

摩根士丹利华鑫深证300指数增强型证券投资基金

2013 第一季度 报告

2013年3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: 中信银行股份有限公司
报告送出日期: 二〇一三年四月十九日

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金管理人摩根士丹利华鑫基金管理有限公司根据本基金合同约定,于2013年4月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,基金净值增长不表示对本基金未来表现的预测,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。

本报告期自2013年1月1日起至3月31日止。

1.2 基金基本情况

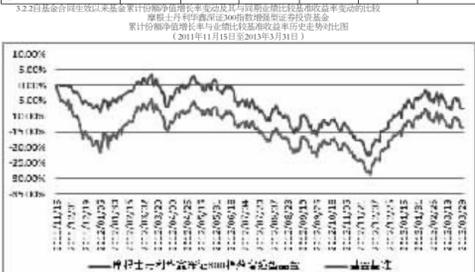
基金简称	摩根士丹利华鑫深证300
基金代码	233001
交易代码	233001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年11月15日
报告期末基金份额总额	156,416,126.99

1.3 主要财务指标

1.本期已实现收益	2,493,728.46
2.本期利润	3,350,014.26
3.加权平均基金份额本期利润	0.0219
4.期末基金份额净值	1.0024

3.1 主要财务指标

1.本期已实现收益	2,493,728.46
2.本期利润	3,350,014.26
3.加权平均基金份额本期利润	0.0219
4.期末基金份额净值	1.0024



4.1 基金经理(或基金经理小组)

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
程志田	本基金基金经理	2011-11-15	-	7	华中科技大学金融学硕士,曾任长江证券股份有限公司金融产品部产品经理及研究部研究员,现任基金管理部基金经理。程志田于2011年加入本基金管理人,曾任研究员、交易员、基金经理等职务。
赵立松	本基金基金经理	2011-11-15	2013-3-20	14	中国人民大学金融学硕士,曾任招商基金管理有限公司研究员、基金经理等职务。赵立松于2011年加入本基金管理人,曾任研究员、基金经理等职务。

5.1 报告期末基金资产组合情况

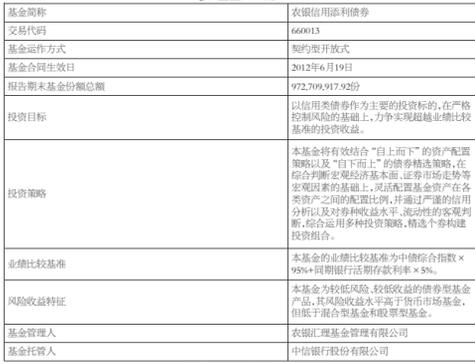
序号	代码	名称	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资		136,806,267.78	92.86
2	其中:股票		136,806,267.78	92.86
3	债券投资		-	-
4	其中:国债		-	-
5	金融债		-	-
6	企业债		-	-
7	中期票据		-	-
8	其他债券		-	-
9	资产支持证券		-	-
10	买入返售金融资产		-	-
11	银行存款		-	-
12	其他货币资金		-	-
13	应收利息		-	-
14	其他资产		-	-
15	负债		-	-
16	其中:应付利息		-	-
17	其他负债		-	-
18	未分配利润		19,609,859.21	12.62
19	合计		156,416,126.99	100.00

5.2 基金资产组合

代码	名称	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
A	农林、牧、渔业	359,671.00	0.23
B	采矿业	3,574,709.99	2.28
C	制造业	504,752.44	0.33
D	电力、热力、燃气及生产供应业	232,285.40	0.16
E	建筑业	80,238.57	0.05
F	批发和零售业	1,287,580.30	0.84
G	交通运输、仓储和邮政业	536,699.77	0.37
H	住宿和餐饮业	67,444.44	0.04
I	信息技术、软件和信息技术服务业	1,297,580.30	0.84
J	金融业	536,699.77	0.37
K	房地产业	499,628.83	0.33
L	租赁和商务服务业	282,577.30	0.20
M	科学研究和技术服务业	114,609.40	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	301,624.07	0.21
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公工作	9,930.80	0.01
R	文化、体育和娱乐业	126,823.65	0.09
S	综合	68,328.81	0.04
T	合计	147,319,088.16	100.00

5.3 主要财务指标和基金净值表现

1.本期已实现收益	2,493,728.46
2.本期利润	3,350,014.26
3.加权平均基金份额本期利润	0.0219
4.期末基金份额净值	1.0024



