

摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资 基金 2016 年半年度报告

2016 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 25 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 2016 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	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 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	13
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.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	34
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.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
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.....	46
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.....	46
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.....	46
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.....	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.12 投资组合报告附注.....	47

§8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
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.....	48
§9 开放式基金份额变动	48
§10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
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.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
10.4 基金投资策略的改变.....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	49
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.....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
10.8 其他重大事件.....	51
§11 备查文件目录	53
11.1 备查文件目录.....	53
11.2 存放地点.....	53
11.3 查阅方式.....	53

§ 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配置混合型证券投资基金
基金简称	大摩量化配置混合
基金主代码	233015
交易代码	233015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 12 月 11 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	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,133,326,447.10 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化模型，优化资产配置权重，力争在降低组合风险的同时，获得超越比较基准的超额收益。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>资产配置采取“自上而下”的多因素分析决策支持，结合定性分析和定量分析，确定中长期的资产配置方案。</p> <p>2、行业配置策略</p> <p>本基金通过量化方法分析各个行业的股价表现与宏观经济、产业链指标之间的关系，并结合各行业的估值水平、一致预期、盈利水平、动量反转等指标，获得各行业的预期收益率，并运用 BL 模型对行业配置权重进行优化。</p> <p>3、股票配置策略</p> <p>在行业内选股策略上，本基金采用量化模型的方法进行选股。量化选股模型包括但不限于以下两种：一种是持有行业内若干权重股，并优化其在基金中的权重以拟合行业平均收益；另一种是通过量化多因子选股模型挑选优势个股。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+标普中国债券指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期收益和风险高于货币型基金、债券型基金，而低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险、中高收益品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		摩根士丹利华鑫基金管理有 限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李锦	林葛
	联系电话	(0755) 88318883	(010) 66060069
	电子邮箱	xxpl@msfunds.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-8888-668	95599
传真		(0755) 82990384	(010) 63201816
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	北京市东城区建国门内大街 69 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	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518048	100031
法定代表人		YU HUA(于华)	周慕冰

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	摩根士丹利华鑫基金管理有限公司	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建 设广场第二座第 17 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-212,753,454.12
本期利润	-370,764,807.06
加权平均基金份额本期利润	-0.2797
本期加权平均净值利润率	-15.15%
本期基金份额净值增长率	-10.85%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)

期末可供分配利润	668,238,877.66
期末可供分配基金份额利润	0.5896
期末基金资产净值	2,187,899,517.54
期末基金份额净值	1.931
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	93.10%

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。

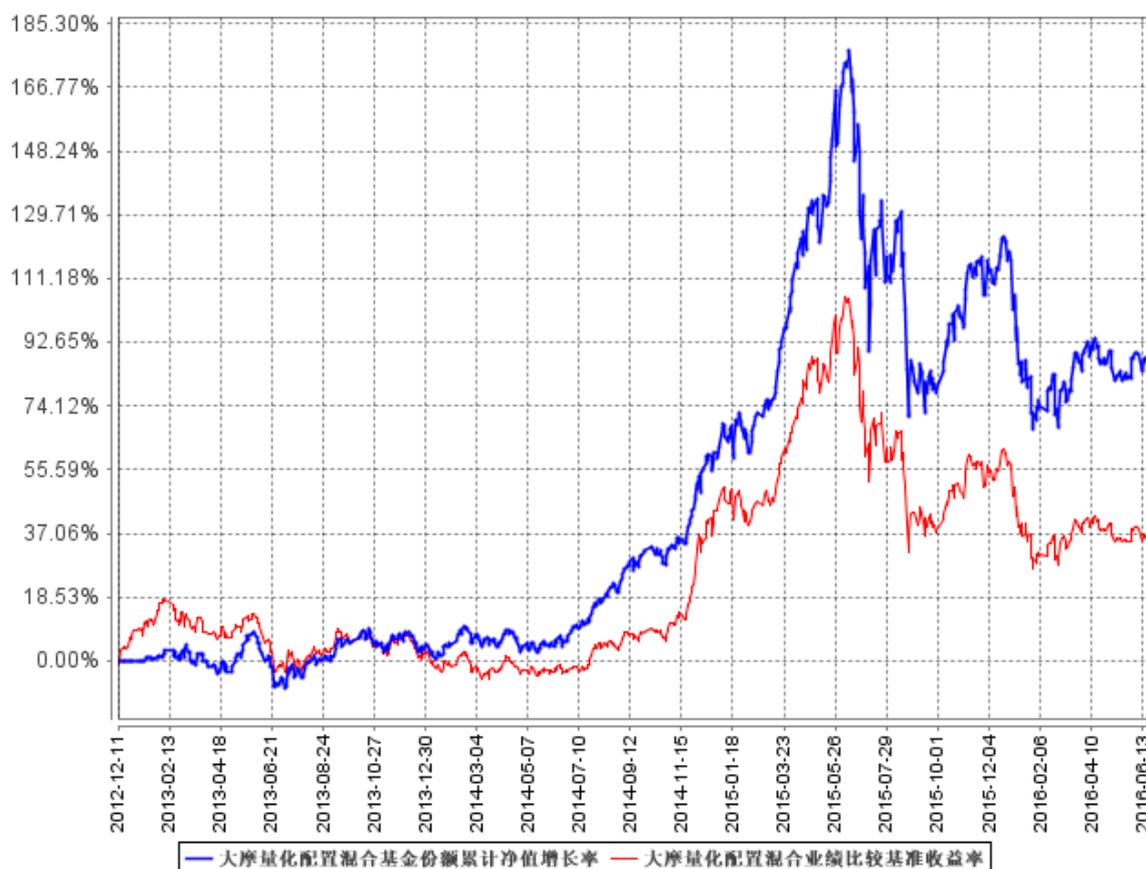
3.2 基金净值表现

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	2.82%	0.92%	-0.26%	0.79%	3.08%	0.13%
过去三个月	1.79%	1.00%	-1.50%	0.81%	3.29%	0.19%
过去六个月	-10.85%	1.81%	-12.02%	1.48%	1.17%	0.33%
过去一年	-18.00%	2.32%	-22.65%	1.84%	4.65%	0.48%
过去三年	107.41%	1.71%	40.45%	1.47%	66.96%	0.24%
自基金合同生效起至今	93.10%	1.62%	38.06%	1.44%	55.04%	0.18%

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

大摩量化配置混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止2016年6月30日，公司旗下共管理二十三只开放式基金，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、摩根士丹利华鑫多元收益 18 个月定期开放债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫沪港深新价值灵活配置混合型证券投资基金、摩根士丹利华鑫纯债稳定增值 18 个月定期开放债券型证券投资基金和摩根士丹利华鑫健康产业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		
杨雨龙	基金经理	2015 年 6 月 26 日	-	7	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，历任量化投资部投资经理，2015 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及本基金基金经理，2015 年 7 月起任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。
吴国雄	基金经理	2016 年 6 月 3 日	-	9	金融风险管理师（FRM），香港科技大学金融数学与统计专业硕士，曾任职于安信证券股份有限公司风险管理部。2013 年 5 月加入本公司，历任风险管理部风险管理经理、量化

					投资部基金经理助理、数量化投资部投资经理。2016年6月起任本基金基金经理，2016年7月起任摩根士丹利华鑫深证300指数增强型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、基金经理的任职日期为根据本公司决定确定的聘任日期；

