

摩根士丹利华鑫睿成中小盘弹性股票型证 券投资基金 2018 年半年度报告

2018 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：交通银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 27 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 23 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 2018 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.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	错误!未定义书签。
§4 管理人报告	10
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.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
§5 托管人报告	15
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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	43
7.1 期末基金资产组合情况.....	43
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	58
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.....	58
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.....	59
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.....	59
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.....	59
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	59
7.12 投资组合报告附注.....	60
§8 基金份额持有人信息.....	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	62
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.....	62
§9 开放式基金份额变动.....	63
§10 重大事件揭示.....	64
10.1 基金份额持有人大会决议.....	64
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.....	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	64
10.4 基金投资策略的改变.....	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	64
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.....	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	64
10.8 其他重大事件.....	65
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	错误!未定义书签。

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	错误!未定义书签。
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	错误!未定义书签。
§12 备查文件目录.....	68
12.1 备查文件目录.....	68
12.2 存放地点.....	68
12.3 查阅方式.....	68

§ 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	90,581,321.98 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。
投资策略	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，使用指数成份股量化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。通过提炼适合中国市场逻辑，具备获取稳定超额收益的因子，在基准指数成份股的基础上根据因子决定投资组合中各只成份股的权重，每隔一段时期，基金管理人将重新计算因子的数值，并以新的因子数值为依据对股票投资组合进行调整，始终保持投资组合能够最大限度的体现出该因子获取超额收益的能力。同时，辅以运用衍生品、债券和资产支持证券等投资策略。
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、货币型基金

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	-3,042,162.32
本期利润	-14,322,756.91
加权平均基金份额本期利润	-0.1486
本期加权平均净值利润率	-15.72%
本期基金份额净值增长率	-16.06%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配利润	-15,520,262.90
期末可供分配基金份额利润	-0.1713
期末基金资产净值	75,061,059.08
期末基金份额净值	0.8287
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-17.13%

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

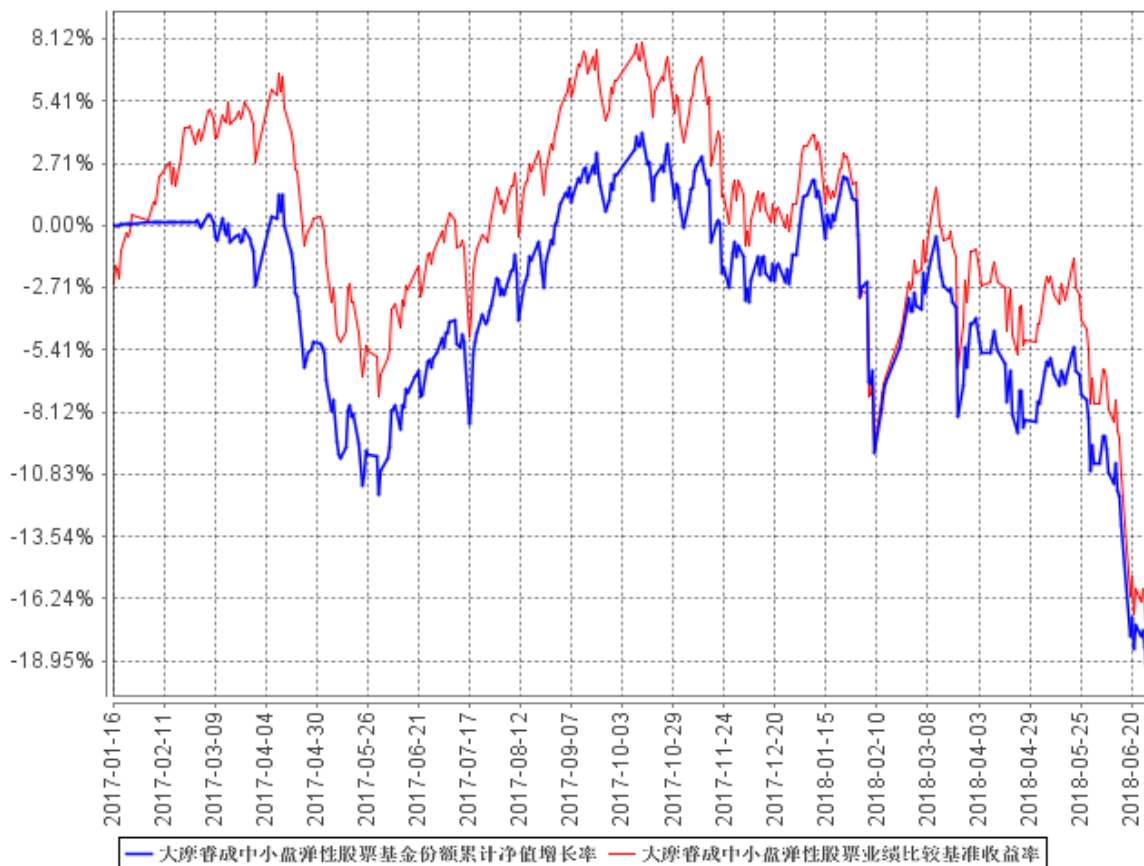
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-8.39%	1.60%	-8.86%	1.77%	0.47%	-0.17%
过去三个月	-13.45%	1.21%	-13.96%	1.31%	0.51%	-0.10%
过去六个月	-16.06%	1.27%	-15.71%	1.37%	-0.35%	-0.10%
过去一年	-12.25%	1.08%	-14.21%	1.16%	1.96%	-0.08%
自基金合同	-17.13%	0.99%	-14.93%	1.07%	-2.20%	-0.08%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

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



§ 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 2018 年 6 月 30 日，公司旗下共管理二十五只开放式基金，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、摩根士丹利华鑫睿成中小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	2017 年 1 月 16	2018 年 6 月 13	11	金融风险管理师（FRM），

	理	日	日		<p>香港科技大学金融数学与统计专业硕士，曾任职于安信证券股份有限公司风险管理部。2013 年 5 月加入本公司，历任风险管理部风险管理经理、数量化投资部基金经理助理、数量化投资部投资经理。</p> <p>2016 年 6 月至 2018 年 6 月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 月至 2018 年 6 月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 月至 2018 年 6 月任本基金基金经理，2017 年 4 月至 2018 年 5 月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。</p>
夏青	数量化 投资部 总监、基 金经理	2018 年 5 月 22 日	-	12	<p>美国马里兰大学金融数学博士。曾于 2006 年 4 月至 2011 年 5 月期间任美国摩根士丹利机构证券部副总裁；2011 年 6 月至 2012 年 12 月期间任美国芝加哥交易对冲基金投资经理；2012 年 12 月至 2013 年 11 月期间任美国斯考特交易对冲基金投资经理；2014 年 3 月至 2014 年 10 月任万向资源有限公司量化投资部总经理；2014 年 12 月至 2016 年 6 月任东吴证券股份有限公司投资总部董事总经理。</p> <p>2016 年 7 月加入本公司，现任数量化投资部总监、组合投资部总监。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</p>

					投资基金基金经理、摩根士丹利华鑫量化多策略股票型证券投资基金基金经理，2017 年 11 月起担任摩根士丹利华鑫新趋势灵活配置混合型证券投资基金基金经理 2018 年 5 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、本基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、吴国雄的任职日期为基金合同生效之日，夏青的任职、吴国雄的离任日期为根据本公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

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

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

经对报告期内公司管理所有投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异，连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）不同投资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，本基金未出现基金管理人管理的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，基金管理人未发现异常交易行为。