5.5 报告期末基金资产组合情况

序号	代码	名称	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资		136,806,267.78	92.86
2	其中:股票		136,806,267.78	92.86
3	债券投资		-	-
4	其中:国债		-	-
5	金融债		-	-
6	企业债		-	-
7	中期票据		-	-
8	其他债券		-	-
9	资产支持证券		-	-
10	买入返售金融资产		-	-
11	银行存款		-	-
12	其他货币资金		-	-
13	应收利息		-	-
14	其他资产		-	-
15	负债		-	-
16	其中:应付利息		-	-
17	其他负债		-	-
18	未分配利润		19,609,859.21	12.62
19	合计		156,416,126.99	100.00

5.6 基金资产组合

代码	名称	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
A	农林、牧、渔业	359,671.00	0.23
B	采矿业	3,574,709.99	2.28
C	制造业	504,752.44	0.33
D	电力、热力、燃气及生产供应业	232,285.40	0.16
E	建筑业	80,238.57	0.05
F	批发和零售业	1,287,580.30	0.84
G	交通运输、仓储和邮政业	536,699.77	0.37
H	住宿和餐饮业	67,444.44	0.04
I	信息技术、软件和信息技术服务业	1,297,580.30	0.84
J	金融业	536,699.77	0.37
K	房地产业	499,628.83	0.33
L	租赁和商务服务业	282,577.30	0.20
M	科学研究和技术服务业	114,609.40	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	301,624.07	0.21
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公工作	9,930.80	0.01
R	文化、体育和娱乐业	126,823.65	0.09
S	综合	68,328.81	0.04
T	合计	147,319,088.16	100.00

5.7 基金资产组合

代码	名称	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
A	农林、牧、渔业	359,671.00	0.23
B	采矿业	3,574,709.99	2.28
C	制造业	504,752.44	0.33
D	电力、热力、燃气及生产供应业	232,285.40	0.16
E	建筑业	80,238.57	0.05
F	批发和零售业	1,287,580.30	0.84
G	交通运输、仓储和邮政业	536,699.77	0.37
H	住宿和餐饮业	67,444.44	0.04
I	信息技术、软件和信息技术服务业	1,297,580.30	0.84
J	金融业	536,699.77	0.37
K	房地产业	499,628.83	0.33
L	租赁和商务服务业	282,577.30	0.20
M	科学研究和技术服务业	114,609.40	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	301,624.07	0.21
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公工作	9,930.80	0.01
R	文化、体育和娱乐业	126,823.65	0.09
S	综合	68,328.81	0.04
T	合计	147,319,088.16	100.00

5.8 基金业绩比较基准

摩根士丹利华鑫深证300指数增强型证券投资基金业绩比较基准: 沪深300指数收益率×95%+同期银行活期存款利率×5%

5.9 报告期末基金资产组合情况

序号	代码	名称	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资		136,806,267.78	92.86
2	其中:股票		136,806,267.78	92.86
3	债券投资		-	-
4	其中:国债		-	-
5	金融债		-	-
6	企业债		-	-
7	中期票据		-	-
8	其他债券		-	-
9	资产支持证券		-	-
10	买入返售金融资产		-	-
11	银行存款		-	-
12	其他货币资金		-	-
13	应收利息		-	-
14	其他资产		-	-
15	负债		-	-
16	其中:应付利息		-	-
17	其他负债		-	-
18	未分配利润		19,609,859.21	12.62
19	合计		156,416,126.99	100.00

5.10 基金资产组合

代码	名称	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
A	农林、牧、渔业	359,671.00	0.23
B	采矿业	3,574,709.99	2.28
C	制造业	504,752.44	0.33
D	电力、热力、燃气及生产供应业	232,285.40	0.16
E	建筑业	80,238.57	0.05
F	批发和零售业	1,287,580.30	0.84
G	交通运输、仓储和邮政业	536,699.77	0.37
H	住宿和餐饮业	67,444.44	0.04
I	信息技术、软件和信息技术服务业	1,297,580.30	0.84
J	金融业	536,699.77	0.37
K	房地产业	499,628.83	0.33
L	租赁和商务服务业	282,577.30	0.20
M	科学研究和技术服务业	114,609.40	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	301,624.07	0.21
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公工作	9,930.80	0.01
R	文化、体育和娱乐业	126,823.65	0.09
S	综合	68,328.81	0.04
T	合计	147,319,088.16	100.00