2、基金经理任职已按规定在中国证券投资基金业协会办理完毕基金经理注册；

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金管理人所有投资组合参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况有14次，为量化投资基金因执行投资策略与其他组合发生的反向交易。基金管理人未发现其他异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年上半年，A股各大指数均呈现“L”型走势。一月份，在诸多利空消息的笼罩下，市场再次对高估值股票进行集中抛售，A股承压大跌。春节过后，在货币宽松的预期下，市场启动了

一轮反弹行情，上证综指一度逼近 3100 点；及后受美联储加息议程开启、英国脱欧公投等利空消息影响，又回落到 3000 点以下。

本基金坚持执行量化投资策略，在一月份市场大幅波动期间利用量化配置模型优化持股结构，并于一月底将仓位适当提高；二月份之后，基于市场可能演绎区间震荡行情的判断，我们在市场低迷时适当提高仓位，在市场上涨过程中逐步获利了结，因此在报告期内取得了一定的超额收益。

国内经济方面，7 月 15 日，统计局发布 2016 年二季度 GDP，数据显示为 6.7%，与一季度持平。6 月份中国制造业采购经理指数（PMI）为 50.0%，位于临界点。上述数据显示，中国经济正在“由落转稳”。政府稳增长、城镇化、简政放权以及供给侧改革等政策所带来的效果于二季度逐渐显现：经济运行平稳，工业生产有所回稳，第三产业稳健增长，“稳”成为上半年经济的重要特征。

国际经济方面，欧洲伊斯兰化引发了难民潮涌入、英国脱欧、土耳其政变等负面事件，在一定程度上对欧洲经济造成冲击，欧洲经济前景或难言乐观。美国经济数据也低于预期，市场对美联储年内加息的预期也因此有所降低。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期截至 2016 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.931 元，累计份额净值为 1.931 元，基金份额净值增长率为-10.85%，同期业绩比较基准收益率为-12.02%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在国际重大宏观事件冲击暂告一段落的背景下，下半年的焦点将集中在国内经济。从近期决策层讲话中可以看出，政府有信心和能力应对今年经济挑战，也决心力保实现全年增速目标。经济稳定增长、供给侧改革、经济结构转型升级、新旧动能转换、落实“三去一降一补”将是下半年的重点任务

部分经济学家认为，三季度之后，全方面稳增长力度将进一步加大，政府将加快下达预算内投资和专项建设基金项目，推进新型城镇化、城乡交通网络、地下管廊、水利工程等建设。基础设施建设投资进一步加码，将带动投资领域迎来增长，从而拉动经济平稳增长。

总体来看，下半年 A 股市场将继续扮演国内经济晴雨表的角色，或仍将持续演绎指数区间震荡、个股表现迥异的结构化行情。本基金将会持续关注受益于稳增长和供给侧改革的价值股。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

基金管理人旗下基金持有的资产按规定以公允价值进行估值。对于相关品种，特别是长期停牌股票等没有市价的投资品种，基金管理人根据中国证监会发布的《关于进一步规范证券投资

基金估值业务的指导意见》的要求进行估值，具体采用的估值政策和程序说明如下：

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 4 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 25%。

根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，本报告期内，本基金未进行利润分配。

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

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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—摩根士丹利华鑫基金管理有限公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，摩根士丹利华鑫基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，摩根士丹利华鑫基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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：摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	240,287,490.23	421,453,674.66
结算备付金		6,313,759.68	13,392,952.67
存出保证金		599,102.30	2,669,604.85
交易性金融资产	6.4.7.2	1,980,149,902.85	2,781,333,096.56
其中：股票投资		1,980,149,902.85	2,781,333,096.56
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	58,458.71	114,258.21
应收股利		104.25	104.25
应收申购款		441,527.28	6,830,842.23
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-

资产总计		2, 227, 850, 345. 30	3, 225, 794, 533. 43
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		25, 531, 948. 27	45. 74
应付赎回款		6, 678, 397. 14	187, 454, 316. 45
应付管理人报酬		2, 648, 842. 15	3, 953, 011. 00
应付托管费		441, 473. 69	658, 835. 20
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	4, 289, 841. 21	3, 953, 708. 54
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	360, 325. 30	830, 061. 93
负债合计		39, 950, 827. 76	196, 849, 978. 86
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	1, 133, 326, 447. 10	1, 398, 653, 196. 48
未分配利润	6.4.7.10	1, 054, 573, 070. 44	1, 630, 291, 358. 09
所有者权益合计		2, 187, 899, 517. 54	3, 028, 944, 554. 57
负债和所有者权益总计		2, 227, 850, 345. 30	3, 225, 794, 533. 43

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.931 元，基金份额总额 1,133,326,447.10 份。

6.2 利润表

会计主体：摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-337, 986, 961. 31	1, 129, 555, 818. 66
1.利息收入		1, 465, 719. 12	3, 335, 938. 34
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1, 465, 719. 12	1, 139, 986. 37
债券利息收入		-	1, 699, 774. 43
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	496, 177. 54
其他利息收入		-	-

2.投资收益（损失以“-”填列）		-182,146,214.73	1,424,992,184.11
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-200,412,562.13	1,397,860,990.49
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-81,504.00
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	18,266,347.40	27,212,697.62
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-158,011,352.94	-306,181,056.21
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	704,887.24	7,408,752.42
减：二、费用		32,777,845.75	63,327,875.50
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	18,298,587.70	22,287,789.91
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,049,764.65	3,714,631.65
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	11,195,301.16	37,143,459.07
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	234,192.24	181,994.87
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-370,764,807.06	1,066,227,943.16
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-370,764,807.06	1,066,227,943.16

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,398,653,196.48	1,630,291,358.09	3,028,944,554.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-370,764,807.06	-370,764,807.06
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）	-265,326,749.38	-204,953,480.59	-470,280,229.97
其中：1.基金申购款	157,015,755.32	149,552,614.85	306,568,370.17
2.基金赎回款	-422,342,504.70	-354,506,095.44	-776,848,600.14
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)	1,133,326,447.10	1,054,573,070.44	2,187,899,517.54
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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)	884,096,741.39	550,549,791.04	1,434,646,532.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,066,227,943.16	1,066,227,943.16
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)	637,657,249.08	445,819,600.73	1,083,476,849.81
其中：1.基金申购款	3,347,594,524.52	3,665,497,803.16	7,013,092,327.68
2.基金赎回款	-2,709,937,275.44	-3,219,678,202.43	-5,929,615,477.87
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)	1,521,753,990.47	2,062,597,334.93	3,584,351,325.40

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：

_____ 高潮生 _____

基金管理人负责人

_____ 张力 _____

主管会计工作负责人

_____ 谢先斌 _____

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资基金(原名为摩根士丹利华鑫量化配置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[2012]第1238号《关于核准摩根士丹利华鑫量化配置股票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《摩根士丹利华鑫量化配置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1,094,111,652.89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(2012)第508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配置股票型证券投资基金基金合同》于2012年12月11日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,095,372,033.67份基金份额,其中认购资金利息折合1,260,380.78

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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其配套规定的相关要求，自 2015 年 8 月 7 日起，摩根士丹利华鑫量化配置股票型证券投资基金更名为摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资基金。

