

# 摩根士丹利华鑫睿成中小盘弹性股票型证 券投资基金 2017 年年度报告

2017 年 12 月 31 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：交通银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 27 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。

本报告中财务资料经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计并出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2017 年 1 月 16 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 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.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>16</b>
6.1 审计报告基本信息.....	16
6.2 审计报告的基本内容.....	16
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>19</b>
7.1 资产负债表.....	19
7.2 利润表.....	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
7.4 报表附注.....	22
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>46</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	46
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	46
8.3 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.....	47
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	59
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	62
8.6 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.....	62
8.7 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.....	63

8.8	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	63
8.9	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	63
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	63
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63
8.12	投资组合报告附注	63
<b>§9</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>65</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65
9.3	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	65
<b>§10</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>66</b>
<b>§11</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>67</b>
11.1	基金份额持有人大会决议	67
11.2	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	67
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
11.4	基金投资策略的改变	67
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	67
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	67
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	68
11.8	其他重大事件	69
<b>§12</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>72</b>
12.1	备查文件目录	72
12.2	存放地点	72
12.3	查阅方式	72

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	摩根士丹利华鑫睿成中小盘弹性股票型证券投资基金
基金简称	大摩睿成中小盘弹性股票
基金主代码	003312
交易代码	003312
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 1 月 16 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	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	115,042,034.64 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采取中证 500 指数成分股量化加权投资策略,在控制风险的基础上,力争获取超额收益与长期资本增值。
投资策略	<p>本基金的投资策略主要包括:</p> <p>1、股票投资策略</p> <p>本基金以中证 500 指数的成份股为基础,根据“异象效应及其风险溢价”的理论,使用指数成分股量化加权的理念进行主动投资组合的构建,并定期进行组合的再平衡。</p> <p>2、衍生品投资策略</p> <p>本基金的衍生品投资将严格遵守相关法律法规的规定,合理利用股指期货、权证等衍生工具,充分考虑衍生品的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置、品种选择,谨慎进行投资,追求稳定的当期收益或降低投资组合的整体风险。</p> <p>3、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金通过对资产支持证券的发行条款、基础资产的构成及质量等基本研究,结合相关定价模型评估其内在价值,谨慎参与资产支持证券投资。</p> <p>4、债券投资策略</p> <p>本基金对于债券的投资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>
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95% + 一年期活期存款利率×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金,理论上其长期平均预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金、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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李锦	陆志俊
	联系电话	(0755) 88318883	95559
	电子邮箱	xxpl@msfunds.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-8888-668	95559
传真		(0755) 82990384	(021) 62701216
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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
邮政编码		518048	200120
法定代表人		YU HUA(于华)	彭纯

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.msfunds.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
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 楼

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2017年1月16日(基金合同生效日)-2017年12月31日
本期已实现收益	1,666,411.84
本期利润	-1,598,615.72
加权平均基金份额本期利润	-0.0088
本期加权平均净值利润率	-0.90%
本期基金份额净值增长率	-1.27%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末
期末可供分配利润	-1,465,264.55
期末可供分配基金份额利润	-0.0127
期末基金资产净值	113,576,770.09
期末基金份额净值	0.9873
3.1.3 累计期末指标	2017年末
基金份额累计净值增长率	-1.27%

注：1. 本基金基金合同于 2017 年 1 月 16 日正式生效，截至报告期末未满一年；

2. 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；

3. 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）；

4. 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。

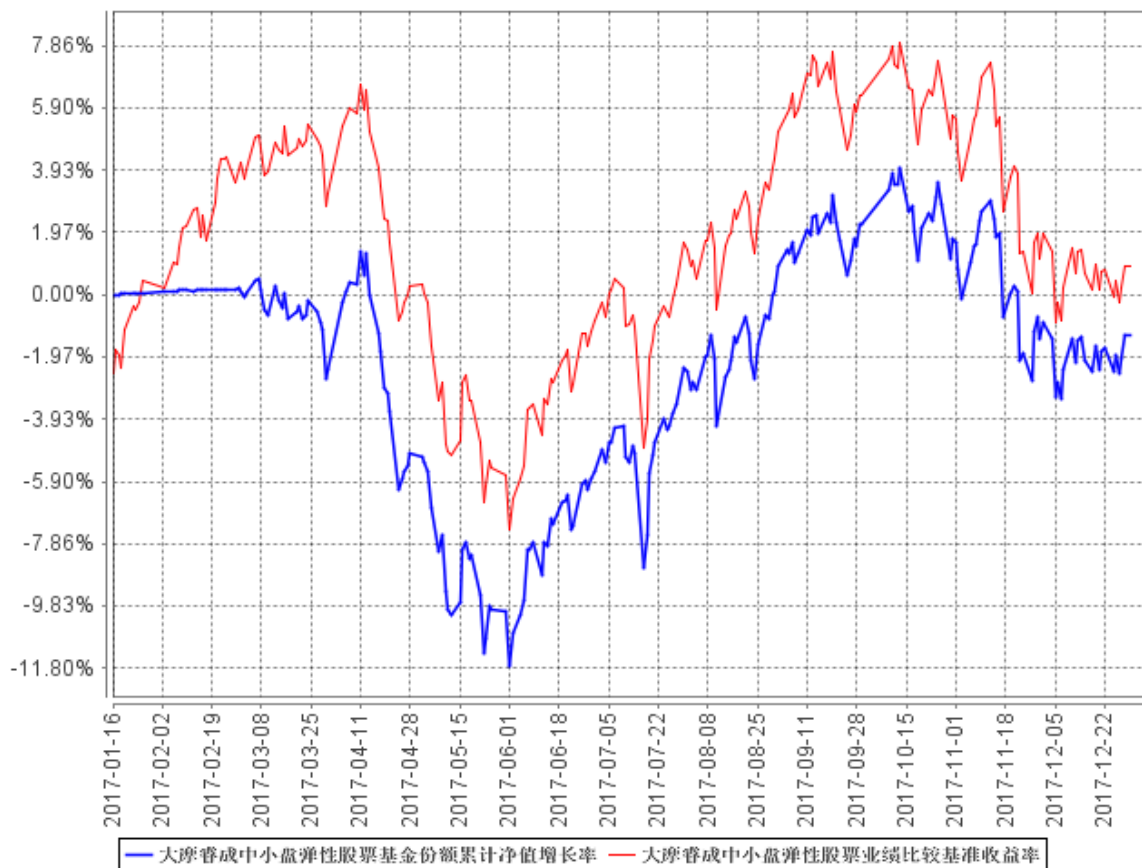
### 3.2 基金净值表现

#### 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
过去三个月	-3.40%	0.85%	-5.06%	0.93%	1.66%	-0.08%
过去六个月	4.54%	0.85%	1.78%	0.91%	2.76%	-0.06%
自基金合同生效起至今	-1.27%	0.81%	0.93%	0.88%	-2.20%	-0.07%

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

大摩睿成中小盘弹性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



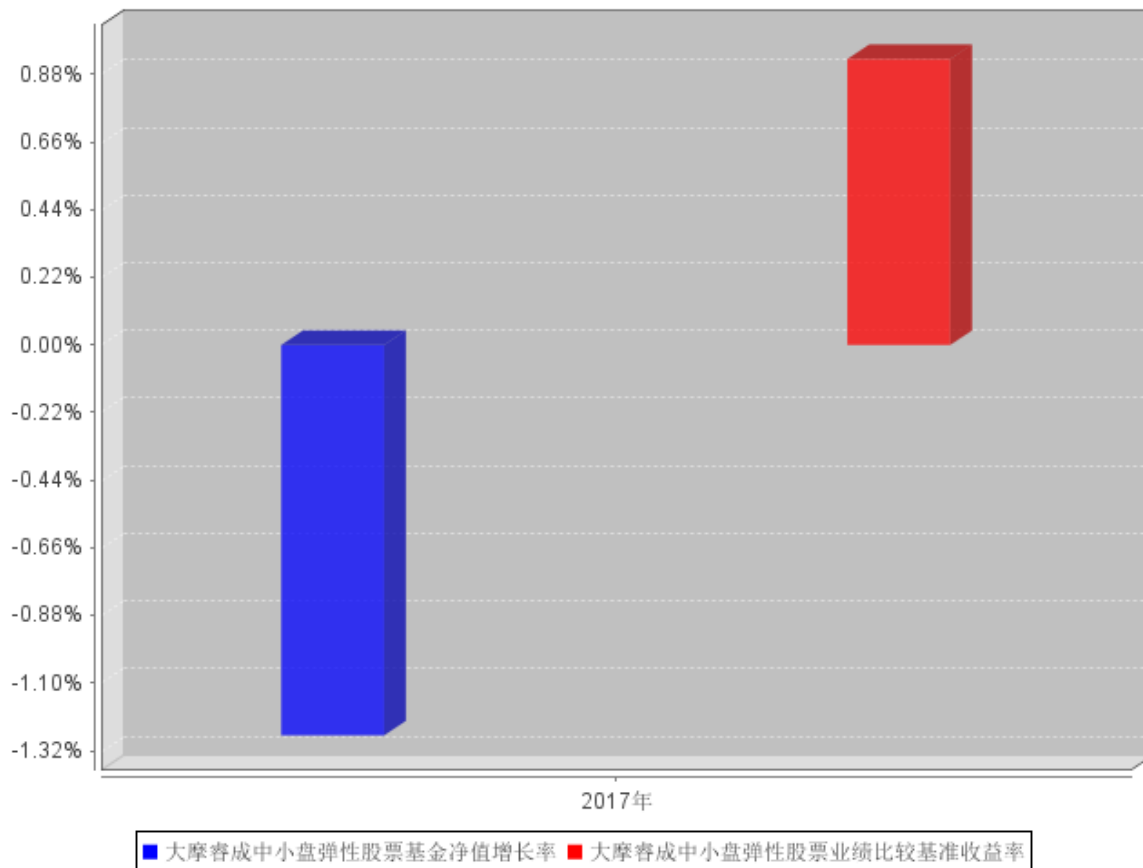
注：1. 本基金基金合同于 2017 年 1 月 16 日正式生效，截至本报告期末未满一年。

