

摩根士丹利华鑫多因子精选策略混合型证 券投资基金 2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：摩根士丹利华鑫基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
§3 主要财务指标和基金净值表现	9
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20

6.4 报表附注.....	21
§7 投资组合报告.....	43
7.1 期末基金资产组合情况.....	43
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	43
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.....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	63
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	65
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.....	65
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.....	65
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.....	65
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.....	65
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	66
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	66
7.12 投资组合报告附注.....	66
§8 基金份额持有人信息.....	68
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	68
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	68
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.....	68
§9 开放式基金份额变动.....	69
§10 重大事件揭示.....	70
10.1 基金份额持有人大会决议.....	70
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.....	70
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	70
10.4 基金投资策略的改变.....	70
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	70
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.....	70
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	70
10.8 其他重大事件.....	74
§11 备查文件目录.....	77
11.1 备查文件目录.....	77

11.2 存放地点.....	77
11.3 查阅方式.....	77

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	摩根士丹利华鑫多因子精选策略混合型证券投资基金
基金简称	大摩多因子策略混合
基金主代码	233009
交易代码	233009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 5 月 17 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	2,780,681,125.12 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过多因子量化模型方法，精选股票进行投资，在充分控制风险的前提下，力争获取超越比较基准的投资回报。
投资策略	<p>本基金采用数量化模型驱动的选股策略为主导投资策略，结合适当的资产配置策略。</p> <p>1. 股票投资策略</p> <p>本基金以“量化投资”为主要投资策略，通过基金管理人开发的“大摩多因子阿尔法模型”进行股票选择并据此构建股票投资组合。“大摩多因子阿尔法模型”在实际运行过程中将定期或不定期地进行修正，优化股票投资组合。</p> <p>2. 资产配置策略</p> <p>本基金实行在公司投资决策委员会统一指导下的资产配置机制。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，对股票资产和固定收益类资产的风险收益特征进行分析预测，</p>

	<p>确定中长期的资产配置方案。</p> <p>3. 其他金融工具投资策略</p> <p>(1) 固定收益投资策略</p> <p>本基金遵循中长期资产配置策略，进行国债、金融债、公司债等固定收益类证券以及可转换债券的投资。</p> <p>本基金采用的主要固定收益投资策略包括：利率预期策略、收益率曲线策略、信用利差策略、公司/企业债券策略、可转换债券策略等。</p> <p>(2) 股指期货投资策略</p> <p>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。</p> <p>(3) 权证投资策略</p> <p>本基金对权证的投资建立在对标的证券和组合收益风险分析的基础上，以 Black-Scholes 模型和二叉树期权定价模型为基础对权证进行分析定价，并根据市场情况对定价模型和参数进行适当修正。</p>
业绩比较基准	中证 500 指数×80% + 中证综合债券指数×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，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、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.msfunfs.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	-489,243,286.71
本期利润	-623,403,693.13
加权平均基金份额本期利润	-0.2067
本期加权平均净值利润率	-13.20%
本期基金份额净值增长率	-13.37%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	124,307,130.29
期末可供分配基金份额利润	0.0447
期末基金资产净值	3,815,126,158.50
期末基金份额净值	1.372
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	148.31%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2. 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，而非当期发生数）；

3. 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

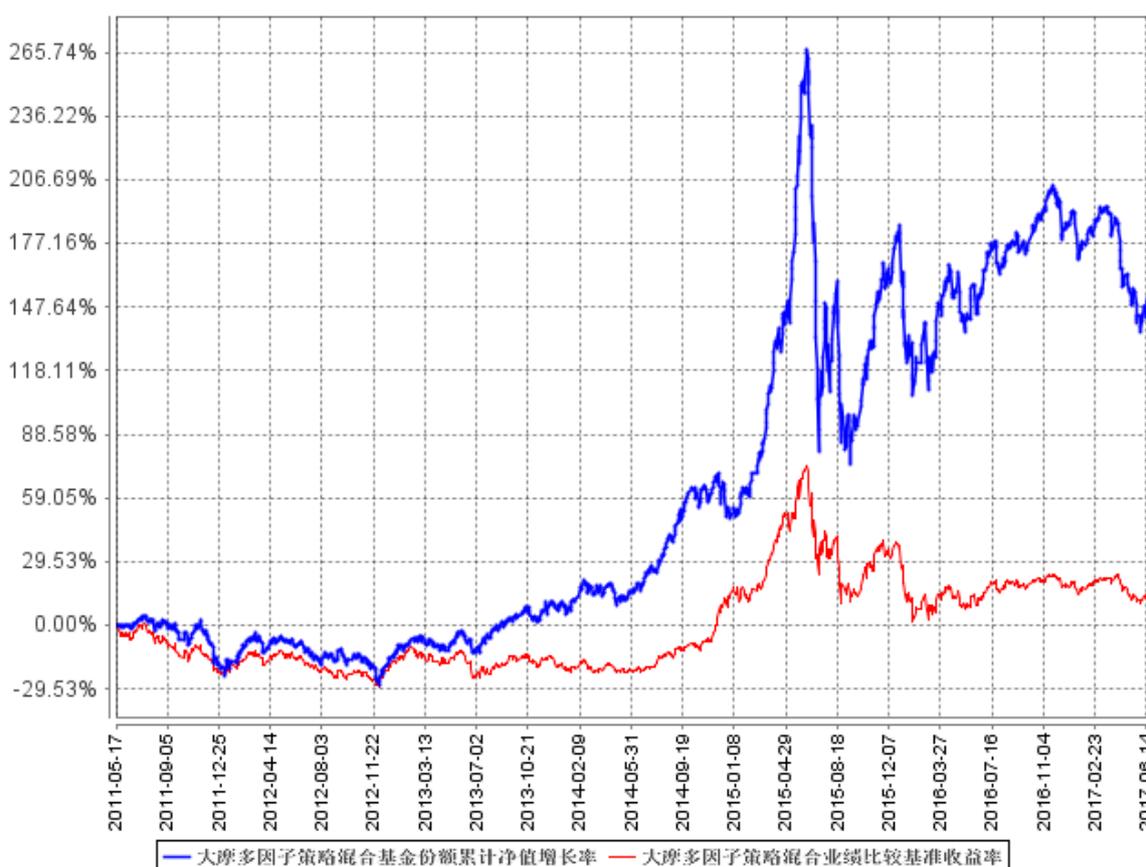
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

		准差②	率③	准差④		
过去一个月	2.07%	1.23%	4.38%	0.75%	-2.31%	0.48%
过去三个月	-11.69%	1.23%	-3.06%	0.82%	-8.63%	0.41%
过去六个月	-13.37%	1.08%	-1.13%	0.72%	-12.24%	0.36%
过去一年	-6.29%	1.00%	1.18%	0.73%	-7.47%	0.27%
过去三年	101.85%	2.08%	45.54%	1.55%	56.31%	0.53%
自基金合同 生效起至今	148.31%	1.68%	16.47%	1.32%	131.84%	0.36%

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

大摩多因子策略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



注：自 2015 年 9 月 29 日起，本基金的业绩基准由原来的“中证 800 指数×80%+中证综合债券指数×20%”变更为“中证 500 指数×80%+中证综合债券指数×20%”。上述事项已于 2015 年 9 月 29 日在指定媒体上公告。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止 2017 年 6 月 30 日，公司旗下共管理二十四只开放式基金，包括摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金、摩根士丹利华鑫资源优选混合型证券投资基金（LOF）、摩根士丹利华鑫领先优势混合型证券投资基金、摩根士丹利华鑫强收益债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫卓越成长混合型证券投资基金、摩根士丹利华鑫消费领航混合型证券投资基金、摩根士丹利华鑫多因子精选策略混合型证券投资基金、摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金、摩根士丹利华鑫主题优选混合型证券投资基金、摩根士丹利华鑫多元收益债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资基金、摩根士丹利华鑫双利增强债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫纯债稳定增利 18 个月定期开放债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫品质生活精选股票型证券投资基金、摩根士丹利华鑫进取优选股票型证券投资基金、摩根士丹利华鑫纯债稳定添利 18 个月定期开放债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫优质信价纯债债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫量化多策略股票型证券投资基金、摩根士丹利华鑫新机遇灵活配置混合型证券投资基金、摩根士丹利华鑫纯债稳定增值 18 个月定期开放债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫健康产业混合型证券投资基金、摩根士丹利华鑫多元兴利 18 个月定期开放债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫睿成中小盘弹性股票型证券投资基金和摩根士丹利华鑫睿成大盘弹性股票型证券投资基金。同时，公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
夏青	数量化	2017 年 6 月 15	-	11	美国马里兰大学金融数学

	投资部 总监	日				博士。曾担任美国摩根士丹利机构证券部副总裁，美国芝加哥交易对冲基金投资经理，美国斯考特交易对冲基金投资经理，万向资源有限公司量化投资部总经理，东吴证券股份有限公司投资总部董事总经理。2016 年 7 月加入本公司，现任量化投资部总监。2017 年 6 月起任本基金、摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资基金、摩根士丹利华鑫量化多策略股票型证券投资基金基金经理。
杨雨龙	量化 投资部 副总监、 基金经 理	2015 年 6 月 26 日	2017 年 6 月 17 日	8		北京大学金融数学硕士。曾任招商银行总行计划财务部管理会计，博时基金管理有限公司交易员，兴业证券股份有限公司研究所金融工程高级分析师。2014 年 7 月份加入本公司，历任量化投资部投资经理，2015 年 6 月至 2017 年 6 月任本基金及摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 7 月至 2017

