

# 摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金

## 2013 年年度报告摘要

2013 年 12 月 31 日

基金管理人：摩根士丹利华鑫基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2014 年 3 月 27 日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 3 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

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

本报告期自 2013 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                  |
|------------|------------------|
| 基金简称       | 大摩基础行业混合         |
| 基金主代码      | 233001           |
| 交易代码       | 233001           |
| 基金运作方式     | 契约型开放式           |
| 基金合同生效日    | 2004 年 3 月 26 日  |
| 基金管理人      | 摩根士丹利华鑫基金管理有限公司  |
| 基金托管人      | 中国光大银行股份有限公司     |
| 报告期末基金份额总额 | 145,167,895.17 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期              |

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

|    |       |       |
|----|-------|-------|
| 项目 | 基金管理人 | 基金托管人 |
|----|-------|-------|

|             |                 |                     |                           |
|-------------|-----------------|---------------------|---------------------------|
| 名称          | 摩根士丹利华鑫基金管理有限公司 |                     | 中国光大银行股份有限公司              |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名              | 李锦                  | 张建春                       |
|             | 联系电话            | (0755) 88318883     | (010) 63639180            |
|             | 电子邮箱            | xxpl@msfunds.com.cn | zhangjianchun@cebbank.com |
| 客户服务电话      |                 | 400-8888-668        | 95595                     |
| 传真          |                 | (0755) 82990384     | (010) 63639132            |

## 2.4 信息披露方式

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

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2013 年        | 2012 年        | 2011 年         |
|---------------|---------------|---------------|----------------|
| 本期已实现收益       | 8,919,140.70  | -6,384,535.92 | -25,342,948.04 |
| 本期利润          | 6,919,907.07  | -1,121,411.72 | -29,257,364.13 |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0447        | -0.0067       | -0.1726        |
| 本期基金份额净值增长率   | 11.02%        | -2.50%        | -30.03%        |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2013 年末       | 2012 年末       | 2011 年末        |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.5618       | -0.6053       | -0.5952        |
| 期末基金资产净值      | 63,613,472.68 | 64,168,052.24 | 67,592,195.46  |
| 期末基金份额净值      | 0.4382        | 0.3947        | 0.4048         |

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。

4. 自基金合同生效以来至 2012 年 3 月 4 日本基金份额净值增长率为 13.08%，2012 年 1 月 1 日至 2012 年 3 月 4 日本基金份额净值增长率为 5.71%，2012 年 3 月 5 日至 2012 年 12 月 31 日本基金份额净值增长率为-7.76%，2012 年 3 月 5 日至 2013 年 12 月 31 日本基金份额净值增长率为 2.41%。

## 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 | 份额净值增<br>长率标准差<br>② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①—③     | ②—④    |
|-------------------------------------|--------------|---------------------|----------------|---------------------------|---------|--------|
| 过去三个月                               | -3.76%       | 1.09%               | -1.25%         | 0.62%                     | -2.51%  | 0.47%  |
| 过去六个月                               | 7.11%        | 1.13%               | 4.44%          | 0.71%                     | 2.67%   | 0.42%  |
| 过去一年                                | 11.02%       | 1.11%               | -1.91%         | 0.77%                     | 12.93%  | 0.34%  |
| 2011 年 1 月 1 日至<br>2012 年 3 月 4 日   | -26.03%      | 0.94%               | -10.75%        | 9.40%                     | -15.28% | -8.46% |
| 2009 年 1 月 1 日至<br>2012 年 3 月 4 日   | 1.93%        | 1.29%               | 36.31%         | 1.17%                     | -34.38% | 0.12%  |
| 自基金合同生效日<br>起至 2012 年 3 月 4<br>日    | 13.08%       | 1.52%               | 59.27%         | 1.36%                     | -46.19% | 0.16%  |
| 2012 年 3 月 5 日至<br>2013 年 12 月 31 日 | 2.41%        | 1.01%               | -3.39%         | 0.72%                     | 5.80%   | 0.29%  |

