

摩根士丹利华鑫量化配置股票型
证券投资基金
2013 年半年度报告

2013 年 6 月 30 日

基金管理人：摩根士丹利华鑫基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2013 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2013 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	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 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	36
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	49
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	49
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	49
7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	49
7.10 投资组合报告附注	49
§8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51

§9 开放式基金份额变动	51
§10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	53
§11 备查文件目录	54
11.1 备查文件目录.....	54
11.2 存放地点.....	55
11.3 查阅方式.....	55

§ 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股票型证券投资基金
基金简称	大摩量化配置股票
基金主代码	233015
基金交易代码	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	54,939,076.82 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 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 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 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%×中信标普全债指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李锦	李芳菲
	联系电话	(0755) 88318883	(010) 66060069
	电子邮箱	xxpl@msfunds.com.cn	lifangfei@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
邮政编码		518048	100031
法定代表人		王文学	蒋超良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网 网址	www.msfunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2013 年 1 月 1 日 - 2013 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	4,388,186.32
本期利润	1,628,560.32
加权平均基金份额本期利润	0.0123
本期加权平均净值利润率	1.22%

本期基金份额净值增长率	-7.09%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)
期末可供分配利润	-3,805,115.77
期末可供分配基金份额利润	-0.0693
期末基金资产净值	51,133,961.05
期末基金份额净值	0.931
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2013年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-6.90%

注：1.本基金基金合同于2012年12月11日正式生效，截至报告期末未满一年；

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

3.期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，而非当期发生数）；

4.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

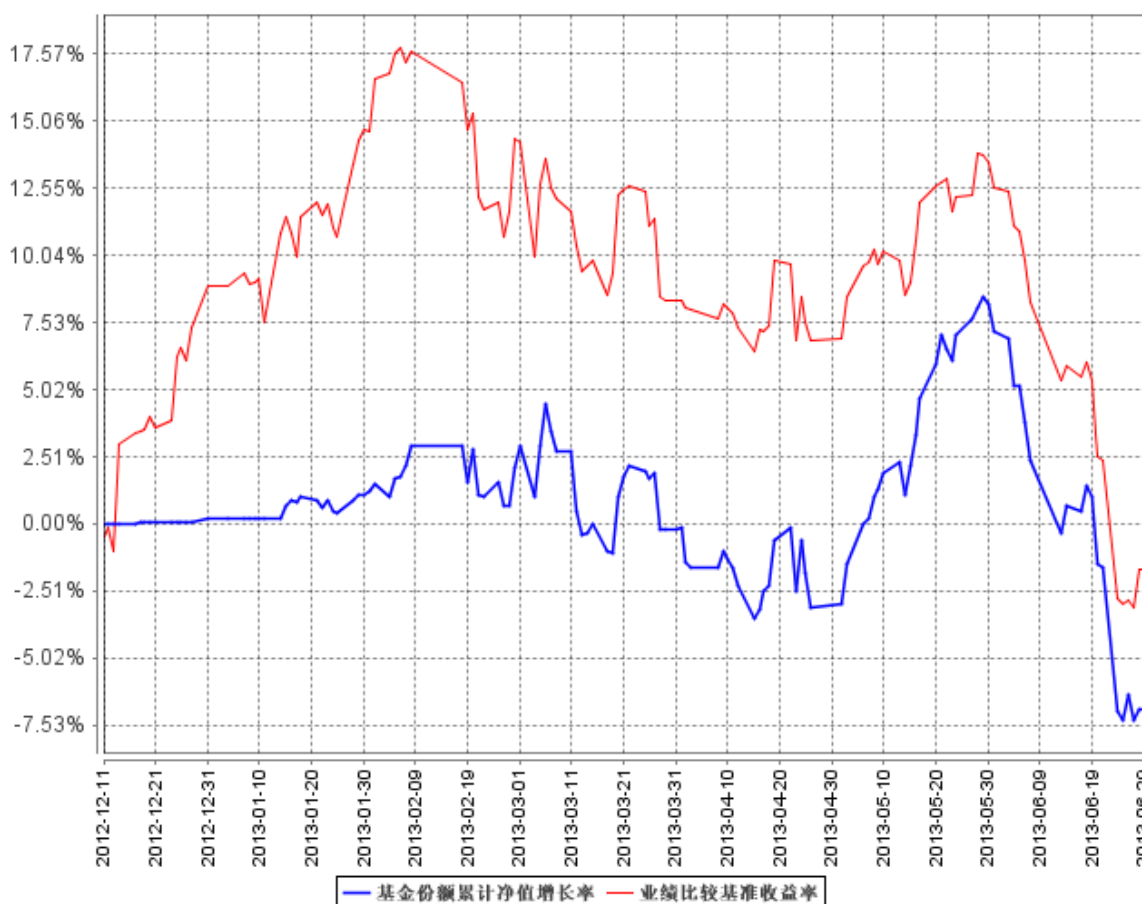
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-13.15%	1.59%	-12.66%	1.50%	-0.49%	0.09%
过去三个月	-6.71%	1.26%	-9.30%	1.17%	2.59%	0.09%
过去六个月	-7.09%	1.07%	-9.71%	1.20%	2.62%	-0.13%
自基金合同生效起至今	-6.90%	1.00%	-1.70%	1.22%	-5.20%	-0.22%

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1.本基金基金合同于2012年12月11日正式生效，截至本报告期末未满一年。

2.按照本基金基金合同的规定，基金管理人自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。建仓期结束时本基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止 2013 年 6 月 30 日，公司旗下共管理十四只开放式基金，包括摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金、摩根士丹利华鑫资源优选混合型证券投资基金（LOF）、摩根士丹利华鑫货币市场基金、摩根士丹利华鑫领先优势股票型证券投资基金、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股票型证券投资基金、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股票型证券投资基金、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股票型证券投资基金，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股票型证券投资基金、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。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		
张靖	基金经理	2012 年 12 月 11 日	-	8	武汉大学金融学硕士，曾于 2005 年 11 月至 2009 年 12 月间任职于平安证券有限责任公司，历任权证研究员、数量研究员和风险经理、股票研究员、金融工程研究员、高级业务总监。2009 年 12 月加入本公司，历任金融工程师，2011 年 5 月起任摩根士丹利华鑫多因子精选策略股票型证券投资基金基金经理，2012 年 12 月起任本基金基金经理。

注：1、基金经理的任职日期为基金合同生效之日；

2、基金经理任职已按规定在中国证券投资基金业协会办理完毕基金经理注册；

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

经对报告期内公司管理所有投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异，连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未出现基金管理人管理的所有投资组合参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况，基金管理人未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

