摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金

2014 半年度 报告摘要

2014年6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
送出日期：2014年8月26日

§1 重要提示及目录

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。本半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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年8月22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。

经中国证券监督管理委员会证监许可[2012]277号文《关于核准摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》的核准，本基金自2012年3月5日起修改了基金合同中基础行业定义，并相应修改投资比例、业绩比较基准及收益分配条款。以上事项具体内容请查阅指定报刊和本基金管理人网站相关公告。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	大摩基础行业混合
基金主代码	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	2004年3月26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
报告期末基金份额总额	137,705,670.44份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	分享中国经济持续发展过程所带来的基础行业的稳定增长，为基金份额持有人谋求长期、稳定的投资回报。
投资策略	（1）股票投资策略 基于宏观经济的自上而下方式，结合自下而上个股精选，形成动态股票组合，追求持续稳定收益。 （2）债券投资策略 我们以“类别资产配置、久期管理”为核心，通过“自上而下”的投资策略，以长期利率趋势分析为基础，兼顾中短期经济周期、政策方向等因素在类别资产配置、不同市场间的资产配置、券种选择三个层面进行投资管理；并结合使用“自下而上”的投资策略，即收益率曲线分析，久期管理，新债分析，信用分析，流动性分析等方法，实施动态投资管理，动态调整组合的投资品种，以达到预期投资目标。 （3）权证投资策略 对权证的投资建立在对标的证券和组合收益风险进行分析的基础之上，权证在基金的投资中将主要起到锁定收益和控制风险的作用。以BS模型和二叉树模型为基础来对权证进行定价，并根据市场情况对定价模型和参数进行适当修正。在组合构建和操作中运用的投资策略主要包括但不限于保护性看跌策略、抛补的认购权证、双限策略等。
业绩比较基准	沪深300指数×55% + 中证综合债券指数×45%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期收益和风险高于货币型基金、债券型基金，而低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险、中高收益品种。

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	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李锦	张建春
	联系电话	(0755) 88318883	(010) 63639180
	电子邮箱	xxpl@msfunds.com.cn	zhangjianchun@cebbank.com
客户服务电话		400-8888-668	95595
传真		(0755) 82990384	(010) 63639132

2.4 信息披露方式

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2014年1月1日 - 2014年6月30日）
本期已实现收益	-2,951,518.89
本期利润	369,447.03
加权平均基金份额本期利润	0.0026
本期基金份额净值增长率	0.64%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2014年6月30日）
期末可供分配基金份额利润	-0.5590
期末基金资产净值	60,731,456.73
期末基金份额净值	0.4410

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
过去一个月	5.70%	1.04%	0.42%	0.43%	5.28%	0.61%
过去三个月	4.93%	1.01%	1.13%	0.48%	3.80%	0.53%
过去六个月	0.64%	1.16%	-2.68%	0.57%	3.32%	0.59%
过去一年	7.80%	1.14%	1.64%	0.65%	6.16%	0.49%
2011年7月1日至2012年3月4日	-13.97%	0.93%	-8.38%	1.01%	-5.59%	-0.08%
2012年3月5日至2014年6月30日	3.06%	1.04%	-5.98%	0.69%	9.04%	0.35%
自基金合同生效起至2012年3月4日	13.08%	1.52%	59.27%	1.36%	-46.19%	0.16%

注：1.本基金自2012年3月5日起修改了基金合同中基础行业定义及投资比例，并相应调整基金业绩比较基准为：

沪深300指数×55% + 中证综合债券指数×45%

沪深300指数是由中证指数有限公司编制，在上海和深圳证券市场中选取300只A股作为样本编制而成的成份股指数。该指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值，具有良好的市场代表性，是目前中国证券市场中公允性较好的股票指数，适合作为本基金的业绩比较基准。

中证综合债券指数是中证指数有限公司编制的综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短期融资券的跨市场债券指数。该指数的推出旨在更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势，为债券投资人提供更切合的市场基准，适合作为本基金的业绩比较基准。

