

# 摩根士丹利华鑫量化多策略股票型证券投资 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
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
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
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.....	12
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.....	12
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
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
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>34</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
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.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54
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.....	54
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.....	54
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.....	54
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.....	54
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	54
7.12 投资组合报告附注.....	55

<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>56</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	56
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.....	56
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>56</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>57</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	57
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.....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	57
10.4 基金投资策略的改变.....	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	57
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.....	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	57
10.8 其他重大事件.....	60
<b>§11 备查文件目录</b> .....	<b>62</b>
11.1 备查文件目录.....	62
11.2 存放地点.....	62
11.3 查阅方式.....	62

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	摩根士丹利华鑫量化多策略股票型证券投资基金
基金简称	大摩量化多策略股票
基金主代码	001291
交易代码	001291
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 6 月 2 日
基金管理人	摩根士丹利华鑫基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,591,006,250.75 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

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

	证券投资基金品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
--	--

## 2.3 基金管理人和基金托管人

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

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
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 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	-69,952,215.93
本期利润	-167,492,426.81
加权平均基金份额本期利润	-0.1014

本期加权平均净值利润率	-11.30%
本期基金份额净值增长率	-9.19%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2016年6月30日)</b>
期末可供分配利润	-66,924,525.41
期末可供分配基金份额利润	-0.0421
期末基金资产净值	1,524,081,725.34
期末基金份额净值	0.958
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2016年6月30日)</b>
基金份额累计净值增长率	-4.20%

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。

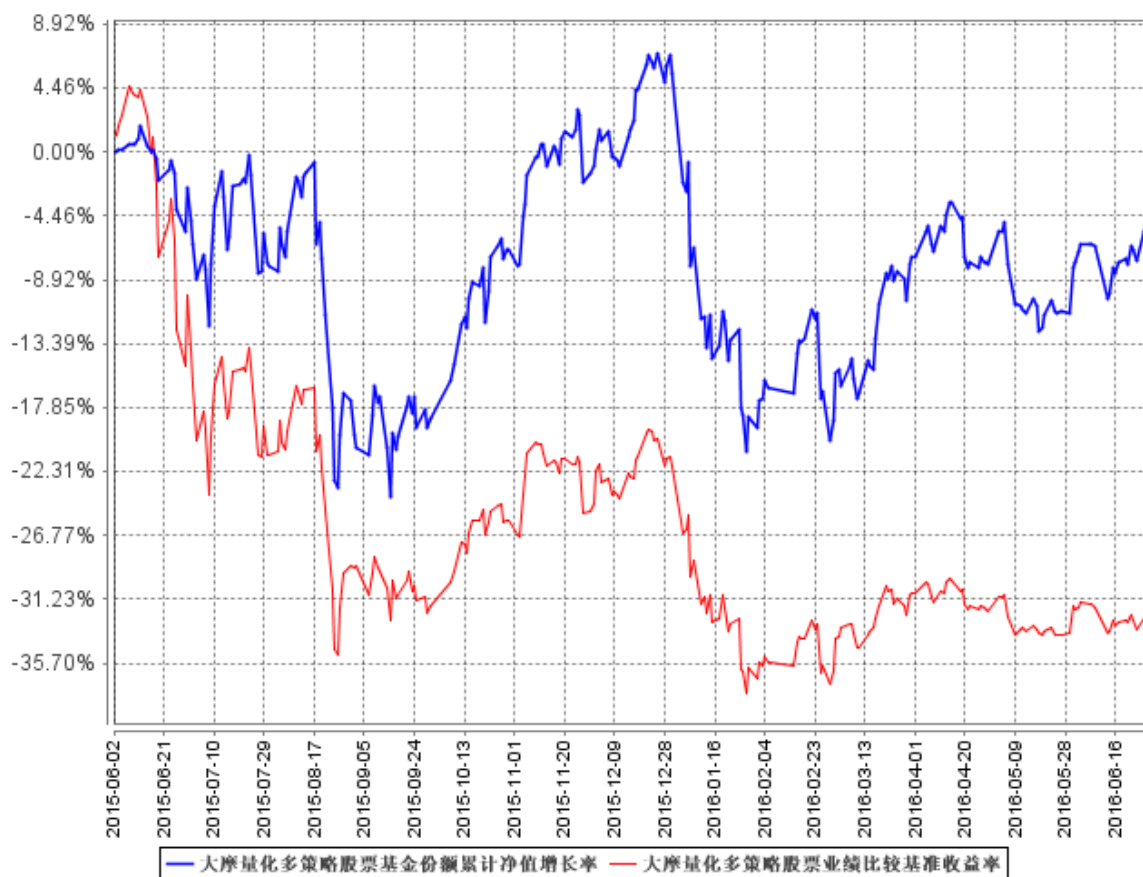
## 3.2 基金净值表现

### 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	4.24%	1.27%	-0.32%	0.83%	4.56%	0.44%
过去三个月	3.34%	1.30%	-1.62%	0.86%	4.96%	0.44%
过去六个月	-9.19%	2.07%	-12.88%	1.57%	3.69%	0.50%
过去一年	-1.74%	2.22%	-24.38%	1.96%	22.64%	0.26%
自基金合同生效起至今	-4.20%	2.16%	-31.97%	2.04%	27.77%	0.12%

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

大摩量化多策略股票基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同于 2015 年 6 月 2 日正式生效。按照本基金基金合同的规定，基金管理人自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

## § 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 7 月 25 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摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 7 月起任本基金基金经理。

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。

在一月份市场大幅波动期间，本基金坚持执行量化投资策略，运用多个量化策略混合选股的方法较好地分散了风险。一月底，我们认为市场风险已得到较好释放，故将基金仓位适当提高；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。在市场围绕 3000 点震荡期间，个股表现分化，部分优质成长股票走出了独立行情，我们的多策略混合选股模型也顺利捕捉到其中的机会。总体来说，本基金在报告期内取得了较好的超额收益。

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0.958元，累计份额净值为0.958元，基金份额净值增长率为-9.19%，同期业绩比较基准收益率为-12.88%。

#### 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供给侧改革的蓝筹股以及受益于经济结构转型升级的成长股。

#### 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**

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

#### **4.8 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**

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### **5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明**

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

### **5.3 托管人对本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：摩根士丹利华鑫量化多策略股票型证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	116,927,161.48	206,037,759.77
结算备付金		7,289,669.89	10,263,068.25
存出保证金		398,517.42	2,323,181.02
交易性金融资产	6.4.7.2	1,393,390,733.25	1,603,804,398.81
其中：股票投资		1,393,390,733.25	1,603,804,398.81
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		26,728,129.33	-
应收利息	6.4.7.5	27,379.75	60,604.03
应收股利		-	-
应收申购款		167,103.50	641,750.18
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,544,928,694.62	1,823,130,762.06
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2015 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		13,845,729.54	18,987,208.44
应付管理人报酬		1,844,026.45	2,529,477.02
应付托管费		307,337.72	421,579.51
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	4,456,675.10	6,124,394.18

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	393,200.47	184,003.11
负债合计		20,846,969.28	28,246,662.26
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,591,006,250.75	1,701,243,243.63
未分配利润	6.4.7.10	-66,924,525.41	93,640,856.17
所有者权益合计		1,524,081,725.34	1,794,884,099.80
负债和所有者权益总计		1,544,928,694.62	1,823,130,762.06

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.958 元，基金份额总额 1,591,006,250.75 份。

## 6.2 利润表

会计主体：摩根士丹利华鑫量化多策略股票型证券投资基金

本报告期：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 6 月 2 日(基 金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-139,630,982.32	-54,492,299.57
1.利息收入		635,255.71	1,481,441.37
其中：存款利息收入	6.4.7.11	635,255.71	853,699.75
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	627,741.62
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-42,999,367.20	12,017,305.26
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-50,757,049.12	8,944,253.38
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	6.4.7.13.1	-	-
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	7,757,681.92	3,073,051.88
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-97,540,210.88	-67,991,114.41
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	273,340.05	68.21
<b>减：二、费用</b>		27,861,444.49	9,937,180.61

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	11,060,041.17	2,943,606.53
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,843,340.12	490,601.09
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	14,728,992.03	6,465,118.22
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	229,071.17	37,854.77
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-167,492,426.81	-64,429,480.18
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-167,492,426.81	-64,429,480.18

### 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多策略股票型证券投资基金

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)	1,701,243,243.63	93,640,856.17	1,794,884,099.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-167,492,426.81	-167,492,426.81
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）	-110,236,992.88	6,927,045.23	-103,309,947.65
其中：1.基金申购款	87,478,074.77	-8,775,973.98	78,702,100.79
2.基金赎回款	-197,715,067.65	15,703,019.21	-182,012,048.44
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)	1,591,006,250.75	-66,924,525.41	1,524,081,725.34
项目	上年度可比期间 2015 年 6 月 2 日(基金合同生效日)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)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净	-	-64,429,480.18	-64,429,480.18