A、大类资产配置：

①股票资产配置——去年下半年宏观经济有回暖迹象，经济复苏预期抬头，并在 QFII 增持银行股等触发因素影响下，市场在银行股的带领下大幅上扬，并持续到今年 2 月中旬。随后，市场对于复苏的强弱产生分歧，在随后的几个月中宏观经济复苏乏力，工业增加值、通胀水平、投资增速逐步回落，大盘股应声下跌。与此同时，新一届政府对刺激经济的欲望不强，更强调结构转型，以 TMT 为代表的中小盘股票在经济转型、改革红利的预期影响下，走出较强的结构性行情。报告期内，本基金处于建仓期，股票配置比例逐步提升，主要集中在成长股板块。6 月份，成长股估值高企，且与大盘蓝筹的估值偏差过大，成长股的风险在不断累积，期间本基金适当降低了股票配置比例。

②债券资产配置——报告期内本基金未配置债券资产。

B、二级资产配置：

①股票资产配置——根据量化配置模型，上半年本基金的行业配置主要集中在文化传媒、电子、国防军工、通信等成长板块，并取得了较好的收益。进入 6 月份，随着结构性行情的继续演

绎，成长股与大盘蓝筹的估值差已处于历史高位，风险逐步累积。本基金逐渐降低了上述成长板块的配置，转向业绩稳健、估值较低的大盘蓝筹，提高了蓝筹股的配置比例。

②债券资产配置——报告期内本基金未配置债券资产。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期截至 2013 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.931 元，累计份额净值为 0.931 元，基金份额净值增长率为-7.09%，同期业绩比较基准收益率为-9.71%，基金表现超越业绩比较基准 2.62 个百分点。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

由于产能过剩和结构性问题，国内经济缺乏新的增长动力；货币政策和财政政策调控的空间已十分有限，货币政策将从宽松转向稳健；美联储 QE 政策的调整对新兴经济体的影响在加大；通胀低位徘徊，企业扩张意愿不强。面临当前的经济困局，新一届政府最有可能采取的对策是维持基本增长水平，重在进行改革放权和加强市场机制在经济运行中的作用。宏观经济疲弱，企业盈利水平大幅提升的可能性较低，股票市场缺乏整体性的乐观预期和趋势性的机会。但从结构性来看：一方面，成长股与大盘蓝筹的估值差已处于极高水平，加上中报公告期临近，成长股将受到检验，成长股将面临分化；大盘蓝筹已较充分反映了市场对于宏观经济的悲观预期，蓝筹股被重新估值的概率较大，结构性修复行情有望在下半年展开。另一方面，在传统产业增长乏力，缺乏趋势性上涨的基础上，改革和调整箭在弦上，新兴产业仍然是市场青睐的品种。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

由于基金经理及相关投资研究人员对特定投资品种的估值有深入的理解，经估值委员会主任

委员同意，在需要时可以参加估值委员会会议并提出估值的建议。估值委员会对特定品种估值方法需经委员充分讨论后确定。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，在符合有关基金分红条件的前提下，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，本报告期内，本基金未进行利润分配。

§ 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

在托管摩根士丹利华鑫量化配置股票型证券投资基金的过程中，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《摩根士丹利华鑫量化配置股票型证券投资基金基金合同》、《摩根士丹利华鑫量化配置股票型证券投资基金托管协议》的约定，对摩根士丹利华鑫量化配置股票型证券投资基金管理人—摩根士丹利华鑫管理有限公司 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 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摩根士丹利华鑫量化配置股票型证券投资基金的投资运作、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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，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摩根士丹利华鑫量化配置股票型证券投资基金半年度报告中的财务指标、净值表现、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：摩根士丹利华鑫量化配置股票型证券投资基金

报告截止日：2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,396,153.16	1,052,066,909.44
结算备付金		262,123.07	-
存出保证金		50,460.21	-
交易性金融资产	6.4.7.2	24,264,187.25	-
其中：股票投资		24,264,187.25	-
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	33,400,000.00
应收证券清算款		-	10,009,520.84
应收利息	6.4.7.5	436.50	2,589,977.30
应收股利		35,372.56	-
应收申购款		25,444,232.13	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		51,452,964.88	1,098,066,407.58
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		457.38	-
应付赎回款		13,694.53	-
应付管理人报酬		36,506.67	898,488.60
应付托管费		6,084.43	149,748.10
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	158,072.69	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	104,188.13	-
负债合计		319,003.83	1,048,236.70
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	54,939,076.82	1,095,372,033.67
未分配利润	6.4.7.10	-3,805,115.77	1,646,137.21
所有者权益合计		51,133,961.05	1,097,018,170.88
负债和所有者权益总计		51,452,964.88	1,098,066,407.58

注：报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.931 元，基金份额总额 54,939,076.82 份。

6.2 利润表

会计主体：摩根士丹利华鑫量化配置股票型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
一、收入		3,507,118.63	-
1.利息收入		2,081,937.61	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,977,500.60	-
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		104,437.01	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,760,776.37	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,365,857.96	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	394,918.41	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-2,759,626.00	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,424,030.65	-
减：二、费用		1,878,558.31	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,093,480.20	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	182,246.72	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	491,695.59	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	111,135.80	-

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,628,560.32	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,628,560.32	-

注：本基金自基金合同生效日（2012 年 12 月 11 日）至本报告期末未满一年，无上年度对比数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：摩根士丹利华鑫量化配置股票型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,095,372,033.67	1,646,137.21	1,097,018,170.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,628,560.32	1,628,560.32
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）	-1,040,432,956.85	-7,079,813.30	-1,047,512,770.15
其中：1.基金申购款	93,644,682.41	-1,946,709.50	91,697,972.91
2.基金赎回款	-1,134,077,639.26	-5,133,103.80	-1,139,210,743.06
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）	54,939,076.82	-3,805,115.77	51,133,961.05
项目	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-	-
三、本期基金份额交易	-	-	-

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%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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%。本基金的业绩比较基准为： $80\% \times$ 沪深 300 指数收益率 $+20\% \times$ 中信标普全债指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《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>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《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股票型证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2013 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2013 年 6 月 30 日的财务状况以及 2013 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 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(主要为权证投资)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各类应付款项等。

6.4.4.4 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。

6.4.4.5 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(主要为权证投资)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。

6.4.4.6 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。当本基金依法 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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)。

6.4.4.9 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，其公允价值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。

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 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。

6.4.4.12 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。

6.4.4.13 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：

(a)对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌等情况，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《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(b)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计字[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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、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 号文《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》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (a) 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。
- (b) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。
- (c) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。2013 年 1 月 1 日以前，对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 计入应纳税所得额。
- (d) 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。
- (e) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
活期存款	1,396,153.16
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	1,396,153.16

