

摩根士丹利华鑫主题优选股票型证券投资基金

2012 年半年度报告

2012 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一二年八月二十九日

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2012 年 3 月 13 日（基金合同生效日）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.....	7
2.5	其他相关资料.....	7
3	主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1	主要会计数据和财务指标.....	7
3.2	基金净值表现.....	8
4	管理人报告.....	9
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	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.....	10
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.....	11
5	托管人报告.....	12
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	12
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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的真实、准确和完整发表意见.....	12
6	半年度财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1	资产负债表.....	12
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.....	33
7.1	期末基金资产组合情况.....	33
7.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	33
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.....	34
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	35
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	37
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.....	37
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.....	37
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.....	37
7.9	投资组合报告附注.....	37

8	基金份额持有人信息.....	38
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	38
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	38
9	开放式基金份额变动.....	39
10	重大事件揭示.....	39
10.1	基金份额持有人大会决议.....	39
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.....	39
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	39
10.4	基金投资策略的改变.....	39
10.5	报告期内改聘会计师事务所情况.....	40
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.....	40
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	40
10.8	其他重大事件.....	42
11	影响投资者决策的其他重要信息.....	43
12	备查文件目录.....	43
12.1	备查文件目录.....	43
12.2	存放地点.....	44
12.3	查阅方式.....	44

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	摩根士丹利华鑫主题优选股票型证券投资基金
基金简称	大摩主题优选股票
基金主代码	233011
交易代码	233011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年3月13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	188,651,884.41份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金力图通过把握中国经济发展和结构转型环境下的主题投资机会，在控制风险并保持基金资产良好的流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>(1) 资产配置策略</p> <p>本基金将通过分析宏观经济环境的深入分析，采取“自上而下”的顺序，结合定性分析和定量分析方法的结论，以实现大类资产的动态配置。</p> <p>(2) 主题选择策略</p> <p>本基金采用自上而下的“主题投资分析框架”，通过主题挖掘、主题配置和主题投资三个步骤，筛选出主题特征明显、成长性好的优质股票构建股票投资组合。</p> <p>本基金所指的“主题”，是指国内外实体经济、政府政策、科学技术、社会变迁、金融市场等层面已经发生或预期将发生的，将导致行业或企业竞争力提升、盈利水平改善的驱动因素。</p> <p>(3) 行业选择和配置</p> <p>本基金将挑选主题特征明显和预期具有良好增长前景的行业进行重点投资。</p>

	<p>(4) 股票选择</p> <p>在前述主题配置和行业优选的基础上，本基金综合运用各种股票研究分析方法和其它投资分析工具，采用自下而上方式精选主题特征鲜明，具有投资潜力的股票构建股票投资组合。</p> <p>(5) 债券投资</p> <p>在债券投资方面，本基金可投资于国债、央行票据、金融债、企业债和可转换债券等债券品种。本基金的债券投资采取主动的投资管理方式，获得与风险相匹配的投资收益，以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。</p> <p>(6) 权证投资策略</p> <p>本基金的权证投资以权证的市场价值分析为基础，配以权证定价模型寻求其合理估值水平，以主动式的科学投资管理为手段，充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，追求基金资产稳定的当期收益。</p> <p>(7) 资产支持证券的投资策略</p> <p>本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后的收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。</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	本基金为一只主动投资的股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		摩根士丹利华鑫基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李锦	尹东
	联系电话	(0755) 88318883	(010) 67595003
	电子邮箱	xxpl@msfunds.com.cn	yindong.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	北京市西城区金融大街25号

	嘉里建设广场第二座第 17 层 01-04 室	
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	王文学	王洪章

2.4 信息披露方式

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

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（2012 年 3 月 13 日（基金合同生效日）至 2012 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	1,820,247.37
本期利润	372,233.33
加权平均基金份额本期利润	0.0013
本期加权平均净值利润率	0.13%
本期基金份额净值增长率	0.10%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	266,331.99
期末可供分配基金份额利润	0.0014
期末基金资产净值	188,918,216.40
期末基金份额净值	1.001
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2012 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	0.10%

