

摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型 证券投资基金 2013 年半年度报告

2013 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2013 年 8 月 27 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2013 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§7 投资组合报告	32
7.1 期末基金资产组合情况	32
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	33
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	48
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	48
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	48
7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	48
7.10 投资组合报告附注	49
§8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50

§9 开放式基金份额变动	50
§10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
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	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
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	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	51
10.8 其他重大事件	54
§11 备查文件目录	55
11.1 备查文件目录	55
11.2 存放地点	56
11.3 查阅方式	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金
基金简称	大摩深证 300 指数增强
基金主代码	233010
基金交易代码	233010
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
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	139,396,096.02 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，以深证 300 指数作为本基金投资组合跟踪的目标指数。本基金在有效跟踪深证 300 指数的基础上，通过运用增强型投资策略，力争获取超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增长。本基金对业绩比较基准的跟踪目标是：力求控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。
投资策略	本基金以深证 300 指数为目标指数，采用指数化投资为主要投资策略，适度增强型投资策略为辅助投资策略。 1、股票投资策略 本基金股票投资策略由指数化投资策略和增强型投资策略组成。 （1）指数化投资策略 指数化投资策略是本基金主要股票投资策略，通过采用复制指数的方法，根据目标指数即深证 300 指数的成份股及其权重构建指数投资组合。 （2）增强型主动投资策略 增强型主动投资策略是本基金辅助股票投资策略，包括：成份股增强策略和非成份股增强策略。管理人将对当前及未来国内外宏观经济形势的判断和经济景气周期预测作为基础，从多个方面把握不同行业的景气度变化情况和上市公司业绩增长的趋势，以“自下而上”与“自上而下”相结合的方法，重点投资价值被市场低估的指数成份股，并适度投资一些具有估值优势、

	持续成长能力的非成分股，对指数投资组合进行优化增强。 2、债券投资策略 本基金债券投资的目的是基金资产流动性管理，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。本基金将根据国内外宏观经济形势、货币政策、债券市场供求状况以及市场利率走势等因素，合理预期债券市场利率变动趋势，制定以久期控制下的债券资产配置策略，主要投资于到期日在一年以内的政府债券、金融债等。 3、股指期货投资策略 本基金可运用股指期货，以提高投资效率，有效控制指数的跟踪误差，更好地实现投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，本着审慎原则，适度参与股指期货投资，改善投资组合风险收益特征。另外，本基金将利用股指期货流动性好、杠杆交易的特点，进行现金管理，以应对大额申购赎回、大额现金分红等，管理流动性风险，优化投资组合对目标指数的跟踪效果，提高投资组合的运作效率等。
业绩比较基准	深证 300 价格指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票指数型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金，属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的基金产品

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	李锦	田青
	联系电话	(0755) 88318883	(010) 67595096
	电子邮箱	xxpl@msfunds.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8888-668	(010) 67595096
传真		(0755) 82990384	(010) 66275853
注册地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第二座第 17 层 01-04 室	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第二座第 17 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		518048	100033
法定代表人		王文学	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.msfnunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	摩根士丹利华鑫基金管理有限公司	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第二座第 17 层

§ 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(2013 年 1 月 1 日 - 2013 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	4,520,113.09
本期利润	-4,220,031.17
加权平均基金份额本期利润	-0.0275
本期加权平均净值利润率	-2.91%
本期基金份额净值增长率	-4.65%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-19,184,323.06
期末可供分配基金份额利润	-0.1376
期末基金资产净值	120,211,772.96
期末基金份额净值	0.862
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2013 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-13.80%

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。

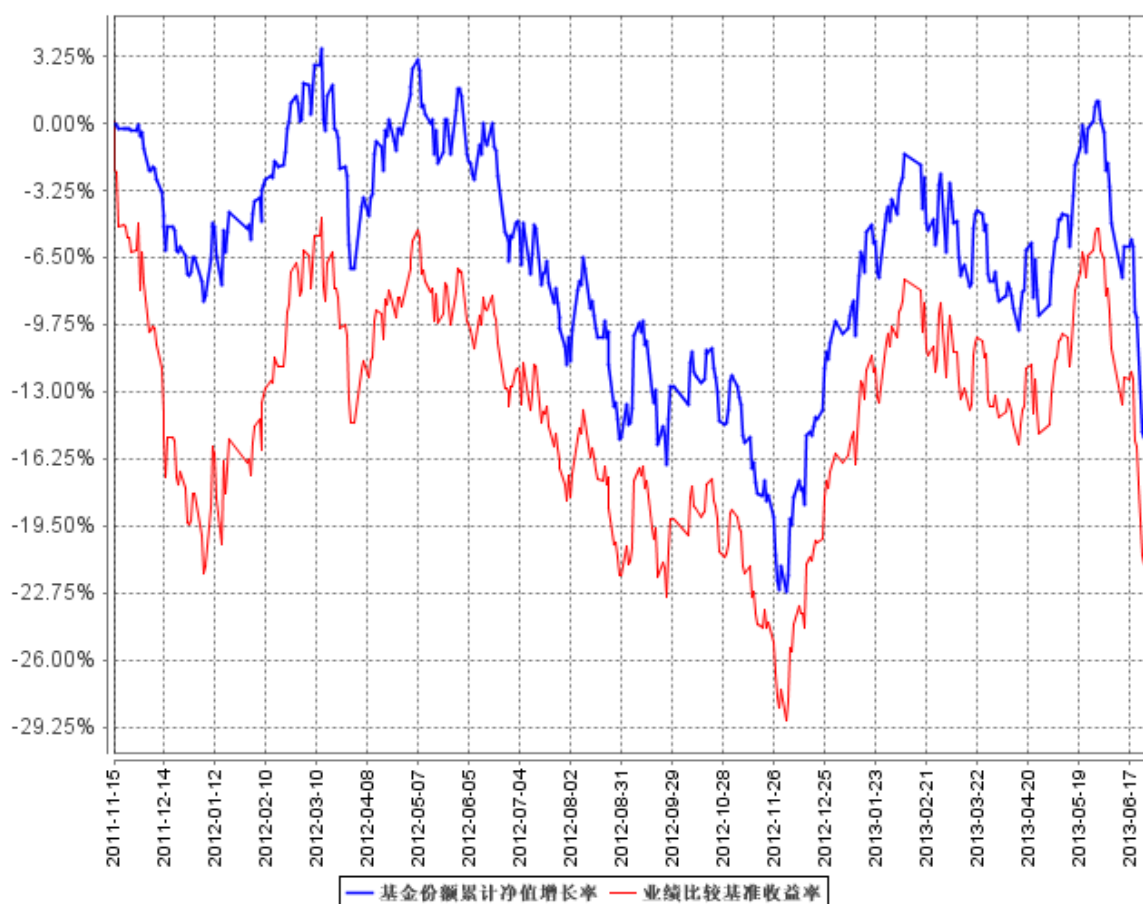
3.2 基金净值表现

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	-13.97%	1.90%	-14.98%	1.94%	1.01%	-0.04%
过去三个月	-6.71%	1.45%	-7.53%	1.49%	0.82%	-0.04%
过去六个月	-4.65%	1.41%	-4.98%	1.43%	0.33%	-0.02%
过去一年	-8.78%	1.34%	-8.56%	1.37%	-0.22%	-0.03%
自基金合同 生效起至今	-13.80%	1.24%	-20.19%	1.39%	6.39%	-0.15%