2.基金合同修改前本基金的业绩比较基准计算公式为：

上证综指与深证综指的复合指数×75%+中信全债指数×20%+同业存款利率×5%；

其中：上证综指与深证综指的复合指数=（上证A股流通市值/A股总流通市值）×上证综指+（深证A股流通市值/A股总流通市值）×深证综指

基准指数的构建考虑了三个原则：

（1）由于当前并不存在一个为投资者广泛接受的基础行业指数，所以以自定义方式来构建业绩比较基准，若将来出现一个能得到市场认可的基础行业指数，我们将在研究对比的基础上选择更为合理的业绩比较基准。

（2）投资者认同度。选择被市场广泛认同的上证综指、深证综指、中信标普全债指数作为计算的基础指数，并以流通市值比例为权数对上证综指、深证综指作加权计算。

（3）业绩比较的合理性。基金投资业绩受到资产配置比例限制的影响，根据基金资产配置比例来确定加权计算的权数，使业绩比较更具有合理性。

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合合同要求，基准指数每日按照75%、20%、5%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

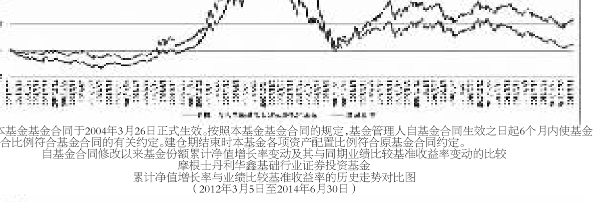
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

自基金合同生效以来至基金合同修改前基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2004年3月26日至2012年3月4日）



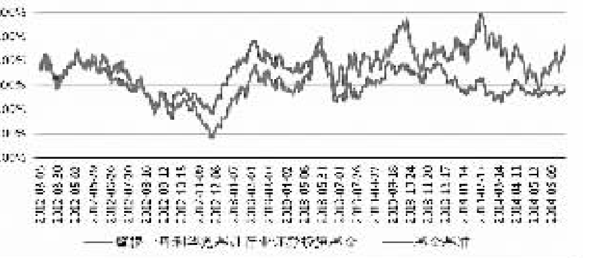
注：本基金基金合同于2004年3月26日正式生效。按照本基金基金合同的规定，基金管理人自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合原基金合同约定。

自基金合同修改以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2012年3月5日至2014年6月30日）



§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2014年6月30日，公司旗下共管理十六只开放式基金，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和摩根士丹利华鑫进取优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		
王增财	基金经理	2013年10月23日	-	7	西南财经大学经济学硕士。曾任职于平安证券有限责任公司资产管理事业部投资部，历任研究员、投资经理助理、投资经理。2013年9月加入本公司，2013年10月起任本基金基金经理。

