

摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券 投资基金 2018 年半年度报告

2018 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：2018 年 8 月 27 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 2018 年 8 月 23 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 2018 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	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
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	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
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	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表	18
6.2 利润表	19
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.....	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	57
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.....	58
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.....	58
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.....	58
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.....	58
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	59
7.12 投资组合报告附注.....	59
§8 基金份额持有人信息.....	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	61
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.....	61
§9 开放式基金份额变动.....	62
§10 重大事件揭示.....	63
10.1 基金份额持有人大会决议.....	63
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.....	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	63
10.4 基金投资策略的改变.....	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	63
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.....	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	64
10.8 其他重大事件.....	65
§11 备查文件目录.....	68
11.1 备查文件目录.....	68

11.2 存放地点.....	68
11.3 查阅方式.....	68

§ 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	29,104,003.71 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	陈竽	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	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.msfnunds.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(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	684,925.29
本期利润	-6,246,561.12
加权平均基金份额本期利润	-0.2209
本期加权平均净值利润率	-14.38%
本期基金份额净值增长率	-14.94%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	10,319,632.63
期末可供分配基金份额利润	0.3546
期末基金资产净值	39,423,636.34
期末基金份额净值	1.355
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	35.50%

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

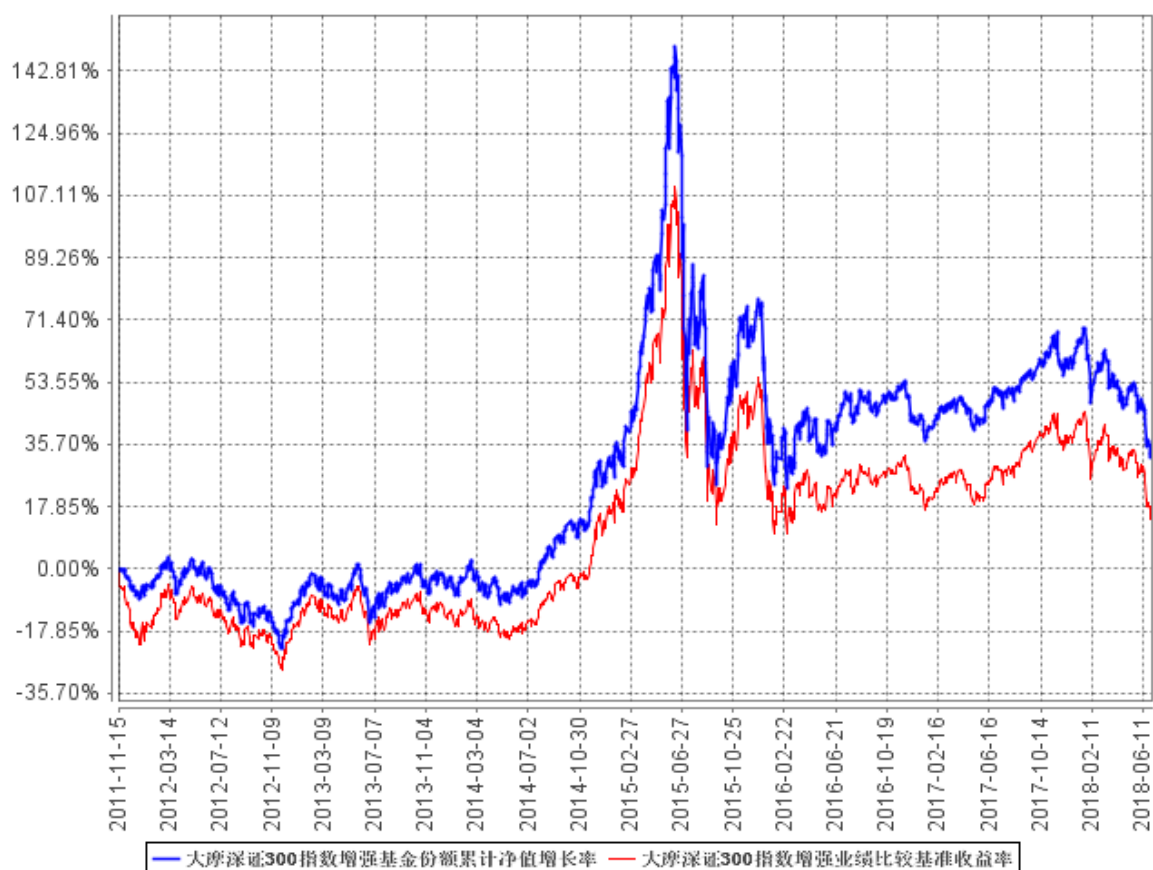
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	-8.20%	1.47%	-8.32%	1.62%	0.12%	-0.15%
过去三个月	-12.97%	1.15%	-12.74%	1.27%	-0.23%	-0.12%
过去六个月	-14.94%	1.19%	-14.18%	1.30%	-0.76%	-0.11%
过去一年	-10.74%	1.01%	-8.62%	1.10%	-2.12%	-0.09%
过去三年	-31.74%	1.84%	-30.32%	1.66%	-1.42%	0.18%

自基金合同 生效起至今	35.50%	1.61%	18.05%	1.54%	17.45%	0.07%
----------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

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

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



§ 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 2018 年 6 月 30 日，公司旗下共管理二十五只开放式基金，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、摩根士丹利华鑫睿成中小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		

吴国雄	基金经理	2016 年 7 月 16 日	2018 年 6 月 13 日	11	金融风险管理师 (FRM)，香港科技大学金融数学与统计专业硕士，曾任职于安信证券股份有限公司风险管理部。2013 年 5 月加入本公司，历任风险管理部风险管理经理、数量化投资部基金经理助理、数量化投资部投资经理。2016 年 6 月至 2018 年 6 月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 月至 2018 年 6 月任本基金基金经理，2017 年 1 月至 2018 年 6 月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 月至 2018 年 5 月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。
夏青	数量化投资部总监、基金经理	2018 年 5 月 22 日	-	12	美国马里兰大学金融数学博士。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。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

					资基金、摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资基金、摩根士丹利华鑫量化多策略股票型证券投资基金基金经理, 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, 2018 年 5 月起担任本基金、摩根士丹利华鑫睿成中小盘弹性股票型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

- 注：1、基金经理的任职、离任日期为根据本公司决定确定的聘任日期、解聘日期；
- 2、基金经理的任职、离任已按规定在中国证券投资基金业协会办理完毕基金经理注册、注销；
- 3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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，本基金未出现基金管理人管理的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，基金管理人未发现异常交易行为。