值变动数（本期利润）			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 （净值减少以“-”号填列）	2,576,611,172.81	-	2,576,611,172.81
其中：1.基金申购款	2,576,611,172.81	-	2,576,611,172.81
2.基金赎回款	-	-	-
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)	2,576,611,172.81	-64,429,480.18	2,512,181,692.63

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：

<u>高潮生</u>	<u>张力</u>	<u>谢先斌</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

摩根士丹利华鑫量化多策略股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]737号《关于核准摩根士丹利华鑫量化多策略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多策略股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式证券投资基金,存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集2,575,896,377.40元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第661号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《摩根士丹利华鑫量化多策略股票型证券投资基金基金合同》于2015年6月2日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,576,611,172.81份,其中认购资金利息折合714,795.41份基金份额。本基金的基金管理人为摩根士丹利华鑫基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《摩根士丹利华鑫量化多策略股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资于股票(包含中小板、创业板及其他依法发行、上市的股票),股指期货、权证,债券(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产以及现金,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。基金



的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 80%-95%；权证投资占基金资产净值的比例不高于 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金，基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；股指期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。自基金合同生效日至 2015 年 9 月 28 日止期间，本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 $\times$ 85%+中信标普全债指数收益率 $\times$ 15%。根据本基金的基金管理人于 2015 年 9 月 29 日发布的《摩根士丹利华鑫基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金变更业绩比较基准及修改相关基金合同的公告》，自 2015 年 9 月 29 日起，本基金业绩比较基准变更为：沪深 300 指数收益率 $\times$ 85%+标普中国债券指数收益率 $\times$ 15%。

#### 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》、《摩根士丹利华鑫量化多策略股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 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	116,927,161.48
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	116,927,161.48

### 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	1,396,039,788.24	1,393,390,733.25	-2,649,054.99
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	1,396,039,788.24	1,393,390,733.25	-2,649,054.99

### 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	23,920.15
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	3,280.30
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	179.30
合计	27,379.75

#### 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	4,456,650.11
银行间市场应付交易费用	24.99
合计	4,456,675.10

#### 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	15,420.73
预提费用	377,779.74
合计	393,200.47

#### 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	1,701,243,243.63	1,701,243,243.63
本期申购	87,478,074.77	87,478,074.77
本期赎回(以“-”号填列)	-197,715,067.65	-197,715,067.65
本期末	1,591,006,250.75	1,591,006,250.75

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	28,370,435.28	65,270,420.89	93,640,856.17
本期利润	-69,952,215.93	-97,540,210.88	-167,492,426.81
本期基金份额交易产生的变动数	2,883,871.35	4,043,173.88	6,927,045.23
其中：基金申购款	-2,948,917.14	-5,827,056.84	-8,775,973.98

基金赎回款	5,832,788.49	9,870,230.72	15,703,019.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-38,697,909.30	-28,226,616.11	-66,924,525.41

#### 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	555,015.64
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	75,779.97
其他	4,460.10
合计	635,255.71

注：“其他”为基金申购款利息收入及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	4,865,938,380.83
减：卖出股票成本总额	4,916,695,429.95
买卖股票差价收入	-50,757,049.12

#### 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	7,757,681.92
基金投资产生的股利收益	-
合计	7,757,681.92

**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	-97,540,210.88
——股票投资	-97,540,210.88
——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	-97,540,210.88

**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	191,134.48
基金转换费收入	82,205.57
其他	-
合计	273,340.05

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

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

**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	14,728,992.03
银行间市场交易费用	-
合计	14,728,992.03

#### 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	54,700.10
信息披露费	149,178.12
银行费用	3,791.43
债券账户维护费	21,201.52
其他	200.00
合计	229,071.17

#### 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 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年6月2日(基金合同生效日)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	1,169,083,540.66	12.09%	-	-

## 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 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	1,088,769.43	12.09%	0.00	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2015年6月2日(基金合同生效日)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	-	-	-	-

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 2016年1月1日至2016年6 月30日	上年度可比期间 2015年6月2日(基金合同生 效日)至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	11,060,041.17	2,943,606.53



其中:支付销售机构的客户维护费	5,833,689.04	1,517,781.29
-----------------	--------------	--------------

注:支付基金管理人摩根士丹利华鑫基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

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6月2日(基金合同生效日)至2015年6月30日	
当期发生的基金应支付的托管费	1,843,340.12		490,601.09	

注:支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

#### 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

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年6月2日(基金合同生效日)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
中国建设银行	116,927,161.48	555,015.64	1,340,087,551.42	853,699.75

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

本基金本报告期未进行利润分配。

#### 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
002735	王子新材	2016年4月5日	重大资产重组	41.19	-	-	80,761	2,687,205.10	3,326,545.59	-
000651	格力电器	2016年2月22日	重大事项	22.07	-	-	142,950	3,275,313.27	3,154,906.50	-
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	442,500	3,978,942.71	3,017,850.00	-
002101	广东鸿图	2016年4月29日	重大资产重组	21.62	-	-	139,071	2,833,798.55	3,006,715.02	-
603519	立霸股份	2016年3月21日	重大资产重组	21.90	2016年8月4日	23.44	136,200	2,716,882.00	2,982,780.00	-
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	365,226	2,881,178.72	2,881,633.14	-
000553	沙隆达A	2015年8月5日	重大资产重组	10.68	-	-	250,900	3,287,160.55	2,679,612.00	-
300225	金力泰	2016年3月22日	重大资产重组	7.12	2016年7月8日	7.58	369,465	2,472,327.60	2,630,590.80	-
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	80,300	2,636,618.00	2,548,722.00	-
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	98,700	2,372,155.00	2,504,019.00	-
300265	通光线缆	2016年3月24日	重大事项	12.38	2016年7月21日	12.55	198,900	2,417,787.00	2,462,382.00	-
300472	新元科技	2016年3月24日	重大资产重组	31.53	-	-	76,752	2,371,437.83	2,419,990.56	-
300402	宝色股份	2016年5月31日	重大资产重组	16.48	-	-	145,615	2,716,356.73	2,399,735.20	-

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	113,220	2,320,022.97	2,373,091.20	-
002314	南山控股	2016年3月7日	重大资产重组	6.83	2016年7月19日	7.51	337,400	2,789,734.48	2,304,442.00	-
300391	康跃科技	2016年3月25日	重大资产重组	17.79	2016年7月18日	19.57	129,500	2,057,335.69	2,303,805.00	-
000159	国际实业	2016年2月22日	重大事项	7.63	2016年8月3日	7.20	300,800	2,067,146.24	2,295,104.00	-
300308	中际装备	2016年3月11日	重大事项	12.36	-	-	185,683	2,372,064.99	2,295,041.88	-
300292	吴通控股	2016年1月25日	重大事项	33.26	2016年7月20日	36.48	68,700	2,593,270.99	2,284,962.00	-
002762	金发拉比	2016年1月18日	重大资产重组	52.44	2016年7月11日	57.68	41,176	2,026,473.20	2,159,269.44	-
300044	赛为智能	2016年5月12日	重大资产重组	12.97	-	-	161,109	2,443,872.16	2,089,583.73	-
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	102,430	2,263,858.36	2,058,843.00	-
300423	鲁亿通	2016年3月21日	重大资产重组	28.55	-	-	71,220	2,110,486.77	2,033,331.00	-
002469	三维工程	2016年5月10日	重大事项	9.01	2016年8月2日	8.11	223,800	2,217,632.50	2,016,438.00	-
000524	岭南控股	2016年4月5日	重大资产重组	13.08	-	-	154,108	2,780,437.86	2,015,732.64	-
300351	永贵电器	2016年6月29日	重大事项	33.93	2016年7月4日	33.30	58,400	1,685,259.00	1,981,512.00	-
600019	宝钢股份	2016年6月27日	重大资产重组	4.90	-	-	393,600	2,161,462.75	1,928,640.00	-
300355	蒙草生态	2016年6月30日	重大事项	7.11	2016年7月6日	7.38	259,600	1,759,798.21	1,845,756.00	-
603606	东方电缆	2016年6月22日	重大事项	13.85	2016年7月5日	15.13	130,440	1,678,475.13	1,806,594.00	-
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	97,400	2,091,092.27	1,733,720.00	-
000718	苏宁环球	2016年1月4日	重大事项	13.09	2016年7月18日	11.78	131,500	1,720,313.36	1,721,335.00	-
300184	力源信息	2016年3月4日	重大资产重组	11.03	-	-	147,500	1,797,326.31	1,626,925.00	-
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	83,572	1,199,946.38	1,521,010.40	-
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	162,700	1,493,904.25	1,233,266.00	-
000693	ST华泽	2016年3月	重大资产	12.50	-	-	74,246	1,089,030.94	928,075.00	-