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配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(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(包括交易所和银行间两个市场的国债、金融债、企业债与可转换债、中期票据、短期融资券等)、银行存款、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规和中国证监会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 60%—95%，除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 5%—40%，其中权证资产占基金资产净值的比例范围为 0—3%，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%。自基金合同生效日至 2015 年 9 月 28 日，本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+中信标普全债指数收益率×20%。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部分开放式基金变更业绩比较基准的公告》，自 2015 年 9 月 29 日期，本基金的业绩比较基准变更为：沪深 300 指数收益率×80%+标普中国债券指数收益率×20%。

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配置混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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，股权的股息、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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	240,287,490.23
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	240,287,490.23

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,974,822,264.68	1,980,149,902.85	5,327,638.17
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	1,974,822,264.68	1,980,149,902.85	5,327,638.17

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 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	55,347.91
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	2,841.20
应收债券利息	-
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	269.60
合计	58,458.71

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 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	4,289,841.21
银行间市场应付交易费用	-
合计	4,289,841.21

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	22,556.89
预提费用	337,768.41
合计	360,325.30

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	1,398,653,196.48	1,398,653,196.48
本期申购	157,015,755.32	157,015,755.32
本期赎回(以“-”号填列)	-422,342,504.70	-422,342,504.70
本期末	1,133,326,447.10	1,133,326,447.10

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	1,033,535,790.20	596,755,567.89	1,630,291,358.09
本期利润	-212,753,454.12	-158,011,352.94	-370,764,807.06
本期基金份额交易产生的变动数	-152,543,458.42	-52,410,022.17	-204,953,480.59
其中：基金申购款	108,344,079.03	41,208,535.82	149,552,614.85
基金赎回款	-260,887,537.45	-93,618,557.99	-354,506,095.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	668,238,877.66	386,334,192.78	1,054,573,070.44

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	1,401,437.46
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	53,620.28
其他	10,661.38
合计	1,465,719.12

注：“其他”为申购款利息收入和结算保证金利息收入。

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 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	3,942,227,626.59
减：卖出股票成本总额	4,142,640,188.72
买卖股票差价收入	-200,412,562.13

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 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	18,266,347.40
基金投资产生的股利收益	-
合计	18,266,347.40

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-158,011,352.94
——股票投资	-158,011,352.94
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-158,011,352.94

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	695,302.49
基金转换费收入	9,584.75
合计	704,887.24

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% 归入基金

资产，未归入基金财产的部分用于支付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。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	11,195,301.16
银行间市场交易费用	-
合计	11,195,301.16

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
审计费用	59,672.34
信息披露费	149,178.12
银行费用	5,323.83
债券账户维护费	19,417.95
其他	600.00
合计	234,192.24

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

中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	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 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	1,208,047,620.99	16.24%	13,135,580,508.74	53.30%

6.4.10.1.2 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。

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 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
华鑫证券	1,125,055.89	16.77%	1,125,055.89	26.23%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	11,958,616.52	53.30%	7,239,700.41	53.19%

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	上年度可比期间
----	----	---------

	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	18,298,587.70	22,287,789.91
其中：支付销售机构的客户维护费	7,266,077.07	10,811,698.69

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 1.5% 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 × 1.5% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,049,764.65	3,714,631.65

注：支付基金托管人中国农业银行股份有限公司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。

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无与关联方进行的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无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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
中国农业银行 股份有限公司	240,287,490.23	1,401,437.46	338,698,443.08	932,899.92

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，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

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2016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
000651	格力电器	2016年2月22日	重大事项	22.07	-	-	539,790	12,729,010.66	11,913,165.30	-
000002	万科A	2015年12月18日	重大资产重组	18.20	2016年7月4日	21.99	552,300	7,885,295.39	10,051,860.00	-
000553	沙隆达A	2015年8月5日	重大资产重组	10.68	-	-	718,200	9,185,326.09	7,670,376.00	-
000920	南方汇通	2016年2月17日	重大资产重组	17.80	2016年7月12日	18.10	375,100	6,246,413.00	6,676,780.00	-
300032	金龙机电	2016年6月28日	重大事项	20.10	2016年7月7日	19.80	310,600	6,677,987.23	6,243,060.00	-
300351	永贵电器	2016年6月29日	临时停牌	33.93	2016年7月4日	33.30	169,834	4,778,751.15	5,762,467.62	-
600019	宝钢股份	2016年6月27日	重大资产重组	4.90	-	-	1,157,200	6,405,792.58	5,670,280.00	-
002766	索菱股份	2016年3月21日	重大资产重组	31.74	2016年7月5日	34.91	138,950	3,692,736.79	4,410,273.00	-
002065	东华软件	2015年12月21日	重大事项	18.71	2016年7月4日	22.59	231,425	7,806,870.37	4,329,961.75	-
000693	ST华泽	2016年	重大资	12.50	-	-	341,000	5,322,285.86	4,262,500.00	-

		3月1日	产重组								
600759	洲际油气	2016年6月27日	重大资产重组	7.58	2016年7月11日	8.10	527,500	4,710,754.55	3,998,450.00		-
600511	国药股份	2016年2月18日	重大资产重组	27.42	2016年8月4日	30.16	110,700	2,790,967.00	3,035,394.00		-
002101	广东鸿图	2016年5月3日	重大资产重组	21.62	-	-	111,600	2,433,390.00	2,412,792.00		-
000415	渤海金控	2016年2月1日	重大资产重组	6.82	2016年8月11日	7.50	339,000	2,946,262.00	2,311,980.00		-
600738	兰州民百	2016年3月23日	重大资产重组	8.49	2016年7月11日	9.34	258,300	2,564,711.56	2,192,967.00		-
603611	诺力股份	2016年3月30日	重大资产重组	25.37	2016年7月19日	27.91	78,800	1,763,772.31	1,999,156.00		-
600843	上工申贝	2016年2月18日	重大资产重组	13.71	2016年7月26日	15.08	144,500	2,158,010.34	1,981,095.00		-
300298	三诺生物	2016年3月21日	重大资产重组	20.96	2016年8月4日	23.06	49,010	1,024,470.02	1,027,249.60		-
600295	鄂尔多斯	2016年6月30日	重大事项	7.89	2016年7月14日	8.46	126,712	1,370,465.45	999,757.68		-
300242	明家联合	2016年5月9日	重大资产重组	34.99	2016年8月12日	36.69	28,200	1,047,247.00	986,718.00		-
002682	龙洲股份	2016年4月6日	重大资产重组	12.69	2016年7月20日	13.96	59,816	931,601.71	759,065.04		-

注：本基金截至 2016 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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

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

本基金为进行主动投资的混合型基金。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争取将以上风险控制在限定的范围之内，通过数量化模型，优化资产配置权重，力争在降低组合风险的同时，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农业银行，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；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资 (2015 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

