

摩根士丹利华鑫多因子精选策略股票型证券投资基金

摩根士丹利华鑫领先优势股票型证券投资基金

2011 第三季度报告

2011年9月30日

2011 第三季度报告

2011年9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:二〇一一年十月二十四日

重要提示
基金管理人及基金托管人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责任。
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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失或收益不受保证。

基金投资组合
截至2011年9月30日止,本基金资产组合如下:
1.权益投资 589,950,931.80 74.08%
2.其中:股票 589,950,931.80 74.08%
3.固定收益投资 14,745,500.00 1.85%
4.买入返售金融资产 80,000,000.00 10.05%
5.银行存款和结算备付金合计 37,759,050.61 4.73%
6.其他各项资产 27,845,776.36 3.50%
7.合计 796,321,261.77 100.00%

投资策略
本基金通过多因子量化模型方法,精选股票进行投资,在充分控制风险的前提下力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
本基金采用数量化模型驱动的投资策略,结合适当的资产配置策略。
1.股票投资策略
本基金以“量化投资”为主要投资策略,通过基金管理人开发的“多因子阿尔法模型”进行选股并据此构建股票投资组合。多因子阿尔法模型在控制市场风险和特定行业风险的前提下,优化股票投资组合。

主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益 16,042,933.40
2.本期利润 -65,093,555.95
3.加权平均基金份额本期利润 -0.0674
4.期末基金资产净值 788,033,147.68
5.期末基金份额净值 0.936

基金经理
姓名 职务 任职日期 离任日期
张靖 本基金基金经理 2011-5-17 - 6

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:二〇一一年十月二十四日
重要提示
基金管理人及基金托管人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责任。

基金投资组合
截至2011年9月30日止,本基金资产组合如下:
1.权益投资 8,300,502.50 2.54%
2.其中:股票 8,300,502.50 2.54%
3.固定收益投资 266,928,233.52 81.71%
4.买入返售金融资产 296,929,392.28 88.21%
5.银行存款和结算备付金合计 3,650,324.96 1.12%
6.其他各项资产 4,968,334.65 1.52%
7.合计 326,667,699.65 100.00%

投资策略
本基金采取自上而下资产配置和自下而上个股精选相结合的投资策略。
1.资产配置策略
本基金根据对宏观经济、政策、市场、行业、个股的综合分析,动态调整资产配置比例,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。
2.个股精选策略
本基金采用定量与定性相结合的方法,从基本面、估值、技术面等多个角度对个股进行筛选,构建股票投资组合。

主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益 -9,238,434.26
2.本期利润 -68,718.17
3.加权平均基金份额本期利润 -0.0106
4.期末基金资产净值 324,107,380.10
5.期末基金份额净值 1.0246

基金经理
姓名 职务 任职日期 离任日期
张靖 本基金基金经理 2011-6-3 - 15

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:二〇一一年十月二十四日

重要提示
基金管理人及基金托管人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责任。
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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失或收益不受保证。

基金投资组合
截至2011年9月30日止,本基金资产组合如下:
1.权益投资 8,300,502.50 2.54%
2.其中:股票 8,300,502.50 2.54%
3.固定收益投资 266,928,233.52 81.71%
4.买入返售金融资产 296,929,392.28 88.21%
5.银行存款和结算备付金合计 3,650,324.96 1.12%
6.其他各项资产 4,968,334.65 1.52%
7.合计 326,667,699.65 100.00%

投资策略
本基金采取自上而下资产配置和自下而上个股精选相结合的投资策略。
1.资产配置策略
本基金根据对宏观经济、政策、市场、行业、个股的综合分析,动态调整资产配置比例,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。
2.个股精选策略
本基金采用定量与定性相结合的方法,从基本面、估值、技术面等多个角度对个股进行筛选,构建股票投资组合。

主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益 -9,238,434.26
2.本期利润 -68,718.17
3.加权平均基金份额本期利润 -0.0106
4.期末基金资产净值 324,107,380.10
5.期末基金份额净值 1.0246

基金经理
姓名 职务 任职日期 离任日期
张靖 本基金基金经理 2011-6-3 - 15

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:二〇一一年十月二十四日
重要提示
基金管理人及基金托管人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责任。

基金投资组合
截至2011年9月30日止,本基金资产组合如下:
1.权益投资 8,300,502.50 2.54%
2.其中:股票 8,300,502.50 2.54%
3.固定收益投资 266,928,233.52 81.71%
4.买入返售金融资产 296,929,392.28 88.21%
5.银行存款和结算备付金合计 3,650,324.96 1.12%
6.其他各项资产 4,968,334.65 1.52%
7.合计 326,667,699.65 100.00%

投资策略
本基金采取自上而下资产配置和自下而上个股精选相结合的投资策略。
1.资产配置策略
本基金根据对宏观经济、政策、市场、行业、个股的综合分析,动态调整资产配置比例,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。
2.个股精选策略
本基金采用定量与定性相结合的方法,从基本面、估值、技术面等多个角度对个股进行筛选,构建股票投资组合。

主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益 -9,238,434.26
2.本期利润 -68,718.17
3.加权平均基金份额本期利润 -0.0106
4.期末基金资产净值 324,107,380.10
5.期末基金份额净值 1.0246

