

摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资 基金 2016 年年度报告

2016 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 30 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 28 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 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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	5
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
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
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
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
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.....	14
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
§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
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	15
§7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	20
§8 投资组合报告	43
8.1 期末基金资产组合情况.....	43
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	44
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.....	44
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	55
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	56
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.....	56
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.....	56

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	56
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	57
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	57
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
8.12	投资组合报告附注	57
§9	基金份额持有人信息	59
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
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	60
§10	开放式基金份额变动	60
§11	重大事件揭示	60
11.1	基金份额持有人大会决议	60
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	61
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
11.4	基金投资策略的改变	61
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	61
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	61
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
11.8	其他重大事件	62
§12	备查文件目录	67
12.1	备查文件目录	67
12.2	存放地点	67
12.3	查阅方式	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资基金
基金简称	大摩量化配置混合
基金主代码	233015
交易代码	233015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 12 月 11 日
基金管理人	摩根士丹利华鑫基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	931, 831, 313. 74 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化模型，优化资产配置权重，力争在降低组合风险的同时，获得超越比较基准的超额收益。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>资产配置采取“自上而下”的多因素分析决策支持，结合定性分析和定量分析，确定中长期的资产配置方案。</p> <p>2、行业配置策略</p> <p>本基金通过量化方法分析各个行业的股价表现与宏观经济、产业链指标之间的关系，并结合各行业的估值水平、一致预期、盈利水平、动量反转等指标，获得各行业的预期收益率，并运用 BL 模型对行业配置权重进行优化。</p> <p>3、股票配置策略</p> <p>在行业内选股策略上，本基金采用量化模型的方法进行选股。量化选股模型包括但不限于以下两种：一种是持有行业内若干权重股，并优化其在基金中的权重以拟合行业平均收益；另一种是通过量化多因子选股模型挑选优势个股。</p>
业绩比较基准	80%×沪深 300 指数收益率+20%×标普中国债券指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期收益和风险高于货币型基金、债券型基金，而低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险、中高收益品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		摩根士丹利华鑫基金管理 有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李锦	林葛
	联系电话	(0755) 88318883	(010) 66060069
	电子邮箱	xexpl@msfunds.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-8888-668	95599
传真		(0755) 82990384	(010) 63201816
注册地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第二座第 17 层 01-04 室	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第二座第 17 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518048	100031
法定代表人		YU HUA(于华)	周慕冰

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券日报
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	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-104,713,285.27	681,111,300.60	38,727,825.29
本期利润	-261,985,726.49	742,050,675.27	141,257,883.76
加权平均基金份额本期利润	-0.2195	0.5175	1.1160

本期加权平均净值利润率	-11.38%	24.59%	83.57%
本期基金份额净值增长率	-6.88%	33.46%	55.31%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	640,480,164.96	1,033,535,790.20	284,686,135.33
期末可供分配基金份额利润	0.6873	0.7390	0.3220
期末基金资产净值	1,879,837,958.91	3,028,944,554.57	1,434,646,532.43
期末基金份额净值	2.017	2.166	1.623
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	101.70%	116.60%	62.30%

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。

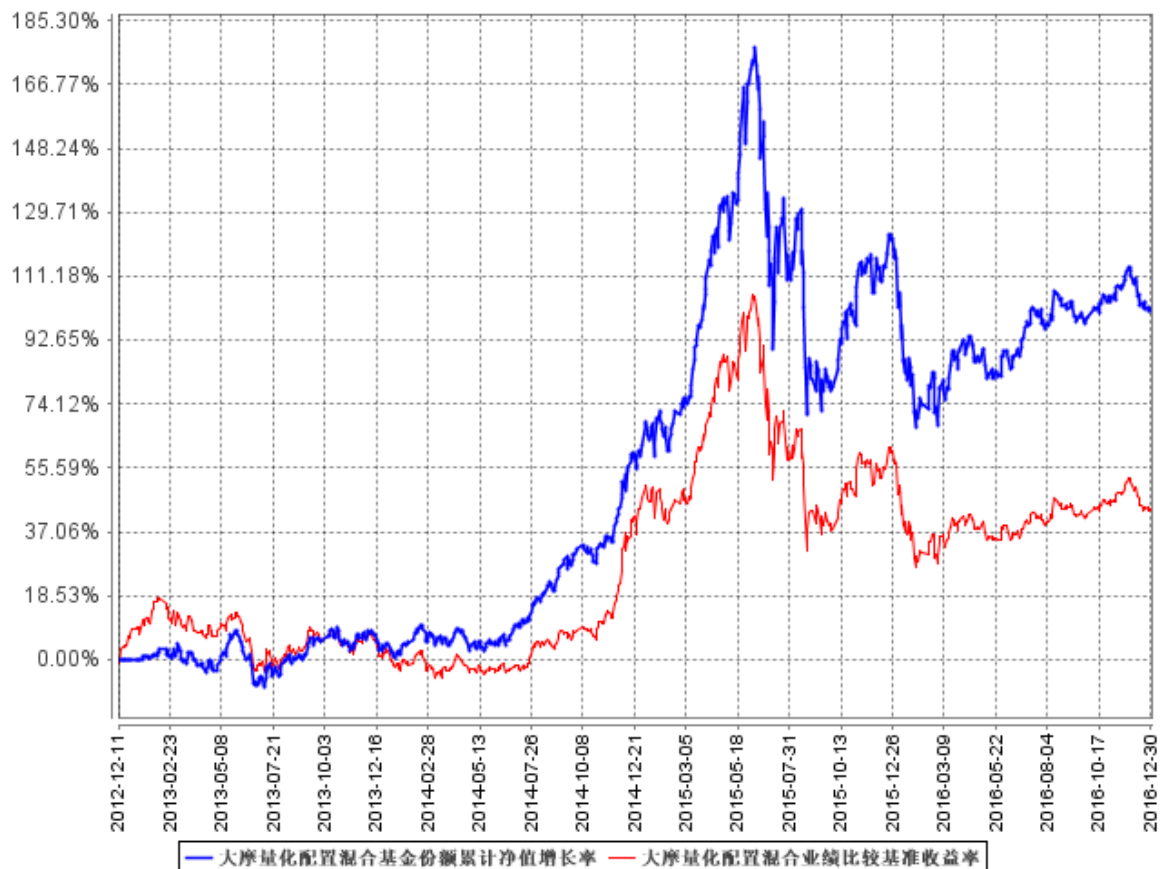
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	1.26%	0.62%	1.17%	0.57%	0.09%	0.05%
过去六个月	4.45%	0.71%	4.11%	0.61%	0.34%	0.10%
过去一年	-6.88%	1.36%	-8.40%	1.12%	1.52%	0.24%
过去三年	93.01%	1.68%	39.69%	1.43%	53.32%	0.25%
自基金合同生效起至今	101.70%	1.54%	43.74%	1.36%	57.96%	0.18%

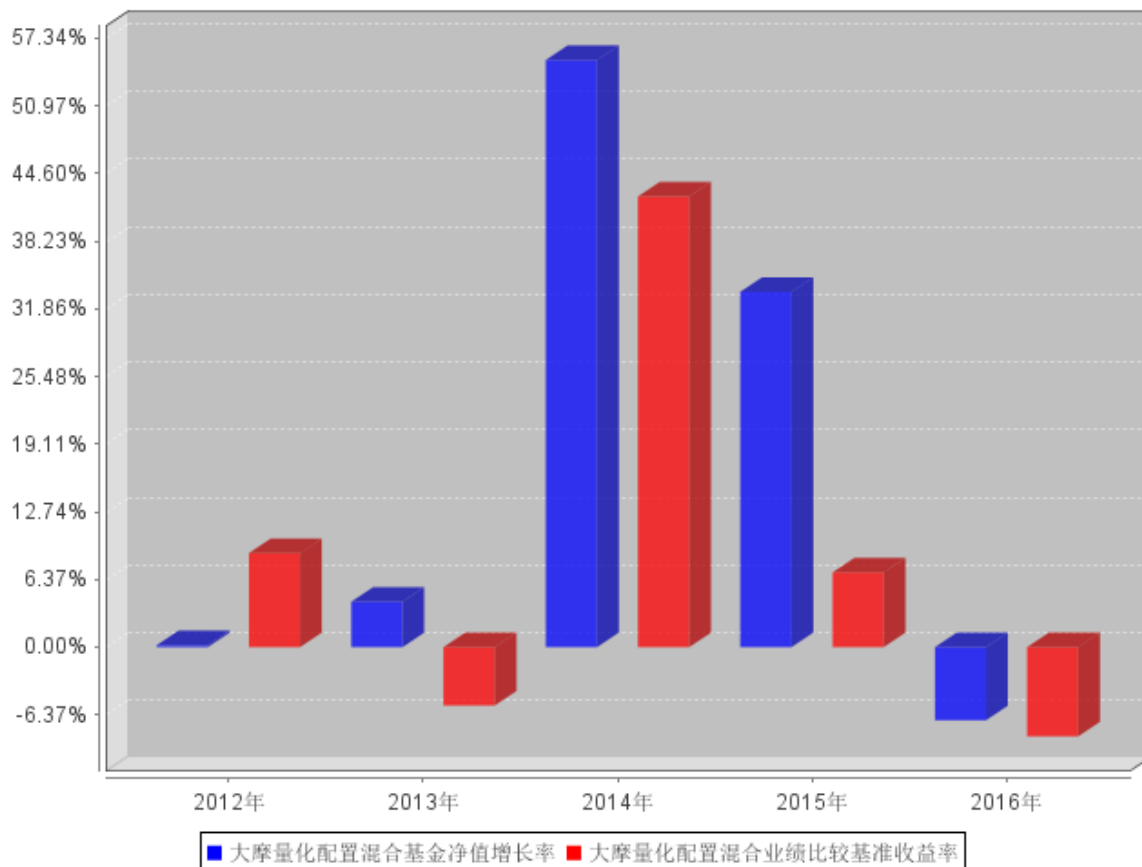
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

