

摩根士丹利华鑫量化多策略股票型证券投资
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.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	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.....	44
7.1 期末基金资产组合情况.....	44
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	81
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	83
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.....	83
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.....	83
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.....	83
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.....	83
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	83
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	84
7.12 投资组合报告附注.....	84
§8 基金份额持有人信息.....	86
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	86
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	86
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.....	86
§9 开放式基金份额变动.....	87
§10 重大事件揭示.....	88
10.1 基金份额持有人大会决议.....	88
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.....	88
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	88
10.4 基金投资策略的改变.....	88
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	88
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.....	88
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	88
10.8 其他重大事件.....	92
§11 备查文件目录.....	95
11.1 备查文件目录.....	95

11.2 存放地点.....	95
11.3 查阅方式.....	95

§ 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	970,799,078.20 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</p> <p>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，</p>

	<p>优化股票投资组合。</p> <p>2) 固定收益投资策略</p> <p>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</p> <p>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	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8888-668	(010) 67595096
传真		(0755) 82990384	(010) 66275853
注册地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第二座第 17 层 01-04 室	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第二座第 17 层	北京市西城区闹市口大街 1 号 院 1 号楼

邮政编码	518048	100033
法定代表人	YU HUA(于华)	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	-52,518,141.97
本期利润	-74,669,636.37
加权平均基金份额本期利润	-0.0692
本期加权平均净值利润率	-6.98%
本期基金份额净值增长率	-7.68%
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	-60,493,944.59
期末可供分配基金份额利润	-0.0623
期末基金资产净值	910,305,133.61
期末基金份额净值	0.938
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	-6.20%

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

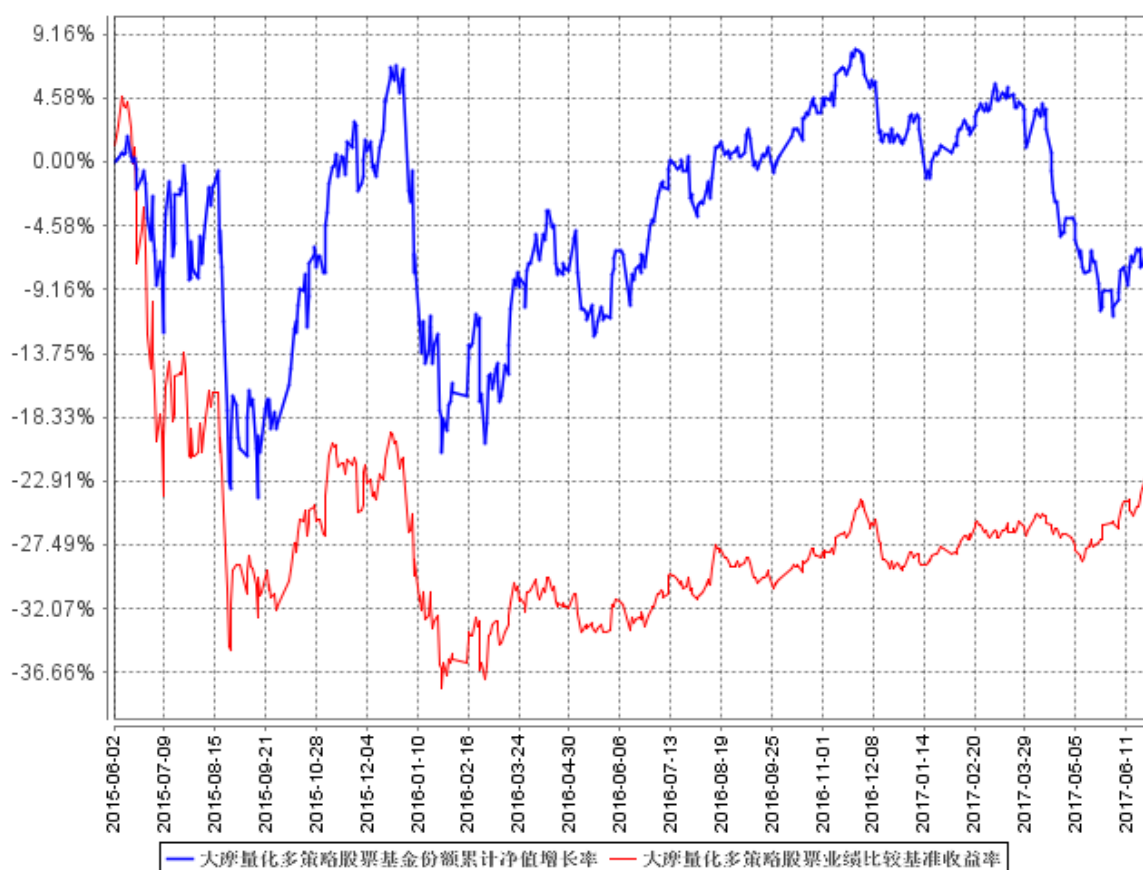
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	3.30%	0.90%	4.39%	0.57%	-1.09%	0.33%
过去三个月	-7.50%	0.98%	5.17%	0.53%	-12.67%	0.45%
过去六个月	-7.68%	0.82%	9.03%	0.48%	-16.71%	0.34%
过去一年	-2.09%	0.80%	13.74%	0.57%	-15.83%	0.23%
自基金合同 生效起至今	-6.20%	1.65%	-22.62%	1.52%	16.42%	0.13%

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 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	数量化投资部总监	2017 年 6 月 15 日	-	11	美国马里兰大学金融数学博士。曾担任美国摩根士丹利机构证券部副总裁，

					<p>美国芝加哥交易对冲基金投资经理，美国斯考特交易对冲基金投资经理，万向资源有限公司量化投资部总经理，东吴证券股份有限公司投资总部董事总经理。2016 年 7 月加入本公司，现任数量化投资部总监。2017 年 6 月起任摩根士丹利华鑫多因子精选策略混合型证券投资基金、摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资基金基金和本基金基金经理。</p>
杨雨龙	数量化 投资部 副总监、 基金经 理	2015 年 7 月 25 日	2017 年 6 月 17 日	8	<p>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。</p> <p>2014 年 7 月份加入本公司，历任数量化投资部投资经理，2015 年 6 月至 2017 年 6 月任摩根士丹利华鑫多因子精选策略混合型证券投资基金及摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 7 月至 2017 年 6</p>

					月任本基金基金经理。
--	--	--	--	--	------------

- 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遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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。

本基金运用多个量化策略，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。在报告期内，基金管理人通过自主开发的“多因子阿尔法模型”、“行业轮动模型”、“事件驱动模型”等不同种类的量化模型进行股票选择并据此构建投资组合。

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 0.938 元，累计份额净值为 0.938 元，报告期内基金份额净值增长率为-7.68%，同期业绩比较基准收益率为 9.03%。

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 股依然面临一定的向上压力。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。

本基金将继续在估值处于合理水平且相对更具成长空间的成长股以及较低估值的大盘蓝筹股之间进行均衡配置，并适时根据市场变化，动态调整资产配置权重，力争为投资者实现资产的长期稳健增值。

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：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	91,060,326.53	140,998,696.73
结算备付金		4,197,546.19	3,303,759.40
存出保证金		219,869.65	244,451.72
交易性金融资产	6.4.7.2	819,016,729.58	1,099,659,655.40
其中：股票投资		819,016,729.58	1,099,659,655.40
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	20,497.60	33,548.37
应收股利		-	-
应收申购款		74,280.47	196,025.62
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		914,589,250.02	1,244,436,137.24
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		-	-
应付赎回款		837,282.73	1,273,333.68
应付管理人报酬		1,109,443.68	1,736,090.78
应付托管费		184,907.26	289,348.46
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,900,367.21	2,286,195.68
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	252,115.53	119,501.50
负债合计		4,284,116.41	5,704,470.10
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	970,799,078.20	1,219,112,283.14
未分配利润	6.4.7.10	-60,493,944.59	19,619,384.00
所有者权益合计		910,305,133.61	1,238,731,667.14
负债和所有者权益总计		914,589,250.02	1,244,436,137.24

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.938 元，基金份额总额 970,799,078.20 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：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		-55,875,320.53	-139,630,982.32
1.利息收入		456,099.65	635,255.71
其中：存款利息收入	6.4.7.11	456,099.65	635,255.71
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-34,310,773.59	-42,999,367.20
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-38,239,407.06	-50,757,049.12
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	3,928,633.47	7,757,681.92
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-22,151,494.40	-97,540,210.88
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	130,847.81	273,340.05
减：二、费用		18,794,315.84	27,861,444.49
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	7,989,738.04	11,060,041.17
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,331,622.96	1,843,340.12
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	9,209,408.61	14,728,992.03
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	263,546.23	229,071.17

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-74,669,636.37	-167,492,426.81
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-74,669,636.37	-167,492,426.81

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：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）	1,219,112,283.14	19,619,384.00	1,238,731,667.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-74,669,636.37	-74,669,636.37
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）	-248,313,204.94	-5,443,692.22	-253,756,897.16
其中：1.基金申购款	24,798,531.05	-230,549.78	24,567,981.27
2.基金赎回款	-273,111,735.99	-5,213,142.44	-278,324,878.43
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	970,799,078.20	-60,493,944.59	910,305,133.61

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
金净值)			
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

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

张力

谢先斌

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

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。

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	91,060,326.53
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	91,060,326.53

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	865,455,324.46	819,016,729.58	-46,438,594.88
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	865,455,324.46	819,016,729.58	-46,438,594.88

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	18,509.80
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,888.90
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	98.90
合计	20,497.60

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	1,900,367.21
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,900,367.21

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	276.43
预提费用	251,839.10
合计	252,115.53

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	1,219,112,283.14	1,219,112,283.14
本期申购	24,798,531.05	24,798,531.05
本期赎回(以“-”号填列)	-273,111,735.99	-273,111,735.99
本期末	970,799,078.20	970,799,078.20

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	64,860,548.56	-45,241,164.56	19,619,384.00
本期利润	-52,518,141.97	-22,151,494.40	-74,669,636.37
本期基金份额交易产生的变动数	-14,696,427.01	9,252,734.79	-5,443,692.22
其中：基金申购款	1,242,073.26	-1,472,623.04	-230,549.78
基金赎回款	-15,938,500.27	10,725,357.83	-5,213,142.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,354,020.42	-58,139,924.17	-60,493,944.59

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	411,685.44
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	42,199.40
其他	2,214.81
合计	456,099.65

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	3,161,651,742.98
减：卖出股票成本总额	3,199,891,150.04
买卖股票差价收入	-38,239,407.06

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	3,928,633.47
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,928,633.47

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	-22,151,494.40
——股票投资	-22,151,494.40
——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	-22,151,494.40

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	128,275.89
基金转换费收入	2,571.92
合计	130,847.81

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
	2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	9,209,408.61
银行间市场交易费用	-
合计	9,209,408.61

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	54,547.97
信息披露费	188,437.29
银行费用	1,707.13
债券账户维护费	17,853.84
其他	1,000.00
合计	263,546.23