		月 1 日	重组							
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	25,800	761,781.00	707,436.00	-
002065	东华软件	2015 年 12 月 22 日	重大事项	18.71	2016 年 7 月 4 日	22.59	37,800	769,902.16	707,238.00	-
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	76,700	766,684.97	651,183.00	-
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	40,500	650,160.98	555,255.00	-
300427	红相电力	2016 年 6 月 13 日	重大资产重组	21.89	-	-	15,400	280,690.00	337,106.00	-
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	8,600	305,998.00	300,914.00	-
002686	亿利达	2016 年 4 月 20 日	重大资产重组	13.54	2016 年 7 月 14 日	14.89	18,400	236,192.00	249,136.00	-
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	15,600	239,491.18	197,964.00	-
300038	梅泰诺	2015 年 12 月 16 日	重大资产重组	56.68	-	-	21	712.15	1,190.28	-
603918	金桥信息	2016 年 3 月 28 日	重大资产重组	34.10	2016 年 8 月 15 日	32.50	20	579.92	682.00	-
000571	新大洲 A	2016 年 1 月 18 日	重大资产重组	5.71	2016 年 7 月 19 日	6.28	59	471.15	336.89	-

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重大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

本基金为股票型证券投资基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是运用多种策略

的量化投资模型，从不同投资维度，在不同市场情况下捕捉市场定价失效的投资机会，力争在控制风险的基础上，实现基金资产的长期稳定增值。

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

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

#### **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 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证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同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	116,927,161.48	-	-	-	116,927,161.48
结算备付金	7,289,669.89	-	-	-	7,289,669.89
存出保证金	398,517.42	-	-	-	398,517.42
交易性金融资产	-	-	-	1,393,390,733.25	1,393,390,733.25
应收证券清算款	-	-	-	26,728,129.33	26,728,129.33
应收利息	-	-	-	27,379.75	27,379.75
应收申购款	-	-	-	167,103.50	167,103.50
资产总计	124,615,348.79	-	-	1,420,313,345.83	1,544,928,694.62
负债					
应付赎回款	-	-	-	13,845,729.54	13,845,729.54
应付管理人报酬	-	-	-	1,844,026.45	1,844,026.45
应付托管费	-	-	-	307,337.72	307,337.72
应付交易费用	-	-	-	4,456,675.10	4,456,675.10
其他负债	-	-	-	393,200.47	393,200.47
负债总计	-	-	-	20,846,969.28	20,846,969.28
利率敏感度缺口	124,615,348.79	-	-	-1,399,466,376.55	1,524,081,725.34
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	206,037,759.77	-	-	-	206,037,759.77
结算备付金	10,263,068.25	-	-	-	10,263,068.25
存出保证金	2,323,181.02	-	-	-	2,323,181.02
交易性金融资产	-	-	-	1,603,804,398.81	1,603,804,398.81
应收利息	-	-	-	60,604.03	60,604.03
应收申购款	417.50	-	-	641,332.68	641,750.18
资产总计	218,624,426.54	-	-	1,604,506,335.52	1,823,130,762.06
负债					
应付赎回款	-	-	-	18,987,208.44	18,987,208.44
应付管理人报酬	-	-	-	2,529,477.02	2,529,477.02
应付托管费	-	-	-	421,579.51	421,579.51
应付交易费用	-	-	-	6,124,394.18	6,124,394.18
其他负债	-	-	-	184,003.11	184,003.11
负债总计	-	-	-	28,246,662.26	28,246,662.26
利率敏感度缺口	218,624,426.54	-	-	-1,576,259,673.26	1,794,884,099.80

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。本基金投资组合中股票资产占基金资产的 80%-95%；权证投资占基金资产净值的比例不高于 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金，基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。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 2016 年 6 月 30 日		上年度末 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	1,393,390,733.25	91.42	1,603,804,398.81	89.35
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	1,393,390,733.25	91.42	1,603,804,398.81	89.35

##### 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%	74,980,000.00	69,470,000.00
	业绩比较基准(附注 6.4.1) 下降 5%	-74,980,000.00	-69,470,000.00

#### 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 1,311,110,332.98 元，属于第二层次的余额为 82,280,400.27 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 1,528,600,340.50 元，第二层次 75,204,058.31 元，无属于第三层次的余额)。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负债均属于第一层次(2015 年 12 月 31 日：同)。

##### (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	1,393,390,733.25	90.19
	其中：股票	1,393,390,733.25	90.19
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	124,216,831.37	8.04
7	其他各项资产	27,321,130.00	1.77
8	合计	1,544,928,694.62	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	11,444,516.52	0.75
B	采矿业	27,512,384.55	1.81
C	制造业	727,480,089.95	47.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	40,785,643.69	2.68

E	建筑业	29,047,181.90	1.91
F	批发和零售业	50,419,318.37	3.31
G	交通运输、仓储和邮政业	38,820,818.58	2.55
H	住宿和餐饮业	2,518,884.64	0.17
I	信息传输、软件和信息技术服务业	57,392,332.30	3.77
J	金融业	246,242,591.24	16.16
K	房地产业	83,650,768.88	5.49
L	租赁和商务服务业	13,303,350.34	0.87
M	科学研究和技术服务业	12,652,446.20	0.83
N	水利、环境和公共设施管理业	20,485,029.06	1.34
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	804,035.00	0.05
R	文化、体育和娱乐业	27,629,277.03	1.81
S	综合	3,202,065.00	0.21
	合计	1,393,390,733.25	91.42

### 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	601398	工商银行	9,741,345	43,251,571.80	2.84
2	601818	光大银行	7,976,100	29,990,136.00	1.97
3	600999	招商证券	1,667,100	27,507,150.00	1.80
4	000783	长江证券	2,187,410	25,373,956.00	1.66
5	000776	广发证券	1,377,244	23,082,609.44	1.51
6	601166	兴业银行	993,081	15,134,554.44	0.99
7	000750	国海证券	1,960,000	14,484,400.00	0.95
8	600015	华夏银行	980,000	9,692,200.00	0.64
9	601601	中国太保	338,664	9,157,474.56	0.60
10	601318	中国平安	285,432	9,145,241.28	0.60
11	601336	新华保险	222,223	8,977,809.20	0.59
12	601628	中国人寿	429,035	8,932,508.70	0.59
13	600837	海通证券	490,000	7,555,800.00	0.50
14	300302	同有科技	219,466	7,126,061.02	0.47
15	300370	安控科技	625,800	7,109,088.00	0.47

16	601988	中国银行	1,960,000	6,291,600.00	0.41
17	603020	爱普股份	263,075	6,021,786.75	0.40
18	002361	神剑股份	751,898	5,834,728.48	0.38
19	000848	承德露露	476,710	5,696,684.50	0.37
20	300342	天银机电	185,000	5,635,100.00	0.37
21	000869	张裕A	138,300	5,556,894.00	0.36
22	300305	裕兴股份	398,200	5,519,052.00	0.36
23	000858	五粮液	165,300	5,377,209.00	0.35
24	300018	中元股份	419,900	5,336,929.00	0.35
25	002304	洋河股份	74,000	5,322,080.00	0.35
26	300012	华测检测	426,900	5,285,022.00	0.35
27	300389	艾比森	209,905	5,157,365.85	0.34
28	002221	东华能源	416,300	5,074,697.00	0.33
29	300122	智飞生物	321,436	4,972,614.92	0.33
30	002748	世龙实业	297,900	4,960,035.00	0.33
31	000035	中国天楹	687,800	4,862,746.00	0.32
32	600845	宝信软件	208,920	4,661,005.20	0.31
33	300165	天瑞仪器	427,300	4,627,659.00	0.30
34	002677	浙江美大	414,767	4,504,369.62	0.30
35	603366	日出东方	526,499	4,422,591.60	0.29
36	300480	光力科技	167,123	4,371,937.68	0.29
37	300303	聚飞光电	459,600	4,370,796.00	0.29
38	300393	中来股份	116,100	4,258,548.00	0.28
39	300452	山河药辅	86,900	4,233,768.00	0.28
40	600606	绿地控股	388,601	4,204,662.82	0.28
41	600551	时代出版	209,749	4,186,590.04	0.27
42	002516	旷达科技	691,300	4,168,539.00	0.27
43	000665	湖北广电	279,200	4,137,744.00	0.27
44	002520	日发精机	279,300	4,122,468.00	0.27
45	300204	舒泰神	222,706	4,106,698.64	0.27
46	000552	靖远煤电	1,156,300	4,070,176.00	0.27
47	300211	亿通科技	294,780	4,047,329.40	0.27
48	603588	高能环境	148,500	4,046,625.00	0.27
49	002618	丹邦科技	116,000	3,931,240.00	0.26
50	600757	长江传媒	466,500	3,913,935.00	0.26
51	601633	长城汽车	458,571	3,870,339.24	0.25
52	300449	汉邦高科	67,555	3,860,092.70	0.25
53	002258	利尔化学	410,500	3,854,595.00	0.25
54	000625	长安汽车	280,500	3,834,435.00	0.25