注：1、基金经理的任职日期为根据本公司决定确定的聘任日期；

2、基金经理的任职已按规定在中国证券投资基金业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。

4.3.2 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

报告期内，国内宏观经济总体表现疲弱，投资、消费、出口表现乏善可陈。面对经济下行压力，上半年管理层并未出台大规模经济刺激政策，而是稳步推进各项改革与经济转型。直到5月份，宏观经济政策才出现较为明显的“托底”转向，但仍以微刺激为主，经济在政策作用下出现短暂企稳。报告期内股票市场表现分化，以大盘蓝筹股为权重的沪深300表现低迷，而以新兴行业为权重的创业板则延续了去年的良好表现。股票市场的分化表现反映了经济转型期的基本面：传统周期行业面临“去产能、去杠杆、挤泡沫”的压力，而新兴行业多数处于发展初中期，面临加杠杆、泡沫化的发展机遇。本基金在一季度主要配置以蓝筹类个股为主，但由于受经济下行影响，蓝筹股的业绩增速放缓，估值不断下移，表现不佳。二季度本基金投资思路做了一些调整，主要是结合个股基本面和市场环境，降低了蓝筹类个股的投资比例，在股票选择上，遵循业务向好、财务健康和估值合理原则，重点关注市值较小和市场关注度较低的公司。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期截至2014年6月30日，本基金份额净值为0.4410元，份额累计净值为1.9860元，报告期内基金份额净值增长率为0.64%，同期业绩比较基准收益率为-2.68%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，市场仍处于政策面和经济基本面的博弈中。政策面继5月底转向确立后，后续刺激力度有可能加大，最主要是加强对稳增长、促改革、调结构、惠民生政策措施的落实。而经济基本面受制于地产业的衰退，未来仍有很大的不确定性。当前房地产销量同比增速明显回落，房价环比转负，投资同比增速明显下滑，房地产的调整幅度和时间还需观察。由于房地产产业链对国民经济影响较大，因此，本轮经济调整的底部还不明确。我们预期市场还处于筑底阶段，尽管政策底出现，但何时走出底部还需等待经济底部的确立。值得注意到是，当前经济体和市场不像2008年因外部金融危机冲击出现整体性下滑，本轮经济调整伴随着经济结构调整和转型，所以经济表现和股票市场也呈现结构分化现象。因此，市场可能较难出现2008年那样整体性低估的情形。

从投资思路上，本基金重点关注经济转型的方向，如医药及医疗服务、器械、信息化、传媒娱乐、互联网和细分制造业。选股上遵循业务向好、财务健康和估值合理三项原则，主要选择市值较小，市场关注度较低，具有一定稀缺性的公司，力争在操作上提高灵活性。

4.6 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（基金运营部的分管领导）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；风险管理部负责设计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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、基金合同的相关规定以及本基金的实际运作情况，本基金本报告期未实施利润分配。

§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

2014年上半年度，中国光大银行在摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定，依法安全托管了基金的全部资产，对摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

2014年上半年度，中国光大银行依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人——摩根士丹利华鑫基金管理有限公司的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规的要求。该基金在运作中遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规的要求；各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行依法对基金管理人——摩根士丹利华鑫基金管理有限公司编制的“摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金2014年半年度报告”进行了复核，报告中相关财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容是真实、准确的。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金

报告截止日：2014年6月30日

单位：人民币元

资 产	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资 产：		
银行存款	3,867,680.52	4,116,232.52
结算备付金	469,684.20	208,682.27
存出保证金	64,910.53	63,138.47
交易性金融资产	49,482,660.94	57,514,472.00
其中：股票投资	46,614,353.74	48,200,872.73
基金投资	-	-
债券投资	2,868,307.20	9,313,599.27
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	1,200,000.00
应收证券清算款	7,738,753.16	1,282,855.17
应收利息	61,006.90	56,087.10
应收股利	-	-
应收申购款	5,927.39	14,827.48
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	61,690,623.64	64,456,295.01
负债和所有者权益	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	154,454.39	20,683.41
应付管理人报酬	72,833.43	80,702.07
应付托管费	12,138.89	13,450.35
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	268,084.17	193,290.77
应交税费	358,034.67	358,034.67
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	93,621.36	176,661.06
负债合计	959,166.91	842,822.33
所有者权益：		
实收基金	137,705,670.44	145,167,895.17
未分配利润	-76,974,213.71	-81,554,422.49
所有者权益合计	60,731,456.73	63,613,472.68
负债和所有者权益总计	61,690,623.64	64,456,295.01

注：报告截止日2014年6月30日，基金份额净值0.4410元，基金份额总额137,705,670.44份。

6.2 利润表

会计主体：摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入	1,697,427.72	3,530,655.01
1.利息收入	91,983.68	314,508.10
其中：存款利息收入	29,449.54	31,987.55
债券利息收入	56,830.62	259,908.21
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	5,703.52	22,612.34
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-1,717,610.32	5,937,914.58
其中：股票投资收益	-2,113,021.75	5,528,227.51
基金投资收益	-	-
债券投资收益	159,187.06	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	236,224.37	409,687.07
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	3,320,965.92	-2,727,554.29
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	2,088.44	5,786.62
减：二、费用	1,327,980.69	1,119,085.67
1.管理人报酬	456,862.09	490,547.35
2.托管费	76,143.61	81,757.83
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	706,764.31	467,496.73
5.利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	88,210.68	79,283.76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	369,447.03	2,411,569.34
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	369,447.03	2,411,569.34

