进出口增速双双回升，内需有所企稳，外需继续扩张，进出口增长恢复常态，上游价格也开始企稳回升。房地产方面，限购政策影响逐渐发酵，随着房地产销售的冷却，投资端房地产投资增速也逐渐回落。

上半年，A 股市场总体平稳，结构分化风格迥异，对确定性和价值的追求，主导了市场结构性行情，具有低估值、高股息、内生成长特性的“白马股”受到市场热捧。

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

风险管理机制和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成分外具有超额收益的个股，其中第一和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 2017 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.518 元，份额累计净值为 1.518 元，报告期内基金份额净值增长率为 7.13%，同期业绩比较基准收益率为 6.27%。

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，从需求层面看，房地产、基建投资增速或会有所下滑，但根据朱格拉周期理论，制造业投资可能会继续回升，整体投资增速或较 2016 年小幅上升；在消费升级之下的消费增速仍可能维持相对平稳；而进出口在外需企稳之下对经济的贡献或会有所上升。2017 年金融工作会议中强调金融应将服务实体经济作为主旨，金融监管趋严的形势并未转向，而是将更为有序、更为有节奏。美联储在 2017 年下半年可能仍会加息一次并正式开始缩表，全球流动性或将呈现边际收紧，需警惕美联储的货币政策对全球经济造成蝴蝶效应，对新兴经济体增长前景构成负面冲击。

本基金将在继续跟踪基准指数的同时，继续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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

允价值估值数据模型，计算并向基金运营部提供使用数据模型估值的证券价格；监察稽核部负责与监管机构的沟通、协调以及检查公允价值估值业务的合法、合规性。

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金自 2016 年 1 月 7 日起至 2017 年 6 月 30 日止存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。基金管理人已根据相关法规及基金合同规定向中国证监会报告并提出解决方案。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	3,756,485.64	3,325,951.14
结算备付金		—	180,218.42
存出保证金		1,986.96	4,416.07
交易性金融资产	6.4.7.2	44,859,767.93	42,231,136.31
其中：股票投资		44,859,767.93	42,231,136.31
基金投资		—	—
债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—	—
应收证券清算款		—	—
应收利息	6.4.7.5	687.92	849.24
应收股利		—	—
应收申购款		12,705.83	16,628.55
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		48,631,634.28	45,759,199.73
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日

负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		54,966.18	2,326.76
应付管理人报酬		38,336.88	39,456.51
应付托管费		5,750.53	5,918.47
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	754.11	81,655.09
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	124,051.54	107,228.54
负债合计		223,859.24	236,585.37
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	31,881,342.43	32,134,864.54
未分配利润	6.4.7.10	16,526,432.61	13,387,749.82
所有者权益合计		48,407,775.04	45,522,614.36
负债和所有者权益总计		48,631,634.28	45,759,199.73

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.518 元，基金份额总额 31,881,342.43 份。

6.2 利润表

会计主体：摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
-----	-----	----	---------

		2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		3,793,513.52	-8,908,407.43
1.利息收入		12,192.50	16,328.53
其中：存款利息收入	6.4.7.11	12,192.50	12,040.31
债券利息收入		-	4,288.22
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		603,720.66	-510,934.86
其中：股票投资收益	6.4.7.12	237,324.49	-744,337.53
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-652.00
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	366,396.17	234,054.67
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	3,160,947.68	-8,424,278.34
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	16,652.68	10,477.24
减：二、费用		510,401.09	492,123.08
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	229,520.76	224,509.55
2. 托管费	6.4.10.2.2	34,428.18	33,676.39
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	67,851.17	54,967.68
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	178,600.98	178,969.46
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,283,112.43	-9,400,530.51
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,283,112.43	-9,400,530.51

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	32,134,864.54	13,387,749.82	45,522,614.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,283,112.43	3,283,112.43
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）	-253,522.11	-144,429.64	-397,951.75
其中：1.基金申购款	3,339,758.97	1,512,088.12	4,851,847.09
2.基金赎回款	-3,593,281.08	-1,656,517.76	-5,249,798.84
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）	31,881,342.43	16,526,432.61	48,407,775.04
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	32,219,866.91	23,649,893.83	55,869,760.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-9,400,530.51	-9,400,530.51
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	403,366.08	147,395.34	550,761.42
其中：1.基金申购款	7,081,726.51	2,668,248.88	9,749,975.39
2.基金赎回款	-6,678,360.43	-2,520,853.54	-9,199,213.97
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	32,623,232.99	14,396,758.66	47,019,991.65

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：

于华

张力

谢先斌

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

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

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》、《摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强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 2017 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	3,756,485.64
定期存款	—
其中：存款期限 1-3 个月	—
其他存款	—
合计：	3,756,485.64

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	42,862,023.52	44,859,767.93	1,997,744.41
贵金属投资-金交所 黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	—	—
	合计	—	—

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	42,862,023.52	44,859,767.93	1,997,744.41

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	686.90
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.12
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	0.90
合计	687.92

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	754.11
银行间市场应付交易费用	—
合计	754.11

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	200.26
预提费用	73,851.28
指数使用费	50,000.00
合计	124,051.54

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	32,134,864.54	32,134,864.54
本期申购	3,339,758.97	3,339,758.97
本期赎回(以“-”号填列)	-3,593,281.08	-3,593,281.08

本期末	31,881,342.43	31,881,342.43
-----	---------------	---------------

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	23,287,092.51	-9,899,342.69	13,387,749.82
本期利润	122,164.75	3,160,947.68	3,283,112.43
本期基金份额交易产生的变动数	-184,232.68	39,803.04	-144,429.64
其中：基金申购款	2,422,194.47	-910,106.35	1,512,088.12
基金赎回款	-2,606,427.15	949,909.39	-1,656,517.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	23,225,024.58	-6,698,591.97	16,526,432.61

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	11,708.91
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	454.87
其他	28.72
合计	12,192.50

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	22,667,607.11
减：卖出股票成本总额	22,430,282.62
买卖股票差价收入	237,324.49

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	366,396.17
基金投资产生的股利收益	-
合计	366,396.17

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
------	---------------------------------------

1. 交易性金融资产	3,160,947.68
——股票投资	3,160,947.68
——债券投资	—
——资产支持证券投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—
2. 衍生工具	—
——权证投资	—
3. 其他	—
合计	3,160,947.68