2. 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。



### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

大摩睿成中小盘弹性股票自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金基金合同于 2017 年 1 月 16 日正式生效，截至本报告期末未满一年。上述指标在基金合同生效当年按照实际存续期进行计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日（2017 年 1 月 16 日）至本报告期末未进行利润分配。

## § 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 12 月 31 日，公司旗下共管理二十七只开放式基金，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、摩根士丹利华鑫睿成大盘弹性股票型证券投资基金、摩根士丹利华鑫新趋势灵活配置混合型证券投资基金、摩根士丹利华鑫万众创新灵活配置混合型证券投资基金和摩根士丹利华鑫科技领先灵活配置混合型证券投资基金。同时，公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴国雄	基金经理	2017 年 1 月	-	10	金融风险管理师（FRM），香港科技

		16 日			大学金融数学与统计专业硕士，曾任职于安信证券股份有限公司风险管理部。2013 年 5 月加入本公司，历任风险管理部风险管理经理、数量化投资部基金经理助理、数量化投资部投资经理。2016 年 6 月起担任摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 7 月起担任摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金基金经理，2017 年 1 月起任本基金基金经理，2017 年 4 月起担任摩根士丹利华鑫睿成大盘弹性股票型证券投资基金基金经理。
--	--	------	--	--	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

- 注：1、基金经理任职日期为基金合同生效之日；
- 2、基金经理任职已按规定在中国证券投资基金业协会办理完毕基金经理注册；
- 3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易制度和控制方法

基金管理人遵照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规的要求，制订了《摩根士丹利华鑫基金管理有限公司公平交易管理办法》、《摩根士丹利华鑫基金管理有限公司异常交易报告管理办法》、《摩根士丹利华鑫基金管理有限公司公平交易分析报告实施细则》等内部制度，形成较为完备的公平交易制度及异常交易分析体系。

基金管理人的公平交易管理涵盖了所管理的所有投资组合，管理的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时也包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资管理活动相关的各个环节。基金管理人通过投资交易以及其他相关系统实现了有效系统控制，通过投资交易行为的监控、异常交易的识别与分析、公平交易的分析与报告等方式实现了有效的人工控制，并通过定期及不定期的回顾不断完善相关制度及流程，实现公平交易管理控制目标。

### 4.3.2 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。

### 4.3.3 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的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 42 次，为量化投资基金因执行投资策略和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 中国经济在消费及托底、出口、基建和新经济拉动下，经济韧性较强，全球主要经济体经济加速复苏，全球贸易也出现了强劲的反弹，全球贸易复苏也为 17 年贸易增长拉动中国经济增长提供了支撑。流动性方面，虽然一些经济体货币政策有所转向，但总体而言，全球利率依然维持绝对低位，流动性充足，经济强增长和市场低利率催生了 2017 年全球股市大牛。2018 年美联储开启缩表及渐进加息的模式，美联储、欧洲央行、英国央行、日本央行等全球四大央行的货币将整体呈紧缩态势，长期推动收益率上行。

2017 年上半年，在金融去杠杆影响下，大盘走势低迷，4 到 5 月沪深 300 下跌 5.1%；下半年在业绩推动下，大盘震荡上行，沪深 300 指数全年收益 21.38%。市场风格分化较为严重，龙头白马股主导行情走势。资金面上，金融去杠杆延续，流动性保持紧平衡。

本基金主要通过量化模型作为投资交易决策的依据，通过科学的量化模型研究体系和严格的风险管理机制，争取获得相对基准的超额收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期截至 2017 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.9873 元，累计份额净值为 0.9873

元，基金份额净值增长率为-1.27%，同期业绩比较基准收益率为 0.93%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年国家货币政策基调仍然延续政治局会议、中央经济工作会议基调，要求稳中求进，保持稳健中性，该基调预计将贯穿全年。虽然监管仍然以防风险为主，但优质权益类资产已具备配置价值，有望吸引增量资金入市。

2018 年，本基金将继续采取中证 500 指数成分股量化加权的投资策略进行投资组合管理，在控制风险的基础上，力争获取超额收益与长期资本增值。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期，基金管理人通过开展专项检查、加强日常监控、完善管理制度等方式，检查内控制度的执行情况、基金运作的合法合规情况，及时发现问题，提出改进建议并跟踪落实。

本报告期，基金管理人完成的主要监察稽核工作如下：

(1) 开展专项检查工作。检查范围覆盖投资研究交易、基金销售、基金估值、业务持续性计划、自有资金投资及风险准备金、反洗钱业务、应用系统权限管理等方面。(2) 做好日常监控工作。规范基金投资、销售以及运营等各项业务管理，通过监控基金投资运作、优化关键业务流程、审核宣传推介材料、监督后台运营业务等工作，加强日常风险监控，保障公司和基金运作合法合规。(3) 通过制度定期回顾机制持续完善公司内控制度体系，同时，适时解读监管政策与要求，组织落实投资者适当性管理、基金流动性管理、公司合规管理、反洗钱等法律法规的相关要求，加强各项业务流程控制。公司已建立起覆盖公司业务各个方面，更为全面、完善的内控制度体系，保障公司合规、安全、高效运营。(4) 加强员工合规行为管理。根据法律法规和业务环境的变化不断修订并充实培训材料，进一步提升员工风控意识及合规意识。(5) 有效地推进投资风险管理系统等合规监控系统的建设，加强风险管理手段，提高工作效率。(6) 加强新产品和新业务的风险管理。

2018 年，基金管理人将继续本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，加强风险控制，保障公司和基金的合法合规运作，保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的，应就采用的相关估值技

术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见。

基金管理人成立基金估值委员会，委员会由主任委员（分管基金运营部的助理总经理）以及相关成员（包括研究管理部负责人、监察稽核部负责人、基金运营部负责人、基金会计、风险管理部相关业务人员）构成。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会的相关人员均具有一定年限的专业从业经验，具有良好的专业能力，并能在相关工作中保持独立性。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，本基金本报告期未进行收益分配。

#### **4.9 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

2017 年度，基金托管人在摩根士丹利华鑫睿成中小盘弹性股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2017 年度，摩根士丹利华鑫基金管理有限公司在摩根士丹利华鑫睿成中小盘弹性股票型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2017 年度，由摩根士丹利华鑫基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关摩根士丹利华鑫睿成中小盘弹性股票型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2018)第 20994 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	摩根士丹利华鑫睿成中小盘弹性股票型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了摩根士丹利华鑫睿成中小盘弹性股票型证券投资基金(以下简称“大摩睿成中小盘弹性股票”)的财务报表,包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表,2017 年 1 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了大摩睿成中小盘弹性股票 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年 1 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于大摩睿成中小盘弹性股票,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	大摩睿成中小盘弹性股票的基金管理人摩根士丹利华鑫基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行



	<p>业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估大摩睿成中小盘弹性股票的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算大摩睿成中小盘弹性股票、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督大摩睿成中小盘弹性股票的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对大摩睿成中小盘弹性股票持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定</p>

	<p>性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致大摩睿成中小盘弹性股票不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	许康玮   俞伟敏
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2018 年 3 月 20 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：摩根士丹利华鑫睿成中小盘弹性股票型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	9,542,789.18
结算备付金		279,196.96
存出保证金		19,274.70
交易性金融资产	7.4.7.2	103,943,781.39
其中：股票投资		103,868,548.68
基金投资		-
债券投资		75,232.71
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	2,516.21
应收股利		-
应收申购款		152,110.66
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		113,939,669.10
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		70,936.56
应付管理人报酬		146,318.51
应付托管费		24,386.41
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	66,687.99
应交税费		-

应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	54,569.54
负债合计		362,899.01
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	115,042,034.64
未分配利润	7.4.7.10	-1,465,264.55
所有者权益合计		113,576,770.09
负债和所有者权益总计		113,939,669.10

注：1. 报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9873 元，基金份额总额 115,042,034.64 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2017 年 1 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间。

## 7.2 利润表

会计主体：摩根士丹利华鑫睿成中小盘弹性股票型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		2,704,000.67
1. 利息收入		1,161,702.16
其中：存款利息收入	7.4.7.11	147,353.88
债券利息收入		17.30
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,014,330.98
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,478,981.00
其中：股票投资收益	7.4.7.12	3,151,487.92
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.1	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	1,327,493.08
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-3,265,027.56
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	328,345.07
<b>减：二、费用</b>		4,302,616.39
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,561,100.72
2. 托管费	7.4.10.2.2	426,850.08
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.19	1,144,267.09
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.20	170,398.50
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-1,598,615.72
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-1,598,615.72

