

摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券  
投资基金  
2018 年年度报告

2018 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2019 年 3 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 25 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 2018 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>8</b>
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 过去三年基金的利润分配情况.....	10
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
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.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
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.....	17
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>18</b>
6.1 审计报告基本信息.....	18
6.2 审计报告的基本内容.....	18
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>21</b>
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	24
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>49</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	49
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	49
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.....	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	60
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	62
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	62
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	62
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.....	62

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 .....	62
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	62
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	63
8.12 投资组合报告附注 .....	63
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>65</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	65
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	65
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	65
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>66</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>67</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	67
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	67
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	67
11.4 基金投资策略的改变 .....	67
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	67
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	68
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	68
11.8 其他重大事件 .....	71
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>74</b>
12.1 备查文件目录 .....	74
12.2 存放地点 .....	74
12.3 查阅方式 .....	74

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金
基金简称	大摩深证 300 指数增强
基金主代码	233010
交易代码	233010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 11 月 15 日
基金管理人	摩根士丹利华鑫基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	33,852,630.14 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	<p>本基金为股票指数增强型基金，以深证 300 指数作为本基金投资组合跟踪的目标指数。本基金在有效跟踪深证 300 指数的基础上，通过运用增强型投资策略，力争获取超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增长。本基金对业绩比较基准的跟踪目标是：力求控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。</p>
投资策略	<p>本基金以深证 300 指数为目标指数，采用指数化投资为主要投资策略，适度增强型投资策略为辅助投资策略。</p> <p>1、股票投资策略</p> <p>本基金股票投资策略由指数化投资策略和增强型投资策略组成。</p> <p>（1）指数化投资策略</p> <p>指数化投资策略是本基金主要股票投资策略，通过采用复制指数的方法，根据目标指数即深证 300 指数的成份股及其权重构建指数投资组合。</p> <p>（2）增强型主动投资策略</p> <p>增强型主动投资策略是本基金辅助股票投资策略，包括：成份股增强策略和非成份股增强策略。管理人将对当前及未来国内外宏观经济形势的判断和经济景气周期预测作为基础，从多个方面把握不同行业的景气度变化情况和上市公司业绩增长的趋势，以“自下而上”与“自上而下”相结合的方法，重点投资价值被市场低估的指数成份股，并适度投资一些具有估值优势、持续成长能力的非成份股，对指数投资组合进行优化</p>

	<p>增强。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>本基金债券投资的目的是基金资产流动性管理，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。本基金将根据国内外宏观经济形势、货币政策、债券市场供求状况以及市场利率走势等因素，合理预期债券市场利率变动趋势，制定以久期控制下的债券资产配置策略，主要投资于到期日在一年以内的政府债券、金融债等。</p> <p>3、股指期货投资策略</p> <p>本基金可运用股指期货，以提高投资效率，有效控制指数的跟踪误差，更好地实现投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，本着审慎原则，适度参与股指期货投资，改善投资组合风险收益特征。另外，本基金将利用股指期货流动性好、杠杆交易的特点，进行现金管理，以应对大额申购赎回、大额现金分红等，管理流动性风险，优化投资组合对目标指数的跟踪效果，提高投资组合的运作效率等。</p>
业绩比较基准	深证 300 价格指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票指数型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金，属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的基金产品

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		摩根士丹利华鑫基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李锦	田青
	联系电话	(0755) 88318883	(010) 67595096
	电子邮箱	xxpl@msfunds.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8888-668	(010) 67595096
传真		(0755) 82990384	(010) 66275853
注册地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第二座第 17 层 01-04 室	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第二座第 17 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		518048	100033
法定代表人		YU HUA(于华)	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.msfnunds.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 层

### §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	2018 年	2017 年	2016 年
本期已实现收益	-596,017.79	1,254,674.35	1,837,303.50
本期利润	-14,283,060.86	5,642,792.02	-10,121,818.57
加权平均基金份额本期利润	-0.4783	0.1784	-0.3119
本期加权平均净值利润率	-35.01%	11.84%	-21.81%
本期基金份额净值增长率	-31.07%	12.42%	-18.28%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配利润	3,303,710.12	19,456,278.24	13,387,749.82
期末可供分配基金份额利润	0.0976	0.5934	0.4166
期末基金资产净值	37,156,340.26	52,245,591.69	45,522,614.36
期末基金份额净值	1.098	1.593	1.417
3.1.3 累计期末指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
基金份额累计净值增长率	9.80%	59.30%	41.70%

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

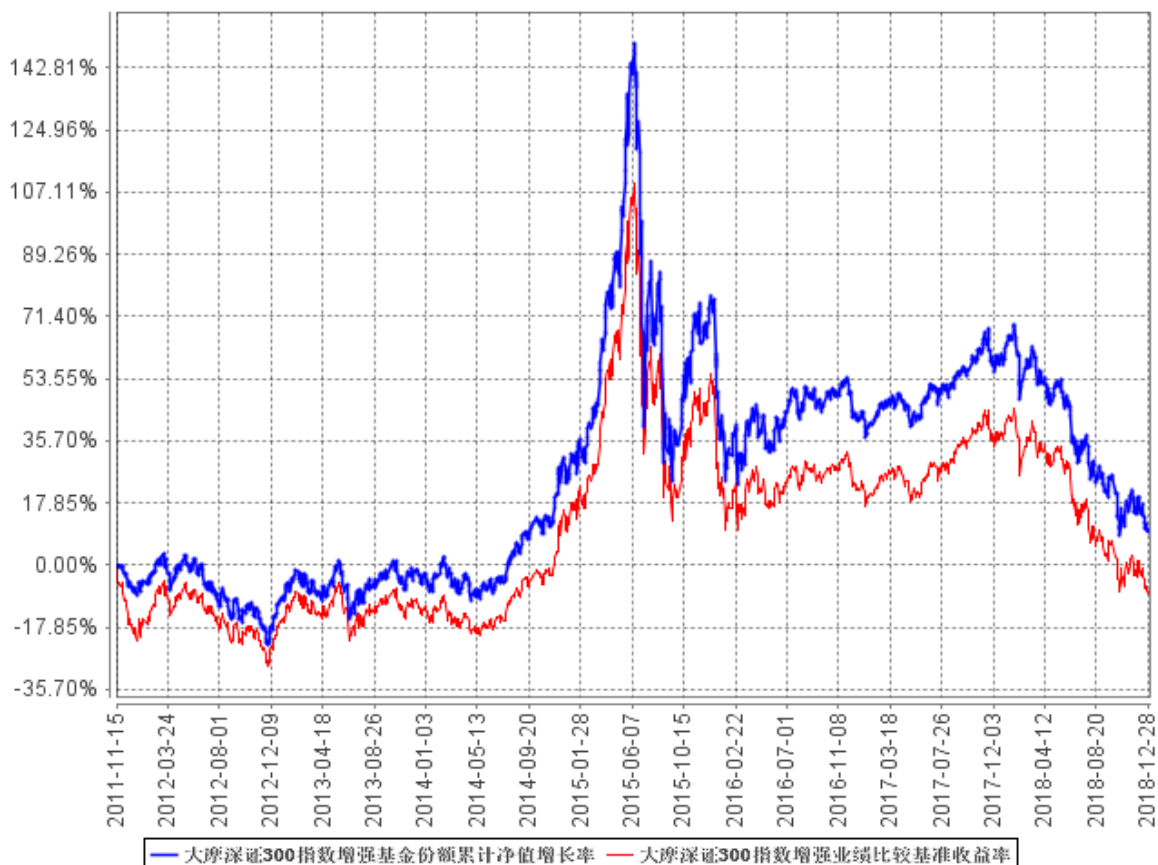
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-12.51%	1.64%	-13.43%	1.74%	0.92%	-0.10%
过去六个月	-18.97%	1.44%	-21.73%	1.56%	2.76%	-0.12%
过去一年	-31.07%	1.32%	-32.82%	1.44%	1.75%	-0.12%
过去三年	-36.68%	1.34%	-37.94%	1.35%	1.26%	-0.01%
过去五年	12.73%	1.73%	5.18%	1.61%	7.55%	0.12%
自基金合同	9.80%	1.60%	-7.60%	1.54%	17.40%	0.06%