					年 6 月任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。
--	--	--	--	--	----------------------------------

注：1、基金经理的任职、离任日期为根据本公司决定确定的聘任、解聘日期；

2、基金经理的任职、离任已按规定在中国证券投资基金业协会办理完毕基金经理注册、注销；

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金管理人所有投资组合参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 40 次，为量化投资基金因执行投资策略与其他组合发生的反向交易。基金管理人未发现其他异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 上半年，上证综指维持在 3000 点区间上方窄幅运行，而创业板指数则跌至 2015 年 7 月以来的新低。

经过 1 月中旬的小幅调整，各指数在春节过后及两会期间震荡上行。3 月，因美国宣布再次加息、国内资金面开始收紧，市场开始调整。清明小长假归来，在“雄安新区规划”的政策刺激下，各大指数吹响号角开启了新征程。然而仅过了一周，市场发现此前吹响的为集结号而非冲锋

号：因预期美国六月宣布再次加息，叠加国内金融去杠杆，市场资金面收紧趋势明显，中小市值股票纷纷掉头往下；而价值类股票则在小幅调整后，悄然走出了“漂亮 50”独立上涨行情。五月底，央行释放“维稳”信号，并于六月初进行 4980 亿元一年期 MLF（中期借贷便利）操作，加大流动性投放力度。中小市值股票开始企稳，跟随“漂亮 50”反弹。

2017 年 6 月中国官方制造业 PMI 51.7，预期为 51，前值为 51.2，意外反弹至年内次高点，连续 11 个月位于荣枯线上方。保持扩张态势的主要原因是外需状况较好，新出口订单指数上升。6 月制造业呈现以下特点：一是供需增速加快，市场环境逐步改善；二是国内外需求回暖，进出口继续回稳向好；三是产业结构优化升级，供给质量不断提升；四是企业采购意愿增强，价格指数有所回升。中国经济走势或比投资者普遍预期的更为乐观。

本基金以“量化投资”为主要投资策略。报告期内，基金管理人在充分控制风险的前提下，通过自主开发的“多因子阿尔法模型”，精选因子得分较高的股票进行投资。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期截至 2017 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.372 元，累计份额净值为 2.389 元，报告期内基金份额净值增长率为-13.37%，同期业绩比较基准收益率为-1.13%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在 2016 年报中，我们指出接下来一段时间，国内将实行中性偏紧的货币政策，以抑制资产泡沫、对抗通货膨胀、应对人民币贬值。而经过上半年调整以后，去年底的资产泡沫已得到了有效控制，人民币贬值预期大幅减弱，金融去杠杆也初见成效。预计央行将保持灵活操作，对不同货币政策工具搭配使用，维护流动性处于中性适度水平。

综上，国内流动性紧张局面或已缓解。在限售股即将大量解禁上市的情况下，A 股依然面临一定的上行压力。预计 2017 年下半年市场将继续演绎指数区间震荡、个股表现分化的结构性行情。

鉴于中小市值成长股前期跌幅足够深，本基金仍将在多因子模型的基础上，继续坚持并看好成长股中估值处于合理水平且相对更具成长空间的标的，并期望从经济结构转型中持续获益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

基金管理人成立基金估值委员会，委员会由主任委员（分管基金运营部的助理总经理）以及相关成员（包括基金运营部负责人、基金会计、风险管理部及监察稽核部相关业务人员）构成。估值委员会的相关人员均具有一定年限的专业从业经验，具有良好的专业能力，并能在相关工作

中保持独立性。其中基金运营部负责具体执行公允价值估值、提供估值建议、跟踪长期停牌股票对资产净值的影响并就调整估值方法与托管行、会计师事务所进行沟通；风险管理部负责评估公允价值估值数据模型、计算并向基金运营部提供使用数据模型估值的证券价格；监察稽核部负责与监管机构的沟通、协调以及检查公允价值估值业务的合法、合规性。

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，在符合有关基金分红条件，且每季度中间月份的最后一个工作日每份基金份额可供分配利润不低于 0.08 元的前提下，本基金采用季度收益分配规则，每年最多进行 4 次收益分配，每次收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 25%。

本基金管理人于 2017 年 3 月 16 日实施了收益分配：2017 年 2 月 28 日为收益分配基准日，利润分配权益登记日为 2017 年 3 月 14 日，每 10 份基金份额派发红利 0.6770 元，分红金额为 221,517,301.06 元。本次分红金额已超过可供分配利润的 25%，符合相关法规及基金合同的规定。

本基金管理人于 2017 年 6 月 16 日实施了收益分配：2017 年 5 月 31 日为收益分配基准日，利润分配权益登记日为 2017 年 6 月 14 日，每 10 份基金份额派发红利 0.3540 元，分红金额为 100,078,603.82 元。本次分红金额已超过可供分配利润的 25%，符合相关法规及基金合同的规定。

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，本基金实施利润分配金额：321,595,904.88 元。

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：摩根士丹利华鑫多因子精选策略混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	387,452,414.43	591,571,990.91
结算备付金		11,174,100.70	31,180,499.97
存出保证金		1,306,719.40	1,274,279.11
交易性金融资产	6.4.7.2	3,460,769,410.68	4,432,040,089.27
其中：股票投资		3,460,769,410.68	4,432,040,089.27
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	82,201.78	148,879.93
应收股利		-	-
应收申购款		2,365,457.20	8,703,007.88
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,863,150,304.19	5,064,918,747.07
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日

负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	126,890,280.32
应付赎回款		31,773,093.09	10,178,362.27
应付管理人报酬		4,817,263.19	6,343,155.38
应付托管费		802,877.18	1,057,192.51
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	10,259,834.06	13,096,737.31
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	371,078.17	251,498.74
负债合计		48,024,145.69	157,817,226.53
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	2,780,681,125.12	2,902,635,994.89
未分配利润	6.4.7.10	1,034,445,033.38	2,004,465,525.65
所有者权益合计		3,815,126,158.50	4,907,101,520.54
负债和所有者权益总计		3,863,150,304.19	5,064,918,747.07

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.372 元，基金份额总额 2,780,681,125.12 份。

6.2 利润表

会计主体：摩根士丹利华鑫多因子精选策略混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		-526,268,705.40	-84,455,065.90
1.利息收入		2,447,532.97	1,388,904.35
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,447,532.97	1,367,133.35
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		-	21,771.00
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-397,302,155.60	-38,527,775.34
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-406,429,558.31	-47,792,656.07
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	9,127,402.71	9,264,880.73
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-134,160,406.42	-48,557,652.17
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	2,746,323.65	1,241,457.26
减：二、费用		97,134,987.73	80,662,108.59
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	35,202,086.54	24,797,104.12
2. 托管费	6.4.10.2.2	5,867,014.31	4,132,850.68
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	55,787,266.26	51,442,745.47
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	278,620.62	289,408.32
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-623,403,693.13	-165,117,174.49
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-623,403,693.13	-165,117,174.49

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：摩根士丹利华鑫多因子精选策略混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,902,635,994.89	2,004,465,525.65	4,907,101,520.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-623,403,693.13	-623,403,693.13
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）	-121,954,869.77	-25,020,894.26	-146,975,764.03
其中：1.基金申购款	1,454,091,967.09	870,246,108.80	2,324,338,075.89
2.基金赎回款	-1,576,046,836.86	-895,267,003.06	-2,471,313,839.92
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）	-	-321,595,904.88	-321,595,904.88

五、期末所有者权益(基金净值)	2,780,681,125.12	1,034,445,033.38	3,815,126,158.50
项目	上年度可比期间		
	2016年1月1日至2016年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,597,283,708.81	1,676,133,908.65	3,273,417,617.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-165,117,174.49	-165,117,174.49
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)	623,360,934.65	468,227,863.54	1,091,588,798.19
其中：1.基金申购款	1,211,844,578.67	894,889,591.47	2,106,734,170.14
2.基金赎回款	-588,483,644.02	-426,661,727.93	-1,015,145,371.95
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)	-	-305,963,420.05	-305,963,420.05
五、期末所有者权益(基金净值)	2,220,644,643.46	1,673,281,177.65	3,893,925,821.11

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

于华

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

摩根士丹利华鑫多因子精选策略混合型证券投资基金(原名为摩根士丹利华鑫多因子精选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[2011]第 356 号《关于核准摩根士丹利华鑫多因子精选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《摩根士丹利华鑫多因子精选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,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,043,431,652.00 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 183 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《摩根士丹利华鑫多因子精选策略股票型证券投资基金基金合同》于 2011 年 5 月 17 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,043,603,222.41 份基金份额,其中认购资金利息折合 171,570.41 份基金份额。本基金的基金管理人为摩根士丹利华鑫基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据 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,摩根士丹利华鑫多因子精选策略股票型证券投资基金更名为摩根士丹利华鑫多因子精选策略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《摩根士丹利华鑫多因子精选策略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、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。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%。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:中证 800 指数×80%+中证综合债券指数×20%。根据本基金的基金管理人于 2015 年 9 月 29 日发布的《摩根士丹利华鑫多因子精选策略混合型证券投资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,本基金的业绩比较基准变更为:中证 500 指数×80%+中证综合债券指数×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(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》、《摩根士丹利华鑫多因子精选策略混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)于 2016 年 5 月 1 日前,以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起,金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%