大摩量化配置混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

大摩量化配置混合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 2012 年 12 月 11 日正式生效。上述指标在基金合同生效当年按照实际存续期计算，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

本基金过去三年无利润分配的情况。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止 2016 年 12 月 31 日，公司旗下共管理二十四只基金产品，包括摩根士丹利华鑫基础行业

证券投资基金、摩根士丹利华鑫资源优选混合型证券投资基金 (LOF)、摩根士丹利华鑫领先优势混合型证券投资基金、摩根士丹利华鑫强收益债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫卓越成长混合型证券投资基金、摩根士丹利华鑫消费领航混合型证券投资基金、摩根士丹利华鑫多因子精选策略混合型证券投资基金、摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金、摩根士丹利华鑫主题优选混合型证券投资基金、摩根士丹利华鑫多元收益债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资基金、摩根士丹利华鑫双利增强债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫纯债稳定增利 18 个月定期开放债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫品质生活精选股票型证券投资基金、摩根士丹利华鑫进取优选股票型证券投资基金、摩根士丹利华鑫纯债稳定添利 18 个月定期开放债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫优质信价纯债债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫量化多策略股票型证券投资基金、摩根士丹利华鑫新机遇灵活配置混合型证券投资基金、摩根士丹利华鑫多元收益 18 个月定期开放债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫沪港深新价值灵活配置混合型证券投资基金、摩根士丹利华鑫纯债稳定增值 18 个月定期开放债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫健康产业混合型证券投资基金和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。同时，公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨雨龙	数量化投资部副总监、基金经理	2015 年 6 月 26 日	-	7	北京大学金融数学硕士。曾任招商银行总行计划财务部管理会计，博时基金管理有限公司交易员，兴业证券股份有限公司研究所金融工程高级分析师。2014 年 7 月份加入本公司，历任数量化投资部投资经理，2015 年 6 月起任摩根士丹利华鑫多因子精选策略混合型证券投资基金及本基金基金经理，2015 年 7 月起任摩根士丹利华鑫量化多策略股票型证券投资基金基金经理。
吴国雄	基金经理	2016 年 6 月 3 日	-	9	金融风险管理师 (FRM)，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、量化投资部基金经理助理、量化投资部投资经理。2016年6月起任本基金基金经理，2016年7月起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经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、基金经理的任职日期为根据本公司决定确定的聘任日期；

2、基金经理任职已按规定在中国证券投资基金业协会办理完毕基金经理注册；

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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 28 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

2016 年初，市场对泡沫时期产生的高估值股票进行集中抛售，引发了市场大幅下跌。随后的行情波澜不惊，A 股主要指数全年均呈现“L”型的走势。其中，大盘股表现相对较好，特别是四季度，受益于保险资金轮番举牌，上证指数表现一枝独秀，在 3000 点大关企稳反弹，成交量较三季度有所上升；而深市各指数虽在 10 月份跟随市场反弹，但力度明显偏弱，及后更受到美国总统大选和美联储加息两大宏观事件影响，指数不升反跌。临近新年，两市交投活跃度下降，各大指数均有所回落。

中国官方制造业采购经理指数（PMI）在 2016 年下半年明显好转，且第四季度各月均在 51.0 以上，呈持续扩张态势。受供给侧改革影响，大型企业生产经营状况良好，11 月和 12 月的生产扩散指数和新订单扩散指数分别为全年的新高和次高，而中小型企业依然在荣枯线以下，表现远逊于大型企业。

本基金主要通过数量化模型优化资产配置。在报告期内，本基金坚持执行量化配置策略，精选并持有低估值蓝筹股，力争在降低组合风险的同时，获得一定超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期截至 2016 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 2.017 元，累计份额净值为 2.017 元，报告期内基金份额净值增长率为-6.88%，同期业绩比较基准收益率为-8.40%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为，未来一段时间，国内或将实行中性偏紧的货币政策，以抑制资产泡沫、对抗通货膨胀、应对人民币贬值。

国内方面，从 2016 年三季度开始，政府一直强调要“抑制资产泡沫，防范金融风险”。央行行长周小川新年致辞强调，2017 年将保持货币政策稳健中性，把防控金融风险放到更加重要的位置，牢牢守住不发生系统性金融风险的底线。

海外方面，美国候任总统川普上台前频频与普京互动示好，美俄关系的好转很可能助推原油修复到符合美俄共同利益的价格，并传导到各行业以及大宗商品，引发通胀。

综上，国内流动性拐点或已出现。在限售股即将大量解禁上市的情况下，A 股市场可能面临一定的向上压力。预计 2017 年市场将继续演绎指数区间震荡、个股表现分化的结构性行情。本基金将根据市场情况，动态调整策略和仓位，并持续关注受益于供给侧改革、一带一路和国企改革的蓝筹股。

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) 完成专项检查工作。检查范围覆盖投资研究交易、基金销售、特定客户资产管理业务、业务持续性计划、自有资金投资及风险准备金、反洗钱业务等方面。(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，适时以合规指引方式解读监管政策与要求，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，改进合规培训形式，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。

2017 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

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

基金管理人成立基金估值委员会，委员会由主任委员（分管基金运营部的助理总经理）以及相关成员（包括基金运营部负责人、基金会计、风险管理部及监察稽核部相关业务人员）构成。估值委员会的相关人员均具有一定年限的专业从业经验，具有良好的专业能力，并能在相关工作中保持独立性。其中基金运营部负责具体执行公允价值估值、提供估值建议、跟踪长期停牌股票对资产净值的影响并就调整估值方法与托管行、会计师事务所进行沟通；风险管理部负责评估公允价值估值数据模型，计算并向基金运营部提供使用数据模型估值的证券价格；监察稽核部负责与监管机构的沟通、协调以及检查公允价值估值业务的合法、合规性。

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，在符合有关基金分红的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 4 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 25%。

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，本基金本报告期未满足收益分配条件，因此未进行收益分配。

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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—摩根士丹利华鑫基金管理有限公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，摩根士丹利华鑫基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，摩根士丹利华鑫基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 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(2017)第 20313 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	摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
引言段	我们审计了后附的摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资基金(以下简称“摩根士丹利华鑫量化配置基金”)的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所

	所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	<p>编制和公允列报财务报表是摩根士丹利华鑫量化配置基金的基金管理人摩根士丹利华鑫基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：</p> <p>(1) 按照企业会计准则和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财务报表，并使其实现公允反映；</p> <p>(2) 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>
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。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。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，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。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>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>
审计意见段	我们认为，上述摩根士丹利华鑫量化配置基金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，公允反映了摩根士丹利华鑫量化配置基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	单峰 俞伟敏
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)
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 号楼普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2017 年 3 月 15 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	173,741,724.21	421,453,674.66
结算备付金		4,193,696.39	13,392,952.67
存出保证金		453,282.40	2,669,604.85
交易性金融资产	7.4.7.2	1,707,656,373.31	2,781,333,096.56
其中：股票投资		1,707,656,373.31	2,781,333,096.56
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		69,127.28	-
应收利息	7.4.7.5	41,085.28	114,258.21
应收股利		-	104.25
应收申购款		329,333.10	6,830,842.23
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,886,484,621.97	3,225,794,533.43
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负债：			
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		-	45.74
应付赎回款		2,731,935.39	187,454,316.45
应付管理人报酬		2,546,023.57	3,953,011.00
应付托管费		424,337.27	658,835.20
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	804,513.13	3,953,708.54
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	139,853.70	830,061.93
负债合计		6,646,663.06	196,849,978.86
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	931,831,313.74	1,398,653,196.48

未分配利润	7.4.7.10	948,006,645.17	1,630,291,358.09
所有者权益合计		1,879,837,958.91	3,028,944,554.57
负债和所有者权益总计		1,886,484,621.97	3,225,794,533.43

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.017 元，基金份额总额 931,831,313.74 份。

