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
送出日期: 2014年3月27日

摩根士丹利华鑫主题优选股票型证券投资基金

2013 年度 报告摘要

2013年12月31日

§1 重要提示

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2014年3月25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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告中财务资料经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计并出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自2013年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	33,404,448.05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	(1)资产配置策略 本基金将通过对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。 (2)主题选择策略 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。 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。 (3)行业选择和配置 本基金将线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。 (4)股票选择 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。 (5)债券投资 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。 (6)权证投资策略 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。 (7)资产支持证券的投资策略 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。
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	李锋	田青
	联系电话	(0755) 88318883	(010) 67595096
	电子邮箱	xqxf@msfunds.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8888-668	(010) 67595096
传真		(0755) 82990384	(010) 66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.msfunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2013年	2012年3月13日(基金合同生效日)-2012年12月31日
本期已实现收益	12,251,500.43	-11,267,669.11
本期利润	9,479,757.09	-5,999,332.61
加权平均基金份额本期利润	0.1210	-0.0286
本期基金份额净值增长率	7.13%	-3.20%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末
期末可供分配基金份额利润	0.0367	-0.0758
期末基金资产净值	34,630,676.50	138,389,776.93
期末基金份额净值	1.037	0.968

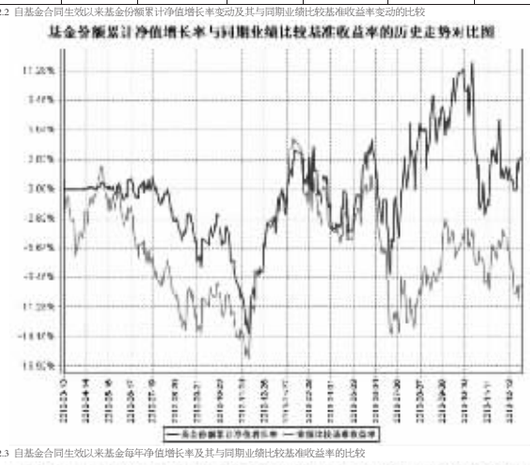
注:1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;
2. 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,而非当期发生数);
3. 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

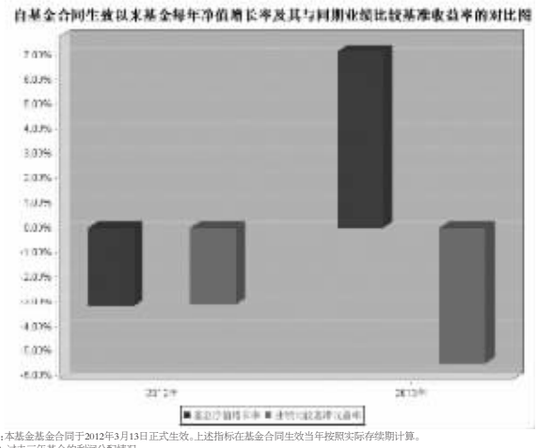
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	-6.58%	1.35%	-2.81%	0.90%	-3.77%	0.45%
过去六个月	9.16%	1.35%	4.67%	1.04%	4.49%	0.31%
过去一年	7.13%	1.30%	-5.49%	1.12%	12.62%	0.18%
自基金合同生效起至今	3.70%	1.05%	-8.45%	1.05%	12.15%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金基金合同于2012年3月13日正式生效。上述指标在基金合同生效当年按照实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日(2012年3月13日)至本报告期末未进行利润分配。

§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(以下简称"公司")是一家中外合资基金管理公司,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,公司的主要股东包括华鑫证券有限责任公司、摩根士丹利国际控股公司、深圳市招融投资控股有限公司等国内外机构。

截止2013年12月31日,公司旗下共管理十五只开放式基金,包括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、摩根士丹利华鑫主题优选股票型证券投资基金、摩根士丹利华鑫多元收益债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫量化配置股票型证券投资基金、摩根士丹利华鑫双利增强债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫纯债稳定增利18个月定期开放债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫品质生活精选股票型证券投资基金。同时,公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

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	基金经理	2012年3月13日	-	7	雅商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,2012年1月至2013年10月任摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金基金经理,2012年3月起任本基金基金经理,2012年9月起任摩根士丹利华鑫卓越成长股票型证券投资基金基金经理。

注:1.基金经理的任职日期为基金合同生效日;
2.基金经理任职已按规定在中国证券投资基金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遵规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

基金管理人遵照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规的要求,制订了《摩根士丹利华鑫基金管理有限公司公平交易管理办法》、《摩根士丹利华鑫基金管理有限公司异常交易管理办法》、《摩根士丹利华鑫基金管理有限公司公平交易分析报告实施细则》等内部制度,形成较为完备的公平交易制度及异常交易分析体系。

基金管理人的公平交易管理涵盖了所管理的所有投资组合,管理的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,同时也包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资管理活动相关的各个环节。基金管理人通过投资交易以及其他相关系统实现了有效系统控制,通过投资交易行为的监控、异常交易的识别与分析、公平交易的分析与报告等方式实现了有效的人工控制,并通过定期及不定期的回顾不断完善相关制度及流程,实现公平交易管理控制目标。