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

于 2016 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

备付金及存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 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	240,287,490.23	-	-	-	240,287,490.23
结算备付金	6,313,759.68	-	-	-	6,313,759.68
存出保证金	599,102.30	-	-	-	599,102.30
交易性金融资产	-	-	-	1,980,149,902.85	1,980,149,902.85
应收利息	-	-	-	58,458.71	58,458.71
应收股利	-	-	-	104.25	104.25
应收申购款	-	-	-	441,527.28	441,527.28
资产总计	247,200,352.21	-	-	1,980,649,993.09	2,227,850,345.30
负债					
应付证券清算款	-	-	-	25,531,948.27	25,531,948.27
应付赎回款	-	-	-	6,678,397.14	6,678,397.14
应付管理人报酬	-	-	-	2,648,842.15	2,648,842.15
应付托管费	-	-	-	441,473.69	441,473.69
应付交易费用	-	-	-	4,289,841.21	4,289,841.21
其他负债	-	-	-	360,325.30	360,325.30
负债总计	-	-	-	39,950,827.76	39,950,827.76
利率敏感度缺口	247,200,352.21	-	-	1,940,699,165.33	2,187,899,517.54
上年度末 2015 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	421,453,674.66	-	-	-	421,453,674.66
结算备付金	13,392,952.67	-	-	-	13,392,952.67
存出保证金	2,669,604.85	-	-	-	2,669,604.85
交易性金融资产	-	-	-	2,781,333,096.56	2,781,333,096.56
应收利息	-	-	-	114,258.21	114,258.21
应收股利	-	-	-	104.25	104.25
应收申购款	-	-	-	6,830,842.23	6,830,842.23
资产总计	437,516,232.18	-	-	2,788,278,301.25	3,225,794,533.43
负债					
应付证券清算款	-	-	-	45.74	45.74
应付赎回款	-	-	-	187,454,316.45	187,454,316.45
应付管理人报酬	-	-	-	3,953,011.00	3,953,011.00
应付托管费	-	-	-	658,835.20	658,835.20

应付交易费用	-	-	-	3,953,708.54	3,953,708.54
其他负债	-	-	-	830,061.93	830,061.93
负债总计	-	-	-	196,849,978.86	196,849,978.86
利率敏感度缺口	437,516,232.18	-	-	-2,591,428,322.39	3,028,944,554.57

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 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2015 年 12 月 31 日：同）。因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2015 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，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。本基金投资组合的资产配置范围为：股票资产占基金资产的比例范围为 60%-95%；除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 5%-40%，其中权证资产占基金资产净值的比例范围为 0-3%，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%。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，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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	上年度末
----	-----	------

	2016 年 6 月 30 日		2015 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	1,980,149,902.85	90.50	2,781,333,096.56	91.83
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,980,149,902.85	90.50	2,781,333,096.56	91.83

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(2016年6月30日)	上年度末(2015年12月31日)
	业绩比较基准(附注 6.4.1)上升5%	122,820,000.00	162,910,000.00
	业绩比较基准(附注 6.4.1)下降5%	-122,820,000.00	-162,910,000.00

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 2016 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 1,891,454,554.86 元，属于第二层次的余额为 88,695,347.99 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 2,718,389,952.03 元，第二层次 62,943,144.53 元，

无属于第三层余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 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(2015 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	1,980,149,902.85	88.88
	其中：股票	1,980,149,902.85	88.88
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	246,601,249.91	11.07
7	其他各项资产	1,099,192.54	0.05
8	合计	2,227,850,345.30	100.00

7.2 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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,383,730.05	0.06
B	采矿业	65,346,244.96	2.99
C	制造业	715,315,239.83	32.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	84,857,048.98	3.88
E	建筑业	65,818,635.83	3.01
F	批发和零售业	42,478,642.05	1.94
G	交通运输、仓储和邮政业	69,530,062.59	3.18
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	63,641,884.69	2.91
J	金融业	647,634,639.99	29.60
K	房地产业	115,949,947.64	5.30
L	租赁和商务服务业	15,593,022.97	0.71
M	科学研究和技术服务业	12,122,897.60	0.55
N	水利、环境和公共设施管理业	11,302,075.80	0.52
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,610,336.00	0.07
R	文化、体育和娱乐业	57,842,002.87	2.64
S	综合	9,723,491.00	0.44
	合计	1,980,149,902.85	90.50

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

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	601166	兴业银行	8,452,126	128,810,400.24	5.89
2	601398	工商银行	23,531,800	104,481,192.00	4.78
3	000783	长江证券	6,822,760	79,144,016.00	3.62
4	000776	广发证券	4,520,331	75,760,747.56	3.46
5	601818	光大银行	13,573,200	51,035,232.00	2.33

6	600999	招商证券	2,153,469	35,532,238.50	1.62
7	601988	中国银行	10,150,000	32,581,500.00	1.49
8	601601	中国太保	1,085,693	29,357,138.72	1.34
9	601336	新华保险	725,810	29,322,724.00	1.34
10	601318	中国平安	911,092	29,191,387.68	1.33
11	601628	中国人寿	1,376,101	28,650,422.82	1.31
12	000848	承德露露	1,513,505	18,086,384.75	0.83
13	000957	中通客车	397,909	18,065,068.60	0.83
14	000858	五粮液	527,559	17,161,494.27	0.78
15	000869	张裕A	419,273	16,846,389.14	0.77
16	002304	洋河股份	225,724	16,234,070.08	0.74
17	600837	海通证券	1,015,000	15,651,300.00	0.72
18	000665	湖北广电	867,300	12,853,386.00	0.59
19	600551	时代出版	643,005	12,834,379.80	0.59
20	600757	长江传媒	1,499,013	12,576,719.07	0.57
21	600011	华能国际	1,658,855	12,474,589.60	0.57
22	600373	中文传媒	597,204	12,391,983.00	0.57
23	600104	上汽集团	601,240	12,199,159.60	0.56
24	601633	长城汽车	1,432,839	12,093,161.16	0.55
25	000651	格力电器	539,790	11,913,165.30	0.54
26	000600	建投能源	1,357,742	11,853,087.66	0.54
27	000625	长安汽车	852,667	11,655,957.89	0.53
28	000966	长源电力	1,779,100	11,564,150.00	0.53
29	002507	涪陵榨菜	952,180	11,464,247.20	0.52
30	300146	汤臣倍健	800,200	10,834,708.00	0.50
31	600804	鹏博士	561,658	10,239,025.34	0.47
32	300315	掌趣科技	975,699	10,235,082.51	0.47
33	600167	联美控股	617,049	10,125,774.09	0.46
34	000333	美的集团	426,100	10,107,092.00	0.46
35	000002	万科A	552,300	10,051,860.00	0.46
36	600854	春兰股份	1,342,900	10,031,463.00	0.46
37	600724	宁波富达	1,912,900	9,755,790.00	0.45
38	000402	金融街	1,000,365	9,723,547.80	0.44
39	000692	惠天热电	1,713,871	9,563,400.18	0.44
40	000540	中天城投	1,531,200	9,539,376.00	0.44
41	600887	伊利股份	570,900	9,516,903.00	0.43
42	600795	国电电力	3,243,600	9,503,748.00	0.43
43	000863	三湘股份	1,023,957	9,420,404.40	0.43
44	600690	青岛海尔	1,047,800	9,304,464.00	0.43