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	3,429.17
基金转换费收入	500.54
其他	12,722.97
合计	16,652.68

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

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

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

交易所市场交易费用	67,851.17
银行间市场交易费用	-
合计	67,851.17

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	49,588.57
银行费用	249.70
债券账户维护费	8,926.92
指数使用费	100,000.00
合计	178,600.98

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

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
摩根士丹利华鑫基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
华鑫证券有限责任公司（“华鑫证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
华鑫证券	14,607,809.47	32.93%	1,836,416.20	5.12%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期			
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
华鑫证券	13,604.38	32.93%	-	-

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

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至 2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至 2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	229,520.76	224,509.55
其中：支付销售机构的客户维护费	112,314.40	111,037.33

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

1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.00% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至 2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至 2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	34,428.18	33,676.39

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期		上年度可比期间	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	3,756,485.64	11,708.91	3,732,365.32	11,588.11

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002252	上海莱士	2017 年 4 月 21 日	重大事项	20.24	-	-	25,000	530,194.77	506,000.00	-
000100	TCL 集团	2017 年 4 月 21 日	重大事项	3.43	2017 年 7 月 26 日	3.72	117,900	405,828.86	404,397.00	-
002399	海普瑞	2017 年 4 月 28 日	重大事项	20.23	-	-	13,200	243,538.18	267,036.00	-
300088	长信科技	2016 年 9 月 12 日	重大资产重组	15.75	2017 年 8 月 9 日	14.50	16,100	193,006.65	253,575.00	-
000061	农产品	2017 年 6 月 28 日	重大事项	9.06	-	-	23,800	293,991.80	215,628.00	-
002010	传化智联	2017 年 6 月 30 日	临时停牌	15.26	2017 年 7 月 4 日	16.77	14,101	261,633.03	215,181.26	-
002049	紫光国芯	2017 年 2 月 20 日	重大资产重组	30.82	2017 年 7 月 17 日	27.74	6,300	214,179.72	194,166.00	-
300104	乐视网	2017 年 4 月 17 日	重大资产重组	30.68	-	-	4,744	195,335.49	145,545.92	-
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	-
000656	金科股份	2017 年 5 月 5 日	重大资产重组	6.54	2017 年 7 月 5 日	5.92	12,800	56,839.11	83,712.00	-
000503	海虹控股	2017 年 5 月	重大资	24.93	-	-	3,000	143,805.10	74,790.00	-

		11 日	产重组							
002426	胜利精密	2017 年 1 月 16 日	重大事 项	7.68	-	-	7,800	75,907.89	59,904.00	-
000887	中鼎股份	2017 年 4 月 27 日	重大资 产重组	22.09	2017 年 7 月 14 日	19.88	2,600	62,790.00	57,434.00	-
002168	深圳惠程	2017 年 1 月 23 日	重大资 产重组	16.99	-	-	3,300	46,903.43	56,067.00	-
300367	东方网力	2016 年 12 月 15 日	重大资 产重组	20.00	2017 年 7 月 3 日	18.01	2,200	54,340.00	44,000.00	-
002013	中航机电	2017 年 5 月 12 日	重大事 项	10.33	2017 年 8 月 2 日	11.36	3,750	47,265.00	38,737.50	-
300134	大富科技	2017 年 2 月 9 日	重大资 产重组	23.36	-	-	1,611	42,779.97	37,632.96	-
601088	中国神华	2017 年 6 月 5 日	重大事 项	22.29	-	-	1,600	26,272.00	35,664.00	-
300267	尔康制药	2017 年 5 月 10 日	重大事 项	11.46	-	-	2,900	38,629.14	33,234.00	-
002642	荣之联	2017 年 4 月 10 日	重大事 项	25.06	2017 年 7 月 7 日	22.54	1,300	33,528.73	32,578.00	-
000862	银星能源	2017 年 3 月 13 日	重大资 产重组	7.90	-	-	4,100	33,434.00	32,390.00	-
300291	华录百纳	2017 年 4 月 19 日	重大资 产重组	20.02	-	-	1,500	34,305.00	30,030.00	-
300085	银之杰	2017 年 6 月 30 日	重大事 项	18.50	2017 年 7 月 7 日	18.88	1,200	30,660.00	22,200.00	-

					日					
002610	爱康科技	2017 年 5 月 12 日	重大事 项	2.44	2017 年 8 月 2 日	2.44	7,800	25,740.00	19,032.00	-
002681	奋达科技	2017 年 6 月 22 日	重大事 项	12.59	2017 年 7 月 3 日	12.70	1,500	20,805.00	18,885.00	-
000693	*ST 华泽	2016 年 3 月 1 日	重大资 产重组	12.50	-	-	900	22,171.00	11,250.00	-
002504	*ST 弘高	2017 年 5 月 2 日	重大资 产重组	8.10	-	-	1,300	10,283.00	10,530.00	-
600050	中国联通	2017 年 4 月 5 日	重大事 项	7.47	2017 年 8 月 21 日	8.22	1,100	8,404.00	8,217.00	-
000153	丰原药业	2017 年 1 月 16 日	重大资 产重组	12.52	2017 年 7 月 12 日	11.27	100	1,299.00	1,252.00	-

注：本基金截至 2017 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票指数增强型基金，以深证 300 指数作为本基金投资组合跟踪的目标指数。本基

金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“谋求超过业绩比较基准的投资业绩”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任，其下设的风险控制和审计委员会负责制定风险管理政策，检查公司和基金运作的合法合规情况；公司经营层对内部控制制度的有效执行承担责任，其下设的风险管理委员会负责讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；督察长监督检查基金和公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况；监察稽核部、风险管理部分工负责风险监督与控制，前者负责合规及运营风险管理，后者主要负责基金投资的信用风险、市场风险以及流动性风险的监督管理；基金经理、投资总监以及投资决策委员会负责对基金投资业务风险进行直接管理。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资(2016 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种