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

据国家统计局数据显示，6 月官方制造业 PMI 为 51.5，低于上月的 51.9，下降了 0.4 个百分点，但仍连续二十三个月位于荣枯线上方。从分类指数来看，6 月 PMI 新订单指数为 53.2，较上月回落 0.6 个百分点，而新出口订单则重新回到临界点下方，为 49.8，比上月下降 1.4 个百分点，创今年 3 月以来新低。考虑到近期海外经济景气程度渐趋下行，叠加贸易摩擦可能带来的不确定性，下半年需求端或将持续承压。汇率方面，受美联储加息和中美贸易战影响，截止二季度末，人民币兑美元汇率已跌破 6.6 关口，并呈现持续贬值态势。

2018 年上半年，在美联储加息、中美贸易摩擦等事件影响下，A 股表现持续低迷。上证综指更是在二季度创下了 2016 年三季度以来的最大单季跌幅，单季下跌幅度达到 10.14%，且连续三个季度下跌，季末报收 2847.42。从中信一级行业来看，上半年上涨的行业仅有餐饮旅游、医药和食品饮料，体现出在本轮普跌行情中食品饮料、医药等防御性较强的板块抗跌性更好。从整个上半年来看，代表大盘蓝筹的沪深 300 指数下跌 12.90%，代表中小盘成长股票的创业板指和中小板指则分别下跌 8.33%和 14.26%。

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 2018 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.8287 元，份额累计净值为 0.8287 元，报告期内基金份额净值增长率为-16.06%，同期业绩比较基准收益率为-15.71%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从监管政策看，下半年金融严监管态势仍会延续，货币政策向偏松方向微调继续对金融体系流动性提供支持，但“紧信用”环境预计将难现明显改观，内需扩张动力将持续承压。与此同时，下半年中美双方互相加征关税正式落地，双方将进入“边打边谈”阶段，不排除贸易摩擦进一步升温的可能。由此，预计下半年国内外经济环境均将趋紧，宏观经济增速下行压力也将有所加大。

2018 年下半年，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采用通过量化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（分管基金运营部的副总经理）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、基金合同的相关规定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

报告期内，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

报告期内，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

报告期内，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半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：摩根士丹利华鑫睿成中小盘弹性股票型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	8,399,618.39	9,542,789.18
结算备付金		155,079.84	279,196.96
存出保证金		10,914.73	19,274.70
交易性金融资产	6.4.7.2	66,733,446.21	103,943,781.39
其中：股票投资		66,668,028.69	103,868,548.68
基金投资		-	-
债券投资		65,417.52	75,232.71
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	1,860.41	2,516.21
应收股利		-	-
应收申购款		24,778.15	152,110.66
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		75,325,697.73	113,939,669.10
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 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		20,850.18	70,936.56
应付管理人报酬		97,100.73	146,318.51
应付托管费		16,183.48	24,386.41
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	51,680.66	66,687.99

应交税费		0.34	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	78,823.26	54,569.54
负债合计		264,638.65	362,899.01
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	90,581,321.98	115,042,034.64
未分配利润	6.4.7.10	-15,520,262.90	-1,465,264.55
所有者权益合计		75,061,059.08	113,576,770.09
负债和所有者权益总计		75,325,697.73	113,939,669.10

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8287 元，基金份额总额 90,581,321.98 份。

6.2 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 16 日(基 金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-13,258,544.84	-8,687,516.14
1.利息收入		26,638.85	1,115,179.26
其中：存款利息收入	6.4.7.11	26,560.04	103,610.17
债券利息收入		78.81	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	1,011,569.09
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-2,014,192.67	-1,390,085.51
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-2,593,849.63	-2,389,618.68
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,378.92	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-	-
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	578,278.04	999,533.17
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-11,280,594.59	-8,694,971.39
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	9,603.57	282,361.50

减：二、费用		1,064,212.07	2,515,359.17
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	676,771.61	1,416,898.60
2. 托管费	6.4.10.2.2	112,795.31	236,149.76
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	190,014.14	777,953.50
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.24	-
7. 其他费用	6.4.7.20	84,630.77	84,357.31
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-14,322,756.91	-11,202,875.31
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-14,322,756.91	-11,202,875.31

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：摩根士丹利华鑫睿成中小盘弹性股票型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	115,042,034.64	-1,465,264.55	113,576,770.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-14,322,756.91	-14,322,756.91
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）	-24,460,712.66	267,758.56	-24,192,954.10
其中：1.基金申购款	2,389,017.37	-139,015.48	2,250,001.89
2.基金赎回款	-26,849,730.03	406,774.04	-26,442,955.99
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)	90,581,321.98	-15,520,262.90	75,061,059.08
项目	上年度可比期间 2017年1月16日(基金合同生效日)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)	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)	-	-11,202,875.31	-11,202,875.31
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)	-73,294,837.32	685,873.33	-72,608,963.99
其中：1.基金申购款	4,786,790.16	-162,147.79	4,624,642.37
2.基金赎回款	-78,081,627.48	848,021.12	-77,233,606.36
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)	189,208,946.14	-10,517,001.98	178,691,944.16

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

李锦

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]第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人民币 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 份基金份额，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：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%。

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》、《摩根士丹利华鑫睿成中小盘弹性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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 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

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[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》、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》、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》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 2018 年 6 月 30 日
活期存款	8,399,618.39
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	8,399,618.39

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	81,213,868.36	66,668,028.69	-14,545,839.67
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	65,200.00	65,417.52
	银行间市场	-	-
	合计	65,200.00	65,417.52
资产支持证券	-	-	-

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	81,279,068.36	66,733,446.21	-14,545,622.15

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 2018年6月30日
应收活期存款利息	1,691.87
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	69.80
应收债券利息	93.84
应收资产支持证券利息	-
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	4.90
合计	1,860.41

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 2018年6月30日
----	-------------------

交易所市场应付交易费用	51,680.66
银行间市场应付交易费用	-
合计	51,680.66

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	12.58
预提费用	78,810.68
合计	78,823.26

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	115,042,034.64	115,042,034.64
本期申购	2,389,017.37	2,389,017.37
本期赎回(以“-”号填列)	-26,849,730.03	-26,849,730.03
本期末	90,581,321.98	90,581,321.98

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,636,460.51	-3,101,725.06	-1,465,264.55
本期利润	-3,042,162.32	-11,280,594.59	-14,322,756.91
本期基金份额交易产生的变动数	-256,378.44	524,137.00	267,758.56
其中：基金申购款	-1,414.99	-137,600.49	-139,015.48
基金赎回款	-254,963.45	661,737.49	406,774.04
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,662,080.25	-13,858,182.65	-15,520,262.90

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
活期存款利息收入	25,675.19
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	747.90
其他	136.95
合计	26,560.04

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出股票成交总额	79,225,717.45
减：卖出股票成本总额	81,819,567.08
买卖股票差价收入	-2,593,849.63

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	1,378.92
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,378.92

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交	6,383.00

总额	
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付） 成本总额	5,000.00
减：应收利息总额	4.08
买卖债券差价收入	1,378.92

6.4.7.13.3 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
	2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	578,278.04
基金投资产生的股利收益	-
合计	578,278.04

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
1. 交易性金融资产	-11,280,594.59
——股票投资	-11,275,779.40
——债券投资	-4,815.19
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-11,280,594.59

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	9,569.97
基金转换费收入	33.60
合计	9,603.57

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% 归入基金财产，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。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
交易所市场交易费用	190,014.14
银行间市场交易费用	-
合计	190,014.14

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	49,588.57
银行费用	1,320.09
债券账户维护费	8,926.92
合计	84,630.77

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
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

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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月16日(基金合同生效日)至 2017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	135,096,828.94	100.00%	656,267,998.53	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018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	98,799.27	100.00%	51,680.66	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月16日(基金合同生效日)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	479,930.96	100.00%	123,120.45	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 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月16日(基金合同生效日)至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	676,771.61	1,416,898.60
其中：支付销售机构的客户维护费	374,025.77	728,970.41

