

# 摩根士丹利华鑫强收益债券型 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

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b>                       | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b>                          | <b>5</b>  |
| 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                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料                              | 6         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>                 | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| <b>§4 管理人报告</b>                         | <b>8</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 8         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 9         |
| 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             | 10        |
| 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                | 11        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 12        |
| <b>§5 托管人报告</b>                         | <b>12</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 12        |
| 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 | 12        |
| 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      | 12        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>               | <b>13</b> |
| 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        |
| <b>§7 投资组合报告</b>                        | <b>30</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 30        |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合                      | 31        |
| 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       | 31        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 31        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 31        |
| 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      | 32        |
| 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   | 32        |
| 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      | 32        |
| 7.9 投资组合报告附注                            | 32        |
| <b>§8 基金份额持有人信息</b>                     | <b>33</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构                   | 33        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况                | 33        |
| <b>§9 开放式基金份额变动</b>                     | <b>34</b> |

|                                  |           |
|----------------------------------|-----------|
| <b>§10 重大事件揭示</b>                | <b>34</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议                 | 34        |
| 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 | 34        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼      | 34        |
| 10.4 基金投资策略的改变                   | 34        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况            | 35        |
| 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    | 35        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况           | 35        |
| 10.8 其他重大事件                      | 36        |
| <b>§11 备查文件目录</b>                | <b>37</b> |
| 11.1 备查文件目录                      | 37        |
| 11.2 存放地点                        | 37        |
| 11.3 查阅方式                        | 38        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                     |
|------------|---------------------|
| 基金名称       | 摩根士丹利华鑫强收益债券型证券投资基金 |
| 基金简称       | 大摩强收益债券             |
| 基金主代码      | 233005              |
| 基金交易代码     | 233005              |
| 基金运作方式     | 契约型开放式              |
| 基金合同生效日    | 2009 年 12 月 29 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      | 中国银行股份有限公司          |
| 报告期末基金份额总额 | 115,335,141.78 份    |
| 基金合同存续期    | 不定期                 |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|--------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金的投资目标是在严格控制风险的前提下审慎投资、主动管理，寻求最大化的总回报，包括当期收益和资本增值。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 投资策略   | <p>本基金的资产配置以投资债券等固定收益类资产为主，并着重投资于信用类固定收益证券和适当投资低风险非固定收益证券，在综合考虑基金组合的流动性需求、本金安全和投资风险控制的基础上，根据市场中投资机会的相对价值和风险决定现金类资产、非现金类固定收益资产和低风险非固定收益类资产的具体比例。</p> <p>对于固定收益投资，本基金通过分析经济增长、通货膨胀、收益率曲线、信用利差、提前偿付率等指标来发现固定收益市场中存在的各种投资机会，并根据这些投资机会的相对投资价值构建投资组合。本基金着重投资于承载一定信用风险、收益率相对较高的投资级信用类固定收益证券，以增强基金的收益。此外，本基金还可以利用回购进行无风险套利和在严格控制风险的前提下适当使用杠杆以获取增强收益。</p> <p>对于非固定收益投资，本基金根据对股票市场趋势的判断，积极寻找和仔细评估可转换债券和一级市场股票的投资机会，在严格控制投资风险的基础上审慎投资，通过权益类投资获取额外的增强收益。</p> |
| 业绩比较基准 | 中债综合指数                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 风险收益特征 | 本基金属债券型证券投资基金，属于证券投资基金中的较低风险品种。本基金长期平均风险和预期收益低于股票和混合型基金，高于货币市场基金。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |

## 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                       | 中国银行股份有限公司               |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 李锦                                    | 唐州徽                      |
|         | 联系电话 | (0755) 88318883                       | 95566                    |
|         | 电子邮箱 | xxpl@msfunds.com.cn                   | tgxxpl@bank-of-china.com |
| 客户服务电话  |      | 400-8888-668                          | 95566                    |
| 传真      |      | (0755) 82990384                       | (010) 66594942           |
| 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 | 北京西城区复兴门内大街 1 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         | 北京西城区复兴门内大街 1 号          |
| 邮政编码    |      | 518048                                | 100818                   |
| 法定代表人   |      | 王文学                                   | 田国立                      |

## 2.4 信息披露方式

|                      |                    |
|----------------------|--------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称       | 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.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       |

## 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       | 7,356,831.14                           |
| 本期利润          | 3,450,646.36                           |

|                      |                                |
|----------------------|--------------------------------|
| 加权平均基金份额本期利润         | 0.0270                         |
| 本期加权平均净值利润率          | 2.29%                          |
| 本期基金份额净值增长率          | 2.14%                          |
| <b>3.1.2 期末数据和指标</b> | <b>报告期末( 2013 年 6 月 30 日 )</b> |
| 期末可供分配利润             | 19,883,791.26                  |
| 期末可供分配基金份额利润         | 0.1724                         |
| 期末基金资产净值             | 135,769,874.72                 |
| 期末基金份额净值             | 1.1772                         |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b>  | <b>报告期末( 2013 年 6 月 30 日 )</b> |
| 基金份额累计净值增长率          | 21.62%                         |