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：摩根士丹利华鑫睿成中小盘弹性股票型证券投资基金

本报告期：2017年1月16日(基金合同生效日)至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月16日(基金合同生效日)至2017年12月31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）	262,503,783.46	-	262,503,783.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,598,615.72	-1,598,615.72
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）	-147,461,748.82	133,351.17	-147,328,397.65
其中：1. 基金申购款	10,190,481.38	-189,219.19	10,001,262.19
2. 基金赎回款	-157,652,230.20	322,570.36	-157,329,659.84
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	115,042,034.64	-1,465,264.55	113,576,770.09

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

摩根士丹利华鑫睿成中小盘弹性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[2016]1916 号《关于准予摩根士丹利华鑫睿成中小盘弹性股票型证券投资基金注册的批复》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《摩根士丹利华鑫睿成中小盘弹性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 262,187,528.82 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(2017)第 022 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《摩根士丹利华鑫睿成中小盘弹性股票型证券投资基金基金合同》于 2017 年 1 月 16 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 262,503,783.46 份,其中认购资金利息折合 316,254.64 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,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《摩根士丹利华鑫睿成中小盘弹性股票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,包括国内依法上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、次级债、短期融资券、超短期融资券、中期票据及其他中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款、权证、股指期货、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例范围为 80%-95%,其中投资于中证 500 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金非现金资产的 80%;权证投资比例不高于基金资产净值的 3%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后,本基金持有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%。权证、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。本基金的业绩比较基准为:中证 500 指数收益率×95%+一年期活期存款利

率×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人摩根士丹利华鑫基金管理有限公司于 2018 年 3 月 20 日批准报出。

## 7.4.2 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》、《摩根士丹利华鑫睿成中小盘弹性股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制

## 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年 1 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间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 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年 1 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2017 年 1 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：



(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### **7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### **7.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### **7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认

为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### **7.4.4.12 分部报告**

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### **7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

#### **7.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### **7.4.5.3 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。

### **7.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税

[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日
活期存款	9,542,789.18
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	9,542,789.18

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日
----	-------------------------

	成本	公允价值	公允价值变动
股票	107,138,608.95	103,868,548.68	-3,270,060.27
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	75,232.71	5,032.71
	银行间市场	-	-
	合计	75,232.71	5,032.71
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	107,208,808.95	103,943,781.39	-3,265,027.56

### 7.4.7.3 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。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 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。

#### 7.4.7.4.2 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。

### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日
应收活期存款利息	2,351.18
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	138.16
应收债券利息	17.30
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	9.57
合计	2,516.21

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日
交易所市场应付交易费用	66,687.99
银行间市场应付交易费用	-
合计	66,687.99

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	69.54
预提费用	54,500.00
合计	54,569.54

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月16日(基金合同生效日)至2017年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	262,503,783.46	262,503,783.46
本期申购	10,190,481.38	10,190,481.38
本期赎回(以“-”号填列)	-157,652,230.20	-157,652,230.20
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	115,042,034.64	115,042,034.64

注：1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 本基金自2016年11月16日至2017年1月12日止期间公开发售，共募集有效净认购资金262,187,528.82元。根据《摩根士丹利华鑫睿成中小盘弹性股票型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入316,254.64元在本基金成立后，折算为

316,254.64 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

3. 根据《摩根士丹利华鑫睿成中小盘弹性股票型证券投资基金基金合同》和《摩根士丹利华鑫睿成中小盘弹性股票型证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金于 2017 年 1 月 16 日(基金合同生效日)起至 2017 年 2 月 26 日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购、赎回和转换业务自 2017 年 2 月 27 日起开始办理。

#### 7.4.7.10 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	1,666,411.84	-3,265,027.56	-1,598,615.72
本期基金份额交易产生的变动数	-29,951.33	163,302.50	133,351.17
其中：基金申购款	-21,251.82	-167,967.37	-189,219.19
基金赎回款	-8,699.51	331,269.87	322,570.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,636,460.51	-3,101,725.06	-1,465,264.55

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	113,306.36
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	33,394.23
其他	653.29
合计	147,353.88

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	401,968,506.72
减：卖出股票成本总额	398,817,018.80

买卖股票差价收入	3,151,487.92
----------	--------------

#### 7.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

##### 7.4.7.13.1 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。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月16日(基金合同生效日)至2017年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,327,493.08
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,327,493.08

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2017年1月16日(基金合同生效日)至2017年12月31日
1. 交易性金融资产	-3,265,027.56
——股票投资	-3,270,060.27
——债券投资	5,032.71
——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	-3,265,027.56



### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	325,973.92
基金转换费收入	2,371.15
合计	328,345.07

注：1. 本基金的赎回费用按基金份额持有人持有时间的增加而递减。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。不低于赎回费用的 25% 归入基金资产，未归入基金资产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

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

### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	1,144,267.09
银行间市场交易费用	-
合计	1,144,267.09

### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00
信息披露费	100,000.00
银行费用	4,998.50
债券账户维护费	15,000.00
其他	400.00
合计	170,398.50

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 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。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

### 7.4.9 关联方关系

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
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	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
摩根士丹利国际控股公司	基金管理人的股东
深圳市招融投资控股有限公司	基金管理人的股东
深圳市中技实业（集团）有限公司	基金管理人的股东
深圳市基石创业投资有限公司(2017 年 10 月 26 日后)	基金管理人的股东
汉唐证券有限责任公司(2017 年 10 月 26 日前)	基金管理人的股东

注：1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 2007 年 12 月 26 日，深圳中院依法宣告汉唐证券破产清算。经过公开竞价，汉唐证券有限责任公司持有的基金管理人股权最终由竞买人深圳市基石创业投资有限公司竞得。上述股权转让于 2017 年 9 月 28 日经中国证监会批复核准，后于 2017 年 10 月 26 日经深圳市市场监督管理局予以核准并备案。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
华鑫证券	905,196,834.54	100.00%

##### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 7.4.10.1.3 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16日(基金合同生效日)至2017年12月31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	661,967.09	100.00%	66,687.99	100.00%

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。

3. 本基金基金合同于 2017 年 1 月 16 日正式生效，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月16日(基金合同生效日)至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,561,100.72
其中：支付销售机构的客户维护费	1,355,581.27

注：1. 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。

2. 本基金基金合同于 2017 年 1 月 16 日正式生效，无上年度可比期间数据。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月16日(基金合同生效日)至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	426,850.08

注：1. 支付基金托管人交通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。

2. 本基金基金合同于 2017 年 1 月 16 日正式生效，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。本基金基金合同于 2017 年 1 月 16 日正式生效，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。本基金基金合同于 2017 年 1 月 16 日正式生效，无上年度可比期间数据。

##### 7.4.10.4.2 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

本基金本报告期除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。本基金基金合同于 2017 年 1 月 16 日正式生效，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.10.5 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 2017 年 1 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行	9,542,789.18	113,306.36

注：本基金的活期银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。本基金基金合同于 2017 年 1 月 16 日正式生效，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券。本基金基金合同于 2017 年 1 月 16 日正式生效，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。本基金基金合同于 2017 年 1 月 16 日正式生效，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

#### 7.4.12 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
128027	崇达转债	2017 年 12 月 15 日	2018 年 1 月 22 日	新债流通受限	100.00	100.00	43	4,300.00	4,300.00	-

## 7.4.12.2 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
000031	中粮地产	2017年7月24日	重大资产重组	8.00	-	-	146,800	1,132,603.15	1,174,400.00	-
000006	深振业A	2017年9月11日	重大资产重组	9.85	2018年3月8日	8.87	94,100	818,572.49	926,885.00	-
600664	哈药股份	2017年9月28日	重大资产重组	5.81	2018年2月27日	6.00	113,700	727,595.07	660,597.00	-
300032	金龙机电	2017年11月27日	重大事项	13.89	-	-	36,500	513,583.02	506,985.00	-
002358	森源电气	2017年12月7日	重大资产重组	14.86	2018年3月7日	15.05	26,100	428,122.80	387,846.00	-
600525	长园集团	2017年12月25日	重大事项	15.79	2018年1月10日	17.30	24,000	414,890.76	378,960.00	-
000930	中粮生化	2017年10月24日	重大资产重组	13.34	-	-	19,600	216,617.02	261,464.00	-
000401	冀东水泥	2017年11月21日	重大资产重组	13.79	2018年1月15日	15.17	16,800	257,020.90	231,672.00	-
300116	坚瑞沃能	2017年12月18日	重大资产重组	7.62	-	-	28,600	301,923.11	217,932.00	-
002344	海宁皮城	2017年11月1日	重大事项	7.93	2018年1月31日	7.44	23,300	235,983.18	184,769.00	-
000566	海南海药	2017年11月22日	重大资产重组	12.89	-	-	11,600	157,969.09	149,524.00	-