基金经理
姓名 职务 任职日期 离任日期
张靖 本基金基金经理 2011-6-3 - 15

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:二〇一一年十月二十四日

重要提示
基金管理人及基金托管人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责任。
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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失或收益不受保证。

基金投资组合
截至2011年9月30日止,本基金资产组合如下:
1.权益投资 8,300,502.50 2.54%
2.其中:股票 8,300,502.50 2.54%
3.固定收益投资 266,928,233.52 81.71%
4.买入返售金融资产 296,929,392.28 88.21%
5.银行存款和结算备付金合计 3,650,324.96 1.12%
6.其他各项资产 4,968,334.65 1.52%
7.合计 326,667,699.65 100.00%

投资策略
本基金采取自上而下资产配置和自下而上个股精选相结合的投资策略。
1.资产配置策略
本基金根据对宏观经济、政策、市场、行业、个股的综合分析,动态调整资产配置比例,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。
2.个股精选策略
本基金采用定量与定性相结合的方法,从基本面、估值、技术面等多个角度对个股进行筛选,构建股票投资组合。

主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益 -9,238,434.26
2.本期利润 -68,718.17
3.加权平均基金份额本期利润 -0.0106
4.期末基金资产净值 324,107,380.10
5.期末基金份额净值 1.0246

基金经理
姓名 职务 任职日期 离任日期
张靖 本基金基金经理 2011-6-3 - 15

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:二〇一一年十月二十四日
重要提示
基金管理人及基金托管人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责任。

基金投资组合
截至2011年9月30日止,本基金资产组合如下:
1.权益投资 8,300,502.50 2.54%
2.其中:股票 8,300,502.50 2.54%
3.固定收益投资 266,928,233.52 81.71%
4.买入返售金融资产 296,929,392.28 88.21%
5.银行存款和结算备付金合计 3,650,324.96 1.12%
6.其他各项资产 4,968,334.65 1.52%
7.合计 326,667,699.65 100.00%

投资策略
本基金采取自上而下资产配置和自下而上个股精选相结合的投资策略。
1.资产配置策略
本基金根据对宏观经济、政策、市场、行业、个股的综合分析,动态调整资产配置比例,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。
2.个股精选策略
本基金采用定量与定性相结合的方法,从基本面、估值、技术面等多个角度对个股进行筛选,构建股票投资组合。

主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益 -9,238,434.26
2.本期利润 -68,718.17
3.加权平均基金份额本期利润 -0.0106
4.期末基金资产净值 324,107,380.10
5.期末基金份额净值 1.0246

基金经理
姓名 职务 任职日期 离任日期
张靖 本基金基金经理 2011-6-3 - 15

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:二〇一一年十月二十四日

重要提示
基金管理人及基金托管人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责任。
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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失或收益不受保证。

基金投资组合
截至2011年9月30日止,本基金资产组合如下:
1.权益投资 8,300,502.50 2.54%
2.其中:股票 8,300,502.50 2.54%
3.固定收益投资 266,928,233.52 81.71%
4.买入返售金融资产 296,929,392.28 88.21%
5.银行存款和结算备付金合计 3,650,324.96 1.12%
6.其他各项资产 4,968,334.65 1.52%
7.合计 326,667,699.65 100.00%

投资策略
本基金采取自上而下资产配置和自下而上个股精选相结合的投资策略。
1.资产配置策略
本基金根据对宏观经济、政策、市场、行业、个股的综合分析,动态调整资产配置比例,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。
2.个股精选策略
本基金采用定量与定性相结合的方法,从基本面、估值、技术面等多个角度对个股进行筛选,构建股票投资组合。

主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益 -9,238,434.26
2.本期利润 -68,718.17
3.加权平均基金份额本期利润 -0.0106
4.期末基金资产净值 324,107,380.10
5.期末基金份额净值 1.0246

基金经理
姓名 职务 任职日期 离任日期
张靖 本基金基金经理 2011-6-3 - 15

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:二〇一一年十月二十四日
重要提示
基金管理人及基金托管人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责任。

基金投资组合
截至2011年9月30日止,本基金资产组合如下:
1.权益投资 8,300,502.50 2.54%
2.其中:股票 8,300,502.50 2.54%
3.固定收益投资 266,928,233.52 81.71%
4.买入返售金融资产 296,929,392.28 88.21%
5.银行存款和结算备付金合计 3,650,324.96 1.12%
6.其他各项资产 4,968,334.65 1.52%
7.合计 326,667,699.65 100.00%

投资策略
本基金采取自上而下资产配置和自下而上个股精选相结合的投资策略。
1.资产配置策略
本基金根据对宏观经济、政策、市场、行业、个股的综合分析,动态调整资产配置比例,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。
2.个股精选策略
本基金采用定量与定性相结合的方法,从基本面、估值、技术面等多个角度对个股进行筛选,构建股票投资组合。

主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益 -9,238,434.26
2.本期利润 -68,718.17
3.加权平均基金份额本期利润 -0.0106
4.期末基金资产净值 324,107,380.10
5.期末基金份额净值 1.0246

基金经理
姓名 职务 任职日期 离任日期
张靖 本基金基金经理 2011-6-3 - 15

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:二〇一一年十月二十四日