的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
	2017 年 6 月 30 日
活期存款	387,452,414.43
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计	387,452,414.43

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,816,994,110.85	3,460,769,410.68	-356,224,700.17
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		3,816,994,110.85	3,460,769,410.68	-356,224,700.17

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 2017年6月30日
应收活期存款利息	76,583.71
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	5,028.30
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	1.77
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	588.00
合计	82,201.78

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末
	2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	10,259,834.06
银行间市场应付交易费用	-
合计	10,259,834.06

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
	2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	111,799.97
预提费用	259,278.20
合计	371,078.17

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,902,635,994.89	2,902,635,994.89
本期申购	1,454,091,967.09	1,454,091,967.09
本期赎回(以“-”号填列)	-1,576,046,836.86	-1,576,046,836.86

本期末	2,780,681,125.12	2,780,681,125.12
-----	------------------	------------------

注：申购含红利再投、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	916,779,445.06	1,087,686,080.59	2,004,465,525.65
本期利润	-489,243,286.71	-134,160,406.42	-623,403,693.13
本期基金份额交易产生的变动数	18,366,876.82	-43,387,771.08	-25,020,894.26
其中：基金申购款	347,155,605.41	523,090,503.39	870,246,108.80
基金赎回款	-328,788,728.59	-566,478,274.47	-895,267,003.06
本期已分配利润	-321,595,904.88	-	-321,595,904.88
本期末	124,307,130.29	910,137,903.09	1,034,445,033.38

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	2,164,243.63
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	264,831.41
其他	18,457.93
合计	2,447,532.97

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	18,976,314,390.18
减：卖出股票成本总额	19,382,743,948.49
买卖股票差价收入	-406,429,558.31

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	9,127,402.71
基金投资产生的股利收益	-
合计	9,127,402.71

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

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

1. 交易性金融资产	-134,160,406.42
——股票投资	-134,160,406.42
——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	-134,160,406.42

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	2,595,080.92
基金转换费收入	65,872.60
其他	85,370.13
合计	2,746,323.65

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，其中不低于赎回费部分的 25% 归入转出基金的资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	55,787,266.26

银行间市场交易费用	-
合计	55,787,266.26

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	61,987.07
信息披露费	188,437.29
银行费用	9,542.42
债券账户维护费	17,853.84
其他	800.00
合计	278,620.62

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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	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	3,179,167,336.49	8.47%	3,347,157,028.80	9.78%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
华鑫证券	2,960,772.74	8.84%	1,497,196.24	14.59%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
华鑫证券	3,117,215.34	9.83%	2,469,490.10	14.44%

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至 2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至 2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	35,202,086.54	24,797,104.12
其中：支付销售机构的客户维护费	13,786,520.69	9,045,402.60

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 2017年1月1日至 2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至 2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	5,867,014.31	4,132,850.68

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未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	387,452,414.43	2,164,243.63	265,126,941.43	1,090,474.59

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

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2017 年 6 月 14 日	2017 年 6 月 14 日	0.3540	64,741,101.40	35,337,502.42	100,078,603.82	
2	2017 年 3 月 14 日	2017 年 3 月 14 日	0.6770	138,474,510.71	83,042,790.35	221,517,301.06	
合计	-	-	1.0310	203,215,612.11	118,380,292.77	321,595,904.88	

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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘 单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300092	科新机电	2017年4月14日	重大资产重组	12.70	-	-	1,788,100	22,695,094.77	22,708,870.00	-
002596	海南瑞泽	2017年5月22日	重大资产重组	8.29	-	-	2,377,600	20,213,050.00	19,710,304.00	-
300163	先锋新材	2017年4月26日	重大资产重组	7.60	-	-	2,496,200	21,371,776.47	18,971,120.00	-
300500	启迪设计	2017年4月17日	重大资产重组	34.03	2017年7月12日	30.64	533,116	19,257,573.16	18,141,937.48	-
600136	当代明诚	2017年2月13日	重大资产重组	16.79	-	-	1,042,200	17,246,768.48	17,498,538.00	-
300423	鲁亿通	2017年2月27日	重大资产重组	33.95	2017年7月31日	30.56	497,820	16,582,383.43	16,900,989.00	-
002625	光启技术	2017年4月13日	重大资产重组	36.36	-	-	458,200	15,940,038.94	16,660,152.00	-
300414	中光防雷	2017年4月28日	重大资产重组	24.78	-	-	598,400	18,533,077.12	14,828,352.00	-
300404	博济医药	2017年6月20日	重大资产重组	23.07	-	-	637,400	19,092,165.10	14,704,818.00	-
300486	东杰智能	2017年1月25日	重大资产重组	22.63	2017年8月9日	20.38	565,365	14,634,174.03	12,794,209.95	-
300234	开尔新材	2017年6月9日	重大资产重组	12.79	-	-	946,000	14,916,019.34	12,099,340.00	-
600318	新力金融	2017年4月27日	重大事项	10.73	2017年8月8日	11.50	946,800	10,266,000.00	10,159,164.00	-

300022	吉峰农机	2017年5月23日	重大资产重组	6.72	-	-	1,339,000	10,753,736.97	8,998,080.00	-
002693	双成药业	2017年5月25日	重大资产重组	6.67	2017年7月25日	6.88	1,347,400	12,256,005.33	8,987,158.00	-
002796	世嘉科技	2017年6月5日	重大资产重组	31.50	2017年8月23日	34.65	285,100	11,126,964.00	8,980,650.00	-
002418	康盛股份	2017年3月20日	重大资产重组	9.31	2017年7月10日	9.27	547,927	5,131,418.28	5,101,200.37	-
002076	雪莱特	2017年3月20日	重大资产重组	7.07	-	-	688,800	4,584,478.51	4,869,816.00	-
603598	引力传媒	2017年5月10日	重大资产重组	16.21	-	-	246,599	4,078,082.78	3,997,369.79	-
002781	奇信股份	2017年5月31日	重大事项	29.44	-	-	96,200	2,795,235.10	2,832,128.00	-
002756	永兴特钢	2017年6月30日	重大事项	28.20	-	-	35,598	1,039,023.18	1,003,863.60	-
300313	天山生物	2017年5月15日	重大资产重组	13.10	-	-	45,700	615,027.00	598,670.00	-
002787	华源控股	2017年3月22日	重大事项	18.91	-	-	76	1,365.43	1,437.16	-

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

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

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，采用数量化模型驱动的选股策略为主导投资策略，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，与该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 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资(2016 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

于 2017 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合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 2017年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	387,452,414.43	-	-	-	387,452,414.43
结算备付金	11,174,100.70	-	-	-	11,174,100.70
存出保证金	1,306,719.40	-	-	-	1,306,719.40
交易性金融资产	-	-	-	3,460,769,410.68	3,460,769,410.68
应收利息	-	-	-	82,201.78	82,201.78
应收申购款	5,967.13	-	-	2,359,490.07	2,365,457.20
资产总计	399,939,201.66	-	-	3,463,211,102.53	3,863,150,304.19
负债					
应付赎回款	-	-	-	31,773,093.09	31,773,093.09
应付管理人报酬	-	-	-	4,817,263.19	4,817,263.19
应付托管费	-	-	-	802,877.18	802,877.18
应付交易费用	-	-	-	10,259,834.06	10,259,834.06
其他负债	-	-	-	371,078.17	371,078.17
负债总计	-	-	-	48,024,145.69	48,024,145.69
利率敏感度缺口	399,939,201.66	-	-	3,415,186,956.84	3,815,126,158.50
上年度末 2016年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	591,571,990.91	-	-	-	591,571,990.91
结算备付金	31,180,499.97	-	-	-	31,180,499.97

存出保证金	1,274,279.11	-	-	-	1,274,279.11
交易性金融资产	-	-	-	4,432,040,089.27	4,432,040,089.27
应收利息	-	-	-	148,879.93	148,879.93
应收申购款	15,608.70	-	-	8,687,399.18	8,703,007.88
资产总计	624,042,378.69	-	-	4,440,876,368.38	5,064,918,747.07
负债					
应付证券清算款	-	-	-	126,890,280.32	126,890,280.32
应付赎回款	-	-	-	10,178,362.27	10,178,362.27
应付管理人报酬	-	-	-	6,343,155.38	6,343,155.38
应付托管费	-	-	-	1,057,192.51	1,057,192.51
应付交易费用	-	-	-	13,096,737.31	13,096,737.31
其他负债	-	-	-	251,498.74	251,498.74
负债总计	-	-	-	157,817,226.53	157,817,226.53
利率敏感度缺口	624,042,378.69	-	-	4,283,059,141.85	4,907,101,520.54