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。

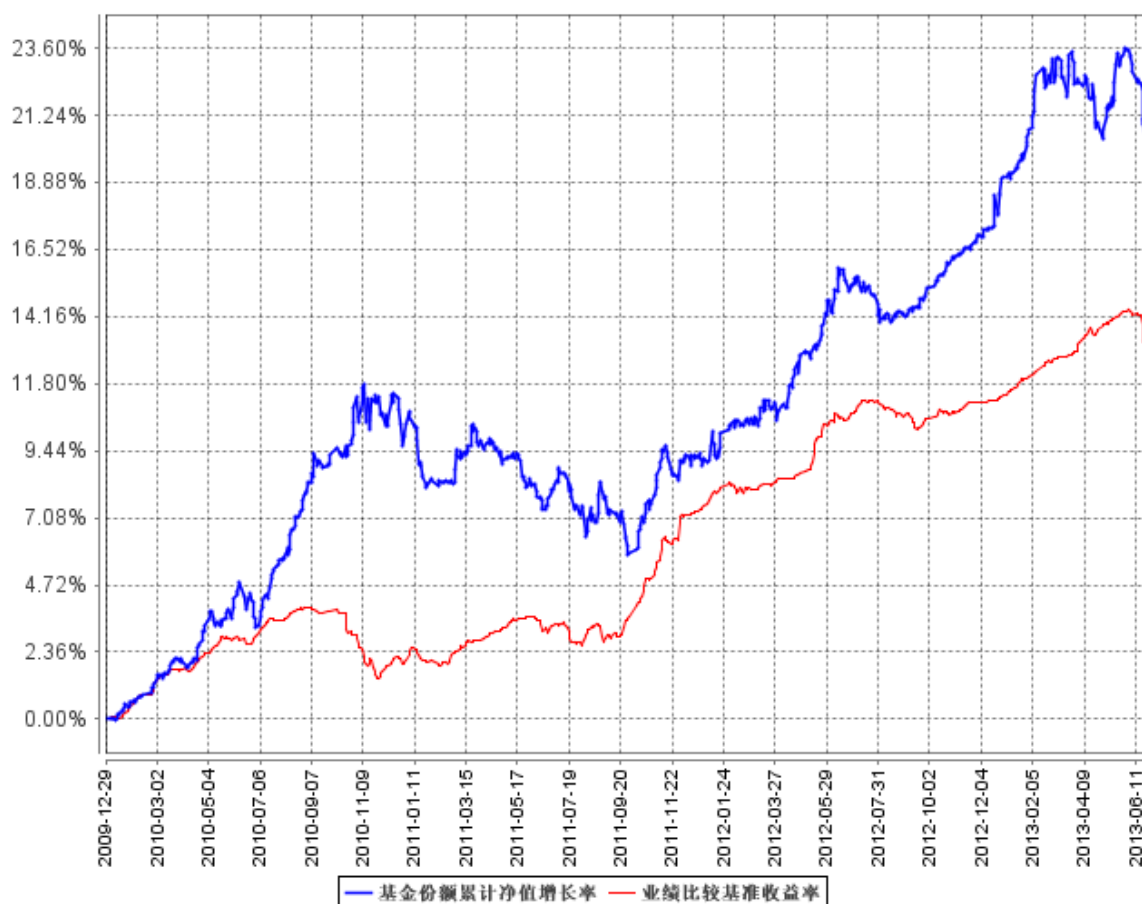
## 3.2 基金净值表现

### 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<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④   |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去一个月          | -1.58%       | 0.34%               | -0.31%             | 0.18%                 | -1.27% | 0.16% |
| 过去三个月          | -0.64%       | 0.30%               | 0.93%              | 0.11%                 | -1.57% | 0.19% |
| 过去六个月          | 2.14%        | 0.28%               | 2.34%              | 0.08%                 | -0.20% | 0.20% |
| 过去一年           | 5.46%        | 0.22%               | 2.94%              | 0.06%                 | 2.52%  | 0.16% |
| 过去三年           | 17.48%       | 0.22%               | 10.82%             | 0.07%                 | 6.66%  | 0.15% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 21.62%       | 0.21%               | 14.01%             | 0.07%                 | 7.61%  | 0.14% |

### 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<br>（助理）期限 |      | 证券从<br>业年限 | 说明                                                                                                                                                                                                     |
|-----|------|---------------------|------|------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |      | 任职日期                | 离任日期 |            |                                                                                                                                                                                                        |
| 洪天阳 | 基金经理 | 2012 年 10 月 11 日    | -    | 6          | 伦敦帝国学院计算科学博士。曾于 2005 年 9 月至 2007 年 7 月任职于摩根大通银行投资银行部，2007 年 10 月至 2012 年 8 月任职于中银保险北京总公司，历任外汇投资经理、固定收益投资经理、权益类投资经理和组合投资经理等职。2012 年 9 月加入本公司，2012 年 10 月起任本基金基金经理，2013 年 3 月起任摩根士丹利华鑫双利增强债券型证券投资基金基金经理。 |