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30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）	145,167,895.17	-81,554,422.49	63,613,472.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	369,447.03	369,447.03
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）	-7,462,224.73	4,210,761.75	-3,251,462.98
其中：1.基金申购款	3,796,617.40	-2,119,849.97	1,676,767.43
2.基金赎回款	-11,258,842.13	6,330,611.72	-4,928,230.41
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）	137,705,670.44	-76,974,213.71	60,731,456.73
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30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）	162,588,179.82	-98,420,127.58	64,168,052.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,411,569.34	2,411,569.34
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）	-6,735,614.37	3,919,515.71	-2,816,098.66
其中：1.基金申购款	8,857,702.74	-5,189,009.87	3,668,692.87
2.基金赎回款	-15,593,317.11	9,108,525.58	-6,484,791.53
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）	155,852,565.45	-92,089,042.53	63,763,522.92

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金（原名为巨田基础行业证券投资基金，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”）证监基金字[2004]第11号《关于同意巨田基础行业证券投资基金设立的批复》核准，由巨田基金管理有限公司（现已更名为摩根士丹利华鑫基金管理有限公司）依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《巨田基础行业证券投资基金基金契约》（后更名为《摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金基金合同》）发起，并于2004年3月26日募集成立。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,854,428,324.58元，业经深圳天健信德会计师事务所信德验资字（2004）第8号验资报告予以验证。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，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下，本基金的投资组合范围为：股票投资占基金净值的50%-75%；债券投资占基金净值的20%-45%；现金资产占基金净值的5%-20%。其中投资于基础行业类股票的比例不低于股票资产的80%。本基金的业绩比较基准为：上证综指与深证综指的复合指数×75%+中信标普全债指数×20%+同业存款利率×5%。

经中国证券监督管理委员会证监许可[2012]277号文《关于核准摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》的核准，本基金自2012年3月5日起修改了基金合同中基础行业定义，并相应修改投资比例、业绩比较基准及收益分配条款。

2012年3月5日本基金修改合同后，本基金的投资组合比例变更为：股票等权益类资产占基金资产的30%-80%，其中投资于基础行业的上市公司股票市值不低于股票等权益类资产的80%，持有权证的市值不得超过基金资产净值的3%；现金、债券等固定收益类资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的20%-70%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准变更为：沪深300指数×55%+中证综合债券指数×45%。

6.4.2 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》、《摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2014年上半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2014年6月30日的财务状况以及2014年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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

本基金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。

6.4.5 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。

6.4.6 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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
中国光大银行股份有限公司（“中国光大银行”）	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

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行交易。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	456,862.09	490,547.35
其中：支付销售机构的客户维护费	52,863.95	57,931.17

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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	76,143.61	81,757.83

注：支付基金托管人中国光大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。

6.4.8.3 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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
基金合同生效日（2004年3月26日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	8,090,552.04	8,090,552.04
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	8,090,552.04	8,090,552.04
期末持有的基金份额占基金总份额比例	5.88%	5.19%

6.4.8.4.2 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除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.8.5 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 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国光大银行	3,867,680.52	25,922.30	3,089,893.30	27,833.56

注：本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.9 期末（2014年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
603369	今世缘	2014年6月25日	2014年7月3日	新股流通受限	16.93	16.93	1,000	16,930.00	16,930.00	-
002727	一心堂	2014年6月25日	2014年7月2日	新股流通受限	12.20	12.20	500	6,100.00	6,100.00	-