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

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



§ 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 6 月 30 日，公司旗下共管理十四只开放式基金，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。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		
刘钊	数量化投资部总监、基金经理	2013 年 4 月 15 日	-	5	中国科学技术大学管理学博士，曾任职于深交所博士后工作站，五矿证券有限责任公司，历任总裁助理、研究部负责人、董事会秘书。2010 年 1 月加入本公司，现任数量化投资部总监，2012 年 7 月起任摩根士丹利华鑫多因子精选策略股票型证券投资基金基金经理，2013 年 4 月起任本基金基金经理。
程志田	基金经理	2011 年 11 月 15 日	2013 年 4 月 15 日	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衍生产品总部研发部金融工程研究员、高级经理，国海证券

					有限责任公司研究所高级分析师兼金融工程负责人。2011 年 7 月加入本公司。
赵立松	基金经理	2011 年 11 月 15 日	2013 年 3 月 20 日	14	加拿大约克大学经济研究硕士，美国特许金融分析师（CFA）。曾任西南证券研究员，加拿大约克大学亚洲研究中心宏观经济研究员，深圳唯尔尼投资管理公司投资经理，华安财险股份有限公司首席研究员。2009 年 10 月加入本公司，历任研究员、研究管理部总监助理。

注：1、基金经理程志田先生和赵立松先生的任职日期为基金合同生效日，其他任职日期、离任日期为根据本公司决定确定的聘任日期、离任日期；

2、基金经理任职、离任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和注销；

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合规守信情况的说明

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

本基金主要通过量化模型作为投资交易决策的依据，其中“指数跟踪模型”被用于跟踪指数，“量化选股模型”被用于量化选股以增强基金业绩，“日内择时交易模型”被用于辅助判断日内交易时点。通过科学的量化模型研究体系、严格的风险管理机制、高效的量化投资执行制度，本基金在本报告期内较好地跟踪了标的指数的波动，控制了跟踪误差，并取得一定程度的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期截至 2013 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.862 元，份额累计净值为 0.862 元，报告期内基金份额净值增长率为-4.65%，同期业绩比较基准收益率为-4.98%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2013 年上半年，证券市场结构分化特征明显：代表大盘蓝筹股的沪深 300 指数下跌，代表成长型个股的创业板指数大幅上涨，本基金标的指数深证 300 指数兼具大盘蓝筹和成长股特点，表现中规中矩。

展望下半年，宏观经济形势可以概括为稳增长、调结构。首先是稳增长。李克强总理多次强调，宏观调控的主要目的就是要避免经济大起大落，使经济运行保持在合理区间。在整体经济形势下滑的背景下，稳住“合理区间”的“下限”显然更为重要。可以合理预期，一旦经济增长低于某个下限值，宏观政策将会适时进行一些微调。

其次是调结构。目前，一些周期性行业存在产难过剩的问题，对经济增长起到了较大的负面影响。李克强总理强调了遏制产能严重过剩行业盲目扩张的硬任务，工信部也公布了淘汰落后产能企业名单，主要集中在水泥、造纸、焦炭等行业。可以预期，周期性行业去杠杆将持续较长一段时间。相反，以互联网、传媒、电子、环保等为代表的新兴行业、民生行业得到了政策支持，将在调结构中获益。

基于以上对宏观经济的判断，我们认为今年下半年 A 股市场仍将维持结构性行情的趋势。周期性行业在稳增长、去杠杆的基调下，不容易大幅下跌，也难以大幅上涨，总体上将在一定范围内上下波动。新兴行业的成长型个股上半年已积累了较大的涨幅，存在调整的需求。但一旦完成

调整，仍将是未来一段时间最重要的投资标的。

在投资管理上，我们将继续发挥行业研究和量化投资方面的团队优势，在跟踪指数的基础上，适当的精选个股，对投资业绩进行增强。

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

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、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

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关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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	1,197,573.19	9,251,754.22
结算备付金		374,780.93	386,216.99
存出保证金		23,610.74	1,764,245.42
交易性金融资产	6.4.7.2	115,818,185.70	136,432,229.66
其中：股票投资		110,877,276.50	136,432,229.66
基金投资		-	-
债券投资		4,940,909.20	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	2,500,000.00	-

应收证券清算款		641,135.55	3,031,768.83
应收利息	6.4.7.5	112,157.88	2,216.64
应收股利		14,862.49	-
应收申购款		13,185.25	49,154.18
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		120,695,491.73	150,917,585.94
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		29,285.65	-
应付赎回款		16,915.92	729,531.89
应付管理人报酬		106,902.19	116,721.61
应付托管费		16,035.30	17,508.25
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	105,766.29	211,055.24
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	208,813.42	2,285,888.23
负债合计		483,718.77	3,360,705.22
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	139,396,096.02	163,261,917.18
未分配利润	6.4.7.10	-19,184,323.06	-15,705,036.46
所有者权益合计		120,211,772.96	147,556,880.72
负债和所有者权益总计		120,695,491.73	150,917,585.94

注：报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.862 元，基金份额总额 139,396,096.02 份。

6.2 利润表

会计主体：摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
一、收入		-2,674,277.74	16,363,009.60
1.利息收入		74,792.81	576,219.05
其中：存款利息收入	6.4.7.11	30,152.38	159,856.51

债券利息收入		27,080.80	4.29
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		17,559.63	416,358.25
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		5,970,477.00	3,687,464.60
其中：股票投资收益	6.4.7.12	5,050,792.57	2,734,007.78
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	695.71
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	919,684.43	952,761.11
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-8,740,144.26	11,625,363.09
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	20,596.71	473,962.86
减：二、费用		1,545,753.43	2,484,691.00
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	718,754.78	1,245,691.70
2. 托管费	6.4.10.2.2	107,813.22	186,853.73
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	463,946.31	789,063.02
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	255,239.12	263,082.55
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-4,220,031.17	13,878,318.60
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-4,220,031.17	13,878,318.60

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	163,261,917.18	-15,705,036.46	147,556,880.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利	-	-4,220,031.17	-4,220,031.17

润)			
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)	-23,865,821.16	740,744.57	-23,125,076.59
其中: 1.基金申购款	6,223,730.28	-419,634.65	5,804,095.63
2.基金赎回款	-30,089,551.44	1,160,379.22	-28,929,172.22
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)	139,396,096.02	-19,184,323.06	120,211,772.96
项目	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 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)	421,922,840.88	-27,412,731.27	394,510,109.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	13,878,318.60	13,878,318.60
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)	-251,941,594.35	4,240,699.77	-247,700,894.58
其中: 1.基金申购款	131,323,169.75	127,511.04	131,450,680.79
2.基金赎回款	-383,264,764.10	4,113,188.73	-379,151,575.37
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)	169,981,246.53	-9,293,712.90	160,687,533.63

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

沈良

周源

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

摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金(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 1218 号《关于核准摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强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《摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强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 421,871,132.46 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(2011)第 439 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2011 年 11 月 15 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 421,922,840.88 份基金份额,其中认购资金利息折合 51,708.42 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《摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强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(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例范围为 90%—95%,其中投资于深证 300 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产的 80%;除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 5%—10%,保持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%,股指期货、权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金力求控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%,年化跟踪误差不超过 7.75%。本基金的业绩比较基准为:深证 300 价格指数收益率 $\times 95\%$ +银行活期存款利率(税后) $\times 5\%$ 。

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”)、中国证监会公告[2010]5 号《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>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型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 2013 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 2013 年 6 月 30 日的财务状况以及 2013 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[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、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 号文《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》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(a) 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。

(b) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(c) 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派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。2013 年 1 月 1 日以前，对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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。