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

2013 年上半年，中国债券市场在经历了一季度的流动性盛宴之后，二季度福过灾生。

宏观方面，上半年经济继续呈现弱复苏态势。PMI，工业增加值，铁路货运量和发电量等数据均无超预期回升，进一步印证经济复苏乏力。通胀方面，在总需求趋弱的大背景下，国内农产品价格涨幅低于预期，而国际大宗商品价格甚至出现下跌，通胀环境仍较为温和。

有利债市的基本面和超预期宽松的流动性共同促成了一季度债券的牛市。但是进入二季度，监管风暴和流动性紧缩使债市陷入调整。四月债市监管风暴拉开债市调整之幕，不过由于当时经济基本面有利且资金宽松，市场短期内似乎消化了利空因素，没有引起投资者足够重视。五月中旬，年初以来持续宽松的资金开始逐渐收紧，直至六月底季节性因素叠加商业银行等机构投资者的误判引发了近年最严重的“钱荒”，导致债券市场一轮剧烈的去杠杆和股票市场的暴跌。

2013 年上半年，本基金秉承稳中求进的原则，力争在风险可控的前提下为投资人获取绝对收益。一季度初，基于对流动性的前瞻和机构持仓杠杆等因素的判断，本基金适度增加组合的杠杆和组合久期，并增加了转债配置；春节后减持信用债持仓，并调整了转债组合。进入二季度，本基金重新审视风险因素，降低了组合的杠杆和久期，持有短融、高等级信用债和转债等流动性较

好的资产。五月底，由于流动性偏紧，主动减持了部分转债和短融。本基金坚持超配流动性较好资产，虽然流动性紧缩时组合净值波动较大，但可确保组合流动性风险可控，也使得本基金在市场调整中可以增配转债等弹性较好的资产。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2013 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.1772 元，累计份额净值为 1.2122 元，报告期内基金份额净值增长率为 2.14%，同期业绩比较基准收益率为 2.34%。

#### 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 2013 年下半年，中国经济仍将延续弱复苏趋势，通胀压力暂无，基本面有利于债券市场。但是，随着外汇占款缩量常态化，QE 退出引发的流动性压力逐步显现；同时，美国国债收益率上移也将抬高中国国债收益率的中枢，下半年超预期宽松的流动性也将不复存在。另外，银行压缩表外信贷等金融机构去杠杆的过程也将对资金面造成压力，加之央行稳中趋紧的货币政策，资金价格波动加大和中枢抬升可能相伴而行。

下半年，预计债券市场仍然面临资金价格上行和经济下行的交织。利率债方面，经济维持弱势对于利率债基本面形成支撑。若资金面偏紧，短期限品种交易机会将明确，但长期品种仍存在不确定性。信用债方面，在从紧货币政策和偏弱的经济周期叠加之下，信用风险或将加速暴露。近期评级机构已经下调了部分产能过剩行业债券和城投类债券的评级，低评级债券调整压力较大，相对而言，高评级债券下半年表现可能更佳。

下半年，资金价格上行和信用风险暴露将使债券市场的估值承压，而经济复苏乏力和企业盈利增长下调使得股市难有系统性机会。本基金将坚持平衡收益与风险的原则，未来半年度将放缓配置节奏，控制组合的久期、杠杆和权益类仓位，适度增加组合流动性，在防御为先的基础上择机把握大类资产机会。本基金将秉承稳健、专业的投资理念，勤勉尽责地为持有人争取最大化的回报。

#### 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对摩根士丹利华鑫强收益债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数

据核对无误。(注：财务会计报告中的“金融工具风险管理”部分未在托管人复核范围内。)

## § 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：摩根士丹利华鑫强收益债券型证券投资基金

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<br>2013 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2012 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>     |            |                                |                                  |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 2,118,588.59                   | 15,544,947.88                    |
| 结算备付金           |            | 1,274,123.94                   | 608,910.87                       |
| 存出保证金           |            | 16,174.60                      | 500,000.00                       |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 184,308,133.69                 | 230,236,248.22                   |
| 其中：股票投资         |            | -                              | -                                |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | 184,308,133.69                 | 230,236,248.22                   |
| 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    | -                              | -                                |
| 应收证券清算款         |            | 2,987,601.53                   | 5,184,763.72                     |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 2,203,485.75                   | 2,915,977.58                     |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | 98,365.59                      | 114,624.05                       |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 193,006,473.69                 | 255,105,472.32                   |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2013 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2012 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债：</b>     |            |                                |                                  |
| 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       |            | 52,899,838.15                  | 86,299,851.50                    |
| 应付证券清算款         |            | 2,240,089.60                   | 301,405.87                       |
| 应付赎回款           |            | 432,845.16                     | 312,590.14                       |
| 应付管理人报酬         |            | 80,417.42                      | 98,336.70                        |
| 应付托管费           |            | 22,976.40                      | 28,096.21                        |
| 应付销售服务费         |            | -                              | -                                |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 2,694.51                       | 573.50                           |
| 应交税费            |            | 1,452,057.04                   | 1,452,057.04                     |

