

摩根士丹利华鑫资源优选混合型证券投资基金(LOF)

2013 第三季度 报告

2013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:中国光大银行股份有限公司

报告日期:2013年10月24日

\$ 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，并对内容的真实性、准确性和完整性承担个别法律责任。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，并对内容的真实性、准确性和完整性承担个别法律责任。本基金的基金经理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，并对内容的真实性、准确性和完整性承担个别法律责任。本基金的基金管理人根据本基金合同规定，于2013年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告，复核结果表明本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告，复核结果表明本报告不存

在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，但不能保证一定正确。

基金的过往业绩并不代表其未来表现，投资者投资，在作出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期自2013年7月1日起至9月30日止。

\$ 2 基金产品概况

基金简称 大多因子策略股票型证券投资基金(LOF)

交易代码 163302

基金运作方式契约型开放式

基金合同生效日 2005年9月27日

报告期末基金份额总额 1,478,334,756.71份

投资目标 本基金将根据宏观经济形势变化，对市场的现状和未来的分析判断，通过灵活的资产配置，力争在控制风险的前提下，实现基金资产的长期稳定增值。

投资策略 本基金将根据宏观经济形势变化，对市场的现状和未来的分析判断，通过灵活的资产配置，力争在控制风险的前提下，实现基金资产的长期稳定增值。

业绩比较基准 97%×沪深300指数+3%×定期存款利率

风险收益特征 本基金为混合型基金，风险收益特征介于股票型基金与债券型基金之间，属于较高风险、较高收益的基金品种。

风险等级 中高风险

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 中国光大银行股份有限公司

\$ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2013年7月1日-2013年9月30日)

1.本期已实现收益 146,381,741.09

2.本期利润 408,891,233.59

3.加权平均基金份额本期利润 0.3110

4.期末基金资产净值 3,085,475,703.34

5.期末基金份额净值 2.0871

6.期末可供分配基金份额利润 0.3000

7.期末基金资产净值与份额净值的差额 -0.0001

8.期末基金份额净值占份额面值的偏离度 -0.00%

9.过去三个月净值增长率 17.83%

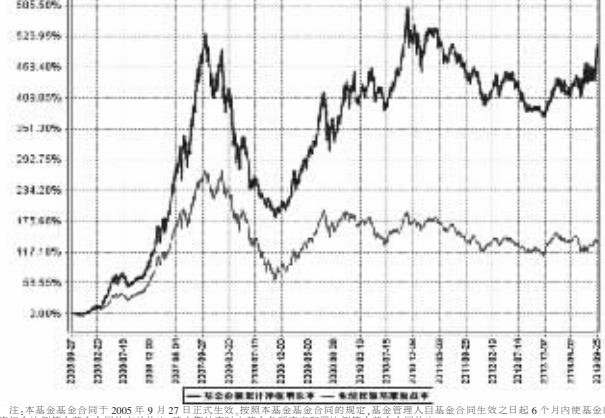
10.过去三个月净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额 7.65%

11.过去三个月净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额 -0.98%

12.过去三个月净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额 10.20%

13.过去三个月净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额 0.61%

\$ 3.2 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:本基金基金合同期于2005年9月27日正式生效,根据基金合同的规定,基金合同期内每6个月末基金的业绩报酬比例将根据合同的有关规定进行调整。

\$ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理助理)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理 任职日期 离任日期 证券从业年限 说明

姓名	职务	任本基金的基金经理	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
卞亚军	基金经理	2013年6月28日	-	9	中国社会科学院研究生院金融学硕士，中国社会科学院金融研究所副研究员，2006年7月至2012年6月任中国银河证券股份有限公司，任产品经理研究员，2012年7月至2013年6月任华泰柏瑞基金管理有限公司，任量化投资部研究员，2012年6月加入本公司，2012年11月至担任本基金基金经理。卞亚军先生拥有丰富的量化投资经验，具备深厚的金融理论功底，长期从事量化投资研究工作，对量化投资有深入的理解，能够把握量化投资的脉搏，对量化投资具有独到的见解，能够独立完成量化投资项目的操作，能较好地把握量化投资的节奏，所管理的基金业绩良好，所管理的基金多次获得行业奖项。卞亚军先生拥有丰富的量化投资经验，具备深厚的金融理论功底，长期从事量化投资研究工作，对量化投资有深入的理解，能够把握量化投资的脉搏，对量化投资具有独到的见解，能够独立完成量化投资项目的操作，能较好地把握量化投资的节奏，所管理的基金业绩良好，所管理的基金多次获得行业奖项。	
何滨	基金经理	2008年4月25日	2013年8月16日	16	湖南大学工外贸学院学士，曾任国信证券资产管理有限公司研究员，2008年1月加入本公司，历任研究员、基金经理助理、基金经理等职，2012年6月加入本公司，2012年11月至担任本基金基金经理。何滨先生拥有丰富的量化投资经验，具备深厚的金融理论功底，长期从事量化投资研究工作，对量化投资有深入的理解，能够把握量化投资的脉搏，对量化投资具有独到的见解，能够独立完成量化投资项目的操作，能较好地把握量化投资的节奏，所管理的基金业绩良好，所管理的基金多次获得行业奖项。	

注:基金经理的任职日期,通常指基金经理开始履行职务之日起,即正式履行基金经理职责之日。

2.基金的经理(或基金经理助理)已按规定向中国证监会报告并公告基金经理变动情况。

3.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

4.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

5.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

6.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

7.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

8.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

9.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

10.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

11.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

12.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

13.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

14.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

15.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

16.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

17.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

18.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

19.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

20.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

21.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

22.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

23.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

24.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

25.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

26.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

27.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

28.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

29.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

30.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

31.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

32.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

33.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

34.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

35.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

36.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

37.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

38.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

39.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

40.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

41.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

42.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

43.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

44.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

45.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

46.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

47.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

48.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

49.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

50.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

51.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

52.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

53.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

54.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

55.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

56.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

57.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

58.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

59.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

60.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

61.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

62.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

63.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

64.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的绩效考核奖励。

65.公司内部的基金经理从本公司领取基本工资及绩效考核奖励的,基金管理人将根据有关法律法规的规定,向基金经理支付相应的