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金结合定性分析和定量分析，对股票资产和固定收益类资产的风险收益特征进行分析预

测，确定中长期的资产配置方案。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	3,460,769,410.68	90.71	4,432,040,089.27	90.32
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	3,460,769,410.68	90.71	4,432,040,089.27	90.32

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 6.4.1)以外的其他市场变量保持不变.		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额(单位:人民币元)	
		本期末(2017年6月 30日)	上年度末(2016年12月 31日)
	业绩比较基准(附注 6.4.1) 上升 5%	221,820,000.00	259,220,000.00

	业绩比较基准(附注 6.4.1)		
	下降 5%	-221,820,000.00	-259,220,000.00

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 3,220,221,243.33 元，属于第二层次的余额为 240,548,167.35 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 4,245,028,712.61 元，第二层次 187,011,376.66 元，无属于第三层次的余额)。

(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 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 增值税

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

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

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

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

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

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	3,460,769,410.68	89.58
	其中：股票	3,460,769,410.68	89.58
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	398,626,515.13	10.32
7	其他各项资产	3,754,378.38	0.10
8	合计	3,863,150,304.19	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	64,478,485.93	1.69
B	采矿业	60,190,455.97	1.58
C	制造业	1,951,888,924.61	51.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	109,127,411.96	2.86
E	建筑业	116,507,967.26	3.05

F	批发和零售业	188,215,838.52	4.93
G	交通运输、仓储和邮政业	104,767,182.52	2.75
H	住宿和餐饮业	15,838,737.00	0.42
I	信息传输、软件和信息技术服务业	206,610,484.72	5.42
J	金融业	141,853,656.64	3.72
K	房地产业	121,469,130.54	3.18
L	租赁和商务服务业	58,512,397.85	1.53
M	科学研究和技术服务业	93,135,167.14	2.44
N	水利、环境和公共设施管理业	55,869,257.24	1.46
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	14,449,481.76	0.38
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	73,665,003.92	1.93
S	综合	84,189,827.10	2.21
	合计	3,460,769,410.68	90.71

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600620	天宸股份	2,523,638	31,419,293.10	0.82
2	000628	高新发展	3,200,800	30,695,672.00	0.80
3	600792	云煤能源	5,762,018	26,562,902.98	0.70
4	600784	鲁银投资	3,823,800	25,504,746.00	0.67
5	000906	浙商中拓	2,679,133	23,817,492.37	0.62
6	300092	科新机电	1,788,100	22,708,870.00	0.60
7	600593	大连圣亚	808,166	21,529,542.24	0.56
8	300403	地尔汉宇	1,136,132	20,654,879.76	0.54

9	603099	长白山	1,297,900	19,896,807.00	0.52
10	002596	海南瑞泽	2,377,600	19,710,304.00	0.52
11	600397	安源煤业	4,482,600	19,364,832.00	0.51
12	002719	麦趣尔	566,917	19,201,478.79	0.50
13	300163	先锋新材	2,496,200	18,971,120.00	0.50
14	600371	万向德农	1,574,070	18,857,358.60	0.49
15	603519	立霸股份	853,084	18,477,799.44	0.48
16	300500	启迪设计	533,116	18,141,937.48	0.48
17	002220	天宝股份	2,136,700	17,991,014.00	0.47
18	601999	出版传媒	1,955,800	17,836,896.00	0.47
19	603878	武进不锈	721,832	17,540,517.60	0.46
20	600136	当代明诚	1,042,200	17,498,538.00	0.46
21	300423	鲁亿通	497,820	16,900,989.00	0.44
22	603828	柯利达	778,100	16,892,551.00	0.44
23	002625	光启技术	458,200	16,660,152.00	0.44
24	603959	百利科技	905,128	16,328,509.12	0.43
25	002295	精艺股份	1,174,300	16,299,284.00	0.43
26	300272	开能环保	1,617,883	16,292,081.81	0.43
27	300489	中飞股份	674,975	15,969,908.50	0.42
28	300211	亿通科技	1,741,370	15,672,330.00	0.41
29	300527	华舟应急	897,614	15,600,531.32	0.41
30	000421	南京公用	2,134,500	15,581,850.00	0.41
31	000428	华天酒店	3,048,200	15,545,820.00	0.41
32	600573	惠泉啤酒	1,524,925	15,462,739.50	0.41
33	600724	宁波富达	3,239,500	15,355,230.00	0.40
34	600385	山东金泰	1,103,153	15,267,637.52	0.40
35	603701	德宏股份	494,079	15,247,277.94	0.40
36	600830	香溢融通	1,521,601	15,002,985.86	0.39

37	300414	中光防雷	598,400	14,828,352.00	0.39
38	300404	博济医药	637,400	14,704,818.00	0.39
39	600232	金鹰股份	1,809,311	14,637,325.99	0.38
40	000534	万泽股份	1,237,200	14,598,960.00	0.38
41	002687	乔治白	1,880,700	14,481,390.00	0.38
42	600661	新南洋	673,008	14,449,481.76	0.38
43	000713	丰乐种业	1,733,307	14,195,784.33	0.37
44	600917	重庆燃气	1,496,817	14,114,984.31	0.37
45	603117	万林股份	1,163,600	14,091,196.00	0.37
46	600493	凤竹纺织	1,276,734	13,941,935.28	0.37
47	300473	德尔股份	291,100	13,856,360.00	0.36
48	600223	鲁商置业	2,954,076	13,765,994.16	0.36
49	603223	恒通股份	559,253	13,673,735.85	0.36
50	600769	祥龙电业	1,570,080	13,455,585.60	0.35
51	600783	鲁信创投	789,600	13,446,888.00	0.35
52	601998	中信银行	2,116,500	13,312,785.00	0.35
53	002077	大港股份	1,199,150	13,310,565.00	0.35
54	002829	星网宇达	403,100	13,298,269.00	0.35
55	002731	萃华珠宝	620,774	13,222,486.20	0.35
56	002738	中矿资源	645,700	13,107,710.00	0.34
57	300389	艾比森	901,273	13,104,509.42	0.34
58	300046	台基股份	698,371	13,059,537.70	0.34
59	300589	江龙船艇	531,174	13,045,633.44	0.34
60	300493	润欣科技	1,007,658	13,008,864.78	0.34
61	002828	贝肯能源	497,949	12,961,612.47	0.34
62	000757	浩物股份	1,786,100	12,895,642.00	0.34
63	600077	宋都股份	3,224,543	12,865,926.57	0.34
64	300265	通光线缆	1,009,325	12,818,427.50	0.34

65	300220	金运激光	688,133	12,806,155.13	0.34
66	300486	东杰智能	565,365	12,794,209.95	0.34
67	600883	博闻科技	1,096,208	12,792,747.36	0.34
68	002208	合肥城建	981,400	12,758,200.00	0.33
69	600015	华夏银行	1,359,112	12,531,012.64	0.33
70	300581	晨曦航空	298,200	12,494,580.00	0.33
71	002627	宜昌交运	679,198	12,490,451.22	0.33
72	002227	奥特迅	679,275	12,369,597.75	0.32
73	300286	安科瑞	599,363	12,364,858.69	0.32
74	002723	金莱特	602,473	12,224,177.17	0.32
75	300234	开尔新材	946,000	12,099,340.00	0.32
76	600981	汇鸿集团	1,624,223	12,035,492.43	0.32
77	600131	岷江水电	1,483,600	11,987,488.00	0.31
78	300390	天华超净	1,300,200	11,922,834.00	0.31
79	603309	维力医疗	668,501	11,892,632.79	0.31
80	000909	数源科技	981,000	11,870,100.00	0.31
81	002519	银河电子	1,494,500	11,761,715.00	0.31
82	002800	天顺股份	298,000	11,437,240.00	0.30
83	300435	中泰股份	828,200	11,404,314.00	0.30
84	300214	日科化学	1,698,200	11,394,922.00	0.30
85	600605	汇通能源	676,600	11,380,412.00	0.30
86	300381	溢多利	671,800	11,219,060.00	0.29
87	300467	迅游科技	270,500	11,179,765.00	0.29
88	603779	威龙股份	509,583	11,149,676.04	0.29
89	601169	北京银行	1,191,100	10,922,387.00	0.29
90	002088	鲁阳节能	905,600	10,840,032.00	0.28
91	601616	广电电气	2,310,300	10,789,101.00	0.28
92	002652	扬子新材	1,496,100	10,786,881.00	0.28