所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2017 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款及存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,756,485.64	-	-	-	3,756,485.64
存出保证金	1,986.96	-	-	-	1,986.96
交易性金融资产	-	-	-	44,859,767.93	44,859,767.93
应收利息	-	-	-	687.92	687.92
应收申购款	-	-	-	12,705.83	12,705.83
资产总计	3,758,472.60	-	-	44,873,161.68	48,631,634.28
负债					
应付赎回款	-	-	-	54,966.18	54,966.18
应付管理人报酬	-	-	-	38,336.88	38,336.88
应付托管费	-	-	-	5,750.53	5,750.53
应付交易费用	-	-	-	754.11	754.11
其他负债	-	-	-	124,051.54	124,051.54
负债总计	-	-	-	223,859.24	223,859.24
利率敏感度缺口	3,758,472.60	-	-	44,649,302.44	48,407,775.04
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,325,951.14	-	-	-	3,325,951.14
结算备付金	180,218.42	-	-	-	180,218.42
存出保证金	4,416.07	-	-	-	4,416.07
交易性金融资产	-	-	-	42,231,136.31	42,231,136.31
应收利息	-	-	-	849.24	849.24
应收申购款	-	-	-	16,628.55	16,628.55
资产总计	3,510,585.63	-	-	42,248,614.10	45,759,199.73

负债					
应付赎回款	-	-	-	2,326.76	2,326.76
应付管理人报酬	-	-	-	39,456.51	39,456.51
应付托管费	-	-	-	5,918.47	5,918.47
应付交易费用	-	-	-	81,655.09	81,655.09
其他负债	-	-	-	107,228.54	107,228.54
负债总计	-	-	-	236,585.37	236,585.37
利率敏感度缺口	3,510,585.63	-	-	42,012,028.73	45,522,614.36

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2016 年 12 月 31 日：同）。因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2016 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。此外，本基金的基金管理人日常对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量、跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	44,859,767.93	92.67	42,231,136.31	92.77
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	44,859,767.93	92.67	42,231,136.31	92.77

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 6.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额(单位：人民币元)	
		本期末(2017 年 6 月 30 日)	上年度末(2016 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准(附注 6.4.1) 上升 5%	2,130,000.00	2,220,000.00
	业绩比较基准(附注 6.4.1) 下降 5%	-2,130,000.00	-2,220,000.00

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2017 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 41,851,864.52 元，属于第二层次的余额为 3,007,903.41 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 39,876,772.77 元，第二层次 2,354,363.54 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 2017 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(2016 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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：

(a) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；

(b) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转

让；

(c) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

§ 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	44,859,767.93	92.24
	其中：股票	44,859,767.93	92.24
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	3,756,485.64	7.72
7	其他各项资产	15,380.71	0.03
8	合计	48,631,634.28	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	751,467.04	1.55
B	采矿业	172,823.15	0.36
C	制造业	25,900,646.79	53.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,772,290.35	3.66
E	建筑业	316,691.54	0.65

F	批发和零售业	1,467,428.50	3.03
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	2,247,533.91	4.64
J	金融业	2,535,171.07	5.24
K	房地产业	2,115,614.46	4.37
L	租赁和商务服务业	560,572.60	1.16
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,594,599.35	3.29
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	482,527.64	1.00
R	文化、体育和娱乐业	663,826.00	1.37
S	综合	63,911.00	0.13
	合计	40,645,103.40	83.96

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	16,520.00	0.03
B	采掘业	217,906.00	0.45
C	制造业	1,493,213.33	3.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	212,402.00	0.44
E	建筑业	119,914.00	0.25
F	批发和零售业	262,835.00	0.54
G	交通运输、仓储和邮政业	60,760.00	0.13
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	80,892.00	0.17
J	金融业	1,168,963.40	2.41
K	房地产业	334,136.60	0.69
L	租赁和商务服务业	18,185.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	38,006.20	0.08
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	190,931.00	0.39
S	综合	-	-
	合计	4,214,664.53	8.71

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000333	美的集团	25,000	1,076,000.00	2.22
2	000858	五 粮 液	14,940	831,560.40	1.72
3	000651	格力电器	20,180	830,810.60	1.72
4	002415	海康威视	25,650	828,495.00	1.71
5	000725	京东方 A	191,000	794,560.00	1.64
6	000001	平安银行	81,153	762,026.67	1.57
7	300498	温氏股份	23,880	559,747.20	1.16

8	002236	大华股份	22,685	517,444.85	1.07
9	000963	华东医药	10,400	516,880.00	1.07
10	002304	洋河股份	5,946	516,172.26	1.07
11	002450	康得新	22,685	510,866.20	1.06
12	002252	上海莱士	25,000	506,000.00	1.05
13	000063	中兴通讯	21,300	505,662.00	1.04
14	000999	华润三九	15,900	504,825.00	1.04
15	000423	东阿阿胶	6,800	488,852.00	1.01
16	000069	华侨城 A	47,500	477,850.00	0.99
17	000568	泸州老窖	9,400	475,452.00	0.98
18	002294	信立泰	12,540	447,176.40	0.92
19	002572	索菲亚	10,800	442,800.00	0.91
20	002142	宁波银行	22,920	442,356.00	0.91
21	000895	双汇发展	18,550	440,562.50	0.91
22	000338	潍柴动力	33,100	436,920.00	0.90
23	000625	长安汽车	30,000	432,600.00	0.89
24	000876	新 希 望	52,608	432,437.76	0.89
25	002475	立讯精密	14,400	421,056.00	0.87
26	000028	国药一致	5,175	418,657.50	0.86
27	002024	苏宁云商	37,200	418,500.00	0.86
28	002508	老板电器	9,620	418,277.60	0.86
29	000002	万 科 A	16,702	417,048.94	0.86
30	000540	中天金融	59,400	412,830.00	0.85
31	000100	TCL 集团	117,900	404,397.00	0.84
32	002573	清新环境	21,300	400,866.00	0.83
33	300003	乐普医疗	17,980	397,537.80	0.82
34	300070	碧水源	20,119	375,219.35	0.78
35	002594	比亚迪	7,400	369,630.00	0.76

