摩根士丹利华鑫量化多策略股票型证券投资基金
2017 年年度报告

2017 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：2018 年 3 月 29 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 2018 年 3 月 27 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 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....2
1.1 重要提示.....2
1.2 目录.....3
§2 基金简介.....5
2.1 基金基本情况.....5
2.2 基金产品说明.....5
2.3 基金管理人和基金托管人.....6
2.4 信息披露方式.....6
2.5 其他相关资料.....6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....7
3.1 主要会计数据和财务指标.....7
3.2 基金净值表现.....7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....9
§4 管理人报告.....10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....12
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.....13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....15
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.....15
§5 托管人报告.....16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....16
§6 审计报告.....17
6.1 审计报告基本信息.....17
6.2 审计报告的基本内容.....17
§7 年度财务报表.....20
7.1 资产负债表.....20
7.2 利润表.....21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....22
7.4 报表附注.....23
§8 投资组合报告.....48
8.1 期末基金资产组合情况.....48
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....48
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.....49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....64
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....65
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.....66
8.7 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.....66

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 66
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 66
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 66
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 67
8.12 投资组合报告附注 67
§9 基金份额持有人信息 69
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 69
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 69
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 69
§10 开放式基金份额变动 70
§11 重大事件揭示 71
11.1 基金份额持有人大会决议 71
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 71
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 71
11.4 基金投资策略的改变 71
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 71
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 71
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 72
11.8 其他重大事件 75
§12 备查文件目录 79
12.1 备查文件目录 79
12.2 存放地点 79
12.3 查阅方式 79

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	摩根士丹利华鑫量化多策略股票型证券投资基金
基金简称	大摩量化多策略股票
基金主代码	001291
交易代码	001291
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 6 月 2 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	719,514,572.99 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	运用多种策略的量化投资模型，从不同投资维度，在不同市场情况下捕捉市场定价失效的投资机会，力争有效控制风险的基础上，实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	量化多策略体系的理念主要有两个：增强收益、分散风险。量化策略是基于市场历史数据实现的，不同市场信号需要采用不同策略和交易手段，因此建立多种策略可以弥补单一策略失效的可能并形成互补，保证整体投资业绩的持续性和增强。另一方面，策略间相关性越低，越能分散组合的整体风险，这是配置多个策略，并在策略之间设定适当比例的基本原理。本基金的投资策略主要包括： 1）股票投资策略 通过基金管理人开发的“多因子阿尔法模型”、“行业轮动模型”、“事件驱动模型”等各类量化模型进行股票选择并据此构建股票投资组合。在实际运行过程中，将定期或不定期的进行修正，优化股票投资组合。 2）固定收益投资策略 本基金债券等固定收益类证券以及可转换债券的投资策略主要为：久期管理策略、收益率曲线策略、个券选择策略、跨市场套利策略等，并择机把握市场有效性不足情况下的交易机会。 3）衍生品投资策略 本基金的衍生品投资原则上为有利于基金资产保值增值。本基金将严格遵守相关法律法规的约束，合理利用股指期货、权证等衍生工具，通过量化工具控制下行风险。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×85%+标普中国债券指数收益率×15%
风险收益特征	本基金为股票型证券投资基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债

	券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报
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	2017 年	2016 年	2015 年 6 月 2 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-94,180,421.44	50,102,344.37	-30,579,614.53
本期利润	-78,348,686.52	-69,075,912.00	64,311,541.36
加权平均基金份额本期利润	-0.0822	-0.0438	0.0271
本期加权平均净值利润率	-8.46%	-4.59%	2.88%
本期基金份额净值增长率	-8.66%	-3.70%	5.50%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	-51,967,510.96	19,619,384.00	28,370,435.28
期末可供分配基金份额利润	-0.0722	0.0161	0.0167
期末基金资产净值	667,547,062.03	1,238,731,667.14	1,794,884,099.80
期末基金份额净值	0.928	1.016	1.055
3.1.3 累计期末指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长率	-7.20%	1.60%	5.50%

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。

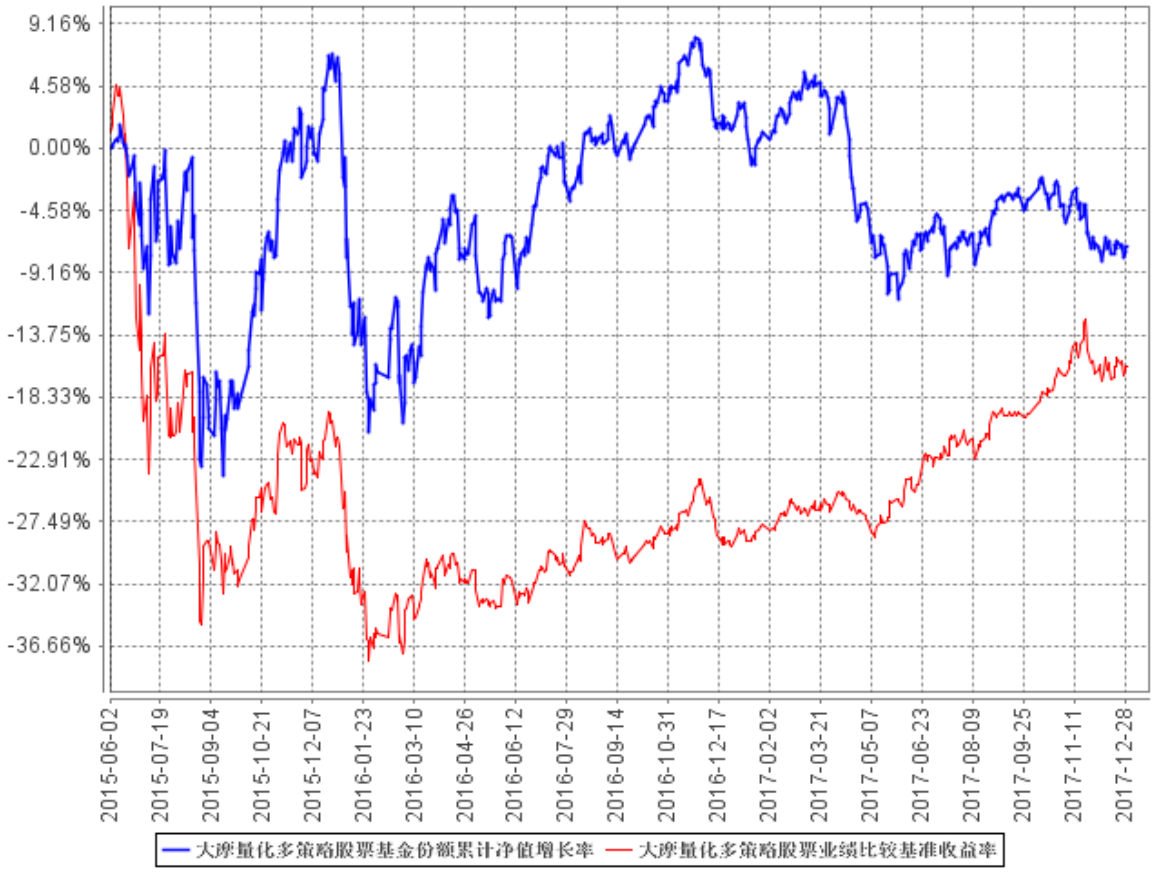
3.2 基金净值表现

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

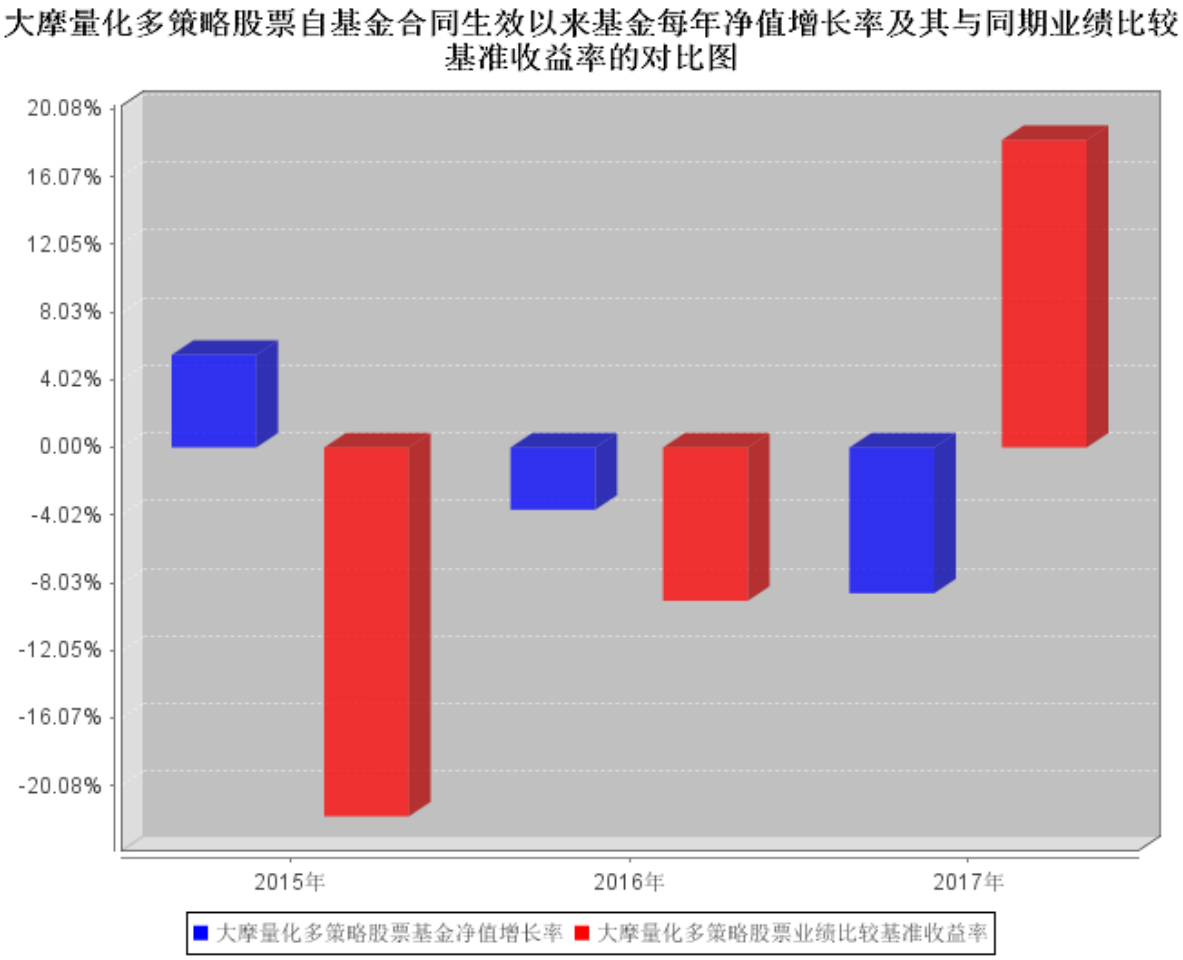
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-3.53%	0.69%	4.25%	0.69%	-7.78%	0.00%
过去六个月	-1.07%	0.71%	8.46%	0.59%	-9.53%	0.12%
过去一年	-8.66%	0.77%	18.26%	0.54%	-26.92%	0.23%
自基金合同生效起至今	-7.20%	1.51%	-16.07%	1.39%	8.87%	0.12%