注：1.本基金基金合同于 2012 年 3 月 13 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

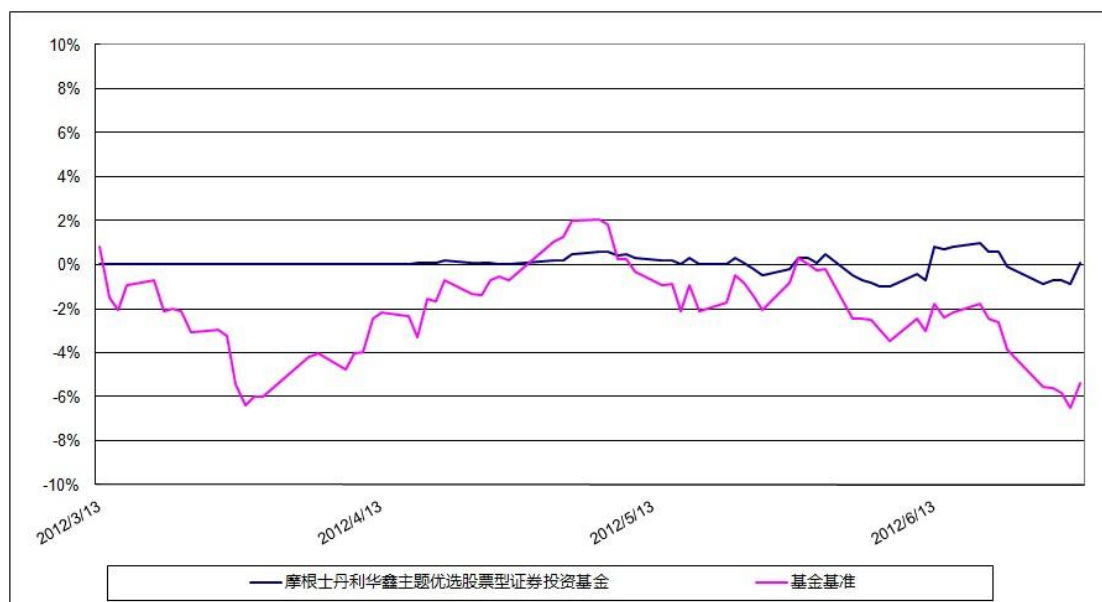
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.00%	0.57%	-5.12%	0.87%	5.12%	-0.30%
过去三个月	0.10%	0.36%	0.67%	0.90%	-0.57%	-0.54%
自基金合同生效起至今	0.10%	0.32%	-5.37%	0.93%	5.47%	-0.61%

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

摩根士丹利华鑫主题优选股票型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2012年3月13日至2012年6月30日）



注：1.本基金基金合同于2012年3月13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。截至本报告期末，本基金仍处于建仓期。

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是一家中外合资基金管理公司，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。基金管理人旗下共管理十只开放式基金，即本基金、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。本基金是基金管理人管理的第十只基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
盛军锋	本基金基金 经理	2012-03-13	-	6	暨南大学产业经济学博士。曾任中国人民银行深圳中心支行货币信贷管理科科员，宝盈基金管理有限公司研究员、基金经理。2011年4月加入本公司。

- 注：1、基金经理任职日期为基金合同生效之日；
2、基金经理任职已按规定在中国证券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合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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

上半年在国内经济下滑、货币政策逐步放松、财政政策适度宽松的背景下，A 股市场呈现先扬后抑走势。一季度，在库存回补背景下，周期股走出了一波上涨行情，我们重点关注了由于库存回补带来的中上游价格短期上涨导致的周期股投资机会，同时对于产业政策重点扶持的方向，如高铁、水利、新能源等也进行了重点布局。二季度我们适度降低股票仓位，重点配置了消费类板块股票。上半年，本基金处于建仓期间，截至报告期末，股票的持仓比例为 39.10%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2012 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.001 元，累计份额净值为 1.001 元，报告期内基金份额净值增长率为 0.10%，同期业绩比较基准收益率为-5.37%，基金超越业绩比较基准 5.47 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

未来一段时间市场将处于经济与政策的观察期。第一，在持续宽松的货币政策影响下，经济增速和需求短期难以显著回升，但累计效应逐步增加，经济有望企稳回升，但我们对其力度和幅度预期不高。第二，从实体经济看，三季度企业去库存过程仍将持续，但程度较二季度会有所缓和，企业盈利继续面临下调风险，但由于成本下降，毛利率有望回升。第三，随着欧债危机逐步解决，以及美国经济内生复苏，海外经济有望逐步向好，但仍需要较长时