(d) 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。

(e) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
活期存款	1,197,573.19
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	1,197,573.19

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2013 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		124,259,008.37	110,877,276.50	-13,381,731.87
债券	交易所市场	4,955,952.00	4,940,909.20	-15,042.80
	银行间市场	-	-	-
	合计	4,955,952.00	4,940,909.20	-15,042.80
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		129,214,960.37	115,818,185.70	-13,396,774.67

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	2,500,000.00	-
合计	2,500,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	257.97
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	168.60
应收债券利息	110,887.37
应收买入返售证券利息	833.34
应收申购款利息	-
其他	10.60
合计	112,157.88

注：“其他”为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	105,766.29
银行间市场应付交易费用	-
合计	105,766.29

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	45.90
预提费用	158,767.52
指数使用费	50,000.00
合计	208,813.42

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	163,261,917.18	163,261,917.18
本期申购	6,223,730.28	6,223,730.28
本期赎回(以“-”号填列)	-30,089,551.44	-30,089,551.44
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	139,396,096.02	139,396,096.02

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-13,385,947.79	-2,319,088.67	-15,705,036.46
本期利润	4,520,113.09	-8,740,144.26	-4,220,031.17
本期基金份额交易产生的变动数	1,585,355.63	-844,611.06	740,744.57
其中：基金申购款	-408,515.49	-11,119.16	-419,634.65
基金赎回款	1,993,871.12	-833,491.90	1,160,379.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-7,280,479.07	-11,903,843.99	-19,184,323.06

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	26,989.91
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	2,622.73
其他	539.74
合计	30,152.38

注：“其他”为申购款利息收入和结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

卖出股票成交总额	160,585,707.07
减：卖出股票成本总额	155,534,914.50
买卖股票差价收入	5,050,792.57

6.4.7.13 债券投资收益

注：本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	919,684.43
基金投资产生的股利收益	-
合计	919,684.43

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-8,740,144.26
——股票投资	-8,725,101.46
——债券投资	-15,042.80
——资产支持证券投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-8,740,144.26

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	19,789.07
基金转出费收入	807.64

合计	20,596.71
----	-----------

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	463,946.31
银行间市场交易费用	-
合计	463,946.31

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	119,014.74
银行费用	1,571.60
债券帐户维护费	4,500.00
指数使用费	100,000.00
其他	400.00
合计	255,239.12

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度(自然季度)人民币 50,000 元。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 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 6 月 30 日		上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 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	-	-	76,362,679.23	15.01%

注：本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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 6 月 30 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	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 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	64,908.24	15.43%	938.67	0.74%

注：1. 本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

2. 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。

3. 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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	718,754.78	1,245,691.70
其中：支付销售机构的客户维护费	326,709.91	739,788.02

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 1.00% 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 × 1.00% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	107,813.22	186,853.73

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 0.15% 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 × 0.15% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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

注：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。

6.4.10.5 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 6 月 30 日		上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 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
中国建设银行	1,197,573.19	26,989.91	9,686,389.89	103,136.39

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：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。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：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。

6.4.11 利润分配情况**6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金**

注：本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2013 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 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
000999	华润三九	2013 年 6 月 3 日	重大事项停牌	26.55	2013 年 8 月 19 日	26.51	30,486	749,591.75	809,403.30	-
300027	华谊兄弟	2013 年 6 月 5 日	重大事项停牌	28.55	2013 年 7 月 24 日	31.41	24,310	451,307.31	694,050.50	-
000998	隆平高科	2013 年 5 月 3 日	重大事项停牌	20.73	2013 年 7 月 8 日	20.50	26,425	518,672.64	547,790.25	-
300133	华策影视	2013 年 5 月 28 日	重大事项停牌	24.43	2013 年 7 月 30 日	26.87	11,850	221,137.95	289,495.50	-

		日	停牌		日					
000997	新大陆	2013 年 6 月 3 日	重大事项停牌	15.11	-	-	18,849	210,891.76	284,808.39	-
000683	远兴能源	2013 年 4 月 8 日	重大事项停牌	4.80	2013 年 7 月 18 日	5.09	38,976	261,270.23	187,084.80	-
002252	上海莱士	2013 年 3 月 26 日	重大事项停牌	21.00	2013 年 7 月 2 日	22.80	7,763	116,315.69	163,023.00	-
000928	中钢吉炭	2013 年 5 月 14 日	重大事项停牌	9.66	2013 年 8 月 14 日	10.63	9,365	103,681.06	90,465.90	-
600436	片仔癀	2013 年 6 月 21 日	配股停牌	136.82	2013 年 7 月 1 日	118.73	500	70,008.00	68,410.00	-
300020	银江股份	2013 年 6 月 3 日	重大事项停牌	22.67	-	-	2,653	50,290.89	60,143.51	-
000600	建投能源	2013 年 5 月 20 日	重大事项停牌	4.07	2013 年 7 月 15 日	4.31	13,814	59,438.53	56,222.98	-
601918	国投新集	2013 年 5 月 16 日	重大事项停牌	7.55	-	-	60	519.20	453.00	-

注：本基金截至 2013 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票指数增强型基金，以深证 300 指数作为本基金投资组合跟踪的目标指数。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使

本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“谋求超过业绩比较基准的投资业绩”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任，其下设的风险控制和审计委员会负责制定风险管理政策，检查公司和基金运作的合法合规情况；公司经营层对内部控制制度的有效执行承担责任，其下设的风险管理委员会负责讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；督察长监督检查基金和公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况；监察稽核部、风险管理部分工负责风险监督与控制，前者负责协调并与各部门合作完成运营及合规风险管理，后者主要负责基金投资的信用风险、市场风险以及流动性风险的管理；基金经理、投资总监以及投资决策委员会负责对基金投资业务风险进行直接管理。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2013 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券 (2012 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现产生的潜在损失。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2013 年 6 月 30 日，本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量

在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2013 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,197,573.19	-	-	-	1,197,573.19
结算备付金	374,780.93	-	-	-	374,780.93
存出保证金	23,610.74	-	-	-	23,610.74
交易性金融资产	4,940,909.20	-	-	110,877,276.50	115,818,185.70
买入返售金融资产	2,500,000.00	-	-	-	2,500,000.00
应收证券清算款	-	-	-	641,135.55	641,135.55
应收利息	-	-	-	112,157.88	112,157.88
应收股利	-	-	-	14,862.49	14,862.49
应收申购款	-	-	-	13,185.25	13,185.25
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	9,036,874.06	-	-	111,658,617.67	120,695,491.73
负债					
应付证券清算款	-	-	-	29,285.65	29,285.65
应付赎回款	-	-	-	16,915.92	16,915.92
应付管理人报酬	-	-	-	106,902.19	106,902.19
应付托管费	-	-	-	16,035.30	16,035.30
应付交易费用	-	-	-	105,766.29	105,766.29
其他负债	-	-	-	208,813.42	208,813.42
负债总计	-	-	-	483,718.77	483,718.77
利率敏感度缺口	9,036,874.06	-	-	111,174,898.90	120,211,772.96
上年度末 2012 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	9,251,754.22	-	-	-	9,251,754.22
结算备付金	386,216.99	-	-	-	386,216.99
存出保证金	-	-	-	1,764,245.42	1,764,245.42
交易性金融资产	-	-	-	136,432,229.66	136,432,229.66
应收证券清算款	-	-	-	3,031,768.83	3,031,768.83
应收利息	-	-	-	2,216.64	2,216.64
应收申购款	-	-	-	49,154.18	49,154.18
资产总计	9,637,971.21	-	-	141,279,614.73	150,917,585.94