55	600373	中文传媒	184,065	3,819,348.75	0.25
56	600104	上汽集团	187,170	3,797,679.30	0.25
57	603111	康尼机电	274,173	3,679,401.66	0.24
58	002540	亚太科技	412,500	3,597,000.00	0.24
59	300366	创意信息	94,500	3,577,770.00	0.23
60	601890	亚星锚链	392,256	3,565,607.04	0.23
61	000692	惠天热电	638,900	3,565,062.00	0.23
62	002753	永东股份	139,275	3,520,872.00	0.23
63	600795	国电电力	1,195,300	3,502,229.00	0.23
64	600543	莫高股份	254,700	3,479,202.00	0.23
65	300428	四通新材	56,600	3,455,996.00	0.23
66	002507	涪陵榨菜	286,960	3,454,998.40	0.23
67	000902	新洋丰	272,866	3,413,553.66	0.22
68	300448	浩云科技	94,764	3,383,074.80	0.22
69	600804	鹏博士	185,527	3,382,157.21	0.22
70	300315	掌趣科技	322,300	3,380,927.00	0.22
71	600011	华能国际	448,395	3,371,930.40	0.22
72	600238	海南椰岛	282,100	3,371,095.00	0.22
73	300019	硅宝科技	187,306	3,369,634.94	0.22
74	000600	建投能源	384,500	3,356,685.00	0.22
75	300455	康拓红外	148,850	3,340,194.00	0.22
76	600271	航天信息	140,200	3,336,760.00	0.22
77	300115	长盈精密	161,640	3,329,784.00	0.22
78	002124	天邦股份	312,520	3,328,338.00	0.22
79	002735	王子新材	80,761	3,326,545.59	0.22
80	300066	三川智慧	339,100	3,319,789.00	0.22
81	600027	华电国际	669,357	3,313,317.15	0.22
82	300272	开能环保	210,400	3,246,472.00	0.21
83	600854	春兰股份	427,417	3,192,804.99	0.21
84	000418	小天鹅 A	97,200	3,170,664.00	0.21
85	000966	长源电力	486,200	3,160,300.00	0.21
86	002203	海亮股份	406,600	3,159,282.00	0.21
87	000651	格力电器	142,950	3,154,906.50	0.21
88	300249	依米康	318,000	3,141,840.00	0.21
89	300446	乐凯新材	63,664	3,132,268.80	0.21
90	600261	阳光照明	439,433	3,102,396.98	0.20
91	300453	三鑫医疗	118,400	3,100,896.00	0.20
92	002382	蓝帆医疗	275,700	3,098,868.00	0.20
93	600185	格力地产	494,500	3,070,845.00	0.20

94	002475	立讯精密	155,600	3,057,540.00	0.20
95	600970	中材国际	485,300	3,057,390.00	0.20
96	300089	文化长城	246,300	3,034,416.00	0.20
97	300440	运达科技	90,000	3,033,900.00	0.20
98	000415	渤海金控	442,500	3,017,850.00	0.20
99	002101	广东鸿图	139,071	3,006,715.02	0.20
100	002745	木林森	87,763	2,983,064.37	0.20
101	603519	立霸股份	136,200	2,982,780.00	0.20
102	000965	天保基建	502,100	2,972,432.00	0.20
103	300343	联创互联	136,200	2,956,902.00	0.19
104	000333	美的集团	124,450	2,951,954.00	0.19
105	002588	史丹利	238,800	2,949,180.00	0.19
106	601000	唐山港	755,920	2,932,969.60	0.19
107	300352	北信源	156,900	2,929,323.00	0.19
108	002493	荣盛石化	240,100	2,910,012.00	0.19
109	000506	中润资源	383,827	2,890,217.31	0.19
110	600295	鄂尔多斯	365,226	2,881,633.14	0.19
111	000030	富奥股份	400,900	2,874,453.00	0.19
112	000430	张家界	250,800	2,846,580.00	0.19
113	600887	伊利股份	170,495	2,842,151.65	0.19
114	601968	宝钢包装	275,500	2,826,630.00	0.19
115	000423	东阿阿胶	53,200	2,810,556.00	0.18
116	603268	松发股份	70,289	2,806,639.77	0.18
117	600859	王府井	183,184	2,791,724.16	0.18
118	600690	青岛海尔	314,329	2,791,241.52	0.18
119	300146	汤臣倍健	206,100	2,790,594.00	0.18
120	600389	江山股份	200,638	2,788,868.20	0.18
121	300041	回天新材	193,696	2,787,285.44	0.18
122	603158	腾龙股份	117,000	2,786,940.00	0.18
123	002096	南岭民爆	186,400	2,777,360.00	0.18
124	601390	中国中铁	397,300	2,769,181.00	0.18
125	601677	明泰铝业	207,500	2,768,050.00	0.18
126	601313	江南嘉捷	191,035	2,766,186.80	0.18
127	300139	晓程科技	187,700	2,761,067.00	0.18
128	300232	洲明科技	173,500	2,749,975.00	0.18
129	002692	远程电缆	334,377	2,741,891.40	0.18
130	000529	广弘控股	334,100	2,732,938.00	0.18
131	603099	长白山	152,105	2,724,200.55	0.18
132	600750	江中药业	85,600	2,722,080.00	0.18

133	603369	今世缘	202,742	2,720,797.64	0.18
134	600176	中国巨石	284,220	2,719,985.40	0.18
135	601669	中国电建	476,100	2,718,531.00	0.18
136	002086	东方海洋	310,600	2,717,750.00	0.18
137	601186	中国铁建	272,300	2,712,108.00	0.18
138	600073	上海梅林	236,754	2,710,833.30	0.18
139	300043	互动娱乐	191,100	2,707,887.00	0.18
140	300283	温州宏丰	288,550	2,706,599.00	0.18
141	300407	凯发电气	136,500	2,704,065.00	0.18
142	002732	燕塘乳业	101,600	2,701,544.00	0.18
143	000553	沙隆达 A	250,900	2,679,612.00	0.18
144	300482	万孚生物	50,500	2,673,975.00	0.18
145	002531	天顺风能	416,100	2,667,201.00	0.18
146	600068	XD 葛洲坝	456,966	2,659,542.12	0.17
147	000926	福星股份	226,600	2,658,018.00	0.17
148	002706	良信电器	97,200	2,647,728.00	0.17
149	000999	华润三九	109,200	2,644,824.00	0.17
150	600518	康美药业	173,800	2,640,022.00	0.17
151	300394	天孚通信	64,550	2,634,285.50	0.17
152	300225	金力泰	369,465	2,630,590.80	0.17
153	603306	华懋科技	76,400	2,630,452.00	0.17
154	000895	双汇发展	125,129	2,612,693.52	0.17
155	300416	苏试试验	75,500	2,612,300.00	0.17
156	002400	省广股份	184,300	2,604,159.00	0.17
157	002752	昇兴股份	153,850	2,590,834.00	0.17
158	601678	滨化股份	507,300	2,582,157.00	0.17
159	002244	滨江集团	385,200	2,580,840.00	0.17
160	002158	汉钟精机	209,140	2,578,696.20	0.17
161	600117	西宁特钢	512,400	2,577,372.00	0.17
162	603969	银龙股份	193,200	2,575,356.00	0.17
163	002020	京新药业	207,800	2,570,486.00	0.17
164	002742	三圣特材	111,100	2,568,632.00	0.17
165	600510	黑牡丹	294,191	2,565,345.52	0.17
166	000898	鞍钢股份	669,100	2,562,653.00	0.17
167	600376	首开股份	230,200	2,559,824.00	0.17
168	600612	老凤祥	62,577	2,556,270.45	0.17
169	002766	索菱股份	80,300	2,548,722.00	0.17
170	600340	华夏幸福	104,300	2,542,834.00	0.17
171	300328	宜安科技	144,500	2,540,310.00	0.17

172	603566	普莱柯	115,000	2,528,850.00	0.17
173	000402	金融街	259,787	2,525,129.64	0.17
174	300397	天和防务	74,100	2,519,400.00	0.17
175	603022	新通联	121,450	2,518,873.00	0.17
176	002141	蓉胜超微	83,300	2,515,660.00	0.17
177	603899	晨光文具	142,000	2,513,400.00	0.16
178	601101	昊华能源	397,000	2,513,010.00	0.16
179	601158	重庆水务	390,100	2,508,343.00	0.16
180	600438	通威股份	393,800	2,504,568.00	0.16
181	603611	诺力股份	98,700	2,504,019.00	0.16
182	300261	雅本化学	205,200	2,497,284.00	0.16
183	600048	保利地产	289,300	2,496,659.00	0.16
184	600332	白云山	101,122	2,491,646.08	0.16
185	002470	金正大	309,400	2,490,670.00	0.16
186	603011	合锻智能	215,200	2,487,712.00	0.16
187	000540	中天城投	398,800	2,484,524.00	0.16
188	603108	润达医疗	88,000	2,480,720.00	0.16
189	600724	宁波富达	485,918	2,478,181.80	0.16
190	000623	吉林敖东	99,117	2,472,969.15	0.16
191	300091	金通灵	168,800	2,462,792.00	0.16
192	300265	通光线缆	198,900	2,462,382.00	0.16
193	300301	长方集团	290,700	2,462,229.00	0.16
194	600313	农发种业	475,900	2,460,403.00	0.16
195	300360	炬华科技	108,643	2,458,591.09	0.16
196	300358	楚天科技	126,700	2,455,446.00	0.16
197	002119	康强电子	118,800	2,430,648.00	0.16
198	300472	新元科技	76,752	2,419,990.56	0.16
199	300250	初灵信息	81,662	2,416,378.58	0.16
200	600617	国新能源	210,600	2,413,476.00	0.16
201	300447	全信股份	53,800	2,403,246.00	0.16
202	600248	延长化建	393,549	2,400,648.90	0.16
203	300402	宝色股份	145,615	2,399,735.20	0.16
204	603889	新澳股份	165,600	2,397,888.00	0.16
205	600491	龙元建设	279,200	2,395,536.00	0.16
206	300099	尤洛卡	271,917	2,392,869.60	0.16
207	603315	福鞍股份	119,100	2,386,764.00	0.16
208	300445	康斯特	83,800	2,384,110.00	0.16
209	002592	八菱科技	72,000	2,376,000.00	0.16
210	002333	罗普斯金	243,654	2,373,189.96	0.16