生效起至今					
-------	--	--	--	--	--

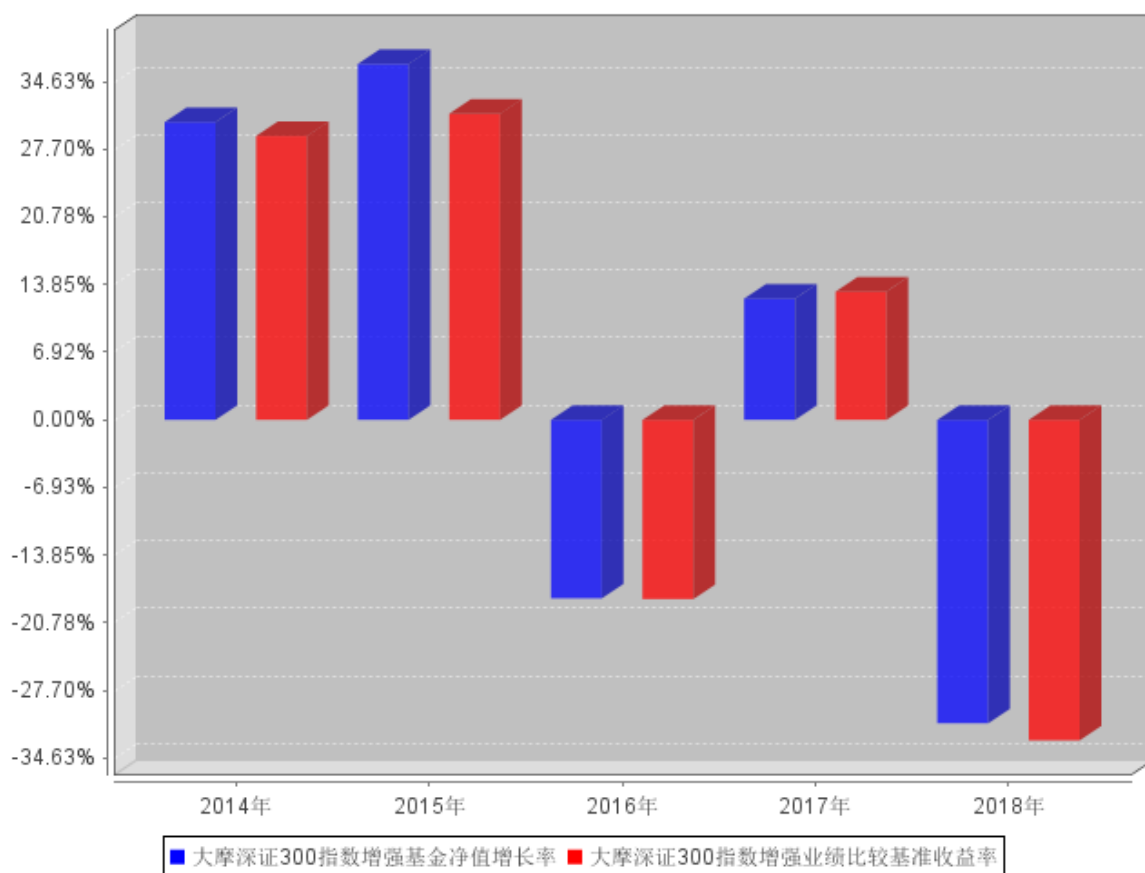
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

大摩深证300指数增强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 过去五年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

大摩深证300指数增强过去五年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



### 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 2018 年 12 月 31 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，公司还管理着多个私募资产管理计划。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
夏青	数量化投资部总监、组合投资部总	2018 年 5 月 22 日	-	12	美国马里兰大学金融数学博士。曾任美国摩根士丹利机构证券部副总裁，美国芝加哥交易对

	监、基金经理				<p>冲基金投资经理，美国斯考特交易对冲基金投资经理，万向资源有限公司量化投资部总经理，东吴证券股份有限公司投资总部董事总经理。2016 年 7 月加入本公司，现任数量化投资部总监、组合投资部总监、基金经理。2017 年 6 月起担任摩根士丹利华鑫多因子精选策略混合型证券投资基金、摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资基金、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 12 月至 2018 年 12 月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睿成中小盘弹性股票型证券投资基金和本基金基金经理。</p>
吴国雄	基金经理	2016 年 7 月 16 日	2018 年 6 月 13 日	11	<p>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、数量化投资部基金经理助理、数量化投资部投资经理。2016 年 6 月至 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 月任本基金基金经理，2017 年 1 月至 2018 年 6 月任摩根士丹利华鑫睿成中小盘弹性股票型证</p>

					券投资基金基金经理，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。
--	--	--	--	--	---

- 注：1、基金经理的任职、离任日期为根据本公司决定确定的聘任、解聘日期；
- 2、基金经理的任职、离任已按规定在中国证券投资基金业协会办理完毕基金经理注册、注销；
- 3、证券从业的含义遵从《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 1 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

2018 年全年宏观经济数据前高后低。上半年工业经济数据相对平稳；下半年随着去杠杆深化、中美贸易战的升级，经济金融风险加速暴露。流动性方面，在金融去杠杆的背景下，流动性总体偏紧，为对冲信用收缩的影响，央行也采取了一系列逆周期调节措施，流动性得到边际改善。汇率方面，2018 年美联储持续加息，美元流动性收缩超出市场预期，人民币汇率经历了从升值到贬值的转换过程，经济基本面对汇率的短期走势影响进一步增大。

2018 年，在金融去杠杆、中美贸易战和美联储加息等事件的影响下，A 股表现持续低迷，所有宽基指数均大幅下跌，其中，上证综指下跌 24.59%，代表大盘蓝筹的上证 50 指数和沪深 300 指数全年分别下跌 19.83% 和 25.31%，代表中小盘成长股票的创业板指和中小板指则分别下跌 28.65% 和 37.75%。市场总体结构分化、风格迥异。2018 年上半年，市场主要是“二八轮动”行情，所以对于分散化投资的量化基金而言，表现不是很好；2018 年下半年，主要是权重股领跌和机构抱团的行情，随着市场风格的变化，本基金的表现有所改善。

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、严格的风险管理机制、高效的量化投资执行制度跟踪指数控制跟踪误差，争取获得超额收益。本基金投资由三部分组成：一是“指数复制部分”，完全跟踪指数；二是“指数内增强部分”，精选指数内成分股，力争获得超额收益；三是“个股增强部分”，该部分通过量化模型精选成分外具有超额收益的个股，其中第一第二部分资产占基金净值比例不低于 80%，三部分股票合计占基金资产的比例为 90%-95%。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期截至 2018 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.098 元，累计份额净值为 1.098 元，基金份额净值增长率为-31.07%，同期业绩比较基准收益率为-32.82%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2019 年，在经历了较长时期的下行调整后，当前 A 股市场的风险释放已经相当充分，无论是从估值层面还是从投资者情绪层面出发，市场都已经调整到了历史底部区域，尽管盈利面临一定压力，但无风险利率下行有望提升市场估值，随着贸易战边际缓和、政策托底、改革预期升温，市场风险偏好有望提升。随着市场情绪的逐步修复，以及外资的逐步进入，A 股的核心资产和前期被错杀的优质成长股的投资价值将显著提升。此外，从历史经验来看，量化策略在市场情绪得到改善以及市场情绪高涨的环境下具有明显的投资优势，因此在当前时间窗口下，量化基金的配置价值或许已经重新显现。

2019 年一季度，本基金将在跟踪基准指数的同时，继续采用量化因子选股策略进行投资组合管理，通过科学的量化模型研究体系、严格的风险管理机制对组合的跟踪误差和投资限制进行控制。本基金将在控制跟踪误差的前提下，力争超越基准，取得超额收益。