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

据国家统计局数据显示，6 月官方制造业 PMI 为 51.5，低于上月的 51.9，下降了 0.4 个百分点，但仍连续二十三个月位于荣枯线上方。从分类指数来看，6 月 PMI 新订单指数为 53.2，较上月回落 0.6 个百分点，而新出口订单则重新回到临界点下方，为 49.8，比上月下降 1.4 个百分点，创今年 3 月以来新低。考虑到近期海外经济景气程度渐趋下行，叠加贸易摩擦可能带来的不确定性，下半年需求端或将持续承压。汇率方面，受美联储加息和中美贸易战影响，截止二季度末，人民币兑美元汇率已跌破 6.6 关口，并呈现持续贬值态势。

2018 年上半年，在美联储加息、中美贸易摩擦等事件影响下，A 股表现持续低迷。上证综指更是在二季度创下了 2016 年三季度以来的最大单季跌幅，单季下跌幅度达到 10.14%，且连续三个季度下跌，季末报收 2847.42。从中信一级行业来看，上半年上涨的行业仅有餐饮旅游、医药和食品饮料，体现出在本轮普跌行情中食品饮料、医药等防御性较强的板块抗跌性更好。从整个上半年来看，代表大盘蓝筹的沪深 300 指数下跌 12.90%，代表中小盘成长股票的创业板指和中小板指则分别下跌 8.33% 和 14.26%。

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 2018 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.355 元，份额累计净值为 1.355 元，报告期内基金份额净值增长率为-14.94%，同期业绩比较基准收益率为-14.18%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从监管政策看，下半年金融严监管态势仍会延续，货币政策向偏松方向微调继续对金融体系流动性提供支持，但“紧信用”环境预计将难现明显改观，内需扩张动力将持续承压。与此同时，下半年中美双方互相加征关税正式落地，双方将进入“边打边谈”阶段，不排除贸易摩擦进一步升温的可能。由此，预计下半年国内外经济环境均将趋紧，宏观经济增速下行压力也将有所加大。

2018 年下半年，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

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（分管基金运营部的副总经理）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。

4.7 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，本基金本报告期末实

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 2018 年 1 月 18 日起至 2018 年 6 月 29 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。

§ 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 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：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	3,703,083.08	3,855,663.44
结算备付金		6,872.38	7,665.81
存出保证金		10,233.43	2,256.28
交易性金融资产	6.4.7.2	36,482,226.34	48,427,951.38
其中：股票投资		36,433,124.10	48,379,833.67
基金投资		-	-
债券投资		49,102.24	48,117.71
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	747.35	807.64
应收股利		-	-
应收申购款		26,268.91	1,312,535.64
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		40,229,431.49	53,606,880.19
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 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		558,461.30	1,174,461.70
应付赎回款		49,864.91	29,372.32
应付管理人报酬		33,646.67	42,217.01
应付托管费		5,047.00	6,332.56
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	34,773.78	14,341.70

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	124,001.49	94,563.21
负债合计		805,795.15	1,361,288.50
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	29,104,003.71	32,789,313.45
未分配利润	6.4.7.10	10,319,632.63	19,456,278.24
所有者权益合计		39,423,636.34	52,245,591.69
负债和所有者权益总计		40,229,431.49	53,606,880.19

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.355 元，基金份额总额 29,104,003.71 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-5,683,133.34	3,793,513.52
1.利息收入		13,494.96	12,192.50
其中：存款利息收入	6.4.7.11	13,452.57	12,192.50
债券利息收入		42.39	-
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）		1,223,063.08	603,720.66
其中：股票投资收益	6.4.7.12	962,844.76	237,324.49
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-	-
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	260,218.32	366,396.17
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-6,931,486.41	3,160,947.68
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	11,795.03	16,652.68

减：二、费用		563,427.78	510,401.09
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	214,681.18	229,520.76
2. 托管费	6.4.10.2.2	32,202.17	34,428.18
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	137,803.93	67,851.17
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	178,740.50	178,600.98
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-6,246,561.12	3,283,112.43
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-6,246,561.12	3,283,112.43

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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	32,789,313.45	19,456,278.24	52,245,591.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-6,246,561.12	-6,246,561.12
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）	-3,685,309.74	-2,890,084.49	-6,575,394.23
其中：1.基金申购款	9,441,245.32	5,038,157.99	14,479,403.31
2.基金赎回款	-13,126,555.06	-7,928,242.48	-21,054,797.54
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）	29,104,003.71	10,319,632.63	39,423,636.34

项目	上年度可比期间 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

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

李锦

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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

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

据财政部、国家税务总局财税[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》、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》、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》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 2018 年 6 月 30 日
活期存款	3,703,083.08
定期存款	—
其中：存款期限 1 个月以内	—
存款期限 1-3 个月	—
存款期限 3 个月以上	—
其他存款	—
合计：	3,703,083.08

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	40,140,598.35	36,433,124.10	-3,707,474.25
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	48,200.00	49,102.24
	银行间市场	—	—
	合计	48,200.00	49,102.24
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	40,188,798.35	36,482,226.34	-3,706,572.01

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 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	690.80
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	3.10
应收债券利息	48.85
应收资产支持证券利息	—
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	4.60
合计	747.35

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 2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	34,773.78
银行间市场应付交易费用	—
合计	34,773.78

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	150.21
预提费用	73,851.28
指数使用费	50,000.00
合计	124,001.49

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	32,789,313.45	32,789,313.45
本期申购	9,441,245.32	9,441,245.32
本期赎回(以“-”号填列)	-13,126,555.06	-13,126,555.06
本期末	29,104,003.71	29,104,003.71

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	25,048,811.39	-5,592,533.15	19,456,278.24
本期利润	684,925.29	-6,931,486.41	-6,246,561.12
本期基金份额交易产生的变动数	-2,693,562.23	-196,522.26	-2,890,084.49
其中：基金申购款	7,619,813.20	-2,581,655.21	5,038,157.99
基金赎回款	-10,313,375.43	2,385,132.95	-7,928,242.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	23,040,174.45	-12,720,541.82	10,319,632.63

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

活期存款利息收入	12,811.65
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	585.68
其他	55.24
合计	13,452.57

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	47,333,878.25
减：卖出股票成本总额	46,371,033.49
买卖股票差价收入	962,844.76

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	260,218.32

基金投资产生的股利收益	-
合计	260,218.32

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-6,931,486.41
——股票投资	-6,932,470.94
——债券投资	984.53
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-6,931,486.41

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	10,271.04
基金转换费收入	1,523.99
合计	11,795.03

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
----	----

	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	137,803.93
银行间市场交易费用	-
合计	137,803.93

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	49,588.57
银行费用	389.22
债券账户维护费	8,926.92
指数使用费	100,000.00
合计	178,740.50

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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	0.00	0.00%	14,607,809.47	32.93%

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 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	0.00	0.00%	—	—
关联方名称	上年度可比期间 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%	—	—