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	27,023,813.25	24,264,187.25	-2,759,626.00
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	27,023,813.25	24,264,187.25	-2,759,626.00

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	295.80
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	118.00
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	22.70
合计	436.50

注：“其他”为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	158,072.69
银行间市场应付交易费用	-
合计	158,072.69

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	51.59
预提费用	104,136.54
合计	104,188.13

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,095,372,033.67	1,095,372,033.67

本期申购	93,644,682.41	93,644,682.41
本期赎回(以“-”号填列)	-1,134,077,639.26	-1,134,077,639.26
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	54,939,076.82	54,939,076.82

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,646,137.21	-	1,646,137.21
本期利润	4,388,186.32	-2,759,626.00	1,628,560.32
本期基金份额交易产生的变动数	-2,448,755.25	-4,631,058.05	-7,079,813.30
其中：基金申购款	2,867,083.15	-4,813,792.65	-1,946,709.50
基金赎回款	-5,315,838.40	182,734.60	-5,133,103.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,585,568.28	-7,390,684.05	-3,805,115.77

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	86,399.12
定期存款利息收入	1,883,157.44
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	7,033.26
其他	910.78
合计	1,977,500.60

注：“其他”为申购款利息收入和结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	152,717,650.54
减：卖出股票成本总额	150,351,792.58
买卖股票差价收入	2,365,857.96

6.4.7.13 债券投资收益

注：本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
股票投资产生的股利收益	394,918.41
基金投资产生的股利收益	-
合计	394,918.41

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
1.交易性金融资产	-2,759,626.00
——股票投资	-2,759,626.00
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-2,759,626.00

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
基金赎回费收入	1,423,733.00
转出费收入	297.65
合计	1,424,030.65

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	491,695.59
银行间市场交易费用	-
合计	491,695.59

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
审计费用	54,547.97
信息披露费	49,588.57
银行费用	6,999.26
合计	111,135.80

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系**6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
摩根士丹利华鑫基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金代销机构
华鑫证券有限责任公司（“华鑫证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
华鑫证券	151,277,392.68	45.83%	-	-

注：本基金基金合同于 2012 年 12 月 11 日正式生效，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。本基金基金合同于 2012 年 12 月 11 日正式生效，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
华鑫证券	137,724.88	46.11%	68,308.06	43.21%
关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例

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。

3.本基金基金合同于 2012 年 12 月 11 日正式生效，无上年度可比期间数据。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,093,480.20	-
其中：支付销售机构的客户维护费	547,131.85	-

注：1.支付基金管理人摩根士丹利华鑫基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 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 × 1.5% / 当年天数。

2.本基金基金合同于 2012 年 12 月 11 日正式生效，无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	182,246.72	-

注：1.支付基金托管人中国农业银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

2.本基金基金合同于 2012 年 12 月 11 日正式生效，无上年度可比期间数据。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。本基金基金合同于 2012 年 12 月 11 日正式生效，无上年度可比期间数据。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本基金本报告期无基金管理人运用自有资金投资本基金的情况。本基金基金合同于 2012 年 12 月 11 日正式生效，无上年度可比期间数据。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：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。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	1,396,153.16	86,399.12	-	-

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。本基金基金合同于2012年12月11日正式生效，无上年度可比期间数据。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。本基金基金合同于2012年12月11日正式生效，无上年度可比期间数据。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。本基金基金合同于2012年12月11日正式生效，无上年度可比期间数据。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2013年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601989	中国重工	2013年5月17日	重大事项	3.79	-	-	88,652	443,525.38	335,991.08	-
600547	山东黄金	2013年4月3日	重大事项	32.13	2013年7月1日	28.77	5,700	192,015.73	183,141.00	-
000600	建投能源	2013年5月20日	重大事项	4.07	2013年7月15日	4.31	32,661	130,408.45	132,930.27	-
000719	大地传媒	2013年5月17日	重大事项	9.61	2013年8月12日	10.57	9,200	84,563.00	88,412.00	-

600983	合肥三洋	2013年5月14日	重大事项	9.96	2013年8月14日	10.90	8,367	69,563.57	83,335.32	-
000938	紫光股份	2013年5月29日	重大事项	13.99	2013年7月26日	15.39	3,800	52,565.00	53,162.00	-
002252	上海莱士	2013年3月26日	重大事项	21.00	2013年7月2日	22.80	2,499	46,914.53	52,479.00	-
002280	新世纪	2013年6月18日	重大事项	9.06	2013年7月3日	8.70	5,651	52,838.25	51,198.06	-
002388	新亚制程	2013年6月18日	重大事项	8.03	-	-	5,100	37,418.00	40,953.00	-
002260	伊立浦	2013年6月13日	重大事项	9.17	2013年7月1日	9.73	1,900	12,046.00	17,423.00	-
300020	银江股份	2013年6月3日	重大事项	22.67	-	-	600	13,458.00	13,602.00	-
300027	华谊兄弟	2013年6月5日	重大事项	28.55	2013年7月24日	31.41	400	11,900.00	11,420.00	-
600973	宝胜股份	2013年6月18日	重大事项	7.88	2013年7月2日	8.67	1,300	10,114.00	10,244.00	-
000683	远兴能源	2013年4月8日	重大事项	4.80	2013年7月18日	5.09	1,618	8,445.96	7,766.40	-
600292	中电远达	2013年6月5日	重大事项	19.37	2013年7月1日	17.50	300	6,043.00	5,811.00	-

注：本基金截至 2013 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为进行主动投资的股票型基金，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。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。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，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管理；基金经理、投资总监以及投资决策委员会负责对基金投资业务风险进行直接管理。

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行股份有限公司，与该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 2013 年 6 月 30 日，本基金未持有债券(2012 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现产生的潜在损失。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、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票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%。本基金所持大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，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2013 年 6 月 30 日，本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2013年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,396,153.16	-	-	-	1,396,153.16
结算备付金	262,123.07	-	-	-	262,123.07
存出保证金	50,460.21	-	-	-	50,460.21
交易性金融资产	-	-	-	24,264,187.25	24,264,187.25
应收利息	-	-	-	436.50	436.50
应收股利	-	-	-	35,372.56	35,372.56
应收申购款	-	-	-	25,444,232.13	25,444,232.13
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,708,736.44	-	-	49,744,228.44	51,452,964.88
负债					
应付证券清算款	-	-	-	457.38	457.38
应付赎回款	-	-	-	13,694.53	13,694.53
应付管理人报酬	-	-	-	36,506.67	36,506.67
应付托管费	-	-	-	6,084.43	6,084.43
应付交易费用	-	-	-	158,072.69	158,072.69
其他负债	-	-	-	104,188.13	104,188.13
负债总计	-	-	-	319,003.83	319,003.83
利率敏感度缺口	1,708,736.44	-	-	49,425,224.61	51,133,961.05
上年度末 2012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	1,052,066,909.44	-	-	-	1,052,066,909.44