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	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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
华鑫证券	462,738,650.29	7.58%	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 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	430,948.85	7.83%	122,848.19	6.46%
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	1,088,769.43	12.09%	-	-

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月	2016年1月1日至2016年6月30日

	30 日	
当期发生的基金应支付的管理费	7,989,738.04	11,060,041.17
其中：支付销售机构的客户维护费	3,517,357.08	5,833,689.04

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
	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
当期发生的基金应支付的托管费	1,331,622.96	1,843,340.12

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	
	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	91,060,326.53	411,685.44	116,927,161.48	555,015.64

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

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
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	158,800	5,783,056.17	5,403,964.00	-
300414	中光防雷	2017 年 4 月 28 日	重大资产重组	24.78	-	-	139,893	4,316,254.33	3,466,548.54	-

300234	开尔新材	2017年 6月9日	重大 资产 重组	12.79	-	-	238,600	3,622,185.00	3,051,694.00	-
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	276,800	2,621,641.00	2,577,008.00	-
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	75,000	2,483,851.52	2,546,250.00	-
300404	博济医药	2017年 6月20日	重大 资产 重组	23.07	-	-	102,100	3,099,538.81	2,355,447.00	-
002596	海南瑞泽	2017年 5月22日	重大 资产 重组	8.29	-	-	255,300	2,126,624.00	2,116,437.00	-
600136	当代明诚	2017年 2月13日	重大 资产 重组	16.79	-	-	89,300	1,519,703.61	1,499,347.00	-
600485	信威集团	2016年 12月26日	重大 资产 重组	14.59	-	-	101,400	2,139,516.91	1,479,426.00	-
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	44,600	1,757,979.00	1,404,900.00	-
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	53,200	1,399,665.10	1,203,916.00	-
000889	茂业通信	2017年 4月14日	重大 资产	16.71	-	-	63,100	738,989.88	1,054,401.00	-

		日	重组							
600050	中国联通	2017年 4月5日	重大 事项	7.47	2017 年8月 21日	8.22	137,454	904,394.30	1,026,781.38	-
601989	中国 重工	2017年 5月31 日	重大 资产 重组	6.21	-	-	159,700	1,014,817.00	991,737.00	-
600655	豫园 商城	2016年 12月20 日	重大 资产 重组	11.32	-	-	85,200	999,630.60	964,464.00	-
000693	*ST 华泽	2016年 3月1日	重大 资产 重组	12.50	-	-	74,246	1,089,030.94	928,075.00	-
002025	航天 电器	2016年 9月12 日	重大 资产 重组	24.95	2017 年7月 4日	22.46	31,900	782,717.00	795,905.00	-
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	35,600	542,829.55	381,988.00	-
002781	奇信 股份	2017年 5月31 日	重大 事项	29.44	-	-	6,900	217,070.00	203,136.00	-
002756	永兴 特钢	2017年 6月30 日	重大 事项	28.20	-	-	5,900	161,716.00	166,380.00	-
600577	精达 股份	2017年 6月26 日	重大 资产 重组	4.80	2017 年7月 10日	4.50	28,300	164,366.00	135,840.00	-
600172	黄河	2017年	重大	8.23	2017	8.00	9,600	80,088.00	79,008.00	-

	旋风	6 月 30 日	事项		年 7 月 14 日					
002010	传化 智联	2017 年 6 月 30 日	临时 停牌	15.26	2017 年 7 月 4 日	16.77	2,600	40,016.00	39,676.00	-

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 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 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	91,060,326.53	-	-	-	91,060,326.53
结算备付金	4,197,546.19	-	-	-	4,197,546.19
存出保证金	219,869.65	-	-	-	219,869.65
交易性金融资产	-	-	-	819,016,729.58	819,016,729.58
应收利息	-	-	-	20,497.60	20,497.60

应收申购款	-	-	-	74,280.47	74,280.47
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	95,477,742.37	-	-	819,111,507.65	914,589,250.02
负债					
应付赎回款	-	-	-	837,282.73	837,282.73
应付管理人报酬	-	-	-	1,109,443.68	1,109,443.68
应付托管费	-	-	-	184,907.26	184,907.26
应付交易费用	-	-	-	1,900,367.21	1,900,367.21
其他负债	-	-	-	252,115.53	252,115.53
负债总计	-	-	-	4,284,116.41	4,284,116.41
利率敏感度缺口	95,477,742.37	-	-	814,827,391.24	910,305,133.61
上年度末 2016年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	140,998,696.73	-	-	-	140,998,696.73
结算备付金	3,303,759.40	-	-	-	3,303,759.40
存出保证金	244,451.72	-	-	-	244,451.72
交易性金融资产	-	-	-	1,099,659,655.40	1,099,659,655.40
应收利息	-	-	-	33,548.37	33,548.37
应收申购款	-	-	-	196,025.62	196,025.62
资产总计	144,546,907.85	-	-	1,099,889,229.39	1,244,436,137.24
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,273,333.68	1,273,333.68
应付管理人报酬	-	-	-	1,736,090.78	1,736,090.78
应付托管费	-	-	-	289,348.46	289,348.46
应付交易费用	-	-	-	2,286,195.68	2,286,195.68
其他负债	-	-	-	119,501.50	119,501.50
负债总计	-	-	-	5,704,470.10	5,704,470.10
利率敏感度缺口	144,546,907.85	-	-	1,094,184,759.29	1,238,731,667.14

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

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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过开发各类量化模型进行股票选择并据此构建投资组合。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司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	819,016,729.58	89.97	1,099,659,655.40	88.77
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	819,016,729.58	89.97	1,099,659,655.40	88.77

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%	43,230,000.00	68,440,000.00
	业绩比较基准(附注 6.4.1) 下降 5%	-43,230,000.00	-68,440,000.00

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 785,223,408.66 元,属于第二层次的余额为 33,793,320.92 元,无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日:第一层次 1,045,069,844.89 元,第二层次 54,589,810.51,无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 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	819,016,729.58	89.55
	其中：股票	819,016,729.58	89.55
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	95,257,872.72	10.42
7	其他各项资产	314,647.72	0.03
8	合计	914,589,250.02	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	7,328,295.78	0.81
B	采矿业	16,710,171.00	1.84
C	制造业	399,014,678.56	43.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	23,359,704.00	2.57
E	建筑业	31,088,909.74	3.42
F	批发和零售业	40,926,885.98	4.50
G	交通运输、仓储和邮政业	21,648,619.71	2.38

H	住宿和餐饮业	595,028.20	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39,948,676.31	4.39
J	金融业	143,672,745.26	15.78
K	房地产业	33,178,588.30	3.64
L	租赁和商务服务业	11,347,562.72	1.25
M	科学研究和技术服务业	14,351,032.94	1.58
N	水利、环境和公共设施管理业	7,668,231.11	0.84
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,700,424.00	0.19
Q	卫生和社会工作	1,030,730.00	0.11
R	文化、体育和娱乐业	17,369,421.00	1.91
S	综合	8,077,024.97	0.89
	合计	819,016,729.58	89.97

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	600015	华夏银行	2,099,760	19,359,787.20	2.13
2	601818	光大银行	4,263,400	17,266,770.00	1.90
3	601998	中信银行	2,735,100	17,203,779.00	1.89
4	000776	广发证券	646,000	11,143,500.00	1.22
5	600016	民生银行	1,272,800	10,462,416.00	1.15
6	002736	国信证券	672,800	8,914,600.00	0.98
7	601601	中国太保	263,200	8,914,584.00	0.98
8	600999	招商证券	422,300	7,272,006.00	0.80
9	601211	国泰君安	353,600	7,252,336.00	0.80
10	601336	新华保险	133,723	6,873,362.20	0.76

11	601318	中国平安	138,500	6,870,985.00	0.75
12	601628	中国人寿	228,257	6,158,373.86	0.68
13	300500	启迪设计	158,800	5,403,964.00	0.59
14	300301	长方集团	822,000	5,260,800.00	0.58
15	000333	美的集团	112,000	4,820,480.00	0.53
16	601579	会稽山	381,647	4,640,827.52	0.51
17	600690	青岛海尔	288,400	4,340,420.00	0.48
18	603369	今世缘	328,200	4,332,240.00	0.48
19	300389	艾比森	297,600	4,327,104.00	0.48
20	300050	世纪鼎利	426,589	4,295,751.23	0.47
21	000651	格力电器	97,400	4,009,958.00	0.44
22	600983	惠而浦	349,700	3,783,754.00	0.42
23	000869	张裕A	96,600	3,593,520.00	0.39
24	300043	星辉娱乐	436,100	3,580,381.00	0.39
25	600213	亚星客车	325,000	3,513,250.00	0.39
26	300414	中光防雷	139,893	3,466,548.54	0.38
27	300039	上海凯宝	474,190	3,447,361.30	0.38
28	603887	城地股份	98,800	3,295,968.00	0.36
29	002262	恩华药业	214,400	3,243,872.00	0.36
30	300234	开尔新材	238,600	3,051,694.00	0.34
31	600792	云煤能源	659,600	3,040,756.00	0.33
32	601015	陕西黑猫	396,800	3,015,680.00	0.33
33	603020	爱普股份	203,000	2,955,680.00	0.32
34	300270	中威电子	249,202	2,918,155.42	0.32
35	000623	吉林敖东	121,960	2,791,664.40	0.31
36	002295	精艺股份	198,900	2,760,732.00	0.30
37	002765	蓝黛传动	249,900	2,721,411.00	0.30
38	601186	中国铁建	225,000	2,706,750.00	0.30

39	000502	绿景控股	223,000	2,693,840.00	0.30
40	603919	金徽酒	139,670	2,664,903.60	0.29
41	603909	合诚股份	65,300	2,634,855.00	0.29
42	603117	万林股份	217,300	2,631,503.00	0.29
43	603223	恒通股份	107,000	2,616,150.00	0.29
44	000688	建新矿业	326,900	2,615,200.00	0.29
45	600724	宁波富达	549,000	2,602,260.00	0.29
46	601368	绿城水务	263,500	2,592,840.00	0.28
47	002418	康盛股份	276,800	2,577,008.00	0.28
48	000421	南京公用	351,900	2,568,870.00	0.28
49	300423	鲁亿通	75,000	2,546,250.00	0.28
50	600371	万向德农	211,232	2,530,559.36	0.28
51	600090	同济堂	269,394	2,524,221.78	0.28
52	002227	奥特迅	137,600	2,505,696.00	0.28
53	000757	浩物股份	343,800	2,482,236.00	0.27
54	300264	佳创视讯	279,800	2,473,432.00	0.27
55	601668	中国建筑	254,800	2,466,464.00	0.27
56	603701	德宏股份	79,775	2,461,856.50	0.27
57	002220	天宝股份	289,400	2,436,748.00	0.27
58	300211	亿通科技	269,000	2,421,000.00	0.27
59	000785	武汉中商	215,300	2,415,666.00	0.27
60	000951	中国重汽	157,300	2,405,117.00	0.26
61	603100	川仪股份	206,800	2,400,948.00	0.26
62	300505	川金诺	56,500	2,379,215.00	0.26
63	002077	大港股份	214,100	2,376,510.00	0.26
64	002687	乔治白	308,446	2,375,034.20	0.26
65	300489	中飞股份	100,000	2,366,000.00	0.26
66	300404	博济医药	102,100	2,355,447.00	0.26