#### 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，基金管理人在完善内部控制制度的同时，通过开展日常监控、例行检查、专项检查等方式，检查内控制度的执行情况、基金运作的合法合规情况，及时发现问题，提出改进建议并跟踪落实。

本报告期，基金管理人完成的主要监察稽核工作如下：

(1) 开展专项检查工作。检查范围覆盖投资研究交易、基金销售、基金会计、业务持续性计划、自有资金投资及风险准备金管理等方面以及合规管理、资管新规、流动性管理等新规落实情况。(2) 做好日常监控工作。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，规范基金投资、销售以及运营等各项业务管理，保障公司和基金运作合法合规。(3) 通过制度定期回顾机制持续完善公司内控制度体系，同时，适时解读监管政策与要求，组织落实债券交易业务管理、私募资产管理业务管理、基金流动性管理、公司合规管理、反洗钱等法律法规的相关要求。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、充实培训材料并组织开展培训工作，进一步提升员工风控意识及合规意识。(5) 加强新产品和新业务的风险管理。

2019 年，基金管理人将继续本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，加强风险控制，保障公司和基金的合法合规运作，保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，则及时就所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见。

本基金管理人设有基金估值委员会，委员会由主任委员（分管基金运营部的公司领导）以及相关成员（包括研究管理部负责人、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。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会的相关人员均具有一定年限的专业从业经验，具有良好的专业能力，并能在相关工作中保持独立性。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和估值方法的最终决策和日常估值的执行。

由于基金经理、相关投资研究人员、债券信用分析师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，在需要时可以列席估值委员会会议并提出估值建议，估值委员会对特定品种估值方法需经委员充分讨论后确定。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

##### 4.7.1 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，本基金自 2018 年 1 月 18 日起存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。本报告期内，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的情形。



## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## §6 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(2019)第 21420 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	摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金(以下简称“摩根士丹利华鑫深证 300 基金”)的财务报表，包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表，2018 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了摩根士丹利华鑫深证 300 基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于摩根士丹利华鑫深证 300 基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>摩根士丹利华鑫深证 300 基金的基金管理人摩根士丹利华鑫基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重</p>

	<p>大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估摩根士丹利华鑫深证 300 基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算摩根士丹利华鑫深证 300 基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督摩根士丹利华鑫深证 300 基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对导致对摩根士丹利华鑫深证</p>

	<p>300 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致摩根士丹利华鑫深证 300 基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	许康玮   俞伟敏
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2019 年 3 月 14 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	3,553,728.90	3,855,663.44
结算备付金		20,284.18	7,665.81
存出保证金		2,406.40	2,256.28
交易性金融资产	7.4.7.2	33,719,962.99	48,427,951.38
其中：股票投资		33,719,962.99	48,379,833.67
基金投资		-	-
债券投资		-	48,117.71
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		49,501.93	-
应收利息	7.4.7.5	815.76	807.64
应收股利		-	-
应收申购款		47,832.60	1,312,535.64
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		37,394,532.76	53,606,880.19
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	1,174,461.70
应付赎回款		-	29,372.32
应付管理人报酬		32,549.22	42,217.01
应付托管费		4,882.37	6,332.56
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	6,260.78	14,341.70
应交税费		0.13	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	194,500.00	94,563.21
负债合计		238,192.50	1,361,288.50
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	33,852,630.14	32,789,313.45
未分配利润	7.4.7.10	3,303,710.12	19,456,278.24
所有者权益合计		37,156,340.26	52,245,591.69
负债和所有者权益总计		37,394,532.76	53,606,880.19

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.098 元，基金份额总额 33,852,630.14 份。

## 7.2 利润表

会计主体：摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-13,300,225.03	6,714,493.34
1.利息收入		27,497.67	25,429.93
其中：存款利息收入	7.4.7.11	27,386.58	25,423.47
债券利息收入		111.09	6.46
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		346,105.11	2,275,606.26
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-184,473.30	1,692,211.38
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	1,292.97	-
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	529,285.44	583,394.88
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-13,687,043.07	4,388,117.67
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	13,215.26	25,339.48
<b>减：二、费用</b>		982,835.83	1,071,701.32
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	407,652.16	475,882.83

2. 托管费	7.4.10.2.2	61,147.88	71,382.52
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	155,131.56	165,518.07
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.01	-
7. 其他费用	7.4.7.20	358,904.22	358,917.90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-14,283,060.86	5,642,792.02
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-14,283,060.86	5,642,792.02

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	32,789,313.45	19,456,278.24	52,245,591.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-14,283,060.86	-14,283,060.86
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）	1,063,316.69	-1,869,507.26	-806,190.57
其中：1.基金申购款	15,702,024.93	6,390,308.68	22,092,333.61
2.基金赎回款	-14,638,708.24	-8,259,815.94	-22,898,524.18
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）	33,852,630.14	3,303,710.12	37,156,340.26
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	32,134,864.54	13,387,749.82	45,522,614.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,642,792.02	5,642,792.02
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）	654,448.91	425,736.40	1,080,185.31
其中：1.基金申购款	10,977,660.70	5,887,380.64	16,865,041.34
2.基金赎回款	-10,323,211.79	-5,461,644.24	-15,784,856.03
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）	32,789,313.45	19,456,278.24	52,245,591.69

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]第 1218 号《关于核准摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金募集的批复》核准，由摩根士丹利华鑫基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强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基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 421,871,132.46 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 439 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2011 年 11 月 15 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 421,922,840.88 份基金份额，其中认购资金利息折合 51,708.42 份基金份额。本基金的基金管理人为摩根士丹利华鑫基



金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。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 90%-95%，其中投资于深证 300 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产的 80%；除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 5%-10%，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%，股指期货、权证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。本基金力求控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。本基金的业绩比较基准为：深证 300 价格指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人摩根士丹利华鑫基金管理有限公司于 2019 年 3 月 14 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》、《摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。截至 2018 年 12 月 31 日，本基金存在连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并评估后续处理方案，故本财务报表仍以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 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 12

月 31 日的财务状况以及 2018 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变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

###### (2) 金融负债的分类

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

##### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于

应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

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

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金

红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。

## 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 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
活期存款	3,553,728.90	3,855,663.44
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：	3,553,728.90	3,855,663.44

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	44,182,091.66	33,719,962.99	-10,462,128.67
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		44,182,091.66	33,719,962.99	-10,462,128.67
项目		上年度末 2017 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		45,154,836.98	48,379,833.67	3,224,996.69
贵金属投资-金交所 黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	48,200.00	48,117.71	-82.29
	银行间市场	-	-	-
	合计	48,200.00	48,117.71	-82.29
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		45,203,036.98	48,427,951.38	3,224,914.40

#### 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 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	804.54	796.23
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	10.01	3.85
应收债券利息	-	6.46
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	1.21	1.10
合计	815.76	807.64

#### 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 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	6,260.78	14,341.70
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	6,260.78	14,341.70

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	63.21
预提费用	144,500.00	44,500.00
指数使用费	50,000.00	50,000.00
合计	194,500.00	94,563.21

#### 7.4.7.9 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 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	32,789,313.45	32,789,313.45
本期申购	15,702,024.93	15,702,024.93
本期赎回(以“-”号填列)	-14,638,708.24	-14,638,708.24
本期末	33,852,630.14	33,852,630.14

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	25,048,811.39	-5,592,533.15	19,456,278.24
本期利润	-596,017.79	-13,687,043.07	-14,283,060.86
本期基金份额交易产生的变动数	979,638.02	-2,849,145.28	-1,869,507.26
其中：基金申购款	12,461,842.52	-6,071,533.84	6,390,308.68
基金赎回款	-11,482,204.50	3,222,388.56	-8,259,815.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	25,432,431.62	-22,128,721.50	3,303,710.12

#### 7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
活期存款利息收入	26,585.11	24,487.83
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	696.23	893.57
其他	105.24	42.07
合计	27,386.58	25,423.47

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
卖出股票成交总额	51,291,772.26	58,242,318.52
减：卖出股票成本总额	51,476,245.56	56,550,107.14
买卖股票差价收入	-184,473.30	1,692,211.38