000979	中弘股份	2017年9月7日	重大资产重组	1.94	2018年2月14日	1.75	71,480	130,685.72	138,671.20	-
002004	华邦健康	2017年12月14日	重大事项	6.73	2018年3月14日	7.30	18,400	155,172.31	123,832.00	-
002345	潮宏基	2017年12月20日	重大事项	10.75	-	-	10,184	113,292.78	109,478.00	-
002122	天马股份	2017年12月19日	重大资产重组	8.49	-	-	11,700	130,849.56	99,333.00	-
300134	大富科技	2017年12月18日	重大资产重组	16.45	2018年3月19日	14.81	5,800	98,774.00	95,410.00	-
000592	平潭发展	2017年8月9日	重大资产重组	5.75	2018年1月29日	5.70	14,500	89,812.52	83,375.00	-
600187	国中水务	2017年11月9日	重大资产重组	4.68	2018年3月20日	4.21	17,100	89,511.61	80,028.00	-
600614	鹏起科技	2017年12月26日	重大资产重组	10.16	-	-	7,700	89,408.57	78,232.00	-
300156	神雾环保	2017年7月17日	重大资产重组	24.16	2018年1月17日	21.74	3,100	103,951.05	74,896.00	-
300383	光环新网	2017年11月7日	重大事项	13.19	2018年3月19日	14.51	5,600	75,053.55	73,864.00	-
000926	福星股份	2017年12月26日	重大事项	10.89	2018年1月10日	11.98	6,200	76,310.86	67,518.00	-
300159	新研股份	2017年11月23日	重大资产重组	10.40	-	-	6,200	85,974.09	64,480.00	-
600645	中源协和	2017年10月9日	重大资产重组	28.40	2018年1月19日	25.56	2,200	46,856.73	62,480.00	-

300010	立思辰	2017年11月17日	重大事项	11.17	2018年2月22日	10.05	5,300	66,251.72	59,201.00	-
000766	通化金马	2017年11月24日	重大资产重组	13.60	-	-	4,300	73,192.05	58,480.00	-
000939	凯迪生态	2017年11月16日	重大资产重组	4.99	-	-	10,000	57,049.60	49,900.00	-
300730	科创信息	2017年12月25日	临时停牌	41.55	2018年1月2日	45.71	821	6,863.56	34,112.55	-
002512	达华智能	2017年12月6日	重大资产重组	18.07	2018年3月6日	16.26	1,700	26,776.87	30,719.00	-
000547	航天发展	2017年10月30日	重大事项	10.83	-	-	2,700	37,892.20	29,241.00	-
002366	台海核电	2017年12月6日	重大资产重组	26.45	-	-	1,100	25,812.01	29,095.00	-
000806	银河生物	2017年7月18日	重大资产重组	10.76	2018年1月18日	10.01	300	3,666.95	3,228.00	-

注：本基金截至 2017 年 12 月 31 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。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 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。

#### 7.4.12.3.2 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。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型证券投资基金，其长期平均预期风险收益水平高于混合型基金、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采取中证 500 指数成份股量化加权投资策略，在控制风险的基础上，力争获取超额收益与长期资本增值。

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。

#### **7.4.13.2 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交通银行，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 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.07%。



### 7.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2017 年 12 月 31 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。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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、结算备付金及债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	9,542,789.18	-	-	-	9,542,789.18
结算备付金	279,196.96	-	-	-	279,196.96
存出保证金	19,274.70	-	-	-	19,274.70
交易性金融资产	-	5,309.00	69,923.71	103,868,548.68	103,943,781.39

应收利息	-	-	-	2,516.21	2,516.21
应收申购款	-	-	-	152,110.66	152,110.66
资产总计	9,841,260.84	5,309.00	69,923.71	104,023,175.55	113,939,669.10
负债					
应付赎回款	-	-	-	70,936.56	70,936.56
应付管理人报酬	-	-	-	146,318.51	146,318.51
应付托管费	-	-	-	24,386.41	24,386.41
应付交易费用	-	-	-	66,687.99	66,687.99
其他负债	-	-	-	54,569.54	54,569.54
负债总计	-	-	-	362,899.01	362,899.01
利率敏感度缺口	9,841,260.84	5,309.00	69,923.71	103,660,276.54	113,576,770.09

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.07%。因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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，以中证 500 指数的成份股为基础，使用指数成份股量化加权的理念进行主动投资组合的构建。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。

**7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口**

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	103,868,548.68	91.45
交易性金融资产-基金投资	-	-
交易性金融资产-债券投资	75,232.71	0.07
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	103,943,781.39	91.52

**7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析**

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)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12月31日)
	业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	不适用
	业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	不适用

注：于 2017 年 12 月 31 日，本基金运行期间不足一年，尚不存在足够的经验数据，因此无法对本报告期间的基金资产净值对于其他价格风险的敏感性作定量分析。

**7.4.14 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 12 月 31 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 97,412,873.64 元,属于第二层次的余额为 6,530,907.75 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 12 月 31 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(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,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。

根据财政部、国家税务总局于 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。

此外,财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年 1 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间的经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	103,868,548.68	91.16
	其中：股票	103,868,548.68	91.16
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	75,232.71	0.07
	其中：债券	75,232.71	0.07
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	9,821,986.14	8.62
8	其他各项资产	173,901.57	0.15
9	合计	113,939,669.10	100.00

### 8.2 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	631,548.00	0.56
B	采矿业	5,284,549.00	4.65
C	制造业	60,496,019.30	53.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,661,883.15	4.99
E	建筑业	2,227,663.20	1.96
F	批发和零售业	8,657,630.61	7.62
G	交通运输、仓储和邮政业	3,351,184.22	2.95
H	住宿和餐饮业	271,236.00	0.24
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,837,141.40	4.26
J	金融业	822,416.00	0.72
K	房地产业	7,624,501.60	6.71
L	租赁和商务服务业	1,475,950.50	1.30
M	科学研究和技术服务业	390,212.00	0.34

N	水利、环境和公共设施管理业	207,254.00	0.18
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	91,954.00	0.08
Q	卫生和社会工作	11,219.50	0.01
R	文化、体育和娱乐业	1,622,939.40	1.43
S	综合	203,246.80	0.18
	合计	103,868,548.68	91.45

### 8.3 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	000031	中粮地产	146,800	1,174,400.00	1.03
2	000006	深振业A	94,100	926,885.00	0.82
3	000830	鲁西化工	54,800	872,416.00	0.77
4	601699	潞安环能	72,800	828,464.00	0.73
5	600801	华新水泥	58,200	822,366.00	0.72
6	600176	中国巨石	48,360	787,784.40	0.69
7	600348	阳泉煤业	105,100	775,638.00	0.68
8	000012	南玻A	90,040	760,838.00	0.67
9	002078	太阳纸业	74,500	691,360.00	0.61
10	600743	华远地产	181,600	664,656.00	0.59
11	600664	哈药股份	113,700	660,597.00	0.58
12	600597	光明乳业	43,000	651,450.00	0.57
13	600586	金晶科技	141,000	641,550.00	0.56
14	000488	晨鸣纸业	37,900	631,793.00	0.56
15	600073	上海梅林	77,100	626,052.00	0.55
16	000703	恒逸石化	28,700	619,059.00	0.55
17	600863	内蒙华电	208,300	618,651.00	0.54
18	000418	小天鹅A	9,100	617,435.00	0.54
19	600808	马钢股份	147,600	609,588.00	0.54
20	600642	申能股份	103,500	606,510.00	0.53
21	600426	华鲁恒升	37,350	594,612.00	0.52
22	600787	中储股份	53,800	591,800.00	0.52
23	000027	深圳能源	97,400	590,244.00	0.52
24	000669	金鸿控股	40,231	589,384.15	0.52
25	002155	湖南黄金	60,400	585,880.00	0.52
26	000543	皖能电力	115,400	579,308.00	0.51
27	002221	东华能源	46,800	571,428.00	0.50

28	000620	新华联	99,200	565,440.00	0.50
29	600219	南山铝业	152,400	560,832.00	0.49
30	601233	桐昆股份	24,800	557,752.00	0.49
31	600835	上海机电	22,600	553,700.00	0.49
32	000039	中集集团	24,100	550,685.00	0.48
33	000021	深科技	55,800	542,934.00	0.48
34	601231	环旭电子	34,400	542,488.00	0.48
35	600062	华润双鹤	21,900	542,025.00	0.48
36	600487	亨通光电	13,400	541,628.00	0.48
37	000761	本钢板材	104,000	540,800.00	0.48
38	000426	兴业矿业	54,700	537,701.00	0.47
39	002440	闰土股份	27,300	537,537.00	0.47
40	002311	海大集团	22,800	533,520.00	0.47
41	000960	锡业股份	40,200	530,640.00	0.47
42	600122	宏图高科	54,700	530,043.00	0.47
43	600138	中青旅	25,300	528,011.00	0.46
44	000528	柳工	61,900	528,007.00	0.46
45	002092	中泰化学	39,500	525,745.00	0.46
46	601678	滨化股份	64,700	525,364.00	0.46
47	600978	宜华生活	57,400	524,636.00	0.46
48	600195	中牧股份	26,600	524,286.00	0.46
49	002106	莱宝高科	51,100	519,687.00	0.46
50	600380	健康元	46,300	518,097.00	0.46
51	600201	生物股份	16,300	517,362.00	0.46
52	600338	西藏珠峰	12,400	516,460.00	0.45
53	600183	生益科技	29,800	514,348.00	0.45
54	002491	通鼎互联	40,600	511,560.00	0.45
55	600298	安琪酵母	15,600	510,432.00	0.45
56	002013	中航机电	47,000	507,130.00	0.45
57	300032	金龙机电	36,500	506,985.00	0.45
58	000598	兴蓉环境	93,100	505,533.00	0.45
59	600748	上实发展	77,400	496,134.00	0.44
60	000732	泰禾集团	24,500	490,490.00	0.43
61	000860	顺鑫农业	25,300	486,013.00	0.43
62	000829	天音控股	51,000	484,500.00	0.43
63	000587	金洲慈航	69,200	484,400.00	0.43
64	601016	节能风电	146,900	483,301.00	0.43
65	600694	大商股份	14,300	482,339.00	0.42
66	000612	焦作万方	50,900	478,460.00	0.42