67	000790	泰合健康	267,400	2,342,424.00	0.26
68	300181	佐力药业	336,800	2,337,392.00	0.26
69	300341	麦迪电气	268,200	2,319,930.00	0.25
70	300527	华舟应急	132,565	2,303,979.70	0.25
71	300455	康拓红外	188,740	2,291,303.60	0.25
72	300435	中泰股份	165,900	2,284,443.00	0.25
73	600917	重庆燃气	242,100	2,283,003.00	0.25
74	300305	裕兴股份	254,600	2,281,216.00	0.25
75	002071	长城影视	224,200	2,233,032.00	0.25
76	002758	华通医药	159,000	2,232,360.00	0.25
77	600620	天宸股份	179,100	2,229,795.00	0.24
78	600068	葛洲坝	198,036	2,225,924.64	0.24
79	300220	金运激光	118,800	2,210,868.00	0.24
80	601137	博威合金	192,900	2,191,344.00	0.24
81	002738	中矿资源	107,700	2,186,310.00	0.24
82	002360	同德化工	264,600	2,177,658.00	0.24
83	603309	维力医疗	122,400	2,177,496.00	0.24
84	300286	安科瑞	104,900	2,164,087.00	0.24
85	600170	上海建工	563,255	2,151,634.10	0.24
86	002517	恺英网络	61,100	2,150,109.00	0.24
87	002674	兴业科技	170,900	2,146,504.00	0.24
88	603789	星光农机	113,500	2,134,935.00	0.23
89	300321	同大股份	94,400	2,129,664.00	0.23
90	000719	大地传媒	203,900	2,126,677.00	0.23
91	000625	长安汽车	147,100	2,121,182.00	0.23
92	002596	海南瑞泽	255,300	2,116,437.00	0.23
93	300387	富邦股份	106,700	2,112,660.00	0.23
94	600223	鲁商置业	450,700	2,100,262.00	0.23

95	300472	新元科技	76,700	2,093,910.00	0.23
96	600816	安信信托	153,500	2,086,065.00	0.23
97	002261	拓维信息	177,800	2,082,038.00	0.23
98	300442	普丽盛	70,900	2,068,153.00	0.23
99	300464	星徽精密	163,700	2,041,339.00	0.22
100	002062	宏润建设	338,000	2,014,480.00	0.22
101	601800	中国交建	126,000	2,002,140.00	0.22
102	300184	力源信息	160,700	1,999,108.00	0.22
103	600606	绿地控股	254,900	1,993,318.00	0.22
104	603828	柯利达	91,800	1,992,978.00	0.22
105	000036	华联控股	218,500	1,988,350.00	0.22
106	600830	香溢融通	201,200	1,983,832.00	0.22
107	601127	小康股份	99,300	1,981,035.00	0.22
108	600077	宋都股份	495,000	1,975,050.00	0.22
109	600975	新五丰	308,600	1,975,040.00	0.22
110	300532	今天国际	83,500	1,972,270.00	0.22
111	300513	恒泰实达	43,500	1,968,810.00	0.22
112	300067	安诺其	312,800	1,967,512.00	0.22
113	600575	皖江物流	467,100	1,961,820.00	0.22
114	300194	福安药业	282,000	1,959,900.00	0.22
115	600261	阳光照明	297,133	1,952,163.81	0.21
116	300265	通光线缆	153,653	1,951,393.10	0.21
117	002706	良信电器	163,500	1,942,380.00	0.21
118	000540	中天金融	273,800	1,902,910.00	0.21
119	600051	宁波联合	198,900	1,901,484.00	0.21
120	600783	鲁信创投	111,099	1,892,015.97	0.21
121	002234	民和股份	151,900	1,889,636.00	0.21
122	600573	惠泉啤酒	186,000	1,886,040.00	0.21

123	600757	长江传媒	252,000	1,882,440.00	0.21
124	300329	海伦钢琴	159,800	1,880,846.00	0.21
125	300046	台基股份	100,200	1,873,740.00	0.21
126	600819	耀皮玻璃	277,900	1,870,267.00	0.21
127	600784	鲁银投资	280,000	1,867,600.00	0.21
128	000011	深物业 A	93,200	1,864,000.00	0.20
129	002769	普路通	122,000	1,854,400.00	0.20
130	002208	合肥城建	142,000	1,846,000.00	0.20
131	300139	晓程科技	175,900	1,845,191.00	0.20
132	000050	深天马 A	89,700	1,845,129.00	0.20
133	300390	天华超净	201,200	1,845,004.00	0.20
134	600758	红阳能源	205,700	1,838,958.00	0.20
135	000416	民生控股	229,700	1,837,600.00	0.20
136	300062	中能电气	154,900	1,837,114.00	0.20
137	600865	百大集团	156,200	1,833,788.00	0.20
138	600373	中文传媒	78,000	1,833,780.00	0.20
139	000601	韶能股份	257,100	1,833,123.00	0.20
140	601999	出版传媒	201,000	1,833,120.00	0.20
141	600794	保税科技	444,600	1,827,306.00	0.20
142	300375	鹏翎股份	92,300	1,824,771.00	0.20
143	600593	大连圣亚	68,400	1,822,176.00	0.20
144	600356	恒丰纸业	183,100	1,820,014.00	0.20
145	002652	扬子新材	251,900	1,816,199.00	0.20
146	002719	麦趣尔	53,600	1,815,432.00	0.20
147	002591	恒大高新	118,200	1,812,006.00	0.20
148	000906	浙商中拓	203,470	1,808,848.30	0.20
149	600073	上海梅林	188,800	1,803,040.00	0.20
150	600650	锦江投资	100,500	1,802,970.00	0.20

151	600507	方大特钢	210,200	1,793,006.00	0.20
152	601900	南方传媒	143,900	1,790,116.00	0.20
153	600252	中恒集团	442,300	1,786,892.00	0.20
154	600509	天富能源	234,800	1,786,828.00	0.20
155	600131	岷江水电	220,900	1,784,872.00	0.20
156	600167	联美控股	83,700	1,777,788.00	0.20
157	002033	丽江旅游	173,641	1,774,611.02	0.19
158	600067	冠城大通	257,900	1,771,773.00	0.19
159	002214	大立科技	204,500	1,770,970.00	0.19
160	000908	景峰医药	209,600	1,769,024.00	0.19
161	002548	金新农	146,400	1,768,512.00	0.19
162	600493	凤竹纺织	161,800	1,766,856.00	0.19
163	600741	华域汽车	72,882	1,766,659.68	0.19
164	300315	掌趣科技	216,300	1,765,008.00	0.19
165	603600	永艺股份	107,200	1,764,512.00	0.19
166	000628	高新发展	183,500	1,759,765.00	0.19
167	002731	萃华珠宝	82,600	1,759,380.00	0.19
168	000868	安凯客车	330,700	1,759,324.00	0.19
169	600325	华发股份	210,660	1,759,011.00	0.19
170	000650	仁和药业	293,300	1,753,934.00	0.19
171	600769	祥龙电业	204,100	1,749,137.00	0.19
172	002580	圣阳股份	218,200	1,743,418.00	0.19
173	002537	海立美达	142,700	1,738,086.00	0.19
174	002660	茂硕电源	181,700	1,733,418.00	0.19
175	002243	通产丽星	179,000	1,730,930.00	0.19
176	002369	卓翼科技	200,200	1,729,728.00	0.19
177	002150	通润装备	147,100	1,728,425.00	0.19
178	600248	延长化建	286,200	1,725,786.00	0.19

179	002317	众生药业	138,500	1,720,170.00	0.19
180	600973	宝胜股份	307,000	1,719,200.00	0.19
181	300200	高盟新材	116,969	1,714,765.54	0.19
182	300403	地尔汉宇	94,300	1,714,374.00	0.19
183	600776	东方通信	252,200	1,709,916.00	0.19
184	002702	海欣食品	206,600	1,708,582.00	0.19
185	300037	新宙邦	74,300	1,707,414.00	0.19
186	600981	汇鸿集团	230,200	1,705,782.00	0.19
187	600661	新南洋	79,200	1,700,424.00	0.19
188	002670	国盛金控	106,860	1,699,074.00	0.19
189	600995	文山电力	174,600	1,698,858.00	0.19
190	600232	金鹰股份	209,700	1,696,473.00	0.19
191	000705	浙江震元	164,400	1,693,320.00	0.19
192	600361	华联综超	285,200	1,691,236.00	0.19
193	600647	同达创业	73,000	1,686,300.00	0.19
194	002708	光洋股份	183,300	1,684,527.00	0.19
195	000926	福星股份	138,000	1,683,600.00	0.18
196	002397	梦洁股份	251,600	1,680,688.00	0.18
197	000419	通程控股	237,300	1,680,084.00	0.18
198	300019	硅宝科技	164,800	1,677,664.00	0.18
199	000909	数源科技	138,600	1,677,060.00	0.18
200	000517	荣安地产	359,700	1,672,605.00	0.18
201	002662	京威股份	231,600	1,667,520.00	0.18
202	300141	和顺电气	133,450	1,662,787.00	0.18
203	600864	哈投股份	198,900	1,652,859.00	0.18
204	603519	立霸股份	76,300	1,652,658.00	0.18
205	300460	惠伦晶体	95,000	1,648,250.00	0.18
206	000665	湖北广电	135,600	1,647,540.00	0.18

207	300443	金雷风电	76,900	1,647,198.00	0.18
208	002760	凤形股份	50,100	1,641,276.00	0.18
209	600597	光明乳业	128,700	1,640,925.00	0.18
210	002700	新疆浩源	152,800	1,638,016.00	0.18
211	002206	海利得	219,700	1,632,371.00	0.18
212	300381	溢多利	97,400	1,626,580.00	0.18
213	002194	武汉凡谷	183,061	1,620,089.85	0.18
214	300146	汤臣倍健	117,700	1,617,198.00	0.18
215	600814	杭州解百	179,000	1,614,580.00	0.18
216	300474	景嘉微	45,600	1,614,240.00	0.18
217	300158	振东制药	99,500	1,613,890.00	0.18
218	300248	新开普	99,600	1,610,532.00	0.18
219	603999	读者传媒	72,000	1,607,040.00	0.18
220	300218	安利股份	139,300	1,604,736.00	0.18
221	300214	日科化学	239,000	1,603,690.00	0.18
222	300243	瑞丰高材	145,300	1,602,659.00	0.18
223	600530	交大昂立	282,300	1,594,995.00	0.18
224	002152	广电运通	191,850	1,594,273.50	0.18
225	300310	宜通世纪	120,100	1,587,722.00	0.17
226	002523	天桥起重	297,840	1,584,508.80	0.17
227	300395	菲利华	107,700	1,577,805.00	0.17
228	300517	海波重科	54,500	1,570,690.00	0.17
229	300342	天银机电	102,500	1,564,150.00	0.17
230	300254	仟源医药	109,800	1,560,258.00	0.17
231	600337	美克家居	275,900	1,558,835.00	0.17
232	601020	华钰矿业	70,400	1,550,912.00	0.17
233	600831	广电网络	155,800	1,550,210.00	0.17
234	300495	美尚生态	103,700	1,549,278.00	0.17