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月16日(基金合同生效日)至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	112,795.31	236,149.76

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。

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

本基金本报告期无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月16日(基金合同生效日)至2017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
交通银行	8,399,618.39	25,675.19	13,349,581.18	71,791.73

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；保管于交通银行的定期存款按约定利率计息。

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

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2018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
002309	中利集团	2018年2月5日	重大资产重组	14.30	2018年7月30日	12.78	27,200	383,241.88	388,960.00	-
600811	东方集团	2018年5月30日	重大事项	4.30	-	-	78,410	348,054.55	337,163.00	-
000669	金鸿控股	2018年5月18日	重大资产重组	7.25	2018年8月6日	6.53	41,203	405,764.62	298,721.75	-
600687	刚泰控股	2018年6月11日	重大资产重组	9.09	2018年8月20日	7.36	32,200	338,601.93	292,698.00	-
002005	德豪润达	2018年1月2日	重大资产重组	4.36	2018年7月2日	3.92	60,200	311,633.99	262,472.00	-
000587	金洲慈航	2018年6月15日	重大资产重组	4.96	2018年7月2日	4.46	38,300	266,223.87	189,968.00	-
600022	山东钢铁	2018年3月27日	重大资	2.02	2018年8月16日	1.83	81,600	185,018.45	164,832.00	-

		日	产 重 组		日					
002437	誉衡 药业	2018 年 6 月 11 日	重 大 资 产 重 组	6.20	2018 年 8 月 13 日	5.57	26,200	201,790.47	162,440.00	-
000566	海南 海药	2017 年 11 月 22 日	重 大 资 产 重 组	12.89	2018 年 7 月 9 日	11.60	11,600	157,969.09	149,524.00	-
600759	洲际 油气	2018 年 3 月 27 日	重 大 资 产 重 组	3.94	-	-	34,400	152,748.09	135,536.00	-
002051	中工 国际	2018 年 4 月 9 日	重 大 资 产 重 组	15.27	-	-	8,340	142,723.49	127,351.80	-
002431	棕榈 股份	2018 年 5 月 30 日	重 大 事 项	6.71	-	-	16,200	130,671.30	108,702.00	-
002477	雏鹰 农牧	2018 年 6 月 14 日	重 大 事 项	3.31	-	-	32,700	127,326.98	108,237.00	-
002359	北讯 集团	2018 年 5 月 21 日	重 大 事 项	19.58	2018 年 8 月 21 日	17.62	5,400	137,947.26	105,732.00	-
000825	太钢 不锈	2018 年 4 月 16 日	重 大 资 产 重 组	6.00	-	-	17,500	112,689.84	105,000.00	-

			组							
300146	汤臣倍健	2018年1月31日	重大资产重组	16.60	2018年7月31日	16.50	6,100	83,981.17	101,260.00	-
600750	江中药业	2018年5月2日	重大资产重组	17.75	2018年8月1日	16.12	5,698	121,446.47	101,139.50	-
600158	中体产业	2018年3月27日	重大事项	11.64	2018年7月16日	11.61	8,400	116,258.94	97,776.00	-
600751	海航科技	2018年1月12日	重大资产重组	6.49	-	-	14,400	105,584.89	93,456.00	-
002665	首航节能	2018年5月29日	重大资产重组	5.80	-	-	15,800	112,366.65	91,640.00	-
002408	齐翔腾达	2018年6月19日	重大资产重组	12.28	-	-	7,400	91,420.93	90,872.00	-
002699	美盛文化	2018年2月5日	重大资产重组	18.76	2018年7月2日	16.88	4,540	64,043.81	85,170.40	-
002011	盾安环境	2018年5月2日	重大资	6.40	-	-	13,003	107,024.83	83,219.20	-

		日	产 重 组							
002573	清新 环境	2018 年 6 月 19 日	重 大 事 项	11.55	-	-	6,500	104,413.40	75,075.00	-
000426	兴业 矿业	2018 年 6 月 19 日	重 大 资 产 重 组	7.21	-	-	10,100	107,553.58	72,821.00	-
002147	新光 圆成	2018 年 1 月 18 日	重 大 资 产 重 组	10.29	-	-	6,180	73,206.32	63,592.20	-
300324	旋极 信息	2018 年 5 月 30 日	重 大 资 产 重 组	9.49	-	-	6,623	68,571.47	62,852.27	-
600086	东方 金钰	2018 年 1 月 19 日	重 大 资 产 重 组	10.04	-	-	6,200	66,087.97	62,248.00	-
600335	国机 汽车	2018 年 4 月 4 日	重 大 事 项	10.43	-	-	5,700	71,023.53	59,451.00	-
600122	宏图 高科	2018 年 6 月 19 日	重 大 资 产 重 组	7.40	-	-	7,700	84,579.93	56,980.00	-
000939	凯迪 生态	2017 年 11 月 16 日	重 大 事 项	4.99	2018 年 7 月 2	4.74	10,000	57,049.60	49,900.00	-

		日	项		日					
600848	上海 临港	2018 年 6 月 15 日	重 大 资 产 重 组	21.67	-	-	2,300	53,576.64	49,841.00	-
300266	兴源 环境	2018 年 2 月 5 日	重 大 事 项	19.99	2018 年 7 月 2 日	17.99	2,320	60,128.25	46,376.80	-
000616	海航 投资	2018 年 1 月 24 日	重 大 资 产 重 组	3.42	2018 年 7 月 25 日	3.08	11,500	53,629.47	39,330.00	-
300197	铁汉 生态	2018 年 5 月 28 日	重 大 资 产 重 组	5.37	-	-	5,100	37,507.60	27,387.00	-
002512	达华 智能	2018 年 6 月 19 日	重 大 事 项	9.70	-	-	2,200	30,175.90	21,340.00	-

注：本基金截至 2018 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购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，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。

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 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资(2017 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。

于 2018 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。

6.4.13.3.1 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 6.4.12。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。

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 2018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	8,399,618.39	-	-	-	8,399,618.39
结算备付金	155,079.84	-	-	-	155,079.84
存出保证金	10,914.73	-	-	-	10,914.73
交易性金融资产	65,417.52	-	-	66,668,028.69	66,733,446.21

应收利息	-	-	-	1,860.41	1,860.41
应收申购款	-	-	-	24,778.15	24,778.15
资产总计	8,631,030.48	-	-	66,694,667.25	75,325,697.73
负债					
应付赎回款	-	-	-	20,850.18	20,850.18
应付管理人报酬	-	-	-	97,100.73	97,100.73
应付托管费	-	-	-	16,183.48	16,183.48
应付交易费用	-	-	-	51,680.66	51,680.66
应交税费	-	-	-	0.34	0.34
其他负债	-	-	-	78,823.26	78,823.26
负债总计	-	-	-	264,638.65	264,638.65
利率敏感度缺口	8,631,030.48	-	-	66,430,028.60	75,061,059.08
上年度末 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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2018 年 6 月 30 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 0.09%。因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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，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。

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 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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	66,668,028.69	88.82	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	65,417.52	0.09	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	66,733,446.21	88.91	103,943,781.39	91.52

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(2018年6月) 上年度末(2017年12月)

		30 日)	31 日)
	业绩比较基准 (附注 6.4.1) 上升 5%	3,070,000.00	4,450,000.00
	业绩比较基准 (附注 6.4.1) 下降 5%	-3,070,000.00	-4,450,000.00

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 2018 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 62,298,963.77 元，属于第二层次的余额为 43,69,064.92 元，无属于第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第一层的余额为 97,412,873.64 元，第二层的余额为 6,530,907.75 元，无属于第三层的余额)。