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

大摩量化多策略股票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 自基金合同生效以来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



注：本基金 基金合同于 2015 年 6 月 2 日正式生效。上述指标在基金合同生效当年按照实际存续期进行计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日（2015 年 6 月 2 日）至本报告期末未进行利润分配。

§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 12 月 31 日，公司旗下共管理二十七只开放式基金，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、摩根士丹利华鑫睿成大盘弹性股票型证券投资基金、摩根士丹利华鑫新趋势灵活配置混合型证券投资基金、摩根士丹利华鑫万众创新灵活配置混合型证券投资基金和摩根士丹利华鑫科技领先灵活配置混合型证券投资基金。 同时，公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
夏青	数量化投	2017 年 6 月	-	11	美国马里兰大学金融数学博

	资部总监、基金经理	15 日			士。曾担任美国摩根士丹利机构证券部副总裁，美国芝加哥交易对冲基金投资经理，美国斯考特交易对冲基金投资经理，万向资源有限公司量化投资部总经理，东吴证券股份有限公司投资总部董事总经理。2016 年 7 月加入本公司，现任数量化投资部总监、基金经理。2017 年 6 月起任摩根士丹利华鑫多因子精选策略混合型证券投资基金、摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资基金基金和本基金基金经理，2017 年 12 月起担任摩根士丹利华鑫新趋势灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
王联欣	基金经理助理	2017 年 8 月 3 日	-	2	天津大学技术经济及管理硕士、中山大学统计本科毕业。2015 年 2 月加入本公司，历任助理量化研究员。2017 年 8 月起任本基金、摩根士丹利华鑫多因子精选策略混合型证券投资基金基金经理助理。
杨雨龙	数量化投资部副总监、基金经理	2015 年 7 月 25 日	2017 年 6 月 17 日	8	北京大学金融数学硕士。曾任招商银行总行计划财务部管理会计，博时基金管理有限公司交易员，兴业证券股份有限公司研究所金融工程高级分析师。2014 年 7 月份加入本公司，历任数量化投资部投资经理，2015 年 6 月至 2017 年 6 月任摩根士丹利华鑫多因子精选策略混合型证券投资基金及摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 7 月至 2017 年 6 月任本基金基金经理。

注：1、基金经理、基金经理助理的任职、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遵规守信情况的说明

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 42 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

回顾 2017 年，市场风格极度分化，代表大盘蓝筹的上证 50 指数和沪深 300 指数分别上涨 25.08%和 21.78%，代表中小盘成长股票的中证 500 指数和创业板指则分别下跌 0.20%和 10.67%。其中创业板指最近两年累计下跌 35.42%；沪深 300 指数与 2015 年股市大幅调整后的最低点相比已经累计上涨 42.88%。此外，从个股层面来看，2017 年 A 股上涨的股票只有 590 只，下跌的股票数量则达到了 2438 只，其中处于中位数的股票下跌幅度更是达到了 24%。高度分化的市场行情为强调分散化投资的量化基金带来极大的挑战，但以实际兑现业绩作为选股支撑的白马、蓝筹策略则在 2017 年斩获了不错的投资回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期截至 2017 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.928 元，累计份额净值为 0.928 元，基金份额净值增长率为-8.66%，同期业绩比较基准收益率为 18.26%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

截至目前，我国经济在地产和基建领域仍承受一定压力，但传统行业的产能过剩已明显缓解，以先进制造业、装备制造为代表的新动力保持较高的景气度。整体产能利用率的提升和企业盈利的改善意味着未来制造业投资仍存在改善的空间。资金层面，持续的金融监管导致金融体系内部资金的创造能力受到影响，银行体系投向非银系统的资金规模减少以及表外融资渠道受限都是影响 M2 增速的重要原因，而社会融资更多反映的是实体经济的融资需求，受金融监管影响较小，因此可以观察到 M2 和社会融资增速差距逐渐扩大。总体来看，未来国内货币政策预计仍将维持稳健中性，同时监管将继续加强统筹协调，国内资金面和跨境资本流动都有望更加有序。

未来我们仍将坚持按照既定的量化模型进行选股，并通过多策略相结合的方法提高整体投资的稳健性，同时保持中等偏高的仓位，相信在货币政策保持稳定、供给侧改革持续推进的基础上，加上市场情绪的逐步修复，投资者视野或将不仅仅集中在业绩确定性较高的蓝筹股上，前期被错杀的优质成长股有望迎来进一步的审视，而其中一大批尚处于历史估值洼地的、极具增长潜质的股票更有望逐渐迎来投资机会。

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，检查内控制度的执行情况、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）开展专项检查工作。检查范围覆盖投资研究交易、基金销售、基金估值、业务持续性计划、自有资金投资及风险准备金、反洗钱业务、应用系统权限管理等方面。（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，适时解读监管政策与要求，组织落实投资者适当性管理、基金流动性管理、公司合规管理、反洗钱等法律法规的相关要求，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，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。

2018 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

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的，则及时就所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见。

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（包括研究管理部负责人、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。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。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。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。

由于基金经理及相关投资研究人员对特定投资品种的估值有深入的理解，经估值委员会主任

委员同意，在需要时可以参加估值委员会议并提出估值的建议，估值委员会对特定品种估值方法需经委员充分讨论后确定。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、基金合同的要求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

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2018)第 21015 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	摩根士丹利华鑫量化多策略股票型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	(一)我们审计的内容 我们审计了摩根士丹利华鑫量化多策略股票型证券投资基金(以下简称“摩根士丹利华鑫量化多策略基金”)的财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表，2017 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。 (二)我们的意见 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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，公允反映了摩根士丹利华鑫量化多策略基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。 按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于摩根士丹利华鑫量化多策略基金，并履行了职业道德方面的其他责任。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	摩根士丹利华鑫量化多策略基金的基金管理人摩根士丹利华鑫基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

	在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估摩根士丹利华鑫量化多策略基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算摩根士丹利华鑫量化多策略基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督摩根士丹利华鑫量化多策略基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对摩根士丹利华鑫量化多策略基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致摩根士丹利华鑫量化多策略基金不能持续经营。 (五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现

	等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	许　康　玮	俞伟敏
会计师事务所的地址	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	
审计报告日期	2018 年 3 月 20 日	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：摩根士丹利华鑫量化多策略股票型证券投资基金

报告截止日： 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	61,304,736.12	140,998,696.73
结算备付金		2,796,524.80	3,303,759.40
存出保证金		114,105.39	244,451.72
交易性金融资产	7.4.7.2	606,578,675.26	1,099,659,655.40
其中：股票投资		605,980,409.32	1,099,659,655.40
基金投资		-	-
债券投资		598,265.94	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	15,439.82	33,548.37
应收股利		-	-
应收申购款		52,316.27	196,025.62
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		670,861,797.66	1,244,436,137.24
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2017 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		7.07	-
应付赎回款		1,086,269.29	1,273,333.68
应付管理人报酬		860,320.35	1,736,090.78
应付托管费		143,386.70	289,348.46
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,015,697.42	2,286,195.68
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	209,054.80	119,501.50
负债合计		3,314,735.63	5,704,470.10
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	719,514,572.99	1,219,112,283.14
未分配利润	7.4.7.10	-51,967,510.96	19,619,384.00
所有者权益合计		667,547,062.03	1,238,731,667.14
负债和所有者权益总计		670,861,797.66	1,244,436,137.24

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.928 元，基金份额总额 719,514,572.99 份。

7.2 利润表

会计主体：摩根士丹利华鑫量化多策略股票型证券投资基金

本报告期： 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		-46,637,718.91	-17,672,130.31
1.利息收入		795,240.58	1,171,145.01
其中：存款利息收入	7.4.7.11	795,082.57	1,171,145.01
债券利息收入		158.01	-
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）		-63,439,725.22	99,498,633.63
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-70,676,530.61	85,374,455.86
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	7,236,805.39	14,124,177.77
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	15,831,734.92	-119,178,256.37
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	175,030.81	836,347.42
减：二、费用		31,710,967.61	51,403,781.69
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	13,978,747.97	22,627,303.13
2．托管费	7.4.10.2.2	2,329,791.26	3,771,217.11

3．销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4．交易费用	7.4.7.19	14,880,378.85	24,549,419.80
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．其他费用	7.4.7.20	522,049.53	455,841.65
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-78,348,686.52	-69,075,912.00
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-78,348,686.52	-69,075,912.00

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：摩根士丹利华鑫量化多策略股票型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	1,219,112,283.14	19,619,384.00	1,238,731,667.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-78,348,686.52	-78,348,686.52
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）	-499,597,710.15	6,761,791.56	-492,835,918.59
其中：1.基金申购款	36,342,340.49	-839,221.25	35,503,119.24
2.基金赎回款	-535,940,050.64	7,601,012.81	-528,339,037.83
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）	719,514,572.99	-51,967,510.96	667,547,062.03
项目	**上年度可比期间 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）	1,701,243,243.63	93,640,856.17	1,794,884,099.80
二、本期经营活动产生的	-	-69,075,912.00	-69,075,912.00

基金净值变动数（本期利润）			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-482,130,960.49	-4,945,560.17	-487,076,520.66
其中：1.基金申购款	434,632,458.39	-1,949,099.46	432,683,358.93
2.基金赎回款	-916,763,418.88	-2,996,460.71	-919,759,879.59
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）	1,219,112,283.14	19,619,384.00	1,238,731,667.14

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 - 至 - 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