5.11 基金业绩比较基准

摩根士丹利华鑫深证300指数增强型证券投资基金业绩比较基准: 沪深300指数收益率×95%+同期银行活期存款利率×5%

5.12 报告期末基金资产组合情况

序号	代码	名称	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资		136,806,267.78	92.86
2	其中:股票		136,806,267.78	92.86
3	债券投资		-	-
4	其中:国债		-	-
5	金融债		-	-
6	企业债		-	-
7	中期票据		-	-
8	其他债券		-	-
9	资产支持证券		-	-
10	买入返售金融资产		-	-
11	银行存款		-	-
12	其他货币资金		-	-
13	应收利息		-	-
14	其他资产		-	-
15	负债		-	-
16	其中:应付利息		-	-
17	其他负债		-	-
18	未分配利润		19,609,859.21	12.62
19	合计		156,416,126.99	100.00

5.13 基金资产组合

代码	名称	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
A	农林、牧、渔业	359,671.00	0.23
B	采矿业	3,574,709.99	2.28
C	制造业	504,752.44	0.33
D	电力、热力、燃气及生产供应业	232,285.40	0.16
E	建筑业	80,238.57	0.05
F	批发和零售业	1,287,580.30	0.84
G	交通运输、仓储和邮政业	536,699.77	0.37
H	住宿和餐饮业	67,444.44	0.04
I	信息技术、软件和信息技术服务业	1,297,580.30	0.84
J	金融业	536,699.77	0.37
K	房地产业	499,628.83	0.33
L	租赁和商务服务业	282,577.30	0.20
M	科学研究和技术服务业	114,609.40	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	301,624.07	0.21
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公工作	9,930.80	0.01
R	文化、体育和娱乐业	126,823.65	0.09
S	综合	68,328.81	0.04
T	合计	147,319,088.16	100.00

5.14 基金业绩比较基准

摩根士丹利华鑫深证300指数增强型证券投资基金业绩比较基准: 沪深300指数收益率×95%+同期银行活期存款利率×5%

5.15 报告期末基金资产组合情况

序号	代码	名称	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资		136,806,267.78	92.86
2	其中:股票		136,806,267.78	92.86
3	债券投资		-	-
4	其中:国债		-	-
5	金融债		-	-
6	企业债		-	-
7	中期票据		-	-
8	其他债券		-	-
9	资产支持证券		-	-
10	买入返售金融资产		-	-
11	银行存款		-	-
12	其他货币资金		-	-
13	应收利息		-	-
14	其他资产		-	-
15	负债		-	-
16	其中:应付利息		-	-
17	其他负债		-	-
18	未分配利润		19,609,859.21	12.62
19	合计		156,416,126.99	100.00

5.16 基金资产组合

代码	名称	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
A	农林、牧、渔业	359,671.00	0.23
B	采矿业	3,574,709.99	2.28
C	制造业	504,752.44	0.33
D	电力、热力、燃气及生产供应业	232,285.40	0.16
E	建筑业	80,238.57	0.05
F	批发和零售业	1,287,580.30	0.84
G	交通运输、仓储和邮政业	536,699.77	0.37
H	住宿和餐饮业	67,444.44	0.04
I	信息技术、软件和信息技术服务业	1,297,580.30	0.84
J	金融业	536,699.77	0.37
K	房地产业	499,628.83	0.33
L	租赁和商务服务业	282,577.30	0.20
M	科学研究和技术服务业	114,609.40	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	301,624.07	0.21
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公工作	9,930.80	0.01
R	文化、体育和娱乐业	126,823.65	0.09
S	综合	68,328.81	0.04
T	合计	147,319,088.16	100.00

5.17 基金业绩比较基准

摩根士丹利华鑫深证300指数增强型证券投资基金业绩比较基准: 沪深300指数收益率×95%+同期银行活期存款利率×5%

5.18 报告期末基金资产组合情况

序号	代码	名称	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资		136,806,267.78	92.86
2	其中:股票		136,806,267.78	92.86
3	债券投资		-	-
4	其中:国债		-	-
5	金融债		-	-
6	企业债		-	-
7	中期票据		-	-
8	其他债券		-	-
9	资产支持证券		-	-
10	买入返售金融资产		-	-
11	银行存款		-	-
12	其他货币资金		-	-
13	应收利息			