买入返售金融资产	33,400,000.00	-	-	-	33,400,000.00
应收证券清算款	-	-	-	10,009,520.84	10,009,520.84
应收利息	-	-	-	2,589,977.30	2,589,977.30
资产总计	1,085,466,909.44	-	-	12,599,498.14	1,098,066,407.58
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	898,488.60	898,488.60
应付托管费	-	-	-	149,748.10	149,748.10
负债总计	-	-	-	1,048,236.70	1,048,236.70
利率敏感度缺口	1,085,466,909.44	-	-	11,551,261.44	1,097,018,170.88

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2012 年 6 月 30 日，本基金未持有债券(2012 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(2012 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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，对股票资产和固定收益类资产的风险收益特征进行分析预测，确定中长期的资产配置方案。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。本基金投资组合的资产配置范围为：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%。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，测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险

进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日		上年度末 2012 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	24,264,187.25	47.45	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	24,264,187.25	47.45	-	-

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 6.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额(单位：人民币元)	
		本期末(2013 年 6 月 30 日)	上年度末(2012 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准(附注 6.4.1)上 升 5%	1,650,000.00	-
业绩比较基准(附注 6.4.1)下 降 5%	-1,650,000.00	-	

注：截止至 2012 年 12 月 31 日，本基金无足够的经验数据进行其他价格风险分析。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	24,264,187.25	47.16
	其中：股票	24,264,187.25	47.16
2	固定收益投资	-	-

	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	1,658,276.23	3.22
6	其他各项资产	25,530,501.40	49.62
7	合计	51,452,964.88	100.00

注：报告期末，本基金因基金规模变动导致股票投资比例、除股票外其他资产比例、现金类资产比例被动超标。本基金已于 7 月 5 日完成上述被动超标事项调整，符合法律法规及基金合同的相关规定。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	653,719.23	1.28
C	制造业	14,622,749.61	28.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,152,058.24	2.25
E	建筑业	14,700.00	0.03
F	批发和零售业	334,035.49	0.65
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	22,504.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,297,177.46	2.54
J	金融业	3,980,573.74	7.78
K	房地产业	1,533,731.54	3.00
L	租赁和商务服务业	69,622.00	0.14
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	188,997.60	0.37
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	331,378.16	0.65
S	综合	62,940.18	0.12
	合计	24,264,187.25	47.45

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	4,718	907,601.66	1.77
2	600016	民生银行	83,350	714,309.50	1.40
3	002353	杰瑞股份	9,168	632,592.00	1.24
4	600036	招商银行	53,721	623,163.60	1.22
5	000651	格力电器	23,813	596,753.78	1.17
6	601166	兴业银行	30,312	447,708.24	0.88
7	002142	宁波银行	46,900	397,243.00	0.78
8	601328	交通银行	92,600	376,882.00	0.74
9	600000	浦发银行	44,000	364,320.00	0.71
10	000024	招商地产	13,912	337,783.36	0.66
11	601989	中国重工	88,652	335,991.08	0.66
12	000858	五粮液	16,553	331,722.12	0.65
13	601998	中信银行	85,600	317,576.00	0.62
14	000002	万科A	30,995	305,300.75	0.60
15	000100	TCL 集团	124,382	282,347.14	0.55
16	600583	海油工程	42,061	272,134.67	0.53
17	600048	保利地产	27,196	269,512.36	0.53
18	601398	工商银行	65,669	263,989.38	0.52
19	600383	金地集团	35,717	245,018.62	0.48
20	000527	美的电器	18,299	227,273.58	0.44
21	600887	伊利股份	6,775	211,922.00	0.41
22	000568	泸州老窖	8,739	207,813.42	0.41
23	600015	华夏银行	22,200	200,244.00	0.39
24	601808	中海油服	14,084	198,443.56	0.39
25	600690	青岛海尔	17,358	189,375.78	0.37
26	600177	雅戈尔	30,270	184,949.70	0.36
27	600900	长江电力	26,628	184,265.76	0.36
28	600547	山东黄金	5,700	183,141.00	0.36
29	600718	东软集团	21,897	178,241.58	0.35
30	002065	东华软件	8,738	173,012.40	0.34
31	600271	航天信息	12,129	160,345.38	0.31
32	600893	航空动力	8,800	145,024.00	0.28
33	000895	双汇发展	3,636	139,767.84	0.27

34	002304	洋河股份	2,529	137,324.70	0.27
35	000069	华侨城 A	25,780	133,282.60	0.26
36	000600	建投能源	32,661	132,930.27	0.26
37	600839	四川长虹	71,994	128,869.26	0.25
38	600060	海信电器	11,805	122,653.95	0.24
39	600862	南通科技	38,765	121,722.10	0.24
40	000533	万家乐	32,500	118,950.00	0.23
41	002401	中海科技	11,610	118,538.10	0.23
42	002338	奥普光电	6,977	118,050.84	0.23
43	600873	梅花集团	28,106	111,580.82	0.22
44	600011	XD 华能国	20,448	109,192.32	0.21
45	002315	焦点科技	3,092	107,601.60	0.21
46	002520	日发精机	10,900	105,730.00	0.21
47	600674	川投能源	10,326	105,015.42	0.21
48	600570	恒生电子	8,339	104,237.50	0.20
49	601818	光大银行	35,623	102,950.47	0.20
50	002090	金智科技	13,814	101,394.76	0.20
51	600795	国电电力	44,272	100,940.16	0.20
52	002332	仙琚制药	8,300	96,778.00	0.19
53	002204	大连重工	9,400	96,538.00	0.19
54	002530	丰东股份	18,374	94,442.36	0.18
55	002472	双环传动	14,400	93,600.00	0.18
56	601999	出版传媒	17,012	92,545.28	0.18
57	000768	中航飞机	10,386	92,435.40	0.18
58	000410	沈阳机床	17,880	91,903.20	0.18
59	002403	爱仕达	10,548	91,767.60	0.18
60	002363	隆基机械	8,900	91,047.00	0.18
61	002132	恒星科技	24,300	90,882.00	0.18
62	002365	永安药业	11,500	90,160.00	0.18
63	601169	北京银行	11,300	90,061.00	0.18
64	002468	艾迪西	14,800	89,688.00	0.18
65	300067	安诺其	14,000	89,180.00	0.17
66	600992	贵绳股份	15,600	89,076.00	0.17
67	000719	大地传媒	9,200	88,412.00	0.17
68	002150	江苏通润	19,600	88,200.00	0.17
69	000597	东北制药	15,500	88,195.00	0.17
70	600779	水井坊	7,657	87,749.22	0.17
71	000756	新华制药	22,400	87,584.00	0.17
72	002209	达意隆	17,190	87,153.30	0.17