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002035	华帝股份	2014年6月27日	临时停牌	9.89	2014年7月2日	10.58	220,840	2,214,721.97	2,184,107.60	-
300050	世纪鼎利	2014年5月30日	重大资产重组	17.78	2014年7月30日	19.56	76,637	1,126,948.93	1,362,605.86	-
002581	万昌科技	2014年4月21日	重大资产重组	16.65	2014年8月21日	18.32	55,730	917,019.99	927,904.50	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	46,614,353.74	75.56
	其中：股票	46,614,353.74	75.56
2	固定收益投资	2,868,307.20	4.65
	其中：债券	2,868,307.20	4.65
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	4,337,364.72	7.03
7	其他各项资产	7,870,597.98	12.76
8	合计	61,690,623.64	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	33,617,075.05	55.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	6,100.00	0.01
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	8,275,411.90	13.63
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,672,376.00	2.75
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	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	3,043,390.79	5.01
S	综合	-	-
	合计	46,614,353.74	76.75

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002063	远光软件	181,900	3,719,855.00	6.13
2	300291	华录百纳	86,731	3,043,390.79	5.01
3	002038	双鹭药业	68,136	3,036,821.52	5.00
4	002539	新都化工	226,600	2,467,674.00	4.06
5	002527	新时达	128,900	2,331,801.00	3.84
6	300233	金城医药	90,300	2,264,724.00	3.73
7	002035	华帝股份	220,840	2,184,107.60	3.60
8	002450	康得新	90,690	2,063,197.50	3.40
9	002410	广联达	74,966	1,982,101.04	3.26
10	300054	鼎龙股份	159,300	1,927,530.00	3.17

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站（http://www.msfunds.com.cn）的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002038	双鹭药业	6,175,791.59	9.71
2	300070	碧水源	4,797,456.53	7.54
3	002572	索菲亚	4,273,043.76	6.72
4	000780	平庄能源	3,990,523.23	6.27
5	002367	康力电梯	3,811,636.71	5.99
6	600048	保利地产	3,440,246.76	5.41
7	600519	贵州茅台	3,414,635.99	5.37
8	300145	南方泵业	3,332,684.32	5.24
9	002410	广联达	2,988,873.93	4.70
10	600880	博瑞传播	2,913,089.01	4.58
11	600637	百视通	2,650,355.74	4.17
12	002450	康得新	2,570,675.35	4.04
13	002539	新都化工	2,513,426.29	3.95
14	002140	东华科技	2,422,350.46	3.81
15	300291	华录百纳	2,411,001.25	3.79
16	000024	招商地产	2,401,944.00	3.78
17	600270	外运发展	2,395,708.73	3.77
18	000671	阳 光 城	2,338,866.10	3.68
19	300074	华平股份	2,304,858.00	3.62
20	000858	五 粮 液	2,274,148.85	3.57
21	002035	华帝股份	2,214,721.97	3.48
22	002415	海康威视	2,212,447.12	3.48
23	300110	华仁药业	2,193,207.30	3.45
24	002527	新时达	2,165,138.96	3.40
25	300005	探路者	2,134,095.71	3.35
26	002230	科大讯飞	2,115,640.75	3.33
27	300165	天瑞仪器	2,001,365.01	3.15
28	002081	金 螳 螂	1,993,038.79	3.13
29	002376	新北洋	1,986,528.03	3.12
30	300233	金城医药	1,962,569.00	3.09
31	002353	杰瑞股份	1,950,031.06	3.07
32	600079	人福医药	1,924,127.03	3.02
33	300041	回天新材	1,912,492.60	3.01
34	000423	东阿阿胶	1,863,609.22	2.93
35	600422	昆明制药	1,846,028.61	2.90
36	002546	新联电子	1,778,160.47	2.80
37	002441	众业达	1,753,572.00	2.76
38	002146	荣盛发展	1,746,145.37	2.74
39	002460	赣锋锂业	1,730,193.00	2.72
40	300054	鼎龙股份	1,718,307.57	2.70
41	002108	沧州明珠	1,665,585.77	2.62
42	002236	大华股份	1,657,486.20	2.61
43	300183	东软载波	1,635,814.58	2.57
44	002701	奥瑞金	1,611,916.00	2.53
45	002219	恒康医疗	1,603,901.32	2.52
46	600240	华业地产	1,594,462.00	2.51
47	002063	远光软件	1,558,123.37	2.45
48	002454	松芝股份	1,533,993.18	2.41
49	002385	大北农	1,507,905.59	2.37
50	600563	法拉电子	1,485,914.60	2.34
51	002329	皇氏乳业	1,467,918.00	2.31
52	002091	江苏国泰	1,447,995.00	2.28
53	300289	利德曼	1,428,657.00	2.25
54	002250	联化科技	1,400,545.00	2.20
55	002227	奥 特 迅	1,369,302.60	2.15
56	002327	富安娜	1,284,279.08	2.02
57	002509	天广消防	1,281,267.50	2.01
58	002400	省广股份	1,273,772.53	2.00