235	603678	火炬电子	55,500	1,544,565.00	0.17
236	300303	聚飞光电	355,900	1,541,047.00	0.17
237	603843	正平股份	108,800	1,539,520.00	0.17
238	603028	赛福天	101,100	1,530,654.00	0.17
239	600272	开开实业	111,800	1,527,188.00	0.17
240	300499	高澜股份	60,300	1,526,796.00	0.17
241	000960	锡业股份	112,130	1,526,089.30	0.17
242	002279	久其软件	121,100	1,519,805.00	0.17
243	002487	大金重工	242,000	1,517,340.00	0.17
244	002645	华宏科技	85,000	1,514,700.00	0.17
245	601798	蓝科高新	136,800	1,510,272.00	0.17
246	300480	光力科技	91,400	1,505,358.00	0.17
247	300354	东华测试	96,900	1,502,919.00	0.17
248	600136	当代明诚	89,300	1,499,347.00	0.16
249	603588	高能环境	96,100	1,499,160.00	0.16
250	300155	安居宝	190,500	1,491,615.00	0.16
251	300542	新晨科技	47,800	1,480,366.00	0.16
252	600485	信威集团	101,400	1,479,426.00	0.16
253	000985	大庆华科	62,300	1,476,510.00	0.16
254	300101	振芯科技	105,400	1,475,600.00	0.16
255	002698	博实股份	123,000	1,447,710.00	0.16
256	002096	南岭民爆	138,100	1,441,764.00	0.16
257	603090	宏盛股份	49,300	1,405,543.00	0.15
258	002796	世嘉科技	44,600	1,404,900.00	0.15
259	300535	达威股份	26,800	1,401,908.00	0.15
260	000997	新大陆	61,400	1,393,166.00	0.15
261	300525	博思软件	29,300	1,377,100.00	0.15
262	000666	经纬纺机	60,500	1,375,770.00	0.15

263	002376	新北洋	100,100	1,373,372.00	0.15
264	600393	粤泰股份	189,300	1,370,532.00	0.15
265	300487	蓝晓科技	80,600	1,358,916.00	0.15
266	300224	正海磁材	149,100	1,341,900.00	0.15
267	600845	宝信软件	79,600	1,341,260.00	0.15
268	000415	渤海金控	194,424	1,308,473.52	0.14
269	603099	长白山	84,800	1,299,984.00	0.14
270	600291	西水股份	58,900	1,295,800.00	0.14
271	600688	上海石化	189,600	1,253,256.00	0.14
272	002354	天神娱乐	58,200	1,251,300.00	0.14
273	000059	华锦股份	125,000	1,251,250.00	0.14
274	002281	光迅科技	54,200	1,204,324.00	0.13
275	300486	东杰智能	53,200	1,203,916.00	0.13
276	300370	安控科技	245,500	1,193,130.00	0.13
277	601997	贵阳银行	75,400	1,192,074.00	0.13
278	000030	富奥股份	132,500	1,184,550.00	0.13
279	600782	新钢股份	317,900	1,160,335.00	0.13
280	600221	海航控股	358,300	1,153,726.00	0.13
281	002478	常宝股份	207,700	1,148,581.00	0.13
282	600808	马钢股份	314,300	1,112,622.00	0.12
283	600282	南钢股份	294,400	1,092,224.00	0.12
284	002771	真视通	39,434	1,086,406.70	0.12
285	603111	康尼机电	86,873	1,059,850.60	0.12
286	000889	茂业通信	63,100	1,054,401.00	0.12
287	600060	海信电器	69,100	1,048,247.00	0.12
288	600029	南方航空	119,800	1,042,260.00	0.11
289	002540	亚太科技	147,400	1,040,644.00	0.11
290	601166	兴业银行	61,200	1,031,832.00	0.11

291	600050	中国联通	137,454	1,026,781.38	0.11
292	601899	紫金矿业	299,300	1,026,599.00	0.11
293	600038	中直股份	22,100	1,011,517.00	0.11
294	600862	中航高科	103,800	1,005,822.00	0.11
295	601989	中国重工	159,700	991,737.00	0.11
296	603799	华友钴业	16,100	978,558.00	0.11
297	600115	东方航空	143,900	978,520.00	0.11
298	601225	陕西煤业	137,900	974,953.00	0.11
299	600655	豫园商城	85,200	964,464.00	0.11
300	002001	新和成	49,000	951,090.00	0.10
301	603885	吉祥航空	62,200	944,196.00	0.10
302	600028	中国石化	157,900	936,347.00	0.10
303	000693	*ST 华泽	74,246	928,075.00	0.10
304	601677	明泰铝业	66,200	902,968.00	0.10
305	603993	洛阳钼业	176,900	895,114.00	0.10
306	300123	太阳鸟	75,500	889,390.00	0.10
307	601006	大秦铁路	103,017	864,312.63	0.09
308	002155	湖南黄金	89,900	860,343.00	0.09
309	002195	二三四五	119,500	854,425.00	0.09
310	002446	盛路通信	69,720	848,492.40	0.09
311	600262	北方股份	31,100	843,121.00	0.09
312	300008	天海防务	99,922	826,354.94	0.09
313	603300	华铁科技	71,900	816,065.00	0.09
314	300204	舒泰神	52,225	814,187.75	0.09
315	000338	潍柴动力	61,000	805,200.00	0.09
316	002025	航天电器	31,900	795,905.00	0.09
317	600873	梅花生物	140,000	793,800.00	0.09
318	600125	铁龙物流	88,039	788,829.44	0.09

319	300406	九强生物	47,900	788,434.00	0.09
320	600967	内蒙一机	57,800	787,814.00	0.09
321	002400	省广股份	98,040	787,261.20	0.09
322	600971	恒源煤电	96,400	783,732.00	0.09
323	300351	永贵电器	42,500	774,775.00	0.09
324	601333	广深铁路	169,600	766,592.00	0.08
325	600475	华光股份	38,000	757,340.00	0.08
326	600105	永鼎股份	93,700	756,159.00	0.08
327	000078	海王生物	125,100	754,353.00	0.08
328	600345	长江通信	36,600	754,326.00	0.08
329	600867	通化东宝	40,980	747,475.20	0.08
330	600459	贵研铂业	34,600	744,938.00	0.08
331	600419	天润乳业	14,600	731,898.00	0.08
332	600713	南京医药	103,800	729,714.00	0.08
333	300287	飞利信	79,200	727,056.00	0.08
334	601101	昊华能源	88,500	725,700.00	0.08
335	002290	中科新材	43,600	715,476.00	0.08
336	603508	思维列控	13,500	713,880.00	0.08
337	600850	华东电脑	33,300	711,621.00	0.08
338	002467	二六三	88,700	702,504.00	0.08
339	601857	中国石油	91,100	700,559.00	0.08
340	300079	数码视讯	119,400	698,490.00	0.08
341	000581	威孚高科	26,700	691,530.00	0.08
342	000698	沈阳化工	105,500	688,915.00	0.08
343	601231	环旭电子	43,700	686,527.00	0.08
344	600742	一汽富维	35,100	670,761.00	0.07
345	601788	光大证券	44,000	656,920.00	0.07
346	002429	兆驰股份	213,050	654,063.50	0.07

347	000055	方大集团	88,050	641,004.00	0.07
348	601117	中国化学	90,200	630,498.00	0.07
349	600323	瀚蓝环境	43,200	626,832.00	0.07
350	600089	特变电工	60,235	622,227.55	0.07
351	600030	中信证券	36,100	614,422.00	0.07
352	600759	洲际油气	99,500	602,970.00	0.07
353	600704	物产中大	82,450	601,060.50	0.07
354	000001	平安银行	63,700	598,143.00	0.07
355	601988	中国银行	160,700	594,590.00	0.07
356	601328	交通银行	95,600	588,896.00	0.06
357	000529	广弘控股	63,972	585,343.80	0.06
358	601288	农业银行	166,000	584,320.00	0.06
359	600692	亚通股份	43,900	570,700.00	0.06
360	002763	汇洁股份	19,700	566,375.00	0.06
361	600835	上海机电	26,600	562,324.00	0.06
362	603167	渤海轮渡	50,900	553,283.00	0.06
363	002727	一心堂	29,900	550,160.00	0.06
364	600547	山东黄金	18,900	546,777.00	0.06
365	002320	海峡股份	38,200	541,676.00	0.06
366	000738	航发控制	27,300	534,261.00	0.06
367	601000	唐山港	99,620	520,016.40	0.06
368	002416	爱施德	47,800	515,762.00	0.06
369	600668	尖峰集团	30,000	515,400.00	0.06
370	601607	上海医药	17,700	511,176.00	0.06
371	601222	林洋能源	68,700	510,441.00	0.06
372	002519	银河电子	64,770	509,739.90	0.06
373	600297	广汇汽车	67,440	507,823.20	0.06
374	300190	维尔利	33,600	495,936.00	0.05

375	300274	阳光电源	43,900	486,851.00	0.05
376	000990	诚志股份	29,800	476,204.00	0.05
377	603323	吴江银行	30,800	475,552.00	0.05
378	601965	中国汽研	49,900	468,561.00	0.05
379	601128	常熟银行	41,900	466,347.00	0.05
380	002382	蓝帆医疗	37,200	454,956.00	0.05
381	300360	炬华科技	30,100	453,005.00	0.05
382	600585	海螺水泥	19,900	452,327.00	0.05
383	002179	中航光电	14,400	449,136.00	0.05
384	002293	罗莱生活	38,900	445,794.00	0.05
385	601618	中国中冶	88,900	445,389.00	0.05
386	600026	中远海能	66,600	441,558.00	0.05
387	000860	顺鑫农业	21,800	436,218.00	0.05
388	300083	劲胜精密	47,100	435,204.00	0.05
389	603015	弘讯科技	41,006	426,462.40	0.05
390	300393	中来股份	7,700	423,577.00	0.05
391	600335	国机汽车	35,357	422,869.72	0.05
392	600811	东方集团	64,800	422,496.00	0.05
393	300279	和晶科技	30,180	420,105.60	0.05
394	600380	健康元	45,500	413,140.00	0.05
395	600309	万华化学	14,280	408,979.20	0.04
396	600064	南京高科	27,069	408,741.90	0.04
397	601018	宁波港	71,800	405,670.00	0.04
398	002534	杭锅股份	42,580	402,806.80	0.04
399	601169	北京银行	43,900	402,563.00	0.04
400	600648	外高桥	21,200	392,624.00	0.04
401	000830	鲁西化工	56,700	391,230.00	0.04
402	002099	海翔药业	58,200	387,612.00	0.04