73	002532	新界泵业	5,200	87,152.00	0.17
74	002337	赛象科技	11,400	87,096.00	0.17
75	002001	新 和 成	5,900	86,966.00	0.17
76	002406	远东传动	12,500	86,000.00	0.17
77	600410	华胜天成	14,088	85,655.04	0.17
78	601177	杭齿前进	13,600	84,320.00	0.16
79	600983	合肥三洋	8,367	83,335.32	0.16
80	002504	东光微电	10,200	83,334.00	0.16
81	600370	三房巷	20,077	82,717.24	0.16
82	601988	中国银行	30,305	82,126.55	0.16
83	300126	锐奇股份	11,300	81,925.00	0.16
84	002342	巨力索具	14,100	80,229.00	0.16
85	002046	轴研科技	13,801	78,941.72	0.15
86	600558	大西洋	13,400	78,926.00	0.15
87	600843	上工申贝	15,000	78,150.00	0.15
88	600360	华微电子	20,400	77,724.00	0.15
89	300046	台基股份	10,700	77,361.00	0.15
90	002156	通富微电	18,200	76,440.00	0.15
91	002177	御银股份	23,012	76,399.84	0.15
92	000816	江淮动力	20,900	75,449.00	0.15
93	002122	天马股份	20,700	73,899.00	0.14
94	600702	沱牌舍得	5,024	73,802.56	0.14
95	002026	山东威达	14,500	73,515.00	0.14
96	000529	广弘控股	14,292	73,317.96	0.14
97	002282	博深工具	11,400	73,074.00	0.14
98	000799	酒 鬼 酒	4,500	72,675.00	0.14
99	600809	山西汾酒	2,945	72,152.50	0.14
100	600501	航天晨光	10,273	70,883.70	0.14
101	600197	伊力特	7,176	70,468.32	0.14
102	002101	广东鸿图	8,900	69,776.00	0.14
103	600118	中国卫星	4,682	66,390.76	0.13
104	600757	长江传媒	11,298	65,980.32	0.13
105	600829	三精制药	9,900	65,340.00	0.13
106	002380	科远股份	3,195	64,954.35	0.13
107	601991	大唐发电	12,589	64,707.46	0.13
108	600889	南京化纤	14,000	63,840.00	0.12
109	002216	三全食品	4,400	63,756.00	0.12
110	600149	廊坊发展	10,119	62,940.18	0.12
111	002054	德美化工	10,390	61,924.40	0.12

112	300130	新国都	5,769	61,785.99	0.12
113	601607	上海医药	5,800	61,654.00	0.12
114	002152	广电运通	5,409	59,390.82	0.12
115	600597	光明乳业	4,400	59,356.00	0.12
116	600523	贵航股份	6,515	59,156.20	0.12
117	601002	晋亿实业	7,400	58,978.00	0.12
118	600572	康恩贝	5,300	58,777.00	0.11
119	000078	海王生物	9,400	58,280.00	0.11
120	000716	南方食品	4,700	57,810.00	0.11
121	600529	山东药玻	6,900	57,546.00	0.11
122	600530	交大昂立	8,400	57,036.00	0.11
123	002495	佳隆股份	12,100	56,870.00	0.11
124	600165	新日恒力	6,800	56,508.00	0.11
125	002393	力生制药	1,800	56,304.00	0.11
126	601098	中南传媒	5,994	55,744.20	0.11
127	300076	宁波 GQY	4,651	55,625.96	0.11
128	002429	兆驰股份	7,376	55,246.24	0.11
129	002293	罗莱家纺	3,300	55,242.00	0.11
130	002131	利欧股份	6,551	55,028.40	0.11
131	300049	福瑞股份	6,100	54,961.00	0.11
132	600664	哈药股份	9,200	54,648.00	0.11
133	002516	江苏旷达	7,700	54,593.00	0.11
134	600848	自仪股份	10,600	54,378.00	0.11
135	600199	金种子酒	3,993	53,945.43	0.11
136	002394	联发股份	5,100	53,652.00	0.10
137	002404	嘉欣丝绸	9,300	53,382.00	0.10
138	000938	紫光股份	3,800	53,162.00	0.10
139	002252	上海莱士	2,499	52,479.00	0.10
140	002518	科士达	5,601	51,865.26	0.10
141	002280	新世纪	5,651	51,198.06	0.10
142	600161	天坛生物	3,600	50,796.00	0.10
143	002083	孚日股份	13,856	50,435.84	0.10
144	300138	晨光生物	6,400	49,920.00	0.10
145	002327	富安娜	3,900	49,842.00	0.10
146	002179	中航光电	4,115	49,380.00	0.10
147	600452	涪陵电力	6,871	48,715.39	0.10
148	600386	北巴传媒	8,243	48,468.84	0.09
149	600833	第一医药	7,300	48,180.00	0.09
150	000690	宝新能源	10,257	47,900.19	0.09

151	000153	丰原药业	6,800	47,668.00	0.09
152	002063	远光软件	3,225	46,601.25	0.09
153	002029	七匹狼	6,500	46,475.00	0.09
154	000883	湖北能源	9,289	44,865.87	0.09
155	002022	科华生物	3,000	44,430.00	0.09
156	000650	仁和药业	9,100	44,317.00	0.09
157	600216	浙江医药	2,100	43,092.00	0.08
158	002519	银河电子	4,854	42,569.58	0.08
159	002474	榕基软件	5,046	41,881.80	0.08
160	002514	宝馨科技	3,800	41,838.00	0.08
161	002275	桂林三金	2,700	41,742.00	0.08
162	002368	太极股份	2,169	41,623.11	0.08
163	300154	瑞凌股份	5,600	41,496.00	0.08
164	000919	金陵药业	6,200	41,106.00	0.08
165	002388	新亚制程	5,100	40,953.00	0.08
166	002242	九阳股份	7,060	40,736.20	0.08
167	300101	国腾电子	2,600	40,534.00	0.08
168	002196	方正电机	4,800	39,648.00	0.08
169	000623	吉林敖东	2,700	39,366.00	0.08
170	300002	神州泰岳	2,435	38,935.65	0.08
171	600232	金鹰股份	9,859	38,745.87	0.08
172	600037	歌华有线	6,300	38,178.00	0.07
173	002118	紫鑫药业	5,400	38,070.00	0.07
174	600308	华泰股份	14,158	37,943.44	0.07
175	600765	中航重机	2,800	37,632.00	0.07
176	000402	金融街	7,300	36,573.00	0.07
177	001896	豫能控股	5,894	36,365.98	0.07
178	000977	浪潮信息	1,500	36,315.00	0.07
179	600283	XD 钱江水	4,554	35,931.06	0.07
180	002084	海鸥卫浴	8,400	35,364.00	0.07
181	002491	通鼎光电	2,900	34,858.00	0.07
182	000423	东阿阿胶	900	34,812.00	0.07
183	600831	广电网络	5,200	34,684.00	0.07
184	000936	华西股份	10,096	34,023.52	0.07
185	601369	陕鼓动力	5,000	33,750.00	0.07
186	300142	沃森生物	900	33,561.00	0.07
187	600863	内蒙华电	5,900	33,335.00	0.07
188	002154	报喜鸟	5,500	33,275.00	0.07
189	002036	宜科科技	5,200	32,500.00	0.06