摩根士丹利华鑫量化多策略股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]737 号《关于准予摩根士丹利华鑫量化多策略股票型证券投资基金注册的批复》核准，由摩根士丹利华鑫基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《摩根士丹利华鑫量化多策略股票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证券投资基金，存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集 2,575,896,377.40 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 661 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《摩根士丹利华鑫量化多策略股票型证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 2 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,576,611,172.81 份，其中认购资金利息折合 714,795.41 份基金份额。本基金的基金管理人为摩根士丹利华鑫基金管理有限公司，基金托管人为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《摩根士丹利华鑫量化多策略股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资于股票(包含中小板、创业板及其他依法发行、上市的股票)，股指期货、权证，债券(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转

债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产以及现金，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。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 80%-95%；权证投资占基金资产净值的比例不高于 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金，基金保留的现金或者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。自基金合同生效日至 2015 年 9 月 28 日止期间，本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×85%+中信标普全债指数收益率×15%。根据本基金的基金管理人于 2015 年 9 月 29 日发布的《摩根士丹利华鑫基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金变更业绩比较基准及修改相关基金合同的公告》，自 2015 年 9 月 29 日起，本基金业绩比较基准变更为：沪深 300 指数收益率×85%+标普中国债券指数收益率×15%。

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 2018 年 3 月 20 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》、《 摩根士丹利华鑫量化多策略股票型证券投资基金 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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 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 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1）具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2）交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的

金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足

一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	61,304,736.12	140,998,696.73
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	61,304,736.12	140,998,696.73

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2017 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		614,475,840.82	605,980,409.32	-8,495,431.50
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	558,200.00	598,265.94	40,065.94
	银行间市场	-	-	-
	合计	558,200.00	598,265.94	40,065.94
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		615,034,040.82	606,578,675.26	-8,455,365.56
项目		上年度末 2016 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,123,946,755.88	1,099,659,655.40	-24,287,100.48
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		1,123,946,755.88	1,099,659,655.40	-24,287,100.48

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末

	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	13,841.03	31,792.00
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	1,384.35	1,635.37
应收债券利息	158.01	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	56.43	121.00
合计	15,439.82	33,548.37

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	1,015,697.42	2,286,195.68
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	1,015,697.42	2,286,195.68

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	54.80	501.50
预提费用	209,000.00	119,000.00
合计	209,054.80	119,501.50

7.4.7.9 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 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,219,112,283.14	1,219,112,283.14

本期申购	36,342,340.49	36,342,340.49
本期赎回（以“-”号填列）	-535,940,050.64	-535,940,050.64
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	719,514,572.99	719,514,572.99

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 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	64,860,548.56	-45,241,164.56	19,619,384.00
本期利润	-94,180,421.44	15,831,734.92	-78,348,686.52
本期基金份额交易产生的变动数	-5,066,730.43	11,828,521.99	6,761,791.56
其中：基金申购款	843,675.34	-1,682,896.59	-839,221.25
基金赎回款	-5,910,405.77	13,511,418.58	7,601,012.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-34,386,603.31	-17,580,907.65	-51,967,510.96

7.4.7.11 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	727,764.40	1,037,052.73
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	64,072.60	120,892.63
其他	3,245.57	13,199.65
合计	795,082.57	1,171,145.01

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间

	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	5,129,117,210.04	8,236,744,611.67
减：卖出股票成本总额	5,199,793,740.65	8,151,370,155.81
买卖股票差价收入	-70,676,530.61	85,374,455.86

7.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无债券投资收益。

7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	7,236,805.39	14,124,177.77
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	7,236,805.39	14,124,177.77

7.4.7.17 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	15,831,734.92	-119,178,256.37
——股票投资	15,791,668.98	-119,178,256.37
——债券投资	40,065.94	-
——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	15,831,734.92	-119,178,256.37

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	170,621.78	729,513.57
基金转换费收入	4,409.03	106,833.85
合计	175,030.81	836,347.42

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。不低于赎回费用的 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 25%的部分归入转出基金的基金资产。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	14,880,378.85	24,549,419.80
银行间市场交易费用	-	-
合计	14,880,378.85	24,549,419.80

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
审计费用	100,000.00	110,000.00
信息披露费	380,000.00	300,000.00
银行费用	4,449.53	5,741.65
债券账户维护费	36,000.00	39,300.00
其他	1,600.00	800.00
合计	522,049.53	455,841.65

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 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
深圳市基石创业投资有限公司(2017 年 10 月 26 日后)	基金管理人的股东
汉唐证券有限责任公司(2017 年 10 月 26 日前)	基金管理人的股东

注：1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 2007 年 12 月 26 日，深圳中院依法宣告汉唐证券破产清算。经过公开竞价，汉唐证券有限责任公司持有的基金管理人股权最终由竞买人深圳市基石创业投资有限公司竞得。上述股权转让于 2017 年 9 月 28 日经中国证监会批复核准，后于 2017 年 10 月 26 日经深圳市市场监督管理局予以核准并备案。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	462,738,650.29	4.71%	2,005,954,962.50	12.54%

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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	430,948.85	4.85%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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	1,868,148.18	12.54%	-	-

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	13,978,747.97	22,627,303.13
其中：支付销售机构的客户维护费	6,399,544.78	10,782,236.11

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31

	月 31 日	日
当期发生的基金应支付的托管费	2,329,791.26	3,771,217.11

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。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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	61,304,736.12	727,764.40	140,998,696.73	1,037,052.73

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。

7.4.10.6 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。

7.4.10.7 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。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

7.4.12 期末（ 2017 年 12 月 31 日 ）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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
002466	天齐锂业	2017 年 12 月 26 日	2018 年 1 月 3 日	配股流通受限	11.06	53.21	12,735	140,849.10	677,629.35	-
300374	恒通科技	2017 年 12 月 27 日	2018 年 1 月 12 日	配股流通受限	11.12	14.82	5,040	56,044.80	74,692.80	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
123004	铁汉转债	2017 年 12 月 18 日	2018 年 1 月 26 日	新债流通受限	100.00	100.00	140	14,000.00	14,000.00	-

7.4.12.2 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
600309	万华化学	2017 年 12 月 5 日	重大资产重组	37.94	-	-	179,006	6,736,965.61	6,791,487.64	-
600664	哈药股份	2017 年 9 月 28 日	重大资产重组	5.81	2018 年 2 月 27 日	6.00	566,900	3,280,234.37	3,293,689.00	-
002366	台海核电	2017 年 12 月 6 日	重大资产重组	26.45	-	-	71,566	2,147,694.56	1,892,920.70	-
300032	金龙机电	2017 年 11 月 27 日	重大事项	13.89	-	-	116,000	1,653,225.83	1,611,240.00	-
600248	延长化建	2017 年 7 月 18 日	重大资产重组	5.54	2018 年 1 月 5 日	6.09	280,900	1,819,921.86	1,556,186.00	-
300216	千山药机	2017 年 12 月 25 日	重大事项	15.95	2018 年 1 月 18 日	14.36	95,500	1,639,217.00	1,523,225.00	-
600485	信威集团	2016 年 12 月 26 日	重大资产重组	14.59	-	-	101,400	2,139,516.91	1,479,426.00	-
000900	现代投资	2017 年 10 月 27 日	重大资产重组	6.25	-	-	200,100	1,246,848.03	1,250,625.00	-
300116	坚瑞沃能	2017 年 12 月 18 日	重大资产重组	7.62	-	-	137,700	1,332,015.57	1,049,274.00	-

000693	*ST 华泽	2016 年 3 月 1 日	重大事项	12.50	-	-	74,246	1,089,030.94	928,075.00	-
300134	大富科技	2017 年 12 月 18 日	重大资产重组	16.45	2018 年 3 月 19 日	14.81	33,500	462,831.11	551,075.00	-
300149	量子高科	2017 年 11 月 6 日	重大资产重组	15.35	2018 年 1 月 29 日	16.89	34,400	501,706.00	528,040.00	-
002575	群兴玩具	2017 年 9 月 20 日	重大事项	9.10	-	-	46,700	434,080.14	424,970.00	-
000564	供销大集	2017 年 11 月 28 日	重大资产重组	4.78	-	-	81,400	463,280.26	389,092.00	-
002545	东方铁塔	2017 年 12 月 4 日	重大资产重组	8.67	-	-	41,600	394,469.67	360,672.00	-
300159	新研股份	2017 年 11 月 23 日	重大资产重组	10.40	-	-	33,400	373,453.00	347,360.00	-
002524	光正集团	2017 年 12 月 18 日	重大资产重组	6.35	-	-	52,200	347,712.19	331,470.00	-
000812	陕西金叶	2017 年 12 月 7 日	重大资产重组	7.17	-	-	40,000	327,024.70	286,800.00	-
002382	蓝帆医疗	2017 年 7 月 24 日	重大资产重组	12.19	2018 年 1 月 8 日	13.41	21,700	259,618.67	264,523.00	-
300392	腾信股份	2017 年 10 月 11 日	重大资产重组	14.93	-	-	16,200	244,178.14	241,866.00	-
000695	滨海能源	2017 年 10 月 9 日	重大资产重组	11.73	2018 年 1 月 15 日	10.73	19,700	227,172.62	231,081.00	-
000022	深赤湾 A	2017 年 11 月 20 日	重大资产重组	24.14	-	-	9,500	241,751.50	229,330.00	-
000006	深振业 A	2017 年 9 月 11 日	重大资产重组	9.85	2018 年 3 月 8 日	8.87	22,000	186,697.25	216,700.00	-
002103	广博股份	2017 年 11 月 15 日	重大资产重组	9.45	-	-	21,000	244,355.82	198,450.00	-
300272	开能环保	2017 年 8 月 14 日	重大资产重组	9.13	2018 年 1 月 8 日	10.00	18,900	180,308.10	172,557.00	-
002787	华源控股	2017 年 12 月 21 日	重大事项	10.65	2018 年 1 月 2 日	10.94	16,000	215,629.77	170,400.00	-
000032	深桑达 A	2017 年 12 月 29 日	重大事项	10.06	2018 年 1 月 3 日	10.32	15,500	196,131.04	155,930.00	-
300356	光一科技	2017 年 12 月 26 日	重大资产重组	6.99	-	-	17,500	153,867.22	122,325.00	-
000688	建新矿业	2017 年 9 月 6 日	重大事项	10.95	2018 年 2 月 7 日	9.86	10,900	85,811.53	119,355.00	-
300010	立思辰	2017 年 11 月 17 日	重大事项	11.17	2018 年 2 月 22 日	10.05	10,400	120,256.00	116,168.00	-
603032	德新	2017 年 11 月 2 日	重大资	54.26	-	-	2,100	100,041.59	113,946.00	-