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	214,681.18	229,520.76
其中：支付销售机构的客户维护费	107,084.83	112,314.40

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	32,202.17	34,428.18

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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	3,703,083.08	12,811.65	3,756,485.64	11,708.91

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（2018 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
000540	中天金融	2017 年 8 月 21 日	重大资产重组	4.87	-	-	74,700	335,404.72	363,789.00	-
300072	三聚环保	2018 年 6 月 19 日	重大事项	23.28	2018 年 7 月 10 日	24.00	10,908	347,855.09	253,938.24	-

002450	康得新	2018 年 6 月 4 日	重大资产重组	17.08	-	-	14,185	269,181.58	242,279.80	-
002739	万达电影	2017 年 7 月 4 日	重大资产重组	38.02	-	-	5,900	352,995.92	224,318.00	-
000415	渤海金控	2018 年 1 月 17 日	重大资产重组	5.84	2018 年 7 月 17 日	5.26	35,400	247,571.37	206,736.00	-
002252	上海莱士	2018 年 2 月 23 日	重大资产重组	19.52	-	-	9,100	191,780.60	177,632.00	-
002610	爱康科技	2018 年 6 月 5 日	重大资产重组	2.10	-	-	66,000	154,806.43	138,600.00	-
002426	胜利精密	2018 年 6 月 19 日	重大事项	3.60	2018 年 7 月 3 日	3.26	34,100	189,129.97	122,760.00	-
000825	太钢不锈	2018 年 4 月 16 日	重大资产重组	6.00	-	-	16,800	86,666.11	100,800.00	-
002310	东方园林	2018 年 5 月 25 日	重大资产	15.03	-	-	5,850	103,122.19	87,925.50	-

			重							
			组							
002051	中工国际	2018 年 4 月 4 日	重大资产重组	15.27	-	-	3,668	61,706.95	56,010.36	-
000008	神州高铁	2018 年 6 月 6 日	重大事项	4.96	2018 年 8 月 7 日	4.46	10,300	79,146.86	51,088.00	-
600221	海航控股	2018 年 1 月 10 日	重大资产重组	3.23	2018 年 7 月 20 日	2.91	15,300	49,801.50	49,419.00	-
000793	华闻传媒	2018 年 2 月 1 日	重大资产重组	8.40	2018 年 7 月 16 日	7.56	5,700	61,464.35	47,880.00	-
000566	海南海药	2017 年 11 月 22 日	重大资产重组	12.89	2018 年 7 月 9 日	11.60	3,700	48,434.44	47,693.00	-
601390	中国中铁	2018 年 5 月 7 日	重大资产重组	7.47	-	-	5,800	43,210.00	43,326.00	-
300146	汤臣倍健	2018 年 1 月 31 日	重大资产重组	16.60	2018 年 7 月 31 日	16.50	2,500	30,623.48	41,500.00	-
002408	齐翔腾达	2018 年 6 月	重大	12.28	-	-	3,200	39,311.78	39,296.00	-

		月 19 日	资产重组							
002602	世纪华通	2018 年 6 月 12 日	重大资产重组	32.50	-	-	1,200	40,312.18	39,000.00	-
300266	兴源环境	2018 年 2 月 5 日	重大资产重组	19.99	2018 年 7 月 2 日	17.99	1,900	50,123.52	37,981.00	-
002573	清新环境	2018 年 6 月 19 日	重大事项	11.55	-	-	2,800	46,291.24	32,340.00	-
300090	盛运环保	2018 年 6 月 4 日	重大事项	8.32	2018 年 7 月 2 日	7.49	3,600	33,998.30	29,952.00	-
300197	铁汉生态	2018 年 5 月 28 日	重大资产重组	5.37	-	-	5,500	40,150.89	29,535.00	-
002665	首航节能	2018 年 5 月 29 日	重大资产重组	5.80	-	-	4,700	33,993.53	27,260.00	-
002716	金贵银业	2018 年 5 月 3 日	重大资产重组	16.84	-	-	1,600	32,958.47	26,944.00	-
002411	必康股份	2018 年 6 月	重大	28.34	-	-	900	24,202.13	25,506.00	-

		月 19 日	资产重组							
002431	棕榈股份	2018 年 5 月 30 日	重大事项	6.71	-	-	3,345	29,100.32	22,444.95	-
002477	雏鹰农牧	2018 年 6 月 14 日	重大事项	3.31	-	-	6,700	27,756.06	22,177.00	-
000723	美锦能源	2018 年 3 月 27 日	重大资产重组	5.43	2018 年 7 月 31 日	4.89	3,500	23,677.54	19,005.00	-
000564	供销大集	2017 年 11 月 28 日	重大资产重组	4.78	2018 年 7 月 20 日	4.29	2,100	13,589.86	10,038.00	-
000693	*ST 华泽	2018 年 5 月 2 日	重大事项	1.00	-	-	900	22,171.00	900.00	-

注：本基金截至 2018 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 2018 年 6 月 30 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 0.12%。

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。

于 2018 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。

6.4.13.3.1 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上市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 6.4.12。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。

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 2018 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	3,703,083.08	-	-	-	3,703,083.08
结算备付金	6,872.38	-	-	-	6,872.38

存出保证金	10,233.43	-	-	-	10,233.43
交易性金融资产	49,102.24	-	-	36,433,124.10	36,482,226.34
应收利息	-	-	-	747.35	747.35
应收申购款	-	-	-	26,268.91	26,268.91
资产总计	3,769,291.13	-	-	36,460,140.36	40,229,431.49
负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	558,461.30	558,461.30
应付赎回款	-	-	-	49,864.91	49,864.91
应付管理人报酬	-	-	-	33,646.67	33,646.67
应付托管费	-	-	-	5,047.00	5,047.00
应付交易费用	-	-	-	34,773.78	34,773.78
其他负债	-	-	-	124,001.49	124,001.49
负债总计	-	-	-	805,795.15	805,795.15
利率敏感度缺口	3,769,291.13	-	-	35,654,345.21	39,423,636.34
上年度末 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	3,855,663.44	-	-	-	3,855,663.44
结算备付金	7,665.81	-	-	-	7,665.81
存出保证金	2,256.28	-	-	-	2,256.28
交易性金融资产	-	-	48,117.71	48,379,833.67	48,427,951.38
应收利息	-	-	-	807.64	807.64
应收申购款	-	-	-	1,312,535.64	1,312,535.64
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,865,585.53	-	48,117.71	49,693,176.95	53,606,880.19
负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	1,174,461.70	1,174,461.70
应付赎回款	-	-	-	29,372.32	29,372.32
应付管理人报酬	-	-	-	42,217.01	42,217.01
应付托管费	-	-	-	6,332.56	6,332.56
应付交易费用	-	-	-	14,341.70	14,341.70
其他负债	-	-	-	94,563.21	94,563.21
负债总计	-	-	-	1,361,288.50	1,361,288.50
利率敏感度缺口	3,865,585.53	-	48,117.71	48,331,888.45	52,245,591.69