|               |          |                |                |
|---------------|----------|----------------|----------------|
| 应付利息          |          | 31,186.18      | 113,460.81     |
| 应付利润          |          | -              | -              |
| 递延所得税负债       |          | -              | -              |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 74,494.51      | 659,030.78     |
| 负债合计          |          | 57,236,598.97  | 89,265,402.55  |
| <b>所有者权益：</b> |          |                |                |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 115,335,141.78 | 143,897,850.27 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 20,434,732.94  | 21,942,219.50  |
| 所有者权益合计       |          | 135,769,874.72 | 165,840,069.77 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 193,006,473.69 | 255,105,472.32 |

注：报告截止日 2013 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.1772 元，基金份额总额 115,335,141.78 份。

## 6.2 利润表

会计主体：摩根士丹利华鑫强收益债券型证券投资基金

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<br>2013 年 1 月 1 日至<br>2013 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2012 年 1 月 1 日至<br>2012 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>           |            | 5,434,365.49                             | 15,528,635.87                                 |
| 1.利息收入                |            | 3,743,668.72                             | 6,352,609.49                                  |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.11   | 62,145.65                                | 48,144.50                                     |
| 债券利息收入                |            | 3,671,677.96                             | 6,279,191.90                                  |
| 资产支持证券利息收入            |            | -                                        | -                                             |
| 买入返售金融资产收入            |            | 9,845.11                                 | 25,273.09                                     |
| 其他利息收入                |            | -                                        | -                                             |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |            | 5,589,205.73                             | 5,353,868.68                                  |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.12   | -13.72                                   | 59,730.00                                     |
| 基金投资收益                |            | -                                        | -                                             |
| 债券投资收益                | 6.4.7.13   | 5,589,219.45                             | 5,072,367.39                                  |
| 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   | -                                        | 221,771.29                                    |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16   | -3,906,184.78                            | 3,793,618.71                                  |
| 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   | 7,675.82                                 | 28,538.99                                     |
| <b>减：二、费用</b>         |            | 1,983,719.13                             | 2,170,117.72                                  |
| 1. 管理人报酬              | 6.4.10.2.1 | 524,151.03                               | 920,238.49                                    |
| 2. 托管费                | 6.4.10.2.2 | 149,757.37                               | 262,925.23                                    |
| 3. 销售服务费              | 6.4.10.2.3 | -                                        | -                                             |
| 4. 交易费用               | 6.4.7.18   | 5,234.33                                 | 11,906.42                                     |
| 5. 利息支出               |            | 1,212,051.83                             | 874,376.22                                    |

|                     |          |              |               |
|---------------------|----------|--------------|---------------|
| 其中：卖出回购金融资产支出       |          | 1,212,051.83 | 874,376.22    |
| 6. 其他费用             | 6.4.7.19 | 92,524.57    | 100,671.36    |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |          | 3,450,646.36 | 13,358,518.15 |
| 减：所得税费用             |          | -            | -             |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |          | 3,450,646.36 | 13,358,518.15 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：摩根士丹利华鑫强收益债券型证券投资基金

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<br>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）                        | 143,897,850.27                             | 21,942,219.50 | 165,840,069.77 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                          | 3,450,646.36  | 3,450,646.36   |
| 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）      | -28,562,708.49                             | -4,958,132.92 | -33,520,841.41 |
| 其中：1.基金申购款                             | 24,112,545.81                              | 4,381,244.08  | 28,493,789.89  |
| 2.基金赎回款                                | -52,675,254.30                             | -9,339,377.00 | -62,014,631.30 |
| 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）                        | 115,335,141.78                             | 20,434,732.94 | 135,769,874.72 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>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）                        | 333,986,499.59                             | 19,016,356.29 | 353,002,855.88 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本                   | -                                          | 13,358,518.15 | 13,358,518.15  |

|                                        |                 |                |                 |
|----------------------------------------|-----------------|----------------|-----------------|
| 期利润)                                   |                 |                |                 |
| 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)      | -170,135,276.58 | -13,330,921.66 | -183,466,198.24 |
| 其中：1.基金申购款                             | 14,256,744.14   | 1,425,699.65   | 15,682,443.79   |
| 2.基金赎回款                                | -184,392,020.72 | -14,756,621.31 | -199,148,642.03 |
| 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)                        | 163,851,223.01  | 19,043,952.78  | 182,895,175.79  |