	交运		产重组							
600150	中国船舶	2017 年 9 月 27 日	重大资产重组	24.67	-	-	4,500	102,908.12	111,015.00	-
600685	中船防务	2017 年 9 月 27 日	重大资产重组	26.66	-	-	3,100	80,700.03	82,646.00	-
300455	康拓红外	2017 年 11 月 15 日	重大资产重组	11.24	-	-	6,940	80,845.25	78,005.60	-
002033	丽江旅游	2017 年 12 月 14 日	重大事项	9.10	2018 年 3 月 14 日	9.19	6,541	67,870.42	59,523.10	-
000540	中天金融	2017 年 8 月 21 日	重大资产重组	7.35	-	-	6,500	41,136.94	47,775.00	-
300483	沃施股份	2017 年 10 月 9 日	重大资产重组	33.13	2018 年 1 月 8 日	36.44	1,100	34,915.73	36,443.00	-
300260	新莱应材	2017 年 10 月 16 日	重大资产重组	14.43	2018 年 1 月 29 日	13.10	2,500	31,688.81	36,075.00	-
002738	中矿资源	2017 年 10 月 9 日	重大资产重组	28.66	-	-	1,200	26,549.24	34,392.00	-
002189	利达光电	2017 年 9 月 8 日	重大资产重组	18.08	2018 年 3 月 7 日	16.53	1,600	25,063.58	28,928.00	-
002015	霞客环保	2017 年 7 月 31 日	重大资产重组	8.41	2018 年 1 月 4 日	7.58	1,400	10,542.52	11,774.00	-

注：本基金截至 2017 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，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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型证券投资基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。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运用多种策略的量化投资模型，从不同投资维度，在不同市场情况下捕捉市场定价失效的投资机会，力争在控

制风险的基础上，实现基金资产的长期稳定增值。

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。

7.4.13.2 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 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.09%(2016 年 12 月 31 日：无)。

7.4.13.3 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。

于 2017 年 12 月 31 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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。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。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：

根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 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	61,304,736.12	-	-	-	61,304,736.12
结算备付金	2,796,524.80	-	-	-	2,796,524.80
存出保证金	114,105.39	-	-	-	114,105.39
交易性金融资产	-	93,438.40	504,827.54	605,980,409.32	606,578,675.26
应收利息	-	-	-	15,439.82	15,439.82
应收申购款	-	-	-	52,316.27	52,316.27
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	64,215,366.31	93,438.40	504,827.54	606,048,165.41	670,861,797.66
负债					

应付证券清算款	-	-	-	7.07	7.07
应付赎回款	-	-	-	1,086,269.29	1,086,269.29
应付管理人报酬	-	-	-	860,320.35	860,320.35
应付托管费	-	-	-	143,386.70	143,386.70
应付交易费用	-	-	-	1,015,697.42	1,015,697.42
其他负债	-	-	-	209,054.80	209,054.80
负债总计	-	-	-	3,314,735.63	3,314,735.63
利率敏感度缺口	64,215,366.31	93,438.40	504,827.54	602,733,429.78	667,547,062.03
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	140,998,696.73	-	-	-	140,998,696.73
结算备付金	3,303,759.40	-	-	-	3,303,759.40
存出保证金	244,451.72	-	-	-	244,451.72
交易性金融资产	-	-	-	1,099,659,655.40	1,099,659,655.40
应收利息	-	-	-	33,548.37	33,548.37
应收申购款	-	-	-	196,025.62	196,025.62
资产总计	144,546,907.85	-	-	1,099,889,229.39	1,244,436,137.24
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,273,333.68	1,273,333.68
应付管理人报酬	-	-	-	1,736,090.78	1,736,090.78
应付托管费	-	-	-	289,348.46	289,348.46
应付交易费用	-	-	-	2,286,195.68	2,286,195.68
其他负债	-	-	-	119,501.50	119,501.50
负债总计	-	-	-	5,704,470.10	5,704,470.10
利率敏感度缺口	144,546,907.85	-	-	1,094,184,759.29	1,238,731,667.14

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.09%(2016 年 12 月 31 日：无)。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)。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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，通过开发各类量化模型进行股票选择并据此构建投资组合。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发行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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 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	605,980,409.32	90.78	1,099,659,655.40	88.77
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	598,265.94	0.09	-	-
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	606,578,675.26	90.87	1,099,659,655.40	88.77

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)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 12 月 31 日 ）	上年度末（ 2016 年 12 月 31 日 ）
	1. 业绩比较基准（附注 7.4.1)上升 5%	28,530,000.00	68,440,000.00
	2. 业绩比较基准（附注 7.4.1)下降 5%	-28,530,000.00	-68,440,000.00

7.4.14 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 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 579,089,840.22 元，属于第二层次的余额为 27,488,835.04 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次的余额为 1,045,069,844.89 元，第二层次的余额为 54,589,810.51 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 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(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，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。

根据财政部、国家税务总局于 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。

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况和 2017 年度的经营成果无影响。

(3)除公允价值和增值税外，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	605,980,409.32	90.33
	其中：股票	605,980,409.32	90.33
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	598,265.94	0.09
	其中：债券	598,265.94	0.09
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	64,101,260.92	9.56
8	其他各项资产	181,861.48	0.03
9	合计	670,861,797.66	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	5,240,601.46	0.79
B	采矿业	23,909,721.16	3.58
C	制造业	298,414,990.65	44.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,385,605.00	2.75
E	建筑业	18,708,608.00	2.80
F	批发和零售业	20,989,277.00	3.14
G	交通运输、仓储和邮政业	17,101,878.57	2.56
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	36,058,451.00	5.40
J	金融业	94,136,705.40	14.10
K	房地产业	35,452,019.80	5.31
L	租赁和商务服务业	11,538,069.00	1.73
M	科学研究和技术服务业	1,659,063.00	0.25

N	水利、环境和公共设施管理业	10,721,741.10	1.61
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,354,200.00	0.35
R	文化、体育和娱乐业	11,031,378.18	1.65
S	综合	278,100.00	0.04
	合计	605,980,409.32	90.78

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

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	601318	中国平安	190,500	13,331,190.00	2.00
2	601988	中国银行	2,763,000	10,969,110.00	1.64
3	000776	广发证券	641,900	10,706,892.00	1.60
4	000651	格力电器	216,800	9,474,160.00	1.42
5	601211	国泰君安	482,800	8,941,456.00	1.34
6	600519	贵州茅台	11,200	7,811,888.00	1.17
7	000423	东阿阿胶	123,900	7,467,453.00	1.12
8	601398	工商银行	1,186,000	7,353,200.00	1.10
9	300072	三聚环保	208,400	7,321,092.00	1.10
10	600104	上汽集团	223,600	7,164,144.00	1.07
11	600309	万华化学	179,006	6,791,487.64	1.02
12	002415	海康威视	173,700	6,774,300.00	1.01
13	002304	洋河股份	57,700	6,635,500.00	0.99
14	600674	川投能源	632,700	6,440,886.00	0.96
15	601628	中国人寿	202,100	6,153,945.00	0.92
16	002027	分众传媒	421,400	5,933,312.00	0.89
17	601225	陕西煤业	716,000	5,842,560.00	0.88
18	300136	信维通信	114,400	5,800,080.00	0.87
19	002146	荣盛发展	605,400	5,769,462.00	0.86
20	601006	大秦铁路	633,200	5,743,124.00	0.86
21	002466	天齐锂业	107,435	5,716,616.35	0.86
22	600383	金地集团	449,700	5,679,711.00	0.85
23	300033	同花顺	112,600	5,627,748.00	0.84
24	000333	美的集团	99,000	5,487,570.00	0.82
25	601668	中国建筑	605,200	5,458,904.00	0.82
26	002491	通鼎互联	421,100	5,305,860.00	0.79

27	000069	华侨城Ａ	606,700	5,150,883.00	0.77
28	600566	济川药业	134,800	5,142,620.00	0.77
29	600585	海螺水泥	172,700	5,065,291.00	0.76
30	600688	上海石化	794,600	5,029,818.00	0.75
31	000895	双汇发展	183,700	4,868,050.00	0.73
32	601601	中国太保	115,000	4,763,300.00	0.71
33	600000	浦发银行	367,800	4,630,602.00	0.69
34	601899	紫金矿业	967,700	4,441,743.00	0.67
35	600282	南钢股份	911,400	4,411,176.00	0.66
36	000513	丽珠集团	65,900	4,379,055.00	0.66
37	601166	兴业银行	249,700	4,242,403.00	0.64
38	002092	中泰化学	291,000	3,873,210.00	0.58
39	600886	国投电力	521,900	3,830,746.00	0.57
40	300124	汇川技术	130,000	3,772,600.00	0.57
41	000501	鄂武商Ａ	231,400	3,693,144.00	0.55
42	002065	东华软件	447,700	3,671,140.00	0.55
43	000999	华润三九	132,425	3,601,960.00	0.54
44	002714	牧原股份	67,561	3,571,274.46	0.53
45	002152	广电运通	470,600	3,501,264.00	0.52
46	300266	兴源环境	128,900	3,480,300.00	0.52
47	600053	九鼎投资	143,300	3,423,437.00	0.51
48	002147	新光圆成	263,500	3,409,690.00	0.51
49	000028	国药一致	56,100	3,380,025.00	0.51
50	600664	哈药股份	566,900	3,293,689.00	0.49
51	600016	民生银行	386,000	3,238,540.00	0.49
52	601186	中国铁建	286,500	3,191,610.00	0.48
53	601328	交通银行	513,700	3,190,077.00	0.48
54	002236	大华股份	134,500	3,105,605.00	0.47
55	601800	中国交建	241,100	3,086,080.00	0.46
56	600487	亨通光电	73,500	2,970,870.00	0.45
57	000858	五 粮 液	36,700	2,931,596.00	0.44
58	300296	利亚德	149,800	2,919,602.00	0.44
59	002002	鸿达兴业	424,300	2,902,212.00	0.43
60	000625	长安汽车	227,600	2,867,760.00	0.43
61	600887	伊利股份	86,000	2,768,340.00	0.41
62	600240	华业资本	317,900	2,727,582.00	0.41
63	000963	华东医药	50,100	2,699,388.00	0.40
64	600338	西藏珠峰	63,600	2,648,940.00	0.40
65	600066	宇通客车	108,700	2,616,409.00	0.39