7.2 利润表

会计主体：摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		-205,073,309.40	848,419,620.92
1. 利息收入		2,688,945.88	5,932,627.96
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,520,508.37	2,694,444.02
债券利息收入		-	2,702,941.56
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		168,437.51	535,242.38
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-51,747,492.96	772,045,962.39
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-86,789,718.56	724,678,929.23
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-150,324.00
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.3	-	-
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	35,042,225.60	47,517,357.16
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-157,272,441.22	60,939,374.67
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	1,257,678.90	9,501,655.90
减：二、费用		56,912,417.09	106,368,945.65
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	34,628,566.17	44,776,679.90
2. 托管费	7.4.10.2.2	5,771,427.74	7,462,780.02
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	16,040,126.09	53,754,479.44
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	472,297.09	375,006.29
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-261,985,726.49	742,050,675.27
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-261,985,726.49	742,050,675.27
-------------------	--	-----------------	----------------

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	1,398,653,196.48	1,630,291,358.09	3,028,944,554.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-261,985,726.49	-261,985,726.49
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-466,821,882.74	-420,298,986.43	-887,120,869.17
其中：1. 基金申购款	213,726,660.80	207,402,553.45	421,129,214.25
2. 基金赎回款	-680,548,543.54	-627,701,539.88	-1,308,250,083.42
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）	931,831,313.74	948,006,645.17	1,879,837,958.91
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	884,096,741.39	550,549,791.04	1,434,646,532.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	742,050,675.27	742,050,675.27
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）	514,556,455.09	337,690,891.78	852,247,346.87

工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。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 60%—95%,除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 5%—40%,其中权证资产占基金资产净值的比例范围为 0—3%,保持现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。自基金合同生效日至 2015 年 9 月 28 日止期间,本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 \times 80%+中信标普全债指数收益率 \times 20%。根据本基金的基金管理人于 2015 年 9 月 29 日发布的《摩根士丹利华鑫基金管理有限公司关于部分开放式基金变更业绩比较基准的公告》,自 2015 年 9 月 29 日期,本基金的业绩比较基准变更为:沪深 300 指数收益率 \times 80%+标普中国债券指数收益率 \times 20%。

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 2017 年 3 月 15 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》、《摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资基金 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度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。

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(主要为股指期货)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(主要为股指期货)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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

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，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[2008]38号《关于进一步规范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)对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3)在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4)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)，按照中证指数有限公司根据《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》所独立提供的债券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[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规

和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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	
	2016 年 12 月 31 日	
	上年度末	
	2015 年 12 月 31 日	
活期存款	173,741,724.21	421,453,674.66
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计	173,741,724.21	421,453,674.66

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,701,589,823.42	1,707,656,373.31	6,066,549.89

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,701,589,823.42	1,707,656,373.31	6,066,549.89
项目	上年度末 2015年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,617,994,105.45	2,781,333,096.56	163,338,991.11
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,617,994,105.45	2,781,333,096.56	163,338,991.11

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度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

本基金本报告期末及上年度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

本基金本报告期末及上年度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 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应收活期存款利息	38,784.93	99,707.41
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	2,075.92	6,629.48

应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	0.03	6,599.89
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	224.40	1,321.43
合计	41,085.28	114,258.21

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	804,513.13	3,953,239.14
银行间市场应付交易费用	-	469.40
合计	804,513.13	3,953,708.54

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	6,353.70	705,561.93
预提费用	133,500.00	124,500.00
合计	139,853.70	830,061.93

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	1,398,653,196.48	1,398,653,196.48
本期申购	213,726,660.80	213,726,660.80
本期赎回(以“-”号填列)	-680,548,543.54	-680,548,543.54
本期末	931,831,313.74	931,831,313.74

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

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
上年度末	1,033,535,790.20	596,755,567.89	1,630,291,358.09
本期利润	-104,713,285.27	-157,272,441.22	-261,985,726.49
本期基金份额交易产生的变动数	-288,342,339.97	-131,956,646.46	-420,298,986.43
其中：基金申购款	145,090,011.06	62,312,542.39	207,402,553.45
基金赎回款	-433,432,351.03	-194,269,188.85	-627,701,539.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	640,480,164.96	307,526,480.21	948,006,645.17

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31日
活期存款利息收入	2,422,846.97	2,328,139.19
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	82,964.11	287,227.48
其他	14,697.29	79,077.35
合计	2,520,508.37	2,694,444.02

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015 年12月31日
卖出股票成交总额	6,028,469,256.05	17,446,844,266.64
减：卖出股票成本总额	6,115,258,974.61	16,722,165,337.41
买卖股票差价收入	-86,789,718.56	724,678,929.23

7.4.7.13 债券投资收益**7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31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	-	-150,324.00
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	-	-150,324.00

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	-	160,363,377.60
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	-	154,158,324.00
减：应收利息总额	-	6,355,377.60
买卖债券差价收入	-	-150,324.00

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
股票投资产生的股利收益	35,042,225.60	47,517,357.16
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	35,042,225.60	47,517,357.16

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
1. 交易性金融资产	-157,272,441.22	60,939,374.67
——股票投资	-157,272,441.22	60,942,908.27
——债券投资	-	-3,533.60
——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	-157,272,441.22	60,939,374.67

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31 日
基金赎回费收入	1,209,209.92	8,927,938.63
基金转换费收入	21,339.74	573,717.27
其他	27,129.24	-
合计	1,257,678.90	9,501,655.90

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的赎回费两部分构成，其中不低于赎回费 25% 的部分归入转出基金的基金资产。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
交易所市场交易费用	16,040,126.09	53,754,479.44
银行间市场交易费用	-	-
合计	16,040,126.09	53,754,479.44

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12 月31日
审计费用	120,000.00	120,000.00
信息披露费	300,000.00	200,000.00
银行费用	13,897.09	36,406.29
债券账户维护费	37,500.00	18,000.00
其他	900.00	600.00
合计	472,297.09	375,006.29

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

财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布《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[2016]140号），要求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，自2016年5月1日起执行。

根据财政部、国家税务总局于2017年1月6日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》（财税[2017]2号），2017年7月1日(含)以后，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，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在2017年7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。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。截至本财务报表批准报出日止，上述税收政策对本基金截至2016年12月31日止期间的财务状况和经营成果无影响。

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
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	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
汉唐证券有限责任公司	基金管理人的股东

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。

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 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
华鑫证券	1,208,047,620.99	10.77%	16,500,463,123.20	46.44%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间无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 2016年1月1日至2016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	1,125,055.89	11.54%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	15,059,307.23	46.34%	120,046.18	3.04%

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。

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	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	34,628,566.17	44,776,679.90
其中：支付销售机构的客户维护费	14,537,448.84	19,682,432.92

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	5,771,427.74	7,462,780.02

注：支付基金托管人中国农业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。

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

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

本基金本报告期及上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	173,741,724.21	2,422,846.97	421,453,674.66	2,328,139.19

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期无利润分配事项。

7.4.12 期末（2016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

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
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：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601375	中原证券	2016年12月20日	2017年1月3日	新股流通受限	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603228	景旺电子	2016年12月28日	2017年1月6日	新股流通受限	23.16	23.16	3,491	80,851.56	80,851.56	-
603877	太平鸟	2016年12月29日	2017年1月9日	新股流通受限	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
300583	赛托生物	2016年12月29日	2017年1月6日	新股流通受限	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
603689	皖天然气	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	7.87	7.87	4,819	37,925.53	37,925.53	-
603266	天龙股份	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-

300587	天铁股份	2016年12月28日	2017年1月5日	新股流通受限	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-
002840	华统股份	2016年12月29日	2017年1月10日	新股流通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016年12月28日	2017年1月6日	新股流通受限	15.28	15.28	682	10,420.96	10,420.96	-
603186	华正新材	2016年12月26日	2017年1月3日	新股流通受限	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
300586	美联新材	2016年12月26日	2017年1月4日	新股流通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-
300588	熙菱信息	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

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
000540	中天城投	2016年11月28日	重大资产重组	6.93	2017年1月3日	7.00	1,276,500	10,186,096.14	8,846,145.00	-
600551	时代出版	2016年11月28日	重大资产重组	20.32	-	-	304,900	6,328,956.82	6,195,568.00	-
600687	刚泰控股	2016年7月25日	重大资产重组	16.42	2017年1月18日	16.38	285,900	5,470,525.44	4,694,478.00	-
603111	康尼机电	2016年12月26日	重大事项	14.70	-	-	312,200	3,648,013.63	4,589,340.00	-