负债					
应付赎回款	-	-	-	729,531.89	729,531.89
应付管理人报酬	-	-	-	116,721.61	116,721.61
应付托管费	-	-	-	17,508.25	17,508.25
应付交易费用	-	-	-	211,055.24	211,055.24
其他负债	-	-	-	2,285,888.23	2,285,888.23
负债总计	-	-	-	3,360,705.22	3,360,705.22
利率敏感度缺口	9,637,971.21	-	-	137,918,909.51	147,556,880.72

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2013 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 4.11%(2012 年 12 月 31 日：0.00%)。因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2012 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，在有效跟踪深证 300 指数的基础上，通过运用增强型投资策略，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资占基金净值的 90%-95%，其中投资于深证 300 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产的 80%；除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 5%-10%，保持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%，股指期货、权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。此外，本基金的基金管理人日常对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定

量方法对基金进行风险度量，测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日		上年度末 2012 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	110,877,276.50	92.23	136,432,229.66	92.46
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	110,877,276.50	92.23	136,432,229.66	92.46

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 6.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2013 年 6 月 30 日）	上年度末（2012 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%	5,530,000.00	7,380,000.00
	业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-5,530,000.00	-7,380,000.00

§ 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	110,877,276.50	91.87

	其中：股票	110,877,276.50	91.87
2	固定收益投资	4,940,909.20	4.09
	其中：债券	4,940,909.20	4.09
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	2,500,000.00	2.07
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	1,572,354.12	1.30
6	其他各项资产	804,951.91	0.67
7	合计	120,695,491.73	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资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	1,945,563.46	1.62
B	采矿业	3,358,973.15	2.79
C	制造业	60,745,765.99	50.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,037,541.08	1.69
E	建筑业	3,199,502.96	2.66
F	批发和零售业	4,063,798.95	3.38
G	交通运输、仓储和邮政业	653,448.93	0.54
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,392,552.07	3.65
J	金融业	7,229,218.78	6.01
K	房地产业	9,337,930.24	7.77
L	租赁和商务服务业	458,027.92	0.38
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,360,181.01	1.96
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	1,292,615.24	1.08
S	综合	554,257.00	0.46
	合计	101,629,376.78	84.54

7.2.2 期末积极投资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	228,562.76	0.19
B	采掘业	237,411.76	0.20
C	制造业	5,187,217.89	4.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	52.44	0.00
E	建筑业	663.08	0.00
F	批发和零售业	316,705.26	0.26
G	交通运输、仓储和邮政业	241,453.68	0.20
H	住宿和餐饮业	1,005.60	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	228,249.21	0.19
J	金融业	1,720,913.48	1.43
K	房地产业	272,392.16	0.23
L	租赁和商务服务业	521,135.30	0.43
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,896.42	0.00
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	289,709.40	0.24
S	综合	531.28	0.00
	合计	9,247,899.72	7.69

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	000002	万 科 A	462,862	4,559,190.70	3.79
2	000651	格力电器	120,890	3,029,503.40	2.52
3	000001	平安银行	224,888	2,242,133.36	1.87
4	000858	五 粮 液	107,790	2,160,111.60	1.80
5	000776	广发证券	140,514	1,556,895.12	1.30
6	000063	中兴通讯	118,966	1,516,816.50	1.26
7	000895	双汇发展	33,642	1,293,198.48	1.08

8	000527	美的电器	104,051	1,292,313.42	1.08
9	000538	云南白药	14,603	1,226,798.03	1.02
10	000157	中联重科	225,798	1,226,083.14	1.02
11	002353	杰瑞股份	16,848	1,162,512.00	0.97
12	002024	苏宁云商	225,295	1,128,727.95	0.94
13	000423	东阿阿胶	28,780	1,113,210.40	0.93
14	002450	康得新	38,388	1,074,096.24	0.89
15	000338	潍柴动力	61,149	1,060,935.15	0.88
16	000625	长安汽车	113,327	1,052,807.83	0.88
17	002241	歌尔声学	28,249	1,025,156.21	0.85
18	002236	大华股份	26,794	1,024,334.62	0.85
19	002081	金螳螂	34,973	995,681.31	0.83
20	000024	招商地产	39,194	951,630.32	0.79
21	000100	TCL 集团	408,614	927,553.78	0.77
22	000069	华侨城 A	177,212	916,186.04	0.76
23	000568	泸州老窖	37,157	883,593.46	0.74
24	002415	海康威视	24,208	855,510.72	0.71
25	002230	科大讯飞	18,423	851,142.60	0.71
26	002038	双鹭药业	14,335	840,031.00	0.70
27	300070	碧水源	21,863	823,797.84	0.69
28	000999	华润三九	30,486	809,403.30	0.67
29	002142	宁波银行	95,199	806,335.53	0.67
30	000400	许继电气	28,820	780,445.60	0.65
31	000725	京东方 A	330,447	733,592.34	0.61
32	000963	华东医药	17,585	700,762.25	0.58
33	300027	华谊兄弟	24,310	694,050.50	0.58
34	002304	洋河股份	12,736	691,564.80	0.58
35	300104	乐视网	26,629	691,022.55	0.57
36	000581	威孚高科	20,135	672,307.65	0.56
37	000983	西山煤电	82,295	671,527.20	0.56
38	000783	长江证券	84,737	670,269.67	0.56
39	000848	承德露露	29,015	658,930.65	0.55
40	000402	金融街	127,195	637,246.95	0.53
41	002422	科伦药业	11,645	620,794.95	0.52
42	000826	桑德环境	19,219	620,197.13	0.52
43	000661	长春高新	6,269	613,797.79	0.51
44	000793	华闻传媒	59,737	598,564.74	0.50
45	000012	南玻 A	62,563	579,959.01	0.48
46	000970	中科三环	43,988	573,603.52	0.48

47	000623	吉林敖东	39,037	569,159.46	0.47
48	300024	机器人	15,107	561,225.05	0.47
49	000792	盐湖股份	32,814	555,869.16	0.46
50	002594	比亚迪	18,537	554,441.67	0.46
51	000009	中国宝安	50,387	554,257.00	0.46
52	000998	隆平高科	26,425	547,790.25	0.46
53	000768	中航飞机	60,881	541,840.90	0.45
54	000800	一汽轿车	43,790	538,617.00	0.45
55	000503	海虹控股	37,502	528,028.16	0.44
56	000562	宏源证券	56,772	499,025.88	0.42
57	002570	贝因美	17,769	496,643.55	0.41
58	000629	攀钢钒钛	203,079	477,235.65	0.40
59	000598	兴蓉投资	99,082	476,584.42	0.40
60	000060	中金岭南	71,508	473,382.96	0.39
61	000917	电广传媒	40,164	472,730.28	0.39
62	000039	中集集团	45,733	472,421.89	0.39
63	002140	东华科技	18,825	467,048.25	0.39
64	000425	徐工机械	59,393	466,235.05	0.39
65	002008	大族激光	41,568	465,145.92	0.39
66	002456	欧菲光	9,416	448,766.56	0.37
67	002310	东方园林	11,716	448,605.64	0.37
68	002202	金风科技	82,274	443,456.86	0.37
69	002146	荣盛发展	30,242	426,714.62	0.35
70	000630	铜陵有色	39,234	422,942.52	0.35
71	002385	大北农	40,966	422,769.12	0.35
72	002041	登海种业	19,016	403,709.68	0.34
73	000728	国元证券	47,392	400,936.32	0.33
74	000501	鄂武商 A	35,330	395,696.00	0.33
75	000709	河北钢铁	210,790	389,961.50	0.32
76	000878	云南铜业	40,020	388,194.00	0.32
77	002375	亚厦股份	12,509	385,277.20	0.32
78	000729	燕京啤酒	65,240	372,520.40	0.31
79	002007	华兰生物	16,243	366,766.94	0.31
80	002408	齐翔腾达	31,321	358,625.45	0.30
81	002065	东华软件	17,755	351,549.00	0.29
82	000839	中信国安	52,514	338,715.30	0.28
83	000937	冀中能源	38,238	337,641.54	0.28
84	000061	农产品	56,080	337,040.80	0.28
85	000758	中色股份	32,903	333,307.39	0.28