4.3.2 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》及内部相关制度和流程,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。

经对报告期内公司管理所有投资组合的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异,连续四个季度期间内、不同时间窗下(如日内、3日内、5日内)不同投资组合同向交易的交易价差进行分析,未发现异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金未出现基金管理人管理的所有投资组合参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况,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

A、大类资产配置:

①股票资产配置——宏观经济处于长周期的去产能去杠杆进程,周期性行业景气呈现低迷景象,而经济结构中新兴产业和消费行业景气较好,故本基金主仓位仍维持成长股。

②债券资产配置——截至报告期末,本基金债券资产持仓比例为6.94%。同时,报告期内,本基金通过融券回购提高了现金收益。

B、二级资产配置:

①股票资产配置——股票资产的行业配置采取了相对均衡的策略,但更倾向于从自下而上角度出发,对行业景气度好,成长性高的细分子行业给予积极配置,例如科技、安防、医药等。

②债券资产配置——报告期末,本基金债券资产以信用类债券为主。

C、报告期股票操作回顾:

报告期内,市场呈现显著的结构性机会,以监等和传统产业为代表的上证指数全年震荡下跌,持续低迷,缺乏持续性的趋势性投资机会,而以科技和新兴产业为代表的创业板指数则相对较强,全年指数近乎翻倍,传媒、TMT等新兴行业投资机会丰富。

分季度看,1季度,本基金保持了相对均衡的组合结构,银行地产占据一定配置,医药消费等的配置比重相对较低,市场初步呈现成长风格,因此,本基金的组合未显示明显优势.4月份后,本基金调整了组合结构,增加了医药、TMT等成长类个股比重,并精选个股,经历了5.6月份的震荡下跌后,以传媒、影视、游戏为代表的科技行业大幅上涨,创业板指数也重新上升,本基金顺势增加了传媒行业的配置.至3季度末,本基金的组合契合市场风格,业绩弹势得到了扭转.4季度,市场情绪有所变化,宏观经济经历了3季度的微弱库存回补、10月份开始,经济指标又呈现见顶回落态象,加之地方债务、影子银行效应,导致市场利率走高,流动性紧缩,股票市场情绪恶现化,使得前期涨幅巨大且依靠行业前景预期的个别行业,尤其是传媒游戏行业,经历了深幅调整,对基金业绩带来一定冲击.在个股分化的市场环境中,本基金维持优质成长股组合,相应降低了仓位,并动态调整相应个股。

回顾全年的市场结构变化,深刻反映了经济转型的大趋势,传统产业持续去产能去杠杆,新兴产业发展迅猛,相应的指数大幅上涨。因此,本基金2季度后,更加注重契合该趋势,执行中观选行业,微观选个股的策略,淡化行业配置,注重成长因子。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期截至2013年12月31日,本基金份额净值为1.037元,累计份额净值为1.037元,报告期内基金份额净值增长率为7.13%,同期业绩比较基准收益率为-5.49%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2014年,宏观经济环境可能并无大大变化,市场依然会呈现"与宏观经济脱钩,与产业升级挂钩"的结构性特征,与投资相关的行业依然处于长周期的去产能过程,而人均收入已超越5000美元,消费相关的行业长周期景气向上,在这样的大背景下,必须结合经济转型和政策改革的大环境,在医药、消费、文化、科技、先进制造业等行业中,用长期眼光和成长思路精选个股,形成能够穿越市场波动的投资组合。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期,基金管理人通过开展专项检查、加强日常监控、完善管理制度等方式,检查内控制度的执行情况、基金运作的合法合规情况,及时发现问题,提出改进建议并跟踪落实。

本报告期,基金管理人完成的主要监察稽核工作如下:

(1)完成专项检查工作.检查范围覆盖投资交易、基金销售、客户服务、专户业务、主要应用系统管理、IT合规检查、系统开发、自有资金投资及风险准备金、反洗钱业务等方面。(2)做好日常监控工作.严格规范基金投资、销售以及运营等各项业务管理,通过监控基金投资运作、优化关键业务流程、审核宣传推介材料、监督后台运营业务等工作,加强日常风险监控,确保公司和基金运作合法合规。(3)持续完善公司内控制度体系.对业务制度和流程进行合规审核,同时,适时以"合规指引"方式及时清晰地解读监管政策与要求,加强各项业务流程控制。公司已建立起覆盖公司业务各个方面,更为全面、完善的内控制度体系,保障公司合规、安全、高效运营。(4)加强员工合规行为管理.根据法律法规和业务环境的变化不断修订并充实培训材料,并制作学习手册,改进合规培训形式,进一步提升员工风险意识及合规意识。(5)有效地推进投资风险管理系统等合规监控系统的建设,加强风险管理手段,提高工作实效。(6)积极深入参与新产品设计、新业务拓展工作,就相关的合规及风控问题提供意见和建议。

2014年,基金管理人将继续本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,加强风险控制,保障公司和基金的合法合规运作,保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

基金管理人对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;风险管理部负责评估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。