000693	ST 华泽	2016 年 3 月 1 日	重大事 项	12.50	-	-	341,000	5,322,285.86	4,262,500.00	-
300123	太阳鸟	2016 年 9 月 28 日	重大资 产重组	15.08	2017 年 2 月 15 日	16.59	251,600	3,772,227.00	3,794,128.00	-
300271	华宇软 件	2016 年 12 月 19 日	重大资 产重组	17.45	-	-	181,800	3,463,807.88	3,172,410.00	-
600655	豫园商 城	2016 年 12 月 20 日	重大事 项	11.42	-	-	265,162	3,900,367.03	3,028,150.04	-
600763	通策医 疗	2016 年 12 月 19 日	重大事 项	33.54	2017 年 1 月 3 日	34.80	86,000	2,965,428.51	2,884,440.00	-
600485	信威集 团	2016 年 12 月 26 日	重大事 项	14.60	-	-	188,400	3,377,594.63	2,750,640.00	-
002635	安洁科 技	2016 年 11 月 8 日	重大资 产重组	36.40	2017 年 2 月 8 日	33.50	67,500	2,170,247.00	2,457,000.00	-
002491	通鼎互 联	2016 年 12 月 22 日	重大事 项	15.54	2017 年 1 月 3 日	15.89	149,300	2,460,870.00	2,320,122.00	-
002025	航天电 器	2016 年 9 月 12 日	重大资 产重组	25.20	-	-	84,800	2,085,592.00	2,136,960.00	-
000887	中鼎股 份	2016 年 11 月 18 日	重大资 产重组	25.94	2017 年 2 月 15 日	23.99	67,500	1,610,637.00	1,750,950.00	-
002400	省广股 份	2016 年 11 月 28 日	重大事 项	13.79	-	-	90,360	1,472,790.51	1,246,064.40	-
002440	闰土股 份	2016 年 10 月 24 日	重大资 产重组	16.34	2017 年 1 月 12 日	15.22	72,300	1,165,722.00	1,181,382.00	-

注：本基金截至 2016 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

本基金为进行主动投资的混合型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，通过数量化模型，优化资产配置权重，力争在降低组合风险的同时，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“谋求超过业绩比较基准的投资业绩”的风险收益目标。

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

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

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中国农业银行，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；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有债券投资 (2015 年 12 月 31 日：同)。

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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

除应交税费无固定到期日外，于 2016 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。

7.4.13.4 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、存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	173,741,724.21	-	-	-	173,741,724.21
结算备付金	4,193,696.39	-	-	-	4,193,696.39
存出保证金	453,282.40	-	-	-	453,282.40
交易性金融资产	-	-	-	1,707,656,373.31	1,707,656,373.31
应收证券清算款	-	-	-	69,127.28	69,127.28
应收利息	-	-	-	41,085.28	41,085.28
应收申购款	-	-	-	329,333.10	329,333.10
资产总计	178,388,703.00	-	-	1,708,095,918.97	1,886,484,621.97
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,731,935.39	2,731,935.39
应付管理人报酬	-	-	-	2,546,023.57	2,546,023.57
应付托管费	-	-	-	424,337.27	424,337.27
应付交易费用	-	-	-	804,513.13	804,513.13
其他负债	-	-	-	139,853.70	139,853.70
负债总计	-	-	-	6,646,663.06	6,646,663.06
利率敏感度缺口	178,388,703.00	-	-	-1,701,449,255.91	1,879,837,958.91
上年度末 2015年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	421,453,674.66	-	-	-	421,453,674.66
结算备付金	13,392,952.67	-	-	-	13,392,952.67
存出保证金	2,669,604.85	-	-	-	2,669,604.85
交易性金融资产	-	-	-	-2,781,333,096.56	2,781,333,096.56

应收利息	-	-	-	114,258.21	114,258.21
应收股利	-	-	-	104.25	104.25
应收申购款	-	-	-	6,830,842.23	6,830,842.23
资产总计	437,516,232.18	-	-	2,788,278,301.25	3,225,794,533.43
负债					
应付证券清算款	-	-	-	45.74	45.74
应付赎回款	-	-	-	187,454,316.45	187,454,316.45
应付管理人报酬	-	-	-	3,953,011.00	3,953,011.00
应付托管费	-	-	-	658,835.20	658,835.20
应付交易费用	-	-	-	3,953,708.54	3,953,708.54
其他负债	-	-	-	830,061.93	830,061.93
负债总计	-	-	-	196,849,978.86	196,849,978.86
利率敏感度缺口	437,516,232.18	-	-	2,591,428,322.39	3,028,944,554.57

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 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2015 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2015 年 12 月 31 日：同)。

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

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

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 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	1,707,656,373.31	90.84	2,781,333,096.56	91.83
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,707,656,373.31	90.84	2,781,333,096.56	91.83

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(2016年12月31日)	上年度末(2015年12月31日)
	业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	102,850,000.00	162,910,000.00
业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-102,850,000.00	-162,910,000.00	

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 2016 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 1,651,890,025.93 元, 属于第二层次的余额为 55,766,347.38 元, 无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日: 第一层次 2,718,389,952.03 元, 第二层次 62,943,144.53 元, 无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 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(2015 年 12 月 31 日: 同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外, 截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	1,707,656,373.31	90.52
	其中: 股票	1,707,656,373.31	90.52
2	固定收益投资	-	-
	其中: 债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-

5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	177,935,420.60	9.43
7	其他各项资产	892,828.06	0.05
8	合计	1,886,484,621.97	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	1,434,331.93	0.08
B	采矿业	47,552,368.67	2.53
C	制造业	585,973,934.79	31.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	74,614,135.04	3.97
E	建筑业	60,237,198.48	3.20
F	批发和零售业	43,299,757.60	2.30
G	交通运输、仓储和邮政业	64,214,197.55	3.42
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	67,279,925.72	3.58
J	金融业	572,461,180.58	30.45
K	房地产业	96,508,346.87	5.13
L	租赁和商务服务业	12,669,365.32	0.67
M	科学研究和技术服务业	12,074,055.83	0.64
N	水利、环境和公共设施管理业	14,070,006.50	0.75
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	10,469,055.40	0.56
R	文化、体育和娱乐业	44,798,513.03	2.38
S	综合	-	-
	合计	1,707,656,373.31	90.84

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	601166	兴业银行	7,412,526	119,638,169.64	6.36
2	601398	工商银行	19,444,200	85,748,922.00	4.56
3	000776	广发证券	4,138,231	69,770,574.66	3.71
4	600030	中信证券	3,587,100	57,608,826.00	3.06
5	601211	国泰君安	3,094,100	57,519,319.00	3.06
6	600036	招商银行	2,980,800	52,462,080.00	2.79
7	601628	中国人寿	1,364,301	32,866,011.09	1.75
8	601318	中国平安	865,492	30,664,381.56	1.63
9	601336	新华保险	697,310	30,528,231.80	1.62
10	601601	中国太保	1,006,593	27,953,087.61	1.49
11	002304	洋河股份	202,624	14,305,254.40	0.76
12	000858	五粮液	395,159	13,625,082.32	0.72
13	000651	格力电器	539,790	13,289,629.80	0.71
14	603369	今世缘	972,939	12,764,959.68	0.68
15	601633	长城汽车	1,017,939	11,258,405.34	0.60
16	600795	国电电力	3,533,800	11,202,146.00	0.60
17	600023	浙能电力	1,988,200	10,795,926.00	0.57
18	601186	中国铁建	898,497	10,746,024.12	0.57
19	600104	上汽集团	451,340	10,583,923.00	0.56
20	000719	大地传媒	917,200	10,556,972.00	0.56
21	600011	华能国际	1,496,055	10,547,187.75	0.56
22	000600	建投能源	1,160,042	10,301,172.96	0.55
23	000625	长安汽车	686,367	10,254,322.98	0.55
24	000333	美的集团	363,300	10,234,161.00	0.54
25	600197	伊力特	703,100	10,187,919.00	0.54
26	601669	中国电建	1,396,700	10,140,042.00	0.54
27	600300	维维股份	1,517,200	10,134,896.00	0.54
28	000623	吉林敖东	314,018	9,731,417.82	0.52
29	000921	海信科龙	888,600	9,072,606.00	0.48
30	000540	中天城投	1,276,500	8,846,145.00	0.47
31	600724	宁波富达	1,449,600	8,625,120.00	0.46
32	600048	保利地产	918,000	8,381,340.00	0.45
33	601668	中国建筑	936,000	8,292,960.00	0.44
34	600886	国投电力	1,242,600	8,288,142.00	0.44
35	600887	伊利股份	469,000	8,254,400.00	0.44
36	600606	绿地控股	928,197	8,084,595.87	0.43
37	000418	小天鹅A	249,300	8,057,376.00	0.43