67	000999	华润三九	17,400	473,280.00	0.42
68	300026	红日药业	110,500	470,730.00	0.41
69	000685	中山公用	45,900	470,475.00	0.41
70	002309	中利集团	31,600	466,732.00	0.41
71	600729	重庆百货	18,400	461,104.00	0.41
72	000089	深圳机场	52,900	460,230.00	0.41
73	300324	旋极信息	31,300	457,919.00	0.40
74	000563	陕国投 A	107,000	454,750.00	0.40
75	600563	法拉电子	8,943	454,393.83	0.40
76	002179	中航光电	11,470	451,688.60	0.40
77	000680	山推股份	88,500	450,465.00	0.40
78	000501	鄂武商 A	28,007	446,991.72	0.39
79	000028	国药一致	7,400	445,850.00	0.39
80	002002	鸿达兴业	64,900	443,916.00	0.39
81	600831	广电网络	54,300	443,631.00	0.39
82	600366	宁波韵升	24,900	436,248.00	0.38
83	000652	泰达股份	98,800	435,708.00	0.38
84	600280	中央商场	54,897	432,039.39	0.38
85	601012	隆基股份	11,800	429,992.00	0.38
86	000513	丽珠集团	6,391	424,681.95	0.37
87	600765	中航重机	35,300	424,306.00	0.37
88	601929	吉视传媒	142,800	422,688.00	0.37
89	603766	隆鑫通用	60,200	422,604.00	0.37
90	002690	美亚光电	21,700	418,159.00	0.37
91	002601	龙蟠佰利	26,100	418,122.00	0.37
92	002416	爱施德	44,100	417,627.00	0.37
93	002727	一心堂	20,700	416,070.00	0.37
94	300039	上海凯宝	64,990	413,336.40	0.36
95	000417	合肥百货	51,200	413,184.00	0.36
96	002463	沪电股份	76,900	409,877.00	0.36
97	601928	凤凰传媒	50,300	407,933.00	0.36
98	002048	宁波华翔	17,100	406,980.00	0.36
99	600557	康缘药业	30,100	405,748.00	0.36
100	603866	桃李面包	10,400	405,288.00	0.36
101	600582	天地科技	86,400	401,760.00	0.35
102	601717	郑煤机	60,700	399,406.00	0.35
103	000400	许继电气	29,700	391,743.00	0.34
104	000726	鲁泰 A	35,700	390,915.00	0.34
105	600628	新世界	38,400	390,528.00	0.34

106	600894	广日股份	41,609	389,044.15	0.34
107	002308	威创股份	31,800	387,960.00	0.34
108	002358	森源电气	26,100	387,846.00	0.34
109	603567	珍宝岛	27,400	387,162.00	0.34
110	600565	迪马股份	96,200	384,800.00	0.34
111	002063	远光软件	35,800	380,554.00	0.34
112	002396	星网锐捷	17,600	379,984.00	0.33
113	600525	长园集团	24,000	378,960.00	0.33
114	600580	卧龙电气	47,200	378,072.00	0.33
115	002368	太极股份	14,900	378,013.00	0.33
116	300274	阳光电源	20,100	377,277.00	0.33
117	600881	亚泰集团	71,200	375,936.00	0.33
118	600039	四川路桥	91,200	371,184.00	0.33
119	600056	中国医药	14,900	370,861.00	0.33
120	000541	佛山照明	40,200	369,840.00	0.33
121	300296	利亚德	18,936	369,062.64	0.32
122	001696	宗申动力	58,300	368,456.00	0.32
123	300297	蓝盾股份	38,600	368,244.00	0.32
124	002375	亚厦股份	47,900	360,208.00	0.32
125	600079	人福医药	20,100	358,584.00	0.32
126	600307	酒钢宏兴	125,000	357,500.00	0.31
127	600611	大众交通	71,300	355,074.00	0.31
128	600967	内蒙一机	29,200	351,860.00	0.31
129	600284	浦东建设	37,600	349,680.00	0.31
130	000997	新大陆	19,500	349,635.00	0.31
131	600312	平高电气	34,900	348,651.00	0.31
132	002468	申通快递	14,100	348,129.00	0.31
133	600971	恒源煤电	32,900	343,147.00	0.30
134	600325	华发股份	46,320	340,915.20	0.30
135	601168	西部矿业	41,500	340,300.00	0.30
136	600757	长江传媒	48,200	334,990.00	0.29
137	000667	美好置业	109,900	334,096.00	0.29
138	603025	大豪科技	11,300	332,446.00	0.29
139	600750	江中药业	12,970	330,475.60	0.29
140	002589	瑞康医药	24,510	329,659.50	0.29
141	000078	海王生物	55,100	325,090.00	0.29
142	600466	蓝光发展	34,400	321,640.00	0.28
143	600270	外运发展	18,400	317,952.00	0.28
144	600141	兴发集团	18,800	317,720.00	0.28

145	601311	骆驼股份	23,900	316,675.00	0.28
146	600422	昆药集团	34,500	315,675.00	0.28
147	600657	信达地产	56,000	312,480.00	0.28
148	600098	广州发展	43,300	306,131.00	0.27
149	000581	威孚高科	12,700	304,800.00	0.27
150	600277	亿利洁能	46,900	302,036.00	0.27
151	600335	国机汽车	26,800	301,232.00	0.27
152	600736	苏州高新	50,900	300,819.00	0.26
153	000090	天健集团	29,900	300,196.00	0.26
154	600633	浙数文化	19,200	291,840.00	0.26
155	600859	王府井	14,200	289,680.00	0.26
156	000049	德赛电池	7,300	289,007.00	0.25
157	601811	新华文轩	21,400	287,402.00	0.25
158	600017	日照港	71,300	276,644.00	0.24
159	600643	爱建集团	24,800	274,784.00	0.24
160	600754	锦江股份	8,400	271,236.00	0.24
161	002251	步步高	14,824	267,573.20	0.24
162	002477	雏鹰农牧	59,700	265,068.00	0.23
163	002005	德豪润达	60,200	262,472.00	0.23
164	000930	中粮生化	19,600	261,464.00	0.23
165	600282	南钢股份	53,700	259,908.00	0.23
166	300676	华大基因	1,230	255,840.00	0.23
167	000778	新兴铸管	46,400	242,208.00	0.21
168	600220	江苏阳光	79,000	241,740.00	0.21
169	000937	冀中能源	40,000	232,800.00	0.20
170	000401	冀东水泥	16,800	231,672.00	0.20
171	600584	长电科技	10,526	224,519.58	0.20
172	601886	江河集团	25,400	219,964.00	0.19
173	300116	坚瑞沃能	28,600	217,932.00	0.19
174	002503	搜于特	39,200	217,168.00	0.19
175	600600	青岛啤酒	5,400	212,382.00	0.19
176	601000	唐山港	45,000	211,950.00	0.19
177	002437	誉衡药业	30,600	210,834.00	0.19
178	000552	靖远煤电	59,000	207,680.00	0.18
179	002701	奥瑞金	32,800	205,000.00	0.18
180	000729	燕京啤酒	30,200	203,548.00	0.18
181	002001	新和成	5,300	201,718.00	0.18
182	600717	天津港	19,100	200,359.00	0.18
183	600395	盘江股份	28,700	197,169.00	0.17

184	002128	露天煤业	17,700	196,116.00	0.17
185	600267	海正药业	12,600	190,764.00	0.17
186	002266	浙富控股	43,500	188,355.00	0.17
187	600151	航天机电	24,730	187,700.70	0.17
188	600428	中远海特	33,000	185,130.00	0.16
189	002344	海宁皮城	23,300	184,769.00	0.16
190	002277	友阿股份	30,200	177,274.00	0.16
191	600970	中材国际	17,900	177,031.00	0.16
192	000690	宝新能源	21,800	174,400.00	0.15
193	002242	九阳股份	10,100	171,397.00	0.15
194	600917	重庆燃气	15,200	169,328.00	0.15
195	600587	新华医疗	10,000	167,900.00	0.15
196	600022	山东钢铁	77,600	166,064.00	0.15
197	002672	东江环保	10,000	162,500.00	0.14
198	600216	浙江医药	12,000	161,280.00	0.14
199	603001	奥康国际	11,106	160,703.82	0.14
200	000878	云南铜业	11,000	156,090.00	0.14
201	603188	亚邦股份	9,400	155,946.00	0.14
202	002064	华峰氨纶	31,400	153,860.00	0.14
203	002191	劲嘉股份	16,500	152,625.00	0.13
204	600936	广西广电	22,100	151,606.00	0.13
205	000566	海南海药	11,600	149,524.00	0.13
206	600872	中炬高新	5,900	146,084.00	0.13
207	600566	济川药业	3,800	144,970.00	0.13
208	600639	浦东金桥	8,500	144,075.00	0.13
209	002707	众信旅游	13,200	143,748.00	0.13
210	000572	海马汽车	30,900	141,522.00	0.12
211	002073	软控股份	17,451	139,608.00	0.12
212	002408	齐翔腾达	11,000	139,480.00	0.12
213	601880	大连港	49,800	138,942.00	0.12
214	600720	祁连山	13,400	138,690.00	0.12
215	000979	中弘股份	71,480	138,671.20	0.12
216	603883	老百姓	2,200	138,578.00	0.12
217	600059	古越龙山	14,700	138,033.00	0.12
218	600161	天坛生物	4,790	137,904.10	0.12
219	002479	富春环保	14,200	137,882.00	0.12
220	603816	顾家家居	2,300	135,631.00	0.12
221	600500	中化国际	16,000	135,360.00	0.12
222	603369	今世缘	8,700	134,937.00	0.12