403	002131	利欧股份	117,800	387,562.00	0.04
404	300015	爱尔眼科	16,600	386,116.00	0.04
405	002789	建艺集团	7,500	384,750.00	0.04
406	603568	伟明环保	17,700	382,674.00	0.04
407	600318	新力金融	35,600	381,988.00	0.04
408	002479	富春环保	31,900	379,610.00	0.04
409	600031	三一重工	46,600	378,858.00	0.04
410	002324	普利特	14,000	376,320.00	0.04
411	300230	永利股份	22,580	373,473.20	0.04
412	603996	中新科技	21,800	372,780.00	0.04
413	600738	兰州民百	43,800	370,548.00	0.04
414	600004	白云机场	19,900	367,354.00	0.04
415	600763	通策医疗	14,600	366,314.00	0.04
416	600426	华鲁恒升	31,170	365,935.80	0.04
417	002002	鸿达兴业	46,700	365,661.00	0.04
418	600639	浦东金桥	20,000	362,400.00	0.04
419	000541	佛山照明	39,400	358,934.00	0.04
420	600397	安源煤业	83,000	358,560.00	0.04
421	600551	时代出版	22,700	358,433.00	0.04
422	600717	天津港	28,600	357,214.00	0.04
423	600122	宏图高科	31,900	354,090.00	0.04
424	601678	滨化股份	50,100	348,195.00	0.04
425	000089	深圳机场	37,100	346,885.00	0.04
426	600897	厦门空港	13,598	345,117.24	0.04
427	000521	美菱电器	53,600	343,040.00	0.04
428	600383	金地集团	29,700	340,659.00	0.04
429	002470	金正大	45,100	339,603.00	0.04
430	600346	恒力股份	40,800	334,560.00	0.04

431	600839	四川长虹	92,400	334,488.00	0.04
432	603599	广信股份	22,100	334,373.00	0.04
433	600009	上海机场	8,900	332,059.00	0.04
434	600879	航天电子	37,500	329,625.00	0.04
435	002589	瑞康医药	21,200	326,480.00	0.04
436	002440	闰土股份	21,300	325,038.00	0.04
437	000902	新洋丰	36,100	324,900.00	0.04
438	600287	江苏舜天	41,500	324,530.00	0.04
439	603188	亚邦股份	18,400	320,896.00	0.04
440	600273	嘉化能源	34,200	320,796.00	0.04
441	600398	海澜之家	33,700	319,813.00	0.04
442	601179	中国西电	57,100	317,476.00	0.03
443	000876	新希望	38,600	317,292.00	0.03
444	600271	航天信息	15,300	315,792.00	0.03
445	600208	新湖中宝	70,100	315,450.00	0.03
446	300242	明家联合	32,900	312,221.00	0.03
447	002441	众业达	27,000	312,120.00	0.03
448	600790	轻纺城	45,700	311,217.00	0.03
449	002157	正邦科技	67,900	308,945.00	0.03
450	600958	东方证券	21,700	301,847.00	0.03
451	000528	柳工	34,500	298,080.00	0.03
452	600761	安徽合力	22,600	296,060.00	0.03
453	601700	风范股份	48,500	290,515.00	0.03
454	603878	武进不锈	11,800	286,740.00	0.03
455	600694	大商股份	7,200	280,584.00	0.03
456	000428	华天酒店	54,700	278,970.00	0.03
457	300347	泰格医药	11,500	278,300.00	0.03
458	002723	金莱特	13,700	277,973.00	0.03

459	300438	鹏辉能源	11,000	277,200.00	0.03
460	600729	重庆百货	10,300	276,452.00	0.03
461	300272	开能环保	27,300	274,911.00	0.03
462	600824	益民集团	47,400	271,128.00	0.03
463	002100	天康生物	33,500	269,005.00	0.03
464	300191	潜能恒信	10,100	268,862.00	0.03
465	600895	张江高科	15,800	266,704.00	0.03
466	300116	坚瑞沃能	24,800	266,600.00	0.03
467	600628	新世界	23,000	265,650.00	0.03
468	600327	大东方	32,400	265,356.00	0.03
469	002142	宁波银行	13,600	262,480.00	0.03
470	000725	京东方 A	62,800	261,248.00	0.03
471	300017	网宿科技	20,900	252,263.00	0.03
472	002829	星网宇达	7,600	250,724.00	0.03
473	002097	山河智能	27,900	248,031.00	0.03
474	600180	瑞茂通	17,600	247,104.00	0.03
475	002595	豪迈科技	11,000	244,530.00	0.03
476	600415	小商品城	33,200	240,368.00	0.03
477	600823	世茂股份	48,800	239,120.00	0.03
478	600883	博闻科技	20,300	236,901.00	0.03
479	002435	长江润发	13,800	236,532.00	0.03
480	600519	贵州茅台	500	235,925.00	0.03
481	600499	科达洁能	29,700	235,818.00	0.03
482	002183	怡亚通	27,300	235,599.00	0.03
483	600177	雅戈尔	23,140	234,176.80	0.03
484	300178	腾邦国际	18,000	230,400.00	0.03
485	600269	赣粤高速	44,200	230,282.00	0.03
486	600270	外运发展	12,000	227,160.00	0.02

487	002461	珠江啤酒	18,300	223,443.00	0.02
488	002607	亚夏汽车	48,360	221,005.20	0.02
489	000713	丰乐种业	26,900	220,311.00	0.02
490	601888	中国国旅	7,300	220,022.00	0.02
491	600019	宝钢股份	32,700	219,417.00	0.02
492	002828	贝肯能源	8,400	218,652.00	0.02
493	300589	江龙船艇	8,900	218,584.00	0.02
494	601766	中国中车	21,400	216,568.00	0.02
495	000042	中洲控股	13,000	216,190.00	0.02
496	000895	双汇发展	9,100	216,125.00	0.02
497	601188	龙江交通	44,800	215,936.00	0.02
498	000729	燕京啤酒	32,000	215,040.00	0.02
499	600023	浙能电力	39,300	214,578.00	0.02
500	600739	辽宁成大	11,800	212,754.00	0.02
501	603729	龙韵股份	3,100	212,381.00	0.02
502	002707	众信旅游	16,100	211,393.00	0.02
503	300581	晨曦航空	5,000	209,500.00	0.02
504	600642	申能股份	32,900	207,270.00	0.02
505	000598	兴蓉环境	36,700	206,254.00	0.02
506	000543	皖能电力	35,300	205,799.00	0.02
507	002781	奇信股份	6,900	203,136.00	0.02
508	600027	华电国际	42,000	202,860.00	0.02
509	600438	通威股份	35,700	199,206.00	0.02
510	603866	桃李面包	5,500	195,690.00	0.02
511	600385	山东金泰	13,900	192,376.00	0.02
512	002091	江苏国泰	19,960	190,618.00	0.02
513	002160	常铝股份	26,700	190,104.00	0.02
514	600153	建发股份	14,700	190,071.00	0.02

515	300125	易世达	7,200	187,632.00	0.02
516	600766	园城黄金	15,000	187,500.00	0.02
517	002712	思美传媒	8,600	185,588.00	0.02
518	600605	汇通能源	11,000	185,020.00	0.02
519	603158	腾龙股份	8,500	183,345.00	0.02
520	002238	天威视讯	15,200	180,880.00	0.02
521	600362	江西铜业	10,700	180,402.00	0.02
522	600219	南山铝业	52,200	176,958.00	0.02
523	600088	中视传媒	10,100	176,952.00	0.02
524	600778	友好集团	22,400	173,152.00	0.02
525	603038	华立股份	3,600	172,800.00	0.02
526	600117	西宁特钢	33,700	169,848.00	0.02
527	300182	捷成股份	17,700	169,212.00	0.02
528	300093	金刚玻璃	11,800	169,094.00	0.02
529	600332	白云山	5,800	168,432.00	0.02
530	002623	亚玛顿	6,200	167,524.00	0.02
531	002756	永兴特钢	5,900	166,380.00	0.02
532	000402	金融街	14,100	165,252.00	0.02
533	300249	依米康	12,100	164,560.00	0.02
534	600561	江西长运	17,700	164,256.00	0.02
535	300493	润欣科技	12,700	163,957.00	0.02
536	002627	宜昌交运	8,900	163,671.00	0.02
537	002081	金螳螂	14,900	163,602.00	0.02
538	600886	国投电力	20,500	161,950.00	0.02
539	600376	首开股份	14,000	160,160.00	0.02
540	603668	天马科技	10,800	159,192.00	0.02
541	000524	岭南控股	11,800	159,064.00	0.02
542	000423	东阿阿胶	2,200	158,158.00	0.02

543	600708	光明地产	23,790	157,965.60	0.02
544	600238	海南椰岛	15,500	154,690.00	0.02
545	600755	厦门国贸	16,900	154,128.00	0.02
546	002241	歌尔股份	7,900	152,312.00	0.02
547	002714	牧原股份	5,461	148,648.42	0.02
548	300106	西部牧业	13,800	147,798.00	0.02
549	600118	中国卫星	5,300	147,552.00	0.02
550	002500	山西证券	15,400	147,532.00	0.02
551	600498	烽火通信	5,800	147,030.00	0.02
552	002807	江阴银行	11,700	146,601.00	0.02
553	002839	张家港行	9,300	146,196.00	0.02
554	000899	赣能股份	17,100	144,495.00	0.02
555	000977	浪潮信息	8,300	143,756.00	0.02
556	002119	康强电子	8,300	142,594.00	0.02
557	600827	百联股份	8,700	141,375.00	0.02
558	000411	英特集团	6,456	141,257.28	0.02
559	000701	厦门信达	11,200	140,000.00	0.02
560	600505	西昌电力	16,300	136,431.00	0.01
561	002469	三维工程	16,900	136,214.00	0.01
562	600522	中天科技	11,300	136,165.00	0.01
563	600644	乐山电力	17,900	135,861.00	0.01
564	600577	精达股份	28,300	135,840.00	0.01
565	603886	元祖股份	6,900	135,378.00	0.01
566	603023	威帝股份	10,700	134,820.00	0.01
567	300597	吉大通信	7,800	133,848.00	0.01
568	002132	恒星科技	28,700	133,455.00	0.01
569	300536	农尚环境	3,800	133,380.00	0.01
570	000534	万泽股份	11,300	133,340.00	0.01