38	600674	川投能源	924,600	8,044,020.00	0.43
39	600690	青岛海尔	810,800	8,010,704.00	0.43
40	600066	宇通客车	406,500	7,963,335.00	0.42
41	600068	葛洲坝	865,300	7,952,107.00	0.42
42	600170	上海建工	1,678,700	7,940,251.00	0.42
43	002146	荣盛发展	999,500	7,846,075.00	0.42
44	600823	世茂股份	1,111,400	7,802,028.00	0.42
45	600757	长江传媒	938,113	7,795,719.03	0.41
46	000966	长源电力	1,287,000	7,773,480.00	0.41
47	000999	华润三九	313,100	7,742,963.00	0.41
48	600491	龙元建设	665,300	7,677,562.00	0.41
49	601098	中南传媒	452,400	7,536,984.00	0.40
50	300315	掌趣科技	772,399	7,136,966.76	0.38
51	600340	华夏幸福	298,600	7,136,540.00	0.38
52	600019	宝钢股份	1,121,600	7,122,160.00	0.38
53	600703	三安光电	527,500	7,063,225.00	0.38
54	002217	合力泰	388,200	6,948,780.00	0.37
55	600507	方大特钢	992,700	6,720,579.00	0.36
56	002244	滨江集团	948,100	6,617,738.00	0.35
57	002515	金字火腿	384,200	6,615,924.00	0.35
58	000708	大冶特钢	516,725	6,583,076.50	0.35
59	600115	东方航空	914,753	6,467,303.71	0.34
60	000793	华闻传媒	570,000	6,435,300.00	0.34
61	000926	福星股份	503,100	6,409,494.00	0.34
62	000069	华侨城A	921,100	6,401,645.00	0.34
63	000537	广宇发展	693,700	6,298,796.00	0.34
64	300500	苏州设计	68,300	6,233,741.00	0.33
65	600551	时代出版	304,900	6,195,568.00	0.33
66	000895	双汇发展	294,100	6,155,513.00	0.33
67	300043	星辉娱乐	601,128	6,095,437.92	0.32
68	000423	东阿阿胶	112,400	6,054,988.00	0.32
69	000732	泰禾集团	339,100	5,998,679.00	0.32
70	000650	仁和药业	846,600	5,968,530.00	0.32
71	300146	汤臣倍健	498,500	5,952,090.00	0.32
72	600261	阳光照明	821,100	5,928,342.00	0.32
73	600684	珠江实业	752,300	5,913,078.00	0.31
74	300231	银信科技	317,500	5,876,925.00	0.31
75	600221	海南航空	1,796,000	5,854,960.00	0.31
76	600029	南方航空	809,737	5,684,353.74	0.30

77	600373	中文传媒	277,100	5,597,420.00	0.30
78	601111	中国国航	775,600	5,584,320.00	0.30
79	000997	新大陆	269,200	5,230,556.00	0.28
80	600038	中直股份	107,560	5,208,055.20	0.28
81	002555	三七互娱	306,300	5,023,320.00	0.27
82	002415	海康威视	210,396	5,009,528.76	0.27
83	601766	中国中车	506,900	4,952,413.00	0.26
84	601899	紫金矿业	1,482,400	4,951,216.00	0.26
85	002236	大华股份	355,000	4,856,400.00	0.26
86	600688	上海石化	739,100	4,759,804.00	0.25
87	601333	广深铁路	936,100	4,746,027.00	0.25
88	000825	太钢不锈	1,192,800	4,699,632.00	0.25
89	600687	刚泰控股	285,900	4,694,478.00	0.25
90	600196	复星医药	201,485	4,662,362.90	0.25
91	600759	洲际油气	473,800	4,652,716.00	0.25
92	600050	中国联通	636,382	4,651,952.42	0.25
93	600363	联创光电	279,100	4,605,150.00	0.24
94	600262	北方股份	152,400	4,597,908.00	0.24
95	002449	国星光电	345,700	4,590,896.00	0.24
96	603111	康尼机电	312,200	4,589,340.00	0.24
97	000661	长春高新	40,796	4,563,032.60	0.24
98	601890	亚星锚链	517,876	4,552,130.04	0.24
99	002152	广电运通	341,900	4,540,432.00	0.24
100	300204	舒泰神	251,771	4,463,899.83	0.24
101	000059	华锦股份	372,000	4,426,800.00	0.24
102	300351	永贵电器	170,734	4,382,741.78	0.23
103	300008	天海防务	178,747	4,359,639.33	0.23
104	600988	赤峰黄金	281,400	4,339,188.00	0.23
105	002128	露天煤业	502,300	4,319,780.00	0.23
106	601857	中国石油	537,913	4,276,408.35	0.23
107	000693	ST华泽	341,000	4,262,500.00	0.23
108	601088	中国神华	259,755	4,202,835.90	0.22
109	601006	大秦铁路	591,585	4,188,421.80	0.22
110	600125	铁龙物流	517,000	4,177,360.00	0.22
111	002190	成飞集成	126,000	4,029,480.00	0.21
112	600816	安信信托	169,681	4,007,865.22	0.21
113	601989	中国重工	549,800	3,898,082.00	0.21
114	300123	太阳鸟	251,600	3,794,128.00	0.20
115	002013	中航机电	206,500	3,776,885.00	0.20

116	000993	闽东电力	265,400	3,771,334.00	0.20
117	600997	开滦股份	516,000	3,689,400.00	0.20
118	002376	新北洋	289,500	3,589,800.00	0.19
119	600705	中航资本	586,100	3,586,932.00	0.19
120	600028	中国石化	661,800	3,580,338.00	0.19
121	002195	二三四五	309,400	3,502,408.00	0.19
122	300182	捷成股份	331,422	3,416,960.82	0.18
123	600372	中航电子	183,000	3,396,480.00	0.18
124	600271	航天信息	169,200	3,375,540.00	0.18
125	000889	茂业通信	216,500	3,305,955.00	0.18
126	600487	亨通光电	175,300	3,271,098.00	0.17
127	600850	华东电脑	134,410	3,250,033.80	0.17
128	000063	中兴通讯	200,981	3,205,646.95	0.17
129	002501	利源精制	259,400	3,182,838.00	0.17
130	300271	华宇软件	181,800	3,172,410.00	0.17
131	600522	中天科技	297,600	3,133,728.00	0.17
132	002221	东华能源	252,900	3,133,431.00	0.17
133	600655	豫园商城	265,162	3,028,150.04	0.16
134	002038	双鹭药业	112,900	3,015,559.00	0.16
135	002649	博彦科技	77,400	3,010,860.00	0.16
136	600971	恒源煤电	478,300	2,998,941.00	0.16
137	002203	海亮股份	368,900	2,973,334.00	0.16
138	600704	物产中大	287,330	2,968,118.90	0.16
139	000666	经纬纺机	138,600	2,961,882.00	0.16
140	600060	海信电器	172,700	2,956,624.00	0.16
141	300118	东方日升	178,900	2,939,327.00	0.16
142	600122	宏图高科	240,200	2,935,244.00	0.16
143	002540	亚太科技	370,500	2,908,425.00	0.15
144	600498	烽火通信	115,100	2,901,671.00	0.15
145	600763	通策医疗	86,000	2,884,440.00	0.15
146	002202	金风科技	168,500	2,883,035.00	0.15
147	000150	宜华健康	92,400	2,852,388.00	0.15
148	002429	兆驰股份	285,500	2,843,580.00	0.15
149	600811	东方集团	392,419	2,805,795.85	0.15
150	002467	二六三	265,900	2,797,268.00	0.15
151	002065	东华软件	119,700	2,789,010.00	0.15
152	601677	明泰铝业	188,209	2,785,493.20	0.15
153	601012	隆基股份	206,800	2,769,052.00	0.15
154	600485	信威集团	188,400	2,750,640.00	0.15

155	603993	洛阳钼业	735,000	2,734,200.00	0.15
156	603806	福斯特	58,422	2,703,185.94	0.14
157	601117	中国化学	398,300	2,696,491.00	0.14
158	000022	深赤湾 A	140,200	2,668,006.00	0.14
159	002410	广联达	182,700	2,667,420.00	0.14
160	000963	华东医药	36,445	2,626,591.15	0.14
161	300015	爱尔眼科	87,526	2,617,027.40	0.14
162	002294	信立泰	89,080	2,604,699.20	0.14
163	002019	亿帆医药	169,200	2,587,068.00	0.14
164	601992	金隅股份	577,400	2,575,204.00	0.14
165	600511	国药股份	85,400	2,570,540.00	0.14
166	000810	创维数字	182,600	2,569,182.00	0.14
167	601607	上海医药	130,800	2,558,448.00	0.14
168	600062	华润双鹤	114,991	2,556,249.93	0.14
169	002716	金贵银业	109,800	2,540,772.00	0.14
170	300170	汉得信息	215,100	2,540,331.00	0.14
171	002416	爱施德	171,800	2,530,614.00	0.13
172	600143	金发科技	322,243	2,507,050.54	0.13
173	600585	海螺水泥	146,220	2,479,891.20	0.13
174	600056	中国医药	130,000	2,473,900.00	0.13
175	002519	银河电子	109,800	2,459,520.00	0.13
176	002635	安洁科技	67,500	2,457,000.00	0.13
177	600026	中海发展	360,300	2,453,643.00	0.13
178	002460	赣锋锂业	92,500	2,452,175.00	0.13
179	300287	飞利信	205,800	2,449,020.00	0.13
180	002179	中航光电	66,600	2,416,914.00	0.13
181	603167	渤海轮渡	222,550	2,414,667.50	0.13
182	002001	新和成	123,100	2,412,760.00	0.13
183	000826	启迪桑德	73,100	2,410,838.00	0.13
184	600970	中材国际	338,100	2,397,129.00	0.13
185	002466	天齐锂业	73,720	2,392,214.00	0.13
186	600717	天津港	236,470	2,383,617.60	0.13
187	601000	唐山港	593,800	2,381,138.00	0.13
188	600845	宝信软件	134,400	2,370,816.00	0.13
189	600323	瀚蓝环境	164,705	2,365,163.80	0.13
190	000789	万年青	293,700	2,358,411.00	0.13
191	600338	西藏珠峰	80,300	2,327,094.00	0.12
192	300115	长盈精密	89,200	2,324,552.00	0.12
193	002491	通鼎互联	149,300	2,320,122.00	0.12