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：

|             |             |             |
|-------------|-------------|-------------|
| _____<br>于华 | _____<br>沈良 | _____<br>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

摩根士丹利华鑫强收益债券型证券投资基金(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”)证监基金字许可[2009]1086 号《关于核准摩根士丹利华鑫强收益债券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《摩根士丹利华鑫强收益债券型证券投资基金合同》负责公开募集。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 360,941,027.83 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(2009)第 297 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《摩根士丹利华鑫强收益债券型证券投资基金基金合同》于 2009 年 12 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 361,002,285.55 份基金份额，其中认购资金利息折合 61,257.72 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，基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《摩根士丹利华鑫强收益债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资对象包括国内依法发行上市的债券、股票、权证以及法律、法规或监管机构允许基金投资的其它金融工具。本基金的投资组合范围为：债券等固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 80%；非固定收益类资产（股票、权证等）的比例不超过基金资



产的 20%；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中债综合指数。

#### 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》、《摩根士丹利华鑫强收益债券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<br>2013 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 2,118,588.59           |
| 定期存款           | -                      |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | -                      |
| 其他存款           | -                      |
| 合计：            | 2,118,588.59           |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目     |       | 本期末<br>2013 年 6 月 30 日 |                |               |
|--------|-------|------------------------|----------------|---------------|
|        |       | 成本                     | 公允价值           | 公允价值变动        |
| 股票     |       | -                      | -              | -             |
| 债券     | 交易所市场 | 69,535,694.74          | 66,711,133.69  | -2,824,561.05 |
|        | 银行间市场 | 116,635,330.41         | 117,597,000.00 | 961,669.59    |
|        | 合计    | 186,171,025.15         | 184,308,133.69 | -1,862,891.46 |
| 资产支持证券 |       | -                      | -              | -             |
| 基金     |       | -                      | -              | -             |
| 其他     |       | -                      | -              | -             |
| 合计     |       | 186,171,025.15         | 184,308,133.69 | -1,862,891.46 |

**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**

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

**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<br>2013 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息   | 786.70                 |
| 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  | 573.40                 |
| 应收债券利息     | 2,202,118.35           |
| 应收买入返售证券利息 | -                      |
| 应收申购款利息    | -                      |
| 其他         | 7.30                   |
| 合计         | 2,203,485.75           |

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<br>2013 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 1.22                   |
| 银行间市场应付交易费用 | 2,693.29               |
| 合计          | 2,694.51               |

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2013 年 6 月 30 日 |
|----|------------------------|
|----|------------------------|

|             |           |
|-------------|-----------|
| 应付券商交易单元保证金 | -         |
| 应付赎回费       | 110.75    |
| 预提费用        | 74,383.76 |
| 合计          | 74,494.51 |

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>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          | 143,897,850.27                        | 143,897,850.27 |
| 本期申购          | 24,112,545.81                         | 24,112,545.81  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -52,675,254.30                        | -52,675,254.30 |
| - 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           | 115,335,141.78                        | 115,335,141.78 |

注：申购含红利再投、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           | 16,656,908.95 | 5,285,310.55  | 21,942,219.50 |
| 本期利润           | 7,356,831.14  | -3,906,184.78 | 3,450,646.36  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -4,129,948.83 | -828,184.09   | -4,958,132.92 |
| 其中：基金申购款       | 3,573,241.92  | 808,002.16    | 4,381,244.08  |
| 基金赎回款          | -7,703,190.75 | -1,636,186.25 | -9,339,377.00 |
| 本期已分配利润        | -             | -             | -             |
| 本期末            | 19,883,791.26 | 550,941.68    | 20,434,732.94 |

### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
|           |                                       |
| 活期存款利息收入  | 51,327.98                             |
| 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 | 10,587.45                             |

|    |           |
|----|-----------|
| 其他 | 230.22    |
| 合计 | 62,145.65 |

注：“其他”为结算保证金利息收入和申购款利息收入。

#### 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<br>2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 1,337.70                              |
| 减：卖出股票成本总额 | 1,351.42                              |
| 买卖股票差价收入   | -13.72                                |

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2013年1月1日至2013年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 346,049,371.96             |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 335,058,432.10             |
| 减：应收利息总额               | 5,401,720.41               |
| 债券投资收益                 | 5,589,219.45               |

#### 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

注：本基金本报告期无股利收益。

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 1.交易性金融资产  | -3,906,184.78                         |
| ——股票投资     | -                                     |
| ——债券投资     | -3,906,184.78                         |
| ——资产支持证券投资 | -                                     |
| 2.衍生工具     | -                                     |

|        |               |
|--------|---------------|
| ——权证投资 | -             |
| 3.其他   | -             |
| 合计     | -3,906,184.78 |

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 6,259.37                              |
| 基金转出费收入 | 1,416.45                              |
| 合计      | 7,675.82                              |

**6.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 2,984.33                              |
| 银行间市场交易费用 | 2,250.00                              |
| 合计        | 5,234.33                              |