(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 2018 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(2017 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	66,668,028.69	88.51
	其中：股票	66,668,028.69	88.51
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	65,417.52	0.09
	其中：债券	65,417.52	0.09
	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	8,554,698.23	11.36
8	其他各项资产	37,553.29	0.05
9	合计	75,325,697.73	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	630,303.00	0.84
B	采矿业	3,076,381.60	4.10
C	制造业	38,466,307.92	51.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,419,774.75	4.56
E	建筑业	1,587,407.00	2.11
F	批发和零售业	5,140,188.99	6.85
G	交通运输、仓储和邮政业	2,484,675.20	3.31
H	住宿和餐饮业	136,752.00	0.18

I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,835,934.06	5.11
J	金融业	866,118.52	1.15
K	房地产业	4,060,936.60	5.41
L	租赁和商务服务业	1,027,010.10	1.37
M	科学研究和技术服务业	86,670.00	0.12
N	水利、环境和公共设施管理业	353,114.80	0.47
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	48,475.00	0.06
Q	卫生和社会工作	41,346.75	0.06
R	文化、体育和娱乐业	1,327,502.40	1.77
S	综合	79,130.00	0.11
	合计	66,668,028.69	88.82

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	600801	华新水泥	34,900	524,547.00	0.70
2	002233	塔牌集团	41,800	478,192.00	0.64
3	600256	广汇能源	116,500	476,485.00	0.63
4	600881	亚泰集团	115,000	428,950.00	0.57
5	000860	顺鑫农业	11,000	412,500.00	0.55
6	600737	中粮糖业	52,300	394,342.00	0.53
7	600380	健康元	32,800	389,008.00	0.52
8	002309	中利集团	27,200	388,960.00	0.52
9	000999	华润三九	13,700	381,271.00	0.51
10	600572	康恩贝	53,000	380,010.00	0.51
11	600098	广州发展	58,900	379,905.00	0.51
12	002221	东华能源	38,800	379,076.00	0.51
13	002308	威创股份	45,600	378,480.00	0.50
14	600270	外运发展	17,500	366,800.00	0.49
15	000543	皖能电力	82,400	363,384.00	0.48
16	600578	京能电力	113,700	354,744.00	0.47
17	000718	苏宁环球	95,500	350,485.00	0.47
18	002311	海大集团	16,600	350,260.00	0.47
19	002701	奥瑞金	63,900	348,894.00	0.46
20	600195	中牧股份	17,900	348,155.00	0.46

21	601016	节能风电	120,900	346,983.00	0.46
22	600648	外高桥	18,800	343,664.00	0.46
23	600062	华润双鹤	13,900	341,245.00	0.45
24	603025	大豪科技	17,640	341,157.60	0.45
25	002280	联络互动	59,600	340,912.00	0.45
26	600869	智慧能源	71,900	339,368.00	0.45
27	600811	东方集团	78,410	337,163.00	0.45
28	600748	上实发展	66,600	335,664.00	0.45
29	002635	安洁科技	19,500	335,400.00	0.45
30	002001	新和成	17,680	335,212.80	0.45
31	000028	国药一致	6,700	334,330.00	0.45
32	600863	内蒙华电	147,000	333,690.00	0.44
33	600978	宜华生活	48,700	332,621.00	0.44
34	000078	海王生物	68,800	330,928.00	0.44
35	000848	承德露露	31,000	328,290.00	0.44
36	600618	氯碱化工	38,500	327,635.00	0.44
37	300026	红日药业	89,000	324,850.00	0.43
38	000552	靖远煤电	99,000	323,730.00	0.43
39	002242	九阳股份	18,300	323,727.00	0.43
40	600664	哈药股份	81,100	321,967.00	0.43
41	600557	康缘药业	26,000	321,100.00	0.43
42	601001	大同煤业	64,700	320,912.00	0.43
43	600808	马钢股份	89,200	320,228.00	0.43
44	603198	迎驾贡酒	17,400	319,638.00	0.43
45	600064	南京高科	43,520	319,436.80	0.43
46	600426	华鲁恒升	18,050	317,499.50	0.42
47	600143	金发科技	60,800	317,376.00	0.42
48	600201	生物股份	18,460	315,481.40	0.42
49	300182	捷成股份	41,000	310,780.00	0.41
50	002019	亿帆医药	17,600	310,640.00	0.41
51	300297	蓝盾股份	38,100	308,991.00	0.41
52	600073	上海梅林	46,400	308,096.00	0.41
53	600282	南钢股份	69,500	307,190.00	0.41
54	600642	申能股份	60,600	304,212.00	0.41
55	601168	西部矿业	48,400	303,952.00	0.40
56	603328	依顿电子	28,000	303,800.00	0.40
57	002013	中航机电	40,100	303,557.00	0.40
58	000598	兴蓉环境	74,000	300,440.00	0.40
59	002078	太阳纸业	31,000	300,390.00	0.40

60	600056	中国医药	16,400	299,628.00	0.40
61	002244	滨江集团	57,600	299,520.00	0.40
62	002064	华峰氨纶	72,400	299,012.00	0.40
63	600582	天地科技	81,400	298,738.00	0.40
64	000669	金鸿控股	41,203	298,721.75	0.40
65	600823	世茂股份	71,200	297,616.00	0.40
66	002745	木林森	16,700	297,093.00	0.40
67	600565	迪马股份	99,700	294,115.00	0.39
68	600657	信达地产	69,200	294,100.00	0.39
69	600687	刚泰控股	32,200	292,698.00	0.39
70	600717	天津港	38,800	292,164.00	0.39
71	600611	大众交通	73,300	291,734.00	0.39
72	601311	骆驼股份	25,400	291,338.00	0.39
73	600597	光明乳业	29,500	291,165.00	0.39
74	000528	柳工	27,100	290,241.00	0.39
75	601231	环旭电子	31,800	288,426.00	0.38
76	600511	国药股份	10,700	288,365.00	0.38
77	300287	飞利信	40,000	287,600.00	0.38
78	002056	横店东磁	41,000	287,410.00	0.38
79	002463	沪电股份	76,600	286,484.00	0.38
80	600718	东软集团	21,900	286,014.00	0.38
81	600094	大名城	49,500	285,120.00	0.38
82	601678	滨化股份	46,070	284,712.60	0.38
83	600260	凯乐科技	10,600	284,504.00	0.38
84	002681	奋达科技	32,700	283,182.00	0.38
85	600138	中青旅	14,200	283,006.00	0.38
86	002491	通鼎互联	25,400	281,178.00	0.37
87	000031	中粮地产	48,500	280,330.00	0.37
88	600079	人福医药	21,200	280,264.00	0.37
89	000758	中色股份	61,700	277,650.00	0.37
90	600183	生益科技	30,305	277,593.80	0.37
91	601020	华钰矿业	20,100	277,179.00	0.37
92	600787	中储股份	35,800	277,092.00	0.37
93	000830	鲁西化工	16,200	276,696.00	0.37
94	000050	深天马A	19,400	275,868.00	0.37
95	002152	广电运通	46,800	275,184.00	0.37
96	600875	东方电气	37,100	274,911.00	0.37
97	002416	爱施德	46,680	274,011.60	0.37
98	000680	山推股份	79,600	273,824.00	0.36