间形成稳固的复苏趋势。总体来说，下半年股市仍存在不少变数，我们认为市场将见底回升，但中长期看，仍注重自下而上选择业绩确定的成长性个股。下半年我们重点关注以下几方面的投资机会：

(1) 看好政策反转和刺激政策所提供的主题投资机会；

(2) 以医药、白酒为代表的消费行业和部分成长性良好的中小板企业，估值水平合理，长期投资价值显现，我们将重点予以关注；

(3) 国家重点扶持的战略新兴产业的投资机会。

投资策略方面，我们仍将以控制仓位、精选个股为主。

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、律师事务所的沟通、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，本基金收益每年度最多分配 4

次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 25%。

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。

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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：摩根士丹利华鑫主题优选股票型证券投资基金

报告截止日：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日
资 产：		

银行存款	6.4.7.1	47,587,142.67
结算备付金		5,941,849.17
存出保证金		147.20
交易性金融资产	6.4.7.2	87,072,739.18
其中：股票投资		73,872,027.18
基金投资		-
债券投资		13,200,712.00
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	-
应收证券清算款		50,021,119.44
应收利息	6.4.7.5	206,977.24
应收股利		-
应收申购款		12,055.35
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		190,842,030.25
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 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		1,019,436.43
应付赎回款		386,039.13
应付管理人报酬		241,759.21
应付托管费		40,293.20
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	100,136.09
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	136,149.79
负债合计		1,923,813.85
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	188,651,884.41
未分配利润	6.4.7.10	266,331.99
所有者权益合计		188,918,216.40
负债和所有者权益总计		190,842,030.25

注：1、报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.001 元，基金份额总额

188,651,884.41 份。

2、本基金自基金合同生效日（2012 年 3 月 13 日）至本报告期末未满半年，无上年度末数据。

6.2 利润表

会计主体：摩根士丹利华鑫主题优选股票型证券投资基金

本报告期：2012 年 3 月 13 日（基金合同生效日）至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2012 年 3 月 13 日（基金合同生效日）至 2012 年 6 月 30 日
一、收入		2,173,180.03
1.利息收入		1,991,228.71
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,151,006.56
债券利息收入		42,462.41
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		797,759.74
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,311,433.08
其中：股票投资收益	6.4.7.12	885,888.36
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	425,544.72
3.公允价值变动收益（损失以 “-”号填列）	6.4.7.16	-1,448,014.04
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	318,532.28
减：二、费用		1,800,946.70
1. 管理人报酬		1,301,178.12
2. 托管费		216,863.01
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	142,555.04
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	140,350.53
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		372,233.33
减: 所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		372,233.33

注: 1、本财务报表的实际编制期间为 2012 年 3 月 13 日(基金合同生效日)至 2012 年 6 月 30 日。

2、本基金自基金合同生效日(2012 年 3 月 13 日)至本报告期末未满一年, 无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 摩根士丹利华鑫主题优选股票型证券投资基金

本报告期: 2012 年 3 月 13 日(基金合同生效日)至 2012 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2012 年 3 月 13 日(基金合同生效日)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)	442,752,834.36	-	442,752,834.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	372,233.33	372,233.33
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)	-254,100,949.95	-105,901.34	-254,206,851.29
其中: 1.基金申购款	609,356.26	1,101.31	610,457.57
2.基金赎回款	-254,710,306.21	-107,002.65	-254,817,308.86
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)	188,651,884.41	266,331.99	188,918,216.40

注: 1、本财务报表的实际编制期间为 2012 年 3 月 13 日(基金合同生效日)至 2012 年 6 月 30 日。

2、本基金自基金合同生效日(2012 年 3 月 13 日)至本报告期末未满一年, 无上年度可比期间数据。

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

基金管理公司负责人：于华；主管会计工作负责人：沈良；会计机构负责人：周源

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

摩根士丹利华鑫主题优选股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]第 1378 号《关于核准摩根士丹利华鑫主题优选股票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《摩根士丹利华鑫主题优选股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 442,672,779.80 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(2012)第 50 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《摩根士丹利华鑫主题优选股票型证券投资基金基金合同》于 2012 年 3 月 13 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 442,752,834.36 份基金份额，其中认购资金利息折合 80,054.56 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《摩根士丹利华鑫主题优选股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，主要包括：国内依法发行上市的股票（包括创业板、中小板股票及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（包括交易所和银行间两个市场的国债、金融债、企业债与可转换债等）、短期金融工具（包括到期日在一年以内的债券、债券回购、央行票据、短期融资券等）、现金资产、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 60%-95%；股票投资主要集中于本基金所确定五大类投资主题中精选出的股票，投资于该类上市公司的比例不低于本基金股票资产的 80%。除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 5%-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%。