194	002099	海翔药业	270,100	2,290,448.00	0.12
195	601872	招商轮船	461,400	2,279,316.00	0.12
196	600051	宁波联合	173,700	2,270,259.00	0.12
197	600525	长园集团	162,700	2,269,665.00	0.12
198	600660	福耀玻璃	121,200	2,257,956.00	0.12
199	300017	网宿科技	42,000	2,251,620.00	0.12
200	600884	杉杉股份	159,500	2,245,760.00	0.12
201	600064	南京高科	131,500	2,202,625.00	0.12
202	002002	鸿达兴业	299,200	2,196,128.00	0.12
203	600177	雅戈尔	155,800	2,178,084.00	0.12
204	600663	陆家嘴	98,100	2,170,953.00	0.12
205	002324	普利特	72,699	2,170,792.14	0.12
206	002025	航天电器	84,800	2,136,960.00	0.11
207	600398	海澜之家	197,161	2,127,367.19	0.11
208	600742	一汽富维	131,560	2,122,062.80	0.11
209	300244	迪安诊断	66,100	2,115,200.00	0.11
210	600741	华域汽车	132,527	2,113,805.65	0.11
211	000338	潍柴动力	209,500	2,086,620.00	0.11
212	002028	思源电气	158,200	2,085,076.00	0.11
213	600720	祁连山	253,800	2,073,546.00	0.11
214	002573	清新环境	114,700	2,003,809.00	0.11
215	600639	浦东金桥	107,600	1,997,056.00	0.11
216	002437	誉衡药业	238,300	1,970,741.00	0.10
217	002320	海峡股份	125,900	1,965,299.00	0.10
218	002554	惠博普	239,166	1,953,986.22	0.10
219	000581	威孚高科	84,882	1,904,752.08	0.10
220	600018	上港集团	371,700	1,903,104.00	0.10
221	600153	建发股份	174,310	1,865,117.00	0.10
222	600824	益民集团	256,500	1,857,060.00	0.10
223	600270	外运发展	111,700	1,847,518.00	0.10
224	002056	横店东磁	132,000	1,836,120.00	0.10
225	002241	歌尔股份	68,800	1,824,576.00	0.10
226	600216	浙江医药	142,900	1,811,972.00	0.10
227	600790	轻纺城	249,555	1,796,796.00	0.10
228	300262	巴安水务	105,600	1,795,200.00	0.10
229	002008	大族激光	78,700	1,778,620.00	0.09
230	601231	环旭电子	165,300	1,770,363.00	0.09
231	002108	沧州明珠	86,700	1,766,079.00	0.09
232	600119	长江投资	88,500	1,762,035.00	0.09

233	000876	新希望	218,524	1,759,118.20	0.09
234	600648	外高桥	88,800	1,752,912.00	0.09
235	000887	中鼎股份	67,500	1,750,950.00	0.09
236	601566	九牧王	98,700	1,746,003.00	0.09
237	600761	安徽合力	132,300	1,682,856.00	0.09
238	300360	炬华科技	87,200	1,677,728.00	0.09
239	002126	银轮股份	172,400	1,670,556.00	0.09
240	002327	富安娜	185,400	1,631,520.00	0.09
241	000541	佛山照明	164,200	1,615,728.00	0.09
242	002563	森马服饰	156,900	1,611,363.00	0.09
243	600415	小商品城	185,000	1,600,250.00	0.09
244	002157	正邦科技	236,482	1,574,970.12	0.08
245	002344	海宁皮城	139,102	1,574,634.64	0.08
246	603979	金诚信	86,800	1,547,644.00	0.08
247	002048	宁波华翔	69,300	1,534,302.00	0.08
248	600835	上海机电	78,380	1,529,977.60	0.08
249	600894	广日股份	110,200	1,506,434.00	0.08
250	601038	一拖股份	132,700	1,499,510.00	0.08
251	600093	禾嘉股份	102,700	1,489,150.00	0.08
252	002738	中矿资源	56,150	1,480,675.50	0.08
253	002124	天邦股份	121,160	1,469,670.80	0.08
254	601313	江南嘉捷	121,500	1,436,130.00	0.08
255	600843	上工申贝	75,700	1,424,674.00	0.08
256	600009	上海机场	53,400	1,416,168.00	0.08
257	002367	康力电梯	106,400	1,405,544.00	0.07
258	600897	厦门空港	61,800	1,397,298.00	0.07
259	600583	海油工程	185,000	1,365,300.00	0.07
260	002311	海大集团	90,300	1,359,015.00	0.07
261	002074	国轩高科	43,100	1,335,669.00	0.07
262	600004	白云机场	94,680	1,334,041.20	0.07
263	600499	科达洁能	173,500	1,311,660.00	0.07
264	000089	深圳机场	163,200	1,305,600.00	0.07
265	603611	诺力股份	34,100	1,301,938.00	0.07
266	601222	林洋能源	160,900	1,298,463.00	0.07
267	600074	保千里	97,600	1,292,224.00	0.07
268	002400	省广股份	90,360	1,246,064.40	0.07
269	603686	龙马环卫	37,100	1,228,752.00	0.07
270	600739	辽宁成大	68,200	1,224,872.00	0.07
271	000501	鄂武商 A	61,977	1,209,791.04	0.06

272	600755	厦门国贸	147,400	1,208,680.00	0.06
273	600388	龙净环保	97,200	1,202,364.00	0.06
274	600426	华鲁恒升	89,290	1,183,092.50	0.06
275	002440	闰土股份	72,300	1,181,382.00	0.06
276	600729	重庆百货	48,700	1,141,041.00	0.06
277	002033	丽江旅游	77,250	1,112,400.00	0.06
278	600089	特变电工	121,300	1,107,469.00	0.06
279	000151	中成股份	56,500	1,106,835.00	0.06
280	002470	金正大	138,600	1,094,940.00	0.06
281	600138	中青旅	52,000	1,090,440.00	0.06
282	002091	江苏国泰	82,200	1,089,972.00	0.06
283	600694	大商股份	27,200	1,086,096.00	0.06
284	601888	中国国旅	24,809	1,076,710.60	0.06
285	600309	万华化学	49,330	1,062,074.90	0.06
286	600352	浙江龙盛	112,300	1,034,283.00	0.06
287	600885	宏发股份	32,300	1,031,985.00	0.05
288	002588	史丹利	90,500	1,027,175.00	0.05
289	600118	中国卫星	32,700	1,021,548.00	0.05
290	300058	蓝色光标	99,900	1,015,983.00	0.05
291	601877	正泰电器	50,409	1,008,180.00	0.05
292	603188	亚邦股份	56,201	1,003,749.86	0.05
293	600312	平高电气	64,100	1,001,242.00	0.05
294	600879	航天电子	65,400	996,696.00	0.05
295	002027	分众传媒	69,484	991,536.68	0.05
296	000902	新洋丰	85,800	966,108.00	0.05
297	002131	利欧股份	60,200	960,190.00	0.05
298	600176	中国巨石	96,860	953,102.40	0.05
299	002223	鱼跃医疗	30,500	946,110.00	0.05
300	002300	太阳电缆	97,500	930,150.00	0.05
301	600529	山东药玻	41,400	880,164.00	0.05
302	002081	金螳螂	88,784	869,195.36	0.05
303	600697	欧亚集团	26,700	855,201.00	0.05
304	601179	中国西电	151,500	845,370.00	0.04
305	600409	三友化工	89,562	840,987.18	0.04
306	300101	振芯科技	45,300	839,862.00	0.04
307	600054	黄山旅游	50,150	804,907.50	0.04
308	000796	凯撒旅游	52,000	787,800.00	0.04
309	002597	金禾实业	50,100	783,063.00	0.04
310	600273	嘉化能源	80,700	775,527.00	0.04