36	000157	中联重科	82,200	369,078.00	0.76
37	300124	汇川技术	14,400	367,776.00	0.76
38	300015	爱尔眼科	15,538	361,413.88	0.75
39	000661	长春高新	2,750	355,052.50	0.73
40	300408	三环集团	16,700	350,533.00	0.72
41	002422	科伦药业	21,000	346,920.00	0.72
42	000883	湖北能源	68,200	342,364.00	0.71
43	000826	启迪桑德	9,700	340,664.00	0.70
44	000729	燕京啤酒	48,900	328,608.00	0.68
45	000425	徐工机械	84,400	316,500.00	0.65
46	000623	吉林敖东	13,650	312,448.50	0.65
47	300146	汤臣倍健	22,700	311,898.00	0.64
48	002007	华兰生物	8,469	309,118.50	0.64
49	002311	海大集团	16,800	306,936.00	0.63
50	000685	中山公用	27,700	303,315.00	0.63
51	000598	兴蓉环境	53,900	302,918.00	0.63
52	002739	万达电影	5,900	300,723.00	0.62
53	000539	粤电力 A	55,595	296,321.35	0.61
54	002736	国信证券	22,300	295,475.00	0.61
55	002385	大北农	46,623	293,258.67	0.61
56	002470	金正大	38,000	286,140.00	0.59
57	000776	广发证券	16,500	284,625.00	0.59
58	000046	泛海控股	32,300	281,979.00	0.58
59	000027	深圳能源	41,600	279,968.00	0.58
60	002563	森马服饰	32,300	273,904.00	0.57
61	002399	海普瑞	13,200	267,036.00	0.55
62	002152	广电运通	31,695	263,385.45	0.54
63	002004	华邦健康	32,600	255,258.00	0.53

64	300088	长信科技	16,100	253,575.00	0.52
65	002250	联化科技	17,700	253,110.00	0.52
66	000732	泰禾集团	14,400	240,192.00	0.50
67	002266	浙富控股	46,690	227,847.20	0.47
68	002701	奥瑞金	35,000	223,650.00	0.46
69	000800	一汽轿车	21,900	222,723.00	0.46
70	300017	网宿科技	18,308	220,977.56	0.46
71	000543	皖能电力	37,000	215,710.00	0.45
72	000061	农产品	23,800	215,628.00	0.45
73	002010	传化智联	14,101	215,181.26	0.44
74	000979	中弘股份	78,000	204,360.00	0.42
75	002049	紫光国芯	6,300	194,166.00	0.40
76	001979	招商蛇口	7,907	168,893.52	0.35
77	002466	天齐锂业	3,080	167,398.00	0.35
78	000538	云南白药	1,704	159,920.40	0.33
79	002230	科大讯飞	4,000	159,600.00	0.33
80	000166	申万宏源	26,111	146,221.60	0.30
81	300104	乐视网	4,744	145,545.92	0.30
82	002202	金风科技	9,300	143,871.00	0.30
83	002456	欧菲光	7,830	142,271.10	0.29
84	002241	歌尔股份	7,298	140,705.44	0.29
85	000783	长江证券	14,600	138,262.00	0.29
86	300072	三聚环保	3,508	129,971.40	0.27
87	000413	东旭光电	11,500	129,030.00	0.27
88	300059	东方财富	10,560	126,931.20	0.26
89	002008	大族激光	3,568	123,595.52	0.26
90	000686	东北证券	12,200	122,610.00	0.25
91	002460	赣锋锂业	2,600	120,250.00	0.25

92	000415	渤海金控	17,300	116,429.00	0.24
93	300136	信维通信	2,900	116,058.00	0.24
94	002673	西部证券	8,090	115,039.80	0.24
95	000839	中信国安	11,050	110,389.50	0.23
96	002129	中环股份	11,951	98,834.77	0.20
97	000768	中航飞机	5,300	97,732.00	0.20
98	300024	机器人	5,000	97,500.00	0.20
99	002065	东华软件	4,410	96,093.90	0.20
100	002465	海格通信	8,800	94,512.00	0.20
101	000728	国元证券	7,500	91,650.00	0.19
102	000656	金科股份	12,800	83,712.00	0.17
103	002044	美年健康	4,800	81,600.00	0.17
104	002179	中航光电	2,600	81,094.00	0.17
105	002310	东方园林	4,750	79,420.00	0.16
106	002085	万丰奥威	4,080	79,356.00	0.16
107	300156	神雾环保	2,400	78,624.00	0.16
108	000793	华闻传媒	7,600	76,912.00	0.16
109	000709	河钢股份	18,200	76,258.00	0.16
110	000503	海虹控股	3,000	74,790.00	0.15
111	000630	铜陵有色	26,100	74,124.00	0.15
112	300315	掌趣科技	8,970	73,195.20	0.15
113	000066	中国长城	7,968	71,791.68	0.15
114	002340	格林美	11,702	70,797.10	0.15
115	000060	中金岭南	6,308	70,649.60	0.15
116	002405	四维图新	3,432	67,816.32	0.14
117	300115	长盈精密	2,200	64,196.00	0.13
118	000009	中国宝安	7,900	63,911.00	0.13
119	000997	新大陆	2,800	63,532.00	0.13

120	000559	万向钱潮	5,978	63,486.36	0.13
121	002074	国轩高科	2,000	63,100.00	0.13
122	000581	威孚高科	2,400	62,160.00	0.13
123	000998	隆平高科	2,800	61,656.00	0.13
124	000039	中集集团	3,400	61,302.00	0.13
125	000402	金融街	5,200	60,944.00	0.13
126	002081	金螳螂	5,500	60,390.00	0.12
127	000778	新兴铸管	9,000	60,300.00	0.12
128	300296	利亚德	3,200	60,160.00	0.12
129	002426	胜利精密	7,800	59,904.00	0.12
130	002400	省广股份	7,410	59,502.30	0.12
131	300182	捷成股份	6,100	58,316.00	0.12
132	002092	中泰化学	4,590	58,293.00	0.12
133	000887	中鼎股份	2,600	57,434.00	0.12
134	000786	北新建材	3,576	56,643.84	0.12
135	000983	西山煤电	6,395	56,084.15	0.12
136	002168	深圳惠程	3,300	56,067.00	0.12
137	000970	中科三环	3,788	55,986.64	0.12
138	000917	电广传媒	4,900	55,370.00	0.11
139	300144	宋城演艺	2,600	54,262.00	0.11
140	300383	光环新网	4,000	54,240.00	0.11
141	001696	宗申动力	7,100	53,747.00	0.11
142	002027	分众传媒	3,900	53,664.00	0.11
143	300027	华谊兄弟	6,600	53,394.00	0.11
144	002038	双鹭药业	1,800	52,470.00	0.11
145	002501	利源精制	4,600	52,302.00	0.11
146	002185	华天科技	7,200	52,128.00	0.11
147	002183	怡亚通	6,000	51,780.00	0.11