211	300298	三诺生物	113,220	2,373,091.20	0.16
212	300321	同大股份	70,900	2,353,171.00	0.15
213	600658	电子城	227,100	2,345,943.00	0.15
214	000863	三湘股份	254,500	2,341,400.00	0.15
215	600320	振华重工	549,700	2,336,225.00	0.15
216	300108	双龙股份	267,800	2,329,860.00	0.15
217	002743	富煌钢构	161,300	2,325,946.00	0.15
218	002085	万丰奥威	135,200	2,324,088.00	0.15
219	600467	好当家	597,200	2,323,108.00	0.15
220	002302	西部建设	321,313	2,319,879.86	0.15
221	000801	四川九洲	188,140	2,317,884.80	0.15
222	603012	创力集团	172,100	2,309,582.00	0.15
223	300145	中金环境	105,554	2,309,521.52	0.15
224	002013	中航机电	171,200	2,307,776.00	0.15
225	600801	华新水泥	365,700	2,307,567.00	0.15
226	002314	南山控股	337,400	2,304,442.00	0.15
227	300391	康跃科技	129,500	2,303,805.00	0.15
228	000159	国际实业	300,800	2,295,104.00	0.15
229	300308	中际装备	185,683	2,295,041.88	0.15
230	600170	上海建工	598,396	2,291,856.68	0.15
231	600159	大龙地产	489,600	2,286,432.00	0.15
232	000525	红太阳	174,800	2,286,384.00	0.15
233	300292	吴通控股	68,700	2,284,962.00	0.15
234	300417	南华仪器	54,300	2,283,858.00	0.15
235	000951	中国重汽	238,872	2,283,616.32	0.15
236	002750	龙津药业	152,124	2,278,817.52	0.15
237	603718	海利生物	138,770	2,278,603.40	0.15
238	002593	日上集团	297,700	2,268,474.00	0.15
239	002584	西陇科学	170,000	2,262,700.00	0.15
240	600716	凤凰股份	303,900	2,261,016.00	0.15
241	600322	天房发展	506,600	2,259,436.00	0.15
242	300258	精锻科技	139,500	2,254,320.00	0.15
243	603688	石英股份	108,200	2,252,724.00	0.15
244	600819	耀皮玻璃	361,100	2,249,653.00	0.15
245	600792	云煤能源	441,900	2,240,433.00	0.15
246	603699	纽威股份	126,168	2,238,220.32	0.15
247	600507	方大特钢	466,200	2,237,760.00	0.15
248	600810	神马股份	299,400	2,236,518.00	0.15
249	600008	首创股份	574,700	2,235,583.00	0.15

250	002016	世荣兆业	270,650	2,235,569.00	0.15
251	600708	光明地产	264,185	2,216,512.15	0.15
252	600162	香江控股	528,000	2,212,320.00	0.15
253	000544	中原环保	154,100	2,202,089.00	0.14
254	600052	浙江广厦	318,800	2,193,344.00	0.14
255	002399	海普瑞	125,500	2,191,230.00	0.14
256	600548	深高速	279,200	2,174,968.00	0.14
257	601668	中国建筑	408,300	2,172,156.00	0.14
258	601008	连云港	457,700	2,169,498.00	0.14
259	603006	黎明股份	87,200	2,165,176.00	0.14
260	002534	杭锅股份	203,050	2,162,482.50	0.14
261	002762	金发拉比	41,176	2,159,269.44	0.14
262	600279	重庆港九	302,400	2,156,112.00	0.14
263	002122	天马股份	345,800	2,150,876.00	0.14
264	300119	瑞普生物	134,000	2,150,700.00	0.14
265	600136	当代明诚	92,700	2,146,005.00	0.14
266	600459	贵研铂业	71,800	2,145,384.00	0.14
267	300150	世纪瑞尔	197,700	2,141,091.00	0.14
268	300270	中威电子	125,700	2,140,671.00	0.14
269	000088	盐田港	332,300	2,140,012.00	0.14
270	000736	中房地产	146,580	2,138,602.20	0.14
271	600681	百川能源	197,250	2,138,190.00	0.14
272	600784	鲁银投资	242,500	2,136,425.00	0.14
273	600361	华联综超	342,900	2,136,267.00	0.14
274	601339	百隆东方	335,800	2,132,330.00	0.14
275	300255	常山药业	255,300	2,118,990.00	0.14
276	002641	永高股份	257,112	2,118,602.88	0.14
277	300435	中泰股份	102,400	2,113,536.00	0.14
278	600122	宏图高科	157,800	2,111,364.00	0.14
279	000828	东莞控股	232,400	2,110,192.00	0.14
280	000683	远兴能源	804,800	2,108,576.00	0.14
281	300240	飞力达	196,808	2,101,909.44	0.14
282	600693	东百集团	312,600	2,100,672.00	0.14
283	300044	赛为智能	161,109	2,089,583.73	0.14
284	600371	万向德农	128,600	2,083,320.00	0.14
285	300172	中电环保	225,700	2,078,697.00	0.14
286	300437	清水源	76,060	2,077,198.60	0.14
287	000989	九芝堂	91,152	2,075,531.04	0.14
288	300032	金龙机电	102,430	2,058,843.00	0.14

289	002665	首航节能	260,860	2,058,185.40	0.14
290	601933	永辉超市	497,500	2,054,675.00	0.13
291	300267	尔康制药	143,300	2,052,056.00	0.13
292	000708	大冶特钢	182,900	2,048,480.00	0.13
293	600478	科力远	169,100	2,041,037.00	0.13
294	601137	博威合金	151,838	2,036,147.58	0.13
295	300423	鲁亿通	71,220	2,033,331.00	0.13
296	300264	佳创视讯	155,000	2,032,050.00	0.13
297	000631	顺发恒业	417,180	2,031,666.60	0.13
298	600657	信达地产	405,200	2,017,896.00	0.13
299	002578	闽发铝业	213,950	2,017,548.50	0.13
300	601113	华鼎股份	204,517	2,016,537.62	0.13
301	002469	三维工程	223,800	2,016,438.00	0.13
302	000524	岭南控股	154,108	2,015,732.64	0.13
303	600215	长春经开	285,000	2,014,950.00	0.13
304	600184	光电股份	88,662	2,007,307.68	0.13
305	300395	菲利华	74,900	2,005,822.00	0.13
306	300050	世纪鼎利	139,100	2,001,649.00	0.13
307	002295	精艺股份	127,150	1,996,255.00	0.13
308	000560	昆百大 A	222,300	1,996,254.00	0.13
309	002687	乔治白	165,800	1,987,942.00	0.13
310	000759	中百集团	287,550	1,986,970.50	0.13
311	600688	上海石化	325,300	1,984,330.00	0.13
312	300351	永贵电器	58,400	1,981,512.00	0.13
313	601616	广电电气	349,500	1,978,170.00	0.13
314	600683	京投发展	213,855	1,976,020.20	0.13
315	600028	中国石化	418,300	1,974,376.00	0.13
316	600188	XD 兖州煤	180,400	1,973,576.00	0.13
317	600743	华远地产	414,800	1,962,004.00	0.13
318	002143	印纪传媒	83,588	1,958,466.84	0.13
319	603518	XD 维格娜	66,300	1,957,839.00	0.13
320	603456	九洲药业	75,700	1,954,574.00	0.13
321	002180	艾派克	68,485	1,953,877.05	0.13
322	000516	国际医学	333,800	1,952,730.00	0.13
323	600858	银座股份	237,424	1,944,502.56	0.13
324	002449	国星光电	146,200	1,940,074.00	0.13
325	002656	摩登大道	138,700	1,934,865.00	0.13
326	600246	万通地产	379,150	1,933,665.00	0.13
327	600019	宝钢股份	393,600	1,928,640.00	0.13