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

沪深 300 指数×55% + 中证综合债券指数×45%

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

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

2.基金合同修改前本基金的业绩比较基准计算公式为：

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

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

基准指数的构建考虑了三个原则：

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

合理的业绩比较基准。

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

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

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

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

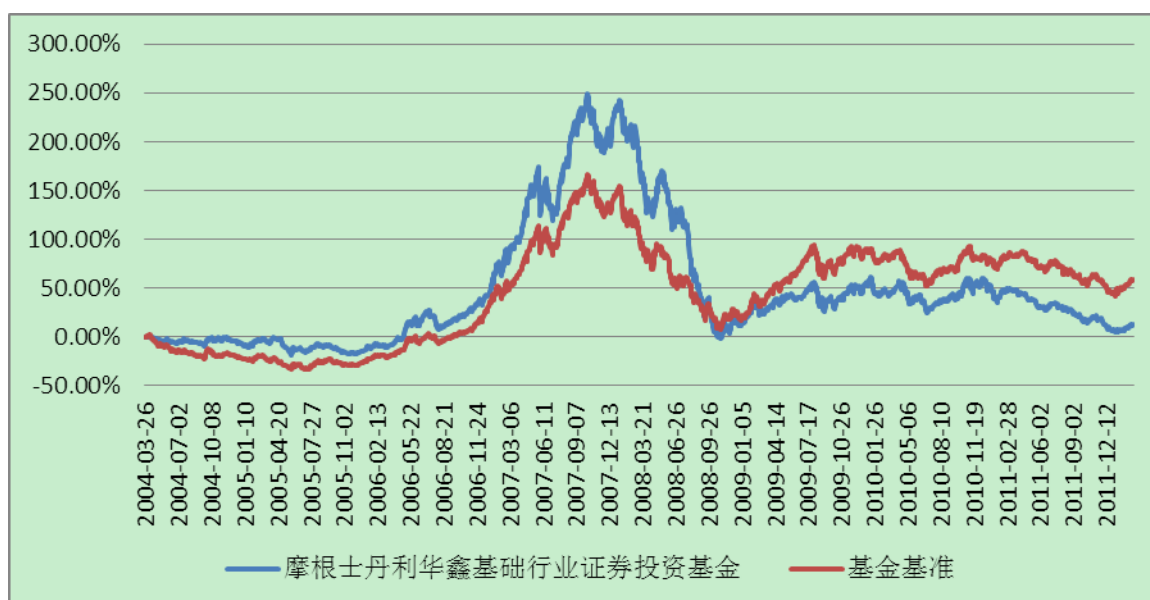
自基金合同生效以来至基金合同修改前基金份额累计净值增长率变动

及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2004 年 3 月 26 日至 2012 年 3 月 4 日)