148	002410	广联达	2,700	50,760.00	0.10
149	002407	多氟多	2,300	50,577.00	0.10
150	002500	山西证券	5,200	49,816.00	0.10
151	300033	同花顺	800	49,768.00	0.10
152	002146	荣盛发展	4,900	48,363.00	0.10
153	000400	许继电气	2,670	47,953.20	0.10
154	002030	达安基因	2,200	47,938.00	0.10
155	000878	云南铜业	3,600	47,484.00	0.10
156	002195	二三四五	6,630	47,404.50	0.10
157	000566	海南海药	3,500	46,410.00	0.10
158	000960	锡业股份	3,400	46,274.00	0.10
159	300055	万邦达	2,500	46,000.00	0.10
160	002273	水晶光电	2,200	45,386.00	0.09
161	002223	鱼跃医疗	1,899	44,968.32	0.09
162	300367	东方网力	2,200	44,000.00	0.09
163	000547	航天发展	4,200	43,890.00	0.09
164	300168	万达信息	3,000	43,650.00	0.09
165	300418	昆仑万维	1,900	43,453.00	0.09
166	000977	浪潮信息	2,500	43,300.00	0.09
167	000516	国际医学	7,700	42,889.00	0.09
168	002138	顺络电子	2,300	42,734.00	0.09
169	300058	蓝色光标	5,415	42,345.30	0.09
170	000671	阳光城	7,100	41,322.00	0.09
171	000930	中粮生化	3,800	40,964.00	0.08
172	002439	启明星辰	2,200	40,920.00	0.08
173	000825	太钢不锈	9,400	40,890.00	0.08
174	000988	华工科技	2,800	40,852.00	0.08
175	002108	沧州明珠	3,060	40,851.00	0.08

176	002051	中工国际	1,968	40,796.64	0.08
177	000792	盐湖股份	3,900	40,755.00	0.08
178	300113	顺网科技	1,500	40,350.00	0.08
179	002019	亿帆医药	2,400	40,032.00	0.08
180	300244	迪安诊断	1,256	39,513.76	0.08
181	002001	新 和 成	2,020	39,208.20	0.08
182	002491	通鼎互联	2,900	38,976.00	0.08
183	002013	中航机电	3,750	38,737.50	0.08
184	002555	三七互娱	1,500	38,355.00	0.08
185	002714	牧原股份	1,400	38,108.00	0.08
186	000627	天茂集团	4,700	37,976.00	0.08
187	002343	慈文传媒	1,000	37,860.00	0.08
188	300134	大富科技	1,611	37,632.96	0.08
189	002176	江特电机	4,300	37,496.00	0.08
190	000078	海王生物	6,200	37,386.00	0.08
191	000738	航发控制	1,900	37,183.00	0.08
192	002292	奥飞娱乐	2,200	37,180.00	0.08
193	002431	棕榈股份	3,345	36,861.90	0.08
194	002131	利欧股份	11,200	36,848.00	0.08
195	000938	紫光股份	600	36,672.00	0.08
196	000758	中色股份	5,200	36,452.00	0.08
197	000806	银河生物	2,700	36,450.00	0.08
198	300014	亿纬锂能	1,996	36,227.40	0.07
199	300002	神州泰岳	4,339	36,187.26	0.07
200	000006	深振业 A	4,100	36,121.00	0.07
201	002424	贵州百灵	1,900	35,834.00	0.07
202	000008	神州高铁	4,900	35,672.00	0.07
203	002191	劲嘉股份	3,800	35,568.00	0.07

204	300253	卫宁健康	4,503	35,168.43	0.07
205	300433	蓝思科技	1,200	34,908.00	0.07
206	000031	中粮地产	4,600	34,638.00	0.07
207	002665	首航节能	4,800	34,560.00	0.07
208	000012	南玻A	3,700	34,521.00	0.07
209	300166	东方国信	2,560	34,380.80	0.07
210	000712	锦龙股份	2,100	34,377.00	0.07
211	002624	完美世界	1,000	34,300.00	0.07
212	300077	国民技术	2,500	34,225.00	0.07
213	000592	平潭发展	6,192	34,179.84	0.07
214	300274	阳光电源	3,000	33,270.00	0.07
215	300267	尔康制药	2,900	33,234.00	0.07
216	002353	杰瑞股份	2,100	33,222.00	0.07
217	300251	光线传媒	4,000	32,760.00	0.07
218	002444	巨星科技	2,100	32,718.00	0.07
219	002642	荣之联	1,300	32,578.00	0.07
220	300133	华策影视	2,900	32,480.00	0.07
221	000898	鞍钢股份	5,700	32,262.00	0.07
222	002002	鸿达兴业	4,100	32,103.00	0.07
223	300068	南都电源	1,900	31,996.00	0.07
224	002153	石基信息	1,400	31,822.00	0.07
225	000690	宝新能源	5,300	31,694.00	0.07
226	000156	华数传媒	2,100	31,311.00	0.06
227	300026	红日药业	6,600	31,086.00	0.06
228	002522	浙江众成	1,900	31,065.00	0.06
229	002477	雏鹰农牧	7,000	31,010.00	0.06
230	300199	翰宇药业	2,000	30,680.00	0.06
231	002368	太极股份	1,100	30,459.00	0.06