**6.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日 |
|----------|---------------------------------------|
| 审计费用     | 24,795.19                             |
| 信息披露费    | 49,588.57                             |
| 银行费用     | 8,740.81                              |
| 银行间账户维护费 | 9,000.00                              |
| 其他       | 400.00                                |
| 合计       | 92,524.57                             |

**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 |
| 中国银行股份有限公司（“中国银行”） | 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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

### 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<br>2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月<br>30 日 | 上年度可比期间<br>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  | 524,151.03                               | 920,238.49                                 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 138,290.95                               | 221,433.02                                 |

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 0.7% 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 × 0.7% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>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 | 149,757.37                            | 262,925.23                                 |

注：支付托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.2% 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 × 0.2% / 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：本报告期及上年度可比期间基金管理人均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：本报告期及上年度末除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金份额。

**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<br>2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日 |           | 上年度可比期间<br>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    |
| 中国银行  | 2,118,588.59                          | 51,327.98 | 452,281.14                                 | 33,522.29 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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均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**

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**

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

**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**

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

**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**

截至本报告期末 2013 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回



购证券款余额 27,899,838.15 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

| 债券代码    | 债券名称   | 回购到期日          | 期末估值单价 | 数量（张）   | 期末估值总额        |
|---------|--------|----------------|--------|---------|---------------|
| 0980186 | 09 海航债 | 2013 年 7 月 2 日 | 108.74 | 300,000 | 32,622,000.00 |
| 合计      |        |                |        | 300,000 | 32,622,000.00 |

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2013 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 25,000,000.00 元，于 2013 年 7 月 1 日、2013 年 7 月 4 日、2013 年 7 月 5 日先后到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 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

本基金为债券型证券投资基金。本基金主要投资于债券等固定收益类资产，包括国债、金融债、企业债、公司债、资产支持证券、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、浮动利率债券、债券回购、银行存款、大额存单以及法律法规或监管机构允许基金投资的其它固定收益类金融工具。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在严格控制风险的前提下审慎投资、主动管理，寻求最大化的总回报，包括当期收益和资本增值。

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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。于 2013 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 128.43%(2012 年 12 月 31 日：132.80%)。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2013 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2012 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | 69,593,000.00          | -                        |
| A-1 以下 | -                      | -                        |
| 未评级    | 9,945,000.00           | 10,003,000.00            |
| 合计     | 79,538,000.00          | 10,003,000.00            |

注：未评级债券为政策性金融债。

##### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2013 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2012 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA    | 37,348,987.60          | 51,952,983.00            |
| AAA 以下 | 67,421,146.09          | 168,280,265.22           |
| 未评级    | -                      | -                        |

|    |                |                |
|----|----------------|----------------|
| 合计 | 104,770,133.69 | 220,233,248.22 |
|----|----------------|----------------|

### 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。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在银行间同业市场交易，其余亦可在证券交易所上市交易，因此均能以合理价格适时变现。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，除卖出回购金融资产按余额计息外，本基金所持有的其他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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>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                     | 2,118,588.59   | -              | -             | -            | 2,118,588.59   |
| 结算备付金                    | 1,274,123.94   | -              | -             | -            | 1,274,123.94   |
| 存出保证金                    | 16,174.60      | -              | -             | -            | 16,174.60      |
| 交易性金融资产                  | 136,217,633.69 | 10,031,500.00  | 38,059,000.00 | -            | 184,308,133.69 |
| 应收证券清算款                  | -              | -              | -             | 2,987,601.53 | 2,987,601.53   |
| 应收利息                     | -              | -              | -             | 2,203,485.75 | 2,203,485.75   |
| 应收申购款                    | -              | -              | -             | 98,365.59    | 98,365.59      |
| 资产总计                     | 139,626,520.82 | 10,031,500.00  | 38,059,000.00 | 5,289,452.87 | 193,006,473.69 |
| 负债                       |                |                |               |              |                |
| 卖出回购金融资产款                | 52,899,838.15  | -              | -             | -            | 52,899,838.15  |
| 应付证券清算款                  | -              | -              | -             | 2,240,089.60 | 2,240,089.60   |
| 应付赎回款                    | -              | -              | -             | 432,845.16   | 432,845.16     |
| 应付管理人报酬                  | -              | -              | -             | 80,417.42    | 80,417.42      |
| 应付托管费                    | -              | -              | -             | 22,976.40    | 22,976.40      |
| 应付交易费用                   | -              | -              | -             | 2,694.51     | 2,694.51       |
| 应付利息                     | -              | -              | -             | 31,186.18    | 31,186.18      |
| 应交税费                     | -              | -              | -             | 1,452,057.04 | 1,452,057.04   |
| 其他负债                     | -              | -              | -             | 74,494.51    | 74,494.51      |
| 负债总计                     | 52,899,838.15  | -              | -             | 4,336,760.82 | 57,236,598.97  |
| 利率敏感度缺口                  | 86,726,682.67  | 10,031,500.00  | 38,059,000.00 | 952,692.05   | 135,769,874.72 |
| 上年度末<br>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                     | 15,544,947.88  | -              | -             | -            | 15,544,947.88  |
| 结算备付金                    | 608,910.87     | -              | -             | -            | 608,910.87     |
| 存出保证金                    | -              | -              | -             | 500,000.00   | 500,000.00     |
| 交易性金融资产                  | 10,003,000.00  | 200,105,248.22 | 20,128,000.00 | -            | 230,236,248.22 |
| 应收证券清算款                  | -              | -              | -             | 5,184,763.72 | 5,184,763.72   |