86	002405	四维图新	23,596	329,872.08	0.27
87	002106	莱宝高科	21,019	322,641.65	0.27
88	002022	科华生物	21,758	322,235.98	0.27
89	002250	联化科技	15,894	317,721.06	0.26
90	002129	中环股份	17,105	315,416.20	0.26
91	002292	奥飞动漫	14,052	314,624.28	0.26
92	000960	锡业股份	25,654	312,978.80	0.26
93	000690	宝新能源	66,929	312,558.43	0.26
94	000876	新 希 望	31,704	312,284.40	0.26
95	002032	苏 泊 尔	25,410	305,682.30	0.25
96	002155	辰州矿业	37,324	300,084.96	0.25
97	000825	太钢不锈	116,568	299,579.76	0.25
98	000046	泛海建设	60,968	297,523.84	0.25
99	000997	新 大 陆	18,849	284,808.39	0.24
100	002223	鱼跃医疗	15,005	282,844.25	0.24
101	002051	中工国际	10,074	280,762.38	0.23
102	002073	软控股份	33,206	278,598.34	0.23
103	000786	北新建材	15,688	276,422.56	0.23
104	300146	汤臣倍健	6,196	272,562.04	0.23
105	000750	国海证券	26,372	272,159.04	0.23
106	000528	柳 工	41,847	272,005.50	0.23
107	000778	新兴铸管	54,779	268,964.89	0.22
108	000540	中天城投	38,014	266,478.14	0.22
109	002104	恒宝股份	20,264	261,608.24	0.22
110	002001	新 和 成	17,647	260,116.78	0.22
111	002005	德豪润达	27,337	254,234.10	0.21
112	000422	湖北宜化	37,180	250,965.00	0.21
113	002500	山西证券	42,326	250,569.92	0.21
114	002092	中泰化学	49,190	249,885.20	0.21
115	000049	德赛电池	4,138	248,280.00	0.21
116	000762	西藏矿业	21,554	248,086.54	0.21
117	000718	苏宁环球	41,802	245,795.76	0.20
118	002262	恩华药业	10,812	240,567.00	0.20
119	000790	华神集团	23,450	236,141.50	0.20
120	002028	思源电气	14,824	233,181.52	0.19
121	000731	四川美丰	27,959	232,339.29	0.19
122	000559	万向钱潮	44,043	231,225.75	0.19
123	000401	冀东水泥	27,690	227,611.80	0.19
124	000969	安泰科技	29,145	226,165.20	0.19

125	000511	银基发展	51,471	224,928.27	0.19
126	000566	海南海药	22,108	223,954.04	0.19
127	002011	盾安环境	22,078	223,870.92	0.19
128	002152	广电运通	20,361	223,563.78	0.19
129	002340	格林美	24,085	222,304.55	0.18
130	000735	罗牛山	42,402	221,338.44	0.18
131	002219	独一味	11,511	220,435.65	0.18
132	000933	神火股份	49,360	220,145.60	0.18
133	000982	中银绒业	27,415	219,594.15	0.18
134	000686	东北证券	13,370	217,128.80	0.18
135	000926	福星股份	29,971	216,090.91	0.18
136	002063	远光软件	14,899	215,290.55	0.18
137	000869	张裕 A	6,201	211,702.14	0.18
138	000726	鲁泰 A	24,837	209,624.28	0.17
139	000799	酒鬼酒	12,820	207,043.00	0.17
140	000027	深圳能源	41,140	206,934.20	0.17
141	000830	鲁西化工	56,640	206,736.00	0.17
142	002477	雏鹰农牧	12,892	203,564.68	0.17
143	000513	丽珠集团	5,437	202,800.10	0.17
144	002299	圣农发展	22,126	200,019.04	0.17
145	002161	远望谷	26,137	199,163.94	0.17
146	000518	四环生物	62,316	198,788.04	0.17
147	000028	国药一致	7,075	197,534.00	0.16
148	000975	银泰资源	23,408	190,072.96	0.16
149	000939	凯迪电力	38,424	187,893.36	0.16
150	000031	中粮地产	51,268	187,128.20	0.16
151	000683	远兴能源	38,976	187,084.80	0.16
152	000616	亿城股份	65,494	186,657.90	0.16
153	000877	天山股份	32,236	186,646.44	0.16
154	002004	华邦颖泰	13,034	183,649.06	0.15
155	000988	华工科技	31,712	182,026.88	0.15
156	000652	泰达股份	55,438	181,282.26	0.15
157	000563	陕国投 A	11,462	180,526.50	0.15
158	000829	天音控股	32,427	180,294.12	0.15
159	000961	中南建设	18,327	179,238.06	0.15
160	000541	佛山照明	28,903	178,909.57	0.15
161	002048	宁波华翔	21,338	178,385.68	0.15
162	000050	深天马 A	15,126	177,427.98	0.15
163	000006	深振业 A	41,284	175,869.84	0.15

164	000539	粤电力 A	38,772	175,249.44	0.15
165	000816	江淮动力	47,863	172,785.43	0.14
166	000930	中粮生化	43,741	172,339.54	0.14
167	000900	现代投资	22,385	171,692.95	0.14
168	000680	山推股份	51,355	171,525.70	0.14
169	002244	滨江集团	20,416	171,494.40	0.14
170	002431	棕榈园林	8,958	169,843.68	0.14
171	000525	红 太 阳	11,277	169,042.23	0.14
172	002428	云南锗业	14,902	168,690.64	0.14
173	002069	獐 子 岛	14,180	168,033.00	0.14
174	000078	海王生物	26,957	167,133.40	0.14
175	000807	云铝股份	44,807	166,682.04	0.14
176	002167	东方锆业	16,992	166,351.68	0.14
177	000488	晨鸣纸业	46,386	165,598.02	0.14
178	000572	海马汽车	49,397	163,998.04	0.14
179	000667	名流置业	92,124	163,980.72	0.14
180	000887	中鼎股份	26,022	163,938.60	0.14
181	000759	中百集团	29,947	163,211.15	0.14
182	002252	上海莱士	7,763	163,023.00	0.14
183	002030	达安基因	18,055	162,314.45	0.14
184	002237	恒邦股份	11,808	161,061.12	0.13
185	000636	风华高科	30,156	161,033.04	0.13
186	002050	三花股份	12,844	156,696.80	0.13
187	000977	浪潮信息	6,399	154,919.79	0.13
188	002176	江特电机	15,191	154,644.38	0.13
189	000685	中山公用	16,584	154,562.88	0.13
190	000612	焦作万方	18,062	152,985.14	0.13
191	000059	辽通化工	33,541	151,940.73	0.13
192	002128	露天煤业	17,261	150,861.14	0.13
193	001696	宗申动力	31,995	150,376.50	0.13
194	000587	金叶珠宝	14,371	147,015.33	0.12
195	000417	合肥百货	28,187	146,008.66	0.12
196	000601	韶能股份	44,033	144,868.57	0.12
197	000550	江铃汽车	9,319	142,673.89	0.12
198	000021	长城开发	31,841	141,692.45	0.12
199	000650	仁和药业	28,832	140,411.84	0.12
200	000090	深 天 健	20,168	140,369.28	0.12
201	002277	友阿股份	18,774	139,678.56	0.12
202	000860	顺鑫农业	12,786	139,111.68	0.12