本基金的业绩比较基准为：80%×沪深 300 指数收益率+20%×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》、《摩根士丹利华鑫主题优选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 2012 年 3 月 13 日(基金合同生效日)至 2012 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2012 年 6 月 30 日的财务状况以及 2012 年 3 月 13 日(基金合同生效日)至 2012 年 6 月 30 日止期间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 2012 年 3 月 13 日(基金合同生效日)至 2012 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。

本基金持有的股票投资和债券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。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，于交易日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已宣告但尚未发放的现金股利或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。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

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和债券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。当本基金依法有权抵销债权债务且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(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)为正数，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(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，不需要进行分部报告的披露。

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[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、现金流量折现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

本基金本报告期会计政策未变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期会计估计未变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期未进行差错更正。

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[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)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。

(2)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。

(3)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。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。

(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。

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 2012 年 6 月 30 日
活期存款	47,587,142.67
定期存款	-
其他存款	-
合计	47,587,142.67

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	75,306,090.34	73,872,027.18	-1,434,063.16	
债券	交易所市场	3,234,992.88	3,196,712.00	-38,280.88
	银行间市场	9,979,670.00	10,004,000.00	24,330.00
	合计	13,214,662.88	13,200,712.00	-13,950.88
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	88,520,753.22	87,072,739.18	-1,448,014.04	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应收活期存款利息	8,287.36
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2,673.90
应收债券利息	196,015.98
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	206,977.24

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
交易所市场应付交易费用	99,961.09
银行间市场应付交易费用	175.00
合计	100,136.09

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,454.79
预提费用	134,695.00
合计	136,149.79

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012 年 3 月 13 日（基金合同生效日）至 2012 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	442,752,834.36	442,752,834.36
本期申购	609,356.26	609,356.26
本期赎回（以“-”号填列）	-254,710,306.21	-254,710,306.21
本期末	188,651,884.41	188,651,884.41

注：1. 申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

2. 本基金自 2012 年 2 月 13 日至 2012 年 3 月 9 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 442,672,779.80 元。根据《摩根士丹利华鑫主题优选股票型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 80,054.56 元在本基金成立后，折算为 80,054.56 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	1,820,247.37	-1,448,014.04	372,233.33
本期基金份额交易产生的变动数	-276,475.01	170,573.67	-105,901.34
其中：基金申购款	2,428.75	-1,327.44	1,101.31
基金赎回款	-278,903.76	171,901.11	-107,002.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,543,772.36	-1,277,440.37	266,331.99

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 3 月 13 日（基金合同生效日）至 2012 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	189,924.60
定期存款利息收入	930,208.32
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	30,873.62
其他	0.02
合计	1,151,006.56

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 3 月 13 日（基金合同生效日）至 2012 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	21,975,114.52

减：卖出股票成本总额	21,089,226.16
买卖股票差价收入	885,888.36

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

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 2012年3月13日（基金合同生效日）至2012年6月30日
股票投资产生的股利收益	425,544.72
基金投资产生的股利收益	-
合计	425,544.72

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年3月13日（基金合同生效日）至2012年6月30日
1.交易性金融资产	-1,448,014.04
——股票投资	-1,434,063.16
——债券投资	-13,950.88
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-1,448,014.04

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年3月13日（基金合同生效日）至2012年6月30日
基金赎回费收入	313,004.53
基金转出费收入	5,527.75
合计	318,532.28

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2012年3月13日（基金合同生效日）至2012年6月30日
交易所市场交易费用	142,380.04
银行间市场交易费用	175.00
合计	142,555.04

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2012年3月13日（基金合同生效日）至2012年6月30日
审计费用	22,448.80
信息披露费	112,246.20
银行费用	4,755.53
其他	900.00
合计	140,350.53

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，本基金无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无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
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	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：上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