99	000513	丽珠集团	6,228	273,720.60	0.36
100	600060	海信电器	20,400	273,156.00	0.36
101	600580	卧龙电气	35,600	271,272.00	0.36
102	600694	大商股份	8,300	269,833.00	0.36
103	601717	郑煤机	46,400	269,584.00	0.36
104	002444	巨星科技	24,200	266,442.00	0.35
105	002277	友阿股份	57,700	265,997.00	0.35
106	002005	德豪润达	60,200	262,472.00	0.35
107	600835	上海机电	13,900	262,154.00	0.35
108	000662	天夏智慧	40,692	261,649.56	0.35
109	002002	鸿达兴业	56,700	261,387.00	0.35
110	002092	中泰化学	26,800	258,352.00	0.34
111	000887	中鼎股份	17,900	257,939.00	0.34
112	601127	小康股份	14,700	254,163.00	0.34
113	603225	新凤鸣	12,700	253,619.00	0.34
114	600039	四川路桥	76,900	252,232.00	0.34
115	000581	威孚高科	11,300	249,843.00	0.33
116	603188	亚邦股份	24,400	248,880.00	0.33
117	600184	光电股份	20,000	247,800.00	0.33
118	603766	隆鑫通用	45,500	247,065.00	0.33
119	000960	锡业股份	20,500	246,205.00	0.33
120	000541	佛山照明	40,840	244,631.60	0.33
121	600859	王府井	11,500	244,605.00	0.33
122	000049	德赛电池	8,600	242,692.00	0.32
123	000652	泰达股份	77,600	242,112.00	0.32
124	601928	凤凰传媒	39,800	241,984.00	0.32
125	000829	天音控股	32,800	240,424.00	0.32
126	601000	唐山港	101,140	237,679.00	0.32
127	002482	广田集团	39,800	237,606.00	0.32
128	600757	长江传媒	41,700	237,273.00	0.32
129	600037	歌华有线	22,300	230,136.00	0.31
130	000501	鄂武商A	18,707	229,909.03	0.31
131	600312	平高电气	40,100	226,164.00	0.30
132	002375	亚厦股份	42,300	225,882.00	0.30
133	000400	许继电气	28,800	224,928.00	0.30
134	600284	浦东建设	45,840	223,699.20	0.30
135	000039	中集集团	16,700	221,776.00	0.30
136	600894	广日股份	35,409	209,975.37	0.28
137	600996	贵广网络	27,400	203,308.00	0.27

138	000930	中粮生化	19,600	201,880.00	0.27
139	300159	新研股份	27,800	196,824.00	0.26
140	600765	中航重机	26,200	194,928.00	0.26
141	002155	湖南黄金	28,100	192,204.00	0.26
142	000587	金洲慈航	38,300	189,968.00	0.25
143	601811	新华文轩	19,300	187,596.00	0.25
144	000563	陕国投 A	54,400	184,960.00	0.25
145	601128	常熟银行	31,500	180,180.00	0.24
146	002517	恺英网络	24,600	176,874.00	0.24
147	600022	山东钢铁	81,600	164,832.00	0.22
148	002437	誉衡药业	26,200	162,440.00	0.22
149	603001	奥康国际	13,471	160,439.61	0.21
150	002503	搜于特	44,600	156,100.00	0.21
151	002354	天神娱乐	16,820	155,753.20	0.21
152	000596	古井贡酒	1,700	150,926.00	0.20
153	000566	海南海药	11,600	149,524.00	0.20
154	600006	东风汽车	35,800	146,422.00	0.20
155	600277	亿利洁能	26,122	136,879.28	0.18
156	600754	锦江股份	3,700	136,752.00	0.18
157	000690	宝新能源	19,600	136,416.00	0.18
158	600759	洲际油气	34,400	135,536.00	0.18
159	002032	苏泊尔	2,600	133,900.00	0.18
160	000656	金科股份	27,000	129,600.00	0.17
161	600240	华业资本	17,600	129,008.00	0.17
162	002051	中工国际	8,340	127,351.80	0.17
163	300001	特锐德	11,187	127,084.32	0.17
164	002127	南极电商	13,500	126,765.00	0.17
165	000418	小天鹅 A	1,800	124,830.00	0.17
166	000778	新兴铸管	29,100	124,548.00	0.17
167	600458	时代新材	16,400	120,704.00	0.16
168	000761	本钢板材	29,800	120,392.00	0.16
169	603877	太平鸟	3,600	119,988.00	0.16
170	600623	华谊集团	12,000	119,760.00	0.16
171	600058	五矿发展	14,400	119,664.00	0.16
172	000089	深圳机场	15,600	119,340.00	0.16
173	600059	古越龙山	14,600	118,990.00	0.16
174	600917	重庆燃气	17,400	118,494.00	0.16
175	000062	深圳华强	6,000	117,600.00	0.16
175	600872	中炬高新	4,200	117,600.00	0.16

176	600466	蓝光发展	18,760	116,312.00	0.15
177	600500	中化国际	17,000	115,940.00	0.15
178	600566	济川药业	2,400	115,656.00	0.15
179	603658	安图生物	1,400	115,444.00	0.15
180	300257	开山股份	7,500	114,675.00	0.15
181	600673	东阳光科	11,100	114,663.00	0.15
182	600428	中远海特	31,900	113,245.00	0.15
183	600161	天坛生物	5,837	112,945.95	0.15
184	002299	圣农发展	7,200	111,528.00	0.15
185	002431	棕榈股份	16,200	108,702.00	0.14
186	002477	雏鹰农牧	32,700	108,237.00	0.14
187	000975	银泰资源	10,640	107,889.60	0.14
188	600655	豫园股份	11,400	107,730.00	0.14
189	600315	上海家化	2,701	107,040.63	0.14
190	600017	日照港	33,100	106,251.00	0.14
191	002603	以岭药业	7,600	106,248.00	0.14
192	600169	太原重工	45,400	106,236.00	0.14
193	600575	皖江物流	28,500	105,735.00	0.14
194	002359	北讯集团	5,400	105,732.00	0.14
195	002191	劲嘉股份	14,100	105,327.00	0.14
196	000825	太钢不锈	17,500	105,000.00	0.14
197	002344	海宁皮城	21,500	104,490.00	0.14
198	600643	爱建集团	11,100	104,340.00	0.14
199	600395	盘江股份	17,000	103,190.00	0.14
200	000878	云南铜业	10,800	103,032.00	0.14
201	600639	浦东金桥	8,200	102,336.00	0.14
202	600266	北京城建	10,800	101,520.00	0.14
203	300146	汤臣倍健	6,100	101,260.00	0.13
204	600750	江中药业	5,698	101,139.50	0.13
205	000937	冀中能源	24,600	101,106.00	0.13
206	600317	营口港	44,400	100,344.00	0.13
207	600298	安琪酵母	2,800	99,904.00	0.13
208	000025	特力 A	3,100	99,727.00	0.13
209	600125	铁龙物流	11,800	98,766.00	0.13
210	603589	口子窖	1,600	98,320.00	0.13
211	603369	今世缘	4,300	98,169.00	0.13
212	000703	恒逸石化	6,580	97,910.40	0.13
213	600155	宝硕股份	13,600	97,784.00	0.13
214	600158	中体产业	8,400	97,776.00	0.13