328	000678	襄阳轴承	243,300	1,922,070.00	0.13
329	600578	京能电力	447,197	1,914,003.16	0.13
330	601188	龙江交通	470,500	1,905,525.00	0.13
331	002300	太阳电缆	195,757	1,904,715.61	0.12
332	600223	鲁商置业	371,400	1,894,140.00	0.12
333	300219	鸿利光电	121,400	1,891,412.00	0.12
334	002542	中化岩土	248,500	1,883,630.00	0.12
335	000908	景峰医药	155,750	1,881,460.00	0.12
336	002228	合兴包装	337,500	1,876,500.00	0.12
337	600029	南方航空	264,600	1,868,076.00	0.12
338	600221	海南航空	583,700	1,850,329.00	0.12
339	300355	蒙草生态	259,600	1,845,756.00	0.12
340	600780	通宝能源	366,076	1,837,701.52	0.12
341	300364	中文在线	35,100	1,825,200.00	0.12
342	000413	东旭光电	211,200	1,814,208.00	0.12
343	600115	东方航空	274,100	1,811,801.00	0.12
344	000539	粤电力A	359,900	1,806,698.00	0.12
345	603606	东方电缆	130,440	1,806,594.00	0.12
346	603998	方盛制药	123,000	1,805,640.00	0.12
347	601111	XD 中国国	265,700	1,796,132.00	0.12
348	002038	双鹭药业	59,300	1,789,674.00	0.12
349	601798	蓝科高新	146,100	1,786,803.00	0.12
350	000661	长春高新	16,710	1,782,622.80	0.12
351	002194	武汉凡谷	138,801	1,773,876.78	0.12
352	002408	齐翔腾达	322,800	1,772,172.00	0.12
353	000032	深桑达A	115,569	1,767,050.01	0.12
354	002126	银轮股份	200,100	1,764,882.00	0.12
355	600297	广汇汽车	200,096	1,742,836.16	0.11
356	300378	鼎捷软件	60,550	1,738,996.00	0.11
357	000920	南方汇通	97,400	1,733,720.00	0.11
358	000718	苏宁环球	131,500	1,721,335.00	0.11
359	601999	出版传媒	180,100	1,714,552.00	0.11
360	300460	惠伦晶体	62,360	1,693,074.00	0.11
361	601801	皖新传媒	145,066	1,692,920.22	0.11
362	000612	焦作万方	235,130	1,678,828.20	0.11
363	002023	海特高新	96,749	1,676,660.17	0.11
364	600747	大连控股	381,700	1,668,029.00	0.11
365	002160	常铝股份	190,303	1,667,054.28	0.11
366	002128	露天煤业	221,286	1,661,857.86	0.11

367	603300	华铁科技	115,100	1,648,232.00	0.11
368	601088	中国神华	116,850	1,644,079.50	0.11
369	300008	天海防务	49,169	1,637,327.70	0.11
370	600825	新华传媒	205,000	1,629,750.00	0.11
371	002670	华声股份	60,367	1,628,097.99	0.11
372	300184	力源信息	147,500	1,626,925.00	0.11
373	600196	复星医药	85,400	1,624,308.00	0.11
374	600547	山东黄金	41,300	1,606,983.00	0.11
375	000719	大地传媒	149,204	1,575,594.24	0.10
376	600038	中直股份	37,900	1,572,092.00	0.10
377	601766	中国中车	170,000	1,558,900.00	0.10
378	000738	中航动控	58,700	1,549,680.00	0.10
379	601989	中国重工	244,600	1,548,318.00	0.10
380	000563	陕国投 A	280,754	1,541,339.46	0.10
381	002041	登海种业	98,345	1,528,281.30	0.10
382	600262	北方股份	56,901	1,525,515.81	0.10
383	000002	万科 A	83,572	1,521,010.40	0.10
384	002027	分众传媒	90,600	1,495,806.00	0.10
385	601069	西部黄金	64,400	1,494,724.00	0.10
386	601369	陕鼓动力	230,804	1,472,529.52	0.10
387	002460	赣锋锂业	42,600	1,424,970.00	0.09
388	000022	深赤湾 A	89,855	1,416,114.80	0.09
389	002104	恒宝股份	86,100	1,415,484.00	0.09
390	600305	恒顺醋业	122,600	1,412,352.00	0.09
391	603118	共进股份	34,700	1,411,943.00	0.09
392	002466	天齐锂业	33,040	1,410,477.60	0.09
393	600522	DR 中天科	143,500	1,406,300.00	0.09
394	002401	中海科技	76,600	1,404,844.00	0.09
395	002415	海康威视	65,400	1,403,484.00	0.09
396	600187	国中水务	314,200	1,401,332.00	0.09
397	600150	中国船舶	62,800	1,397,928.00	0.09
398	300020	银江股份	74,800	1,391,280.00	0.09
399	002561	徐家汇	113,600	1,381,376.00	0.09
400	600850	华东电脑	48,140	1,381,136.60	0.09
401	300170	汉得信息	90,800	1,378,344.00	0.09
402	600485	信威集团	77,000	1,373,680.00	0.09
403	600125	铁龙物流	214,839	1,368,524.43	0.09
404	000063	中兴通讯	95,160	1,364,594.40	0.09
405	600487	亨通光电	107,300	1,349,834.00	0.09

406	600687	刚泰控股	81,700	1,328,442.00	0.09
407	002467	二六三	85,600	1,319,096.00	0.09
408	601857	中国石油	180,200	1,302,846.00	0.09
409	002236	大华股份	99,408	1,302,244.80	0.09
410	601006	大秦铁路	198,917	1,281,025.48	0.08
411	002152	广电运通	77,550	1,274,922.00	0.08
412	603993	洛阳钼业	306,375	1,271,456.25	0.08
413	600291	西水股份	63,400	1,259,758.00	0.08
414	601333	广深铁路	319,000	1,247,290.00	0.08
415	600635	大众公用	206,100	1,242,783.00	0.08
416	000096	广聚能源	103,200	1,240,464.00	0.08
417	600060	海信电器	69,800	1,234,064.00	0.08
418	600759	洲际油气	162,700	1,233,266.00	0.08
419	300079	数码视讯	143,200	1,227,224.00	0.08
420	002519	银河电子	54,500	1,221,890.00	0.08
421	002649	博彦科技	30,800	1,218,756.00	0.08
422	600050	XD 中国联	313,454	1,194,259.74	0.08
423	002195	二三四五	96,800	1,189,672.00	0.08
424	300384	三联虹普	22,900	1,151,870.00	0.08
425	000419	通程控股	157,200	1,144,416.00	0.08
426	603018	设计股份	39,500	1,139,970.00	0.07
427	601222	林洋能源	27,040	1,131,624.00	0.07
428	002429	兆驰股份	133,600	1,119,568.00	0.07
429	000810	创维数字	60,600	1,095,042.00	0.07
430	601908	京运通	139,400	1,069,198.00	0.07
431	000001	平安银行	122,400	1,064,880.00	0.07
432	601009	南京银行	112,600	1,057,314.00	0.07
433	300026	红日药业	60,550	1,052,964.50	0.07
434	002025	航天电器	41,700	1,029,573.00	0.07
435	601998	中信银行	178,000	1,009,260.00	0.07
436	600655	豫园商城	92,300	1,000,532.00	0.07
437	601969	海南矿业	89,117	999,892.74	0.07
438	002099	海翔药业	102,900	979,608.00	0.06
439	002550	千红制药	116,890	974,862.60	0.06
440	000513	丽珠集团	21,100	972,921.00	0.06
441	600566	济川药业	37,500	965,250.00	0.06
442	603017	中衡设计	50,800	963,676.00	0.06
443	002635	安洁科技	25,100	963,338.00	0.06
444	603806	福斯特	18,453	963,062.07	0.06

445	002028	思源电气	87,600	959,220.00	0.06
446	600531	豫光金铅	114,800	958,580.00	0.06
447	002501	利源精制	88,700	957,960.00	0.06
448	600018	上港集团	185,800	947,580.00	0.06
449	601012	隆基股份	72,300	943,515.00	0.06
450	600704	物产中大	100,700	942,552.00	0.06
451	002231	奥维通信	60,910	941,668.60	0.06
452	600717	天津港	107,796	936,747.24	0.06
453	002294	信立泰	34,300	932,960.00	0.06
454	002416	爱施德	46,900	931,434.00	0.06
455	000693	ST 华泽	74,246	928,075.00	0.06
456	600380	健康元	100,000	918,000.00	0.06
457	600525	长园集团	65,597	908,518.45	0.06
458	600643	爱建集团	92,909	907,720.93	0.06
459	002202	金风科技	59,800	904,774.00	0.06
460	300118	东方日升	47,300	892,078.00	0.06
461	002324	普利特	30,500	888,160.00	0.06
462	600476	湘邮科技	31,300	882,347.00	0.06
463	600143	金发科技	136,000	875,840.00	0.06
464	600705	中航资本	148,200	871,416.00	0.06
465	002179	中航光电	20,100	870,732.00	0.06
466	002450	康得新	50,700	866,970.00	0.06
467	000963	华东医药	12,800	862,720.00	0.06
468	000939	凯迪生态	95,700	856,515.00	0.06
469	600062	华润双鹤	46,995	856,248.90	0.06
470	002693	双成药业	90,241	853,679.86	0.06
471	600056	中国医药	53,100	842,166.00	0.06
472	600816	安信信托	49,489	834,879.43	0.05
473	002320	海峡股份	53,500	832,995.00	0.05
474	600639	浦东金桥	33,300	831,834.00	0.05
475	000338	潍柴动力	106,400	830,984.00	0.05
476	000581	威孚高科	40,400	814,464.00	0.05
477	002157	正邦科技	34,000	797,640.00	0.05
478	603001	奥康国际	37,500	797,250.00	0.05
479	000026	飞亚达 A	69,100	789,813.00	0.05
480	000700	模塑科技	77,400	784,062.00	0.05
481	600660	福耀玻璃	56,000	784,000.00	0.05
482	601607	上海医药	43,300	781,565.00	0.05
483	600398	海澜之家	69,100	780,830.00	0.05