223	000975	银泰资源	10,100	134,936.00	0.12
224	000600	建投能源	17,500	134,925.00	0.12
225	000758	中色股份	20,800	133,744.00	0.12
226	600640	号百控股	9,100	133,042.00	0.12
227	002422	科伦药业	5,300	131,970.00	0.12
228	600648	外高桥	7,100	131,350.00	0.12
229	600481	双良节能	32,600	130,726.00	0.12
230	600521	华海药业	4,300	129,516.00	0.11
231	002572	索菲亚	3,500	128,800.00	0.11
232	600528	中铁工业	10,400	126,256.00	0.11
233	000050	深天马 A	6,400	126,144.00	0.11
234	002250	联化科技	11,700	124,254.00	0.11
235	002004	华邦健康	18,400	123,832.00	0.11
236	600409	三友化工	12,900	123,711.00	0.11
237	300147	香雪制药	13,600	121,992.00	0.11
238	000786	北新建材	5,400	121,500.00	0.11
239	600596	新安股份	13,100	120,258.00	0.11
240	600160	巨化股份	11,200	119,056.00	0.10
241	600517	置信电气	18,400	119,048.00	0.10
242	603328	依顿电子	8,100	116,235.00	0.10
243	600572	康恩贝	15,900	112,413.00	0.10
244	603658	安图生物	2,100	111,762.00	0.10
245	300113	顺网科技	6,086	111,312.94	0.10
246	600635	大众公用	23,000	109,940.00	0.10
247	002482	广田集团	13,700	109,874.00	0.10
248	002123	梦网集团	10,600	109,710.00	0.10
249	002345	潮宏基	10,184	109,478.00	0.10
250	000061	农产品	14,200	108,772.00	0.10
251	000848	承德露露	11,400	107,844.00	0.09
252	000877	天山股份	10,300	107,120.00	0.09
253	600006	东风汽车	18,300	107,055.00	0.09
254	002489	浙江永强	17,800	106,978.00	0.09
255	002233	塔牌集团	8,900	105,999.00	0.09
256	002254	泰和新材	9,100	105,924.00	0.09
257	603589	口子窖	2,300	105,915.00	0.09
258	002120	韵达股份	2,299	105,248.22	0.09
259	000596	古井贡酒	1,600	105,072.00	0.09
260	000727	华东科技	43,600	103,768.00	0.09
261	300146	汤臣倍健	6,900	103,638.00	0.09

262	600120	浙江东方	4,200	103,362.00	0.09
263	002400	省广股份	19,350	103,135.50	0.09
264	601020	华钰矿业	5,000	102,600.00	0.09
265	603005	晶方科技	2,900	102,312.00	0.09
266	002410	广联达	5,200	101,920.00	0.09
267	002603	以岭药业	6,500	101,140.00	0.09
268	600536	中国软件	6,100	100,955.00	0.09
269	002373	千方科技	6,800	99,620.00	0.09
270	002122	天马股份	11,700	99,333.00	0.09
271	600064	南京高科	7,000	99,330.00	0.09
272	600773	西藏城投	8,500	99,280.00	0.09
273	600053	九鼎投资	4,100	97,949.00	0.09
274	000636	风华高科	8,200	97,416.00	0.09
275	600329	中新药业	6,500	96,655.00	0.09
276	600545	卓郎智能	8,800	96,624.00	0.09
277	600594	益佰制药	9,400	96,068.00	0.08
278	300134	大富科技	5,800	95,410.00	0.08
279	002050	三花智控	5,200	95,368.00	0.08
280	002699	美盛文化	5,240	94,896.40	0.08
281	300043	星辉娱乐	15,300	93,636.00	0.08
282	600826	兰生股份	7,100	93,507.00	0.08
283	600416	湘电股份	7,460	93,175.40	0.08
284	000656	金科股份	18,800	93,060.00	0.08
285	300002	神州泰岳	15,200	93,024.00	0.08
286	603444	吉比特	500	91,965.00	0.08
287	603377	东方时尚	2,300	91,954.00	0.08
288	000661	长春高新	500	91,500.00	0.08
289	600751	天海投资	14,700	89,817.00	0.08
290	600094	大名城	12,800	89,472.00	0.08
291	002505	大康农业	31,500	89,460.00	0.08
292	603077	和邦生物	44,600	89,200.00	0.08
293	600618	氯碱化工	8,200	88,806.00	0.08
294	002269	美邦服饰	26,700	87,843.00	0.08
295	300257	开山股份	6,200	86,800.00	0.08
296	002190	成飞集成	4,000	86,560.00	0.08
297	600811	东方集团	18,710	85,691.80	0.08
298	603515	欧普照明	2,000	85,680.00	0.08
299	002646	青青稞酒	5,618	85,505.96	0.08
300	600809	山西汾酒	1,500	85,485.00	0.08

301	603806	福斯特	2,500	85,250.00	0.08
302	600026	中远海能	13,900	85,068.00	0.07
303	600240	华业资本	9,900	84,942.00	0.07
304	600315	上海家化	2,301	84,883.89	0.07
305	600143	金发科技	12,900	84,753.00	0.07
306	002390	信邦制药	10,000	84,500.00	0.07
307	002093	国脉科技	8,900	84,461.00	0.07
308	600184	光电股份	4,600	84,272.00	0.07
309	002147	新光圆成	6,480	83,851.20	0.07
310	002041	登海种业	6,500	83,525.00	0.07
311	000592	平潭发展	14,500	83,375.00	0.07
312	300199	翰宇药业	5,100	83,028.00	0.07
313	002353	杰瑞股份	6,300	82,656.00	0.07
314	002028	思源电气	5,200	82,420.00	0.07
315	600058	五矿发展	6,800	82,144.00	0.07
316	002428	云南锗业	6,800	82,076.00	0.07
317	300266	兴源环境	3,020	81,540.00	0.07
318	600687	刚泰控股	6,900	81,489.00	0.07
319	603556	海兴电力	2,229	81,135.60	0.07
320	600169	太原重工	23,300	80,618.00	0.07
321	002038	双鹭药业	2,600	80,522.00	0.07
322	600790	轻纺城	13,500	80,460.00	0.07
323	600187	国中水务	17,100	80,028.00	0.07
324	000062	深圳华强	3,400	79,866.00	0.07
325	002354	天神娱乐	4,620	79,002.00	0.07
326	002818	富森美	2,600	78,806.00	0.07
327	600614	鹏起科技	7,700	78,232.00	0.07
328	600869	智慧能源	13,600	78,064.00	0.07
329	002414	高德红外	4,600	77,326.00	0.07
330	600460	士兰微	5,000	77,150.00	0.07
331	000517	荣安地产	22,800	77,064.00	0.07
332	000536	华映科技	15,500	76,570.00	0.07
333	600316	洪都航空	5,400	76,464.00	0.07
334	000969	安泰科技	8,600	76,454.00	0.07
335	002444	巨星科技	5,500	76,065.00	0.07
336	300136	信维通信	1,500	76,050.00	0.07
337	300122	智飞生物	2,700	75,789.00	0.07
338	002663	普邦股份	13,600	75,480.00	0.07
339	600551	时代出版	6,400	75,136.00	0.07