571	002568	百润股份	8,000	132,960.00	0.01
572	603199	九华旅游	3,400	132,600.00	0.01
573	603031	安德利	3,800	132,354.00	0.01
574	600749	西藏旅游	7,417	131,800.09	0.01
575	603779	威龙股份	6,000	131,280.00	0.01
576	002231	奥维通信	12,200	131,028.00	0.01
577	603929	亚翔集成	5,800	130,616.00	0.01
578	603345	安井食品	5,100	130,560.00	0.01
579	600805	悦达投资	17,500	128,625.00	0.01
580	002528	英飞拓	21,600	128,088.00	0.01
581	603688	石英股份	11,000	126,830.00	0.01
582	002842	翔鹭钨业	3,100	126,790.00	0.01
583	300615	欣天科技	3,500	126,525.00	0.01
584	002713	东易日盛	6,200	126,294.00	0.01
585	603959	百利科技	7,000	126,280.00	0.01
586	300578	会畅通讯	3,500	126,035.00	0.01
587	002200	云投生态	7,300	125,998.00	0.01
588	002761	多喜爱	3,300	125,697.00	0.01
589	002593	日上集团	23,859	125,498.34	0.01
590	600676	交运股份	16,800	125,160.00	0.01
591	603017	中衡设计	7,100	124,818.00	0.01
592	600081	东风科技	10,000	124,500.00	0.01
593	601616	广电电气	26,600	124,222.00	0.01
594	000060	中金岭南	11,000	123,200.00	0.01
595	600828	茂业商业	14,800	123,136.00	0.01
596	300025	华星创业	15,600	122,772.00	0.01
597	603089	正裕工业	4,100	122,754.00	0.01
598	600936	广西广电	15,200	122,664.00	0.01

599	603559	中通国脉	4,700	122,623.00	0.01
600	600150	中国船舶	5,300	121,211.00	0.01
601	603101	汇嘉时代	7,200	119,520.00	0.01
602	603977	国泰集团	7,100	118,499.00	0.01
603	300318	博晖创新	16,600	117,528.00	0.01
604	600188	兖州煤业	9,600	117,504.00	0.01
605	000917	电广传媒	10,300	116,390.00	0.01
606	000900	现代投资	12,600	115,920.00	0.01
606	600020	中原高速	23,000	115,920.00	0.01
607	600774	汉商集团	6,900	115,851.00	0.01
608	600822	上海物贸	9,400	115,620.00	0.01
609	300526	中潜股份	3,700	115,477.00	0.01
610	600882	广泽股份	12,300	115,251.00	0.01
611	600751	天海投资	20,200	114,938.00	0.01
612	600633	浙数文化	5,900	113,988.00	0.01
613	600350	山东高速	18,200	112,840.00	0.01
614	002776	柏堡龙	4,800	111,264.00	0.01
615	600184	光电股份	5,900	110,684.00	0.01
616	000886	海南高速	22,200	110,112.00	0.01
617	300424	航新科技	2,300	108,491.00	0.01
618	600066	宇通客车	4,900	107,653.00	0.01
619	002800	天顺股份	2,800	107,464.00	0.01
620	300174	元力股份	3,600	107,028.00	0.01
621	603069	海汽集团	8,900	106,889.00	0.01
622	600834	申通地铁	8,500	106,760.00	0.01
623	601555	东吴证券	9,500	106,685.00	0.01
624	000686	东北证券	10,600	106,530.00	0.01
625	600804	鹏博士	6,000	106,500.00	0.01

626	601928	凤凰传媒	10,900	106,384.00	0.01
627	603333	明星电缆	14,900	106,237.00	0.01
628	600218	全柴动力	11,800	106,082.00	0.01
629	600104	上汽集团	3,400	105,570.00	0.01
630	300282	汇冠股份	5,000	105,500.00	0.01
631	002092	中泰化学	8,300	105,410.00	0.01
632	002780	三夫户外	3,900	104,871.00	0.01
633	000712	锦龙股份	6,400	104,768.00	0.01
634	002079	苏州固锝	14,200	104,654.00	0.01
635	603606	东方电缆	8,700	104,574.00	0.01
636	600825	新华传媒	14,700	104,223.00	0.01
637	600674	川投能源	10,500	103,110.00	0.01
638	600035	楚天高速	18,500	101,935.00	0.01
639	300552	万集科技	3,100	101,680.00	0.01
640	300283	温州宏丰	14,000	101,080.00	0.01
641	603990	麦迪科技	2,600	100,724.00	0.01
642	300541	先进数通	3,400	99,110.00	0.01
643	300337	银邦股份	11,000	97,570.00	0.01
644	002798	帝王洁具	2,400	97,248.00	0.01
645	000531	穗恒运A	10,200	97,104.00	0.01
646	600011	华能国际	13,200	96,888.00	0.01
647	600615	丰华股份	6,100	96,563.00	0.01
648	000586	汇源通信	4,900	95,942.00	0.01
649	000735	罗牛山	15,200	95,000.00	0.01
650	600743	华远地产	22,500	94,950.00	0.01
651	000066	中国长城	10,500	94,605.00	0.01
652	600173	卧龙地产	14,200	94,430.00	0.01
653	000685	中山公用	8,600	94,170.00	0.01

654	000039	中集集团	5,200	93,756.00	0.01
655	000948	南天信息	7,700	93,632.00	0.01
656	300511	雪榕生物	4,750	93,480.00	0.01
657	001896	豫能控股	13,300	93,366.00	0.01
658	002718	友邦吊顶	1,600	93,200.00	0.01
659	002557	洽洽食品	6,400	92,608.00	0.01
660	000695	滨海能源	7,900	92,588.00	0.01
661	000878	云南铜业	7,000	92,330.00	0.01
662	603398	邦宝益智	4,300	92,192.00	0.01
663	002225	濮耐股份	16,900	92,105.00	0.01
664	000572	海马汽车	17,800	92,026.00	0.01
665	002310	东方园林	5,500	91,960.00	0.01
666	601969	海南矿业	8,700	91,872.00	0.01
667	603021	山东华鹏	7,900	91,482.00	0.01
668	600410	华胜天成	10,300	91,258.00	0.01
669	603268	松发股份	2,800	90,552.00	0.01
670	000617	中油资本	5,800	90,480.00	0.01
671	002740	爱迪尔	8,600	90,386.00	0.01
672	603979	金诚信	5,100	90,372.00	0.01
673	600166	福田汽车	31,800	90,312.00	0.01
674	300501	海顺新材	2,000	90,260.00	0.01
675	600718	东软集团	5,800	90,190.00	0.01
676	002641	永高股份	17,200	89,956.00	0.01
677	002088	鲁阳节能	7,500	89,775.00	0.01
678	002203	海亮股份	11,000	89,540.00	0.01
679	000630	铜陵有色	31,500	89,460.00	0.01
680	300010	立思辰	6,900	89,355.00	0.01
681	000021	深科技	10,400	89,232.00	0.01

682	300253	卫宁健康	11,400	89,034.00	0.01
683	603058	永吉股份	4,100	88,970.00	0.01
684	601168	西部矿业	11,500	88,435.00	0.01
685	601158	重庆水务	12,300	87,945.00	0.01
686	601258	庞大集团	31,400	87,920.00	0.01
687	002105	信隆健康	10,600	85,754.00	0.01
688	002403	爱仕达	6,500	85,670.00	0.01
689	600422	昆药集团	7,500	85,050.00	0.01
690	002554	惠博普	14,400	84,960.00	0.01
691	600285	羚锐制药	7,500	84,225.00	0.01
692	002575	群兴玩具	9,800	83,888.00	0.01
693	600664	哈药股份	14,300	83,083.00	0.01
694	600183	生益科技	6,700	82,678.00	0.01
695	600998	九州通	3,800	81,928.00	0.01
696	600960	渤海活塞	10,700	81,641.00	0.01
697	002750	龙津药业	6,600	81,510.00	0.01
698	300473	德尔股份	1,700	80,920.00	0.01
699	603123	翠微股份	9,100	80,808.00	0.01
700	600129	太极集团	5,900	79,473.00	0.01
701	600172	黄河旋风	9,600	79,008.00	0.01
702	002433	太安堂	8,500	78,625.00	0.01
703	300239	东宝生物	11,900	78,540.00	0.01
704	600482	中国动力	3,100	78,399.00	0.01
705	600216	浙江医药	7,900	78,289.00	0.01
706	600875	东方电气	8,100	77,598.00	0.01
707	603716	塞力斯	800	77,592.00	0.01
708	603339	四方冷链	3,000	77,580.00	0.01
709	600267	海正药业	6,600	77,088.00	0.01

710	300452	山河药辅	2,800	77,000.00	0.01
711	600141	兴发集团	6,200	76,694.00	0.01
712	002788	鹭燕医药	2,300	76,590.00	0.01
713	002777	久远银海	1,100	76,560.00	0.01
714	603328	依顿电子	5,400	76,410.00	0.01
715	000422	湖北宜化	12,700	75,565.00	0.01
716	300233	金城医药	3,600	75,564.00	0.01
717	000590	启迪古汉	4,600	74,658.00	0.01
718	300384	三联虹普	2,000	74,180.00	0.01
719	601155	新城控股	4,000	74,160.00	0.01
720	300434	金石东方	3,000	73,770.00	0.01
721	300346	南大光电	3,200	72,864.00	0.01
722	600900	长江电力	4,700	72,286.00	0.01
723	002386	天原集团	10,100	72,013.00	0.01
724	300045	华力创通	7,000	71,400.00	0.01
725	300119	瑞普生物	5,000	71,200.00	0.01
726	600663	陆家嘴	3,000	70,920.00	0.01
727	300070	碧水源	3,800	70,870.00	0.01
728	600584	长电科技	4,400	70,620.00	0.01
729	600340	华夏幸福	2,100	70,518.00	0.01
730	000536	华映科技	12,100	70,301.00	0.01
731	300566	激智科技	2,200	70,202.00	0.01
732	600487	亨通光电	2,500	70,125.00	0.01
733	300516	久之洋	1,100	69,839.00	0.01
734	002424	贵州百灵	3,700	69,782.00	0.01
735	002005	德豪润达	14,600	69,642.00	0.01
736	002007	华兰生物	1,900	69,350.00	0.01
737	000727	华东科技	24,300	68,769.00	0.01

738	603189	网达软件	3,200	68,736.00	0.01
739	300593	新雷能	2,600	68,614.00	0.01
740	300609	汇纳科技	2,000	68,540.00	0.01
741	000733	振华科技	4,300	68,370.00	0.01
742	603819	神力股份	2,700	68,310.00	0.01
743	601877	正泰电器	3,400	68,306.00	0.01
744	300223	北京君正	2,800	68,180.00	0.01
745	000518	四环生物	8,900	68,085.00	0.01
746	600389	江山股份	4,100	67,978.00	0.01
747	300038	梅泰诺	1,600	67,760.00	0.01
748	300051	三五互联	5,800	67,686.00	0.01
749	300235	方直科技	4,100	67,609.00	0.01
750	603859	能科股份	2,100	67,452.00	0.01
751	000822	山东海化	8,300	67,396.00	0.01
752	000049	德赛电池	1,300	67,353.00	0.01
753	002184	海得控制	4,800	67,200.00	0.01
754	300605	恒锋信息	2,100	66,780.00	0.01
755	002495	佳隆股份	14,600	66,722.00	0.01
756	300598	诚迈科技	1,700	66,674.00	0.01
757	600429	三元股份	10,200	66,606.00	0.01
758	300608	思特奇	2,000	66,340.00	0.01
759	002648	卫星石化	4,000	66,000.00	0.01
760	002216	三全食品	7,600	65,436.00	0.01
761	000929	兰州黄河	4,700	65,377.00	0.01
762	300469	信息发展	1,200	65,292.00	0.01
763	002381	双箭股份	7,400	64,676.00	0.01
764	002017	东信和平	5,800	64,554.00	0.01
765	600409	三友化工	6,400	64,448.00	0.01