4.8 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%。

根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况,本基金本报告期未满足收益分配条件,因此未进行收益分配。

§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 审计报告

本基金本报告期财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计并出具了标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 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:2013年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资 产:			
银行存款	7.4.7.1	2,206,782.54	27,320,860.08
结算备付金		257,843.49	1,534,840.54
存出保证金		35,604.98	269,780.36
交易性金融资产	7.4.7.2	32,636,940.96	110,212,636.09
其中:股票投资		30,233,092.92	106,940,081.69
基金投资		-	-
债券投资		2,403,848.04	3,272,554.40
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	37,955.20	17,491.63
应收股利		-	-
应收申购款		12,880.94	13,677.48
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		35,188,008.11	139,369,286.18
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		3,420.40	-
应付赎回款		115,800.62	514,045.56
应付管理人报酬		44,345.80	169,004.15
应付托管费		7,390.96	28,167.36
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	121,810.13	106,354.96
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	264,563.70	161,937.22
负债合计		557,331.61	979,509.25
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	33,404,448.05	142,939,619.79
未分配利润	7.4.7.10	1,226,228.45	-4,549,842.86
所有者权益合计		34,630,676.50	138,389,776.93
负债和所有者权益总计		35,188,008.11	139,369,286.18

注:1. 报告截止日2013年12月31日,基金份额净值1.037元,基金份额总额33,404,448.05份。
2. 比较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12月31日。

7.2 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:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年3月13日(基金合同生效日)至2012年12月31日
一、收入		12,507,724.75	-2,189,414.92
1.利息收入		150,157.61	2,544,267.57
其中:存款利息收入	7.4.7.11	73,820.59	1,292,562.14
债券利息收入		33,239.17	149,973.11
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		43,097.85	1,101,732.32
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		15,025,965.68	-10,381,538.62
其中:股票投资收益	7.4.7.12	14,101,301.91	-11,225,047.06
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	194,055.26	19,273.37
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	730,608.51	824,235.07
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.16	-2,771,743.34	5,268,336.50
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7.4.7.17	103,344.80	379,519.63
减:二、费用		3,027,967.66	3,809,917.69
1.管理人报酬		1,200,337.14	2,467,069.33
2.托管费		200,056.20	411,178.25
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.18	1,243,358.55	550,497.67
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	7.4.7.19	384,215.77	381,172.44
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		9,479,757.09	-5,999,332.61
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		9,479,757.09	-5,999,332.61

7.3 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:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31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)	142,939,619.79	-4,549,842.86	138,389,776.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	9,479,757.09	9,479,757.09
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)	-109,535,171.74	-3,703,685.78	-113,238,857.52
其中:1.基金申购款	10,048,527.87	551,657.83	10,600,185.70
2.基金赎回款	-119,583,699.61	-4,255,343.61	-123,839,043.22
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)	33,404,448.05	1,226,228.45	34,630,676.50
项目	上年度可比期间 2012年3月13日(基金合同生效日)至2012年12月31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)	-	-5,999,332.61	-5,999,332.61
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)	-299,813,214.57	1,449,489.75	-298,363,724.82
其中:1.基金申购款	5,391,168.12	-154,746.85	5,236,421.27
2.基金赎回款	-305,204,382.69	1,604,236.60	-303,600,146.09
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)	142,939,619.79	-4,549,842.86	138,389,776.93

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

_____于华_____ _____张力_____ _____谢先斌_____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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基金,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,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括创业板、中小板股票及其他经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。本基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的60%-95%,其中投资于本基金所确定的五大类投资主题中精选出的股票比例不低于本基金股票资产的80%;除股票外的其他资产投资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%,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:沪深300指数收益率 × 80%+中信标普全债指数收益率 × 20%。

本财务报表由本基金的基金管理人摩根士丹利华鑫基金管理有限公司于2014年3月18日批准报出。

7.4.2 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")、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《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》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及外部分类会计业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2013年度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2013年12月31日的财务状况以及2013年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》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,基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入、债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。?

(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支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起,对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额.对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(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。

7.4.7 关联方关系

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
摩根士丹利国际控股公司	基金管理人的股东
深圳市中技实业(集团)有限公司	基金管理人的股东
汉唐证券有限责任公司	基金管理人的股东
深圳市招融投资控股有限公司	基金管理人的股东

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年3月13日(基金合同生效日)至2012年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华鑫证券	56,629,221.53	7.19%	128,970,079.30	32.26%

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华鑫证券	51,309.30	7.18%	28,654.60	23.52%
关联方名称	上年度可比期间 2012年3月13日(基金合同生效日)至2012年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华鑫证券	116,444.85	33.35%	62,063.46	58.36%

注:1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年3月13日(基金合同生效日)至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,200,337.14	2,467,069.33
其中:支付销售机构的客户维护费	626,535.72	1,561,880.28

注: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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年3月13日(基金合同生效日)至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	200,056.20	411,178.25

注: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。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期间及上年度可比期间无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.8.4.2 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

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.8.5 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 2013年1月1日至2013年12月31日 | | 上年度可比期间 2012年3月13日(基金合同生效日)至2012年12月31日 | |