215	600108	亚盛集团	33,000	95,370.00	0.13
216	600346	恒力股份	6,500	95,290.00	0.13
217	002672	东江环保	7,200	94,248.00	0.13
218	603169	兰石重装	18,800	94,188.00	0.13
219	000636	风华高科	5,900	93,692.00	0.12
220	600751	海航科技	14,400	93,456.00	0.12
221	002422	科伦药业	2,900	93,090.00	0.12
222	600521	华海药业	3,480	92,881.20	0.12
223	002392	北京利尔	27,300	92,820.00	0.12
224	002050	三花智控	4,900	92,365.00	0.12
225	600885	宏发股份	3,080	92,153.60	0.12
226	002332	仙琚制药	10,508	91,945.00	0.12
227	002665	首航节能	15,800	91,640.00	0.12
228	601233	桐昆股份	5,320	91,610.40	0.12
229	600348	阳泉煤业	12,800	91,520.00	0.12
230	000661	长春高新	400	91,080.00	0.12
231	002408	齐翔腾达	7,400	90,872.00	0.12
232	600773	西藏城投	13,100	90,652.00	0.12
233	600004	白云机场	6,800	89,012.00	0.12
234	000786	北新建材	4,800	88,944.00	0.12
235	000685	中山公用	11,100	88,467.00	0.12
236	603816	顾家家居	1,200	88,212.00	0.12
237	600936	广西广电	18,400	87,584.00	0.12
238	000027	深圳能源	17,700	87,438.00	0.12
239	000006	深振业 A	14,900	87,314.00	0.12
240	002358	森源电气	5,800	87,290.00	0.12
241	002266	浙富控股	23,200	87,000.00	0.12
242	002004	华邦健康	17,100	86,868.00	0.12
243	600645	中源协和	4,500	86,670.00	0.12
244	603806	福斯特	3,900	85,839.00	0.11
245	600267	海正药业	5,900	85,786.00	0.11
246	600160	巨化股份	11,700	85,644.00	0.11
247	002640	跨境通	5,700	85,614.00	0.11
248	002254	泰和新材	7,500	85,350.00	0.11
249	002699	美盛文化	4,540	85,170.40	0.11
250	600292	远达环保	14,400	84,528.00	0.11
251	002371	北方华创	1,700	84,439.00	0.11
252	600388	龙净环保	6,600	84,348.00	0.11
253	002434	万里扬	9,600	84,288.00	0.11

254	600176	中国巨石	8,232	84,213.36	0.11
255	002276	万马股份	14,300	83,512.00	0.11
256	002588	史丹利	16,100	83,398.00	0.11
257	002011	盾安环境	13,003	83,219.20	0.11
258	000061	农产品	15,400	83,160.00	0.11
258	600307	酒钢宏兴	39,600	83,160.00	0.11
258	603883	老百姓	1,000	83,160.00	0.11
259	603077	和邦生物	47,900	82,867.00	0.11
260	002505	大康农业	38,500	82,390.00	0.11
261	600884	杉杉股份	3,700	81,770.00	0.11
262	600392	盛和资源	5,000	81,150.00	0.11
263	002709	天赐材料	2,100	80,934.00	0.11
264	601699	潞安环能	8,700	80,562.00	0.11
265	600216	浙江医药	6,300	80,451.00	0.11
266	002583	海能达	9,600	80,160.00	0.11
267	600600	青岛啤酒	1,800	78,894.00	0.11
268	600908	无锡银行	13,300	78,337.00	0.10
269	600141	兴发集团	6,720	78,288.00	0.10
270	002489	浙江永强	21,500	78,260.00	0.10
271	300058	蓝色光标	13,700	78,090.00	0.10
272	002176	江特电机	8,000	77,760.00	0.10
273	600481	双良节能	25,400	77,724.00	0.10
274	002345	潮宏基	8,984	77,262.40	0.10
275	002325	洪涛股份	20,800	76,960.00	0.10
276	002384	东山精密	3,200	76,800.00	0.10
277	600026	中远海能	18,100	76,744.00	0.10
278	002414	高德红外	5,700	76,608.00	0.10
279	000012	南玻 A	15,456	76,507.20	0.10
280	002439	启明星辰	3,600	76,392.00	0.10
281	002353	杰瑞股份	4,700	76,375.00	0.10
282	600563	法拉电子	1,543	76,363.07	0.10
283	600329	中新药业	4,000	76,000.00	0.10
284	600826	兰生股份	5,600	75,992.00	0.10
285	603568	伟明环保	3,000	75,900.00	0.10
286	000729	燕京啤酒	11,200	75,376.00	0.10
287	002128	露天煤业	8,300	75,198.00	0.10
288	002573	清新环境	6,500	75,075.00	0.10
289	002690	美亚光电	3,100	73,904.00	0.10
290	002183	怡亚通	11,000	73,150.00	0.10

291	000099	中信海直	11,500	73,140.00	0.10
291	600516	方大炭素	3,000	73,140.00	0.10
292	600939	重庆建工	14,800	73,112.00	0.10
293	000426	兴业矿业	10,100	72,821.00	0.10
294	000990	诚志股份	5,200	72,800.00	0.10
295	600729	重庆百货	2,200	72,490.00	0.10
296	600187	国中水务	25,400	72,136.00	0.10
297	601880	大连港	36,800	71,392.00	0.10
298	601200	上海环境	4,500	71,235.00	0.09
299	600628	新世界	9,900	71,082.00	0.09
300	002251	步步高	6,224	70,829.12	0.09
301	002373	千方科技	5,400	70,470.00	0.09
302	000877	天山股份	10,400	70,200.00	0.09
303	600640	号百控股	6,900	70,173.00	0.09
304	002440	闰土股份	6,000	70,140.00	0.09
305	603515	欧普照明	1,500	70,110.00	0.09
306	300253	卫宁健康	5,650	70,003.50	0.09
307	600499	科达洁能	10,200	69,972.00	0.09
308	002642	荣之联	7,600	69,844.00	0.09
309	300088	长信科技	12,000	69,600.00	0.09
310	002340	格林美	11,500	69,575.00	0.09
311	002030	达安基因	4,509	69,528.78	0.09
312	600587	新华医疗	5,100	69,513.00	0.09
313	600970	中材国际	10,400	69,472.00	0.09
314	002271	东方雨虹	4,080	69,400.80	0.09
315	603228	景旺电子	1,400	69,216.00	0.09
316	600418	江淮汽车	10,600	69,006.00	0.09
317	000681	视觉中国	2,400	68,880.00	0.09
318	001696	宗申动力	14,000	68,600.00	0.09
319	300383	光环新网	5,100	68,391.00	0.09
320	002038	双鹭药业	1,800	68,382.00	0.09
321	000592	平潭发展	23,800	67,592.00	0.09
322	002022	科华生物	5,700	67,545.00	0.09
323	002407	多氟多	4,800	67,296.00	0.09
324	002589	瑞康医药	4,910	66,972.40	0.09
325	600120	浙江东方	4,940	66,937.00	0.09
326	000667	美好置业	31,300	66,669.00	0.09
327	000009	中国宝安	13,500	66,150.00	0.09
327	002250	联化科技	7,500	66,150.00	0.09

328	603569	长久物流	4,620	65,973.60	0.09
329	600862	中航高科	10,700	65,805.00	0.09
330	000600	建投能源	11,800	65,726.00	0.09
331	000969	安泰科技	10,500	65,625.00	0.09
332	002428	云南锗业	8,500	65,620.00	0.09
333	600166	福田汽车	32,200	65,366.00	0.09
334	600179	安通控股	6,440	65,237.20	0.09
335	002179	中航光电	1,670	65,130.00	0.09
336	002506	协鑫集成	13,900	65,052.00	0.09
337	600584	长电科技	3,826	64,812.44	0.09
338	600743	华远地产	25,200	64,764.00	0.09
339	300134	大富科技	7,200	64,368.00	0.09
340	002118	紫鑫药业	8,998	64,335.70	0.09
341	000998	隆平高科	3,400	64,124.00	0.09
342	002147	新光圆成	6,180	63,592.20	0.08
343	600635	大众公用	17,000	63,240.00	0.08
344	300324	旋极信息	6,623	62,852.27	0.08
345	600280	中央商场	7,197	62,757.84	0.08
346	600525	长园集团	5,900	62,363.00	0.08
347	600086	东方金钰	6,200	62,248.00	0.08
348	600410	华胜天成	7,100	62,125.00	0.08
349	600316	洪都航空	6,600	61,512.00	0.08
350	002390	信邦制药	8,400	61,488.00	0.08
351	300199	翰宇药业	4,300	61,404.00	0.08
352	002317	众生药业	5,780	61,094.60	0.08
353	000536	华映科技	22,100	60,775.00	0.08
354	601689	拓普集团	3,100	60,264.00	0.08
355	603528	多伦科技	7,500	59,550.00	0.08
356	600776	东方通信	12,300	59,532.00	0.08
357	600335	国机汽车	5,700	59,451.00	0.08
358	002405	四维图新	2,900	58,725.00	0.08
359	002093	国脉科技	7,600	58,596.00	0.08
360	300133	华策影视	5,500	58,575.00	0.08
361	300039	上海凯宝	10,090	58,522.00	0.08
362	002807	江阴银行	10,400	58,448.00	0.08
363	002410	广联达	2,100	58,233.00	0.08
364	002123	梦网集团	6,500	57,785.00	0.08
365	603000	人民网	6,900	57,270.00	0.08
366	000612	焦作万方	10,900	57,225.00	0.08