66	600642	申能股份	444,900	2,607,114.00	0.39
67	002271	东方雨虹	64,700	2,585,412.00	0.39
68	002460	赣锋锂业	35,800	2,568,650.00	0.38
69	600208	新湖中宝	491,600	2,566,152.00	0.38
70	601012	隆基股份	70,000	2,550,800.00	0.38
71	600028	中国石化	415,800	2,548,854.00	0.38
72	300207	欣旺达	260,400	2,541,504.00	0.38
73	601998	中信银行	404,800	2,509,760.00	0.38
74	000541	佛山照明	268,200	2,467,440.00	0.37
75	002841	视源股份	34,000	2,465,000.00	0.37
76	601877	正泰电器	92,600	2,421,490.00	0.36
77	600582	天地科技	519,200	2,414,280.00	0.36
78	000538	云南白药	23,700	2,412,423.00	0.36
79	603658	安图生物	45,037	2,396,869.14	0.36
80	000997	新 大 陆	132,400	2,373,932.00	0.36
81	600019	宝钢股份	272,100	2,350,944.00	0.35
82	600201	生物股份	73,500	2,332,890.00	0.35
83	603188	亚邦股份	139,300	2,310,987.00	0.35
84	603160	汇顶科技	23,600	2,287,784.00	0.34
85	300017	网宿科技	213,100	2,267,384.00	0.34
86	000725	京东方 A	391,100	2,264,469.00	0.34
87	000876	新 希 望	302,300	2,252,135.00	0.34
88	000400	许继电气	168,900	2,227,791.00	0.33
89	600900	长江电力	141,500	2,205,985.00	0.33
90	300251	光线传媒	210,000	2,194,500.00	0.33
91	600312	平高电气	219,500	2,192,805.00	0.33
92	002831	裕同科技	38,800	2,168,144.00	0.32
93	300043	星辉娱乐	354,000	2,166,480.00	0.32
94	300015	爱尔眼科	70,300	2,165,240.00	0.32
95	300027	华谊兄弟	244,600	2,135,358.00	0.32
96	300144	宋城演艺	113,400	2,116,044.00	0.32
97	601020	华钰矿业	101,900	2,090,988.00	0.31
98	002202	金风科技	110,900	2,090,465.00	0.31
99	600649	城投控股	236,900	2,084,720.00	0.31
100	002127	南极电商	167,500	2,041,825.00	0.31
101	603556	海兴电力	56,000	2,038,400.00	0.31
102	000732	泰禾集团	100,900	2,020,018.00	0.30
103	600036	招商银行	68,600	1,990,772.00	0.30
104	300294	博雅生物	66,150	1,981,192.50	0.30

105	002078	太阳纸业	211,000	1,958,080.00	0.29
106	600967	内蒙一机	162,000	1,952,100.00	0.29
107	002468	申通快递	78,853	1,946,880.57	0.29
108	600755	厦门国贸	192,600	1,945,260.00	0.29
109	600835	上海机电	79,300	1,942,850.00	0.29
110	002366	台海核电	71,566	1,892,920.70	0.28
111	601607	上海医药	77,700	1,879,563.00	0.28
112	600522	中天科技	133,400	1,859,596.00	0.28
113	603806	福斯特	54,500	1,858,450.00	0.28
114	601155	新城控股	63,000	1,845,900.00	0.28
115	002120	韵达股份	40,200	1,840,356.00	0.28
116	600177	雅戈尔	197,840	1,814,192.80	0.27
117	002352	顺丰控股	35,300	1,777,708.00	0.27
118	300001	特锐德	128,400	1,757,796.00	0.26
119	300168	万达信息	129,100	1,740,268.00	0.26
120	000166	申万宏源	323,300	1,736,121.00	0.26
121	002174	游族网络	77,800	1,734,940.00	0.26
122	600219	南山铝业	467,500	1,720,400.00	0.26
123	300202	聚龙股份	94,900	1,703,455.00	0.26
124	601169	北京银行	237,876	1,700,813.40	0.25
125	601633	长城汽车	146,300	1,680,987.00	0.25
126	300182	捷成股份	194,900	1,678,089.00	0.25
127	000060	中金岭南	144,500	1,614,065.00	0.24
128	300032	金龙机电	116,000	1,611,240.00	0.24
129	600248	延长化建	280,900	1,556,186.00	0.23
130	600276	恒瑞医药	22,500	1,552,050.00	0.23
131	600703	三安光电	61,100	1,551,329.00	0.23
132	300216	千山药机	95,500	1,523,225.00	0.23
133	600015	华夏银行	169,060	1,521,540.00	0.23
134	600894	广日股份	162,700	1,521,245.00	0.23
135	600388	龙净环保	87,600	1,515,480.00	0.23
136	600816	安信信托	113,300	1,481,964.00	0.22
137	600485	信威集团	101,400	1,479,426.00	0.22
138	002051	中工国际	74,700	1,376,721.00	0.21
139	600183	生益科技	79,700	1,375,622.00	0.21
140	600100	同方股份	139,600	1,368,080.00	0.20
141	300284	苏交科	83,500	1,364,390.00	0.20
142	601088	中国神华	58,000	1,343,860.00	0.20
143	600153	建发股份	120,100	1,335,512.00	0.20

144	601336	新华保险	18,600	1,305,720.00	0.20
145	002241	歌尔股份	74,700	1,296,045.00	0.19
146	002517	恺英网络	57,800	1,283,738.00	0.19
147	300310	宜通世纪	110,200	1,277,218.00	0.19
148	002410	广联达	65,000	1,274,000.00	0.19
149	002555	三七互娱	61,700	1,267,318.00	0.19
150	600271	航天信息	58,100	1,251,474.00	0.19
151	000900	现代投资	200,100	1,250,625.00	0.19
152	000587	金洲慈航	177,600	1,243,200.00	0.19
153	600690	青岛海尔	63,900	1,203,876.00	0.18
154	600637	东方明珠	72,100	1,201,186.00	0.18
155	002311	海大集团	50,500	1,181,700.00	0.18
156	603816	顾家家居	19,600	1,155,812.00	0.17
157	600435	北方导航	92,700	1,142,991.00	0.17
158	600518	康美药业	50,900	1,138,124.00	0.17
159	300498	温氏股份	47,000	1,123,300.00	0.17
160	600115	东方航空	134,500	1,104,245.00	0.17
161	600741	华域汽车	35,900	1,065,871.00	0.16
162	600660	福耀玻璃	36,700	1,064,300.00	0.16
163	000415	渤海金控	183,500	1,056,960.00	0.16
164	002081	金 螳 螂	68,525	1,049,803.00	0.16
165	300116	坚瑞沃能	137,700	1,049,274.00	0.16
166	600804	鹏博士	61,000	1,038,830.00	0.16
167	600048	保利地产	71,900	1,017,385.00	0.15
168	300180	华峰超纤	41,000	1,007,780.00	0.15
169	002252	上海莱士	50,700	1,006,395.00	0.15
170	600628	新世界	94,000	955,980.00	0.14
171	601989	中国重工	155,700	938,871.00	0.14
172	000693	*ST 华泽	74,246	928,075.00	0.14
173	600718	东软集团	62,900	922,114.00	0.14
174	600061	国投资本	69,900	921,282.00	0.14
175	601608	中信重工	219,200	903,104.00	0.14
176	002310	东方园林	43,900	885,463.00	0.13
177	300287	飞利信	119,300	884,013.00	0.13
178	600687	刚泰控股	73,900	872,759.00	0.13
179	600373	中文传媒	51,500	871,895.00	0.13
180	600633	浙数文化	57,300	870,960.00	0.13
181	600260	凯乐科技	29,800	867,478.00	0.13
182	600372	中航电子	62,900	861,101.00	0.13

183	002508	老板电器	17,900	860,990.00	0.13
184	600826	兰生股份	63,300	833,661.00	0.12
185	000758	中色股份	129,300	831,399.00	0.12
186	002690	美亚光电	42,700	822,829.00	0.12
187	002013	中航机电	76,200	822,198.00	0.12
188	600221	海航控股	253,000	807,070.00	0.12
189	600068	葛洲坝	96,800	793,760.00	0.12
190	603328	依顿电子	54,800	786,380.00	0.12
191	000761	本钢板材	148,900	774,280.00	0.12
192	600704	物产中大	110,500	753,610.00	0.11
193	002008	大族激光	14,800	731,120.00	0.11
194	600280	中央商场	92,200	725,614.00	0.11
195	600117	西宁特钢	127,100	723,199.00	0.11
196	300115	长盈精密	36,000	722,520.00	0.11
197	300414	中光防雷	32,400	712,476.00	0.11
198	000612	焦作万方	74,100	696,540.00	0.10
199	600545	卓郎智能	60,800	667,584.00	0.10
200	300026	红日药业	152,700	650,502.00	0.10
201	002475	立讯精密	27,408	642,443.52	0.10
202	002426	胜利精密	109,200	636,636.00	0.10
203	000888	峨眉山Ａ	58,100	625,737.00	0.09
204	002071	长城影视	59,801	608,774.18	0.09
205	601111	中国国航	49,300	607,376.00	0.09
206	000628	高新发展	72,500	606,100.00	0.09
207	600138	中青旅	28,800	601,056.00	0.09
208	600999	招商证券	33,600	576,576.00	0.09
209	000568	泸州老窖	8,700	574,200.00	0.09
210	000630	铜陵有色	196,200	572,904.00	0.09
211	600757	长江传媒	81,700	567,815.00	0.09
212	600415	小商品城	98,200	567,596.00	0.09
213	600694	大商股份	16,700	563,291.00	0.08
214	600348	阳泉煤业	74,932	552,998.16	0.08
215	600547	山东黄金	17,700	551,886.00	0.08
216	300134	大富科技	33,500	551,075.00	0.08
217	601888	中国国旅	12,600	546,714.00	0.08
218	601009	南京银行	69,700	539,478.00	0.08
219	600406	国电南瑞	29,500	539,260.00	0.08
220	600893	航发动力	20,000	538,200.00	0.08
221	600422	昆药集团	58,000	530,700.00	0.08