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 2018 年 6 月 30 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 0.12%。

因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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。

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 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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	36,433,124.10	92.41	48,379,833.67	92.60
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	49,102.24	0.12	48,117.71	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	36,482,226.34	92.54	48,427,951.38	92.69

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(2018年6月30日)	上年度末(2017年12月31日)
	业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%	1,650,000.00	2,170,000.00
	业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-1,650,000.00	-2,170,000.00

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 2018 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 33,861,596.37 元,属于第二层次的余额为 2,619,729.97 元,属于第三层次的余额为 900.00 元(2017 年 12 月 31 日:第一层次 46,334,916.35 元,第二层次 2,055,936.95 元,属于第三层次的余额为 37,098.08 元)。

(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 2018 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(2017 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	36,433,124.10	90.56
	其中：股票	36,433,124.10	90.56
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	49,102.24	0.12
	其中：债券	49,102.24	0.12
	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	3,709,955.46	9.22
8	其他各项资产	37,249.69	0.09
9	合计	40,229,431.49	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	768,654.88	1.95
B	采矿业	206,577.45	0.52
C	制造业	19,786,423.26	50.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	571,984.00	1.45
E	建筑业	452,767.81	1.15
F	批发和零售业	1,058,660.50	2.69
G	交通运输、仓储和邮政业	126,808.00	0.32
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,976,651.46	5.01

J	金融业	2,391,891.28	6.07
K	房地产业	2,119,329.55	5.38
L	租赁和商务服务业	555,145.04	1.41
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	187,793.67	0.48
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	577,587.80	1.47
R	文化、体育和娱乐业	1,089,560.00	2.76
S	综合	40,180.00	0.10
	合计	31,910,014.70	80.94

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	-	-
B	采掘业	247,587.00	0.63
C	制造业	1,042,054.40	2.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	533,693.00	1.35
E	建筑业	145,985.00	0.37
F	批发和零售业	293,569.00	0.74
G	交通运输、仓储和邮政业	372,028.00	0.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	66,264.00	0.17
J	金融业	1,516,614.00	3.85
K	房地产业	206,441.00	0.52
L	租赁和商务服务业	44,824.00	0.11
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	54,050.00	0.14
	合计	4,523,109.40	11.47

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	19,300	1,007,846.00	2.56
2	000651	格力电器	19,380	913,767.00	2.32
3	000858	五粮液	7,340	557,840.00	1.41
4	002415	海康威视	14,550	540,241.50	1.37
5	000002	万科 A	18,202	447,769.20	1.14
6	000001	平安银行	49,253	447,709.77	1.14
7	300498	温氏股份	20,180	444,363.60	1.13
8	300124	汇川技术	13,200	433,224.00	1.10
9	000725	京东方 A	121,600	430,464.00	1.09
10	000540	中天金融	74,700	363,789.00	0.92
11	300015	爱尔眼科	11,056	356,998.24	0.91
12	002024	苏宁易购	24,100	339,328.00	0.86
13	000963	华东医药	6,900	332,925.00	0.84
14	000166	申万宏源	76,011	332,168.07	0.84
15	002142	宁波银行	19,686	320,684.94	0.81
16	000876	新希望	48,908	310,076.72	0.79
17	300144	宋城演艺	12,900	303,150.00	0.77
18	300136	信维通信	9,800	301,154.00	0.76
19	000538	云南白药	2,804	299,915.84	0.76
20	002007	华兰生物	9,269	298,091.04	0.76
21	000157	中联重科	72,200	296,742.00	0.75
22	002304	洋河股份	2,146	282,413.60	0.72
23	000776	广发证券	21,200	281,324.00	0.71
24	000895	双汇发展	10,650	281,266.50	0.71
25	300003	乐普医疗	7,580	278,034.40	0.71
26	002422	科伦药业	8,600	276,060.00	0.70
27	300122	智飞生物	5,700	260,718.00	0.66
28	002027	分众传媒	26,632	254,868.24	0.65
29	300072	三聚环保	10,908	253,938.24	0.64
30	300296	利亚德	19,650	253,092.00	0.64
31	001979	招商蛇口	13,207	251,593.35	0.64
32	000625	长安汽车	27,200	244,800.00	0.62

33	002450	康得新	14,185	242,279.80	0.61
34	000661	长春高新	1,050	239,085.00	0.61
35	300408	三环集团	9,900	232,650.00	0.59
36	002465	海格通信	28,100	225,643.00	0.57
37	002294	信立泰	6,040	224,506.80	0.57
38	002739	万达电影	5,900	224,318.00	0.57
39	300168	万达信息	10,900	222,360.00	0.56
40	002008	大族激光	3,968	211,057.92	0.54
41	000423	东阿阿胶	3,900	209,859.00	0.53
42	000883	湖北能源	51,000	209,610.00	0.53
43	000415	渤海金控	35,400	206,736.00	0.52
44	002470	金正大	29,700	204,336.00	0.52
45	000100	TCL 集团	70,200	203,580.00	0.52
46	000069	华侨城 A	27,800	200,994.00	0.51
47	300059	东方财富	14,992	197,594.56	0.50
48	002475	立讯精密	8,750	197,225.00	0.50
49	002230	科大讯飞	6,100	195,627.00	0.50
50	002044	美年健康	8,620	194,812.00	0.49
51	002202	金风科技	15,370	194,276.80	0.49
52	002736	国信证券	21,000	191,100.00	0.48
53	000425	徐工机械	45,000	190,800.00	0.48
54	000783	长江证券	34,300	186,249.00	0.47
55	000338	潍柴动力	21,200	185,500.00	0.47
56	000729	燕京啤酒	27,500	185,075.00	0.47
57	002385	大北农	44,723	184,705.99	0.47
58	002399	海普瑞	8,300	183,762.00	0.47
59	000999	华润三九	6,600	183,678.00	0.47
60	002252	上海莱士	9,100	177,632.00	0.45
61	000568	泸州老窖	2,900	176,494.00	0.45
62	000686	东北证券	27,000	173,070.00	0.44
63	002004	华邦健康	33,800	171,704.00	0.44
64	002572	索菲亚	5,300	170,554.00	0.43
65	000979	中弘股份	167,400	169,074.00	0.43
66	002179	中航光电	4,300	167,700.00	0.43
67	002594	比亚迪	3,500	166,880.00	0.42
68	002223	鱼跃医疗	8,299	161,747.51	0.41
69	002236	大华股份	7,085	159,766.75	0.41
70	000623	吉林敖东	8,850	159,123.00	0.40
71	002456	欧菲科技	9,730	156,944.90	0.40