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行交易。本基金基金合同于 2012 年 3 月 13 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 2012年3月13日（基金合同生效日）至2012年6月30日	
	当期发生的基金应支付的管理费	1,301,178.12
其中：支付销售机构的客户维护费	787,840.23	

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 3 月 13 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 2012年3月13日（基金合同生效日）至2012年6月30日	
	当期发生的基金应支付的托管费	216,863.01

注：1.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 0.25%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 3 月 13 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

本基金本报告期末与关联方进行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 3 月 13 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固有资金投资本基金的情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。本基金基金合同于 2012 年 3 月 13 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

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。本基金基金合同于 2012 年 3 月 13 日正式生效，无上年度末数据。

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 2012年3月13日（基金合同生效日）至2012年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	47,587,142.67	189,924.60

注：1、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。
2、本基金基金合同于 2012 年 3 月 13 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

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 3 月 13 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

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 3 月 13 日正式生效，无上年度可比期间数据。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2012 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

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

本基金为股票型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，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，将风险控制可在可承受的范围内。

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建设银行股份有限公司，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 2012 年 6 月 30 日，本基金持有除国债、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 1.69%。本基金基金合同于 2012 年 3 月 13 日正式生效，无上年度末数据。

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的难易程度。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，其余均能及时变现。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。

本基金所持有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。

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 2012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	47,587,142.67	-	-	-	47,587,142.67
结算备付金	5,941,849.17	-	-	-	5,941,849.17
存出保证金	-	-	-	147.20	147.20
交易性金融资产	10,004,000.00	1,998,200.00	1,198,512.00	73,872,027.18	87,072,739.18
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	50,021,119.44	50,021,119.44
应收利息	-	-	-	206,977.24	206,977.24
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	12,055.35	12,055.35
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	63,532,991.84	1,998,200.00	1,198,512.00	124,112,326.41	190,842,030.25
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	1,019,436.43	1,019,436.43
应付赎回款	-	-	-	386,039.13	386,039.13
应付管理人报酬	-	-	-	241,759.21	241,759.21
应付托管费	-	-	-	40,293.20	40,293.20
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	100,136.09	100,136.09
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	136,149.79	136,149.79
负债总计	-	-	-	1,923,813.85	1,923,813.85
利率敏感度缺口	63,532,991.84	1,998,200.00	1,198,512.00	122,188,512.56	188,918,216.40

注：1.表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

2.本基金基金合同于 2012 年 3 月 13 日正式生效，无上年度末数据。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2012 年 6 月 30 日,本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 6.99%,因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。本基金基金合同于 2012 年 3 月 13 日正式生效,无上年度末数据。

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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中,采用“自上而下”的策略,结合定性分析和定量分析方法的结论,以实现大类资产的动态配置。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。本基金投资组合中股票资产占基金资产的 60%-95%,股票投资主要集中于本基金所确定五大类投资主题中精选出的股票,投资于该类上市公司的比例不低于本基金股票资产的 80%。除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 5%-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,包括 VaR(Value at Risk)指标等来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 2012 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	73,872,027.18	39.10
衍生金融资产-权证	-	-

投资		
其他	-	-
合计	73,872,027.18	39.10

注：本基金基金合同于 2012 年 3 月 13 日正式生效，无上年度末数据。

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）
		本期末 2012 年 6 月 30 日
	业绩比较基准(附注6.4.1) 上升5%	193.00万元
	业绩比较基准(附注6.4.1) 下降5%	-193.00万元

注：本基金基金合同于 2012 年 3 月 13 日正式生效，无上年度末数据。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于 2012 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 77,068,739.18 元，属于第二层级的余额为 10,004,000.00 元，无属于第三层级的余额。

(iii) 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或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层级；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级或第三层级。

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	73,872,027.18	38.71
	其中：股票	73,872,027.18	38.71
2	固定收益投资	13,200,712.00	6.92
	其中：债券	13,200,712.00	6.92
	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	53,528,991.84	28.05
6	其他各项资产	50,240,299.23	26.33
7	合计	190,842,030.25	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,512,046.80	0.80
B	采掘业	-	-
C	制造业	24,312,076.68	12.87