93	300181	佐力药业	1,541,450	10,697,663.00	0.28
94	000416	民生控股	1,336,200	10,689,600.00	0.28
95	603789	星光农机	568,200	10,687,842.00	0.28
96	600778	友好集团	1,382,514	10,686,833.22	0.28
97	300501	海顺新材	235,215	10,615,252.95	0.28
98	600561	江西长运	1,132,100	10,505,888.00	0.28
99	002593	日上集团	1,970,400	10,364,304.00	0.27
100	601137	博威合金	910,217	10,340,065.12	0.27
101	300321	同大股份	455,959	10,286,435.04	0.27
102	603038	华立股份	213,600	10,252,800.00	0.27
103	603887	城地股份	306,900	10,238,184.00	0.27
104	002231	奥维通信	951,200	10,215,888.00	0.27
105	600318	新力金融	946,800	10,159,164.00	0.27
106	002623	亚玛顿	374,100	10,108,182.00	0.26
107	600272	开开实业	738,700	10,090,642.00	0.26
108	600213	亚星客车	930,000	10,053,300.00	0.26
109	603909	合诚股份	247,500	9,986,625.00	0.26
110	002660	茂硕电源	1,042,400	9,944,496.00	0.26
111	300093	金刚玻璃	692,636	9,925,473.88	0.26
112	300243	瑞丰高材	896,500	9,888,395.00	0.26
113	300354	东华测试	637,400	9,886,074.00	0.26
114	300387	富邦股份	492,058	9,742,748.40	0.26
115	002807	江阴银行	764,500	9,579,185.00	0.25
116	000666	经纬纺机	418,000	9,505,320.00	0.25
117	600794	保税科技	2,307,300	9,483,003.00	0.25
118	603668	天马科技	637,520	9,397,044.80	0.25
119	300283	温州宏丰	1,299,850	9,384,917.00	0.25
120	300442	普丽盛	321,700	9,383,989.00	0.25

121	300281	金明精机	582,225	9,362,178.00	0.25
122	000868	安凯客车	1,757,900	9,352,028.00	0.25
123	002662	京威股份	1,266,100	9,115,920.00	0.24
124	002243	通产丽星	941,600	9,105,272.00	0.24
125	300022	吉峰农机	1,339,000	8,998,080.00	0.24
126	002693	双成药业	1,347,400	8,987,158.00	0.24
127	002796	世嘉科技	285,100	8,980,650.00	0.24
128	300019	硅宝科技	880,025	8,958,654.50	0.23
129	300305	裕兴股份	995,700	8,921,472.00	0.23
130	002071	长城影视	895,500	8,919,180.00	0.23
131	601997	贵阳银行	564,100	8,918,421.00	0.23
132	600776	东方通信	1,315,100	8,916,378.00	0.23
133	300264	佳创视讯	999,900	8,839,116.00	0.23
134	002160	常铝股份	1,241,100	8,836,632.00	0.23
135	601368	绿城水务	898,000	8,836,320.00	0.23
136	300125	易世达	338,559	8,822,847.54	0.23
137	300106	西部牧业	818,900	8,770,419.00	0.23
138	300341	麦迪电气	1,013,800	8,769,370.00	0.23
139	601128	常熟银行	787,600	8,765,988.00	0.23
140	603323	吴江银行	562,600	8,686,544.00	0.23
141	002839	张家港行	545,700	8,578,404.00	0.22
142	300460	惠伦晶体	491,300	8,524,055.00	0.22
143	002184	海得控制	608,629	8,520,806.00	0.22
144	002580	圣阳股份	1,061,200	8,478,988.00	0.22
145	002700	新疆浩源	782,800	8,391,616.00	0.22
146	000695	滨海能源	711,397	8,337,572.84	0.22
147	000785	武汉中商	739,141	8,293,162.02	0.22
148	300218	安利股份	719,063	8,283,605.76	0.22

149	300405	科隆股份	391,428	8,192,588.04	0.21
150	002096	南岭民爆	781,010	8,153,744.40	0.21
151	603886	元祖股份	413,200	8,106,984.00	0.21
152	002360	同德化工	981,500	8,077,745.00	0.21
153	603688	石英股份	699,050	8,060,046.50	0.21
154	603023	威帝股份	639,500	8,057,700.00	0.21
155	002568	百润股份	482,400	8,017,488.00	0.21
156	000790	泰合健康	913,820	8,005,063.20	0.21
157	600287	江苏舜天	1,016,900	7,952,158.00	0.21
158	300597	吉大通信	462,743	7,940,669.88	0.21
159	300536	农尚环境	225,400	7,911,540.00	0.21
160	603031	安德利	225,100	7,840,233.00	0.21
161	603929	亚翔集成	348,133	7,839,955.16	0.21
162	002842	翔鹭钨业	190,400	7,787,360.00	0.20
163	603345	安井食品	302,800	7,751,680.00	0.20
164	603866	桃李面包	217,500	7,738,650.00	0.20
165	300517	海波重科	266,700	7,686,294.00	0.20
166	600081	东风科技	613,600	7,639,320.00	0.20
167	300615	欣天科技	211,300	7,638,495.00	0.20
168	601020	华钰矿业	346,000	7,622,380.00	0.20
169	300224	正海磁材	845,350	7,608,150.00	0.20
170	600828	茂业商业	913,600	7,601,152.00	0.20
171	000502	绿景控股	628,439	7,591,543.12	0.20
172	002014	永新股份	601,026	7,578,937.86	0.20
173	300578	会畅通讯	209,700	7,551,297.00	0.20
174	600831	广电网络	756,519	7,527,364.05	0.20
175	601900	南方传媒	604,993	7,526,112.92	0.20
176	600393	粤泰股份	1,036,300	7,502,812.00	0.20

177	002761	多喜爱	196,800	7,496,112.00	0.20
178	002200	云投生态	434,300	7,496,018.00	0.20
179	300464	星徽精密	599,600	7,477,012.00	0.20
180	600530	交大昂立	1,318,500	7,449,525.00	0.20
181	603559	中通国脉	285,256	7,442,329.04	0.20
182	002238	天威视讯	624,696	7,433,882.40	0.19
183	600766	园城黄金	594,531	7,431,637.50	0.19
184	002780	三夫户外	275,999	7,421,613.11	0.19
185	600774	汉商集团	441,600	7,414,464.00	0.19
186	600551	时代出版	467,400	7,380,246.00	0.19
187	600088	中视传媒	419,600	7,351,392.00	0.19
188	600822	上海物贸	597,000	7,343,100.00	0.19
189	600936	广西广电	903,500	7,291,245.00	0.19
190	300025	华星创业	926,200	7,289,194.00	0.19
191	002670	国盛金控	449,000	7,139,100.00	0.19
192	002033	丽江旅游	698,400	7,137,648.00	0.19
193	603101	汇嘉时代	428,900	7,119,740.00	0.19
194	300067	安诺其	1,130,094	7,108,291.26	0.19
195	601188	龙江交通	1,471,831	7,094,225.42	0.19
196	603977	国泰集团	419,705	7,004,876.45	0.18
197	603729	龙韵股份	102,120	6,996,241.20	0.18
198	002718	友邦吊顶	120,063	6,993,669.75	0.18
199	002725	跃岭股份	356,373	6,984,910.80	0.18
200	002645	华宏科技	391,500	6,976,530.00	0.18
201	300455	康拓红外	572,400	6,948,936.00	0.18
202	603189	网达软件	321,100	6,897,228.00	0.18
203	300526	中潜股份	217,128	6,776,564.88	0.18
204	300329	海伦钢琴	573,800	6,753,626.00	0.18

205	600051	宁波联合	700,363	6,695,470.28	0.18
206	300213	佳讯飞鸿	744,400	6,692,156.00	0.18
207	002659	中泰桥梁	427,900	6,675,240.00	0.17
208	002758	华通医药	472,700	6,636,708.00	0.17
209	600714	金瑞矿业	552,437	6,629,244.00	0.17
210	300542	新晨科技	213,700	6,618,289.00	0.17
211	002776	柏堡龙	285,400	6,615,572.00	0.17
212	600819	耀皮玻璃	980,600	6,599,438.00	0.17
213	000415	渤海金控	978,000	6,581,940.00	0.17
214	300412	迦南科技	506,800	6,487,040.00	0.17
215	300158	振东制药	399,644	6,482,225.68	0.17
216	300525	博思软件	137,900	6,481,300.00	0.17
217	600676	交运股份	869,171	6,475,323.95	0.17
218	000908	景峰医药	764,200	6,449,848.00	0.17
219	600361	华联综超	1,084,891	6,433,403.63	0.17
220	002144	宏达高科	377,608	6,419,336.00	0.17
221	002528	英飞拓	1,082,492	6,419,177.56	0.17
222	300532	今天国际	270,760	6,395,351.20	0.17
223	600834	申通地铁	509,100	6,394,296.00	0.17
224	002150	通润装备	543,545	6,386,653.75	0.17
225	603069	海汽集团	530,700	6,373,707.00	0.17
226	600958	东方证券	457,600	6,365,216.00	0.17
227	000686	东北证券	632,200	6,353,610.00	0.17
228	002736	国信证券	479,200	6,349,400.00	0.17
229	601555	东吴证券	564,600	6,340,458.00	0.17
230	300248	新开普	391,200	6,325,704.00	0.17
231	603300	华铁科技	556,900	6,320,815.00	0.17
232	300241	瑞丰光电	492,661	6,296,207.58	0.17