190	002494	华斯股份	2,563	32,498.84	0.06
191	300005	探路者	3,400	32,436.00	0.06
192	002446	盛路通信	3,638	32,269.06	0.06
193	600679	金山开发	4,278	31,528.86	0.06
194	002485	希努尔	4,600	29,394.00	0.06
195	002399	海普瑞	1,600	28,480.00	0.06
196	000711	天伦置业	5,600	28,056.00	0.05
197	600637	百视通	1,000	28,000.00	0.05
198	600056	中国医药	1,700	27,863.00	0.05
199	000558	莱茵置业	8,700	27,753.00	0.05
200	002103	广博股份	5,027	27,749.04	0.05
201	600619	海立股份	5,100	27,642.00	0.05
202	002418	康盛股份	4,800	27,408.00	0.05
203	600879	航天电子	3,980	26,705.80	0.05
204	002422	科伦药业	500	26,655.00	0.05
205	600886	国投电力	7,838	26,492.44	0.05
206	002291	星期六	5,300	26,235.00	0.05
207	601718	际华集团	10,784	26,097.28	0.05
208	300113	顺网科技	600	25,530.00	0.05
209	002003	伟星股份	3,100	25,420.00	0.05
210	000027	深圳能源	5,013	25,215.39	0.05
211	002352	鼎泰新材	1,500	25,185.00	0.05
212	600329	中新药业	1,900	24,548.00	0.05
213	600511	国药股份	1,700	24,378.00	0.05
214	002015	霞客环保	4,000	24,360.00	0.05
215	600398	凯诺科技	7,837	24,294.70	0.05
216	000880	潍柴重机	3,500	24,080.00	0.05
217	000596	古井贡酒	1,118	23,343.84	0.05
218	000611	四海股份	4,755	23,014.20	0.05
219	000726	鲁泰 A	2,690	22,703.60	0.04
220	600439	瑞贝卡	7,200	22,392.00	0.04
221	300071	华谊嘉信	1,400	22,372.00	0.04
221	000070	特发信息	2,800	22,372.00	0.04
222	600509	天富热电	2,584	22,067.36	0.04
223	600345	长江通信	1,500	21,915.00	0.04
224	300050	世纪鼎利	2,313	21,904.11	0.04
225	600100	同方股份	3,186	21,855.96	0.04
226	000586	汇源通信	4,500	21,780.00	0.04
227	002044	江苏三友	3,898	21,711.86	0.04

228	002146	荣盛发展	1,530	21,588.30	0.04
229	300110	华仁药业	2,700	21,303.00	0.04
230	600995	文山电力	4,100	21,074.00	0.04
231	300011	鼎汉技术	2,100	21,042.00	0.04
232	600680	上海普天	2,800	20,944.00	0.04
233	600776	东方通信	4,700	20,868.00	0.04
234	002117	东港股份	2,744	20,799.52	0.04
235	002089	新海宜	3,800	20,786.00	0.04
236	002366	丹甫股份	3,000	20,700.00	0.04
237	600240	华业地产	4,800	20,496.00	0.04
238	000812	陕西金叶	5,590	20,291.70	0.04
239	300109	新开源	2,788	20,157.24	0.04
240	000418	小天鹅 A	2,827	20,099.97	0.04
241	002181	粤传媒	2,300	20,010.00	0.04
242	000659	珠海中富	10,331	19,938.83	0.04
243	300031	宝通带业	2,517	19,808.79	0.04
244	600836	界龙实业	3,162	19,699.26	0.04
245	600535	天士力	500	19,575.00	0.04
246	002067	景兴纸业	9,914	19,530.58	0.04
247	600667	太极实业	7,128	19,103.04	0.04
248	002452	长高集团	1,600	18,960.00	0.04
249	600173	卧龙地产	6,700	18,894.00	0.04
250	600222	太龙药业	3,500	18,865.00	0.04
251	002397	梦洁家纺	1,700	18,785.00	0.04
252	300121	阳谷华泰	2,026	18,355.56	0.04
253	002503	搜于特	1,600	18,192.00	0.04
254	600966	博汇纸业	3,931	17,650.19	0.03
255	002281	光迅科技	700	17,584.00	0.03
256	600400	红豆股份	5,287	17,447.10	0.03
257	002260	伊立浦	1,900	17,423.00	0.03
258	600551	时代出版	1,658	17,276.36	0.03
259	300112	万讯自控	2,500	17,250.00	0.03
260	300010	立思辰	2,200	17,226.00	0.03
261	002087	新野纺织	5,400	16,902.00	0.03
262	000811	烟台冰轮	2,700	16,875.00	0.03
263	600429	三元股份	3,300	16,863.00	0.03
264	300058	蓝色光标	400	16,680.00	0.03
265	600435	北方导航	1,400	16,576.00	0.03
266	002533	金杯电工	3,200	16,512.00	0.03