484	603167	渤海轮渡	77,500	771,125.00	0.05
485	600064	南京高科	51,569	770,956.55	0.05
486	603568	伟明环保	33,263	768,375.30	0.05
487	002327	富安娜	90,000	765,900.00	0.05
488	000826	启迪桑德	25,000	763,750.00	0.05
489	002233	塔牌集团	95,100	763,653.00	0.05
490	601117	中国化学	137,400	759,822.00	0.05
491	600292	远达环保	59,500	753,865.00	0.05
492	601992	金隅股份	96,800	750,200.00	0.05
493	600741	华域汽车	53,082	743,678.82	0.05
494	601566	九牧王	48,035	741,660.40	0.05
495	600668	XD 尖峰集	49,400	740,012.00	0.05
496	600742	一汽富维	58,600	731,914.00	0.05
497	300191	潜能恒信	16,000	731,680.00	0.05
498	600663	陆家嘴	32,160	731,640.00	0.05
499	600895	张江高科	40,300	728,624.00	0.05
500	600585	海螺水泥	49,590	721,038.60	0.05
501	601872	招商轮船	153,000	716,040.00	0.05
502	601618	中国中冶	192,300	709,587.00	0.05
503	600511	国药股份	25,800	707,436.00	0.05
504	002065	东华软件	37,800	707,238.00	0.05
505	600026	中海发展	118,700	700,330.00	0.05
506	002100	天康生物	76,052	683,707.48	0.04
507	000876	新希望	81,654	679,361.28	0.04
508	600177	雅戈尔	48,500	668,815.00	0.04
509	000789	万年青	107,000	661,260.00	0.04
510	600619	海立股份	54,500	656,725.00	0.04
511	600738	兰州民百	76,700	651,183.00	0.04
512	300210	森远股份	35,899	641,874.12	0.04
513	300133	华策影视	39,800	619,686.00	0.04
514	600665	天地源	124,000	601,400.00	0.04
515	600270	外运发展	32,999	577,152.51	0.04
516	600499	科达洁能	33,500	566,485.00	0.04
517	000978	桂林旅游	53,500	562,285.00	0.04
518	600843	上工申贝	40,500	555,255.00	0.04
519	600676	交运股份	61,800	551,874.00	0.04
520	002367	康力电梯	35,700	549,780.00	0.04
521	600835	上海机电	28,078	538,816.82	0.04
522	002344	海宁皮城	54,430	530,692.50	0.03



523	600057	象屿股份	51,300	527,364.00	0.03
524	600761	安徽合力	52,100	525,689.00	0.03
525	601038	一拖股份	55,400	524,638.00	0.03
526	603686	龙马环卫	14,300	521,521.00	0.03
527	600790	轻纺城	88,200	517,734.00	0.03
528	600824	益民集团	86,450	516,106.50	0.03
529	600009	上海机场	19,600	510,580.00	0.03
530	600388	龙净环保	40,600	509,936.00	0.03
531	000428	华天酒店	76,700	503,152.00	0.03
532	600004	白云机场	40,200	492,852.00	0.03
533	600897	厦门空港	23,498	492,518.08	0.03
534	000089	深圳机场	57,300	487,050.00	0.03
535	600573	惠泉啤酒	36,500	484,720.00	0.03
536	603979	金诚信	20,000	479,800.00	0.03
537	600894	广日股份	35,865	478,080.45	0.03
538	002325	洪涛股份	51,080	469,425.20	0.03
539	600729	重庆百货	18,700	463,760.00	0.03
540	002738	中矿资源	22,850	458,142.50	0.03
541	002554	惠博普	62,400	449,280.00	0.03
542	000685	中山公用	41,300	428,694.00	0.03
543	300101	振芯科技	15,300	427,329.00	0.03
544	600323	瀚蓝环境	33,500	425,115.00	0.03
545	002640	跨境通	24,100	424,642.00	0.03
546	000501	鄂武商 A	26,500	415,785.00	0.03
547	600327	大东方	46,600	415,672.00	0.03
548	002375	亚厦股份	36,500	412,450.00	0.03
549	600168	武汉控股	42,100	410,896.00	0.03
550	600694	大商股份	10,600	408,312.00	0.03
551	002081	金螳螂	40,600	406,812.00	0.03
552	000598	兴蓉环境	77,000	406,560.00	0.03
552	600118	中国卫星	12,100	406,560.00	0.03
553	600486	扬农化工	14,700	402,780.00	0.03
554	600309	万华化学	23,200	401,360.00	0.03
555	002074	国轩高科	10,000	394,700.00	0.03
556	002277	友阿股份	34,200	393,984.00	0.03
557	600312	平高电气	25,000	391,500.00	0.03
558	002250	联化科技	27,300	390,936.00	0.03
559	600879	航天电子	25,000	389,500.00	0.03
560	600426	华鲁恒升	44,091	388,441.71	0.03

561	000906	物产中拓	32,700	388,149.00	0.03
562	600517	置信电气	40,800	388,008.00	0.03
563	002056	横店东磁	22,800	387,600.00	0.03
564	600089	特变电工	45,449	387,225.48	0.03
565	000627	天茂集团	49,000	378,770.00	0.02
566	000541	佛山照明	36,300	373,527.00	0.02
567	600287	江苏舜天	40,875	373,188.75	0.02
568	002004	华邦健康	40,800	372,504.00	0.02
569	601179	中国西电	73,100	370,617.00	0.02
570	002597	金禾实业	27,500	370,425.00	0.02
571	600755	厦门国贸	46,500	369,675.00	0.02
572	600677	XD 航天通	20,000	369,000.00	0.02
573	002008	大族激光	16,100	367,724.00	0.02
574	002391	长青股份	25,700	367,510.00	0.02
575	603188	亚邦股份	20,450	367,282.00	0.02
576	600054	黄山旅游	22,769	366,353.21	0.02
577	300144	宋城演艺	14,700	366,177.00	0.02
578	002411	必康股份	20,500	365,925.00	0.02
579	300124	汇川技术	18,800	364,720.00	0.02
580	601877	正泰电器	19,300	363,805.00	0.02
581	002033	丽江旅游	28,200	357,576.00	0.02
582	601888	中国国旅	8,100	356,238.00	0.02
583	600739	辽宁成大	22,800	354,996.00	0.02
584	000888	峨眉山 A	29,400	353,976.00	0.02
585	600138	中青旅	18,200	351,624.00	0.02
586	600885	宏发股份	11,400	350,094.00	0.02
587	002091	江苏国泰	21,950	347,907.50	0.02
588	300427	红相电力	15,400	337,106.00	0.02
589	600260	凯乐科技	20,600	337,016.00	0.02
590	603558	健盛集团	17,200	324,564.00	0.02
591	300171	东富龙	16,700	315,296.00	0.02
592	002223	鱼跃医疗	9,600	304,512.00	0.02
593	002131	利欧股份	17,700	302,493.00	0.02
594	600846	同济科技	30,500	301,950.00	0.02
595	300242	明家联合	8,600	300,914.00	0.02
596	300058	蓝色光标	30,400	295,184.00	0.02
597	600529	山东药玻	16,655	293,294.55	0.02
598	000762	西藏矿业	11,600	286,752.00	0.02
599	600811	东方集团	42,500	283,050.00	0.02