233	000712	锦龙股份	382,200	6,256,614.00	0.16
234	002702	海欣食品	755,800	6,250,466.00	0.16
235	300141	和顺电气	500,750	6,239,345.00	0.16
236	300350	华鹏飞	603,968	6,226,910.08	0.16
237	000655	金岭矿业	837,500	6,180,750.00	0.16
238	002760	凤形股份	187,445	6,140,698.20	0.16
239	600505	西昌电力	730,900	6,117,633.00	0.16
240	300239	东宝生物	925,600	6,108,960.00	0.16
241	600647	同达创业	264,000	6,098,400.00	0.16
242	002674	兴业科技	485,161	6,093,622.16	0.16
243	000929	兰州黄河	434,449	6,043,185.59	0.16
244	600975	新五丰	943,700	6,039,680.00	0.16
245	002478	常宝股份	1,085,600	6,003,368.00	0.16
246	002771	真视通	216,990	5,978,074.50	0.16
247	300260	新莱应材	442,658	5,905,057.72	0.15
248	000899	赣能股份	688,900	5,821,205.00	0.15
249	300474	景嘉微	163,400	5,784,360.00	0.15
250	002798	帝王洁具	142,748	5,784,148.96	0.15
251	603588	高能环境	370,100	5,773,560.00	0.15
252	300513	恒泰实达	126,800	5,738,968.00	0.15
253	300282	汇冠股份	271,500	5,728,650.00	0.15
254	600302	标准股份	682,600	5,665,580.00	0.15
255	600743	华远地产	1,340,500	5,656,910.00	0.15
256	603678	火炬电子	202,900	5,646,707.00	0.15
257	000570	苏常柴A	806,300	5,644,100.00	0.15
258	300469	信息发展	103,447	5,628,551.27	0.15
259	600173	卧龙地产	845,600	5,623,240.00	0.15
260	600575	皖江物流	1,338,400	5,621,280.00	0.15

261	002708	光洋股份	606,700	5,575,573.00	0.15
262	002591	恒大高新	362,875	5,562,873.75	0.15
263	300395	菲利华	379,200	5,555,280.00	0.15
264	001896	豫能控股	791,000	5,552,820.00	0.15
265	603520	司太立	176,800	5,549,752.00	0.15
266	000042	中洲控股	333,363	5,543,826.69	0.15
267	002234	民和股份	444,700	5,532,068.00	0.15
268	600644	乐山电力	728,700	5,530,833.00	0.14
269	300173	智慧松德	459,400	5,462,266.00	0.14
270	603398	邦宝益智	254,400	5,454,336.00	0.14
271	603021	山东华鹏	470,400	5,447,232.00	0.14
272	300132	青松股份	669,400	5,435,528.00	0.14
273	002706	良信电器	455,755	5,414,369.40	0.14
274	600615	丰华股份	341,700	5,409,111.00	0.14
275	002740	爱迪尔	513,400	5,395,834.00	0.14
276	002789	建艺集团	104,900	5,381,370.00	0.14
277	603268	松发股份	166,300	5,378,142.00	0.14
278	603058	永吉股份	245,736	5,332,471.20	0.14
279	300200	高盟新材	362,200	5,309,852.00	0.14
280	002782	可立克	250,900	5,256,355.00	0.14
281	002769	普路通	343,600	5,222,720.00	0.14
282	300123	太阳鸟	440,600	5,190,268.00	0.14
283	300242	明家联合	542,800	5,151,172.00	0.14
284	002357	富临运业	491,000	5,145,680.00	0.13
285	600513	联环药业	501,650	5,121,846.50	0.13
286	300499	高澜股份	201,600	5,104,512.00	0.13
287	002418	康盛股份	547,927	5,101,200.37	0.13
288	603158	腾龙股份	234,600	5,060,322.00	0.13

289	002105	信隆健康	624,900	5,055,441.00	0.13
290	300535	达威股份	96,600	5,053,146.00	0.13
291	603600	永艺股份	306,145	5,039,146.70	0.13
292	603089	正裕工业	167,900	5,026,926.00	0.13
293	300342	天银机电	328,340	5,010,468.40	0.13
294	601015	陕西黑猫	658,550	5,004,980.00	0.13
295	002575	群兴玩具	584,000	4,999,040.00	0.13
296	600617	国新能源	516,077	4,918,213.81	0.13
297	002753	永东股份	264,100	4,904,337.00	0.13
298	002644	佛慈制药	526,200	4,893,660.00	0.13
299	002076	雪莱特	688,800	4,869,816.00	0.13
300	600052	浙江广厦	960,800	4,852,040.00	0.13
301	300516	久之洋	75,500	4,793,495.00	0.13
302	300270	中威电子	405,974	4,753,955.54	0.12
303	300254	仟源医药	331,520	4,710,899.20	0.12
304	603100	川仪股份	404,700	4,698,567.00	0.12
305	600476	湘邮科技	218,500	4,669,345.00	0.12
306	300101	振芯科技	332,337	4,652,718.00	0.12
307	600969	郴电国际	322,800	4,583,760.00	0.12
308	002319	乐通股份	272,100	4,565,838.00	0.12
309	002484	江海股份	457,007	4,533,509.44	0.12
310	300448	浩云科技	188,500	4,531,540.00	0.12
311	300437	清水源	247,300	4,503,333.00	0.12
312	002214	大立科技	514,200	4,452,972.00	0.12
313	300346	南大光电	191,800	4,367,286.00	0.11
314	600618	氯碱化工	408,321	4,360,868.28	0.11
315	600071	凤凰光学	191,800	4,348,106.00	0.11
316	002369	卓翼科技	501,100	4,329,504.00	0.11

317	002119	康强电子	251,900	4,327,642.00	0.11
318	002599	盛通股份	293,056	4,304,992.64	0.11
319	603333	明星电缆	603,500	4,302,955.00	0.11
320	603028	赛福天	281,500	4,261,910.00	0.11
321	300169	天晟新材	542,300	4,257,055.00	0.11
322	002395	双象股份	260,800	4,253,648.00	0.11
323	002286	保龄宝	340,100	4,241,047.00	0.11
324	300139	晓程科技	403,700	4,234,813.00	0.11
325	300443	金雷风电	196,600	4,211,172.00	0.11
326	603606	东方电缆	349,600	4,202,192.00	0.11
327	300593	新雷能	159,000	4,196,010.00	0.11
328	300223	北京君正	172,200	4,193,070.00	0.11
329	300334	津膜科技	167,006	4,173,479.94	0.11
330	300605	恒锋信息	129,400	4,114,920.00	0.11
331	603819	神力股份	162,300	4,106,190.00	0.11
332	300609	汇纳科技	119,700	4,102,119.00	0.11
333	603999	读者传媒	183,600	4,097,952.00	0.11
334	002529	海源机械	233,800	4,091,500.00	0.11
335	300608	思特奇	123,200	4,086,544.00	0.11
336	002721	金一文化	272,200	4,063,946.00	0.11
337	300552	万集科技	123,600	4,054,080.00	0.11
338	300449	汉邦高科	164,784	4,047,095.04	0.11
339	300541	先进数通	138,300	4,031,445.00	0.11
340	601579	会稽山	331,300	4,028,608.00	0.11
341	300051	三五互联	345,200	4,028,484.00	0.11
342	600248	延长化建	667,900	4,027,437.00	0.11
343	300598	诚迈科技	102,600	4,023,972.00	0.11
344	300235	方直科技	243,600	4,016,964.00	0.11

345	603859	能科股份	124,700	4,005,364.00	0.10
346	603598	引力传媒	246,599	3,997,369.79	0.10
347	603990	麦迪科技	102,200	3,959,228.00	0.10
348	603015	弘讯科技	380,400	3,956,160.00	0.10
349	002194	武汉凡谷	445,657	3,944,064.45	0.10
350	600864	哈投股份	472,600	3,927,306.00	0.10
351	300419	浩丰科技	299,000	3,895,970.00	0.10
352	002262	恩华药业	256,100	3,874,793.00	0.10
353	300290	荣科科技	365,600	3,868,048.00	0.10
354	600543	莫高股份	317,489	3,854,316.46	0.10
355	300566	激智科技	120,167	3,834,528.97	0.10
356	300480	光力科技	231,496	3,812,739.12	0.10
357	000705	浙江震元	365,900	3,768,770.00	0.10
358	603066	音飞储存	265,000	3,768,300.00	0.10
359	002193	如意集团	246,400	3,622,080.00	0.09
360	002817	黄山胶囊	99,000	3,599,640.00	0.09
361	002039	黔源电力	244,500	3,555,030.00	0.09
362	300472	新元科技	127,000	3,467,100.00	0.09
363	603988	中电电机	55,269	3,446,574.84	0.09
364	300601	康泰生物	120,900	3,392,454.00	0.09
365	300529	健帆生物	114,300	3,378,708.00	0.09
366	300155	安居宝	424,000	3,319,920.00	0.09
367	002750	龙津药业	267,200	3,299,920.00	0.09
368	300508	维宏股份	46,734	3,243,339.60	0.09
369	600090	同济堂	344,000	3,223,280.00	0.08
370	000948	南天信息	264,400	3,215,104.00	0.08
371	300573	兴齐眼药	90,100	3,209,362.00	0.08
372	002810	山东赫达	99,000	3,196,710.00	0.08