267	002111	威海广泰	2,300	16,399.00	0.03
268	002508	老板电器	500	16,310.00	0.03
269	600112	长征电气	1,800	16,272.00	0.03
270	002010	传化股份	2,000	16,180.00	0.03
271	600128	弘业股份	2,300	16,146.00	0.03
272	002104	恒宝股份	1,245	16,072.95	0.03
273	002212	南洋股份	4,100	15,908.00	0.03
274	600577	精达股份	4,300	15,695.00	0.03
275	002350	北京科锐	1,900	15,675.00	0.03
276	002376	新北洋	2,000	15,620.00	0.03
277	002486	嘉麟杰	4,626	15,312.06	0.03
278	300122	智飞生物	400	15,180.00	0.03
279	300104	乐视网	580	15,051.00	0.03
280	000488	晨鸣纸业	4,200	14,994.00	0.03
281	000518	四环生物	4,700	14,993.00	0.03
282	000791	甘肃电投	2,900	14,819.00	0.03
283	300045	华力创通	1,100	14,718.00	0.03
284	002482	广田股份	700	14,700.00	0.03
285	002123	荣信股份	2,100	14,553.00	0.03
286	000671	阳光城	1,200	14,220.00	0.03
287	600510	黑牡丹	2,995	14,166.35	0.03
288	002269	美邦服饰	1,600	14,144.00	0.03
289	600791	京能置业	2,738	14,100.70	0.03
290	002420	毅昌股份	2,434	13,849.46	0.03
291	000738	中航动控	1,400	13,832.00	0.03
292	002119	康强电子	2,100	13,818.00	0.03
293	300020	银江股份	600	13,602.00	0.03
294	600340	华夏幸福	400	13,016.00	0.03
295	600027	华电国际	4,127	13,000.05	0.03
296	000917	电广传媒	1,100	12,947.00	0.03
297	000601	韶能股份	3,860	12,699.40	0.02
298	300079	数码视讯	600	12,576.00	0.02
299	600797	浙大网新	2,286	12,184.38	0.02
300	600356	恒丰纸业	2,302	12,154.56	0.02
301	600626	申达股份	3,945	11,953.35	0.02
302	000540	中天城投	1,700	11,917.00	0.02
303	600522	中天科技	1,400	11,816.00	0.02
304	000836	鑫茂科技	2,000	11,620.00	0.02
305	601139	深圳燃气	1,300	11,557.00	0.02

306	000802	北京旅游	2,900	11,513.00	0.02
307	300027	华谊兄弟	400	11,420.00	0.02
308	300036	超图软件	1,100	11,330.00	0.02
309	000796	易食股份	2,600	11,284.00	0.02
310	600054	黄山旅游	1,100	11,264.00	0.02
311	000524	东方宾馆	2,200	11,220.00	0.02
311	002033	丽江旅游	1,100	11,220.00	0.02
312	002296	辉煌科技	700	11,172.00	0.02
313	000430	张家界	1,600	11,008.00	0.02
314	000031	中粮地产	3,000	10,950.00	0.02
314	300103	达刚路机	1,000	10,950.00	0.02
315	300074	华平股份	600	10,860.00	0.02
316	300059	东方财富	800	10,840.00	0.02
317	000725	京东方 A	4,828	10,718.16	0.02
318	600749	西藏旅游	1,500	10,710.00	0.02
319	002195	海隆软件	1,100	10,692.00	0.02
320	600055	华润万东	1,100	10,593.00	0.02
321	002400	省广股份	400	10,560.00	0.02
322	600333	长春燃气	1,300	10,530.00	0.02
323	600079	人福医药	400	10,432.00	0.02
324	600332	广州药业	300	10,278.00	0.02
325	600973	宝胜股份	1,300	10,244.00	0.02
326	300069	金利华电	800	10,216.00	0.02
327	002253	川大智胜	700	10,087.00	0.02
328	600323	南海发展	1,500	10,035.00	0.02
329	002153	石基信息	500	10,010.00	0.02
330	600764	中电广通	1,400	9,996.00	0.02
331	002290	禾盛新材	1,400	9,940.00	0.02
332	600461	洪城水业	1,500	9,915.00	0.02
333	002330	得利斯	1,863	9,836.64	0.02
334	002014	永新股份	1,141	9,812.60	0.02
335	002035	华帝股份	1,000	9,790.00	0.02
336	002032	苏泊尔	800	9,624.00	0.02
337	600635	大众公用	2,500	9,550.00	0.02
338	600107	美尔雅	1,600	9,536.00	0.02
339	002232	启明信息	1,600	9,456.00	0.02
340	000561	烽火电子	1,800	9,432.00	0.02
341	600677	航天通信	1,265	9,133.30	0.02
342	600713	南京医药	2,100	9,114.00	0.02

343	600781	上海辅仁	700	9,037.00	0.02
344	002427	尤夫股份	1,800	9,036.00	0.02
345	002208	合肥城建	1,700	8,976.00	0.02
346	300035	中科电气	1,200	8,952.00	0.02
347	300120	经纬电材	1,500	8,850.00	0.02
348	002099	海翔药业	1,600	8,800.00	0.02
349	600290	华仪电气	2,200	8,756.00	0.02
350	002013	中航精机	735	8,695.05	0.02
351	600505	西昌电力	1,056	8,638.08	0.02
352	300114	中航电测	650	8,580.00	0.02
353	600592	龙溪股份	1,200	8,532.00	0.02
354	002180	万力达	1,100	8,525.00	0.02
355	000752	西藏发展	800	8,464.00	0.02
356	002004	华邦颖泰	600	8,454.00	0.02
357	600372	中航电子	400	8,380.00	0.02
358	600479	千金药业	800	8,200.00	0.02
359	300152	燃控科技	900	8,100.00	0.02
359	600580	卧龙电气	1,500	8,100.00	0.02
360	600021	上海电力	1,956	8,058.72	0.02
361	000636	风华高科	1,500	8,010.00	0.02
362	002387	黑牛食品	1,100	7,821.00	0.02
363	000929	兰州黄河	1,300	7,813.00	0.02
364	000019	深深宝 A	1,100	7,810.00	0.02
365	600616	金枫酒业	1,100	7,788.00	0.02
366	000683	远兴能源	1,618	7,766.40	0.02
367	600059	古越龙山	690	7,741.80	0.02
368	600090	啤酒花	1,300	7,592.00	0.01
369	300092	科新机电	800	7,528.00	0.01
370	600132	重庆啤酒	500	7,515.00	0.01
371	000519	江南红箭	700	7,462.00	0.01
372	000607	华智控股	2,000	7,420.00	0.01
373	600325	华发股份	1,200	7,296.00	0.01
374	002445	中南重工	1,100	7,282.00	0.01
375	600353	旭光股份	1,400	7,210.00	0.01
376	600571	信雅达	699	7,073.88	0.01
377	600071	凤凰光学	1,300	6,838.00	0.01
378	002425	凯撒股份	1,100	6,567.00	0.01
379	600067	冠城大通	800	6,392.00	0.01
380	600316	洪都航空	400	6,240.00	0.01