45	000423	东阿阿胶	172,700	9,123,741.00	0.42
46	600027	华电国际	1,807,600	8,947,620.00	0.41
47	000999	华润三九	365,968	8,863,744.96	0.41
48	600073	上海梅林	771,886	8,838,094.70	0.40
49	601186	中国铁建	867,597	8,641,266.12	0.39
50	000418	小天鹅 A	262,766	8,571,426.92	0.39
51	000895	双汇发展	410,181	8,564,579.28	0.39
52	600068	XD 葛洲坝	1,463,300	8,516,406.00	0.39
53	600518	康美药业	557,100	8,462,349.00	0.39
54	601390	中国中铁	1,205,999	8,405,813.03	0.38
55	000623	吉林敖东	335,218	8,363,689.10	0.38
56	601669	中国电建	1,459,700	8,334,887.00	0.38
57	000965	天保基建	1,343,400	7,952,928.00	0.36
58	600491	龙元建设	902,700	7,745,166.00	0.35
59	000553	沙隆达 A	718,200	7,670,376.00	0.35
60	600376	首开股份	681,800	7,581,616.00	0.35
61	600332	白云山	302,300	7,448,672.00	0.34
62	600750	江中药业	231,096	7,348,852.80	0.34
63	000926	福星股份	616,300	7,229,199.00	0.33
64	600048	保利地产	821,014	7,085,350.82	0.32
65	600185	格力地产	1,136,700	7,058,907.00	0.32
66	600170	上海建工	1,827,400	6,998,942.00	0.32
67	300303	聚飞光电	735,800	6,997,458.00	0.32
68	601668	中国建筑	1,311,100	6,975,052.00	0.32
69	002244	滨江集团	1,038,500	6,957,950.00	0.32
70	600340	华夏幸福	282,066	6,876,769.08	0.31
71	000920	南方汇通	375,100	6,676,780.00	0.31
72	002221	东华能源	543,000	6,619,170.00	0.30
73	600606	绿地控股	594,497	6,432,457.54	0.29
74	600784	鲁银投资	725,900	6,395,179.00	0.29
75	300008	天海防务	189,047	6,295,265.10	0.29
76	600459	贵研铂业	210,200	6,280,776.00	0.29
77	300032	金龙机电	310,600	6,243,060.00	0.29
78	000413	东旭光电	719,080	6,176,897.20	0.28
79	000708	大冶特钢	550,225	6,162,520.00	0.28
80	300219	鸿利光电	390,828	6,089,100.24	0.28
81	601801	皖新传媒	520,100	6,069,567.00	0.28
82	002449	国星光电	457,126	6,066,062.02	0.28
83	600688	上海石化	993,100	6,057,910.00	0.28

84	000661	长春高新	56,296	6,005,657.28	0.27
85	600028	中国石化	1,271,100	5,999,592.00	0.27
86	600029	南方航空	844,837	5,964,549.22	0.27
87	600221	海南航空	1,878,200	5,953,894.00	0.27
88	600507	方大特钢	1,228,779	5,898,139.20	0.27
89	600115	东方航空	878,653	5,807,896.33	0.27
90	300351	永贵电器	169,834	5,762,467.62	0.26
91	601111	中国国航	847,200	5,727,072.00	0.26
92	603111	康尼机电	425,400	5,708,868.00	0.26
93	300204	舒泰神	309,271	5,702,957.24	0.26
94	600019	宝钢股份	1,157,200	5,670,280.00	0.26
95	002038	双鹭药业	180,538	5,448,636.84	0.25
96	600188	兖州煤业	496,881	5,435,878.14	0.25
97	002023	海特高新	309,200	5,358,436.00	0.24
98	603993	洛阳钼业	1,285,800	5,336,070.00	0.24
99	600845	宝信软件	238,186	5,313,929.66	0.24
100	002128	露天煤业	701,700	5,269,767.00	0.24
101	600196	复星医药	276,885	5,266,352.70	0.24
102	600522	中天科技	536,900	5,261,620.00	0.24
103	601088	中国神华	371,355	5,224,964.85	0.24
104	000552	靖远煤电	1,457,070	5,128,886.40	0.23
105	600547	山东黄金	130,800	5,089,428.00	0.23
106	601766	中国中车	540,000	4,951,800.00	0.23
107	600038	中直股份	116,960	4,851,500.80	0.22
108	600485	信威集团	270,100	4,818,584.00	0.22
109	000063	中兴通讯	331,281	4,750,569.54	0.22
110	002460	赣锋锂业	140,500	4,699,725.00	0.21
111	000738	中航动控	176,100	4,649,040.00	0.21
112	601069	西部黄金	197,558	4,585,321.18	0.21
113	600850	华东电脑	159,679	4,581,190.51	0.21
114	601890	亚星锚链	487,376	4,430,247.84	0.20
115	002467	二六三	286,800	4,419,588.00	0.20
116	002152	广电运通	268,300	4,410,852.00	0.20
117	002766	索菱股份	138,950	4,410,273.00	0.20
118	300384	三联虹普	86,500	4,350,950.00	0.20
119	603118	共进股份	106,500	4,333,485.00	0.20
120	002065	东华软件	231,425	4,329,961.75	0.20
121	002415	海康威视	200,296	4,298,352.16	0.20
122	002236	大华股份	327,750	4,293,525.00	0.20

123	000693	ST 华泽	341,000	4,262,500.00	0.19
124	002466	天齐锂业	99,620	4,252,777.80	0.19
125	600271	航天信息	178,200	4,241,160.00	0.19
126	002429	兆驰股份	501,700	4,204,246.00	0.19
127	600150	中国船舶	188,600	4,198,236.00	0.19
128	600125	铁龙物流	651,900	4,152,603.00	0.19
129	601857	中国石油	570,413	4,124,085.99	0.19
130	601006	大秦铁路	636,085	4,096,387.40	0.19
131	600687	刚泰控股	251,400	4,087,764.00	0.19
132	002027	分众传媒	244,600	4,038,346.00	0.18
133	603806	福斯特	77,322	4,035,435.18	0.18
134	600759	洲际油气	527,500	3,998,450.00	0.18
135	601333	广深铁路	999,000	3,906,090.00	0.18
136	601989	中国重工	611,300	3,869,529.00	0.18
137	002104	恒宝股份	234,600	3,856,824.00	0.18
138	000506	中润资源	510,240	3,842,107.20	0.18
139	600050	中国联通	998,382	3,803,835.42	0.17
140	002401	中海科技	207,200	3,800,048.00	0.17
141	300020	银江股份	204,200	3,798,120.00	0.17
142	600487	亨通光电	298,720	3,757,897.60	0.17
143	000810	创维数字	207,200	3,744,104.00	0.17
144	600060	海信电器	210,000	3,712,800.00	0.17
145	002519	银河电子	164,344	3,684,592.48	0.17
146	601222	林洋能源	87,600	3,666,060.00	0.17
147	300170	汉得信息	239,100	3,629,538.00	0.17
148	002649	博彦科技	87,400	3,458,418.00	0.16
149	300118	东方日升	180,800	3,409,888.00	0.16
150	002203	海亮股份	438,000	3,403,260.00	0.16
151	300079	数码视讯	387,150	3,317,875.50	0.15
152	300360	炬华科技	145,300	3,288,139.00	0.15
153	002635	安洁科技	85,000	3,262,300.00	0.15
154	600566	济川药业	125,500	3,230,370.00	0.15
155	600062	华润双鹤	175,991	3,206,556.02	0.15
156	002195	二三四五	258,800	3,180,652.00	0.15
157	601012	隆基股份	243,400	3,176,370.00	0.15
158	000513	丽珠集团	67,852	3,128,655.72	0.14
159	300026	红日药业	178,800	3,109,332.00	0.14
160	002294	信立泰	113,880	3,097,536.00	0.14
161	000022	深赤湾 A	196,100	3,090,536.00	0.14