340	002056	横店东磁	7,000	74,900.00	0.07
341	300156	神雾环保	3,100	74,896.00	0.07
342	603000	人民网	6,900	74,727.00	0.07
343	600125	铁龙物流	6,900	74,658.00	0.07
344	002127	南极电商	6,100	74,359.00	0.07
345	002340	格林美	10,300	74,057.00	0.07
346	002244	滨江集团	9,300	73,935.00	0.07
347	600200	江苏吴中	6,400	73,920.00	0.07
348	002551	尚荣医疗	8,064	73,866.24	0.07
349	300383	光环新网	5,600	73,864.00	0.07
350	600993	马应龙	3,600	73,728.00	0.06
351	002588	史丹利	10,900	72,921.00	0.06
352	603698	航天工程	3,600	71,892.00	0.06
353	601689	拓普集团	2,900	71,746.00	0.06
354	600996	贵广网络	7,200	71,280.00	0.06
355	002019	亿帆医药	3,200	71,200.00	0.06
356	002022	科华生物	5,200	70,772.00	0.06
357	002815	崇达技术	2,200	69,432.00	0.06
358	600086	东方金钰	6,500	69,225.00	0.06
359	002261	拓维信息	8,900	68,886.00	0.06
360	603198	迎驾贡酒	3,900	68,601.00	0.06
361	600770	综艺股份	9,000	68,400.00	0.06
362	002317	众生药业	5,380	68,218.40	0.06
363	603868	飞科电器	900	68,175.00	0.06
364	000926	福星股份	6,200	67,518.00	0.06
365	600759	洲际油气	15,700	66,882.00	0.06
366	002665	首航节能	10,000	66,600.00	0.06
367	600516	方大炭素	2,300	66,424.00	0.06
368	600537	亿晶光电	13,800	66,240.00	0.06
369	600699	均胜电子	2,000	65,740.00	0.06
370	600458	时代新材	6,500	65,455.00	0.06
371	600862	中航高科	6,700	64,856.00	0.06
372	603228	景旺电子	1,200	64,524.00	0.06
373	300159	新研股份	6,200	64,480.00	0.06
374	300001	特锐德	4,687	64,165.03	0.06
375	600496	精工钢构	15,200	63,992.00	0.06
376	002332	仙琚制药	7,808	63,791.36	0.06
377	600645	中源协和	2,200	62,480.00	0.06
378	002051	中工国际	3,340	61,556.20	0.05



379	600805	悦达投资	9,988	60,926.80	0.05
380	600388	龙净环保	3,500	60,550.00	0.05
381	002681	奋达科技	5,400	60,264.00	0.05
382	002657	中科金财	2,600	59,332.00	0.05
383	300010	立思辰	5,300	59,201.00	0.05
384	000998	隆平高科	2,300	59,156.00	0.05
385	600880	博瑞传播	11,200	59,024.00	0.05
386	000766	通化金马	4,300	58,480.00	0.05
387	002018	华信国际	8,200	57,974.00	0.05
388	603877	太平鸟	2,100	56,931.00	0.05
389	600198	大唐电信	5,000	56,300.00	0.05
390	603169	兰石重装	6,700	56,213.00	0.05
391	002271	东方雨虹	1,400	55,944.00	0.05
392	600874	创业环保	4,300	55,943.00	0.05
393	300202	聚龙股份	3,100	55,645.00	0.05
394	000825	太钢不锈	11,200	55,552.00	0.05
395	002583	海能达	3,000	55,530.00	0.05
396	600435	北方导航	4,500	55,485.00	0.05
397	002325	洪涛股份	11,500	54,855.00	0.05
398	000777	中核科技	3,600	53,640.00	0.05
399	002544	杰赛科技	3,400	53,482.00	0.05
400	002011	盾安环境	6,603	53,088.12	0.05
401	002392	北京利尔	10,500	52,920.00	0.05
402	000681	视觉中国	2,700	52,650.00	0.05
403	601001	大同煤业	8,600	52,030.00	0.05
404	002439	启明星辰	2,200	51,370.00	0.05
405	603528	多伦科技	5,800	51,214.00	0.05
406	002517	恺英网络	2,300	51,083.00	0.04
407	600108	亚盛集团	12,400	50,964.00	0.04
408	002223	鱼跃医疗	2,600	50,960.00	0.04
409	603568	伟明环保	2,400	50,520.00	0.04
410	002281	光迅科技	1,700	49,980.00	0.04
411	000939	凯迪生态	10,000	49,900.00	0.04
412	600289	ST 信通	5,000	49,700.00	0.04
413	002273	水晶光电	2,100	49,539.00	0.04
414	600158	中体产业	4,800	49,344.00	0.04
415	300287	飞利信	6,500	48,165.00	0.04
416	000066	中国长城	6,400	46,656.00	0.04
417	000810	创维数字	6,600	45,870.00	0.04

418	600292	远达环保	5,100	45,645.00	0.04
419	002384	东山精密	1,600	45,536.00	0.04
420	000816	智慧农业	14,100	45,261.00	0.04
421	002030	达安基因	2,399	44,573.42	0.04
422	300055	万邦达	2,100	44,163.00	0.04
423	300115	长盈精密	2,200	44,154.00	0.04
424	000712	锦龙股份	2,600	44,148.00	0.04
425	300088	长信科技	5,600	43,848.00	0.04
426	300166	东方国信	3,479	43,661.45	0.04
427	000616	海航投资	12,600	42,210.00	0.04
428	300058	蓝色光标	7,400	40,848.00	0.04
429	002118	紫鑫药业	5,398	40,592.96	0.04
430	002431	棕榈股份	4,700	39,480.00	0.03
431	603355	莱克电气	800	39,424.00	0.03
432	002915	中欣氟材	1,085	38,181.15	0.03
433	002635	安洁科技	1,400	36,526.00	0.03
434	002640	跨境通	1,900	36,366.00	0.03
435	600511	国药股份	1,300	36,140.00	0.03
436	601777	力帆股份	4,800	34,848.00	0.03
437	300730	科创信息	821	34,112.55	0.03
438	002371	北方华创	800	33,152.00	0.03
439	002217	合力泰	3,300	33,000.00	0.03
440	002642	荣之联	2,500	32,775.00	0.03
441	600171	上海贝岭	2,000	32,540.00	0.03
442	600259	广晟有色	800	31,432.00	0.03
443	002512	达华智能	1,700	30,719.00	0.03
444	002249	大洋电机	4,300	29,971.00	0.03
445	002268	卫士通	1,300	29,926.00	0.03
446	000988	华工科技	1,800	29,844.00	0.03
447	002573	清新环境	1,300	29,549.00	0.03
448	000547	航天发展	2,700	29,241.00	0.03
449	002366	台海核电	1,100	29,095.00	0.03
450	000662	天夏智慧	1,900	28,253.00	0.02
451	600166	福田汽车	10,000	28,100.00	0.02
452	002342	巨力索具	4,600	27,554.00	0.02
453	002405	四维图新	1,000	26,390.00	0.02
454	600266	北京城建	2,000	26,280.00	0.02
455	002176	江特电机	2,300	26,036.00	0.02
456	002276	万马股份	3,000	25,860.00	0.02

457	600410	华胜天成	2,300	24,196.00	0.02
458	600503	华丽家族	3,600	23,580.00	0.02
459	600260	凯乐科技	800	23,288.00	0.02
460	000025	特力A	600	23,106.00	0.02
461	600300	维维股份	4,400	19,228.00	0.02
462	300291	华录百纳	1,680	19,068.00	0.02
463	002807	江阴银行	2,300	19,044.00	0.02
464	603888	新华网	800	18,920.00	0.02
465	002709	天赐材料	400	18,396.00	0.02
466	600879	航天电子	2,300	18,032.00	0.02
467	600848	上海临港	800	17,840.00	0.02
468	600776	东方通信	2,300	16,629.00	0.01
469	600291	西水股份	700	16,464.00	0.01
470	600251	冠农股份	2,100	16,359.00	0.01
471	000697	炼石有色	700	16,128.00	0.01
472	300253	卫宁健康	2,350	15,768.50	0.01
473	002670	国盛金控	680	13,226.00	0.01
474	002407	多氟多	600	12,252.00	0.01
475	600884	杉杉股份	600	11,628.00	0.01
476	300244	迪安诊断	475	11,219.50	0.01
477	600755	厦门国贸	800	8,080.00	0.01
478	600418	江淮汽车	800	7,568.00	0.01
479	300273	和佳股份	800	7,248.00	0.01
480	002460	赣锋锂业	100	7,175.00	0.01
481	000970	中科三环	400	5,752.00	0.01
482	601002	晋亿实业	500	5,365.00	0.00
483	002315	焦点科技	192	4,152.96	0.00
484	600392	盛和资源	200	3,800.00	0.00
485	002285	世联行	300	3,345.00	0.00
486	000806	银河生物	300	3,228.00	0.00
487	600499	科达洁能	200	2,218.00	0.00
488	000762	西藏矿业	100	1,570.00	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	000669	金鸿控股	4,425,304.81	3.90

2	600831	广电网络	3,949,131.00	3.48
3	600088	中视传媒	3,948,994.98	3.48
4	600640	号百控股	3,835,975.00	3.38
5	603001	奥康国际	3,738,724.16	3.29
6	600220	江苏阳光	3,641,098.00	3.21
7	600750	江中药业	3,537,450.12	3.11
8	000667	美好置业	3,440,310.00	3.03
9	600587	新华医疗	3,318,594.00	2.92
10	600195	中牧股份	3,260,770.00	2.87
11	600729	重庆百货	3,238,894.00	2.85
12	600292	远达环保	3,232,889.50	2.85
13	600628	新世界	3,150,619.00	2.77
14	000919	金陵药业	3,150,189.33	2.77
15	600460	士兰微	3,117,724.00	2.75
16	002663	普邦股份	3,100,483.21	2.73
17	002011	盾安环境	2,950,460.92	2.60
18	300147	香雪制药	2,921,704.00	2.57
19	002238	天威视讯	2,909,961.75	2.56
20	600422	昆药集团	2,888,362.91	2.54
21	600563	法拉电子	2,884,347.86	2.54
22	000616	海航投资	2,860,641.00	2.52
23	002463	沪电股份	2,849,737.00	2.51
24	002345	潮宏基	2,812,983.98	2.48
25	002646	青青稞酒	2,761,596.02	2.43
26	002029	七匹狼	2,738,337.00	2.41
27	002309	中利集团	2,701,311.43	2.38
28	600825	新华传媒	2,660,334.00	2.34
29	600280	中央商场	2,646,298.60	2.33
30	600993	马应龙	2,632,810.10	2.32
31	600351	亚宝药业	2,607,095.00	2.30
32	002073	软控股份	2,594,054.81	2.28
33	600468	百利电气	2,514,156.54	2.21
34	002327	富安娜	2,503,237.47	2.20
35	002106	莱宝高科	2,386,486.00	2.10
36	002064	华峰氨纶	2,376,947.20	2.09
37	600289	ST 信通	2,362,377.62	2.08