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

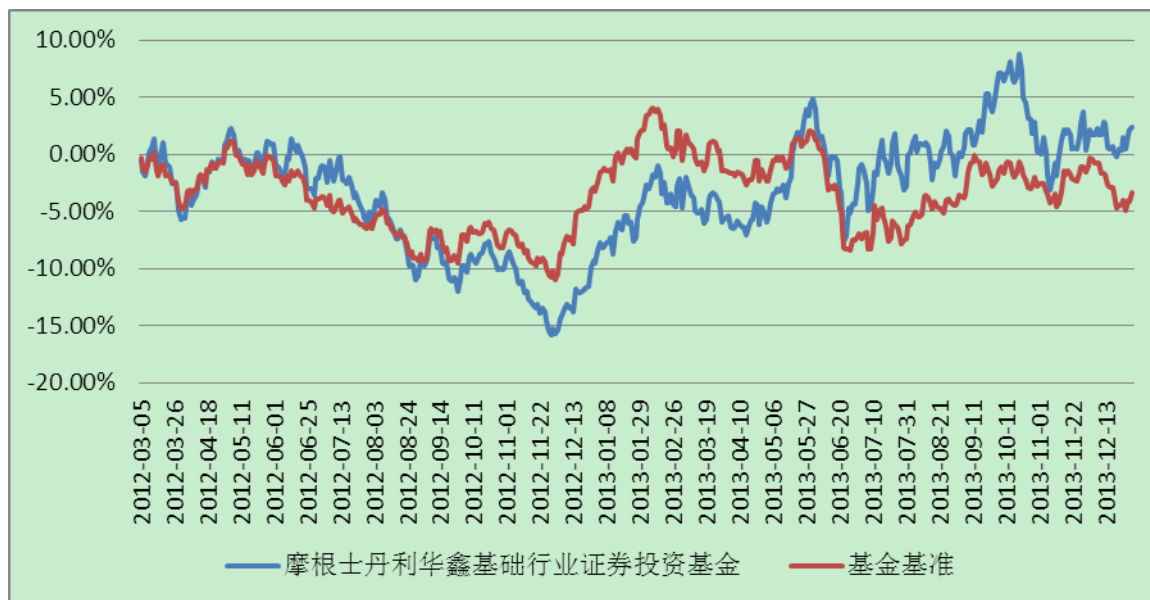
自基金合同修改以来基金份额累计净值增长率变动及其与

### 同期业绩比较基准收益率变动的比较

摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

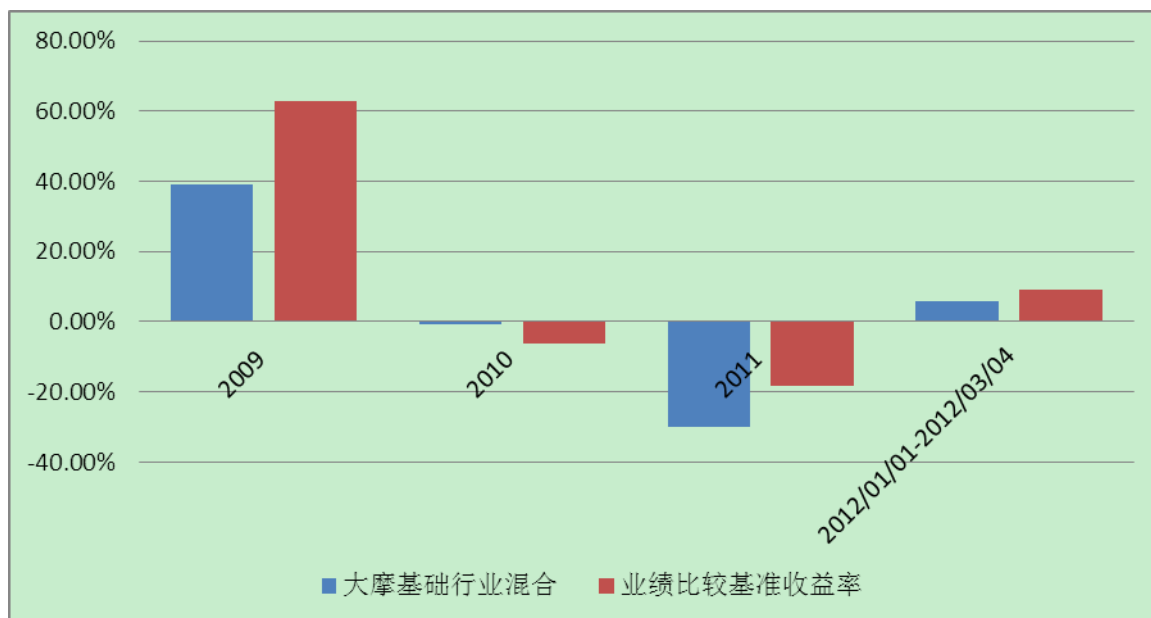
(2012 年 3 月 5 日至 2013 年 12 月 31 日)