72	000961	中南建设	24,800	156,488.00	0.40
73	300182	捷成股份	20,500	155,390.00	0.39
74	000598	兴蓉环境	38,100	154,686.00	0.39
75	000046	泛海控股	26,600	151,354.00	0.38
76	002311	海大集团	7,100	149,810.00	0.38
77	002466	天齐锂业	3,017	149,613.03	0.38
78	000630	铜陵有色	66,900	147,849.00	0.38
79	300315	掌趣科技	34,870	145,756.60	0.37
80	002013	中航机电	19,075	144,397.75	0.37
81	002491	通鼎互联	13,000	143,910.00	0.37
82	002701	奥瑞金	26,200	143,052.00	0.36
83	000998	隆平高科	7,500	141,450.00	0.36
84	000027	深圳能源	28,600	141,284.00	0.36
85	002506	协鑫集成	30,100	140,868.00	0.36
86	000750	国海证券	39,400	140,658.00	0.36
87	002610	爱康科技	66,000	138,600.00	0.35
88	000031	中粮地产	23,900	138,142.00	0.35
89	000581	威孚高科	6,042	133,588.62	0.34
90	000028	国药一致	2,675	133,482.50	0.34
91	000887	中鼎股份	9,200	132,572.00	0.34
92	000078	海王生物	27,500	132,275.00	0.34
93	002138	顺络电子	8,200	131,282.00	0.33
94	300027	华谊兄弟	20,000	123,200.00	0.31
95	002426	胜利精密	34,100	122,760.00	0.31
96	002460	赣锋锂业	3,150	121,527.00	0.31
97	002191	劲嘉股份	16,200	121,014.00	0.31
98	000559	万向钱潮	17,578	119,530.40	0.30
99	000718	苏宁环球	31,700	116,339.00	0.30
100	300274	阳光电源	12,900	115,713.00	0.29
101	002444	巨星科技	10,400	114,504.00	0.29
102	000988	华工科技	7,900	114,155.00	0.29
103	002152	广电运通	19,195	112,866.60	0.29
104	002010	传化智联	8,901	108,147.15	0.27
105	002085	万丰奥威	11,380	106,972.00	0.27
106	000503	国新健康	3,300	104,874.00	0.27
107	000825	太钢不锈	16,800	100,800.00	0.26
108	002241	歌尔股份	9,798	99,841.62	0.25
109	002501	利源精制	16,100	99,820.00	0.25
110	000413	东旭光电	16,200	98,172.00	0.25

111	300142	沃森生物	4,900	97,902.00	0.25
112	002155	湖南黄金	14,300	97,812.00	0.25
113	300159	新研股份	13,600	96,288.00	0.24
114	300024	机器人	5,300	92,220.00	0.23
115	300291	华录百纳	12,800	90,240.00	0.23
116	300070	碧水源	6,319	88,023.67	0.22
117	002310	东方园林	5,850	87,925.50	0.22
118	000768	中航飞机	5,400	84,456.00	0.21
119	000400	许继电气	10,770	84,113.70	0.21
120	002468	申通快递	4,800	82,320.00	0.21
121	000977	浪潮信息	3,320	79,182.00	0.20
122	002410	广联达	2,800	77,644.00	0.20
123	000830	鲁西化工	4,500	76,860.00	0.19
124	002340	格林美	12,602	76,242.10	0.19
125	002129	中环股份	9,451	74,001.33	0.19
126	300017	网宿科技	6,808	72,913.68	0.18
127	000786	北新建材	3,776	69,969.28	0.18
128	000592	平潭发展	24,292	68,989.28	0.17
129	002050	三花智控	3,600	67,860.00	0.17
130	002405	四维图新	3,332	67,473.00	0.17
131	002271	东方雨虹	3,910	66,509.10	0.17
132	000792	盐湖股份	6,100	66,002.00	0.17
133	002797	第一创业	9,300	62,961.00	0.16
134	002146	荣盛发展	7,200	62,856.00	0.16
135	000806	银河生物	14,400	62,352.00	0.16
136	002714	牧原股份	1,400	62,244.00	0.16
137	000728	国元证券	8,400	62,160.00	0.16
138	002001	新和成	3,264	61,885.44	0.16
139	300383	光环新网	4,600	61,686.00	0.16
140	002065	东华软件	7,120	61,232.00	0.16
141	002673	西部证券	8,090	61,079.50	0.15
142	002038	双鹭药业	1,600	60,784.00	0.15
143	002092	中泰化学	6,290	60,635.60	0.15
144	002081	金螳螂	5,800	58,580.00	0.15
145	000401	冀东水泥	6,400	56,768.00	0.14
146	000709	河钢股份	19,100	56,345.00	0.14
147	002051	中工国际	3,668	56,010.36	0.14
148	002508	老板电器	1,820	55,728.40	0.14
149	000050	深天马 A	3,900	55,458.00	0.14

150	002078	太阳纸业	5,700	55,233.00	0.14
151	000656	金科股份	11,400	54,720.00	0.14
152	300450	先导智能	1,797	54,341.28	0.14
153	000839	中信国安	11,450	54,158.50	0.14
154	300253	卫宁健康	4,303	53,314.17	0.14
155	300088	长信科技	9,000	52,200.00	0.13
156	002589	瑞康医药	3,800	51,832.00	0.13
157	000488	晨鸣纸业	4,000	51,680.00	0.13
158	000008	神州高铁	10,300	51,088.00	0.13
159	002493	荣盛石化	4,950	51,084.00	0.13
160	000066	中国长城	7,168	50,964.48	0.13
161	000690	宝新能源	7,300	50,808.00	0.13
162	002176	江特电机	5,100	49,572.00	0.13
163	002019	亿帆医药	2,800	49,420.00	0.13
164	000983	西山煤电	6,495	48,777.45	0.12
165	002049	紫光国微	1,100	48,532.00	0.12
166	300166	东方国信	3,260	48,019.80	0.12
167	000060	中金岭南	9,862	47,929.32	0.12
168	000793	华闻传媒	5,700	47,880.00	0.12
169	002217	合力泰	5,800	47,850.00	0.12
170	002601	龙麟佰利	3,700	47,841.00	0.12
171	002439	启明星辰	2,200	46,684.00	0.12
172	000039	中集集团	3,500	46,480.00	0.12
173	300433	蓝思科技	2,200	46,156.00	0.12
174	002500	山西证券	6,800	45,832.00	0.12
175	000997	新大陆	2,900	45,675.00	0.12
176	002640	跨境通	3,000	45,060.00	0.11
177	002195	二三四五	10,379	44,422.12	0.11
178	000671	阳光城	7,400	44,178.00	0.11
179	300251	光线传媒	4,300	43,774.00	0.11
180	002074	国轩高科	3,100	43,586.00	0.11
181	002624	完美世界	1,400	43,414.00	0.11
182	000156	华数传媒	4,500	43,380.00	0.11
183	002183	怡亚通	6,300	41,895.00	0.11
184	000402	金融街	5,200	41,860.00	0.11
185	300146	汤臣倍健	2,500	41,500.00	0.11
186	002153	石基信息	1,400	40,600.00	0.10
187	002558	巨人网络	1,700	40,426.00	0.10
188	000009	中国宝安	8,200	40,180.00	0.10