766	300530	达志科技	1,300	64,272.00	0.01
767	002093	国脉科技	7,300	64,240.00	0.01
768	000063	中兴通讯	2,700	64,098.00	0.01
769	002286	保龄宝	5,000	62,350.00	0.01
770	002003	伟星股份	5,900	61,655.00	0.01
771	002475	立讯精密	2,100	61,404.00	0.01
772	300391	康跃科技	3,900	61,386.00	0.01
773	002608	江苏国信	4,900	61,201.00	0.01
774	603566	普莱柯	2,500	60,650.00	0.01
775	600677	航天通信	4,400	60,412.00	0.01
776	600685	中船防务	2,200	60,236.00	0.01
777	300488	恒锋工具	1,800	60,120.00	0.01
778	002270	华明装备	5,600	60,032.00	0.01
779	300416	苏试试验	2,400	59,928.00	0.01
780	300445	康斯特	2,700	59,805.00	0.01
781	002034	美欣达	1,400	59,682.00	0.01
782	600754	锦江股份	2,200	59,620.00	0.01
783	002187	广百股份	4,700	58,609.00	0.01
784	600785	新华百货	2,500	58,475.00	0.01
785	000888	峨眉山A	4,600	58,420.00	0.01
786	603018	中设集团	1,800	58,302.00	0.01
787	603698	航天工程	2,300	57,960.00	0.01
788	300281	金明精机	3,600	57,888.00	0.01
789	002541	鸿路钢构	3,300	57,057.00	0.01
789	002656	摩登大道	3,300	57,057.00	0.01
790	300144	宋城演艺	2,700	56,349.00	0.01
791	601107	四川成渝	11,900	56,168.00	0.01
792	300601	康泰生物	2,000	56,120.00	0.01

793	002144	宏达高科	3,300	56,100.00	0.01
794	600386	北巴传媒	4,200	55,860.00	0.01
795	300072	三聚环保	1,500	55,575.00	0.01
796	601666	平煤股份	10,500	55,335.00	0.01
797	300240	飞力达	5,900	55,106.00	0.01
798	600295	鄂尔多斯	5,400	55,080.00	0.01
799	000938	紫光股份	900	55,008.00	0.01
800	000627	天茂集团	6,800	54,944.00	0.01
801	600997	开滦股份	9,000	54,900.00	0.01
802	600258	首旅酒店	2,320	54,195.20	0.01
803	600123	兰花科创	7,100	54,102.00	0.01
804	601898	中煤能源	9,200	54,096.00	0.01
805	600098	广州发展	6,800	53,788.00	0.01
806	600508	上海能源	4,600	53,682.00	0.01
807	300573	兴齐眼药	1,500	53,430.00	0.01
808	600969	郴电国际	3,700	52,540.00	0.01
809	002826	易明医药	2,500	52,350.00	0.01
810	600111	北方稀土	4,600	52,118.00	0.01
811	601139	深圳燃气	6,000	51,900.00	0.01
812	000501	鄂武商A	2,800	51,688.00	0.01
813	603669	灵康药业	2,300	51,336.00	0.01
814	002817	黄山胶囊	1,400	50,904.00	0.01
815	300529	健帆生物	1,700	50,252.00	0.01
816	002236	大华股份	2,200	50,182.00	0.01
817	600859	王府井	3,100	50,065.00	0.01
818	603988	中电电机	800	49,888.00	0.01
819	000882	华联股份	13,700	49,457.00	0.01
820	600251	冠农股份	6,200	49,414.00	0.01

821	600665	天地源	9,900	49,401.00	0.01
822	000631	顺发恒业	11,100	48,951.00	0.01
823	300584	海辰药业	1,400	48,832.00	0.01
824	002058	威尔泰	2,200	48,444.00	0.01
825	601198	东兴证券	2,800	48,272.00	0.01
826	600061	国投安信	3,100	48,205.00	0.01
827	600052	浙江广厦	9,500	47,975.00	0.01
828	600007	中国国贸	2,300	47,863.00	0.01
829	002174	游族网络	1,500	47,640.00	0.01
830	600894	广日股份	4,000	47,360.00	0.01
831	600658	电子城	3,600	46,980.00	0.01
832	601633	长城汽车	3,500	46,515.00	0.01
833	600418	江淮汽车	4,400	46,420.00	0.01
834	000550	江铃汽车	2,200	45,540.00	0.01
835	600737	中粮糖业	4,800	45,312.00	0.00
836	000898	鞍钢股份	8,000	45,280.00	0.00
837	002810	山东赫达	1,400	45,206.00	0.00
838	300026	红日药业	9,500	44,745.00	0.00
838	300169	天晟新材	5,700	44,745.00	0.00
839	601003	柳钢股份	9,900	44,352.00	0.00
840	600469	风神股份	5,800	43,558.00	0.00
841	000639	西王食品	2,200	43,538.00	0.00
842	600320	振华重工	8,400	43,512.00	0.00
843	601007	金陵饭店	3,700	43,179.00	0.00
844	002636	金安国纪	2,500	43,175.00	0.00
845	000709	河钢股份	10,300	43,157.00	0.00
846	601233	桐昆股份	3,100	42,966.00	0.00
847	300587	天铁股份	1,600	42,912.00	0.00

848	600461	洪城水业	5,900	42,539.00	0.00
849	603823	百合花	2,000	42,360.00	0.00
850	002039	黔源电力	2,900	42,166.00	0.00
851	000936	华西股份	6,000	42,120.00	0.00
852	600982	宁波热电	8,700	42,108.00	0.00
853	002805	丰元股份	1,400	42,098.00	0.00
854	603033	三维股份	1,700	41,973.00	0.00
855	002228	合兴包装	9,000	41,940.00	0.00
856	300586	美联新材	1,500	41,925.00	0.00
857	002802	洪汇新材	1,300	41,860.00	0.00
858	002678	珠江钢琴	3,300	41,844.00	0.00
859	601515	东风股份	3,700	41,810.00	0.00
860	600230	沧州大化	1,400	41,608.00	0.00
861	603315	福鞍股份	2,500	41,550.00	0.00
862	603818	曲美家居	2,600	41,418.00	0.00
863	600299	安迪苏	3,400	41,378.00	0.00
864	300576	容大感光	1,800	41,364.00	0.00
865	002338	奥普光电	1,200	41,184.00	0.00
866	000821	京山轻机	3,100	41,137.00	0.00
867	600587	新华医疗	2,300	40,894.00	0.00
868	300540	深冷股份	1,200	40,788.00	0.00
869	603029	天鹅股份	1,400	40,670.00	0.00
870	603429	集友股份	500	40,490.00	0.00
871	000028	国药一致	500	40,450.00	0.00
872	002779	中坚科技	1,600	40,368.00	0.00
873	600481	双良节能	7,600	40,356.00	0.00
874	002014	永新股份	3,200	40,352.00	0.00
875	300042	朗科科技	1,100	40,150.00	0.00

876	002103	广博股份	3,000	39,720.00	0.00
877	002010	传化智联	2,600	39,676.00	0.00
878	300147	香雪制药	3,800	39,026.00	0.00
879	600312	平高电气	2,800	38,472.00	0.00
880	002816	和科达	1,300	38,350.00	0.00
881	600268	国电南自	6,200	38,254.00	0.00
882	601882	海天精工	2,200	38,236.00	0.00
883	300663	科蓝软件	1,600	38,128.00	0.00
884	002370	亚太药业	1,300	38,116.00	0.00
885	002422	科伦药业	2,300	37,996.00	0.00
886	600691	阳煤化工	13,400	37,922.00	0.00
887	600976	健民集团	1,400	37,814.00	0.00
888	002309	中利集团	3,000	37,530.00	0.00
889	002213	特 尔 佳	1,700	37,383.00	0.00
890	000589	黔轮胎A	6,700	37,185.00	0.00
891	002202	金风科技	2,400	37,128.00	0.00
892	000591	太阳能	7,200	37,008.00	0.00
893	600096	云天化	5,000	37,000.00	0.00
894	603088	宁波精达	1,000	36,810.00	0.00
895	603003	龙宇燃油	2,400	36,144.00	0.00
896	603318	派思股份	3,200	35,904.00	0.00
897	300241	瑞丰光电	2,800	35,784.00	0.00
898	300280	南通锻压	1,200	35,736.00	0.00
899	002484	江海股份	3,600	35,712.00	0.00
900	603806	福斯特	1,100	35,211.00	0.00
901	000811	烟台冰轮	2,000	34,900.00	0.00
902	002587	奥拓电子	4,600	34,684.00	0.00
903	300095	华伍股份	3,200	34,592.00	0.00

904	000792	盐湖股份	3,300	34,485.00	0.00
905	600801	华新水泥	3,600	34,308.00	0.00
906	002401	中远海科	2,600	34,190.00	0.00
907	300269	联建光电	1,700	34,051.00	0.00
908	300394	天孚通信	1,300	33,267.00	0.00
909	002609	捷顺科技	2,200	32,934.00	0.00
910	002147	新光圆成	2,100	32,634.00	0.00
911	300227	光韵达	1,500	32,535.00	0.00
912	000636	风华高科	3,800	32,338.00	0.00
913	002452	长高集团	4,700	32,289.00	0.00
914	300256	星星科技	3,100	32,240.00	0.00
915	300365	恒华科技	900	32,130.00	0.00
916	300018	中元股份	3,600	31,644.00	0.00
917	300468	四方精创	700	31,213.00	0.00
918	000863	三湘印象	4,200	30,744.00	0.00
919	000425	徐工机械	8,100	30,375.00	0.00
920	600598	北大荒	2,700	29,997.00	0.00
921	600582	天地科技	6,500	29,835.00	0.00
922	002772	众兴菌业	2,200	29,590.00	0.00
923	601038	一拖股份	3,200	29,536.00	0.00
924	300069	金利华电	900	29,412.00	0.00
925	000157	中联重科	6,500	29,185.00	0.00
926	600133	东湖高新	3,000	28,770.00	0.00
927	002204	大连重工	7,000	28,490.00	0.00
928	600382	广东明珠	1,900	27,379.00	0.00
929	300453	三鑫医疗	1,100	25,355.00	0.00
930	603567	珍宝岛	1,500	25,245.00	0.00
931	002644	佛慈制药	2,700	25,110.00	0.00