C0	食品、饮料	10,456,824.00	5.54
C1	纺织、服装、皮毛	27,294.00	0.01
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	4,857,189.68	2.57
C5	电子	291,240.00	0.15
C6	金属、非金属	1,327,050.00	0.70
C7	机械、设备、仪表	4,391,739.00	2.32
C8	医药、生物制品	2,960,740.00	1.57
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	1,923,834.00	1.02
G	信息技术业	2,675,340.00	1.42
H	批发和零售贸易	8,939,403.08	4.73
I	金融、保险业	34,242,026.62	18.13
J	房地产业	267,300.00	0.14
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	73,872,027.18	39.10

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	000858	五粮液	290,100	9,503,676.00	5.03
2	600837	海通证券	775,300	7,466,139.00	3.95
3	601628	中国人寿	406,366	7,436,497.80	3.94
4	600015	华夏银行	551,750	5,225,072.50	2.77
5	002024	苏宁电器	578,400	4,852,776.00	2.57
6	601601	中国太保	217,020	4,813,503.60	2.55
7	600030	中信证券	335,400	4,236,102.00	2.24
8	000423	东阿阿胶	74,000	2,960,740.00	1.57
9	000686	东北证券	169,458	2,904,510.12	1.54
10	002063	远光软件	182,000	2,640,820.00	1.40
11	600859	王府井	94,000	2,571,840.00	1.36
12	601336	新华保险	63,090	2,160,201.60	1.14
13	002492	恒基达鑫	169,800	1,923,834.00	1.02

14	300171	东富龙	63,054	1,797,039.00	0.95
15	002350	北京科锐	153,000	1,759,500.00	0.93
16	000887	中鼎股份	200,000	1,698,000.00	0.90
17	002440	闰土股份	100,000	1,452,000.00	0.77
18	600153	建发股份	186,913	1,338,297.08	0.71
19	600176	中国玻纤	135,000	1,327,050.00	0.70
20	002014	永新股份	64,744	1,001,589.68	0.53
21	000860	顺鑫农业	55,340	886,546.80	0.47
22	601717	郑煤机	72,000	835,200.00	0.44
23	600887	伊利股份	40,000	823,200.00	0.44
24	300031	宝通带业	70,000	705,600.00	0.37
25	002069	獐子岛	30,000	625,500.00	0.33
26	300303	聚飞光电	12,000	291,240.00	0.15
27	000002	万科A	30,000	267,300.00	0.14
28	000861	海印股份	11,100	176,490.00	0.09
29	000895	双汇发展	2,100	129,948.00	0.07
30	300170	汉得信息	2,000	34,520.00	0.02
31	002327	富安娜	600	27,294.00	0.01

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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601628	中国人寿	12,397,721.76	6.56
2	000858	五粮液	9,697,303.77	5.13
3	600837	海通证券	7,945,607.00	4.21
4	601601	中国太保	7,629,590.40	4.04
5	600015	华夏银行	5,658,428.00	3.00
6	601336	新华保险	5,208,958.86	2.76
7	002024	苏宁电器	4,966,873.00	2.63
8	600030	中信证券	4,307,981.00	2.28
9	000686	东北证券	2,973,834.76	1.57
10	000423	东阿阿胶	2,869,453.18	1.52
11	600859	王府井	2,806,829.56	1.49
12	002069	獐子岛	2,438,591.50	1.29
13	002063	远光软件	2,317,000.00	1.23
14	601555	东吴证券	2,206,132.00	1.17
15	002430	杭氧股份	2,193,452.00	1.16

16	000887	中鼎股份	2,086,091.00	1.10
17	002492	恒基达鑫	1,944,210.00	1.03
18	002350	北京科锐	1,853,586.00	0.98
19	300171	东富龙	1,642,878.63	0.87
20	300064	豫金刚石	1,615,318.56	0.86

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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601628	中国人寿	5,385,820.00	2.85
2	601336	新华保险	3,486,026.00	1.85
3	601601	中国太保	3,343,530.50	1.77
4	002430	杭氧股份	2,319,541.10	1.23
5	601555	东吴证券	2,300,676.00	1.22
6	002069	獐子岛	1,768,789.00	0.94
7	300064	豫金刚石	1,730,543.92	0.92
8	002073	软控股份	760,900.00	0.40
9	300224	正海磁材	453,288.00	0.24
10	601002	晋亿实业	426,000.00	0.23
11	-	-	-	-
12	-	-	-	-
13	-	-	-	-
14	-	-	-	-
15	-	-	-	-
16	-	-	-	-
17	-	-	-	-
18	-	-	-	-
19	-	-	-	-
20	-	-	-	-