注：“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	6,154,733.45	9.68
2	002038	双鹭药业	4,379,933.69	6.89
3	300070	碧水源	4,318,300.25	6.79
4	002572	索菲亚	4,203,411.51	6.61
5	000780	平庄能源	3,913,490.31	6.15
6	002450	康得新	3,886,955.67	6.11
7	600332	白云山	3,781,810.33	5.94
8	000423	东阿阿胶	3,706,280.39	5.83
9	600048	保利地产	3,597,626.40	5.66
10	002367	康力电梯	3,518,818.76	5.53
11	600422	昆明制药	3,173,572.27	4.99
12	002081	金 螳 螂	3,168,894.63	4.98
13	300145	南方泵业	3,052,329.76	4.80
14	300058	蓝色光标	3,034,744.00	4.77
15	600880	博瑞传播	2,927,769.75	4.60
16	300259	新天科技	2,921,853.55	4.59
17	002400	省广股份	2,811,432.95	4.42
18	002701	奥瑞金	2,728,745.33	4.29
19	600637	百视通	2,715,680.50	4.27
20	300289	利德曼	2,609,652.97	4.10
21	600436	片仔癀	2,582,226.15	4.06
22	300110	华仁药业	2,560,095.71	4.02
23	002230	科大讯飞	2,526,615.50	3.97
24	600518	康美药业	2,522,212.40	3.96
25	002385	大北农	2,479,296.96	3.90
26	002140	东华科技	2,425,354.76	3.81
27	600270	外运发展	2,407,431.95	3.78
28	600703	三安光电	2,333,592.92	3.67
29	000858	五 粮 液	2,231,249.87	3.51
30	000024	招商地产	2,228,903.19	3.50
31	002415	海康威视	2,158,973.35	3.39
32	000671	阳 光 城	2,102,948.53	3.31
33	002353	杰瑞股份	2,076,435.33	3.26
34	300005	探路者	2,073,581.86	3.26
35	600315	上海家化	2,028,499.97	3.19
36	600079	人福医药	1,941,971.28	3.05
37	300039	上海凯宝	1,889,136.57	2.97
38	300041	回天新材	1,868,991.45	2.94
39	300165	天瑞仪器	1,854,150.81	2.91
40	002146	荣盛发展	1,791,153.36	2.82
41	300024	机器人	1,775,079.86	2.79
42	002460	赣锋锂业	1,749,280.65	2.75
43	002108	沧州明珠	1,694,913.00	2.66
44	300183	东软载波	1,694,748.16	2.66
45	002236	大华股份	1,666,917.20	2.62
46	002441	众业达	1,656,058.51	2.60
47	002454	松芝股份	1,603,920.64	2.52
48	300215	电科院	1,488,808.40	2.34
49	600563	法拉电子	1,360,149.24	2.14
50	300123	太阳鸟	1,337,078.00	2.10
51	002509	天广消防	1,330,076.96	2.09
52	002227	奥 特 迅	1,324,562.70	2.08
53	300251	光线传媒	1,319,700.00	2.07
54	601798	蓝科高新	1,304,821.74	2.05
55	300157	恒泰艾普	1,296,449.00	2.04
56	002607	亚夏汽车	1,292,466.14	2.03
57	002091	江苏国泰	1,281,547.18	2.01
58	000793	华闻传媒	1,276,448.00	2.01