232	300001	特锐德	1,800	30,168.00	0.06
233	300291	华录百纳	1,500	30,030.00	0.06
234	000158	常山股份	1,900	30,020.00	0.06
235	300079	数码视讯	5,100	29,835.00	0.06
236	002022	科华生物	1,713	29,754.81	0.06
237	002390	信邦制药	3,400	29,614.00	0.06
238	002643	万润股份	2,000	29,520.00	0.06
239	300207	欣旺达	2,500	29,475.00	0.06
240	002261	拓维信息	2,500	29,275.00	0.06
241	002104	恒宝股份	3,100	29,109.00	0.06
242	300020	银江股份	2,100	29,064.00	0.06
243	002285	世联行	3,600	28,872.00	0.06
244	300170	汉得信息	2,800	28,868.00	0.06
245	002709	天赐材料	700	28,819.00	0.06
246	000667	美好置业	8,700	28,797.00	0.06
247	000687	华讯方舟	1,900	28,766.00	0.06
248	000697	炼石有色	1,400	28,658.00	0.06
249	002018	华信国际	4,100	28,085.00	0.06
250	000021	深科技	3,241	27,807.78	0.06
251	000718	苏宁环球	4,700	27,542.00	0.06
252	000937	冀中能源	4,500	27,540.00	0.06
253	002489	浙江永强	4,300	27,434.00	0.06
254	000961	中南建设	4,200	27,384.00	0.06
255	002280	联络互动	2,500	27,200.00	0.06
256	000901	航天科技	1,000	27,160.00	0.06
257	002268	卫 士 通	1,600	26,912.00	0.06
258	300216	千山药机	1,100	26,895.00	0.06
259	002299	圣农发展	1,800	26,766.00	0.06

260	300273	和佳股份	2,152	26,168.32	0.05
261	002375	亚厦股份	2,900	25,839.00	0.05
262	300431	暴风集团	1,080	25,736.40	0.05
263	000973	佛塑科技	3,300	25,476.00	0.05
264	002276	万马股份	2,500	25,225.00	0.05
265	002055	得润电子	1,100	25,003.00	0.05
266	002326	永太科技	1,800	24,948.00	0.05
267	002716	金贵银业	1,300	24,947.00	0.05
268	300073	当升科技	1,000	24,940.00	0.05
269	002308	威创股份	1,900	24,795.00	0.05
270	000762	西藏矿业	1,700	24,089.00	0.05
271	002437	誉衡药业	3,300	24,024.00	0.05
272	300010	立思辰	1,800	23,310.00	0.05
273	002657	中科金财	800	23,192.00	0.05
274	300496	中科创达	800	22,640.00	0.05
275	300085	银之杰	1,200	22,200.00	0.05
276	002190	成飞集成	800	21,440.00	0.04
277	000062	深圳华强	800	21,224.00	0.04
278	002224	三力士	1,900	21,090.00	0.04
279	002474	榕基软件	1,900	20,615.00	0.04
280	002329	皇氏集团	2,100	20,181.00	0.04
281	002284	亚太股份	1,800	19,980.00	0.04
282	300292	吴通控股	2,900	19,633.00	0.04
283	000851	高鸿股份	2,100	19,089.00	0.04
284	002610	爱康科技	7,800	19,032.00	0.04
285	002681	奋达科技	1,500	18,885.00	0.04
286	300043	星辉娱乐	2,300	18,883.00	0.04
287	000957	中通客车	1,600	18,720.00	0.04

288	002467	二六三	2,351	18,619.92	0.04
289	000555	神州信息	1,000	16,700.00	0.03
290	002797	第一创业	1,600	14,736.00	0.03
291	002631	德尔未来	1,000	14,730.00	0.03
292	000681	视觉中国	900	14,094.00	0.03
293	002416	爱施德	1,300	14,027.00	0.03
294	002568	百润股份	800	13,296.00	0.03
295	300474	景嘉微	300	10,620.00	0.02

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601288	农业银行	90,300	317,856.00	0.66
2	601166	兴业银行	17,800	300,108.00	0.62
3	600015	华夏银行	30,720	283,238.40	0.59
4	601607	上海医药	4,100	118,408.00	0.24
5	601668	中国建筑	11,300	109,384.00	0.23
6	601318	中国平安	2,100	104,181.00	0.22
7	600028	中国石化	15,500	91,915.00	0.19
8	600688	上海石化	13,400	88,574.00	0.18
9	600104	上汽集团	2,800	86,940.00	0.18
10	000036	华联控股	9,400	85,540.00	0.18
11	600466	蓝光发展	9,900	85,437.00	0.18
12	601211	国泰君安	4,000	82,040.00	0.17
13	600048	保利地产	8,200	81,754.00	0.17
14	600816	安信信托	6,000	81,540.00	0.17

15	600153	建发股份	6,000	77,580.00	0.16
16	000789	万年青	10,900	77,281.00	0.16
17	000055	方大集团	9,900	72,072.00	0.15
18	000059	华锦股份	6,900	69,069.00	0.14
19	601098	中南传媒	3,700	68,968.00	0.14
20	600373	中文传媒	2,900	68,179.00	0.14
21	600708	光明地产	9,230	61,287.20	0.13
22	600350	山东高速	9,800	60,760.00	0.13
23	603399	新华龙	4,600	58,374.00	0.12
24	600757	长江传媒	7,200	53,784.00	0.11
25	000600	建投能源	4,200	51,534.00	0.11
26	000980	众泰汽车	4,200	50,652.00	0.10
27	600089	特变电工	4,741	48,974.53	0.10
28	600674	川投能源	4,400	43,208.00	0.09
29	600886	国投电力	5,400	42,660.00	0.09
30	600475	华光股份	2,100	41,853.00	0.09
31	601088	中国神华	1,600	35,664.00	0.07
32	002115	三维通信	3,400	35,088.00	0.07
33	000862	银星能源	4,100	32,390.00	0.07
34	600183	生益科技	2,600	32,084.00	0.07
35	600487	亨通光电	1,100	30,855.00	0.06
36	603369	今世缘	2,300	30,360.00	0.06
37	002611	东方精工	2,100	30,114.00	0.06
38	600690	青岛海尔	2,000	30,100.00	0.06
39	002636	金安国纪	1,700	29,359.00	0.06
40	000978	桂林旅游	3,100	28,706.00	0.06
41	300212	易华录	1,100	27,753.00	0.06
42	000921	海信科龙	1,600	27,536.00	0.06