222	300149	量子高科	34,400	528,040.00	0.08
223	600089	特变电工	53,100	526,221.00	0.08
224	000685	中山公用	50,900	521,725.00	0.08
225	600808	马钢股份	122,100	504,273.00	0.08
226	600098	广州发展	71,000	501,970.00	0.08
227	002309	中利集团	33,400	493,318.00	0.07
228	600409	三友化工	50,000	479,500.00	0.07
229	601231	环旭电子	29,000	457,330.00	0.07
230	002608	江苏国信	43,700	443,992.00	0.07
231	600606	绿地控股	60,700	443,110.00	0.07
232	000413	东旭光电	46,700	438,046.00	0.07
233	002575	群兴玩具	46,700	424,970.00	0.06
234	601000	唐山港	87,500	412,125.00	0.06
235	600021	上海电力	44,800	409,472.00	0.06
236	603444	吉比特	2,200	404,646.00	0.06
237	002503	搜于特	73,000	404,420.00	0.06
238	300203	聚光科技	11,300	401,715.00	0.06
239	600270	外运发展	22,900	395,712.00	0.06
240	000564	供销大集	81,400	389,092.00	0.06
241	600551	时代出版	32,700	383,898.00	0.06
242	603858	步长制药	7,500	381,450.00	0.06
243	002400	省广股份	70,300	374,699.00	0.06
244	000517	荣安地产	110,700	374,166.00	0.06
245	300098	高新兴	27,800	369,740.00	0.06
246	600188	兖州煤业	25,200	365,904.00	0.05
247	002074	国轩高科	16,290	362,615.40	0.05
248	002545	东方铁塔	41,600	360,672.00	0.05
249	000608	阳光股份	57,400	360,472.00	0.05
250	300070	碧水源	20,200	350,874.00	0.05
251	300159	新研股份	33,400	347,360.00	0.05
252	601999	出版传媒	46,600	345,772.00	0.05
253	002354	天神娱乐	20,100	343,710.00	0.05
254	600397	安源煤业	88,500	343,380.00	0.05
255	600827	百联股份	25,100	338,599.00	0.05
256	002195	二三四五	57,100	333,464.00	0.05
257	002285	世联行	29,800	332,270.00	0.05
258	002524	光正集团	52,200	331,470.00	0.05
259	600750	江中药业	13,000	331,240.00	0.05
260	000727	华东科技	138,600	329,868.00	0.05

261	300088	长信科技	42,100	329,643.00	0.05
262	002190	成飞集成	15,000	324,600.00	0.05
263	300374	恒通科技	21,840	323,668.80	0.05
264	300014	亿纬锂能	16,400	321,604.00	0.05
265	601699	潞安环能	27,400	311,812.00	0.05
266	603568	伟明环保	14,400	303,120.00	0.05
267	600862	中航高科	30,600	296,208.00	0.04
268	000623	吉林敖东	13,100	294,750.00	0.04
269	600717	天津港	28,000	293,720.00	0.04
270	000793	华闻传媒	29,300	293,293.00	0.04
271	600343	航天动力	22,500	290,925.00	0.04
272	300408	三环集团	14,400	290,304.00	0.04
273	000812	陕西金叶	40,000	286,800.00	0.04
274	603588	高能环境	21,900	278,568.00	0.04
275	000571	新大洲Ａ	51,500	278,100.00	0.04
276	600908	无锡银行	35,100	276,237.00	0.04
277	603799	华友钴业	3,400	272,782.00	0.04
278	601128	常熟银行	38,000	270,940.00	0.04
279	600038	中直股份	5,800	269,874.00	0.04
280	300133	华策影视	24,700	267,748.00	0.04
281	600926	杭州银行	23,200	267,496.00	0.04
282	603868	飞科电器	3,500	265,125.00	0.04
283	002382	蓝帆医疗	21,700	264,523.00	0.04
284	002179	中航光电	6,700	263,846.00	0.04
285	600060	海信电器	17,100	256,842.00	0.04
286	300113	顺网科技	13,900	254,231.00	0.04
287	300024	机器人	13,500	254,070.00	0.04
288	300323	华灿光电	15,500	252,650.00	0.04
289	002106	莱宝高科	24,300	247,131.00	0.04
290	300392	腾信股份	16,200	241,866.00	0.04
291	300009	安科生物	9,300	241,149.00	0.04
292	300355	蒙草生态	19,100	239,514.00	0.04
293	300450	先导智能	4,200	239,274.00	0.04
294	300316	晶盛机电	11,300	236,283.00	0.04
295	600983	惠而浦	32,800	236,160.00	0.04
296	300197	铁汉生态	19,400	235,710.00	0.04
297	000695	滨海能源	19,700	231,081.00	0.03
298	603677	奇精机械	9,600	231,072.00	0.03
299	300418	昆仑万维	11,200	230,384.00	0.03

300	000022	深赤湾Ａ	9,500	229,330.00	0.03
301	600743	华远地产	62,300	228,018.00	0.03
302	300003	乐普医疗	9,300	224,688.00	0.03
303	300145	中金环境	18,600	222,270.00	0.03
304	300558	贝达药业	3,500	221,515.00	0.03
305	601555	东吴证券	22,700	220,644.00	0.03
306	603228	景旺电子	4,100	220,457.00	0.03
307	002019	亿帆医药	9,900	220,275.00	0.03
308	600594	益佰制药	21,400	218,708.00	0.03
309	600586	金晶科技	47,800	217,490.00	0.03
310	002558	巨人网络	5,900	217,120.00	0.03
311	000006	深振业Ａ	22,000	216,700.00	0.03
312	600392	盛和资源	11,300	214,700.00	0.03
313	600643	爱建集团	19,300	213,844.00	0.03
314	300463	迈克生物	8,900	213,333.00	0.03
315	600655	豫园股份	19,800	212,652.00	0.03
316	002726	龙大肉食	18,600	212,412.00	0.03
317	002567	唐人神	27,300	211,302.00	0.03
318	300130	新国都	8,700	207,582.00	0.03
319	000786	北新建材	9,200	207,000.00	0.03
319	600705	中航资本	37,500	207,000.00	0.03
320	300274	阳光电源	10,900	204,593.00	0.03
321	002736	国信证券	18,800	203,980.00	0.03
322	300118	东方日升	16,800	203,784.00	0.03
323	000001	平安银行	15,300	203,490.00	0.03
324	600132	重庆啤酒	9,700	202,342.00	0.03
325	600133	东湖高新	21,500	199,735.00	0.03
326	600959	江苏有线	24,400	199,592.00	0.03
327	002103	广博股份	21,000	198,450.00	0.03
328	002848	高斯贝尔	12,600	195,174.00	0.03
329	603877	太平鸟	7,100	192,481.00	0.03
330	002573	清新环境	8,400	190,932.00	0.03
331	300428	四通新材	9,600	189,696.00	0.03
332	300244	迪安诊断	8,000	188,960.00	0.03
333	002128	露天煤业	16,800	186,144.00	0.03
334	002477	雏鹰农牧	41,800	185,592.00	0.03
335	000603	盛达矿业	15,400	185,108.00	0.03
336	000662	天夏智慧	12,400	184,388.00	0.03
337	000716	黑芝麻	32,900	184,240.00	0.03

338	601118	海南橡胶	32,900	182,595.00	0.03
339	601069	西部黄金	11,500	182,505.00	0.03
340	002417	三元达	13,900	181,117.00	0.03
341	300170	汉得信息	15,100	179,690.00	0.03
342	600017	日照港	45,900	178,092.00	0.03
343	002234	民和股份	15,600	177,840.00	0.03
344	300093	金刚玻璃	15,700	177,410.00	0.03
345	600020	中原高速	36,400	176,904.00	0.03
346	601107	四川成渝	41,900	172,628.00	0.03
347	300272	开能环保	18,900	172,557.00	0.03
348	300037	新宙邦	8,200	171,052.00	0.03
349	600766	园城黄金	18,600	170,934.00	0.03
350	002787	华源控股	16,000	170,400.00	0.03
351	600814	杭州解百	18,900	170,100.00	0.03
352	603025	大豪科技	5,700	167,694.00	0.03
353	600828	茂业商业	26,800	166,160.00	0.02
354	300073	当升科技	6,300	165,627.00	0.02
355	600658	电子城	14,900	165,390.00	0.02
356	603031	安德利	6,700	162,676.00	0.02
357	300271	华宇软件	10,900	162,192.00	0.02
358	300367	东方网力	10,600	159,848.00	0.02
359	600393	粤泰股份	25,000	158,500.00	0.02
360	300324	旋极信息	10,800	158,004.00	0.02
361	600180	瑞茂通	15,000	156,300.00	0.02
362	600007	中国国贸	9,100	155,974.00	0.02
363	000032	深桑达Ａ	15,500	155,930.00	0.02
364	300166	东方国信	12,400	155,620.00	0.02
365	300075	数字政通	9,600	155,328.00	0.02
366	300253	卫宁健康	23,100	155,001.00	0.02
367	300297	蓝盾股份	16,000	152,640.00	0.02
368	600093	易见股份	14,000	150,080.00	0.02
369	002131	利欧股份	56,800	147,680.00	0.02
370	603861	白云电器	8,700	146,073.00	0.02
371	002437	誉衡药业	21,100	145,379.00	0.02
372	600095	哈高科	23,300	144,460.00	0.02
373	002083	孚日股份	21,500	143,620.00	0.02
374	002154	报 喜 鸟	41,000	142,680.00	0.02
375	002818	富森美	4,700	142,457.00	0.02
376	300146	汤臣倍健	9,300	139,686.00	0.02

377	000514	渝 开 发	22,800	139,536.00	0.02
378	000928	中钢国际	21,100	137,361.00	0.02
379	600641	万业企业	10,100	135,340.00	0.02
380	600510	黑牡丹	20,400	135,048.00	0.02
381	000835	长城动漫	16,300	134,964.00	0.02
382	002325	洪涛股份	27,500	131,175.00	0.02
383	600864	哈投股份	16,400	130,216.00	0.02
384	000416	民生控股	17,800	126,736.00	0.02
385	300291	华录百纳	11,100	125,985.00	0.02
386	002372	伟星新材	7,000	125,860.00	0.02
387	300148	天舟文化	15,300	125,766.00	0.02
388	600131	岷江水电	18,000	124,380.00	0.02
389	600101	明星电力	13,400	123,682.00	0.02
390	600830	香溢融通	13,000	123,370.00	0.02
391	300356	光一科技	17,500	122,325.00	0.02
392	600493	凤竹纺织	15,300	122,247.00	0.02
393	600259	广晟有色	3,100	121,799.00	0.02
394	600505	西昌电力	16,600	120,018.00	0.02
395	300496	中科创达	3,700	119,584.00	0.02
396	603977	国泰集团	8,900	119,527.00	0.02
397	000688	建新矿业	10,900	119,355.00	0.02
398	600230	沧州大化	2,800	119,000.00	0.02
399	603288	海天味业	2,200	118,360.00	0.02
400	603313	梦百合	4,400	118,052.00	0.02
401	300384	三联虹普	4,000	117,960.00	0.02
402	300618	寒锐钴业	500	117,885.00	0.02
403	300010	立思辰	10,400	116,168.00	0.02
404	603032	德新交运	2,100	113,946.00	0.02
405	603233	大参林	2,200	113,652.00	0.02
406	603707	健友股份	4,000	112,920.00	0.02
407	600150	中国船舶	4,500	111,015.00	0.02
408	603527	众源新材	3,700	110,778.00	0.02
409	603612	索通发展	2,200	109,846.00	0.02
410	000563	陕国投Ａ	25,700	109,225.00	0.02
411	002058	威 尔 泰	5,100	108,885.00	0.02
412	600698	湖南天雁	13,600	108,664.00	0.02
413	000987	越秀金控	11,000	108,350.00	0.02
414	600609	金杯汽车	18,800	108,288.00	0.02
415	000862	银星能源	22,300	107,932.00	0.02