367	600122	宏图高科	7,700	56,980.00	0.08
368	002223	鱼跃医疗	2,900	56,521.00	0.08
369	002815	崇达技术	3,500	56,350.00	0.08
370	002131	利欧股份	26,700	56,070.00	0.07
371	000712	锦龙股份	5,600	55,888.00	0.07
372	600633	浙数文化	6,700	55,878.00	0.07
373	002663	普邦股份	18,700	55,539.00	0.07
374	002368	太极股份	1,900	55,233.00	0.07
375	002249	大洋电机	12,800	55,168.00	0.07
376	300055	万邦达	4,800	55,152.00	0.07
377	000090	天健集团	8,760	54,312.00	0.07
378	002073	软控股份	9,351	53,768.25	0.07
379	000762	西藏矿业	5,500	52,965.00	0.07
380	600517	置信电气	14,300	52,910.00	0.07
381	002041	登海种业	7,700	52,514.00	0.07
382	603888	新华网	3,100	52,266.00	0.07
383	300147	香雪制药	7,200	51,912.00	0.07
384	002400	省广集团	15,950	51,518.50	0.07
385	600325	华发股份	6,620	51,172.60	0.07
386	603444	吉比特	400	51,116.00	0.07
387	000766	通化金马	4,300	51,084.00	0.07
388	601002	晋亿实业	8,300	50,713.00	0.07
389	603019	中科曙光	1,100	50,457.00	0.07
390	000777	中核科技	5,400	50,436.00	0.07
391	000488	晨鸣纸业	3,900	50,388.00	0.07
392	000939	凯迪生态	10,000	49,900.00	0.07
393	600848	上海临港	2,300	49,841.00	0.07
394	600993	马应龙	2,900	49,329.00	0.07
395	600879	航天电子	7,000	49,210.00	0.07
396	600598	北大荒	5,300	48,548.00	0.06
397	300113	顺网科技	2,786	48,504.26	0.06
398	603377	东方时尚	3,500	48,475.00	0.06
399	000547	航天发展	6,200	48,422.00	0.06
400	002818	富森美	1,800	47,484.00	0.06
401	000926	福星股份	6,500	46,735.00	0.06
402	600971	恒源煤电	6,500	46,410.00	0.06
403	300266	兴源环境	2,320	46,376.80	0.06
404	000987	越秀金控	5,900	46,374.00	0.06
405	600366	宁波韵升	7,560	46,116.00	0.06

406	002268	卫士通	2,100	45,843.00	0.06
407	600503	华丽家族	11,600	45,356.00	0.06
408	600409	三友化工	5,100	43,911.00	0.06
409	002028	思源电气	2,600	43,654.00	0.06
410	002707	众信旅游	4,500	43,200.00	0.06
411	600438	通威股份	6,200	42,780.00	0.06
412	600967	内蒙一机	3,300	42,042.00	0.06
413	300273	和佳股份	6,100	41,358.00	0.06
414	300244	迪安诊断	2,175	41,346.75	0.06
415	600880	博瑞传播	9,700	41,322.00	0.06
416	002342	巨力索具	10,900	41,311.00	0.06
417	300274	阳光电源	4,600	41,262.00	0.05
418	002544	杰赛科技	3,000	41,070.00	0.05
419	600171	上海贝岭	3,500	40,530.00	0.05
420	000988	华工科技	2,800	40,460.00	0.05
421	300291	华录百纳	5,680	40,044.00	0.05
422	300043	星辉娱乐	10,000	40,000.00	0.05
423	000616	海航投资	11,500	39,330.00	0.05
424	002273	水晶光电	2,860	36,808.20	0.05
425	600422	昆药集团	4,700	36,425.00	0.05
426	603355	莱克电气	1,200	36,060.00	0.05
427	600614	鹏起科技	6,100	34,831.00	0.05
428	000997	新大陆	2,200	34,650.00	0.05
429	002551	尚荣医疗	5,464	33,603.60	0.04
430	000970	中科三环	3,500	32,725.00	0.04
431	600536	中国软件	1,500	32,445.00	0.04
432	600594	益佰制药	3,600	32,256.00	0.04
433	600291	西水股份	2,400	32,064.00	0.04
434	002106	莱宝高科	5,500	31,680.00	0.04
435	603556	海兴电力	1,728	31,397.76	0.04
436	002195	二三四五	7,020	30,045.60	0.04
437	600874	创业环保	3,200	29,888.00	0.04
438	300002	神州泰岳	7,100	29,607.00	0.04
439	300202	聚龙股份	2,700	28,161.00	0.04
440	002670	国盛金控	2,576	27,743.52	0.04
441	300197	铁汉生态	5,100	27,387.00	0.04
442	002261	拓维信息	5,900	27,140.00	0.04
443	000066	中国长城	3,800	27,018.00	0.04
444	002479	富春环保	4,600	25,990.00	0.03

445	300115	长盈精密	1,900	24,643.00	0.03
446	002366	台海核电	1,700	24,242.00	0.03
447	603868	飞科电器	500	24,185.00	0.03
448	002281	光迅科技	1,100	23,320.00	0.03
449	002285	世联行	3,600	22,572.00	0.03
450	002657	中科金财	1,400	22,176.00	0.03
451	000401	冀东水泥	2,500	22,175.00	0.03
452	300166	东方国信	1,479	21,785.67	0.03
453	000977	浪潮信息	900	21,465.00	0.03
454	002512	达华智能	2,200	21,340.00	0.03
455	600416	湘电股份	2,960	21,282.40	0.03
456	002048	宁波华翔	1,700	20,961.00	0.03
457	600259	广晟有色	700	20,496.00	0.03
458	000021	深科技	3,000	20,460.00	0.03
459	000806	银河生物	4,700	20,351.00	0.03
460	300010	立思辰	1,500	18,360.00	0.02
461	002049	紫光国微	400	17,648.00	0.02
462	002190	成飞集成	1,000	17,090.00	0.02
463	600338	西藏珠峰	800	16,576.00	0.02
464	002063	远光软件	1,700	14,382.00	0.02
465	600770	综艺股份	2,200	12,980.00	0.02
466	600435	北方导航	1,500	12,240.00	0.02
467	600460	士兰微	700	8,540.00	0.01
468	000807	云铝股份	1,400	7,252.00	0.01

注：1. 根据“宝硕股份”（600155）公告，“宝硕股份”自 2018 年 7 月 12 日更名为“华创阳安”。

2. 根据“凯迪生态”（000939）公告，“凯迪生态”自 2018 年 7 月 2 日更名为“*ST 凯迪”。

3. 根据“亚邦股份”公告，“亚邦股份”自 2018 年 8 月 14 日更名为“ST 亚邦”。

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	600578	京能电力	684,085.00	0.60
2	600823	世茂股份	630,588.00	0.56