189	000778	新兴铸管	9,300	39,804.00	0.10
190	002408	齐翔腾达	3,200	39,296.00	0.10
191	002602	世纪华通	1,200	39,000.00	0.10
192	000930	中粮生化	3,700	38,110.00	0.10
193	300266	兴源环境	1,900	37,981.00	0.10
194	300418	昆仑万维	2,000	37,760.00	0.10
195	002273	水晶光电	2,920	37,580.40	0.10
196	000938	紫光股份	600	37,560.00	0.10
197	300073	当升科技	1,100	37,466.00	0.10
198	000960	锡业股份	3,100	37,231.00	0.09
199	002185	华天科技	6,600	37,224.00	0.09
200	300014	亿纬锂能	2,096	36,889.60	0.09
201	000547	航天发展	4,700	36,707.00	0.09
202	000970	中科三环	3,888	36,352.80	0.09
203	002352	顺丰控股	800	36,000.00	0.09
204	002497	雅化集团	3,400	35,836.00	0.09
205	002280	联络互动	6,200	35,464.00	0.09
206	002407	多氟多	2,500	35,050.00	0.09
207	300115	长盈精密	2,700	35,019.00	0.09
208	002168	深圳惠程	3,300	33,924.00	0.09
209	002030	达安基因	2,200	33,924.00	0.09
210	000807	云铝股份	6,400	33,152.00	0.08
211	002268	卫士通	1,500	32,745.00	0.08
212	002353	杰瑞股份	2,000	32,500.00	0.08
213	000878	云南铜业	3,400	32,436.00	0.08
214	002573	清新环境	2,800	32,340.00	0.08
215	000627	天茂集团	4,600	32,292.00	0.08
216	300055	万邦达	2,800	32,172.00	0.08
217	300133	华策影视	3,000	31,950.00	0.08
218	002583	海能达	3,800	31,730.00	0.08
219	000717	韶钢松山	4,800	31,488.00	0.08
220	300113	顺网科技	1,800	31,338.00	0.08
221	000898	鞍钢股份	5,600	31,192.00	0.08
222	300033	同花顺	800	31,096.00	0.08
223	000059	华锦股份	4,500	31,005.00	0.08
224	300058	蓝色光标	5,315	30,295.50	0.08
225	002831	裕同科技	600	30,000.00	0.08
226	300090	盛运环保	3,600	29,952.00	0.08
227	000917	电广传媒	5,200	29,952.00	0.08

228	300197	铁汉生态	5,500	29,535.00	0.07
229	002285	世联行	4,700	29,469.00	0.07
230	300355	蒙草生态	4,900	29,449.00	0.07
231	002299	圣农发展	1,900	29,431.00	0.07
232	002384	东山精密	1,200	28,800.00	0.07
233	002131	利欧股份	13,690	28,749.00	0.07
234	002108	沧州明珠	4,688	27,518.56	0.07
235	300367	东方网力	2,200	27,500.00	0.07
236	002665	首航节能	4,700	27,260.00	0.07
237	002366	台海核电	1,900	27,094.00	0.07
238	300207	欣旺达	3,000	27,030.00	0.07
239	002709	天赐材料	700	26,978.00	0.07
240	002716	金贵银业	1,600	26,944.00	0.07
241	000800	一汽轿车	3,600	26,928.00	0.07
242	000738	航发控制	2,000	26,660.00	0.07
243	300628	亿联网络	400	26,364.00	0.07
244	002343	慈文传媒	1,400	26,278.00	0.07
245	300244	迪安诊断	1,356	25,777.56	0.07
246	002411	必康股份	900	25,506.00	0.06
247	300459	金科文化	2,600	25,116.00	0.06
248	002056	横店东磁	3,500	24,535.00	0.06
249	000012	南玻 A	4,939	24,448.05	0.06
250	000758	中色股份	5,400	24,300.00	0.06
251	000933	神火股份	5,000	24,050.00	0.06
252	000006	深振业 A	4,100	24,026.00	0.06
253	300496	中科创达	800	23,576.00	0.06
254	000036	华联控股	3,900	23,166.00	0.06
255	002431	棕榈股份	3,345	22,444.95	0.06
256	002477	雏鹰农牧	6,700	22,177.00	0.06
257	002389	南洋科技	1,600	21,664.00	0.05
258	300068	南都电源	1,800	21,564.00	0.05
259	000563	陕国投 A	6,300	21,420.00	0.05
260	002400	省广集团	6,610	21,350.30	0.05
261	000712	锦龙股份	2,100	20,958.00	0.05
262	002635	安洁科技	1,200	20,640.00	0.05
263	300002	神州泰岳	4,939	20,595.63	0.05
264	002292	奥飞娱乐	2,300	20,539.00	0.05
265	300222	科大智能	1,100	20,394.00	0.05
266	300077	国民技术	1,800	20,016.00	0.05

267	000937	冀中能源	4,700	19,317.00	0.05
268	300001	特锐德	1,700	19,312.00	0.05
269	000723	美锦能源	3,500	19,005.00	0.05
270	000877	天山股份	2,800	18,900.00	0.05
271	000901	航天科技	1,800	18,036.00	0.05
272	000158	常山北明	2,600	17,862.00	0.05
273	300020	银江股份	1,800	17,118.00	0.04
274	002555	三七互娱	1,400	17,010.00	0.04
275	300085	银之杰	1,300	16,874.00	0.04
276	002643	万润股份	2,200	16,434.00	0.04
277	000762	西藏矿业	1,700	16,371.00	0.04
278	000687	华讯方舟	1,700	15,657.00	0.04
279	002642	荣之联	1,700	15,623.00	0.04
280	000600	建投能源	2,800	15,596.00	0.04
281	002002	鸿达兴业	3,300	15,213.00	0.04
282	002276	万马股份	2,600	15,184.00	0.04
283	300431	暴风集团	980	14,876.40	0.04
284	000062	深圳华强	700	13,720.00	0.03
285	000959	首钢股份	3,300	13,563.00	0.03
286	002302	西部建设	1,200	12,924.00	0.03
287	300134	大富科技	1,311	11,720.34	0.03
288	000564	供销大集	2,100	10,038.00	0.03
289	002542	中化岩土	1,800	9,612.00	0.02
290	002120	韵达股份	160	8,488.00	0.02
291	000617	中油资本	600	6,744.00	0.02
292	002839	张家港行	900	5,481.00	0.01