416	603933	睿能科技	2,000	106,680.00	0.02
417	000544	中原环保	7,300	105,923.00	0.02
418	000036	华联控股	11,700	105,768.00	0.02
419	603517	绝味食品	2,600	102,492.00	0.02
420	603387	基蛋生物	1,700	101,966.00	0.02
421	300679	电连技术	1,100	101,332.00	0.02
422	002265	西仪股份	6,700	100,902.00	0.02
423	300264	佳创视讯	12,600	100,800.00	0.02
424	600985	雷鸣科化	7,700	99,946.00	0.01
425	000717	韶钢松山	11,200	99,232.00	0.01
426	002708	光洋股份	14,200	97,412.00	0.01
427	603618	杭电股份	10,800	97,200.00	0.01
428	000700	模塑科技	17,100	96,957.00	0.01
429	300589	江龙船艇	3,900	96,330.00	0.01
430	000011	深物业 A	5,700	95,703.00	0.01
431	600581	八一钢铁	7,000	95,620.00	0.01
432	603039	泛微网络	1,500	95,535.00	0.01
433	600352	浙江龙盛	8,100	94,851.00	0.01
434	603363	傲农生物	5,700	94,164.00	0.01
435	300322	硕贝德	7,900	93,378.00	0.01
436	300301	长方集团	15,100	92,563.00	0.01
437	002636	金安国纪	5,800	91,814.00	0.01
438	002547	春兴精工	11,500	91,655.00	0.01
439	300622	博士眼镜	3,500	91,630.00	0.01
440	603963	大理药业	3,200	91,392.00	0.01
441	002001	新 和 成	2,400	91,344.00	0.01
442	603976	正川股份	3,300	91,146.00	0.01
443	600600	青岛啤酒	2,300	90,459.00	0.01
444	300702	天宇股份	2,200	90,420.00	0.01
445	000968	蓝焰控股	5,300	88,987.00	0.01
446	603138	海量数据	2,000	88,580.00	0.01
447	002094	青岛金王	5,000	87,950.00	0.01
448	300709	精研科技	1,200	86,796.00	0.01
449	002456	欧菲科技	4,200	86,478.00	0.01
450	300042	朗科科技	2,700	86,211.00	0.01
451	000586	汇源通信	4,800	86,064.00	0.01
452	603089	正裕工业	3,500	83,895.00	0.01
453	600685	中船防务	3,100	82,646.00	0.01
454	603938	三孚股份	2,000	81,900.00	0.01

455	002721	金一文化	5,100	81,600.00	0.01
456	300150	世纪瑞尔	15,000	81,150.00	0.01
457	600475	华光股份	5,600	81,032.00	0.01
458	600781	辅仁药业	3,500	80,465.00	0.01
459	600855	航天长峰	5,400	80,082.00	0.01
460	300628	亿联网络	600	79,980.00	0.01
461	000590	启迪古汉	5,100	79,713.00	0.01
462	300155	安居宝	14,000	79,520.00	0.01
463	300443	金雷风电	4,700	79,101.00	0.01
464	300273	和佳股份	8,700	78,822.00	0.01
465	300455	康拓红外	6,940	78,005.60	0.01
466	002868	绿康生化	3,200	77,888.00	0.01
467	600681	百川能源	5,700	77,235.00	0.01
468	000701	厦门信达	7,700	77,154.00	0.01
469	300449	汉邦高科	3,900	76,596.00	0.01
470	600436	片仔癀	1,200	75,840.00	0.01
471	002724	海洋王	8,000	75,760.00	0.01
472	002597	金禾实业	2,900	75,168.00	0.01
473	300507	苏奥传感	2,700	74,466.00	0.01
474	300393	中来股份	2,100	73,290.00	0.01
475	600476	湘邮科技	4,500	72,900.00	0.01
476	603113	金能科技	3,200	72,512.00	0.01
477	000596	古井贡酒	1,100	72,237.00	0.01
478	600452	涪陵电力	2,100	71,778.00	0.01
479	603456	九洲药业	4,600	71,254.00	0.01
480	000518	四环生物	10,400	71,136.00	0.01
481	300235	方直科技	6,000	70,200.00	0.01
482	603186	华正新材	2,900	69,426.00	0.01
483	603716	塞力斯	1,400	69,342.00	0.01
484	603660	苏州科达	2,000	69,220.00	0.01
485	000949	新乡化纤	15,400	69,146.00	0.01
486	002099	海翔药业	11,900	68,782.00	0.01
487	300687	赛意信息	1,400	66,276.00	0.01
488	300289	利德曼	7,200	66,240.00	0.01
489	603180	金牌厨柜	500	66,035.00	0.01
490	300285	国瓷材料	3,300	66,000.00	0.01
491	300689	澄天伟业	1,500	65,580.00	0.01
492	600277	亿利洁能	10,000	64,400.00	0.01
493	603106	恒银金融	2,600	64,350.00	0.01

494	603369	今世缘	4,100	63,591.00	0.01
495	300478	杭州高新	1,500	63,585.00	0.01
496	603103	横店影视	2,200	62,744.00	0.01
497	000698	沈阳化工	10,600	62,646.00	0.01
498	603416	信捷电气	2,000	62,640.00	0.01
499	000637	茂化实华	10,400	62,088.00	0.01
500	300627	华测导航	1,400	62,034.00	0.01
501	300660	江苏雷利	900	61,902.00	0.01
502	300121	阳谷华泰	4,600	61,686.00	0.01
503	002809	红墙股份	1,800	61,254.00	0.01
504	300382	斯莱克	4,000	61,160.00	0.01
505	002867	周大生	2,200	61,050.00	0.01
506	300571	平治信息	1,300	60,840.00	0.01
507	002905	金逸影视	1,700	60,826.00	0.01
508	603458	勘设股份	800	60,472.00	0.01
509	002823	凯中精密	3,800	60,268.00	0.01
510	000589	黔轮胎Ａ	12,900	60,243.00	0.01
511	000627	天茂集团	7,500	60,000.00	0.01
512	002462	嘉事堂	2,300	59,892.00	0.01
513	002033	丽江旅游	6,541	59,523.10	0.01
514	603063	禾望电气	3,300	59,499.00	0.01
515	601038	一拖股份	7,100	59,356.00	0.01
516	002882	金龙羽	4,300	58,695.00	0.01
517	300579	数字认证	1,300	58,500.00	0.01
518	002753	永东股份	2,900	58,000.00	0.01
519	603165	荣晟环保	1,000	57,350.00	0.01
520	603225	新凤鸣	1,600	57,280.00	0.01
521	000707	双环科技	10,300	57,062.00	0.01
522	000422	湖北宜化	13,900	56,712.00	0.01
523	000565	渝三峡Ａ	7,900	56,485.00	0.01
524	300484	蓝海华腾	2,600	56,160.00	0.01
525	002892	科力尔	1,500	55,365.00	0.01
526	603110	东方材料	2,000	52,940.00	0.01
527	603181	皇马科技	2,200	52,800.00	0.01
528	600714	金瑞矿业	5,800	52,490.00	0.01
529	300095	华伍股份	6,500	52,260.00	0.01
530	300690	双一科技	900	52,173.00	0.01
531	002740	爱迪尔	5,700	52,155.00	0.01
532	603813	原尚股份	1,700	52,037.00	0.01

533	600262	北方股份	2,600	51,506.00	0.01
534	300201	海伦哲	7,200	51,120.00	0.01
535	002559	亚威股份	5,600	50,848.00	0.01
536	603055	台华新材	3,000	50,160.00	0.01
537	300092	科新机电	6,000	49,920.00	0.01
538	002816	和科达	2,300	49,220.00	0.01
539	000570	苏常柴Ａ	8,700	48,546.00	0.01
540	300341	麦迪电气	7,200	48,456.00	0.01
541	002007	华兰生物	1,800	48,384.00	0.01
542	000540	中天金融	6,500	47,775.00	0.01
543	300151	昌红科技	6,500	47,645.00	0.01
544	600843	上工申贝	4,500	47,475.00	0.01
545	000055	方大集团	7,800	47,268.00	0.01
546	603638	艾迪精密	1,400	46,522.00	0.01
547	603357	设计总院	2,100	45,927.00	0.01
548	300699	光威复材	700	45,878.00	0.01
549	603090	宏盛股份	2,300	45,402.00	0.01
550	603136	天目湖	1,000	42,290.00	0.01
551	603730	岱美股份	1,100	39,391.00	0.01
552	002833	弘亚数控	600	37,230.00	0.01
553	300483	沃施股份	1,100	36,443.00	0.01
554	300260	新莱应材	2,500	36,075.00	0.01
555	603321	梅轮电梯	3,000	36,000.00	0.01
556	603776	永安行	600	35,922.00	0.01
557	603757	大元泵业	600	35,862.00	0.01
558	603617	君禾股份	1,500	35,715.00	0.01
559	002738	中矿资源	1,200	34,392.00	0.01
560	300607	拓斯达	500	33,800.00	0.01
561	603277	银都股份	1,800	33,444.00	0.01
562	603179	新泉股份	900	32,814.00	0.00
563	300700	岱勒新材	500	32,450.00	0.00
564	002884	凌霄泵业	600	31,692.00	0.00
565	603305	旭升股份	800	30,440.00	0.00
566	002189	利达光电	1,600	28,928.00	0.00
567	002021	中捷资源	6,700	28,810.00	0.00
568	300707	威唐工业	600	27,960.00	0.00
569	000927	一汽夏利	6,100	27,877.00	0.00
570	600398	海澜之家	2,500	24,250.00	0.00
571	300282	汇冠股份	1,300	24,024.00	0.00