311	000430	张家界	63,100	770,451.00	0.04
312	601886	江河集团	71,400	760,410.00	0.04
313	600315	上海家化	27,700	750,947.00	0.04
314	300196	长海股份	19,800	744,876.00	0.04
315	002220	天宝股份	54,100	729,809.00	0.04
316	002004	华邦健康	80,400	729,228.00	0.04
317	002482	广田集团	78,000	721,500.00	0.04
318	300474	景嘉微	13,000	700,310.00	0.04
319	601965	中国汽研	65,500	697,575.00	0.04
320	300144	宋城演艺	32,500	680,550.00	0.04
321	600297	广汇汽车	77,650	664,684.00	0.04
322	600298	安琪酵母	37,000	659,340.00	0.04
323	601216	君正集团	139,800	650,070.00	0.03
324	002504	弘高创意	81,600	645,456.00	0.03
325	002510	天汽模	92,400	642,180.00	0.03
326	600335	国机汽车	51,400	624,510.00	0.03
327	300138	晨光生物	34,100	621,643.00	0.03
328	002092	中泰化学	49,500	598,950.00	0.03
329	002595	豪迈科技	28,100	591,505.00	0.03
330	002487	大金重工	64,700	584,241.00	0.03
331	300298	三诺生物	32,100	582,294.00	0.03
332	002532	新界泵业	38,300	578,330.00	0.03
333	002185	华天科技	47,630	575,370.40	0.03
334	000685	中山公用	51,300	570,969.00	0.03
335	000888	峨眉山A	47,400	565,956.00	0.03
336	300183	东软载波	22,563	557,757.36	0.03
337	000811	烟台冰轮	36,900	553,131.00	0.03
338	002041	登海种业	29,179	550,899.52	0.03
339	300373	扬杰科技	27,500	541,200.00	0.03
340	600075	新疆天业	43,500	541,140.00	0.03
341	000598	兴蓉环境	92,800	534,528.00	0.03
342	002150	通润装备	31,800	526,290.00	0.03
343	002444	巨星科技	32,800	511,680.00	0.03
344	002604	龙力生物	42,000	477,540.00	0.03
345	002426	胜利精密	57,550	475,938.50	0.03
346	002772	众兴菌业	21,513	442,522.41	0.02
347	600371	万向德农	27,000	440,910.00	0.02
348	603969	银龙股份	31,100	433,534.00	0.02
349	600172	黄河旋风	23,400	418,392.00	0.02

350	603528	多伦科技	6,300	411,705.00	0.02
351	300145	中金环境	15,600	407,160.00	0.02
352	002158	汉钟精机	37,800	388,962.00	0.02
353	601199	江南水务	49,500	382,140.00	0.02
354	300443	金雷风电	6,300	357,714.00	0.02
355	002270	华明装备	24,300	348,462.00	0.02
356	600996	贵广网络	12,500	234,875.00	0.01
357	603708	家家悦	5,874	185,794.62	0.01
358	002831	裕同科技	2,219	153,554.80	0.01
359	603823	百合花	3,762	123,167.88	0.01
360	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.01
361	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.00
362	603228	景旺电子	3,491	80,851.56	0.00
363	300556	丝路视觉	1,226	76,453.36	0.00
364	603928	兴业股份	2,670	74,359.50	0.00
365	603585	苏利股份	1,041	72,578.52	0.00
366	603577	汇金通	2,460	69,642.60	0.00
367	603336	宏辉果蔬	1,472	69,287.04	0.00
368	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.00
369	603877	太平鸟	3,180	67,734.00	0.00
370	300583	赛托生物	1,582	63,738.78	0.00
371	002827	高争民爆	2,059	60,905.22	0.00
372	002826	易明医药	2,181	57,316.68	0.00
373	601882	海天精工	2,148	54,215.52	0.00
374	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.00
375	603036	如通股份	2,114	51,771.86	0.00
376	002833	弘亚数控	2,743	48,331.66	0.00
377	002828	贝肯能源	1,042	40,221.20	0.00
378	603886	元祖股份	2,242	39,683.40	0.00
379	603689	皖天然气	4,819	37,925.53	0.00
380	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.00
381	603239	浙江仙通	924	29,059.80	0.00
382	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.00
383	603266	天龙股份	1,562	22,852.06	0.00
384	300587	天铁股份	1,438	20,290.18	0.00
385	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.00
386	002838	道恩股份	682	10,420.96	0.00
387	603186	华正新材	1,874	10,063.38	0.00
388	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00

389	300591	万里马	2,397	7,358.79	0.00
390	300588	熙菱信息	1,380	6,817.20	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	601166	兴业银行	147,516,523.33	4.87
2	600030	中信证券	129,889,442.41	4.29
3	601398	工商银行	117,716,443.75	3.89
4	601988	中国银行	113,843,419.00	3.76
5	601328	交通银行	101,769,962.52	3.36
6	601788	光大证券	99,570,295.84	3.29
7	601818	光大银行	97,066,388.38	3.20
8	600015	华夏银行	96,642,845.60	3.19
9	000750	国海证券	93,772,770.51	3.10
10	000776	广发证券	93,006,570.44	3.07
11	600999	招商证券	78,228,491.63	2.58
12	600000	浦发银行	75,343,853.56	2.49
13	000783	长江证券	70,088,238.75	2.31
14	600837	海通证券	69,841,655.52	2.31
15	601211	国泰君安	57,058,404.56	1.88
16	600036	招商银行	54,031,413.21	1.78
17	002736	国信证券	50,145,285.48	1.66
18	000166	申万宏源	45,601,029.22	1.51
19	601336	新华保险	38,019,620.08	1.26
20	601628	中国人寿	37,823,264.06	1.25

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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601166	兴业银行	197,140,102.77	6.51
2	600999	招商证券	158,016,780.38	5.22

3	600030	中信证券	139,327,565.09	4.60
4	601398	工商银行	138,569,260.91	4.57
5	601318	中国平安	121,663,942.32	4.02
6	601988	中国银行	115,834,122.97	3.82
7	000776	广发证券	106,606,724.43	3.52
8	601788	光大证券	106,401,581.54	3.51
9	601818	光大银行	101,822,684.90	3.36
10	601328	交通银行	98,713,902.65	3.26
11	600015	华夏银行	95,399,565.50	3.15
12	000750	国海证券	92,681,087.20	3.06
13	601939	建设银行	91,067,141.44	3.01
14	000783	长江证券	81,838,908.20	2.70
15	600000	浦发银行	74,993,624.36	2.48
16	600837	海通证券	72,994,772.54	2.41
17	601169	北京银行	52,838,976.96	1.74
18	002736	国信证券	52,738,691.15	1.74
19	000166	申万宏源	45,722,141.16	1.51
20	600373	中文传媒	43,542,093.81	1.44

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	5,198,854,692.58
卖出股票收入（成交）总额	6,028,469,256.05

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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，本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。

本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素，结合定性和定量方法，确定投资时机。基金管理人另根据 CAPM 模型计算得到的组合 Beta 值，结合股票投资的总体规模，以及中国证监会的相关限定和要求，确定参与股指期货交易的投资比例。

若相关法律法规发生变化时，基金管理人期货投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。

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广发证券股份有限公司（以下简称“广发证券”）、中信证券股份有限公司（以下简称“中信证券”）、国泰君安股份有限公司（以下简称“国泰君安”）、中国人寿股份有限公司（以下简称“中国人寿”）和中国太平洋保险（集团）股份有限公司（以下简称“中国太保”）外，其余的没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

2016 年 5 月 18 日，全国股转公司下发了《关于对广发证券股份有限公司采取约见谈话并责令改正自律监管措施的决定》（股转系统发[2016]50 号），对广发证券内控不完善、未按规定展开独立的尽职调查工作的违规行为，采取约见谈话并责令改正的自律监管措施。

2016 年 11 月 25 日，中国证监会向广发证券出具《中国证监会行政处罚决定书》（[2016]128 号），对其接入第三方交易终端软件但未采取可靠措施记录客户身份信息、严格审查客户身份的真实性，未切实防范客户借用证券交易通道违规从事交易活动等行为，采取责令改正、给予警告、没收违法所得，并处以罚款的行政处罚措施。

2016 年 8 月 23 日，全国股转公司下发了《关于对中信证券股份有限公司采取出具责令改正自律监管措施的决定》（股转系统发[2016]235 号），对中信证券投资者适当性管理不当的违规行为，采取责令改正的自律监管措施。

2016 年 1 月 29 日，全国股转公司下发了《关于给予国泰君安证券股份有限公司公开谴责，给予王仕宏公开谴责，给予陈扬、李仲凯通报批评的决定》（股转系统发[2016]54 号），对国泰君安扰乱正常市场秩序的违规行为，采取公开谴责的处分措施。

2016 年 3 月 1 日，国泰君安公告其于 2016 年 2 月 26 日收到中国证券监督管理委员会上海监管局《关于对国泰君安证券股份有限公司采取限制新增做市业务等监管措施的决定》（沪证监决[2016]15 号）（以下简称“《决定》”）。国泰君安在公告中陈述了《决定》的内容。

2016 年 6 月 15 日，中国证监会北京监管局发布《中国证券监督管理委员会北京监管局行政监管措施决定书（国泰君安证券）》（[2016]31 号），对国泰君安作为债券受托管理人未履职的行为采取出具警示函的行政监管措施。

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

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

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

2016 年 6 月 23 日，中国人寿公告其收到《中国保险监督管理委员会行政处罚决定书》（保监罚〔2016〕13 号）（以下简称“《行政处罚决定书》”）。中国人寿在公告中陈述了《行政处

罚决定书》的内容。

2016年3月8日，中国保险监督管理委员会向中国太保出具《中国保险监督管理委员会行政处罚决定书》(保监罚〔2016〕3号)和(保监罚〔2016〕5号)，对其客户回访不符合规定、销售人员在电话销售业务中欺骗投保人的行为，对中国太保给予罚款等行政处罚措施。