#### 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 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑	1,292.97	-

付) 差价收入		
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	1,292.97	-

#### 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 2018年1月1日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月 31日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	49,503.91	-
减：卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	48,200.00	-
减：应收利息总额	10.94	-
买卖债券差价收入	1,292.97	-

#### 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 2018年1月1日至2018年12 月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12 月31日
股票投资产生的股利收益	529,285.44	583,394.88
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	529,285.44	583,394.88

## 7.4.7.17 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-13,687,043.07	4,388,117.67
——股票投资	-13,687,125.36	4,388,199.96
——债券投资	82.29	-82.29
——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	-13,687,043.07	4,388,117.67

## 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	11,646.03	11,066.14
基金转换费收入	1,569.23	1,550.37
其他	-	12,722.97
合计	13,215.26	25,339.48

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。赎回费中不低于赎回费总额的 25% 归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

## 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	155,131.56	165,518.07
银行间市场交易费用	-	-
合计	155,131.56	165,518.07

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
审计费用	40,000.00	40,000.00
信息披露费	100,000.00	100,000.00
银行费用	544.22	917.90
债券账户维护费	18,000.00	18,000.00
指数使用费	200,000.00	200,000.00
其他	360.00	-
合计	358,904.22	358,917.90

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度(自然季度)人民币 50,000 元。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
摩根士丹利华鑫基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金销售机构
华鑫证券有限责任公司(“华鑫证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
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
深圳市基石创业投资有限公司 (2017 年 10 月 26 日后)	基金管理人的股东
深圳市中技实业(集团)有限公司	基金管理人的股东

注：1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

## 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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	6,525,662.19	6.41%	14,607,809.47	12.56%

#### 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 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	6,077.54	6.41%	4,990.50	79.71%
关联方名称	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日			

	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
华鑫证券	13,604.38	14.02%	-	-

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

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

## 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
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	407,652.16	475,882.83
其中：支付销售机构的客户维护费	202,301.22	233,963.24

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 1.00% 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 × 1.00% / 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
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	61,147.88	71,382.52

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 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 × 0.15% / 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		上年度可比期间	
	2018年1月1日至2018年12月31日		2017年1月1日至2017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
中国建设银行	3,553,728.90	26,585.11	3,855,663.44	24,487.83

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 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

本基金本报告期无利润分配事项。

#### 7.4.12 期末（2018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

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。

##### 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	中天金融	2017年8月21日	重大资产重组	3.80	2019年1月2日	4.38	74,700	335,404.72	283,860.00	
002183	怡亚通	2018年12月25日	重大事项	5.01	2019年1月2日	4.96	8,800	65,350.38	44,088.00	



000693	*ST 华泽	2018 年 5 月 2 日	重大 事项	1.00	-	-	900	22,171.00	900.00	-
--------	--------	----------------------	----------	------	---	---	-----	-----------	--------	---

注：本基金截至 2018 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票指数增强型基金，以深证 300 指数作为本基金投资组合跟踪的目标指数。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，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，前者负责协调并与各部门合作完成运营及合规风险管理，后者主要负责基金投资的信用风险、市场风险以及流动性风险的监督管理；基金经理、投资总监以及投资决策委员会负责对基金投资业务风险进行直接管理。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风

险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

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

于 2018 年 12 月 31 日，本基金无债券投资(2017 年 12 月 31 日：本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.09%)。

#### 7.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2018 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2018 年 12 月 31 日,本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例未超过 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。于 2018 年 12 月 31 日,本基金最近工作日确认的净赎回金额未超过组合资产中 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。

#### 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 2018 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	3,553,728.90	-	-	-	3,553,728.90
结算备付金	20,284.18	-	-	-	20,284.18
存出保证金	2,406.40	-	-	-	2,406.40
交易性金融资产	-	-	-	33,719,962.99	33,719,962.99
应收证券清算款	-	-	-	49,501.93	49,501.93
应收利息	-	-	-	815.76	815.76
应收申购款	-	-	-	47,832.60	47,832.60
资产总计	3,576,419.48	-	-	33,818,113.28	37,394,532.76
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	32,549.22	32,549.22
应付托管费	-	-	-	4,882.37	4,882.37
应付交易费用	-	-	-	6,260.78	6,260.78
应交税费	-	-	-	0.13	0.13

其他负债	-	-	-	194,500.00	194,500.00
负债总计	-	-	-	238,192.50	238,192.50
利率敏感度缺口	3,576,419.48	-	-	33,579,920.78	37,156,340.26
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	3,855,663.44	-	-	-	3,855,663.44
结算备付金	7,665.81	-	-	-	7,665.81
存出保证金	2,256.28	-	-	-	2,256.28
交易性金融资产	-	-	48,117.71	48,379,833.67	48,427,951.38
应收利息	-	-	-	807.64	807.64
应收申购款	-	-	-	1,312,535.64	1,312,535.64
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,865,585.53	-	48,117.71	49,693,176.95	53,606,880.19
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,174,461.70	1,174,461.70
应付赎回款	-	-	-	29,372.32	29,372.32
应付管理人报酬	-	-	-	42,217.01	42,217.01
应付托管费	-	-	-	6,332.56	6,332.56
应付交易费用	-	-	-	14,341.70	14,341.70
其他负债	-	-	-	94,563.21	94,563.21
负债总计	-	-	-	1,361,288.50	1,361,288.50
利率敏感度缺口	3,865,585.53	-	48,117.71	48,331,888.45	52,245,591.69

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 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2017 年 12 月 31 日：本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.09%)。因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2017 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，在有效跟踪深证 300 指数的基础上，通过运用增强型投资策略，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。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 2018 年 12 月 31 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	33,719,962.99	90.75	48,379,833.67	92.60
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	48,117.71	0.09
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	33,719,962.99	90.75	48,427,951.38	92.69

#### 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（2018 年 12 月 31 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准（附注 7.4.1）	1,540,000.00	2,170,000.00

	上升 5%		
	业绩比较基准（附注 7.4.1）	-1,540,000.00	-2,170,000.00
	下降 5%		

#### 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 2018 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 33,391,114.99 元，属于第二层次的余额为 327,948.00 元，属于第三层次的余额为 900.00 元(2017 年 12 月 31 日：第一层次 46,334,916.35 元，第二层次 2,055,936.95 元，属于第三层次的余额为 37,098.08 元)。

##### (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

于本期末，本基金持有公允价值归属于第三层次的金融工具金额为 900.00 元(2017 年 12 月 31 日：37,098.08 元)。本基金本期净转入第三层次的金额为-36,198.08 元(2017 年度：190,993.44 元)，计入损益的第三层次金融工具公允价值变动为零元(2017 年度：-153,895.36 元)。于本期末，本基金仍持有的资产计入 2018 年度损益的公允价值变动损益的金额为-10,350.00 元(2017 年度：-132,737.12 元)。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 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(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。



## §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	33,719,962.99	90.17
	其中：股票	33,719,962.99	90.17
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	3,574,013.08	9.56
8	其他各项资产	100,556.69	0.27
9	合计	37,394,532.76	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	992,384.40	2.67
B	采矿业	227,528.55	0.61
C	制造业	18,960,100.83	51.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	414,913.00	1.12
E	建筑业	199,593.44	0.54
F	批发和零售业	881,432.00	2.37
G	交通运输、仓储和邮政业	176,566.40	0.48
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,190,737.45	5.90
J	金融业	2,976,884.13	8.01

K	房地产业	2,320,796.09	6.25
L	租赁和商务服务业	568,131.28	1.53
M	科学研究和技术服务业	12,000.00	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	207,647.70	0.56
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	532,490.32	1.43
R	文化、体育和娱乐业	831,446.50	2.24
S	综合	50,858.00	0.14
	合计	31,543,510.09	84.89

### 8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	89,704.00	0.24
C	制造业	441,555.50	1.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	288,585.00	0.78
E	建筑业	80,827.00	0.22
F	批发和零售业	91,726.00	0.25
G	交通运输、仓储和邮政业	165,782.00	0.45
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	32,870.40	0.09
J	金融业	765,379.00	2.06
K	房地产业	94,689.00	0.25
L	租赁和商务服务业	19,195.00	0.05
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	67,270.00	0.18
S	综合	38,870.00	0.10
	合计	2,176,452.90	5.86