572	600390	五矿资本	2,000	23,600.00	0.00
573	601878	浙商证券	1,300	21,606.00	0.00
574	600291	西水股份	800	18,816.00	0.00
575	300577	开润股份	300	18,471.00	0.00
576	603908	牧高笛	500	18,000.00	0.00
577	002015	霞客环保	1,400	11,774.00	0.00
578	300280	南通锻压	300	10,410.00	0.00

注：根据“三元达”（002417）公告，“三元达”自 2018 年 2 月 9 日更名为“深南股份”。

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	601998	中信银行	37,465,543.00	3.02
2	002142	宁波银行	34,844,199.35	2.81
3	000776	广发证券	30,823,578.00	2.49
4	601211	国泰君安	30,162,144.67	2.43
5	601169	北京银行	29,111,089.92	2.35
6	600000	浦发银行	26,585,843.27	2.15
7	002736	国信证券	22,615,118.94	1.83
8	600015	华夏银行	20,820,175.00	1.68
9	600291	西水股份	19,502,713.63	1.57
10	600999	招商证券	18,327,764.34	1.48
11	601818	光大银行	17,801,944.00	1.44
12	000686	东北证券	17,545,625.38	1.42
13	601988	中国银行	17,021,511.00	1.37
14	600061	国投资本	16,998,514.07	1.37
15	000651	格力电器	16,591,121.84	1.34
16	600016	民生银行	16,056,558.00	1.30
17	601628	中国人寿	15,791,563.00	1.27
18	000783	长江证券	14,299,995.00	1.15
19	601318	中国平安	13,095,237.22	1.06
20	000750	国海证券	12,662,554.00	1.02

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	601166	兴业银行	45,413,909.00	3.67
2	601211	国泰君安	44,734,613.10	3.61
3	000776	广发证券	44,588,973.20	3.60
4	601398	工商银行	42,398,552.00	3.42
5	601818	光大银行	42,336,806.29	3.42
6	002142	宁波银行	34,254,346.80	2.77
7	601998	中信银行	33,578,972.90	2.71
8	600036	招商银行	31,971,616.00	2.58
9	600030	中信证券	29,152,444.00	2.35
10	601169	北京银行	24,787,246.00	2.00
11	601628	中国人寿	23,221,678.50	1.87
12	002736	国信证券	22,314,901.81	1.80
13	600291	西水股份	21,564,738.77	1.74
14	600000	浦发银行	21,006,641.10	1.70
15	600015	华夏银行	20,837,239.40	1.68
16	601601	中国太保	19,049,392.68	1.54
17	600999	招商证券	18,485,208.00	1.49
18	000686	东北证券	17,464,362.72	1.41
19	601318	中国平安	15,716,665.86	1.27
20	600061	国投资本	15,101,063.00	1.22

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	4,690,322,825.59
卖出股票收入（成交）总额	5,129,117,210.04

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）

1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	598,265.94	0.09
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	598,265.94	0.09

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110040	生益转债	2,410	260,954.80	0.04
2	110038	济川转债	880	93,438.40	0.01
3	128017	金禾转债	630	72,563.40	0.01
4	128019	久立转 2	732	69,518.04	0.01
5	110039	宝信转债	490	52,268.30	0.01

8.7 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。

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的规定，本基金将本着谨慎原则，适度参与股指期货投资。通过对现货市场和期货市场运行趋势的研究，结合基金股票组合的实际情况及对股指期货的估值水平、基差水平、流动性等因素的分析，选择合适的期货合约构建相应的头寸，以调整投资组合的风险暴露，降低系统性风险。本基金还将利用股指期货作为组合流动性管理工具，降低现货市场流动性不足导致的冲击成本过高的风险，提高基金的建仓或变现效率。

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	114,105.39
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	15,439.82

5	应收申购款	52,316.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	181,861.48

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
14,068	51,145.48	12,822,583.08	1.78%	706,691,989.91	98.22%

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（ 2015 年 6 月 2 日 ）基金份额总额	2,576,611,172.81
本报告期期初基金份额总额	1,219,112,283.14
本报告期基金总申购份额	36,342,340.49
减:本报告期基金总赎回份额	535,940,050.64
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	719,514,572.99

§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，基金管理人的重大人事变动如下：

基金管理人原总经理高潮生先生因个人原因休假，经基金管理人董事会决定，董事长于华先生自 2017 年 8 月 3 日起兼任代总经理。2017 年 8 月 14 日，高潮生先生不再担任基金管理人总经理。基金管理人于 2017 年 8 月 15 日公告了上述事项。

2017 年 9 月 28 日起，督察长李锦女士兼任基金管理人副总经理。根据现行法规、公司章程的规定，督察长李锦女士在兼任公司副总经理期间，其工作职责与原有职责保持一致，不得履行与督察长独立性相冲突的职责。基金管理人于 2017 年 9 月 30 日公告了上述事项。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动如下：

2017 年 9 月 1 日，中国建设银行发布公告，聘任纪伟为中国建设银行资产托管业务部总经理。

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）2017 年度审计的报酬为 100,000.00 元。目前普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已连续三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	
光大证券	1	1,340,502,263.43	13.65%	1,248,411.62	14.06%	-
中信建投	1	926,908,112.43	9.44%	863,237.26	9.72%	-
平安证券	1	854,023,382.38	8.70%	795,355.48	8.96%	-
国信证券	1	685,329,452.89	6.98%	638,248.73	7.19%	-
方正证券	2	669,408,176.84	6.82%	623,423.14	7.02%	-
中泰证券	1	557,848,338.13	5.68%	519,524.59	5.85%	-
海通证券	1	509,176,730.71	5.19%	474,198.58	5.34%	-
华鑫证券	2	462,738,650.29	4.71%	430,948.85	4.85%	-
东吴证券	1	428,345,135.24	4.36%	313,252.58	3.53%	-
申万宏源	2	420,712,605.13	4.28%	391,813.11	4.41%	-
长江证券	2	368,529,299.07	3.75%	343,219.26	3.87%	-
兴业证券	1	359,443,838.97	3.66%	334,753.80	3.77%	-
银河证券	1	246,092,670.50	2.51%	229,192.37	2.58%	-
东北证券	1	238,817,861.42	2.43%	174,648.10	1.97%	-
安信证券	2	211,749,276.37	2.16%	197,203.15	2.22%	-
天风证券	1	200,613,024.97	2.04%	146,710.21	1.65%	-
广发证券	1	199,958,409.46	2.04%	186,222.89	2.10%	-
宏信证券	1	197,523,633.19	2.01%	183,957.44	2.07%	-
中银国际	2	178,580,943.67	1.82%	166,313.81	1.87%	-
长城证券	2	171,410,270.77	1.75%	125,354.20	1.41%	-
浙商证券	2	154,300,103.78	1.57%	112,835.35	1.27%	-
中信证券	3	99,115,453.13	1.01%	92,306.25	1.04%	-
东方证券	2	68,009,238.21	0.69%	63,336.06	0.71%	-

华创证券	1	57,199,629.00	0.58%	53,270.40	0.60%	-
华林证券	1	52,029,385.58	0.53%	38,049.56	0.43%	-
中投证券	1	51,459,367.51	0.52%	47,924.13	0.54%	-
太平洋证券	1	51,433,615.48	0.52%	37,613.76	0.42%	-
国海证券	1	29,006,293.20	0.30%	27,013.73	0.30%	-
川财证券	2	25,539,017.73	0.26%	18,676.75	0.21%	-
国金证券	1	3,276,501.00	0.03%	3,051.50	0.03%	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
九州证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
中信证券（山东）	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务；

（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 3 家证券公司的 3 个专用交易单元，其中东北证券、九州证券、太平洋证券各 1 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
光大证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-

太平洋证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
九州证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
中信证券（山东）	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期未通过租用的证券公司交易单元进行其他证券投资。

11.8 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	本基金招募说明书（更新）（2016 年第 2 号）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 1 月 13 日
2	本基金 2016 年 4 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 1 月 19 日
3	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 1 月 23 日
4	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 1 月 23 日
5	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 2 月 23 日
6	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 3 月 13 日
7	本基金 2016 年年度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 3 月 30 日

8	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 3 月 31 日
9	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 4 月 14 日
10	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 4 月 14 日
11	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 4 月 20 日
12	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 4 月 20 日
13	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 4 月 22 日
14	本基金 2017 年 1 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 4 月 24 日
15	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 4 月 27 日
16	本公司关于调整直销中心最低认申购金额限制的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 5 月 26 日
17	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 6 月 9 日
18	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 6 月 9 日
19	本基金基金经理变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 6 月 15 日
20	本基金基金经理变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 6 月 17 日
21	本公司关于旗下基金增加上海证券为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 6 月 27 日
22	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 6 月 27 日
23	本公司关于直销网上交易开通快付通支付业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 6 月 28 日
24	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 6 月 29 日

25	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 6 月 29 日
26	本公司关于执行《证券期货投资者适当性管理办法》和《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 7 月 1 日
27	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 7 月 1 日
28	本公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司网上银行申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 7 月 1 日
29	本基金招募说明书（更新）（2017 年第 1 号）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 7 月 14 日
30	本基金 2017 年 2 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 7 月 20 日
31	本公司关于旗下基金参与华西证券股份有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 7 月 21 日
32	本公司关于旗下基金参与华泰证券股份有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 8 月 1 日
33	本公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 8 月 15 日
34	本公司关于旗下部分基金参与中泰证券费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 8 月 24 日
35	本公司关于旗下部分基金在国金证券股份有限公司开通基金定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 8 月 25 日
36	本基金 2017 年半年度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 8 月 28 日
37	本公司关于旗下部分基金参与平安银行股份有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 9 月 25 日
38	本公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 9 月 30 日
39	本基金 2017 年 3 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 10 月 25 日
40	本公司关于股权变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 11 月 8 日
41	本公司关于旗下部分基金在大泰金石基金销售有限公司开通基金定期定额投资业务并参与定期定	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 12 月 22 日

	额投资申购费率优惠活动的公告		
42	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 12 月 30 日
43	本公司关于旗下基金所涉增值税征缴事项的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 12 月 30 日

注:上述公告同时在公司网站 www.msfunds.com.cn 上披露。

§12 备查文件目录

12.1 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。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

12.3 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

2018 年 3 月 29 日