|           |                |                |               |              |                |
|-----------|----------------|----------------|---------------|--------------|----------------|
| 应收利息      | -              | -              | -             | 2,915,977.58 | 2,915,977.58   |
| 应收申购款     | -              | -              | -             | 114,624.05   | 114,624.05     |
| 其他资产      | -              | -              | -             | -            | -              |
| 资产总计      | 26,156,858.75  | 200,105,248.22 | 20,128,000.00 | 8,715,365.35 | 255,105,472.32 |
| 负债        |                |                |               |              |                |
| 卖出回购金融资产款 | 86,299,851.50  | -              | -             | -            | 86,299,851.50  |
| 应付证券清算款   | -              | -              | -             | 301,405.87   | 301,405.87     |
| 应付赎回款     | -              | -              | -             | 312,590.14   | 312,590.14     |
| 应付管理人报酬   | -              | -              | -             | 98,336.70    | 98,336.70      |
| 应付托管费     | -              | -              | -             | 28,096.21    | 28,096.21      |
| 应付交易费用    | -              | -              | -             | 573.50       | 573.50         |
| 应交税费      | -              | -              | -             | 1,452,057.04 | 1,452,057.04   |
| 应付利息      | -              | -              | -             | 113,460.81   | 113,460.81     |
| 其他负债      | -              | -              | -             | 659,030.78   | 659,030.78     |
| 负债总计      | 86,299,851.50  | -              | -             | 2,965,551.05 | 89,265,402.55  |
| 利率敏感度缺口   | -60,142,992.75 | 200,105,248.22 | 20,128,000.00 | 5,749,814.30 | 165,840,069.77 |

注：表中所示为本基金资产及负债的帐面价值，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

|    |                    |                             |                        |
|----|--------------------|-----------------------------|------------------------|
| 假设 | 除市场利率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） |
|    | 市场利率上升 25 个基点      | -1,734,737.22               | -3,150,000.00          |
|    | 市场利率下降 25 个基点      | 1,758,766.15                | 3,200,000.00           |

#### 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，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，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。本基金是债券型基金，投资于固定收益类资产占基金资产比例不低于 80%，非固定收益类资产的比例不超过基金资产的 20%，且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%。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，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

注：于 2013 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性权益类投资。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2013 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性权益类投资(2012 年 12 月 31 日：同)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响(2012 年 12 月 31 日：同)。

-

## § 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<br>(%) |
|----|---------|----------------|------------------|
| 1  | 权益投资    | -              | -                |
|    | 其中：股票   | -              | -                |
| 2  | 固定收益投资  | 184,308,133.69 | 95.49            |
|    | 其中：债券   | 184,308,133.69 | 95.49            |
|    | 资产支持证券  | -              | -                |
| 3  | 金融衍生品投资 | -              | -                |

|   |                   |                |        |
|---|-------------------|----------------|--------|
| 4 | 买入返售金融资产          | -              | -      |
|   | 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      | 3,392,712.53   | 1.76   |
| 6 | 其他各项资产            | 5,305,627.47   | 2.75   |
| 7 | 合计                | 193,006,473.69 | 100.00 |

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末无股票投资。

## 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

注：本基金本报告期末无股票投资。

## 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  | 600886 | 国投电力 | 1,351.42 | 0.00           |

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  | 600886 | 国投电力 | 1,337.70 | 0.00           |

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 | 1,351.42 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,337.70 |

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      | 9,945,000.00   | 7.32   |
|   | 其中：政策性金融债 | 9,945,000.00   | 7.32   |
| 4 | 企业债券      | 48,090,500.00  | 35.42  |
| 5 | 企业短期融资券   | 69,593,000.00  | 51.26  |
| 6 | 中期票据      | -              | -      |
| 7 | 可转债       | 56,679,633.69  | 41.75  |
| 8 | 其他        | -              | -      |
| 9 | 合计        | 184,308,133.69 | 135.75 |

## 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  | 011319003 | 13 国电 SCP003 | 500,000 | 49,760,000.00 | 36.65        |
| 2  | 0980186   | 09 海航债       | 350,000 | 38,059,000.00 | 28.03        |
| 3  | 113003    | 重工转债         | 221,930 | 24,261,387.60 | 17.87        |
| 4  | 128001    | 泰尔转债         | 151,059 | 15,887,026.09 | 11.70        |
| 5  | 113002    | 工行转债         | 100,000 | 10,938,000.00 | 8.06         |