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	600900	长江电力	5,800	93,612.00	0.24
2	601288	农业银行	26,600	91,504.00	0.23
3	600023	浙能电力	19,300	89,938.00	0.23
4	600436	片仔癀	800	89,544.00	0.23
5	600276	恒瑞医药	1,170	88,639.20	0.22
6	601988	中国银行	23,900	86,279.00	0.22
7	600674	川投能源	9,500	82,840.00	0.21

8	600886	国投电力	11,000	79,970.00	0.20
9	601818	光大银行	21,500	78,690.00	0.20
10	601857	中国石油	10,200	78,642.00	0.20
11	601328	交通银行	13,600	78,064.00	0.20
12	600518	康美药业	3,400	77,792.00	0.20
13	600016	民生银行	10,700	74,900.00	0.19
14	601166	兴业银行	5,200	74,880.00	0.19
15	600519	贵州茅台	100	73,146.00	0.19
16	600028	中国石化	11,100	72,039.00	0.18
17	601398	工商银行	13,500	71,820.00	0.18
18	601985	中国核电	12,500	70,625.00	0.18
19	600011	华能国际	11,100	70,596.00	0.18
20	600177	雅戈尔	9,000	69,300.00	0.18
21	600535	天士力	2,660	68,681.20	0.17
22	600271	航天信息	2,700	68,229.00	0.17
23	600637	东方明珠	4,400	66,264.00	0.17
24	601169	北京银行	10,900	65,727.00	0.17
25	600352	浙江龙盛	5,500	65,725.00	0.17
26	600085	同仁堂	1,800	63,504.00	0.16
27	601607	上海医药	2,600	62,140.00	0.16
28	600688	上海石化	10,900	62,021.00	0.16
29	300413	快乐购	1,600	60,704.00	0.15
30	600104	上汽集团	1,700	59,483.00	0.15
31	601006	大秦铁路	7,200	59,112.00	0.15
32	601229	上海银行	3,700	58,312.00	0.15
33	600170	上海建工	18,800	57,152.00	0.14
34	601998	中信银行	9,000	55,890.00	0.14
35	600015	华夏银行	7,500	55,875.00	0.14
36	601788	光大证券	5,000	54,900.00	0.14
37	600895	张江高科	4,700	54,050.00	0.14
38	600837	海通证券	5,700	53,979.00	0.14
39	600690	青岛海尔	2,800	53,928.00	0.14
40	600157	永泰能源	30,000	53,400.00	0.14
41	600332	白云山	1,400	53,270.00	0.14
42	601009	南京银行	6,700	51,791.00	0.13
43	600115	东方航空	7,800	51,636.00	0.13
44	600000	浦发银行	5,300	50,668.00	0.13
45	600705	中航资本	10,700	49,969.00	0.13
46	600309	万华化学	1,100	49,962.00	0.13

47	600221	海航控股	15,300	49,419.00	0.13
48	600919	江苏银行	7,700	49,357.00	0.13
49	600061	国投资本	5,300	49,184.00	0.12
50	600606	绿地控股	7,500	49,050.00	0.12
51	000566	海南海药	3,700	47,693.00	0.12
52	601198	东兴证券	3,600	46,944.00	0.12
53	601318	中国平安	800	46,864.00	0.12
54	600795	国电电力	17,600	46,112.00	0.12
55	601211	国泰君安	3,100	45,694.00	0.12
56	601021	春秋航空	1,300	45,539.00	0.12
57	600820	隧道股份	7,700	45,507.00	0.12
58	600208	新潮中宝	11,900	45,458.00	0.12
59	600036	招商银行	1,700	44,948.00	0.11
60	600415	小商品城	10,400	44,824.00	0.11
61	600066	宇通客车	2,300	44,137.00	0.11
62	600153	建发股份	4,900	44,051.00	0.11
63	600739	辽宁成大	2,900	44,022.00	0.11
64	600297	广汇汽车	7,500	43,950.00	0.11
65	600999	招商证券	3,200	43,776.00	0.11
66	601390	中国中铁	5,800	43,326.00	0.11
67	600663	陆家嘴	2,700	42,633.00	0.11
68	600583	海油工程	8,100	42,606.00	0.11
69	601872	招商轮船	11,600	41,876.00	0.11
70	601111	中国国航	4,700	41,783.00	0.11
71	600029	南方航空	4,900	41,405.00	0.11
72	601018	宁波港	9,800	41,258.00	0.10
73	600118	中国卫星	2,100	40,110.00	0.10
74	600704	物产中大	7,400	38,702.00	0.10
75	601601	中国太保	1,200	38,220.00	0.10
76	601766	中国中车	4,700	36,190.00	0.09
77	601555	东吴证券	5,100	34,833.00	0.09
78	600109	国金证券	4,700	33,417.00	0.08
79	600958	东方证券	3,300	30,129.00	0.08
80	000693	*ST 华泽	900	900.00	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	300059	东方财富	552,082.00	1.06
2	300124	汇川技术	486,460.00	0.93
3	300136	信维通信	474,131.00	0.91
4	300072	三聚环保	422,023.00	0.81
5	000895	双汇发展	416,270.00	0.80
6	300408	三环集团	374,490.00	0.72
7	300142	沃森生物	359,072.00	0.69
8	300015	爱尔眼科	353,763.00	0.68
9	300003	乐普医疗	352,507.00	0.67
10	300070	碧水源	347,289.00	0.66
11	601988	中国银行	330,860.00	0.63
12	300144	宋城演艺	328,383.00	0.63
13	601398	工商银行	323,285.00	0.62
14	300355	蒙草生态	315,657.00	0.60
15	300027	华谊兄弟	306,817.00	0.59
16	300024	机器人	302,553.40	0.58
17	000876	新希望	281,305.00	0.54
18	300017	网宿科技	280,018.00	0.54
19	300433	蓝思科技	278,152.00	0.53
20	300274	阳光电源	275,316.00	0.53

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	000333	美的集团	1,548,435.00	2.96
2	000651	格力电器	1,354,468.00	2.59
3	000858	五粮液	1,107,882.00	2.12
4	000002	万科 A	805,436.00	1.54
5	000725	京东方 A	799,272.00	1.53