203	000962	东方钨业	13,646	137,824.60	0.11
204	000596	古井贡酒	6,466	135,010.08	0.11
205	002123	荣信股份	19,239	133,326.27	0.11
206	002673	西部证券	11,496	133,238.64	0.11
207	000089	深圳机场	37,433	132,887.15	0.11
208	000931	中 关 村	28,718	132,677.16	0.11
209	002056	横店东磁	10,387	130,668.46	0.11
210	002646	青青稞酒	6,454	130,628.96	0.11
211	002064	华峰氨纶	18,805	130,506.70	0.11
212	000973	佛塑科技	37,613	130,140.98	0.11
213	000703	恒逸石化	15,062	129,683.82	0.11
214	300077	国民技术	8,371	128,411.14	0.11
215	000752	西藏发展	12,114	128,166.12	0.11
216	000571	新大洲 A	34,142	126,666.82	0.11
217	002029	七 匹 狼	17,707	126,605.05	0.11
218	000823	超声电子	15,421	125,989.57	0.10
219	000850	华茂股份	28,937	125,875.95	0.10
220	000036	华联控股	44,208	125,108.64	0.10
221	000608	阳光股份	24,606	124,752.42	0.10
222	000042	深 长 城	4,805	124,305.35	0.10
223	000996	中国中期	10,081	123,895.49	0.10
224	000537	广宇发展	23,426	123,220.76	0.10
225	000959	首钢股份	62,385	122,898.45	0.10
226	002183	怡 亚 通	18,276	120,987.12	0.10
227	000088	盐 田 港	36,301	120,882.33	0.10
228	000780	平庄能源	22,447	120,540.39	0.10
229	000301	东方市场	44,169	120,139.68	0.10
230	002013	中航精机	10,042	118,796.86	0.10
231	002261	拓维信息	8,149	117,834.54	0.10
232	002267	陕天然气	11,396	117,036.92	0.10
233	002153	石基信息	5,791	115,935.82	0.10
234	002191	劲嘉股份	13,359	115,555.35	0.10
235	300003	乐普医疗	10,240	115,200.00	0.10
236	002091	江苏国泰	8,899	115,064.07	0.10
237	002190	成飞集成	9,291	114,465.12	0.10
238	000989	九 芝 堂	10,180	112,590.80	0.09
239	002254	泰和新材	17,673	112,046.82	0.09
240	002006	精功科技	15,915	110,768.40	0.09
241	000426	兴业矿业	13,176	110,019.60	0.09

242	000592	中福实业	30,422	109,214.98	0.09
243	002168	深圳惠程	14,559	107,882.19	0.09
244	002122	天马股份	29,980	107,028.60	0.09
245	002025	航天电器	10,316	106,564.28	0.09
246	000968	煤气化	14,487	105,465.36	0.09
247	000655	金岭矿业	14,194	105,035.60	0.09
248	000659	珠海中富	54,200	104,606.00	0.09
249	000777	中核科技	6,813	102,467.52	0.09
250	000795	太原刚玉	10,521	102,369.33	0.09
251	000789	江西水泥	12,136	101,942.40	0.08
252	002233	塔牌集团	17,513	101,925.66	0.08
253	002479	富春环保	13,944	101,512.32	0.08
254	002399	海普瑞	5,672	100,961.60	0.08
255	002396	星网锐捷	7,072	100,705.28	0.08
256	002249	大洋电机	13,402	100,649.02	0.08
257	000159	国际实业	19,137	99,512.40	0.08
258	000698	沈阳化工	25,346	98,342.48	0.08
259	002154	报喜鸟	16,139	97,640.95	0.08
260	000099	中信海直	15,658	97,549.34	0.08
261	000852	江钻股份	7,493	97,409.00	0.08
262	002424	贵州百灵	6,757	97,098.09	0.08
263	002093	国脉科技	19,240	95,622.80	0.08
264	000543	皖能电力	16,453	95,427.40	0.08
265	000901	航天科技	8,602	95,310.16	0.08
266	000822	山东海化	30,532	94,038.56	0.08
267	300156	天立环保	8,538	92,466.54	0.08
268	002079	苏州固锝	20,687	92,264.02	0.08
269	000713	丰乐种业	11,303	91,893.39	0.08
270	002407	多氟多	8,509	90,961.21	0.08
271	000410	沈阳机床	17,612	90,525.68	0.08
272	000928	中钢吉炭	9,365	90,465.90	0.08
273	002476	宝莫股份	13,950	88,303.50	0.07
274	002130	沃尔核材	15,069	87,098.82	0.07
275	000987	广州友谊	9,852	84,431.64	0.07
276	002097	山河智能	14,774	83,473.10	0.07
277	002242	九阳股份	14,418	83,191.86	0.07
278	002378	章源钨业	4,371	81,519.15	0.07
279	000927	一汽夏利	21,970	79,092.00	0.07
280	002094	青岛金王	11,051	78,241.08	0.07

281	000722	湖南发展	12,192	76,443.84	0.06
282	000506	中润资源	17,202	74,140.62	0.06
283	000828	东莞控股	17,938	73,904.56	0.06
284	000951	中国重汽	8,669	73,079.67	0.06
285	000707	双环科技	19,890	72,797.40	0.06
286	002203	海亮股份	10,387	72,709.00	0.06
287	002490	山东墨龙	8,347	68,695.81	0.06
288	002601	佰利联	4,436	67,515.92	0.06
289	002218	拓日新能	11,003	67,338.36	0.06
290	002204	大连重工	6,523	66,991.21	0.06
291	000755	山西三维	17,422	60,454.34	0.05
292	002171	精诚铜业	9,629	59,314.64	0.05
293	000708	大冶特钢	10,607	56,641.38	0.05
294	000022	深赤湾 A	5,415	56,532.60	0.05
295	000600	建投能源	13,814	56,222.98	0.05
296	002136	安纳达	8,333	56,164.42	0.05
297	000514	渝开发	17,452	55,671.88	0.05
298	002269	美邦服饰	6,013	53,154.92	0.04
299	300224	正海磁材	3,611	52,142.84	0.04
300	000761	本钢板材	9,326	24,620.64	0.02

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600594	益佰制药	11,286	348,850.26	0.29
2	300133	华策影视	11,850	289,495.50	0.24
3	002400	省广股份	10,700	282,480.00	0.23
4	600036	招商银行	21,700	251,720.00	0.21
5	600600	青岛啤酒	6,565	249,338.70	0.21
6	601818	光大银行	85,700	247,673.00	0.21
7	600340	华夏幸福	7,600	247,304.00	0.21
8	601169	北京银行	30,900	246,273.00	0.20
9	601998	中信银行	66,200	245,602.00	0.20
10	002035	华帝股份	25,072	245,454.88	0.20
11	600720	祁连山	28,700	245,098.00	0.20
12	600729	重庆百货	12,600	244,062.00	0.20
13	601628	中国人寿	17,700	242,313.00	0.20