### 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

#### 8.3.1 期末指数投资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	000333	美的集团	28,100	1,035,766.00	2.79
2	000651	格力电器	28,480	1,016,451.20	2.74
3	300498	温氏股份	27,380	716,808.40	1.93
4	000001	平安银行	65,953	618,639.14	1.66
5	000002	万科 A	25,902	616,985.64	1.66
6	000858	五粮液	10,940	556,627.20	1.50
7	002415	海康威视	20,850	537,096.00	1.45
8	000725	京东方 A	171,800	451,834.00	1.22
9	002142	宁波银行	24,786	402,028.92	1.08
10	000876	新希望	55,008	400,458.24	1.08
11	000166	申万宏源	91,011	370,414.77	1.00
12	002007	华兰生物	10,569	346,663.20	0.93
13	000776	广发证券	27,200	344,896.00	0.93
14	300015	爱尔眼科	12,856	338,112.80	0.91
15	300144	宋城演艺	14,600	311,710.00	0.84
16	300124	汇川技术	15,400	310,156.00	0.83
17	002024	苏宁易购	31,100	306,335.00	0.82
18	000157	中联重科	83,900	298,684.00	0.80
19	000895	双汇发展	12,650	298,413.50	0.80
20	001979	招商蛇口	17,107	296,806.45	0.80
21	002304	洋河股份	3,046	288,517.12	0.78
22	000540	中天金融	74,700	283,860.00	0.76
23	300059	东方财富	22,692	274,573.20	0.74
24	002594	比亚迪	5,100	260,100.00	0.70
25	002465	海格通信	32,200	251,160.00	0.68
26	300136	信维通信	11,500	248,515.00	0.67
27	300122	智飞生物	6,400	248,064.00	0.67
28	000538	云南白药	3,204	236,967.84	0.64
29	000338	潍柴动力	30,300	233,310.00	0.63
30	002027	分众传媒	44,432	232,823.68	0.63
31	000100	TCL 集团	91,900	225,155.00	0.61

32	002475	立讯精密	15,835	222,640.10	0.60
33	002230	科大讯飞	9,000	221,760.00	0.60
34	000783	长江证券	42,900	220,935.00	0.59
35	000069	华侨城 A	34,600	219,710.00	0.59
36	002422	科伦药业	10,600	218,890.00	0.59
37	000661	长春高新	1,250	218,750.00	0.59
38	000963	华东医药	8,200	216,972.00	0.58
39	002736	国信证券	25,700	215,109.00	0.58
40	002470	金正大	33,400	211,088.00	0.57
41	000625	长安汽车	31,400	206,926.00	0.56
42	002739	万达电影	9,450	206,293.50	0.56
43	300408	三环集团	12,000	203,040.00	0.55
44	002202	金风科技	19,570	195,504.30	0.53
45	300003	乐普医疗	9,380	195,197.80	0.53
46	002311	海大集团	8,400	194,628.00	0.52
47	000750	国海证券	44,600	194,456.00	0.52
48	000686	东北证券	30,600	191,556.00	0.52
49	002223	鱼跃医疗	9,699	190,197.39	0.51
50	000423	东阿阿胶	4,700	185,885.00	0.50
51	000999	华润三九	7,200	178,992.00	0.48
52	000425	徐工机械	54,700	176,681.00	0.48
53	300296	利亚德	22,950	176,485.50	0.47
54	000729	燕京啤酒	31,100	175,404.00	0.47
55	000598	兴蓉环境	43,400	174,902.00	0.47
56	002008	大族激光	5,668	172,080.48	0.46
57	002506	协鑫集成	34,200	171,000.00	0.46
58	000568	泸州老窖	4,200	170,772.00	0.46
59	002179	中航光电	5,000	168,400.00	0.45
60	000027	深圳能源	32,000	168,000.00	0.45
61	002044	美年健康	11,220	167,739.00	0.45
62	000961	中南建设	29,300	164,373.00	0.44
63	300072	三聚环保	16,440	161,769.60	0.44
64	000630	铜陵有色	81,100	159,767.00	0.43
65	002385	大北农	49,323	157,833.60	0.42
66	000623	吉林敖东	10,650	153,679.50	0.41
67	300168	万达信息	12,600	151,074.00	0.41
68	002013	中航机电	22,175	144,359.25	0.39
69	300315	掌趣科技	40,770	143,918.10	0.39
70	000415	渤海租赁	39,700	142,920.00	0.38

71	000046	泛海控股	29,900	139,633.00	0.38
72	000998	隆平高科	9,100	134,680.00	0.36
73	002294	信立泰	6,440	134,531.60	0.36
74	300274	阳光电源	15,000	133,800.00	0.36
75	002466	天齐锂业	4,517	132,438.44	0.36
76	300142	沃森生物	6,900	131,790.00	0.35
77	002138	顺络电子	9,500	131,480.00	0.35
78	000031	中粮地产	26,700	130,296.00	0.35
79	000028	国药一致	3,075	127,428.00	0.34
80	002155	湖南黄金	16,100	126,385.00	0.34
81	000581	威孚高科	7,142	126,127.72	0.34
82	002456	欧菲科技	13,530	124,340.70	0.33
83	002152	广电运通	21,895	122,830.95	0.33
84	002450	康得新	15,585	119,069.40	0.32
85	002491	通鼎互联	14,900	117,412.00	0.32
86	002236	大华股份	10,085	115,574.10	0.31
87	000988	华工科技	9,500	113,430.00	0.31
88	002444	巨星科技	11,800	111,864.00	0.30
89	002610	爱康科技	70,700	110,999.00	0.30
90	002572	索菲亚	6,600	110,550.00	0.30
91	000887	中鼎股份	10,800	109,296.00	0.29
92	300027	华谊兄弟	23,300	109,277.00	0.29
93	000413	东旭光电	23,800	107,100.00	0.29
94	002085	万丰奥威	13,780	106,795.00	0.29
95	000559	万向钱潮	20,578	105,359.36	0.28
96	002460	赣锋锂业	4,650	102,672.00	0.28
97	000768	中航飞机	7,700	101,948.00	0.27
98	300024	机器人	7,700	101,794.00	0.27
99	000656	金科股份	16,400	101,516.00	0.27
100	300182	捷成股份	23,600	101,244.00	0.27
101	002714	牧原股份	3,520	101,200.00	0.27
102	002129	中环股份	13,051	94,358.73	0.25
103	002241	歌尔股份	13,598	93,554.24	0.25
104	000078	海王生物	30,900	92,082.00	0.25
105	002673	西部证券	11,790	90,429.30	0.24
106	002426	胜利精密	38,300	88,856.00	0.24
107	002468	申通快递	5,200	85,540.00	0.23
108	002410	广联达	4,100	85,321.00	0.23
109	000728	国元证券	12,200	85,156.00	0.23