600	000150	宜华健康	8,900	277,502.00	0.02
601	300015	爱尔眼科	7,500	273,975.00	0.02
602	002185	华天科技	21,180	269,621.40	0.02
603	300183	东软载波	10,000	265,000.00	0.02
604	002053	云南盐化	9,300	264,027.00	0.02
605	002661	克明面业	16,000	262,560.00	0.02
606	000421	南京公用	26,146	261,721.46	0.02
607	601216	君正集团	35,000	261,450.00	0.02
608	600335	国机汽车	23,057	258,468.97	0.02
609	300373	扬杰科技	10,680	257,494.80	0.02
610	002444	巨星科技	12,600	256,032.00	0.02
611	600409	三友化工	37,500	252,750.00	0.02
612	600763	通策医疗	8,100	252,558.00	0.02
613	002532	新界泵业	16,701	250,515.00	0.02
614	000919	金陵药业	19,100	250,019.00	0.02
615	002686	亿利达	18,400	249,136.00	0.02
616	600218	全柴动力	24,200	247,324.00	0.02
617	600172	黄河旋风	13,300	245,119.00	0.02
618	300064	豫金刚石	23,500	239,230.00	0.02
619	002595	豪迈科技	11,018	235,454.66	0.02
620	002426	胜利精密	23,350	229,997.50	0.02
621	300443	金雷风电	3,400	226,814.00	0.01
622	601965	中国汽研	22,497	216,196.17	0.01
623	000039	中集集团	15,137	214,491.29	0.01
624	002724	海洋王	9,691	213,783.46	0.01
625	601028	玉龙股份	29,300	209,202.00	0.01
626	002487	大金重工	23,200	205,320.00	0.01
627	002682	龙洲股份	15,600	197,964.00	0.01
628	000998	隆平高科	9,200	174,616.00	0.01
629	600979	广安爱众	27,900	164,610.00	0.01
630	002772	众兴菌业	6,274	157,038.22	0.01
631	600105	永鼎股份	10,400	97,448.00	0.01
632	600350	山东高速	17,500	92,750.00	0.01
633	601107	四川成渝	18,800	92,120.00	0.01
634	600723	首商股份	10,182	90,925.26	0.01
635	600033	福建高速	28,600	90,662.00	0.01
636	002216	三全食品	7,200	61,920.00	0.00
637	600830	香溢融通	5,300	49,714.00	0.00
638	600685	中船防务	1,000	25,360.00	0.00

639	300312	邦讯技术	1,100	21,780.00	0.00
640	300406	九强生物	1,000	21,450.00	0.00
641	600370	三房巷	2,200	11,484.00	0.00
642	603338	浙江鼎力	50	2,305.00	0.00
643	300252	金信诺	66	2,186.58	0.00
644	601098	中南传媒	98	1,774.78	0.00
645	300038	梅泰诺	21	1,190.28	0.00
646	002669	康达新材	48	1,161.60	0.00
647	603918	金桥信息	20	682.00	0.00
648	601700	风范股份	49	357.21	0.00
649	000571	新大洲A	59	336.89	0.00
650	000921	海信科龙	36	285.48	0.00
651	002759	天际股份	12	190.32	0.00
652	300169	天晟新材	12	127.92	0.00
653	000530	大冷股份	9	95.94	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	601818	光大银行	60,098,356.00	3.35
2	601398	工商银行	49,759,713.18	2.77
3	600015	华夏银行	48,444,850.58	2.70
4	601328	交通银行	42,825,659.00	2.39
5	600999	招商证券	41,171,237.09	2.29
6	600837	海通证券	38,597,050.20	2.15
7	601788	光大证券	36,971,638.92	2.06
8	600030	中信证券	36,848,082.00	2.05
9	002736	国信证券	36,673,075.26	2.04
10	000783	长江证券	21,930,460.90	1.22
11	000776	广发证券	19,747,011.00	1.10
12	601166	兴业银行	19,509,738.74	1.09
13	000750	国海证券	15,494,157.33	0.86
14	601988	中国银行	13,417,600.00	0.75
15	000550	江铃汽车	13,196,322.61	0.74

16	601336	新华保险	12,849,222.81	0.72
17	300370	安控科技	12,681,502.48	0.71
18	601601	中国太保	12,222,648.63	0.68
19	603369	今世缘	12,095,939.31	0.67
20	000665	湖北广电	11,497,114.40	0.64

注：“买入金额”按买卖成交金额（成交价乘以成交数量）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	601328	交通银行	49,458,298.78	2.76
2	600030	中信证券	49,437,966.09	2.75
3	601166	兴业银行	46,004,250.23	2.56
4	600015	华夏银行	45,829,746.71	2.55
5	601288	农业银行	42,399,955.00	2.36
6	601788	光大证券	38,799,348.41	2.16
7	002736	国信证券	34,725,736.01	1.93
8	600837	海通证券	30,360,822.29	1.69
9	601818	光大银行	27,216,991.68	1.52
10	600999	招商证券	27,177,094.42	1.51
11	601318	中国平安	17,713,630.77	0.99
12	000550	江铃汽车	13,794,413.18	0.77
13	000776	广发证券	12,564,355.00	0.70
14	601801	皖新传媒	12,410,087.63	0.69
15	002543	万和电气	12,088,656.54	0.67
16	000665	湖北广电	11,958,349.06	0.67
17	600051	宁波联合	11,606,990.99	0.65
18	000732	泰禾集团	11,546,339.47	0.64
19	600507	方大特钢	11,483,087.66	0.64
20	300138	晨光生物	11,322,827.22	0.63

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	4,803,821,975.27
卖出股票收入（成交）总额	4,865,938,380.83

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

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

## 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未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	398,517.42
2	应收证券清算款	26,728,129.33
3	应收股利	-
4	应收利息	27,379.75
5	应收申购款	167,103.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,321,130.00

**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
24,772	64,225.99	52,016,507.04	3.27%	1,538,989,743.71	96.73%

**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	26,364.65	0.0017%

**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（2015年6月2日）基金份额总额	2,576,611,172.81
本报告期期初基金份额总额	1,701,243,243.63



本报告期基金总申购份额	87,478,074.77
减:本报告期基金总赎回份额	197,715,067.65
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	1,591,006,250.75

## § 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	

广发证券	1	1,392,304,465.22	14.40%	1,296,655.65	14.40%	-
华鑫证券	2	1,169,083,540.66	12.09%	1,088,769.43	12.09%	-
长江证券	2	1,155,878,096.43	11.95%	1,076,470.39	11.95%	-
中信建投	1	1,059,886,963.44	10.96%	987,074.19	10.96%	-
中信证券	5	793,906,153.34	8.21%	739,367.00	8.21%	-
兴业证券	1	769,829,333.82	7.96%	716,941.67	7.96%	-
民生证券	1	646,994,427.17	6.69%	602,544.65	6.69%	-
安信证券	2	578,844,706.14	5.99%	539,079.07	5.99%	-
国信证券	1	506,662,907.71	5.24%	471,853.79	5.24%	-
银河证券	1	475,466,952.17	4.92%	442,802.84	4.92%	-
中信万通	2	314,263,986.85	3.25%	292,672.83	3.25%	-
华创证券	1	297,375,085.49	3.08%	276,945.68	3.08%	-
国泰君安	1	259,204,837.74	2.68%	241,398.26	2.68%	-
中金公司	1	131,613,378.79	1.36%	122,571.78	1.36%	-
中银国际	2	118,230,368.33	1.22%	110,108.38	1.22%	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	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 2 家证券公司的 3 个专用交易单元：信达证券 1 个，浙商证券 2 个。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例	成交金额	占当期债 券回购 成交总额 的比例	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例
广发证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中信万通	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-

瑞银证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末通过租用的证券公司交易单元进行其他证券投资。

## 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》、《证券时报》	2016年1月12日
2	本基金招募说明书更新（2015年第1号）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年1月15日
3	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》、《证券时报》	2016年1月20日
4	本基金2015年4季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年1月21日
5	本公司关于旗下部分基金增加诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司为销售机构并开通定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年1月22日
6	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》、《证券时报》	2016年1月22日
7	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》、《证券时报》	2016年1月28日
8	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》、《证券时报》	2016年1月28日
9	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》、《证券时报》	2016年2月1日
10	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》、《证券时报》	2016年2月25日
11	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》、《证券时报》	2016年3月1日
12	本公司关于向工商银行借记卡持卡人开	《中国证券报》、《上海证	2016年3月25日

	通基金网上直销业务的公告	券报》、《证券时报》	
13	本公司关于旗下基金增加浙江同花顺基金销售有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年3月30日
14	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》、《证券时报》	2016年3月30日
15	本基金 2015 年年度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年3月30日
16	本公司关于旗下部分基金继续参与工商银行电子银行申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年3月31日
17	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》、《证券时报》	2016年3月31日
18	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》、《证券时报》	2016年3月31日
19	本公司关于旗下基金增加上海联泰资产管理有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年4月1日
20	本公司关于旗下基金参与上海联泰资产管理有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年4月1日
21	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》、《证券时报》	2016年4月11日
22	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》、《证券时报》	2016年4月11日
23	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》、《证券时报》	2016年4月12日
24	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》、《证券时报》	2016年4月12日
25	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》、《证券时报》	2016年4月15日
26	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》、《证券时报》	2016年4月15日
27	本基金 2016 年 1 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年4月20日
28	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》、《证券时报》	2016年5月17日
29	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》、《证券时报》	2016年6月6日
30	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》、《证券时报》	2016年6月8日
31	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》、《证券时报》	2016年6月16日
32	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》、《证券时报》	2016年6月16日

33	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》、《证券时报》	2016 年 6 月 20 日
34	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》、《证券时报》	2016 年 6 月 22 日
35	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》、《证券时报》	2016 年 6 月 22 日
36	本公司关于旗下部分基金在上海陆金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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 6 月 24 日
37	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》、《证券时报》	2016 年 6 月 30 日

注：上述公告同时在公司网站 [www.msfnunds.com.cn](http://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