注：“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	230,083,256.61
卖出股票收入（成交）总额	232,527,399.24

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	2,868,307.20	4.72
8	其他	-	-
9	合计	2,868,307.20	4.72

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110020	南山转债	30,180	2,868,307.20	4.72

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

根据本基金基金合同规定，本基金不参与贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

根据本基金基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体除北京康得新复合材料股份有限公司（以下简称“康得新”）外，其余的没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

康得新于2014年3月20日公告，其于2014年3月18日收到中国证券监督管理委员会北京监管局下发的《行政监管措施决定书》【2014】7号（以下简称“《决定书》”），康得新在公告中陈述了《决定书》的有关内容。

本基金投资康得新（002450）的决策流程符合本基金管理人投资管理制度的相关规定。针对上述情况，本基金管理人进行了分析和研究，认为上述事件对康得新的投资价值未造成实质性影响。本基金管理人将继续对上述公司进行跟踪研究。

7.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	64,910.53
2	应收证券清算款	7,738,753.16
3	应收股利	-
4	应收利息	61,006.90
5	应收申购款	5,927.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,870,597.98

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110020	南山转债	2,868,307.20	4.72

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	002035	华帝股份	2,184,107.60	3.60	临时停牌

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
7,011	19,641.37	12,580,253.07	9.14%	125,125,417.37	90.86%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	-	-

注：本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2004年3月26日）基金份额总额	1,854,893,478.59
本报告期期初基金份额总额	145,167,895.17
本报告期基金总申购份额	3,796,617.40
减：本报告期基金总赎回份额	11,258,842.13
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
本报告期期末基金份额总额	137,705,670.44

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，沈良先生不再担任基金管理人副总经理，公司于2014年1月15日公告了上述事项。

本报告期内，王文学先生不再担任基金管理人董事长，总经理于华先生代任董事长一职，公司于2014年3月8日公告了上述事项。

本报告期内，基金管理人增聘高见先生为公司副总经理，公司于2014年3月15日公告了上述事项。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金未改变投资策略。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	1	166,213,522.31	35.94%	151,321.28	35.94%	-
招商证券	1	138,697,985.26	29.99%	126,271.47	29.99%	-
光大证券	1	72,530,904.26	15.68%	66,033.50	15.68%	-
国金证券	1	24,656,093.49	5.33%	22,447.17	5.33%	-
渤海证券	1	22,744,925.53	4.92%	20,707.25	4.92%	-
齐鲁证券	1	14,311,136.15	3.09%	13,028.95	3.09%	-
海通证券	1	13,619,608.89	2.94%	12,400.45	2.95%	-
平安证券	1	9,218,393.52	1.99%	8,392.40	1.99%	-
东兴证券	1	473,009.00	0.10%	430.69	0.10%	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-

注：1. 专用交易单元的选择标准和程序

（1）实力雄厚，信誉良好。

（2）财务状况良好，经营行为规范。

（3）内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。

（4）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务。

（5）研究实力较强，能及时、定期、全面地为本基金提供研究服务。

（6）为基金份额持有人提供高水平的综合服务。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定合作券商。基金管理人与被选择的证券经营机构签订《专用证券交易单元租用协议》，报证券交易所办理交易单元相关租用手续。

2. 本基金本报告期内新租用渤海证券股份有限公司1个交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信证券	2,010,592.65	8.47%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	14,972,417.00	63.07%	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	29,500,000.00	100.00%	-	-
平安证券	6,757,226.70	28.46%	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期租用的证券公司交易单元未进行权证及基金投资。

摩根士丹利华鑫基金管理有限公司
2014年8月26日