6	300059	东方财富	796,956.00	1.53
7	002415	海康威视	662,737.75	1.27
8	000001	平安银行	506,113.00	0.97
9	000063	中兴通讯	503,913.00	0.96
10	300070	碧水源	469,902.00	0.90
11	300498	温氏股份	446,597.96	0.85
12	300024	机器人	424,612.08	0.81
13	300017	网宿科技	387,407.00	0.74
14	002230	科大讯飞	383,866.00	0.73
15	300136	信维通信	379,063.00	0.73
16	002304	洋河股份	372,090.00	0.71
17	000895	双汇发展	364,847.00	0.70
18	300408	三环集团	358,560.00	0.69
19	300072	三聚环保	351,912.00	0.67
20	601318	中国平安	335,386.00	0.64

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

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	41,356,794.86
卖出股票收入（成交）总额	47,333,878.25

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

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）	49,102.24	0.12
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	49,102.24	0.12

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

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	128024	宁行转债	378	39,542.58	0.10
2	128020	水晶转债	39	3,582.15	0.01
3	123003	蓝思转债	37	3,421.39	0.01
4	123004	铁汉转债	28	2,556.12	0.01

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

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

7.12.2

本基金投资的前十名股票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	10,233.43
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	747.35
5	应收申购款	26,268.91
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	37,249.69

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	------	--------------

1	128024	宁行转债	39,542.58	0.10
2	128020	水晶转债	3,582.15	0.01
3	123003	蓝思转债	3,421.39	0.01
4	123004	铁汉转债	2,556.12	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000540	中天金融	363,789.00	0.92	重大资产重组

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
2,214	13,145.44	148,517.85	0.51%	28,955,485.86	99.49%

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	0.00	0.0000%

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	32,789,313.45
本报告期基金总申购份额	9,441,245.32
减:本报告期基金总赎回份额	13,126,555.06
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	29,104,003.71

§ 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，基金管理人的重大人事变动如下：

2018 年 4 月 9 日，李锦女士离任基金管理人督察长，现任基金管理人副总经理。2018 年 4 月 9 日起，陈竽女士任职基金管理人督察长。基金管理人于 2018 年 4 月 10 日公告了上述事项。

2018 年 4 月 13 日，高见先生由于个人原因辞职，离任基金管理人副总经理。基金管理人于 2018 年 4 月 14 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

1、本报告期内基金管理人收到《深圳证监局关于对摩根士丹利华鑫基金管理有限公司采取责令整改并暂停办理相关业务措施的决定》，责令公司进行整改，整改期间暂停受理公司公募基金产品注册申请。公司高度重视，制定并落实相关整改措施，并及时向深圳证监局提交整改报告。

2、本报告期基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	1	55,131,667.93	62.16%	51,344.62	62.16%	-
长江证券	2	18,538,823.33	20.90%	17,265.43	20.90%	-
中泰证券	1	14,950,232.85	16.86%	13,923.29	16.86%	-
民生证券	1	69,949.00	0.08%	65.18	0.08%	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	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	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中信证券（山东）	2	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-

光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
九州证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 专用交易单元的选择标准

- (1) 实力雄厚，信誉良好；
 - (2) 财务状况良好，经营行为规范；
 - (3) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
 - (4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需
要，并能为本基金提供全面的信息服务；
 - (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：开源证券、西部证券、中信建投证券交易单元各 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

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。

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	本公司关于旗下部分基金在上海利得基金销售有限公司开通基金	《上海证券报》	2018 年 1 月 9 日

	转换业务的公告		
2	本公司关于旗下基金调整停牌股票“光环新网”估值方法的公告	《上海证券报》	2018 年 1 月 16 日
3	本基金 2017 年 4 季度报告	《上海证券报》	2018 年 1 月 22 日
4	本公司关于旗下基金调整停牌股票中粮地产估值方法的公告	《上海证券报》	2018 年 1 月 24 日
5	本公司关于旗下部分基金在招商证券股份有限公司开通基金转换业务的公告	《上海证券报》	2018 年 2 月 2 日
6	本公司关于旗下基金调整流通受限股票估值方法的公告	《上海证券报》	2018 年 2 月 6 日
7	本公司关于旗下基金参与北京展恒基金销售股份有限公司费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2018 年 2 月 8 日
8	本公司关于旗下基金调整停牌股票“*ST 华泽”估值方法的公告	《上海证券报》	2018 年 2 月 24 日
9	本公司关于旗下部分基金在方正证券股份有限公司、中国民族证券有限责任公司开通基金定期定额投资业务并参与定期定额投资申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2018 年 3 月 2 日
10	本公司关于旗下部分基金在上海利得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额投资申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2018 年 3 月 13 日
11	本公司关于调整旗下部分开放式基金赎回费的公告	《上海证券报》	2018 年 3 月 24 日
12	本公司关于修订旗下基金基金合同、托管协议条款的公告	《上海证券报》	2018 年 3 月 24 日
13	本基金 2017 年年度报告	《上海证券报》	2018 年 3 月 29 日
14	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》	2018 年 3 月 31 日
15	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》	2018 年 3 月 31 日
16	本公司关于旗下基金增加上海挖财基金销售有限公司为销售机构的公告	《上海证券报》	2018 年 4 月 4 日
17	本公司关于旗下基金参与上海挖财基金销售有限公司费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2018 年 4 月 4 日
18	本公司高级管理人员变更公告	《上海证券报》	2018 年 4 月 10 日

19	本公司高级管理人员变更公告	《上海证券报》	2018 年 4 月 14 日
20	本公司关于旗下基金调整停牌股票“中兴通讯”估值方法的公告	《上海证券报》	2018 年 4 月 19 日
21	本基金 2018 年 1 季度报告	《上海证券报》	2018 年 4 月 21 日
22	本公司关于旗下基金调整停牌股票万达电影估值方法的公告	《上海证券报》	2018 年 4 月 21 日
23	本公司关于旗下基金增加上海基煜基金销售有限公司为销售机构并参与费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2018 年 4 月 23 日
24	本公司关于旗下基金参与北京恒天明泽基金销售有限公司费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2018 年 4 月 27 日
25	本公司关于旗下基金增加北京蛋卷基金销售有限公司为销售机构并参与费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2018 年 5 月 10 日
26	本基金基金经理变更公告	《上海证券报》	2018 年 5 月 22 日
27	本公司关于旗下基金参与中国银河证券股份有限公司费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2018 年 5 月 31 日
28	本基金基金经理变更公告	《上海证券报》	2018 年 6 月 13 日
29	本公司关于旗下基金调整中兴通讯估值方法的公告	《上海证券报》	2018 年 6 月 20 日
30	本基金招募说明书（更新）（2018 年第 1 号）	《上海证券报》	2018 年 6 月 27 日
31	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》	2018 年 6 月 29 日

§ 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

2018 年 8 月 27 日