14	600522	中天科技	28,700	242,228.00	0.20
15	601988	中国银行	89,300	242,003.00	0.20
16	601009	南京银行	28,700	241,941.00	0.20
17	601006	大秦铁路	40,469	240,385.86	0.20
18	002436	兴森科技	14,200	239,270.00	0.20
19	002345	潮宏基	21,800	239,146.00	0.20
20	002108	沧州明珠	30,500	239,120.00	0.20
21	002311	海大集团	20,810	238,482.60	0.20
22	300005	探路者	24,900	237,546.00	0.20
23	601126	四方股份	16,400	236,980.00	0.20
24	600060	海信电器	22,600	234,814.00	0.20
25	601808	中海油服	16,577	233,569.93	0.19
26	000418	小天鹅 A	32,600	231,786.00	0.19
27	600498	烽火通信	14,026	231,148.48	0.19
28	600486	扬农化工	6,543	229,790.16	0.19
29	002313	日海通讯	13,900	229,211.00	0.19
30	600887	伊利股份	7,300	228,344.00	0.19
31	002447	壹桥苗业	13,000	228,150.00	0.19
32	600418	江淮汽车	32,357	227,469.71	0.19
33	300058	蓝色光标	2,906	121,180.20	0.10
34	600535	天士力	3,008	117,763.20	0.10
35	600637	百视通	4,200	117,600.00	0.10
36	300026	红日药业	3,326	112,884.44	0.09
37	300088	长信科技	5,200	109,668.00	0.09
38	300054	鼎龙股份	4,100	70,479.00	0.06
39	600436	片仔癀	500	68,410.00	0.06
40	300071	华谊嘉信	4,245	67,835.10	0.06
41	300020	银江股份	2,653	60,143.51	0.05
42	601888	中国国旅	1,700	49,640.00	0.04
43	000915	山大华特	2,100	47,565.00	0.04
44	600976	武汉健民	2,200	47,520.00	0.04
45	600422	昆明制药	1,787	47,355.50	0.04
46	300057	万顺股份	3,300	47,355.00	0.04
47	600192	长城电工	3,700	24,827.00	0.02
48	002410	广联达	1,300	24,648.00	0.02
49	000011	深物业 A	3,100	24,583.00	0.02
50	002271	东方雨虹	1,300	24,050.00	0.02
51	002308	威创股份	2,600	23,920.00	0.02
52	002367	康力电梯	2,113	23,644.47	0.02

53	300014	亿纬锂能	1,000	23,600.00	0.02
54	300002	神州泰岳	1,460	23,345.40	0.02
55	600120	浙江东方	2,100	23,331.00	0.02
56	600518	康美药业	1,200	23,076.00	0.02
57	300228	富瑞特装	96	7,680.00	0.01
58	600587	新华医疗	82	3,398.08	0.00
59	600557	康缘药业	96	2,548.80	0.00
60	600276	恒瑞医药	96	2,530.56	0.00
61	002294	信立泰	78	2,257.32	0.00
62	002588	史丹利	72	1,990.08	0.00
63	300289	利德曼	69	1,869.90	0.00
64	600086	东方金钰	88	1,783.76	0.00
65	600552	方兴科技	96	1,573.44	0.00
66	002648	卫星石化	69	1,515.93	0.00
67	300074	华平股份	80	1,448.00	0.00
68	002643	烟台万润	92	1,387.36	0.00
69	002159	三特索道	96	1,367.04	0.00
70	002216	三全食品	91	1,318.59	0.00
71	600549	厦门钨业	46	1,228.20	0.00
72	601336	新华保险	43	1,062.53	0.00
73	300123	太阳鸟	89	1,033.29	0.00
74	600754	锦江股份	80	1,005.60	0.00
75	600511	国药股份	69	989.46	0.00
76	600703	三安光电	50	982.00	0.00
77	002501	利源铝业	80	948.80	0.00
78	002565	上海绿新	86	937.40	0.00
79	600585	海螺水泥	70	936.60	0.00
80	600690	青岛海尔	83	905.53	0.00
81	300043	星辉车模	84	893.76	0.00
82	600123	兰花科创	69	872.85	0.00
83	600000	浦发银行	97	803.16	0.00
84	000705	浙江震元	60	802.80	0.00
85	300072	三聚环保	50	802.50	0.00
86	601601	中国太保	50	796.50	0.00
87	002324	普利特	50	781.00	0.00
88	601857	中国石油	98	745.78	0.00
89	002638	勤上光电	54	745.74	0.00
90	600801	华新水泥	70	740.60	0.00
91	600188	兖州煤业	77	723.80	0.00

92	600085	同仁堂	31	678.28	0.00
93	002663	普邦园林	44	663.08	0.00
94	000801	四川九洲	68	652.80	0.00
95	002318	久立特材	38	650.94	0.00
96	002317	众生药业	29	637.13	0.00
97	300039	上海凯宝	45	569.25	0.00
98	600805	悦达投资	58	531.28	0.00
99	000888	峨眉山 A	34	529.38	0.00
100	600649	城投控股	73	505.16	0.00
101	600004	白云机场	73	459.17	0.00
102	601918	国投新集	60	453.00	0.00
103	300274	阳光电源	28	452.48	0.00
104	000798	中水渔业	68	412.76	0.00
105	002656	卡奴迪路	28	411.32	0.00
106	600200	江苏吴中	26	406.64	0.00
107	600031	三一重工	54	405.54	0.00
108	600588	用友软件	45	402.30	0.00
109	300199	翰宇药业	32	355.52	0.00
110	601688	华泰证券	44	354.64	0.00
111	002327	富安娜	25	319.50	0.00
112	600406	国电南瑞	20	298.60	0.00
113	300047	天源迪科	38	295.64	0.00
114	601377	兴业证券	32	290.56	0.00
115	300016	北陆药业	40	274.00	0.00
116	000553	沙隆达 A	35	267.05	0.00
117	600139	西部资源	41	246.41	0.00
118	600583	海油工程	37	239.39	0.00
119	002582	好想你	19	234.46	0.00
120	600028	中国石化	56	234.08	0.00
121	000678	襄阳轴承	62	224.44	0.00
122	600581	八一钢铁	51	215.22	0.00
123	601100	恒立油缸	22	214.28	0.00
124	601098	中南传媒	23	213.90	0.00
125	600377	宁沪高速	37	199.43	0.00
126	600425	青松建化	48	182.40	0.00
127	600428	中远航运	60	181.20	0.00
128	300019	硅宝科技	21	166.32	0.00
129	601299	中国北车	44	165.44	0.00
130	600157	永泰能源	28	163.80	0.00

131	600348	阳泉煤业	18	162.72	0.00
132	601111	中国国航	28	118.72	0.00
133	002339	积成电子	14	113.68	0.00
134	600029	南方航空	37	104.34	0.00
135	601288	农业银行	28	68.88	0.00
136	002331	皖通科技	7	67.76	0.00
137	300009	安科生物	4	57.92	0.00
138	600795	国电电力	23	52.44	0.00
139	002430	杭氧股份	6	42.00	0.00
140	600298	安琪酵母	2	34.76	0.00
141	600426	华鲁恒升	4	21.88	0.00
142	601328	交通银行	3	12.21	0.00
143	600018	上港集团	2	4.96	0.00