162	601000	唐山港	786,100	3,050,068.00	0.14
163	000581	威孚高科	150,582	3,035,733.12	0.14
164	600511	国药股份	110,700	3,035,394.00	0.14
165	600655	豫园商城	279,162	3,026,116.08	0.14
166	600717	天津港	347,570	3,020,383.30	0.14
167	002501	利源精制	279,200	3,015,360.00	0.14
168	600704	物产中大	319,730	2,992,672.80	0.14
169	002025	航天电器	120,900	2,985,021.00	0.14
170	002028	思源电气	269,020	2,945,769.00	0.13
171	002179	中航光电	67,600	2,928,432.00	0.13
172	601908	京运通	377,702	2,896,974.34	0.13
173	002324	普利特	99,099	2,885,762.88	0.13
174	002416	爱施德	143,200	2,843,952.00	0.13
175	601677	明泰铝业	212,900	2,840,086.00	0.13
176	002320	海峡股份	180,600	2,811,942.00	0.13
177	600018	上港集团	548,000	2,794,800.00	0.13
178	600056	中国医药	175,800	2,788,188.00	0.13
179	600643	爱建集团	283,500	2,769,795.00	0.13
180	600525	长园集团	199,562	2,763,933.70	0.13
181	002540	亚太科技	310,298	2,705,798.56	0.12
182	002099	海翔药业	283,900	2,702,728.00	0.12
183	600660	福耀玻璃	192,500	2,695,000.00	0.12
184	600816	安信信托	158,581	2,675,261.47	0.12
185	600639	浦东金桥	107,000	2,672,860.00	0.12
186	600705	中航资本	454,300	2,671,284.00	0.12
187	600741	华域汽车	188,627	2,642,664.27	0.12
188	600143	金发科技	408,743	2,632,304.92	0.12
189	002157	正邦科技	111,894	2,625,033.24	0.12
190	600531	豫光金铅	313,100	2,614,385.00	0.12
191	002382	蓝帆医疗	232,400	2,612,176.00	0.12
192	603167	渤海轮渡	262,250	2,609,387.50	0.12
193	603306	华懋科技	75,650	2,604,629.50	0.12
194	002450	康得新	150,707	2,577,089.70	0.12
195	300115	长盈精密	124,700	2,568,820.00	0.12
196	600635	大众公用	425,200	2,563,956.00	0.12
197	000963	华东医药	37,545	2,530,533.00	0.12
198	000939	凯迪生态	279,300	2,499,735.00	0.11
199	600380	健康元	271,400	2,491,452.00	0.11
200	600398	海澜之家	219,861	2,484,429.30	0.11

201	601607	上海医药	137,100	2,474,655.00	0.11
202	002202	金风科技	163,100	2,467,703.00	0.11
203	603001	奥康国际	115,500	2,455,530.00	0.11
204	002101	广东鸿图	111,600	2,412,792.00	0.11
205	603568	伟明环保	104,213	2,407,320.30	0.11
206	601566	九牧王	153,000	2,362,320.00	0.11
207	002124	天邦股份	221,460	2,358,549.00	0.11
208	000826	启迪桑德	77,200	2,358,460.00	0.11
209	601117	中国化学	424,400	2,346,932.00	0.11
210	600668	尖峰集团	156,413	2,343,066.74	0.11
211	600026	中海发展	397,100	2,342,890.00	0.11
212	601872	招商轮船	497,400	2,327,832.00	0.11
213	000415	渤海金控	339,000	2,311,980.00	0.11
214	600970	中材国际	364,900	2,298,870.00	0.11
215	600064	南京高科	153,000	2,287,350.00	0.10
216	600585	海螺水泥	156,920	2,281,616.80	0.10
217	002233	塔牌集团	283,646	2,277,677.38	0.10
218	600292	远达环保	178,200	2,257,794.00	0.10
219	601618	中国中冶	610,600	2,253,114.00	0.10
220	600177	雅戈尔	162,400	2,239,496.00	0.10
221	601992	金隅股份	287,200	2,225,800.00	0.10
222	600895	张江高科	123,100	2,225,648.00	0.10
223	600663	陆家嘴	97,600	2,220,400.00	0.10
224	600738	兰州民百	258,300	2,192,967.00	0.10
225	600499	科达洁能	129,200	2,184,772.00	0.10
226	000338	潍柴动力	276,100	2,156,341.00	0.10
227	002100	天康生物	238,600	2,145,014.00	0.10
228	000876	新希望	256,524	2,134,279.68	0.10
229	000700	模塑科技	209,300	2,120,209.00	0.10
230	002327	富安娜	248,700	2,116,437.00	0.10
231	000030	富奥股份	288,465	2,068,294.05	0.09
232	600742	一汽富维	164,160	2,050,358.40	0.09
233	600761	安徽合力	198,400	2,001,856.00	0.09
234	603611	诺力股份	78,800	1,999,156.00	0.09
235	600843	上工申贝	144,500	1,981,095.00	0.09
236	300191	潜能恒信	43,300	1,980,109.00	0.09
237	300210	森远股份	108,200	1,934,616.00	0.09
238	601038	一拖股份	200,000	1,894,000.00	0.09
239	600835	上海机电	98,380	1,887,912.20	0.09

240	601313	江南嘉捷	123,500	1,788,280.00	0.08
241	600790	轻纺城	302,255	1,774,236.85	0.08
242	002344	海宁皮城	181,302	1,767,694.50	0.08
243	600057	象屿股份	170,500	1,752,740.00	0.08
244	600270	外运发展	99,200	1,735,008.00	0.08
245	000089	深圳机场	201,900	1,716,150.00	0.08
246	600824	益民集团	283,700	1,693,689.00	0.08
247	600897	厦门空港	80,800	1,693,568.00	0.08
248	600004	白云机场	132,380	1,622,978.80	0.07
249	600676	交运股份	181,000	1,616,330.00	0.07
250	002554	惠博普	223,466	1,608,955.20	0.07
251	600729	重庆百货	60,400	1,497,920.00	0.07
252	603686	龙马环卫	40,958	1,493,738.26	0.07
253	603188	亚邦股份	82,701	1,485,309.96	0.07
254	002738	中矿资源	73,650	1,476,682.50	0.07
255	002367	康力电梯	95,700	1,473,780.00	0.07
256	300101	振芯科技	52,700	1,471,911.00	0.07
257	600009	上海机场	56,500	1,471,825.00	0.07
258	601238	广汽集团	62,200	1,461,078.00	0.07
259	002056	横店东磁	84,500	1,436,500.00	0.07
260	000902	新洋丰	114,400	1,431,144.00	0.07
261	600176	中国巨石	148,960	1,425,547.20	0.07
262	600388	龙净环保	112,100	1,407,976.00	0.06
263	002074	国轩高科	35,400	1,397,238.00	0.06
264	603979	金诚信	58,000	1,391,420.00	0.06
265	002470	金正大	172,100	1,385,405.00	0.06
266	600894	广日股份	103,000	1,372,990.00	0.06
267	600426	华鲁恒升	152,090	1,339,912.90	0.06
268	600323	瀚蓝环境	103,805	1,317,285.45	0.06
269	002091	江苏国泰	81,800	1,296,530.00	0.06
270	002325	洪涛股份	139,200	1,279,248.00	0.06
271	600879	航天电子	81,200	1,265,096.00	0.06
272	002277	友阿股份	109,400	1,260,288.00	0.06
273	000501	鄂武商A	79,977	1,254,839.13	0.06
274	600694	大商股份	32,300	1,244,196.00	0.06
275	000685	中山公用	119,400	1,239,372.00	0.06
276	601877	正泰电器	65,309	1,231,074.65	0.06
277	002375	亚厦股份	108,400	1,224,920.00	0.06
278	000598	兴蓉环境	230,500	1,217,040.00	0.06