本基金投资广发证券(000776)、中信证券(600030)、国泰君安(601211)、中国人寿(601628)和中国太保(601601)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，认为上述事件对广发证券、中信证券、国泰君安、中国人寿和中国太保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	453,282.40
2	应收证券清算款	69,127.28
3	应收股利	-
4	应收利息	41,085.28
5	应收申购款	329,333.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	892,828.06

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 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
44,634	20,877.16	224,378,321.29	24.08%	707,452,992.45	75.92%

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	-	-

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 (2012 年 12 月 11 日) 基金份额总额	1,095,372,033.67
本报告期期初基金份额总额	1,398,653,196.48
本报告期基金总申购份额	213,726,660.80
减:本报告期基金总赎回份额	680,548,543.54
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	931,831,313.74

§ 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、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

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。报告期内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）2016 年度审计的报酬为 120,000.00 元。目前普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已连续四年向本基金提供审计服务。

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	
招商证券		13,904,373,115.90	34.80%	3,636,139.99	37.31%	-
华泰证券		12,917,653,867.06	26.00%	2,431,644.83	24.95%	-
华鑫证券		11,208,047,620.99	10.77%	1,125,055.89	11.54%	-
中金公司	2	838,195,779.70	7.47%	612,973.12	6.29%	-
中信建投	1	693,362,619.29	6.18%	507,056.73	5.20%	-
安信证券	2	615,228,502.47	5.48%	549,878.05	5.64%	-
东兴证券	1	394,101,297.42	3.51%	367,028.20	3.77%	-
金元证券	1	356,610,015.95	3.18%	260,787.81	2.68%	-
中信证券	1	202,229,370.45	1.80%	188,336.05	1.93%	-
西藏东方财富	1	90,383,729.83	0.81%	66,097.62	0.68%	-

注：1. 专用交易单元的选择标准

- (1) 实力雄厚，信誉良好；
 - (2) 财务状况良好，经营行为规范；
 - (3) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
 - (4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需
要，并能为本基金提供全面的信息服务；
 - (5) 研究实力较强，能及时、定期、全面地为本基金提供研究服务；
 - (6) 为基金份额持有人提供高水平的综合服务。
2. 基金管理人根据以上标准进行考察后确定合作券商。基金管理人与被选择的证券经营机构签订《专用证券交易单元租用协议》，报证券交易所办理交易单元相关租用手续；
3. 本报告期内，本基金增加租用金元证券及西藏东方财富各 1 个交易单元。

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
招商证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	200,000,000.00	100.00%	-	-

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	本公司关于旗下基金调整停牌股票“万科 A”、“乐视网”及“张家界”估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 1 月 12 日
2	本公司关于旗下基金参加平安证券	《中国证券报》、《上海证	2016 年 1 月 20 日

	申购费率优惠活动的公告	券报》、《证券日报》	
3	本基金 2015 年 4 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 1 月 21 日
4	本公司关于旗下基金参与诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 1 月 22 日
5	本基金招募说明书（更新）（2015 年第 2 号）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 1 月 22 日
6	本公司关于向汇付天下“天天盈”账户持有人开通基金网上直销业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 1 月 28 日
7	本公司关于向农业银行借记卡持卡人开通基金网上直销业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 1 月 28 日
8	本公司关于旗下基金参与上海陆金所资产管理有限公司认购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 2 月 1 日
9	本公司关于提醒投资者谨防虚假客服电话、防范金融诈骗的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 2 月 25 日
10	本公司关于旗下基金调整停牌股票“格力电器”及“东华软件”估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 3 月 1 日
11	本公司关于向工商银行借记卡持卡人开通基金网上直销业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 3 月 25 日
12	本公司关于旗下基金参与浙江同花顺基金销售有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 3 月 30 日
13	本基金 2015 年年度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 3 月 30 日
14	本公司关于旗下基金参加深圳市新兰德证券投资咨询有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 3 月 31 日
15	本公司关于旗下基金调整停牌股票“长安汽车”估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 3 月 31 日
16	本公司关于增加上海联泰资产管理有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 4 月 1 日
17	本公司关于旗下基金参与上海联泰资产管理有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 4 月 1 日
18	关于本基金继续参与中国工商银行个人电子银行申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 4 月 1 日
19	本公司关于增加上海凯石财富基金销售有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 4 月 11 日
20	本公司关于旗下基金参与上海凯石	《中国证券报》、《上海证	2016 年 4 月 11 日

	财富基金销售有限公司费率优惠活动的公告	券报》、《证券日报》	
21	本公司关于增加深圳富济财富管理有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 4 月 12 日
22	本公司关于旗下基金参与深圳富济财富管理有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 4 月 12 日
23	本公司关于增加北京钱景财富投资管理有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 4 月 15 日
24	本公司关于旗下基金参与北京钱景财富投资管理有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 4 月 15 日
25	本基金 2016 年 1 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 4 月 20 日
26	本公司关于旗下部分基金参与中国民生银行直销银行费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 5 月 17 日
27	本基金基金经理变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 6 月 3 日
28	本公司关于旗下基金参与上海好买基金销售有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 6 月 6 日
29	本公司关于增加上海利得基金销售有限公司为销售机构并参与申（认）购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 6 月 8 日
30	本公司关于增加申万宏源西部证券有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 6 月 16 日
31	本公司关于旗下基金参加申万宏源西部证券有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 6 月 16 日
32	本公司关于调整开立基金账户证件类型类型的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 6 月 20 日
33	本公司关于增加珠海盈米财富管理有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 6 月 22 日
34	本公司关于旗下基金参与珠海盈米财富管理有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 6 月 22 日
35	本公司关于旗下部分基金在上海陆金所资产管理有限公司开通基金定期定额投资业务并参与定期定额投资申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 6 月 24 日
36	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、手机银行申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 6 月 30 日

37	本公司关于旗下基金参与华泰证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016年7月1日
38	本公司关于旗下基金参与华泰证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016年7月1日
39	本公司关于旗下部分基金增加平安银行股份有限公司为销售机构并参与费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016年7月15日
40	本公司关于增加中证金牛（北京）投资咨询有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016年7月18日
41	本公司关于旗下基金参加中证金牛（北京）投资咨询有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016年7月18日
42	本基金 2016 年 2 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016年7月21日
43	本基金招募说明书（更新）（2016 年第 1 号）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016年7月22日
44	本公司关于增加国金证券股份有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016年7月25日
45	本公司关于旗下部分基金在中国农业银行股份有限公司开通转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016年7月29日
46	本公司关于增加北京汇成基金销售有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016年8月2日
47	本公司关于旗下基金参加北京汇成基金销售有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016年8月2日
48	本公司关于增加大泰金石投资管理有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016年8月12日
49	本公司关于旗下基金参加大泰金石投资管理有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016年8月12日
50	本公司关于增加深圳市金斧子投资咨询有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016年8月25日
51	本公司关于旗下部分基金参加深圳市金斧子投资咨询有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016年8月25日
52	本基金 2016 年半年度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016年8月29日
53	本公司关于增加上海万得投资顾问有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016年9月1日
54	本公司关于旗下部分基金参加上海万得投资顾问有限公司费率优惠活	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016年9月1日

	动的公告		
55	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费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 9 月 20 日
56	本公司关于旗下部分基金增加北京新浪仓石基金销售有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 9 月 27 日
57	本公司关于旗下部分基金参与北京新浪仓石基金销售有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 9 月 27 日
58	本公司关于旗下部分基金增加中国民族证券有限责任公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 10 月 10 日
59	本公司关于旗下基金增加北京恒天明泽基金销售有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 10 月 20 日
60	本公司关于开通网上直销汇款交易的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 10 月 21 日
61	本基金 2016 年 3 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 10 月 25 日
62	本公司关于开展网上直销基金转换费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 11 月 1 日
63	本公司关于旗下基金增加北京晟视天下投资管理有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 11 月 4 日
64	本公司关于旗下基金增加北京肯特瑞财富投资管理有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 11 月 9 日
65	本公司关于旗下基金参加北京肯特瑞财富投资管理有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 11 月 9 日
66	本公司关于旗下基金参与和讯信息科技有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 11 月 9 日
67	本公司关于调整旗下部分基金最低申购金额限制的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 11 月 15 日
68	本公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司手机银行申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 11 月 29 日
69	本公司关于旗下部分基金参与中国民生银行直销银行定期定额投资申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 12 月 1 日
70	本公司关于旗下基金增加中国国际金融股份有限公司为销售机构的公	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 12 月 1 日

	告		
71	本公司关于提请机构投资者及时更新新版营业执照的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 12 月 16 日
72	本公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司手机银行申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 12 月 22 日
73	本公司关于旗下部分基金参与中国农业银行股份有限公司申购及定期定额申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 12 月 30 日
74	本公司关于旗下部分基金参与烟台银行股份有限公司手机银行渠道申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2016 年 12 月 30 日

注：上述公告同时在公司网站 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
2017 年 3 月 30 日