373	002057	中钢天源	249,900	3,196,221.00	0.08
374	002541	鸿路钢构	183,600	3,174,444.00	0.08
375	300483	沃施股份	94,900	3,174,405.00	0.08
376	603716	塞力斯	32,500	3,152,175.00	0.08
377	300318	博晖创新	443,200	3,137,856.00	0.08
378	300061	康旗股份	170,200	3,135,084.00	0.08
379	300452	山河药辅	113,600	3,124,000.00	0.08
380	300233	金城医药	148,200	3,110,718.00	0.08
381	002017	东信和平	279,200	3,107,496.00	0.08
382	002826	易明医药	148,374	3,106,951.56	0.08
383	603669	灵康药业	139,100	3,104,712.00	0.08
384	300174	元力股份	103,700	3,083,001.00	0.08
385	300584	海辰药业	88,200	3,076,416.00	0.08
386	300445	康斯特	137,700	3,050,055.00	0.08
387	000590	启迪古汉	184,200	2,989,566.00	0.08
388	600980	北矿科技	167,300	2,899,309.00	0.08
389	002781	奇信股份	96,200	2,832,128.00	0.07
390	600389	江山股份	169,100	2,803,678.00	0.07
391	002765	蓝黛传动	256,500	2,793,285.00	0.07
392	600841	上柴股份	182,625	2,786,857.50	0.07
393	002537	海立美达	225,900	2,751,462.00	0.07
394	002281	光迅科技	121,600	2,701,952.00	0.07
395	300530	达志科技	54,400	2,689,536.00	0.07
396	002206	海利得	361,700	2,687,431.00	0.07
397	002523	天桥起重	500,900	2,664,788.00	0.07
398	002293	罗莱生活	231,100	2,648,406.00	0.07
399	300062	中能电气	223,300	2,648,338.00	0.07
400	002698	博实股份	224,500	2,642,365.00	0.07

401	002381	双箭股份	302,000	2,639,480.00	0.07
402	300586	美联新材	94,300	2,635,685.00	0.07
403	000719	大地传媒	251,700	2,625,231.00	0.07
404	603823	百合花	123,900	2,624,202.00	0.07
405	000419	通程控股	369,200	2,613,936.00	0.07
406	300576	容大感光	113,700	2,612,826.00	0.07
407	600814	杭州解百	288,500	2,602,270.00	0.07
408	002802	洪汇新材	80,500	2,592,100.00	0.07
409	300587	天铁股份	96,500	2,588,130.00	0.07
410	002805	丰元股份	86,000	2,586,020.00	0.07
411	000919	金陵药业	238,281	2,578,200.42	0.07
412	600469	风神股份	342,000	2,568,420.00	0.07
413	000055	方大集团	348,900	2,539,992.00	0.07
414	002779	中坚科技	100,300	2,530,569.00	0.07
415	300470	日机密封	73,850	2,524,931.50	0.07
416	300039	上海凯宝	343,500	2,497,245.00	0.07
417	002458	益生股份	120,800	2,494,520.00	0.07
418	300540	深冷股份	73,300	2,491,467.00	0.07
419	600356	恒丰纸业	250,300	2,487,982.00	0.07
420	300391	康跃科技	157,600	2,480,624.00	0.07
421	002338	奥普光电	72,200	2,477,904.00	0.06
422	603315	福鞍股份	148,600	2,469,732.00	0.06
423	600128	弘业股份	225,300	2,453,517.00	0.06
424	300488	恒锋工具	73,400	2,451,560.00	0.06
425	300303	聚飞光电	564,500	2,444,285.00	0.06
426	002270	华明装备	227,074	2,434,233.28	0.06
427	300416	苏试试验	97,400	2,432,078.00	0.06
428	000821	京山轻机	182,900	2,427,083.00	0.06

429	603088	宁波精达	65,500	2,411,055.00	0.06
430	002095	生意宝	69,700	2,408,832.00	0.06
431	603029	天鹅股份	82,700	2,402,435.00	0.06
432	600481	双良节能	450,900	2,394,279.00	0.06
433	603090	宏盛股份	83,900	2,391,989.00	0.06
434	300434	金石东方	96,900	2,382,771.00	0.06
435	300310	宜通世纪	179,600	2,374,312.00	0.06
436	601882	海天精工	136,600	2,374,108.00	0.06
437	002420	毅昌股份	282,200	2,373,302.00	0.06
438	603033	三维股份	95,560	2,359,376.40	0.06
439	002816	和科达	77,100	2,274,450.00	0.06
440	600738	兰州民百	267,101	2,259,674.46	0.06
441	300119	瑞普生物	156,044	2,222,066.56	0.06
442	601798	蓝科高新	200,300	2,211,312.00	0.06
443	300184	力源信息	176,800	2,199,392.00	0.06
444	002487	大金重工	345,300	2,165,031.00	0.06
445	300505	川金诺	51,400	2,164,454.00	0.06
446	002598	山东章鼓	184,700	2,114,815.00	0.06
447	300370	安控科技	427,000	2,075,220.00	0.05
448	002037	久联发展	152,688	2,064,341.76	0.05
449	000985	大庆华科	86,700	2,054,790.00	0.05
450	600973	宝胜股份	361,479	2,024,282.40	0.05
451	600448	华纺股份	342,900	2,023,110.00	0.05
452	600370	三房巷	443,600	2,018,380.00	0.05
453	600222	太龙药业	324,100	2,015,902.00	0.05
454	300356	光一科技	229,750	2,001,122.50	0.05
455	600175	美都能源	448,000	1,948,800.00	0.05
456	600378	天科股份	157,500	1,938,825.00	0.05

457	300056	三维丝	126,700	1,920,772.00	0.05
458	300487	蓝晓科技	113,800	1,918,668.00	0.05
459	300217	东方电热	510,200	1,857,128.00	0.05
460	300447	全信股份	85,170	1,855,854.30	0.05
461	603020	爱普股份	123,200	1,793,792.00	0.05
462	600562	国睿科技	62,100	1,710,234.00	0.04
463	300382	斯莱克	40,483	1,673,162.39	0.04
464	002548	金新农	134,711	1,627,308.88	0.04
465	002305	南国置业	291,300	1,575,933.00	0.04
466	000430	张家界	144,500	1,531,700.00	0.04
467	002225	濮耐股份	274,800	1,497,660.00	0.04
468	000715	中兴商业	132,500	1,486,650.00	0.04
469	300506	名家汇	52,450	1,480,663.50	0.04
470	300110	华仁药业	162,978	1,457,023.32	0.04
471	002469	三维工程	176,400	1,421,784.00	0.04
472	600310	桂东电力	201,000	1,378,860.00	0.04
473	300162	雷曼股份	128,600	1,354,158.00	0.04
474	300082	奥克股份	186,600	1,287,540.00	0.03
475	600238	海南椰岛	124,800	1,245,504.00	0.03
476	002786	银宝山新	80,900	1,179,522.00	0.03
477	002628	成都路桥	170,900	1,167,247.00	0.03
478	300121	阳谷华泰	83,300	1,149,540.00	0.03
479	300456	耐威科技	27,900	1,040,112.00	0.03
480	002756	永兴特钢	35,598	1,003,863.60	0.03
481	002170	芭田股份	132,600	985,218.00	0.03
482	300400	劲拓股份	61,100	911,612.00	0.02
483	601009	南京银行	80,800	905,768.00	0.02
484	600746	江苏索普	82,700	891,506.00	0.02

485	300328	宜安科技	80,100	889,110.00	0.02
486	002279	久其软件	63,900	801,945.00	0.02
487	002137	麦达数字	83,800	760,066.00	0.02
488	300054	鼎龙股份	72,800	740,376.00	0.02
489	300194	福安药业	90,300	627,585.00	0.02
490	603703	盛洋科技	34,150	613,675.50	0.02
491	300313	天山生物	45,700	598,670.00	0.02
492	000564	供销大集	91,800	597,618.00	0.02
493	600336	澳柯玛	102,800	597,268.00	0.02
494	002495	佳隆股份	124,000	566,680.00	0.01
495	002515	金字火腿	55,400	525,192.00	0.01
496	002130	沃尔核材	80,700	518,901.00	0.01
497	603618	杭电股份	48,100	498,797.00	0.01
498	300009	安科生物	30,200	495,582.00	0.01
499	300511	雪榕生物	25,100	493,968.00	0.01
500	600979	广安爱众	86,000	491,920.00	0.01
501	600823	世茂股份	95,500	467,950.00	0.01
502	300366	创意信息	27,800	465,928.00	0.01
503	002483	润邦股份	68,100	448,779.00	0.01
504	603012	创力集团	53,500	441,910.00	0.01
505	002668	奥马电器	22,400	441,280.00	0.01
506	002165	红宝丽	70,200	434,538.00	0.01
507	601811	新华文轩	27,600	429,456.00	0.01
508	300507	苏奥传感	9,400	421,872.00	0.01
509	603766	隆鑫通用	57,100	415,688.00	0.01
510	002374	丽鹏股份	70,500	414,540.00	0.01
511	002332	仙琚制药	42,700	367,220.00	0.01
512	600640	号百控股	17,700	299,130.00	0.01