279	002081	金螳螂	120,984	1,212,259.68	0.06
280	600089	特变电工	141,300	1,203,876.00	0.06
281	600168	武汉控股	122,900	1,199,504.00	0.05
282	000888	峨眉山A	98,400	1,184,736.00	0.05
283	600327	大东方	132,200	1,179,224.00	0.05
284	300043	互动娱乐	82,900	1,174,693.00	0.05
285	600755	厦门国贸	146,600	1,165,470.00	0.05
286	600118	中国卫星	34,500	1,159,200.00	0.05
287	600885	宏发股份	37,600	1,154,696.00	0.05
288	601179	中国西电	226,127	1,146,463.89	0.05
289	000541	佛山照明	111,400	1,146,306.00	0.05
290	600677	航天通信	61,600	1,136,520.00	0.05
291	600486	扬农化工	41,300	1,131,620.00	0.05
292	600287	江苏舜天	123,500	1,127,555.00	0.05
293	002504	弘高创意	46,500	1,125,300.00	0.05
294	600309	万华化学	64,830	1,121,559.00	0.05
295	002008	大族激光	49,000	1,119,160.00	0.05
296	600054	黄山旅游	69,550	1,119,059.50	0.05
297	600517	置信电气	117,500	1,117,425.00	0.05
298	300144	宋城演艺	44,800	1,115,968.00	0.05
299	600739	辽宁成大	71,500	1,113,255.00	0.05
300	600260	凯乐科技	67,400	1,102,664.00	0.05
301	002411	必康股份	61,500	1,097,775.00	0.05
302	000762	西藏矿业	42,700	1,055,544.00	0.05
303	600312	平高电气	67,200	1,052,352.00	0.05
304	002033	丽江旅游	82,550	1,046,734.00	0.05
305	600261	阳光照明	145,900	1,030,054.00	0.05
306	300298	三诺生物	49,010	1,027,249.60	0.05
307	000627	天茂集团	132,700	1,025,771.00	0.05
308	002250	联化科技	71,500	1,023,880.00	0.05
309	601969	海南矿业	90,300	1,013,166.00	0.05
310	601888	中国国旅	23,009	1,011,935.82	0.05
311	600295	鄂尔多斯	126,712	999,757.68	0.05
312	002597	金禾实业	74,200	999,474.00	0.05
313	002391	长青股份	69,600	995,280.00	0.05
314	600138	中青旅	51,100	987,252.00	0.05
315	300242	明家联合	28,200	986,718.00	0.05
316	601678	滨化股份	189,100	962,519.00	0.04
317	002223	鱼跃医疗	30,300	961,116.00	0.04

318	002131	利欧股份	56,200	960,458.00	0.04
319	002258	利尔化学	102,000	957,780.00	0.04
320	600529	山东药玻	54,200	954,462.00	0.04
321	300171	东富龙	50,400	951,552.00	0.04
322	002004	华邦健康	104,100	950,433.00	0.04
323	002588	史丹利	76,500	944,775.00	0.04
324	002400	省广股份	66,760	943,318.80	0.04
325	600706	曲江文旅	51,900	927,972.00	0.04
326	300183	东软载波	34,163	905,319.50	0.04
327	300058	蓝色光标	90,900	882,639.00	0.04
328	300373	扬杰科技	35,900	865,549.00	0.04
329	000150	宜华健康	27,700	863,686.00	0.04
330	300015	爱尔眼科	23,000	840,190.00	0.04
331	002426	胜利精密	83,550	822,967.50	0.04
332	002595	豪迈科技	38,000	812,060.00	0.04
333	002185	华天科技	62,930	801,098.90	0.04
334	000421	南京公用	78,700	787,787.00	0.04
335	600763	通策医疗	24,700	770,146.00	0.04
336	601369	陕鼓动力	120,600	769,428.00	0.04
337	002053	云南盐化	27,100	769,369.00	0.04
338	600409	三友化工	113,762	766,755.88	0.04
339	000529	广弘控股	93,000	760,740.00	0.03
340	600846	同济科技	76,700	759,330.00	0.03
341	002682	龙洲股份	59,816	759,065.04	0.03
342	600811	东方集团	113,419	755,370.54	0.03
343	000919	金陵药业	57,400	751,366.00	0.03
344	300443	金雷风电	11,200	747,152.00	0.03
345	601216	君正集团	99,200	741,024.00	0.03
346	600172	黄河旋风	38,900	716,927.00	0.03
347	601028	玉龙股份	99,900	713,286.00	0.03
348	000637	茂化实华	102,600	675,108.00	0.03
349	600218	全柴动力	66,000	674,520.00	0.03
350	002532	新界泵业	44,800	672,000.00	0.03
351	002444	巨星科技	31,800	646,176.00	0.03
352	002180	艾派克	22,230	634,221.90	0.03
353	601965	中国汽研	65,200	626,572.00	0.03
354	000039	中集集团	43,600	617,812.00	0.03
355	300064	豫金刚石	59,800	608,764.00	0.03
356	603699	纽威股份	34,300	608,482.00	0.03

357	600153	建发股份	50,010	600,120.00	0.03
358	002487	大金重工	67,200	594,720.00	0.03
359	600335	国机汽车	46,100	516,781.00	0.02
360	002772	众兴菌业	18,713	468,386.39	0.02
361	000998	隆平高科	24,500	465,010.00	0.02
362	002041	登海种业	28,979	450,333.66	0.02
363	600297	广汇汽车	48,550	422,870.50	0.02
364	601107	四川成渝	76,800	376,320.00	0.02
365	601018	宁波港	66,500	329,175.00	0.02
366	600122	宏图高科	24,300	325,134.00	0.01
367	600350	山东高速	53,200	281,960.00	0.01
368	600033	福建高速	85,600	271,352.00	0.01
369	002419	天虹商场	14,500	173,420.00	0.01
370	300178	腾邦国际	6,400	122,880.00	0.01

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	601166	兴业银行	146,833,448.33	4.85
2	601328	交通银行	101,769,962.52	3.36
3	601788	光大证券	99,570,295.84	3.29
4	000776	广发证券	92,601,667.44	3.06
5	600000	浦发银行	75,343,853.56	2.49
6	600837	海通证券	69,758,263.52	2.30
7	000783	长江证券	69,675,240.75	2.30
8	600030	中信证券	69,611,094.75	2.30
9	600015	华夏银行	60,645,632.60	2.00
10	601988	中国银行	60,606,625.00	2.00
11	601398	工商银行	57,655,858.75	1.90
12	601818	光大银行	54,134,755.38	1.79
13	002736	国信证券	50,145,285.48	1.66
14	000750	国海证券	46,488,904.74	1.53
15	000166	申万宏源	45,601,029.22	1.51
16	600999	招商证券	42,479,490.63	1.40

17	601336	新华保险	37,122,772.08	1.23
18	601601	中国太保	36,679,377.57	1.21
19	601628	中国人寿	36,530,835.06	1.21
20	600373	中文传媒	29,416,939.83	0.97