43	600309	万华化学	960	27,494.40	0.06
44	600123	兰花科创	3,400	25,908.00	0.05
45	300038	梅泰诺	600	25,410.00	0.05
46	000822	山东海化	3,000	24,360.00	0.05
47	000501	鄂武商 A	1,300	23,998.00	0.05
48	300287	飞利信	2,600	23,868.00	0.05
49	000587	金洲慈航	1,600	23,840.00	0.05
50	300202	聚龙股份	1,400	23,128.00	0.05
51	600338	西藏珠峰	600	22,794.00	0.05
52	600887	伊利股份	1,000	21,590.00	0.04
53	600273	嘉化能源	2,300	21,574.00	0.04
54	002601	龙蟠佰利	1,300	21,294.00	0.04
55	600966	博汇纸业	4,100	21,279.00	0.04
56	000488	晨鸣纸业	1,600	20,640.00	0.04
57	600525	长园集团	1,500	20,385.00	0.04
58	002078	太阳纸业	2,700	19,845.00	0.04
59	600697	欧亚集团	700	19,712.00	0.04
60	600295	鄂尔多斯	1,900	19,380.00	0.04
61	601766	中国中车	1,900	19,228.00	0.04
62	600019	宝钢股份	2,800	18,788.00	0.04
63	601677	明泰铝业	1,300	17,732.00	0.04
64	601199	江南水务	2,500	17,175.00	0.04
65	600168	武汉控股	1,900	17,119.00	0.04
66	600299	安迪苏	1,400	17,038.00	0.04
67	600782	新钢股份	4,600	16,790.00	0.03
68	600894	广日股份	1,400	16,576.00	0.03
69	002458	益生股份	800	16,520.00	0.03
70	002635	安洁科技	450	16,299.00	0.03

71	600873	梅花生物	2,700	15,309.00	0.03
72	600366	宁波韵升	800	14,112.00	0.03
73	600703	三安光电	700	13,790.00	0.03
74	000586	汇源通信	700	13,706.00	0.03
75	300323	华灿光电	900	12,492.00	0.03
76	601888	中国国旅	400	12,056.00	0.02
77	002518	科士达	780	11,403.60	0.02
78	600177	雅戈尔	1,120	11,334.40	0.02
79	000693	*ST 华泽	900	11,250.00	0.02
80	600803	新奥股份	800	10,992.00	0.02
81	600850	华东电脑	500	10,685.00	0.02
82	600835	上海机电	500	10,570.00	0.02
83	002504	*ST 弘高	1,300	10,530.00	0.02
84	002327	富安娜	1,200	9,972.00	0.02
85	000422	湖北宜化	1,600	9,520.00	0.02
86	002033	丽江旅游	910	9,300.20	0.02
87	000030	富奥股份	1,000	8,940.00	0.02
88	000863	三湘印象	1,200	8,784.00	0.02
89	600582	天地科技	1,900	8,721.00	0.02
90	600352	浙江龙盛	900	8,577.00	0.02
91	600050	中国联通	1,100	8,217.00	0.02
92	002554	惠博普	1,300	7,670.00	0.02
93	002440	闰土股份	500	7,630.00	0.02
94	601899	紫金矿业	2,200	7,546.00	0.02
95	000869	张裕 A	200	7,440.00	0.02
96	600216	浙江医药	700	6,937.00	0.01
97	600051	宁波联合	700	6,692.00	0.01
98	002099	海翔药业	1,000	6,660.00	0.01

99	600687	刚泰控股	500	6,440.00	0.01
100	600755	厦门国贸	700	6,384.00	0.01
101	600988	赤峰黄金	500	6,375.00	0.01
102	600790	轻纺城	900	6,129.00	0.01
103	000952	广济药业	400	6,012.00	0.01
104	600889	南京化纤	600	5,694.00	0.01
105	600120	浙江东方	200	5,376.00	0.01
106	002032	苏泊尔	130	5,336.50	0.01
107	600804	鹏博士	300	5,325.00	0.01
108	300047	天源迪科	400	5,044.00	0.01
109	000848	承德露露	500	4,990.00	0.01
110	600090	同济堂	500	4,685.00	0.01
111	600856	中天能源	400	4,504.00	0.01
112	601808	中海油服	400	4,416.00	0.01
113	600583	海油工程	700	4,368.00	0.01
114	002242	九阳股份	200	3,934.00	0.01
115	002705	新宝股份	260	3,907.80	0.01
116	600987	航民股份	300	3,888.00	0.01
117	600617	国新能源	400	3,812.00	0.01
118	000810	创维数字	300	3,639.00	0.01
119	000726	鲁泰A	300	3,558.00	0.01
120	600060	海信电器	200	3,034.00	0.01
121	002394	联发股份	200	2,946.00	0.01
122	000541	佛山照明	300	2,733.00	0.01
123	600261	阳光照明	400	2,628.00	0.01
124	603001	奥康国际	100	1,879.00	0.00
125	002003	伟星股份	130	1,358.50	0.00
126	002674	兴业科技	100	1,256.00	0.00

127	000153	丰原药业	100	1, 252. 00	0. 00
-----	--------	------	-----	------------	-------

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300498	温氏股份	669, 592. 00	1. 47
2	000100	TCL 集团	414, 090. 00	0. 91
3	002572	索菲亚	318, 051. 00	0. 70
4	601166	兴业银行	298, 753. 00	0. 66
5	600015	华夏银行	298, 680. 00	0. 66
6	601288	农业银行	297, 483. 00	0. 65
7	002508	老板电器	289, 977. 00	0. 64
8	000883	湖北能源	283, 185. 00	0. 62
9	000598	兴蓉环境	270, 704. 00	0. 59
10	002252	上海莱士	258, 057. 00	0. 57
11	002594	比亚迪	257, 075. 00	0. 56
12	000061	农产品	254, 124. 00	0. 56
13	002024	苏宁云商	253, 310. 00	0. 56
14	002004	华邦健康	249, 876. 00	0. 55
15	300003	乐普医疗	243, 676. 00	0. 54
16	002010	传化智联	243, 006. 00	0. 53
17	002152	广电运通	241, 010. 00	0. 53
18	300146	汤臣倍健	236, 955. 00	0. 52
19	002266	浙富控股	236, 752. 00	0. 52
20	002739	万达电影	226, 302. 00	0. 50