513	601007	金陵饭店	25,100	292,917.00	0.01
514	000678	襄阳轴承	25,700	225,646.00	0.01
515	300495	美尚生态	15,000	224,100.00	0.01
516	300314	戴维医疗	13,739	217,350.98	0.01
517	603456	九洲药业	12,700	209,169.00	0.01
518	603901	永创智能	9,100	107,835.00	0.00
519	600650	锦江投资	4,300	77,142.00	0.00
520	002787	华源控股	76	1,437.16	0.00

注: 1. 根据“天宝股份”(002220)公告,“天宝股份”自 2017 年 8 月 14 日更名为“天宝食品”;
2. 根据“海立美达”(002537)公告,“海立美达”自 2017 年 8 月 7 日更名为“海联金汇”。

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	603519	立霸股份	65,647,935.60	1.34
2	600077	宋都股份	63,900,887.35	1.30
3	000628	高新发展	63,528,956.32	1.29
4	000415	渤海金控	57,440,474.75	1.17
5	600620	天宸股份	56,840,820.98	1.16
6	300125	易世达	55,637,959.09	1.13
7	002077	大港股份	55,273,190.35	1.13
8	600287	江苏舜天	54,772,602.20	1.12
9	603959	百利科技	54,149,210.94	1.10
10	300501	海顺新材	53,284,000.14	1.09
11	603701	德宏股份	53,054,149.28	1.08
12	000666	经纬纺机	53,052,493.23	1.08
13	000708	大冶特钢	52,981,505.61	1.08

14	002719	麦趣尔	52,701,604.67	1.07
15	603099	长白山	51,938,225.82	1.06
16	603520	司太立	51,547,938.39	1.05
17	300173	智慧松德	51,094,659.47	1.04
18	300382	斯莱克	51,050,652.02	1.04
19	002184	海得控制	50,543,528.40	1.03
20	300508	维宏股份	49,522,816.70	1.01

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	000046	泛海控股	60,526,052.62	1.23
2	300260	新莱应材	58,810,422.73	1.20
3	600617	国新能源	58,072,862.18	1.18
4	002607	亚夏汽车	57,934,484.93	1.18
5	300041	回天新材	57,085,513.55	1.16
6	600287	江苏舜天	56,283,449.62	1.15
7	300173	智慧松德	56,218,055.84	1.15
8	002296	辉煌科技	55,270,367.02	1.13
9	000708	大冶特钢	51,849,508.63	1.06
10	000415	渤海金控	51,363,166.48	1.05
11	000695	滨海能源	50,857,647.32	1.04
12	002441	众业达	50,555,750.65	1.03
13	300437	清水源	50,441,898.75	1.03
14	002302	西部建设	49,771,868.88	1.01
15	002532	新界泵业	49,634,715.30	1.01

16	300382	斯莱克	49,419,132.17	1.01
17	002592	八菱科技	49,404,150.69	1.01
18	600077	宋都股份	49,262,870.64	1.00
19	002457	青龙管业	49,181,690.33	1.00
20	300494	盛天网络	49,044,748.13	1.00

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	18,545,633,676.32
卖出股票收入（成交）总额	18,976,314,390.18

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。

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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

7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,306,719.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	82,201.78
5	应收申购款	2,365,457.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,754,378.38

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300092	科新机电	22,708,870.00	0.60	重大资产重组
2	002596	海南瑞泽	19,710,304.00	0.52	重大资产重组

§ 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
235,736	11,795.74	294,838,665.62	10.60%	2,485,842,459.50	89.40%

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	414,581.52	0.0149%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部 门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年5月17日）基金份额总额	1,043,603,222.41
本报告期期初基金份额总额	2,902,635,994.89
本报告期基金总申购份额	1,454,091,967.09
减：本报告期基金总赎回份额	1,576,046,836.86
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	2,780,681,125.12

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金未改变投资策略。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

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

			例			
海通证券	1	3,649,698,131.89	9.73%	3,398,976.41	10.15%	-
华鑫证券	2	3,179,167,336.49	8.47%	2,960,772.74	8.84%	-
广发证券	1	2,796,327,380.59	7.45%	2,604,225.54	7.78%	-
天风证券	1	2,270,506,444.13	6.05%	1,660,425.75	4.96%	-
方正证券	2	1,726,460,155.20	4.60%	1,607,859.04	4.80%	-
华创证券	1	1,677,748,114.38	4.47%	1,562,490.58	4.67%	-
国信证券	1	1,551,982,947.01	4.14%	1,445,362.24	4.32%	-
国泰君安	1	1,481,600,492.29	3.95%	1,379,819.10	4.12%	-
东北证券	1	1,462,708,819.79	3.90%	1,069,678.24	3.19%	-
兴业证券	1	1,374,866,339.32	3.66%	1,280,408.65	3.82%	-
申万宏源	2	1,256,575,316.21	3.35%	1,170,255.32	3.50%	-
银河证券	1	1,114,394,267.08	2.97%	1,037,838.78	3.10%	-
中泰证券	1	1,096,653,005.53	2.92%	1,021,304.42	3.05%	-
中金公司	1	1,029,660,505.85	2.74%	958,927.85	2.86%	-
长江证券	2	1,008,288,529.92	2.69%	939,022.31	2.80%	-
安信证券	2	976,484,943.61	2.60%	909,404.79	2.72%	-
浙商证券	2	964,730,462.69	2.57%	705,509.29	2.11%	-
长城证券	2	941,410,205.08	2.51%	688,455.05	2.06%	-
中投证券	1	888,662,413.52	2.37%	827,613.49	2.47%	-
中信建投	1	791,730,399.17	2.11%	737,339.55	2.20%	-
东方证券	2	746,298,466.22	1.99%	695,030.14	2.08%	-
川财证券	2	720,357,994.17	1.92%	526,799.08	1.57%	-
民生证券	1	695,907,946.53	1.85%	648,097.12	1.94%	-
中信证券	3	668,476,389.03	1.78%	622,553.54	1.86%	-
东吴证券	1	622,497,741.39	1.66%	455,235.16	1.36%	-
光大证券	1	585,136,977.17	1.56%	544,933.52	1.63%	-
瑞银证券	1	447,514,609.78	1.19%	416,767.93	1.24%	-
宏信证券	1	444,072,308.53	1.18%	413,566.51	1.24%	-

中信证券(山东)	2	410,021,284.11	1.09%	381,851.11	1.14%	-
中银国际	2	361,023,969.28	0.96%	336,222.93	1.00%	-
华林证券	1	300,940,527.07	0.80%	220,079.58	0.66%	-
平安证券	1	253,187,159.97	0.67%	235,794.12	0.70%	-
九州证券	1	26,856,483.50	0.07%	19,640.96	0.06%	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	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 2 个专用交易单元：九州证券交易单元 1 个，东北证券交易单元 1 个。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

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

				的比例		
海通证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-

中信证券（山东）	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
九州证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-

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	本基金 2016 年 4 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 1 月 19 日
2	本公司关于旗下基金参与北京钱景财富投资管理有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 1 月 23 日
3	本公司关于旗下基金参加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司基金转换费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 1 月 23 日
4	本公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司手机银行申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 2 月 23 日
5	本基金 2017 年第一次收益分配公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 3 月 10 日
6	本公司关于旗下部分基金参与宜	《中国证券报》、《上海证券	2017 年 3 月 13 日

	信普泽投资顾问（北京）有限公司费率优惠活动的公告	报》、《证券时报》、《证券日报》	
7	本基金 2016 年年度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 3 月 30 日
8	本公司关于旗下部分基金继续参与中国工商银行个人电子银行申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 3 月 31 日
9	本公司关于旗下部分基金参与广发证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 4 月 10 日
10	本公司关于旗下基金增加南京苏宁基金销售有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 4 月 14 日
11	本公司关于旗下基金参与南京苏宁基金销售有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 4 月 14 日
12	本公司关于旗下基金增加济安财富(北京)资本管理有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 4 月 20 日
13	本公司关于旗下基金参与济安财富(北京)资本管理有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 4 月 20 日
14	本公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司手机银行申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 4 月 22 日
15	本基金 2017 年 1 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 4 月 24 日
16	本公司关于调整直销中心最低认	《中国证券报》、《上海证券	2017 年 5 月 26 日

	申购金额限制的公告	报》、《证券时报》、《证券日报》	
17	本公司关于旗下基金增加上海云湾投资管理有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 6 月 9 日
18	本公司关于旗下基金参与上海云湾投资管理有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 6 月 9 日
19	本基金 2017 年第二次收益分配公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 6 月 12 日
20	本基金基金经理变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 6 月 15 日
21	本基金基金经理变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 6 月 17 日
22	本公司关于旗下基金增加上海证券为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 6 月 27 日
23	本公司关于旗下基金参与上海证券销售费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 6 月 27 日
24	本公司关于直销网上交易开通快付通支付业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 6 月 28 日
25	本公司关于旗下部分基金增加上海通华财富资产管理有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 6 月 29 日
26	本公司关于旗下部分基金参与通华财富销售费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 6 月 29 日
27	本基金招募说明书（更新）（2017 年第 1 号）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 6 月 29 日

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

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

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

11.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

11.3 查阅方式

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

摩根士丹利华鑫基金管理有限公司

2017年8月28日