## 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 投资组合报告附注

### 7.9.1 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   | 16,174.60    |
| 2  | 应收证券清算款 | 2,987,601.53 |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 2,203,485.75 |



|   |       |              |
|---|-------|--------------|
| 5 | 应收申购款 | 98,365.59    |
| 6 | 其他应收款 | -            |
| 7 | 待摊费用  | -            |
| 8 | 其他    | -            |
| 9 | 合计    | 5,305,627.47 |

### 7.9.2 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  | 113003 | 重工转债 | 24,261,387.60 | 17.87        |
| 2  | 113002 | 工行转债 | 10,938,000.00 | 8.06         |
| 3  | 127001 | 海直转债 | 2,235,620.00  | 1.65         |
| 4  | 110018 | 国电转债 | 2,149,600.00  | 1.58         |
| 5  | 110016 | 川投转债 | 1,208,000.00  | 0.89         |

### 7.9.3 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额          | 占总份<br>额比例 |
| 4,791        | 24,073.29     | 28,353,281.76 | 24.58%     | 86,981,860.02 | 75.42%     |

### 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 | 8,150.76  | 0.0071%  |

注：1. 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。

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（ 2009 年 12 月 29 日 ）基金份额总额 | 361,002,285.55 |
| 本报告期期初基金份额总额                      | 143,897,850.27 |
| 本报告期基金总申购份额                       | 24,112,545.81  |
| 减:本报告期基金总赎回份额                     | 52,675,254.30  |
| 本报告期基金拆分变动份额                      | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                      | 115,335,141.78 |

## § 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，基金托管人重大人事变动如下：。

2013 年 3 月 17 日，根据国家金融工作需要，肖钢先生辞去中国银行股份有限公司董事长职务。中国银行股份有限公司已于 2013 年 3 月 17 日公告上述事项。

2013 年 6 月 1 日，中国银行股份有限公司发布公告，自 2013 年 5 月 31 日起，田国立先生就任本行董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员。

### 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 |    |
| 华泰证券 | 1      | 1,337.70 | 100.00%      | 1.22      | 100.00%    | -  |
| 中信证券 | 1      | -        | -            | -         | -          | -  |
| 国信证券 | 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。

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.本报告期内，本基金租用证券公司交易单元情况未发生变化。

**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 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |

|      |                |        |                | 的比例    |   |   |
|------|----------------|--------|----------------|--------|---|---|
| 华泰证券 | 360,290,680.16 | 81.60% | 924,000,000.00 | 98.68% | - | - |
| 中信证券 | 81,234,802.41  | 18.40% | 12,330,000.00  | 1.32%  | - | - |
| 国信证券 | -              | -      | -              | -      | - | - |

## 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          | 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 | 证券时报   | 2013 年 1 月 11 日 |
| 3  | 本基金 2012 年 4 季度报告                  | 证券时报   | 2013 年 1 月 21 日 |
| 4  | 本公司关于对旗下部分基金持有的 09 广汇债进行估值调整的公告    | 证券时报   | 2013 年 2 月 7 日  |
| 5  | 本基金招募说明书（更新）（2012 年第 2 号）          | 证券时报   | 2013 年 2 月 8 日  |
| 6  | 本公司关于高级管理人员变更公告                    | 证券时报   | 2013 年 3 月 2 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   | 证券时报   | 2013 年 3 月 29 日 |
| 8  | 本基金 2012 年年度报告                     | 证券时报   | 2013 年 3 月 29 日 |
| 9  | 本基金 2013 年第 1 季度报告                 | 证券时报   | 2013 年 4 月 19 日 |
| 10 | 本公司关于调整旗下基金对账单服务形式的公告              | 证券时报   | 2013 年 4 月 25 日 |
| 11 | 本公司关于调整旗下基金对账单服务形式的提示性公告           | 证券时报   | 2013 年 6 月 7 日  |
| 12 | 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      | 证券时报   | 2013 年 6 月 14 日 |
| 13 | 本公司关于旗下基金增加和讯信息科                   | 证券时报   | 2013 年 6 月 14 日 |

|    |                                     |      |                 |
|----|-------------------------------------|------|-----------------|
|    | 技有限公司为销售机构并参与申购费率优惠活动的公告            |      |                 |
| 14 | 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   | 证券时报 | 2013 年 6 月 26 日 |
| 15 | 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         | 证券时报 | 2013 年 6 月 28 日 |
| 16 | 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  | 证券时报 | 2013 年 6 月 28 日 |
| 17 | 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 | 证券时报 | 2013 年 6 月 29 日 |

注：上述公告同时在公司网站 [www.msfnunds.com.cn](http://www.msfnunds.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