3	600516	方大炭素	589,532.00	0.52
4	600737	中粮糖业	562,102.00	0.49
5	600037	歌华有线	516,993.00	0.46
6	002233	塔牌集团	501,198.00	0.44
7	603198	迎驾贡酒	500,220.00	0.44
8	000718	苏宁环球	498,964.00	0.44
9	600717	天津港	495,835.00	0.44
10	600256	广汇能源	493,707.00	0.43
11	600687	刚泰控股	441,678.00	0.39
12	000990	诚志股份	438,287.00	0.39
13	002195	二三四五	427,819.00	0.38
14	300182	捷成股份	425,070.00	0.37
15	603225	新凤鸣	421,415.00	0.37
16	002280	联络互动	406,866.00	0.36
17	600466	蓝光发展	404,736.00	0.36
18	000662	天夏智慧	401,920.00	0.35
19	002244	滨江集团	398,075.00	0.35
20	600438	通威股份	395,536.00	0.35

注：“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000830	鲁西化工	967,883.00	0.85
2	000732	泰禾集团	799,146.00	0.70
3	601699	潞安环能	723,912.00	0.64
4	600348	阳泉煤业	692,554.00	0.61
5	000031	中粮地产	686,135.00	0.60
6	000021	深科技	685,864.00	0.60
7	600176	中国巨石	671,070.00	0.59
8	300039	上海凯宝	654,102.00	0.58
9	600516	方大炭素	626,792.00	0.55
10	600280	中央商场	619,721.00	0.55
11	000012	南玻 A	619,603.50	0.55
12	000620	新华联	604,272.00	0.53

13	600466	蓝光发展	604,254.00	0.53
14	600729	重庆百货	599,360.00	0.53
15	600586	金晶科技	592,970.00	0.52
16	600743	华远地产	588,386.00	0.52
17	000488	晨鸣纸业	586,187.00	0.52
18	000006	深振业 A	575,685.00	0.51
19	000703	恒逸石化	567,918.00	0.50
20	600664	哈药股份	561,411.00	0.49

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	55,894,826.49
卖出股票收入（成交）总额	79,225,717.45

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

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）	65,417.52	0.09
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	65,417.52	0.09

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

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	39,824.00	0.05
2	128022	众信转债	110	11,128.70	0.01
3	113015	隆基转债	60	5,942.40	0.01
4	128027	崇达转债	43	4,940.27	0.01
5	128020	水晶转债	39	3,582.15	0.00

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。

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江苏中利集团股份有限公司（以下简称“中利集团”）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 7 月，深圳证券交易所出具《关于对江苏中利集团股份有限公司及相关当事人给予通报批评处分的决定》，对中利集团违反上市公司相关规则的行为，予以通报批评处分，并记入上市公司诚信档案。

本基金投资中利集团（002309）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，认为上述事件对中利集团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。

7.13 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	10,914.73
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,860.41
5	应收申购款	24,778.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	37,553.29

7.13.1 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	------	--------------

1	110040	生益转债	39,824.00	0.05
2	128022	众信转债	11,128.70	0.01
3	113015	隆基转债	5,942.40	0.01
4	128027	崇达转债	4,940.27	0.01
5	128020	水晶转债	3,582.15	0.00

7.13.2 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	002309	中利集团	388,960.00	0.52	重大资产重组

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
1,531	59,164.81	0.00	0.00%	90,581,321.98	100.00%

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	19.63	0.0000%

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（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	115,042,034.64
本报告期基金总申购份额	2,389,017.37
减：本报告期基金总赎回份额	26,849,730.03
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	90,581,321.98

§ 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，基金管理人的重大人事变动如下：

2018 年 4 月 9 日，李锦女士离任基金管理人督察长，现任基金管理人副总经理。2018 年 4 月 9 日起，陈竽女士任职基金管理人督察长。基金管理人于 2018 年 4 月 10 日公告了上述事项。

2018 年 4 月 13 日，高见先生由于个人原因辞职，离任基金管理人副总经理。基金管理人于 2018 年 4 月 14 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。

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

1、本报告期内基金管理人收到《深圳证监局关于对摩根士丹利华鑫基金管理有限公司采取责令整改并暂停办理相关业务措施的决定》，责令公司进行整改，整改期间暂停受理公司公募基金产品注册申请。公司高度重视，制定并落实相关整改措施，并及时向深圳证监局提交整改报告。

2、本报告期基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华鑫证券	2	135,096,828.94	100.00%	98,799.27	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《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，本基金租用的证券公司交易单元情况未发生变化。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华鑫证券	6,383.00	100.00%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	本公司关于旗下部分基金在上海利得基金销售有限公司开通基金转换业务的公告	《上海证券报》	2018年1月9日

2	本公司关于旗下基金调整停牌股票“光环新网”估值方法的公告	《上海证券报》	2018 年 1 月 16 日
3	本基金 2017 年 4 季度报告	《上海证券报》	2018 年 1 月 22 日
4	本公司关于旗下基金调整停牌股票中粮地产估值方法的公告	《上海证券报》	2018 年 1 月 24 日
5	本公司关于旗下基金调整流通受限股票估值方法的公告	《上海证券报》	2018 年 2 月 6 日
6	本公司关于旗下基金参与北京展恒基金销售股份有限公司费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2018 年 2 月 8 日
7	关于本基金增加方正证券股份有限公司、中国民族证券有限责任公司为销售机构并参与费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2018 年 2 月 14 日
8	本基金招募说明书（更新）（2018 年第 1 号）	《上海证券报》	2018 年 3 月 1 日
9	本公司关于旗下部分基金在上海利得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》	2018 年 3 月 13 日
10	本公司关于修订旗下基金基金合同、托管协议条款的公告	《上海证券报》	2018 年 3 月 24 日
11	本基金 2017 年年度报告	《上海证券报》	2018 年 3 月 29 日
12	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》	2018 年 3 月 31 日
13	本公司关于旗下部分基金参与东海证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2018 年 4 月 2 日
14	本公司关于旗下基金增加上海挖财基金销售有限公司为销售机构的公告	《上海证券报》	2018 年 4 月 4 日
15	本公司关于旗下基金参与上海挖财基金销售有限公司费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2018 年 4 月 4 日
16	本公司高级管理人员变更公告	《上海证券报》	2018 年 4 月 10 日
17	本公司高级管理人员变更公告	《上海证券报》	2018 年 4 月 14 日
18	本基金 2018 年 1 季度报告	《上海证券报》	2018 年 4 月 21 日
19	本公司关于旗下基金增加上海基煜基金销售有限公司为销售机构并参与费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2018 年 4 月 23 日
20	本公司关于旗下基金参与北京恒天明泽基金销售有限公司费率优	《上海证券报》	2018 年 4 月 27 日

	惠活动的公告		
21	本公司关于旗下基金增加北京蛋卷基金销售有限公司为销售机构并参与费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2018 年 5 月 10 日
22	本公司关于旗下部分基金增加万和证券有限责任公司为销售机构的公告	《上海证券报》	2018 年 5 月 11 日
23	本基金基金经理变更公告	《上海证券报》	2018 年 5 月 22 日
24	本公司关于旗下基金参与中国银河证券股份有限公司费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2018 年 5 月 31 日
25	本基金基金经理变更公告	《上海证券报》	2018 年 6 月 13 日
26	本公司关于旗下基金估值调整情况的公告	《上海证券报》	2018 年 6 月 28 日
27	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》	2018 年 6 月 29 日

§ 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

2018年8月27日