

摩根士丹利华鑫卓越成长股票型证券投资基金

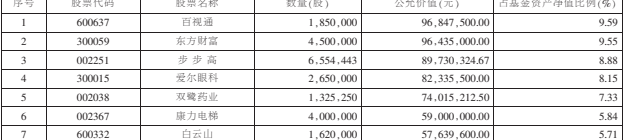
2013 第三季度 报告

2013年9月30日

[illegible]

5.1 报告期内主要投资情况			
5.1.1 权益类资产公允价值变动情况			
序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益类资产	936,192,243.58	91.37
A	股票、债券	936,192,243.58	91.37
2	固定收益证券	40,900,418.50	3.99
B	其中：债券	40,900,418.50	3.99
C	货币市场工具	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
D	其中：买入返售的买入返售金融资产	-	-
5	银行承兑票据及商业承兑票据	19,627,281.03	1.92
6	其他资产	27,969,768.98	2.73
7	合计	1,024,839,684.09	100.00
5.1.2 非权益类资产公允价值变动情况			
代码	行业类别	公允价值(元)	占基金净资产净值比例(%)
A	农林牧渔、制造业	-	-
B	医药生物	-	-
C	信息技术	413,583,824.91	40.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	7,900.00	0.00
F	批发和零售业	143,690,924.67	14.16
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,347,038.00	2.43
J	金融业	40,512,917.00	4.00
K	房地产业	15,462,768.00	1.53

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	55,419.00	0.01
O	房地产业、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	82,335,500.00	8.15
R	文化、体育和娱乐业	9,440.00	0.00
S	综合	936,292,343.58	92.71
S.3	扣除未披露公允价值且其基金资产净值比例大于规定的非公开发行股票市值	-	-



投资于本基金应当符合规定。本基金不从事以下投资活动：

S5.2 投资于非本基金投资的股指期货合约和股票期权合约

原则本基金基金合同规定，本基金不参与与期货期货交易。

S5.3 本基金不得进行融资融券

原则本基金基金合同规定，本基金不参与与期货期货交易。

S5.4 股指期货的持仓限制

S5.1 原则：本基金投资组合中十名证券持有人持有的贵州茅台股份有限公司（以下简称“贵州茅台”）股份，其余没有被托管银行、立鼎资管、或证券公司限制买入的一年内受到公开谴责、处罚

立鼎资管于 2013 年 2 月 23 日公告，原持股人公通源贵州茅台承销有限公司于 2013 年 2 月 22 日收到贵州省物价局《行政处罚决定书》【黔价罚字（2013）1 号】。贵州茅台公司公告称，发生了行政处罚的有关内幕

原则：本基金贵州茅台（600519）的决策程序符合基金管理人投资管理程序的相关规定，上述行政处罚，本基金管理人进行了充分核查并认为不构成内幕交易，不构成内幕信息泄露，本基金管理人将继续对上市公司进行跟踪研究。

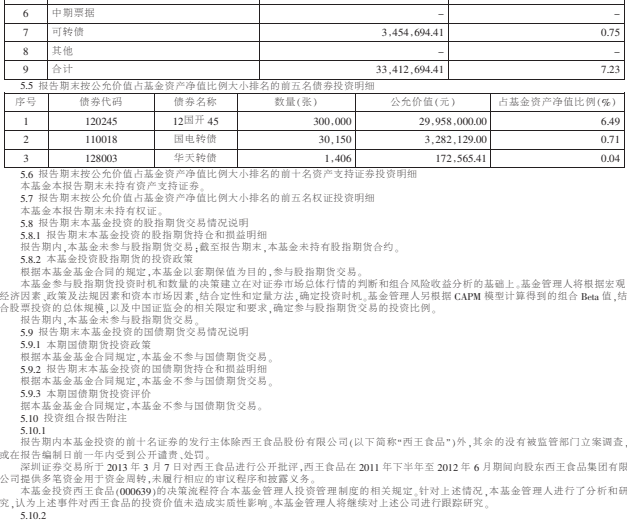
S5.2 原则：本基金组合的前十名未超出基金合同约定的备选股票库。

S5.3 主险资产构成

序号	名称	金额(元)
1	现金及存单	353,379.10
2	应收证券清算款	20,921,813.53
3	应收账款	-
4	预收账款	1,235,613.04
5	应收保险赔款	5,458,939.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	合计	-
9	总计	27,969,740.98

5.10.4 报告期内持有的处于转股期的可转换债券明细				
序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110023	民生转债	936,418.50	0.09
5.10.5 报告期内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的情况				
6 开放式基金份额变动				
单位:元				
报告期期初基金份额总额		780,730,108.87		
报告期期间基金总申购份额		163,560,281.12		
减:报告期期间基金总赎回份额		255,838,178.50		
报告期期间基金净申购/赎回份额		8,452,211.49		
报告期期末基金份额总额		688,460,211.49		
7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况				
本报告期,基金管理人未运用固有资金申购、赎回或买卖本基金。				
8 备查文件目录				
8.1 备查文件目录				
1、中国证监会核准本基金募集的文件;				
2、基金基金合同;				
3、本基金托管协议;				
4、基金招募说明书;				
5、基金管理人营业执照、营业执照;				
6、基金管理人营业执照、营业执照;				
7、报告期内信息披露上披露的各项文件;				
8.2 存放地点				
基金管理人、基金托管人处。				
8.3 查阅方式				
投资者可在营业时间内免费查阅,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。				
康乐士利华证券投资基金 2013年10月24日				

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	29,958,000.00	6.49
	其中:政策性金融债	29,958,000.00	6.49
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-



序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	383,126.23
2	应收证券清算款	9,904,423.30
3	应收股利	3,078.00
4	应收利息	844,727.86
5	应收申购款	91,186.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,226,541.40

序号	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	-	-
2	1091018	1,262,128.00	0.71

3.10.3 投资者申购前10名股票中不存在流通受限情况的说明	
本基金本报告期前10名股票中不存在流通受限情况。	
8.6 开放式基金份额数据	
	单位:份
报告期期初基金份额总额	619,191,100.64
报告期期间基金总申购份额	17,191,522.90
减:报告期期间基金总赎回份额	192,717,267.47
报告期期间基金净变动份额	-
报告期期末基金份额总额	443,665,365.07
8.7 基金管理人运用固有资金投资本基金管理情况	
本报告期,基金管理人未运用固有资金申购、赎回或买卖本基金基金份额。	
8.8 备查文件目录	
8.1 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.基金招募说明书; 5.基金管理人业务资格批文、营业执照; 6.基金管理人业务资格批件、营业执照; 7.报告期内在指定报刊上披露的各项公告; 8. 审计报告; 基金管理人、基金托管人、 会计师事务所。	
投资者可查询时间免费查阅,也可支付工本费购买复印件,还可以通过基金管理人网站查询或下载。	

2013年10月24日