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	000002	万 科 A	2,301,377.00	1.56
2	000776	广发证券	1,813,914.58	1.23
3	000858	五 粮 液	1,320,205.30	0.89
4	000157	中联重科	1,304,544.00	0.88
5	000651	格力电器	1,224,680.00	0.83
6	000001	平安银行	1,063,387.00	0.72
7	000725	京东方 A	950,503.22	0.64
8	002262	恩华药业	902,103.28	0.61
9	002140	东华科技	856,087.80	0.58
10	000400	许继电气	819,469.50	0.56
11	000028	国药一致	808,623.42	0.55
12	300146	汤臣倍健	722,715.00	0.49
13	002065	东华软件	721,692.00	0.49
14	000538	云南白药	715,105.80	0.48
15	002375	亚厦股份	695,112.02	0.47
16	000063	中兴通讯	685,478.00	0.46
17	600594	益佰制药	680,759.48	0.46

18	002250	联化科技	675,610.90	0.46
19	002142	宁波银行	673,193.00	0.46
20	000876	新 希 望	670,343.07	0.45

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	000002	万 科 A	2,978,776.55	2.02
2	000651	格力电器	1,934,194.63	1.31
3	000001	平安银行	1,884,121.02	1.28
4	000776	广发证券	1,840,556.99	1.25
5	000568	泸州老窖	1,826,769.62	1.24
6	600587	新华医疗	1,768,080.50	1.20
7	600594	益佰制药	1,722,786.02	1.17
8	000562	宏源证券	1,657,619.80	1.12
9	600637	百视通	1,596,508.04	1.08
10	000581	威孚高科	1,519,334.92	1.03
11	300039	上海凯宝	1,417,494.24	0.96
12	002587	奥拓电子	1,394,554.00	0.95
13	600889	南京化纤	1,339,505.95	0.91
14	000401	冀东水泥	1,249,959.19	0.85
15	000100	TCL 集团	1,222,496.45	0.83
16	000024	招商地产	1,220,348.30	0.83
17	002241	歌尔声学	1,215,016.00	0.82
18	000598	兴蓉投资	1,214,956.25	0.82
19	601377	兴业证券	1,202,778.41	0.82
20	002008	大族激光	1,195,612.35	0.81

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	138,705,062.80
卖出股票收入（成交）总额	160,585,707.07

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	4,940,909.20	4.11
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	-	-
8	其他	-	-
9	合计	4,940,909.20	4.11

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	010308	03 国债(8)	30,000	2,997,000.00	2.49
2	019025	10 国债 25	19,480	1,943,909.20	1.62

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：报告期内，本基金未参与股指期货交易；截至报告期末，本基金未持有股指期货合约。

7.9.2 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，本基金可运用股指期货，以提高投资效率，有效控制指数的跟踪误差，更好地实现投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，本着审慎原则，适度参与股指期货投资，改善投资组合风险收益特征。另外，本基金将利用

股指期货流动性好、杠杆交易的特点，进行现金管理，以应对大额申购赎回、大额现金分红等，管理流动性风险，优化投资组合对目标指数的跟踪效果，提高投资组合的运作效率等。

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体除宜宾五粮液股份有限公司（以下简称“五粮液”）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。

五粮液于 2013 年 2 月 23 日公告，其控股子公司“宜宾五粮液酒类销售有限责任公司”收到四川省发展和改革委员会《行政处罚决定书》川发改价检处[2013]1 号。五粮液在公告中陈述了《行政处罚决定书》有关内容和公司的说明。

五粮液（000858）为深证 300 指数成份股。本基金投资五粮液（000858）的决策流程符合本基金管理人投资管理制度和基金合同的相关规定。

7.10.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.10.3 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	23,610.74
2	应收证券清算款	641,135.55
3	应收股利	14,862.49
4	应收利息	112,157.88
5	应收申购款	13,185.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	804,951.91

7.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**7.10.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.10.5.2 期末积极投资前五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	300133	华策影视	289,495.50	0.24	重大事项停牌

§ 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
4,008	34,779.47	7,234,601.32	5.19%	132,161,494.70	94.81%

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	435,661.96	0.3125%

注：1. 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 0 至 10 万份（含）。

2. 本基金的基金经理未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011 年 11 月 15 日）基金份额总额	421,922,840.88
本报告期期初基金份额总额	163,261,917.18
本报告期基金总申购份额	6,223,730.28

减:本报告期基金总赎回份额	30,089,551.44
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	139,396,096.02

§ 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，基金管理人增聘孙要国先生为公司副总经理，公司于 2013 年 3 月 2 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	2	143,339,717.32	47.92%	126,842.48	47.26%	-
中金公司	1	31,596,430.65	10.56%	28,765.84	10.72%	-
方正证券	2	26,138,239.99	8.74%	23,797.72	8.87%	-
东方证券	2	23,444,752.99	7.84%	21,344.43	7.95%	-
海通证券	1	23,010,092.39	7.69%	20,948.86	7.80%	-
兴业证券	1	19,284,460.37	6.45%	17,558.77	6.54%	-
申银万国	1	10,893,301.51	3.64%	9,639.52	3.59%	-
齐鲁证券	2	10,529,113.30	3.52%	9,585.64	3.57%	-
中信浙江证券	1	8,751,901.40	2.93%	7,967.82	2.97%	-
长江证券	2	2,161,906.52	0.72%	1,968.27	0.73%	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
中信万通	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-

注：1.专用交易单元的选择标准

- (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。

2. 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；

3. 本基金本报告期交易单元未发生变化。

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	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	71,800,000.00	76.55%	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	3,500,000.00	3.73%	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
中信浙江证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	4,955,952.00	100.00%	8,500,000.00	9.06%	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	10,000,000.00	10.66%	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
中信万通	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

中银国际	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	本公司关于旗下基金在部分代销机构开通转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2013 年 1 月 10 日
2	本公司关于再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2013 年 1 月 11 日
3	本公司关于旗下证券投资基金调整停牌股票估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2013 年 1 月 19 日
4	本基金 2012 年 4 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2013 年 1 月 21 日
5	本公司关于高级管理人员变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2013 年 3 月 2 日
6	本基金基金经理变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2013 年 3 月 21 日
7	本公司关于旗下部分基金参与工商银行电子银行申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2013 年 3 月 29 日
8	本基金 2012 年年度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2013 年 3 月 29 日
9	本基金基金经理变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2013 年 4 月 13 日
10	本基金 2013 年第 1 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2013 年 4 月 19 日
11	本公司关于调整旗下基金对账单服务形式的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2013 年 4 月 25 日
12	本公司关于调整旗下基金对账单服务形式的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2013 年 6 月 7 日

13	本公司关于旗下基金调整停牌股票“华润三九”估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2013 年 6 月 8 日
14	关于招商银行暂停办理本公司旗下基金账户类及交易类业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2013 年 6 月 14 日
15	本公司关于旗下基金增加和讯信息科技有限公司为销售机构并参与申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2013 年 6 月 14 日
16	本公司关于旗下基金调整停牌股票“新华医疗”估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2013 年 6 月 22 日
17	本公司关于调整旗下基金最低申购金额和最低基金转换转出份额限制的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2013 年 6 月 26 日
18	本基金招募说明书（更新）（2013 年第 1 号）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2013 年 6 月 27 日
19	本公司关于旗下部分基金参与同花顺申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2013 年 6 月 28 日
20	本公司关于旗下部分基金在好买开通定投业务及参与定投费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2013 年 6 月 28 日
21	本公司关于旗下部分基金参与交通银行网上银行、手机银行申购费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2013 年 6 月 29 日

注：上述公告同时在公司网站 www.msfnfunds.com.cn 上披露。

§ 11 备查文件目录

11.1 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、本基金招募说明书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内在指定报刊上披露的各项公告。

11.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，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。

摩根士丹利华鑫基金管理有限公司

2013 年 8 月 27 日