110	002146	荣盛发展	10,700	85,065.00	0.23
111	000703	恒逸石化	7,200	82,944.00	0.22
112	000825	太钢不锈	19,900	82,386.00	0.22
113	300253	卫宁健康	6,503	81,027.38	0.22
114	002065	东华软件	11,320	78,674.00	0.21
115	000977	浪潮信息	4,920	78,326.40	0.21
116	300383	光环新网	6,100	77,287.00	0.21
117	000709	河钢股份	27,200	77,248.00	0.21
118	300017	网宿科技	9,808	76,796.64	0.21
119	000503	国新健康	4,700	74,636.00	0.20
120	002001	新和成	4,964	74,509.64	0.20
121	000786	北新建材	5,376	73,973.76	0.20
122	300070	碧水源	9,419	73,468.20	0.20
123	300146	汤臣倍健	4,300	73,057.00	0.20
124	002271	东方雨虹	5,610	72,649.50	0.20
125	002493	荣盛石化	7,150	72,143.50	0.19
126	000690	宝新能源	10,700	72,011.00	0.19
127	002797	第一创业	13,100	71,002.00	0.19
128	300159	新研股份	15,400	70,994.00	0.19
129	002602	世纪华通	3,420	70,623.00	0.19
130	002405	四维图新	4,932	69,590.52	0.19
131	000401	冀东水泥	5,617	69,538.46	0.19
132	002340	格林美	18,102	69,511.68	0.19
133	002384	东山精密	5,900	66,611.00	0.18
134	300450	先导智能	2,297	66,475.18	0.18
135	002049	紫光国微	2,300	66,470.00	0.18
136	002081	金螳螂	8,200	66,420.00	0.18
137	000778	新兴铸管	15,400	66,374.00	0.18
138	002195	二三四五	17,879	65,973.51	0.18
139	002439	启明星辰	3,200	65,792.00	0.18
140	002050	三花智控	5,100	64,719.00	0.17
141	000997	新大陆	4,300	62,952.00	0.17
142	000830	鲁西化工	6,400	62,720.00	0.17
143	002092	中泰化学	8,890	62,674.50	0.17
144	002010	传化智联	9,401	61,106.50	0.16
145	002601	龙鳞佰利	4,900	60,270.00	0.16
146	000806	银河生物	15,500	60,140.00	0.16
147	002038	双鹭药业	2,400	59,544.00	0.16
148	002500	山西证券	9,900	58,608.00	0.16

149	002624	完美世界	2,100	58,485.00	0.16
150	002310	东方园林	8,250	57,420.00	0.15
151	000792	盐湖股份	8,200	57,236.00	0.15
152	000060	中金岭南	14,262	56,477.52	0.15
153	002281	光迅科技	2,100	56,406.00	0.15
154	000839	中信国安	16,650	56,110.50	0.15
155	002268	卫士通	3,100	55,366.00	0.15
156	000050	深天马 A	5,600	54,936.00	0.15
157	002508	老板电器	2,720	54,916.80	0.15
158	000008	神州高铁	14,000	54,460.00	0.15
159	002127	南极电商	7,200	54,144.00	0.15
160	000671	阳光城	10,400	53,976.00	0.15
161	002074	国轩高科	4,600	53,176.00	0.14
162	000066	中国长城	11,168	52,936.32	0.14
163	000039	中集集团	5,000	52,900.00	0.14
164	300088	长信科技	12,700	52,705.00	0.14
165	000418	小天鹅 A	1,200	51,900.00	0.14
166	000983	西山煤电	9,395	51,578.55	0.14
167	002110	三钢闽光	4,000	51,160.00	0.14
168	000009	中国宝安	11,800	50,858.00	0.14
169	002558	巨人网络	2,600	50,362.00	0.14
170	002221	东华能源	6,200	49,972.00	0.13
171	000547	航天发展	6,600	49,896.00	0.13
172	002153	石基信息	1,900	49,324.00	0.13
173	300166	东方国信	4,760	49,313.60	0.13
174	000402	金融街	7,600	48,944.00	0.13
175	002640	跨境通	4,400	47,520.00	0.13
176	002168	深圳惠程	4,800	47,472.00	0.13
177	002078	太阳纸业	8,300	47,310.00	0.13
178	002032	苏泊尔	900	47,250.00	0.13
179	000488	晨鸣纸业	8,400	47,124.00	0.13
180	300009	安科生物	3,500	46,760.00	0.13
181	300251	光线传媒	6,100	46,360.00	0.12
182	000932	华菱钢铁	7,600	46,056.00	0.12
183	300014	亿纬锂能	2,896	45,525.12	0.12
184	002176	江特电机	7,700	45,199.00	0.12
185	002051	中工国际	4,068	45,073.44	0.12
186	002183	怡亚通	8,800	44,088.00	0.12
187	002019	亿帆医药	4,100	43,870.00	0.12

188	002583	海能达	5,500	43,395.00	0.12
189	002373	千方科技	3,900	43,368.00	0.12
190	000960	锡业股份	4,500	42,930.00	0.12
191	000513	丽珠集团	1,700	42,755.00	0.12
192	002352	顺丰控股	1,300	42,575.00	0.11
193	000826	启迪桑德	4,000	41,560.00	0.11
194	000898	鞍钢股份	8,100	41,553.00	0.11
195	002371	北方华创	1,100	41,536.00	0.11
196	300073	当升科技	1,500	41,535.00	0.11
197	002185	华天科技	10,200	41,412.00	0.11
198	002589	瑞康医药	5,900	41,123.00	0.11
199	000970	中科三环	5,588	40,960.04	0.11
200	002353	杰瑞股份	2,700	40,500.00	0.11
201	002273	水晶光电	4,220	40,343.20	0.11
202	300418	昆仑万维	3,100	39,866.00	0.11
203	002299	圣农发展	2,400	39,696.00	0.11
204	002407	多氟多	3,600	39,456.00	0.11
205	300133	华策影视	4,400	39,424.00	0.11
206	000930	中粮生化	5,300	39,326.00	0.11
207	000732	泰禾集团	2,800	39,256.00	0.11
208	300033	同花顺	1,000	38,200.00	0.10
209	000878	云南铜业	4,800	38,064.00	0.10
210	002217	合力泰	8,000	37,440.00	0.10
211	000738	航发控制	3,100	37,386.00	0.10
212	300170	汉得信息	3,800	37,164.00	0.10
213	000627	天茂集团	6,600	37,026.00	0.10
214	000059	华锦股份	6,100	36,234.00	0.10
215	300207	欣旺达	4,200	36,078.00	0.10
216	000938	紫光股份	1,140	35,636.40	0.10
217	300316	晶盛机电	3,500	35,070.00	0.09
218	000807	云铝股份	8,900	34,532.00	0.09
219	002035	华帝股份	3,900	34,515.00	0.09
220	002285	世联行	6,600	33,528.00	0.09
221	002280	联络互动	8,600	33,282.00	0.09
222	000717	韶钢松山	7,300	33,215.00	0.09
223	300433	蓝思科技	5,100	33,201.00	0.09
224	300058	蓝色光标	7,615	33,049.10	0.09
225	002030	达安基因	3,200	32,512.00	0.09
226	000596	古井贡酒	600	32,376.00	0.09



227	002916	深南电路	400	32,068.00	0.09
228	002497	雅化集团	4,800	31,872.00	0.09
229	000800	一汽轿车	4,800	31,776.00	0.09
230	300113	顺网科技	2,500	31,775.00	0.09
231	002151	北斗星通	1,500	31,650.00	0.09
232	002244	滨江集团	7,900	31,442.00	0.08
233	300115	长盈精密	3,800	31,122.00	0.08
234	300628	亿联网络	400	31,064.00	0.08
235	300055	万邦达	4,000	30,680.00	0.08
236	002597	金禾实业	1,900	30,191.00	0.08
237	000006	深振业 A	5,700	29,526.00	0.08
238	002555	三七互娱	3,100	29,264.00	0.08
239	000036	华联控股	5,200	28,652.00	0.08
240	000933	神火股份	7,300	28,470.00	0.08
241	000877	天山股份	4,000	28,440.00	0.08
242	002831	裕同科技	700	28,042.00	0.08
243	300222	科大智能	1,800	27,900.00	0.08
244	002839	张家港行	5,200	27,820.00	0.07
245	000012	南玻 A	6,939	27,686.61	0.07
246	002056	横店东磁	5,000	27,650.00	0.07
247	300355	蒙草生态	7,100	27,619.00	0.07
248	002131	利欧股份	18,590	27,327.30	0.07
249	001965	招商公路	3,400	27,302.00	0.07
250	002366	台海核电	2,900	27,202.00	0.07
251	300459	金科文化	3,700	27,195.00	0.07
252	300244	迪安诊断	1,756	26,638.52	0.07
253	300496	中科创达	1,200	26,520.00	0.07
254	002108	沧州明珠	6,288	26,472.48	0.07
255	002389	航天彩虹	2,100	25,641.00	0.07
256	002573	清新环境	3,500	25,270.00	0.07
257	002670	国盛金控	2,500	25,200.00	0.07
258	002128	露天煤业	3,500	25,060.00	0.07
259	000937	冀中能源	6,500	24,505.00	0.07
260	300367	东方网力	2,700	23,949.00	0.06
261	000712	锦龙股份	2,600	23,608.00	0.06
262	300002	神州泰岳	6,939	22,898.70	0.06
263	002716	金贵银业	3,720	22,803.60	0.06
264	002408	齐翔腾达	3,300	22,572.00	0.06
265	300618	寒锐钴业	300	22,224.00	0.06