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	601166	兴业银行	179,487,136.77	5.93
2	600030	中信证券	139,327,565.09	4.60
3	601318	中国平安	119,897,356.32	3.96
4	601788	光大证券	106,401,581.54	3.51
5	000776	广发证券	99,297,027.01	3.28
6	601328	交通银行	98,713,902.65	3.26
7	601939	建设银行	91,067,141.44	3.01
8	600999	招商证券	82,687,009.52	2.73
9	600000	浦发银行	74,993,624.36	2.48
10	600015	华夏银行	60,165,871.40	1.99
11	601398	工商银行	59,972,445.00	1.98
12	600837	海通证券	56,765,837.54	1.87
13	601169	北京银行	52,838,976.96	1.74
14	002736	国信证券	52,738,691.15	1.74
15	000750	国海证券	47,110,745.41	1.56
16	000166	申万宏源	45,722,141.16	1.51
17	600519	贵州茅台	34,517,083.08	1.14
18	600373	中文传媒	29,857,098.58	0.99
19	000568	泸州老窖	28,175,044.03	0.93
20	600240	华业资本	27,989,524.10	0.92

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	3,499,468,347.95
卖出股票收入（成交）总额	3,942,227,626.59

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

根据本基金基金合同规定，本基金不参与贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

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

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同的规定，本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。

本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素，结合定性和定量方法，确定投资时机。基金管理人另根据 CAPM 模型计算得到的组合 Beta 值，结合股票投资的总体规模，以及中国证监会的相关限定和要求，确定参与股指期货交易的投资比例。

若相关法律法规发生变化时，基金管理人期货投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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

2015年9月12日，广发证券公告其于2015年8月24日收到中国证监会《调查通知书》（鄂证调查字2015023号），并于2015年9月10日收到中国证监会《行政处罚事先告知书》（处罚字[2015]71号），广发证券在公告中陈述了《调查通知书》和《行政处罚事先告知书》的内容。

2016年3月15日，中国证监会湖北监管局下发了《关于对长江证券股份有限公司采取出具警示函监管措施的决定》（[2016]3号），对长江证券未如实披露募集资金使用情况的违规行为给予出具警示函的监督管理措施。

本基金投资广发证券（000776）和长江证券（000783）的决策流程符合本基金管理人投资管理制度相关规定。针对上述情况，本基金管理人进行了分析和研究，认为上述事件对广发证券和长江证券的投资价值未造成实质性影响。本基金管理人将继续对上述公司进行跟踪研究。

7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	599,102.30
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	104.25
4	应收利息	58,458.71
5	应收申购款	441,527.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,099,192.54

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十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
51,061	22,195.54	312,325,204.65	27.56%	821,001,242.45	72.44%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	-	-

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012年12月11日）基金份额总额	1,095,372,033.67
本报告期期初基金份额总额	1,398,653,196.48

本报告期基金总申购份额	157,015,755.32
减:本报告期基金总赎回份额	422,342,504.70
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	1,133,326,447.10

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内,基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金未改变投资策略。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

招商证券	1	2,545,161,500.97	34.20%	2,370,305.49	35.33%	-
华泰证券	1	1,715,325,589.04	23.05%	1,552,379.40	23.14%	-
华鑫证券	1	1,208,047,620.99	16.24%	1,125,055.89	16.77%	-
中信建投	1	620,813,933.63	8.34%	454,001.51	6.77%	-
安信证券	2	499,803,135.66	6.72%	465,467.45	6.94%	-
东兴证券	1	394,101,297.42	5.30%	367,028.20	5.47%	-
金元证券	1	255,499,913.42	3.43%	186,846.03	2.78%	-
中信证券	1	202,229,370.45	2.72%	188,336.05	2.81%	-
中金公司	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. 本基金本报告期内新增金元证券 1 个交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

中金公司	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---

注：本基金本报告期末通过租用的证券公司交易单元进行其他证券投资。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	本公司关于旗下基金调整停牌股票“万科 A”、“乐视网”及“张家界”估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 1 月 12 日
2	本公司关于旗下基金参加平安证券申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 1 月 20 日
3	本基金 2015 年 4 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 1 月 21 日
4	本公司关于旗下基金参与诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 1 月 22 日
5	本基金招募说明书更新(2015 年第 2 号)	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 1 月 22 日
6	本公司关于向汇付天下“天天盈”账户持有人开通基金网上直销业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 1 月 28 日
7	本公司关于向农业银行借记卡持卡人开通基金网上直销业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 1 月 28 日
8	本公司关于旗下基金参与上海陆金所资产管理有限公司认购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 2 月 1 日
9	本公司关于提醒投资者谨防虚假客服电话、防范金融诈骗的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 2 月 25 日
10	本公司关于旗下基金调整停牌股票“格力电器”及“东华软件”估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 3 月 1 日
11	本公司关于向工商银行借记卡持卡人开通基金网上直销业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 3 月 25 日
12	本公司关于旗下基金参与浙江同花顺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》、《证券日报》	2016 年 3 月 30 日
13	本基金 2015 年年度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 3 月 30 日
14	本公司关于旗下基金参加深圳市新兰德证券投资咨询有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 3 月 31 日
15	本公司关于旗下基金调整停牌股票“长安汽车”估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 3 月 31 日
16	本公司关于旗下基金增加上海联泰资	《中国证券报》、《上海	2016 年 4 月 1 日

	产管理有限公司为销售机构的公告	证券报》、《证券日报》	
17	本公司关于旗下基金参与上海联泰资产管理费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 4 月 1 日
18	关于本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》、《证券日报》	2016 年 4 月 1 日
19	本公司关于旗下基金增加上海凯石财富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》、《证券日报》	2016 年 4 月 11 日
20	本公司关于旗下基金参与上海凯石财富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》、《证券日报》	2016 年 4 月 11 日
21	本公司关于旗下基金关于增加深圳富济财富管理有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 4 月 12 日
22	本公司关于旗下基金参与深圳富济财富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》、《证券日报》	2016 年 4 月 12 日
23	本公司关于增加北京钱景财富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》、《证券日报》	2016 年 4 月 15 日
24	本公司关于旗下基金关于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》、《证券日报》	2016 年 4 月 15 日
25	本基金 2016 年 1 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 4 月 20 日
26	本公司关于旗下部分基金关于参与中国民生银行直销银行费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 5 月 17 日
27	本基金基金经理变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 6 月 3 日
28	本公司关于旗下基金参与上海好买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》、《证券日报》	2016 年 6 月 6 日
29	本公司关于增加上海利得基金销售有限公司为销售机构并参与申（认）购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 6 月 8 日
30	本公司关于旗下基金关于增加申万宏源西部为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 6 月 16 日
31	本公司关于旗下基金参加申万宏源西部申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 6 月 16 日
32	本公司关于调整开立基金账户证件类型类型的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 6 月 20 日
33	本公司关于增加盈米财富为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 6 月 22 日
34	本公司关于旗下基金关于参加盈米财富费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 6 月 22 日
35	本公司关于旗下部分基金在上海陆金	《中国证券报》、《上海	2016 年 6 月 24 日

	所资产管理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	证券报》、《证券日报》	
36	本公司关于旗下部分基金参与交通银行网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 6 月 30 日

注：上述公告同时在公司网站 www.msfnunds.com.cn 上披露。

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

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

11.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

11.3 查阅方式

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

摩根士丹利华鑫基金管理有限公司
2016 年 8 月 29 日