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

买入股票的成本（成交）总额	96,395,316.50
卖出股票的收入（成交）总额	21,975,114.52

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,004,000.00	5.30
	其中：政策性金融债	10,004,000.00	5.30
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	3,196,712.00	1.69
8	其他	-	-
9	合计	13,200,712.00	6.99

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	100229	10 国开 29	100,000	10,004,000.00	5.30
2	110015	石化转债	20,000	1,998,200.00	1.06
3	113003	重工转债	11,480	1,198,512.00	0.63
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

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

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

本基金本报告期末未持有权证。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本报告期内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、处罚的情形。

7.9.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.9.3 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	147.20
2	应收证券清算款	50,021,119.44
3	应收股利	-
4	应收利息	206,977.24
5	应收申购款	12,055.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	50,240,299.23

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110015	石化转债	1,998,200.00	1.06

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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
3,773	50,000.50	5,207,133.88	2.76%	183,444,750.53	97.24%

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
----	-----------	----------

基金管理公司所有从业人员持有本基金	355,737.23	0.1886%
-------------------	------------	---------

注：1. 本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 0 至 10 万份（含）。

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 3 月 13 日）基金份额总额	442,752,834.36
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	609,356.26
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	254,710,306.21
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	188,651,884.41

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，基金管理人增聘沈良先生为公司副总经理，公司于 2012 年 5 月 19 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 报告期内改聘会计师事务所情况

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	
兴业证券	1	57,819,992.16	48.85%	49,675.52	49.57%	-
华创证券	1	49,768,623.28	42.04%	41,228.67	41.14%	-
中信证券	2	8,029,385.58	6.78%	6,915.81	6.90%	-
民生证券	1	2,427,330.00	2.05%	2,119.08	2.11%	-
国泰君安	1	299,200.00	0.25%	243.10	0.24%	-
长江证券	2	25,900.00	0.02%	22.01	0.02%	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
中信万通	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-

中信建投	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-

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，本基金共租用 29 家证券公司的 36 个专用交易单元：华鑫证券、中信证券、东方证券、长江证券、中银国际、方正证券、安信证券各 2 个，金元证券、中信万通、民生证券、国泰君安、广发证券、光大证券、兴业证券、银河证券、华创证券、平安证券、中金公司、国海证券、海通证券、申银万国、西部证券、中投证券、齐鲁证券、国信证券、中信建投、瑞银证券、国金证券、东莞证券各 1 个。

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		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
兴业证券	2,090,000.00	100.00%	1,589,000,000.00	32.74%	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	1,283,000,000.00	26.43%	-	-
民生证券	-	-	40,000,000.00	0.82%	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	1,892,000,000.00	38.98%	-	-
东方证券	-	-	50,000,000.00	1.03%	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

海通证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
中信万通	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-

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	本基金招募说明书	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2012-02-07
2	本基金基金合同摘要	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2012-02-07
3	本基金基金份额发售公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2012-02-07
4	本基金基金合同	本公司网站	2012-02-07
5	本基金托管协议	本公司网站	2012-02-07
6	关于本基金增加代销机构的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2012-02-10
7	关于本基金增加中国工商银行为代销机构的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2012-02-29

8	本基金基金合同生效公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2012-03-14
9	关于本基金增加兴业证券为代销机构的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2012-04-12
10	关于本基金参与部分销售机构申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2012-04-12
11	本公司关于高级管理人员变更公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2012-05-19
12	本公司关于旗下基金增加深圳众禄基金销售有限公司为代销机构并参与申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2012-06-05
13	本公司关于旗下基金增加杭州数米基金销售有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2012-06-08
14	本公司关于旗下基金增加浙江同花顺基金销售有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2012-06-20
15	本公司关于旗下基金参与交通银行网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2012-06-28
16	本公司关于旗下基金参与中信银行电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2012-06-28

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

11 影响投资者决策的其他重要信息

2012 年 1 月 16 日，本基金托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长任职的公告，自 2012 年 1 月 16 日起，王洪章先生就任中国建设银行股份有限公司董事长、执行董事。

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

二〇一二年八月二十九日