266	002120	韵达股份	698	21,149.40	0.06
267	002424	贵州百灵	2,400	21,000.00	0.06
268	300197	铁汉生态	5,500	20,845.00	0.06
269	002600	领益智造	7,800	19,500.00	0.05
270	002411	延安必康	900	18,972.00	0.05
271	300266	兴源环境	5,350	18,885.50	0.05
272	000723	美锦能源	5,600	17,976.00	0.05
273	300699	光威复材	500	17,900.00	0.05
274	002292	奥飞娱乐	3,100	17,546.00	0.05
275	002709	天赐材料	800	17,328.00	0.05
276	000537	广宇发展	2,300	17,227.00	0.05
277	002343	慈文传媒	1,900	17,138.00	0.05
278	000959	首钢股份	4,522	16,867.06	0.05
279	002665	首航节能	5,400	15,174.00	0.04
280	002302	西部建设	1,700	15,028.00	0.04
281	002635	安洁科技	1,300	14,729.00	0.04
282	300085	银之杰	1,600	12,736.00	0.03
283	300676	华大基因	200	12,000.00	0.03
284	002920	德赛西威	500	8,675.00	0.02

### 8.3.2 期末积极投资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	600519	贵州茅台	100	59,001.00	0.16
2	601288	农业银行	13,800	49,680.00	0.13
3	600023	浙能电力	10,200	48,246.00	0.13
4	600900	长江电力	3,000	47,640.00	0.13
5	600886	国投电力	5,800	46,690.00	0.13
6	601988	中国银行	12,500	45,125.00	0.12
7	600011	华能国际	5,900	43,542.00	0.12
8	600674	川投能源	5,000	43,350.00	0.12
9	601818	光大银行	11,300	41,810.00	0.11
10	601328	交通银行	7,200	41,688.00	0.11
11	601166	兴业银行	2,700	40,338.00	0.11
12	601857	中国石油	5,400	38,934.00	0.10
13	600895	张江高科	2,600	38,870.00	0.10

14	600016	民生银行	6,640	38,047.20	0.10
15	601398	工商银行	7,100	37,559.00	0.10
16	300413	芒果超媒	1,000	37,010.00	0.10
17	601985	中国核电	6,700	35,309.00	0.10
18	600436	片仔癀	400	34,660.00	0.09
19	600177	雅戈尔	4,700	33,793.00	0.09
20	600637	东方明珠	3,210	32,870.40	0.09
21	600271	航天信息	1,400	32,046.00	0.09
22	601169	北京银行	5,700	31,977.00	0.09
23	601006	大秦铁路	3,800	31,274.00	0.08
24	601229	上海银行	2,720	30,436.80	0.08
25	300291	华录百纳	6,800	30,260.00	0.08
26	600276	恒瑞医药	570	30,067.50	0.08
27	600170	上海建工	9,900	29,997.00	0.08
28	600015	华夏银行	4,000	29,560.00	0.08
29	600028	中国石化	5,800	29,290.00	0.08
30	600688	上海石化	5,700	28,443.00	0.08
31	600352	浙江龙盛	2,900	27,985.00	0.08
32	600000	浦发银行	2,800	27,440.00	0.07
33	600837	海通证券	3,000	26,400.00	0.07
34	600535	天士力	1,360	26,112.00	0.07
35	601211	国泰君安	1,700	26,044.00	0.07
36	600820	隧道股份	4,100	25,666.00	0.07
37	601998	中信银行	4,700	25,615.00	0.07
38	600061	国投资本	2,800	25,172.00	0.07
39	601390	中国中铁	3,600	25,164.00	0.07
40	600332	白云山	700	25,032.00	0.07
41	600085	同仁堂	900	24,750.00	0.07
42	600919	江苏银行	4,100	24,477.00	0.07
43	600606	绿地控股	4,000	24,440.00	0.07
44	600104	上汽集团	900	24,003.00	0.06
45	600795	国电电力	9,300	23,808.00	0.06
46	600705	中航资本	5,600	23,744.00	0.06
47	601788	光大证券	2,700	23,679.00	0.06
48	601009	南京银行	3,600	23,256.00	0.06
49	601872	招商轮船	6,200	22,878.00	0.06
50	600999	招商证券	1,700	22,780.00	0.06
51	600036	招商银行	900	22,680.00	0.06
52	601766	中国中车	2,500	22,550.00	0.06

53	601318	中国平安	400	22,440.00	0.06
54	601021	春秋航空	700	22,267.00	0.06
55	601607	上海医药	1,300	22,100.00	0.06
56	600690	青岛海尔	1,500	20,775.00	0.06
57	600583	海油工程	4,200	20,580.00	0.06
58	600115	东方航空	4,100	19,475.00	0.05
59	600415	小商品城	5,500	19,195.00	0.05
60	600118	中国卫星	1,100	19,052.00	0.05
61	601555	东吴证券	2,800	18,760.00	0.05
62	601111	中国国航	2,400	18,336.00	0.05
63	600153	建发股份	2,600	18,330.00	0.05
64	600704	物产中大	4,000	18,320.00	0.05
65	600208	新湖中宝	6,300	18,270.00	0.05
66	600663	陆家嘴	1,400	18,186.00	0.05
67	601198	东兴证券	1,900	18,164.00	0.05
68	600109	国金证券	2,500	17,900.00	0.05
69	601018	宁波港	5,200	17,368.00	0.05
70	600029	南方航空	2,600	17,264.00	0.05
71	601601	中国太保	600	17,058.00	0.05
72	600221	海航控股	9,000	16,920.00	0.05
73	600309	万华化学	600	16,794.00	0.05
74	600739	辽宁成大	1,600	16,736.00	0.05
75	600518	康美药业	1,800	16,578.00	0.04
76	600297	广汇汽车	4,000	16,240.00	0.04
77	600066	宇通客车	1,300	15,405.00	0.04
78	600958	东方证券	1,700	13,549.00	0.04
79	300760	迈瑞医疗	100	10,922.00	0.03
80	300750	宁德时代	100	7,380.00	0.02
81	000693	*ST 华泽	900	900.00	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	300059	东方财富	648,308.00	1.24

2	000333	美的集团	553,704.00	1.06
3	300124	汇川技术	540,812.00	1.04
4	000651	格力电器	525,580.00	1.01
5	300136	信维通信	520,491.00	1.00
6	000895	双汇发展	463,914.00	0.89
7	300072	三聚环保	453,165.00	0.87
8	300408	三环集团	416,479.00	0.80
9	300003	乐普医疗	406,754.00	0.78
10	300015	爱尔眼科	406,494.00	0.78
11	300142	沃森生物	397,026.00	0.76
12	002027	分众传媒	392,177.00	0.75
13	300070	碧水源	378,783.00	0.73
14	000001	平安银行	366,859.00	0.70
15	300144	宋城演艺	366,235.00	0.70
16	300024	机器人	338,542.40	0.65
17	601988	中国银行	330,860.00	0.63
18	300355	蒙草生态	326,016.00	0.62
19	300027	华谊兄弟	323,664.00	0.62
20	601398	工商银行	323,285.00	0.62

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	000333	美的集团	1,548,435.00	2.96
2	000651	格力电器	1,354,468.00	2.59
3	000858	五粮液	1,107,882.00	2.12
4	000002	万科 A	805,436.00	1.54
5	000725	京东方 A	799,272.00	1.53
6	300059	东方财富	796,956.00	1.53
7	002415	海康威视	662,737.75	1.27
8	000001	平安银行	506,113.00	0.97
9	000063	中兴通讯	503,913.00	0.96
10	300070	碧水源	469,902.00	0.90
11	300498	温氏股份	446,597.96	0.85