381	600495	晋西车轴	600	6,144.00	0.01
382	002038	双鹭药业	100	5,860.00	0.01
383	600292	中电远达	300	5,811.00	0.01
384	300123	太阳鸟	500	5,805.00	0.01
385	600391	成发科技	600	5,670.00	0.01
386	000531	穗恒运 A	600	5,616.00	0.01
387	600867	通化东宝	300	4,467.00	0.01
388	300146	汤臣倍健	100	4,399.00	0.01
389	600518	康美药业	200	3,846.00	0.01
390	300026	红日药业	100	3,394.00	0.01
391	600884	杉杉股份	300	3,237.00	0.01
392	002144	宏达高科	200	3,166.00	0.01
393	600276	恒瑞医药	100	2,636.00	0.01
394	002317	众生药业	100	2,197.00	0.00
395	002115	三维通信	290	1,600.80	0.00
396	000539	粤电力 A	300	1,356.00	0.00
397	000602	金马集团	100	1,330.00	0.00
398	600236	桂冠电力	204	658.92	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601398	工商银行	4,184,137.00	0.38
2	601808	中海油服	2,624,807.56	0.24
3	000651	格力电器	2,528,749.64	0.23
4	600519	贵州茅台	2,333,822.52	0.21
5	601988	中国银行	2,229,619.00	0.20
6	600016	民生银行	1,554,304.73	0.14
7	600583	海油工程	1,525,857.24	0.14
8	000100	TCL 集团	1,516,486.00	0.14
9	600000	浦发银行	1,493,741.25	0.14
10	002353	杰瑞股份	1,439,146.72	0.13
11	600887	伊利股份	1,422,732.00	0.13
12	000895	双汇发展	1,420,625.60	0.13

13	600036	招商银行	1,413,406.00	0.13
14	600271	航天信息	1,226,468.00	0.11
15	601166	兴业银行	1,169,121.00	0.11
16	601989	中国重工	1,128,593.00	0.10
17	600060	海信电器	1,075,236.60	0.10
18	000858	五 粮 液	1,052,359.00	0.10
19	600690	青岛海尔	997,283.13	0.09
20	600839	四川长虹	973,069.00	0.09

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601398	工商银行	3,872,405.70	0.35
2	601808	中海油服	2,473,875.94	0.23
3	601988	中国银行	2,091,742.09	0.19
4	000651	格力电器	1,907,599.68	0.17
5	600583	海油工程	1,386,773.83	0.13
6	600887	伊利股份	1,382,191.15	0.13
7	000895	双汇发展	1,373,114.44	0.13
8	000100	TCL 集团	1,327,749.79	0.12
9	600519	贵州茅台	1,289,813.95	0.12
10	600000	浦发银行	1,045,700.88	0.10
11	600060	海信电器	1,043,946.81	0.10
12	600600	青岛啤酒	1,035,689.92	0.09
13	600271	航天信息	996,722.80	0.09
14	002353	杰瑞股份	935,032.25	0.09
15	600839	四川长虹	828,360.83	0.08
16	600718	东软集团	787,941.83	0.07
17	600690	青岛海尔	742,130.14	0.07
18	600016	民生银行	732,409.30	0.07
19	600036	招商银行	726,169.57	0.07
20	002065	东华软件	719,312.57	0.07

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	177,375,605.83
卖出股票收入（成交）总额	152,717,650.54

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：报告期内，本基金未参与股指期货交易；截至报告期末，本基金未持有股指期货合约。

7.9.2 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。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体除贵州茅台酒股份有限公司（以下简称“贵州茅台”）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。

贵州茅台于 2013 年 2 月 23 日公告，其控股子公司贵州茅台酒销售有限公司于 2013 年 2 月 22 日收到贵州省物价局《行政处罚决定书》（黔价处[2013]1 号）。贵州茅台在公告中陈述了《行政处罚决定书》有关内容。

本基金投资贵州茅台（600519）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，认为上述事件对贵州茅台的投资价值未造成实质性影响。本基金管理人将继续对上述公司进行跟踪研究。

7.10.2

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。

7.10.3 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	50,460.21
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	35,372.56
4	应收利息	436.50
5	应收申购款	25,444,232.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,530,501.40

7.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有可转债。

7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构	
		机构投资者	个人投资者

		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
1,100	49,944.62	16,281,980.59	29.64%	38,657,096.23	70.36%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	26,781.24	0.0487%

注：1. 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。

2. 本基金的基金经理未持有本基金。

§ 9 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	1,095,372,033.67
本报告期基金总申购份额	93,644,682.41
减：本报告期基金总赎回份额	1,134,077,639.26
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	54,939,076.82

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人增聘孙要国先生为公司副总经理，公司于2013年3月2日公告了上述事项。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金未改变投资策略。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华鑫证券	1	151,277,392.68	45.83%	137,724.88	46.11%	-
东兴证券	1	138,225,290.84	41.87%	125,059.56	41.87%	-
中信证券	1	40,589,086.80	12.30%	35,917.54	12.02%	-

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 3 个交易单元均为新增。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华鑫证券	-	-	507,500,000.00	100.00%	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	本基金开放日常申购（赎回、转换、定期定额投资）业务公告	《上海证券报》	2013 年 1 月 10 日
2	关于本基金参与部分代销机构申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2013 年 1 月 10 日
3	本公司关于旗下基金在部分代销机构开通转换业务的公告	《上海证券报》	2013 年 1 月 10 日
4	本公司关于再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	《上海证券报》	2013 年 1 月 11 日
5	本公司关于高级管理人员变更公告	《上海证券报》	2013 年 3 月 2 日
6	本基金 2013 年第 1 季度报告	《上海证券报》	2013 年 4 月 19 日
7	本公司关于调整旗下基金对账单服务形式的公告	《上海证券报》	2013 年 4 月 25 日
8	本公司关于调整旗下基金对账单服务形式的提示性公告	《上海证券报》	2013 年 6 月 7 日
9	关于招商银行暂停办理本公司旗	《上海证券报》	2013 年 6 月 14 日

	下基金账户类及交易类业务的公告		
10	本公司关于旗下基金增加和讯信息科技有限公司为销售机构并参与申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2013 年 6 月 14 日
11	本公司关于调整旗下基金最低申购金额和最低基金转换转出份额限制的公告	《上海证券报》	2013 年 6 月 26 日
12	本公司关于旗下部分基金参与同花顺申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2013 年 6 月 28 日
13	本公司关于旗下部分基金在好买开通定投业务及参与定投费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2013 年 6 月 28 日
14	本公司关于旗下基金调整停牌股票“中国重工”估值方法的公告	《上海证券报》	2013 年 6 月 29 日
15	本公司关于旗下部分基金参与交通银行网上银行、手机银行申购费率优惠的公告	《上海证券报》	2013 年 6 月 29 日

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

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

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

11.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

11.3 查阅方式

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

摩根士丹利华鑫基金管理有限公司

2013 年 8 月 27 日