38	600805	悦达投资	2,334,689.88	2.06
39	000417	合肥百货	2,321,749.94	2.04
40	002118	紫鑫药业	2,289,974.52	2.02
41	002332	仙琚制药	2,275,958.72	2.00

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。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600088	中视传媒	3,786,802.69	3.33
2	000669	金鸿控股	3,769,807.40	3.32
3	600640	号百控股	3,627,269.54	3.19
4	600460	士兰微	3,509,668.00	3.09
5	603001	奥康国际	3,422,366.66	3.01
6	600750	江中药业	3,289,935.67	2.90
7	600220	江苏阳光	3,262,478.00	2.87
8	600831	广电网络	3,223,055.97	2.84
9	600292	远达环保	3,073,807.40	2.71
10	002011	盾安环境	3,030,599.01	2.67
11	000667	美好置业	2,988,753.00	2.63
12	000919	金陵药业	2,961,360.88	2.61
13	600587	新华医疗	2,959,616.00	2.61
14	002663	普邦股份	2,935,825.65	2.58
15	002238	天威视讯	2,779,602.54	2.45
16	600729	重庆百货	2,716,068.00	2.39
17	002345	潮宏基	2,713,389.00	2.39
18	000616	海航投资	2,667,397.00	2.35
19	002029	七匹狼	2,653,255.51	2.34
20	300147	香雪制药	2,648,255.00	2.33
21	600195	中牧股份	2,644,431.23	2.33
22	600993	马应龙	2,630,364.00	2.32
23	002646	青青稞酒	2,570,383.60	2.26
24	600563	法拉电子	2,564,207.80	2.26
25	600628	新世界	2,528,029.01	2.23
26	600825	新华传媒	2,525,207.59	2.22
27	002327	富安娜	2,514,095.93	2.21

28	600351	亚宝药业	2,478,396.00	2.18
29	002463	沪电股份	2,458,100.00	2.16
30	600468	百利电气	2,418,828.32	2.13
31	600422	昆药集团	2,395,253.00	2.11
32	002073	软控股份	2,337,897.00	2.06
33	600289	ST 信通	2,284,664.00	2.01

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。

#### 8.4.3 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	505,955,627.75
卖出股票收入（成交）总额	401,968,506.72

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。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	75,232.71	0.07
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	75,232.71	0.07

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110040	生益转债	400	43,312.00	0.04
2	128022	众信转债	110	11,389.40	0.01
3	113015	隆基转债	60	7,104.60	0.01

4	110038	济川转债	50	5,309.00	0.00
5	128027	崇达转债	43	4,300.00	0.00

### 8.7 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。

### 8.8 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。

### 8.9 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。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 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。

#### 8.10.2 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，本基金将以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 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。

#### 8.11.2 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。

#### 8.11.3 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。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体除中国南玻集团股份有限公司（以下简称“南

玻 A” ) 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。

2017 年 12 月, 深圳证券交易所向南玻 A 出具《关于对中国南玻集团股份有限公司及相关当事人给予处分的决定》, 对南玻 A 违反股票上市相关规则的行为, 予以通报批评处分, 并记入上市公司诚信档案。

本基金投资南玻 A (000012) 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, 认为上述事件对南玻 A 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。

### 8.12.2

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。

### 8.12.3 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	19,274.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,516.21
5	应收申购款	152,110.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	173,901.57

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 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	000031	中粮地产	1,174,400.00	1.03	重大资产重组
2	000006	深振业 A	926,885.00	0.82	重大资产重组



## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
1,716	67,040.81	-	-	115,042,034.64	100.00%

### 9.2 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	19.63	0.0000%

### 9.3 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

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017年1月16日）基金份额总额	262,503,783.46
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	10,190,481.38
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	157,652,230.20
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	115,042,034.64

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人的重大人事变动如下：

基金管理人原总经理高潮生先生因个人原因休假，经基金管理人董事会决定，董事长于华先生自 2017 年 8 月 3 日起兼任代总经理。2017 年 8 月 14 日，高潮生先生不再担任基金管理人总经理。基金管理人于 2017 年 8 月 15 日公告了上述事项。

2017 年 9 月 28 日起，督察长李锦女士兼任基金管理人副总经理。根据现行法规、公司章程的规定，督察长李锦女士在兼任公司副总经理期间，其工作职责与原有职责保持一致，不得履行与督察长独立性相冲突的职责。基金管理人于 2017 年 9 月 30 日公告了上述事项。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金未改变投资策略。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金基金合同于 2017 年 1 月 16 日生效，2017 年度系首次进行基金年度审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）系首次向本基金提供审计服务。报告期内本基金应支付给聘任会计师事务所——普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）2017 年度的报酬为 50,000.00 元。

### 11.6 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、基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华鑫证券		2905,196,834.54	100.00%	661,967.09	100.00%	-

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
- (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，本基金的所有交易单元均为新增交易单元。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华鑫证券	-	-	1,989,000,000.00	100%	-	-

## 11.8 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	关于本基金延长募集时间的公告	《上海证券报》	2017 年 1 月 1 日
2	关于本基金提前结束募集的公告	《上海证券报》	2017 年 1 月 12 日
3	本基金基金合同生效公告	《上海证券报》	2017 年 1 月 17 日
4	本基金 2016 年 4 季度报告	《上海证券报》	2017 年 1 月 19 日
5	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	《上海证券报》	2017 年 1 月 23 日
6	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	《上海证券报》	2017 年 1 月 23 日
7	关于本基金参与部分销售机构费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2017 年 2 月 24 日
8	本公司关于旗下部分基金参与宜信普泽投资顾问（北京）有限公司费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2017 年 3 月 13 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	《上海证券报》	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	《上海证券报》	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	《上海证券报》	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	《上海证券报》	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	《上海证券报》	2017 年 4 月 22 日
14	本基金 2017 年 1 季度报告	《上海证券报》	2017 年 4 月 24 日
15	本公司关于调整直销中心最低认申购金额限制的公告	《上海证券报》	2017 年 5 月 26 日
16	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	《上海证券报》	2017 年 6 月 9 日
17	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	《上海证券报》	2017 年 6 月 9 日
18	本公司关于旗下基金增加上海证券为销售机构的公告	《上海证券报》	2017 年 6 月 27 日

19	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	《上海证券报》	2017 年 6 月 27 日
20	本公司关于直销网上交易开通快付通支付业务的公告	《上海证券报》	2017 年 6 月 28 日
21	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	《上海证券报》	2017 年 6 月 29 日
22	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	《上海证券报》	2017 年 6 月 29 日
23	本公司关于执行《证券期货投资者适当性管理办法》和《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》的提示性公告	《上海证券报》	2017 年 7 月 1 日
24	本公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司手机银行申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2017 年 7 月 1 日
25	本公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司网上银行申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2017 年 7 月 1 日
26	本基金 2017 年 2 季度报告	《上海证券报》	2017 年 7 月 20 日
27	本公司关于旗下基金参与华西证券股份有限公司费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2017 年 7 月 21 日
28	本公司关于旗下基金参与华泰证券股份有限公司费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2017 年 8 月 1 日
29	本公司高级管理人员变更公告	《上海证券报》	2017 年 8 月 15 日
30	本公司关于旗下部分基金参与中泰证券费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2017 年 8 月 24 日
31	本公司关于旗下部分基金在国金证券股份有限公司开通基金定期定额投资业务的公告	《上海证券报》	2017 年 8 月 25 日
32	本基金 2017 年半年度报告	《上海证券报》	2017 年 8 月 28 日
33	本基金招募说明书（更新）（2017 年第 1 号）	《上海证券报》	2017 年 8 月 28 日
34	本公司关于旗下部分基金参与平安银行股份有限公司费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2017 年 9 月 25 日
35	本公司高级管理人员变更公告	《上海证券报》	2017 年 9 月 30 日
36	本基金 2017 年 3 季度报告	《上海证券报》	2017 年 10 月 25 日
37	本公司关于股权变更的公告	《上海证券报》	2017 年 11 月 8 日

38	本公司关于旗下部分基金在大泰金石基金销售有限公司开通基金定期定额投资业务并参与定期定额投资申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2017 年 12 月 22 日
39	本公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司手机银行申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2017 年 12 月 30 日
40	本公司关于旗下基金所涉增值税征缴事项的公告	《上海证券报》	2017 年 12 月 30 日

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

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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。

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

### 12.3 查阅方式

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

摩根士丹利华鑫基金管理有限公司

2018年3月29日