12	300024	机器人	424,612.08	0.81
13	300017	网宿科技	387,407.00	0.74
14	002230	科大讯飞	383,866.00	0.73
15	300136	信维通信	379,063.00	0.73
16	002304	洋河股份	372,090.00	0.71
17	000895	双汇发展	364,847.00	0.70
18	601318	中国平安	359,969.00	0.69
19	300408	三环集团	358,560.00	0.69
20	300072	三聚环保	351,912.00	0.67

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	50,503,500.24
卖出股票收入（成交）总额	51,291,772.26

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规定，本基金可运用股指期货，以提高投资效率，有效控制指数的跟踪误差，更好地实现投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，本着审慎原则，适度参与股指期货投资，改善投资组合风险收益特征。另外，本基金将利用股指期货流动性好、杠杆交易的特点，进行现金管理，以应对大额申购赎回、大额现金分红等，管理流动性风险，优化投资组合对目标指数的跟踪效果，提高投资组合的运作效率等。

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宁波银行股份有限公司（以下简称“宁波银行”）和平安银行股份有限公司（以下简称“平安银行”）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。

2018 年 6 月，中国银行业监督管理委员会宁波监管局发布《宁波银监局行政处罚信息公开表》（甬银监罚决字〔2018〕6 号），对宁波银行以不正当手段违规吸收存款的行为处以罚款人民币 60 万元的行政处罚。

2018 年 7 月，中国人民银行发布《行政处罚决定书》（银反洗罚决字【2018】2 号），对平安银行未按照规定履行客户身份识别义务、未按照规定保存客户身份资料和交易记录、未按照规定

报送大额交易报告或者可疑交易报告的行为，处以罚款。

本基金投资宁波银行（002142）和平安银行（000001）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，认为上述事件对宁波银行和平安银行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	2,406.40
2	应收证券清算款	49,501.93
3	应收股利	-
4	应收利息	815.76
5	应收申购款	47,832.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	100,556.69

### 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

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五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
2,246	15,072.41	49,505.95	0.15%	33,803,124.19	99.85%

### 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（2011 年 11 月 15 日）基金份额总额	421,922,840.88
本报告期期初基金份额总额	32,789,313.45
本报告期基金总申购份额	15,702,024.93
减:本报告期基金总赎回份额	14,638,708.24
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	33,852,630.14

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人的重大人事变动如下：

2018 年 4 月 9 日，李锦女士离任基金管理人督察长。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。

2018 年 12 月 8 日，陈竽女士由于个人原因辞职，离任基金管理人督察长。基金管理人于 2018 年 12 月 8 日公告了上述事项。

2018 年 12 月 27 日起，基金管理人副总经理李锦女士兼任代理督察长。基金管理人于 2018 年 12 月 29 日公告了上述事项。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

### 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

报告期内本基金未改聘会计师事务所。报告期内本基金应支付给聘任会计师事务所——普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）2018 年度审计的报酬为 40,000.00 元。目前普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已连续七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

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。深圳证监局对相关责任人采取了行政监管措施。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报告。

2、本报告期内基金管理人收到中国证券监督管理委员会《关于对摩根士丹利华鑫基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》，责令公司进行整改。公司高度重视，开展自查并制定整改方案积极改进，并在完成整改后按要求向中国证监会、深圳证监局提交自查及整改情况报告。

除上述情况外，本报告期基金管理人、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	
海通证券	1	59,733,432.71	58.68%	55,630.61	58.68%	-
长江证券	2	18,538,823.33	18.21%	17,265.43	18.21%	-
中泰证券	1	16,898,403.83	16.60%	15,737.95	16.60%	-
华鑫证券	2	6,525,662.19	6.41%	6,077.54	6.41%	-
民生证券	1	69,949.00	0.07%	65.18	0.07%	-
国泰君安	1	29,001.44	0.03%	27.01	0.03%	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-

方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
九州证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中信证券（山东）	2	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-

注：1.专用交易单元的选择标准

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

### 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
海通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	49,503.91	100.00%	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

九州证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券(山东)	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

### 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	本公司关于旗下部分基金在招商证券股份有限公司开通基金转换业务的公告	《上海证券报》	2018年2月2日
6	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
7	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
8	本公司关于旗下基金调整停牌股票“*ST 华泽”估值方法的公告	《上海证券报》	2018年2月24日
9	本公司关于旗下部分基金在方正证券股份有限公司、中国民族证券有限责任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2日
10	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
11	本公司关于调整旗下部分开放式基金赎回费的公告	《上海证券报》	2018年3月24日
12	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
13	本基金 2017 年年度报告	《上海证券报》	2018年3月29日
14	本公司关于旗下部分基金继续参与中国工商银行个人电子银行申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2018年3月31日
15	本公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司	《上海证券报》	2018年3月31日

	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		
16	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
17	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
18	本公司高级管理人员变更公告	《上海证券报》	2018 年 4 月 10 日
19	本公司高级管理人员变更公告	《上海证券报》	2018 年 4 月 14 日
20	本公司关于旗下基金调整停牌股票“中兴通讯”估值方法的公告	《上海证券报》	2018 年 4 月 19 日
21	本基金 2018 年 1 季度报告	《上海证券报》	2018 年 4 月 21 日
22	本公司关于旗下基金调整停牌股票“万达电影”估值方法的公告	《上海证券报》	2018 年 4 月 21 日
23	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
24	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惠活动的公告	《上海证券报》	2018 年 4 月 27 日
25	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
26	本基金基金经理变更公告	《上海证券报》	2018 年 5 月 22 日
27	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
28	本基金基金经理变更公告	《上海证券报》	2018 年 6 月 13 日
29	本公司关于旗下基金调整“中兴通讯”估值方法的公告	《上海证券报》	2018 年 6 月 20 日
30	本基金招募说明书（更新）（2018 年第 1 号）	《上海证券报》	2018 年 6 月 27 日
31	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
32	本基金 2018 年 2 季度报告	《上海证券报》	2018 年 7 月 18 日
33	本公司关于旗下部分基金在上海挖财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 7 月 27 日
34	本基金 2018 年半年度报告	《上海证券报》	2018 年 8 月 27 日
35	本公司关于旗下部分基金参与华龙证券股份有限公司费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2018 年 9 月 6 日
36	本公司关于取消纸质对账单的公告	《上海证券报》	2018 年 9 月 19 日
37	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 9 月 29 日
38	本公司关于旗下基金停牌股票估值调整情况的公告	《上海证券报》	2018 年 10 月 12 日
39	本公司关于旗下基金参与上海基煜基金销售有限公司费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2018 年 10 月 19 日



40	本公司关于旗下基金停牌股票估值调整情况的公告	《上海证券报》	2018 年 10 月 19 日
41	本基金 2018 年 3 季度报告	《上海证券报》	2018 年 10 月 26 日
42	本公司关于旗下基金参与北京创金启富基金销售有限公司费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2018 年 11 月 5 日
43	本公司关于旗下基金增加中信期货有限公司为销售机构的公告	《上海证券报》	2018 年 11 月 8 日
44	本公司高级管理人员变更公告	《上海证券报》	2018 年 12 月 8 日
45	本公司关于直销网上交易停止受理汇付天下天天盈渠道认申购、定投业务的公告	《上海证券报》	2018 年 12 月 25 日
46	本公司关于旗下部分基金继续参与中国工商银行股份有限公司 2019 年定期定额投资费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2018 年 12 月 28 日
47	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投资费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2018 年 12 月 28 日
48	本基金招募说明书（更新）（2018 年第 2 号）	《上海证券报》	2018 年 12 月 28 日
49	本公司高级管理人员变更公告	《上海证券报》	2018 年 12 月 29 日

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

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

### 12.3 查阅方式

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

摩根士丹利华鑫基金管理有限公司

2019年3月27日