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000002	万 科 A	475,234.00	1.04
2	002310	东方园林	340,820.00	0.75
3	000651	格力电器	328,550.00	0.72
4	000066	中国长城	296,838.00	0.65
5	300072	三聚环保	274,068.00	0.60
6	300496	中科创达	245,350.00	0.54
7	000939	凯迪生态	243,072.00	0.53
8	000630	铜陵有色	238,395.00	0.52
9	000566	海南海药	235,336.00	0.52
10	001979	招商蛇口	234,096.00	0.51
11	000786	北新建材	225,105.00	0.49
12	002018	华信国际	220,983.00	0.49
13	002052	同洲电子	213,156.00	0.47
14	000825	太钢不锈	210,870.00	0.46
15	002092	中泰化学	210,501.00	0.46
16	002429	兆驰股份	200,460.00	0.44
17	000581	威孚高科	196,602.00	0.43
18	000917	电广传媒	191,268.00	0.42
19	002230	科大讯飞	191,219.00	0.42
20	000709	河钢股份	189,439.00	0.42

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	21,897,966.56
卖出股票收入（成交）总额	22,667,607.11

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

根据本基金基金合同规定，本基金不参与贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

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

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

管理流动性风险，优化投资组合对目标指数的跟踪效果，提高投资组合的运作效率等。

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体除平安银行股份有限公司（以下简称“平安银行”）外，其余的没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

2016 年 12 月，中国银行间市场交易商协会发布自律处分信息，对青岛海湾集团有限公司未按规定及时进行信息披露事件中主承销商平安银行给予通报批评处分，责令其立即纠正违规行为，并进行整改。

本基金投资平安银行（000001）的决策流程符合本基金管理人投资管理制度的相关规定。针对上述情况，本基金管理人进行了分析和研究，认为上述事件对平安银行的投资价值未造成实质性影响。本基金管理人将继续对上述公司进行跟踪研究。

7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,986.96
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	687.92
5	应收申购款	12,705.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,380.71

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
2,087	15,276.16	247,529.75	0.78%	31,633,812.68	99.22%

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（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	32,134,864.54
本报告期基金总申购份额	3,339,758.97
减:本报告期基金总赎回份额	3,593,281.08
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	31,881,342.43

§ 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	佣金	占当期佣金 总量的比例	

			例			
中信建投	1	22,540,750.71	50.81%	20,992.23	50.81%	—
华鑫证券	2	14,607,809.47	32.93%	13,604.38	32.93%	—
中信证券	3	4,480,065.10	10.10%	4,172.35	10.10%	—
国信证券	1	1,926,462.10	4.34%	1,794.16	4.34%	—
安信证券	2	770,077.85	1.74%	717.15	1.74%	—
中信证券（山东）	2	19,933.00	0.04%	18.56	0.04%	—
光大证券	1	19,758.00	0.04%	18.40	0.04%	—
广发证券	1	—	—	—	—	—
国海证券	1	—	—	—	—	—
国金证券	1	—	—	—	—	—
国泰君安	1	—	—	—	—	—
海通证券	1	—	—	—	—	—
宏信证券	1	—	—	—	—	—
华创证券	1	—	—	—	—	—
华林证券	1	—	—	—	—	—
长城证券	2	—	—	—	—	—
长江证券	2	—	—	—	—	—
川财证券	2	—	—	—	—	—
东方证券	2	—	—	—	—	—
东莞证券	1	—	—	—	—	—
东吴证券	1	—	—	—	—	—
方正证券	2	—	—	—	—	—
九州证券	1	—	—	—	—	—
民生证券	1	—	—	—	—	—
平安证券	1	—	—	—	—	—
瑞银证券	1	—	—	—	—	—

申万宏源	2	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	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 2 家证券公司的 2 个专用交易单元：九州证券交易单元 1 个，东北证券交易单元 1 个。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例	成交金额	占当期债 券回购 成交总额	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例

				的比例		
中信建投	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券(山东)	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
九州证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

天风证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末通过租用的证券公司交易单元进行其他证券投资。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	本基金 2016 年 4 季度报告	《上海证券报》	2017 年 1 月 19 日
2	本公司关于旗下基金参与北京钱景财富投资管理有限公司费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2017 年 1 月 23 日
3	本公司关于旗下基金参加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司基金转换费费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2017 年 1 月 23 日
4	本公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司手机银行申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2017 年 2 月 23 日
5	本公司关于旗下部分基金参与宜信普泽投资顾问（北京）有限公司费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2017 年 3 月 13 日
6	本基金 2016 年年度报告	《上海证券报》	2017 年 3 月 30 日
7	本公司关于旗下部分基金继续参与中国工商银行个人电子银行申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2017 年 3 月 31 日
8	本公司关于旗下基金增加南京苏宁基金销售有限公司为销售机构的公告	《上海证券报》	2017 年 4 月 14 日

9	本公司关于旗下基金参与南京苏宁基金销售有限公司费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2017 年 4 月 14 日
10	本公司关于旗下基金增加济安财富(北京)资本管理有限公司为销售机构的公告	《上海证券报》	2017 年 4 月 20 日
11	本公司关于旗下基金参与济安财富(北京)资本管理有限公司费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2017 年 4 月 20 日
12	本公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司手机银行申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2017 年 4 月 22 日
13	本基金 2017 年 1 季度报告	《上海证券报》	2017 年 4 月 24 日
14	本公司关于旗下部分基金在中国银行开通基金转换业务的公告	《上海证券报》	2017 年 4 月 27 日
15	本公司关于调整直销中心最低认申购金额限制的公告	《上海证券报》	2017 年 5 月 26 日
16	本公司关于旗下基金增加上海云湾投资管理有限公司为销售机构的公告	《上海证券报》	2017 年 6 月 9 日
17	本公司关于旗下基金参与上海云湾投资管理有限公司费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2017 年 6 月 9 日
18	本公司关于旗下基金增加上海证券为销售机构的公告	《上海证券报》	2017 年 6 月 27 日
19	本公司关于旗下基金参与上海证券销售费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2017 年 6 月 27 日
20	本基金招募说明书(更新)(2017 年第 1 号)	《上海证券报》	2017 年 6 月 27 日
21	本公司关于直销网上交易开通快付通支付业务的公告	《上海证券报》	2017 年 6 月 28 日
22	本公司关于旗下部分基金增加上海通华财富资产管理有限公司为销售机构的公告	《上海证券报》	2017 年 6 月 29 日
23	本公司关于旗下部分基金参与通华财富销售费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2017 年 6 月 29 日

注：上述公告同时在公司网站 www.msfunfs.com.cn 上披露。

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

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

11.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

11.3 查阅方式

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

摩根士丹利华鑫基金管理有限公司

2017 年 8 月 28 日