932	002653	海思科	1,900	24,719.00	0.00
933	603222	济民制药	1,700	24,633.00	0.00
934	600513	联环药业	2,400	24,504.00	0.00
935	300261	雅本化学	2,622	24,332.16	0.00
936	300396	迪瑞医疗	700	24,171.00	0.00
937	002412	汉森制药	1,500	23,805.00	0.00
938	002604	龙力生物	2,300	21,413.00	0.00
939	002453	天马精化	2,600	21,164.00	0.00
940	600467	好当家	6,200	21,142.00	0.00
941	300498	温氏股份	900	21,096.00	0.00
942	601113	华鼎股份	2,500	21,075.00	0.00
943	603609	禾丰牧业	2,200	21,032.00	0.00
944	002170	芭田股份	2,800	20,804.00	0.00
945	002165	红宝丽	3,300	20,427.00	0.00
946	002015	霞客环保	2,700	20,412.00	0.00
947	300132	青松股份	2,500	20,300.00	0.00
948	603002	宏昌电子	3,800	20,140.00	0.00
949	002632	道明光学	2,500	19,800.00	0.00
950	002666	德联集团	3,100	19,623.00	0.00
951	300179	四方达	3,000	19,620.00	0.00
952	000096	广聚能源	1,300	19,448.00	0.00
953	002514	宝馨科技	2,400	19,368.00	0.00
954	000523	广州浪奇	1,900	19,285.00	0.00
955	002337	赛象科技	3,300	19,272.00	0.00
956	600500	中化国际	2,000	19,120.00	0.00
957	603012	创力集团	2,300	18,998.00	0.00
958	603901	永创智能	1,600	18,960.00	0.00
959	000683	远兴能源	7,000	18,900.00	0.00

960	300114	中航电测	1,400	18,872.00	0.00
961	601567	三星医疗	1,800	18,756.00	0.00
962	300154	瑞凌股份	2,200	18,656.00	0.00
963	300293	蓝英装备	1,300	18,356.00	0.00
964	002598	山东章鼓	1,600	18,320.00	0.00
965	002367	康力电梯	1,400	16,352.00	0.00
966	000796	凯撒旅游	1,300	15,756.00	0.00
967	600175	美都能源	3,500	15,225.00	0.00
968	000789	万年青	2,100	14,889.00	0.00
969	601636	旗滨集团	3,300	14,883.00	0.00
970	600138	中青旅	700	14,742.00	0.00
971	600449	宁夏建材	1,500	14,415.00	0.00
972	000652	泰达股份	2,700	14,310.00	0.00
973	600881	亚泰集团	2,800	14,224.00	0.00
974	300345	红宇新材	1,600	14,208.00	0.00
975	600053	九鼎投资	400	13,984.00	0.00
976	601339	百隆东方	2,000	11,900.00	0.00
977	000726	鲁泰A	1,000	11,860.00	0.00
978	600448	华纺股份	2,000	11,800.00	0.00
979	002394	联发股份	800	11,784.00	0.00
980	600510	黑牡丹	1,500	11,490.00	0.00
981	002029	七匹狼	1,200	11,484.00	0.00
982	600626	申达股份	1,200	11,316.00	0.00
983	002087	新野纺织	2,000	11,300.00	0.00
984	300662	科锐国际	200	5,054.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601998	中信银行	35,017,762.00	2.83
2	002142	宁波银行	34,844,199.35	2.81
3	601169	北京银行	22,685,667.92	1.83
4	600000	浦发银行	21,494,757.70	1.74
5	000776	广发证券	21,244,559.00	1.72
6	601211	国泰君安	19,794,454.67	1.60
7	600015	华夏银行	19,545,716.00	1.58
8	601818	光大银行	17,801,944.00	1.44
9	600999	招商证券	17,585,593.34	1.42
10	002736	国信证券	16,379,937.94	1.32
11	600061	国投安信	14,380,834.07	1.16
12	000686	东北证券	14,348,270.40	1.16
13	000783	长江证券	14,247,756.00	1.15
14	000750	国海证券	12,662,554.00	1.02
15	600016	民生银行	10,186,573.00	0.82
16	000620	新华联	9,850,400.14	0.80
17	300050	世纪鼎利	9,807,502.23	0.79
18	300492	山鼎设计	9,538,410.00	0.77
19	603919	金徽酒	9,519,468.00	0.77
20	600291	西水股份	9,466,644.63	0.76

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	601166	兴业银行	40,738,158.00	3.29
2	601398	工商银行	40,063,091.00	3.23
3	601211	国泰君安	36,850,616.10	2.97
4	000776	广发证券	35,146,368.20	2.84
5	002142	宁波银行	33,972,889.00	2.74
6	600036	招商银行	31,852,595.00	2.57
7	601818	光大银行	24,657,248.00	1.99
8	600030	中信证券	23,685,261.00	1.91
9	600000	浦发银行	20,613,027.10	1.66
10	601169	北京银行	19,870,341.00	1.60
11	601998	中信银行	15,108,032.90	1.22
12	601628	中国人寿	14,973,486.64	1.21
13	000686	东北证券	14,044,511.72	1.13
14	000783	长江证券	14,027,429.86	1.13
15	600061	国投安信	13,669,528.00	1.10
16	601318	中国平安	12,059,707.44	0.97
17	601601	中国太保	11,904,685.76	0.96
18	000620	新华联	11,485,633.00	0.93
19	600291	西水股份	11,202,379.77	0.90
20	000750	国海证券	10,818,793.00	0.87

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	2,941,399,718.62
卖出股票收入（成交）总额	3,161,651,742.98

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国泰君安证券股份有限公司（以下简称“国泰君安”）、广发证券股份有限公司（以下简称“广发证券”）、国信证券股份有限公司（以下简称“国信证券”）、招商证券股份有限公司（以下简称“招商证券”）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。

2016 年 8 月 12 日，全国股转公司下发了《关于对国泰君安证券股份有限公司采取约见谈话并提交书面承诺自律监管措施的决定》（股转系统发[2016]228 号），对国泰君安的信息披露违规行为采取约见谈话并提交书面承诺函的监管措施。

2016 年 8 月 26 日，中国证券监督管理委员会网站公告，对金徽酒股份有限公司及其首发保荐机构国泰君安证券股份有限公司、签字保荐代表人在首发项目过程中的信息披露违法违规行为采取了行政监管措施。

2016 年 12 月 27 日，国泰君安公告其收到《关于对国泰君安证券股份有限公司采取责令改正、增加内部合规检查次数并提交合规检查报告措施的事先告知书》（机构部函[2016]3280 号）（以下简称“《事先告知书》”）。国泰君安在公告中陈述了《事先告知书》的内容。

2016 年 11 月 25 日，中国证监会向广发证券出具《中国证监会行政处罚决定书》（[2016]128 号），对其未按规定审查、了解客户真实身份的违法违规行为，采取责令改正、给予警告、没收违法所得，并处以罚款的行政处罚措施。

2017 年 5 月 24 日，国信证券收到证监会《行政处罚事先告知书》（处罚字[2017]58 号），对其在开展融资融券业务中的违规行为，责令改正、给予警告，没收违法所得，并处罚款。

2017 年 4 月 27 日，深圳证监局发布《关于对招商证券股份有限公司采取责令改正并暂停新开立 PB 系统账户 3 个月措施的决定》（行政监管措施决定书(2017)16 号），对招商证券在内部控

制中存在的归为行为，采取责令改正并暂停新开立 PB 系统账户 3 个月的行政监管措施，并要求提交整改报告。

本基金投资国泰君安（601211）、广发证券（000776）、国信证券（002736）、招商证券（600999）的决策流程符合本基金管理人投资管理制度的相关规定。针对上述情况，本基金管理人进行了分析和研究，认为上述事件对国泰君安、广发证券、国信证券、招商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	219,869.65
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	20,497.60
5	应收申购款	74,280.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	314,647.72

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
16,529	58,733.08	116,199,808.84	11.97%	854,599,269.36	88.03%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	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	1,219,112,283.14
本报告期基金总申购份额	24,798,531.05
减：本报告期基金总赎回份额	273,111,735.99
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	970,799,078.20

§ 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			
光大证券	1	11,225,186,953.74	20.08%	1,141,019.31	20.72%	-
中信建投	1	702,814,115.66	11.52%	654,532.86	11.89%	-
平安证券	1	568,875,767.11	9.32%	529,794.56	9.62%	-
华鑫证券	2	462,738,650.29	7.58%	430,948.85	7.83%	-
方正证券	2	460,093,123.67	7.54%	428,487.58	7.78%	-
东吴证券	1	421,025,023.99	6.90%	307,899.08	5.59%	-
海通证券	1	419,688,505.65	6.88%	390,857.34	7.10%	-
中泰证券	1	377,702,615.44	6.19%	351,755.57	6.39%	-
国信证券	1	286,627,575.44	4.70%	266,937.53	4.85%	-
申万宏源	2	263,664,569.02	4.32%	245,551.64	4.46%	-
东北证券	1	238,817,861.42	3.91%	174,648.10	3.17%	-
安信证券	2	211,749,276.37	3.47%	197,203.15	3.58%	-
广发证券	1	144,423,620.48	2.37%	134,501.68	2.44%	-
天风证券	1	91,229,045.60	1.49%	66,715.84	1.21%	-
浙商证券	2	58,415,535.47	0.96%	42,711.87	0.78%	-
华林证券	1	52,029,385.58	0.85%	38,049.56	0.69%	-
中投证券	1	51,459,367.51	0.84%	47,924.13	0.87%	-
兴业证券	1	29,034,276.95	0.48%	27,039.52	0.49%	-
川财证券	2	25,539,017.73	0.42%	18,676.75	0.34%	-
华创证券	1	11,899,639.53	0.19%	11,082.30	0.20%	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
中信证券(山东)	2	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-

长城证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
九州证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	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		
光大证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信证券(山东)	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-

长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
九州证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
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	本基金招募说明书（更新）（2016 年第 2 号）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 1 月 13 日
2	本基金 2016 年 4 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 1 月 19 日
3	本公司关于旗下基金参与北京钱景财富投资管理有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 1 月 23 日
4	本公司关于旗下基金参加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司基金转换费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 1 月 23 日
5	本公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司手机银行申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 2 月 23 日
6	本公司关于旗下部分基金参与宜	《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	本公司关于旗下基金增加南京苏宁基金销售有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 4 月 14 日
10	本公司关于旗下基金参与南京苏宁基金销售有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 4 月 14 日
11	本公司关于旗下基金增加济安财富(北京)资本管理有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 4 月 20 日
12	本公司关于旗下基金参与济安财富(北京)资本管理有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 4 月 20 日
13	本公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司手机银行申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 4 月 22 日
14	本基金 2017 年 1 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 4 月 24 日
15	本公司关于旗下部分基金在中国银行开通基金转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 4 月 27 日
16	本公司关于调整直销中心最低认申购金额限制的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017 年 5 月 26 日

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

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

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

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

11.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

11.3 查阅方式

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

摩根士丹利华鑫基金管理有限公司

2017年8月28日