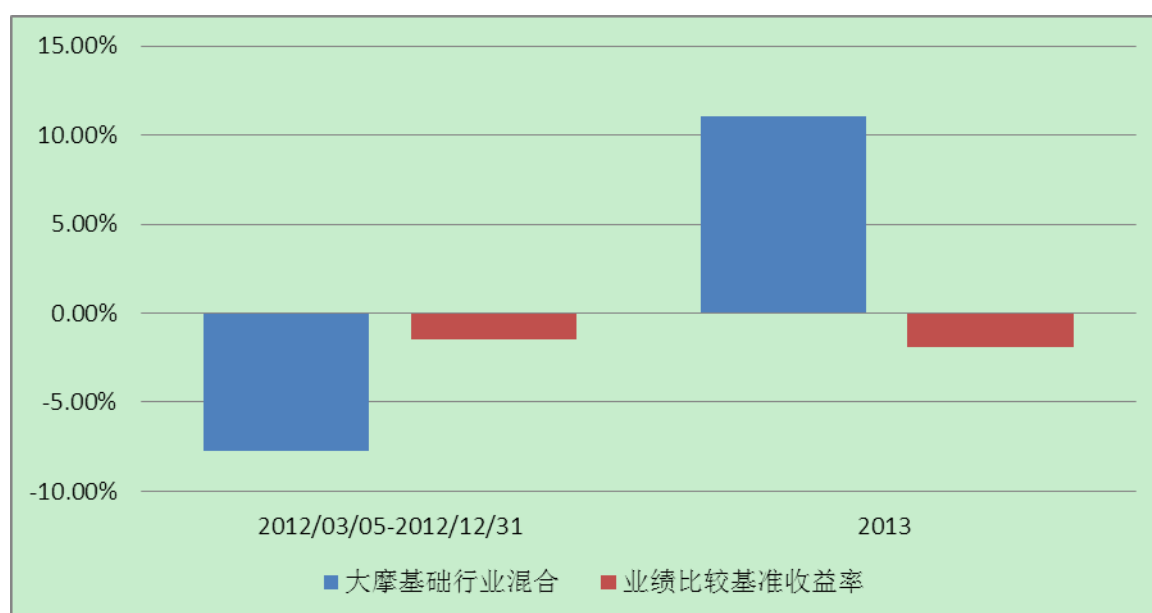


### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金

过去五年基金每年净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图





### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金本报告期过去三年无利润分配的情况。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

摩根士丹利华鑫基金管理有限公司（以下简称“公司”）是一家中外合资基金管理公司，前身为经中国证监会证监基金字[2003]33 号文批准设立并于 2003 年 3 月 14 日成立的巨田基金管理有限公司。公司的主要股东包括华鑫证券有限责任公司、摩根士丹利国际控股公司、深圳市招融投资控股有限公司等国内外机构。

截止 2013 年 12 月 31 日，公司旗下共管理十五只开放式基金，包括摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金、摩根士丹利华鑫资源优选混合型证券投资基金（LOF）、摩根士丹利华鑫货币市场基金、摩根士丹利华鑫领先优势股票型证券投资基金、摩根士丹利华鑫强收益债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫卓越成长股票型证券投资基金、摩根士丹利华鑫消费领航混合型证券投资基金、摩根士丹利华鑫多因子精选策略股票型证券投资基金、摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金、摩根士丹利华鑫主题优选股票型证券投资基金，摩根士丹利华鑫多元收益债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫量化配置股票型证券投资基金、摩根士丹利华鑫双利增强债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫纯债稳定增利 18 个月定期开放债券型证券投资基金、摩根士丹利

华鑫品质生活精选股票型证券投资基金。同时，公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名  | 职务     | 任本基金的基金经理（助理）期限  |                  | 证券从业年限 | 说明                                                                                                                                                                                |
|-----|--------|------------------|------------------|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |        | 任职日期             | 离任日期             |        |                                                                                                                                                                                   |
| 盛军锋 | 基金经理   | 2012 年 1 月 6 日   | 2013 年 10 月 23 日 | 7      | 暨南大学产业经济学博士。曾任中国人民银行深圳中心支行货币信贷管理科科员，宝盈基金管理有限公司研究员、基金经理。2011 年 4 月加入本公司，2012 年 1 月至 2013 年 10 月任本基金基金经理，2012 年 3 月起任摩根士丹利华鑫主题优选股票型证券投资基金基金经理，2012 年 9 月起任摩根士丹利华鑫卓越成长股票型证券投资基金基金经理。 |
| 王增财 | 基金经理   | 2013 年 10 月 23 日 | -                | 6      | 西南财经大学经济学硕士。曾任职于平安证券有限责任公司资产管理事业部投资部，历任研究员、投资经理助理、投资经理。2013 年 9 月加入本公司，2013 年 10 月起任本基金基金经理。                                                                                      |
| 周志超 | 基金经理助理 | 2012 年 2 月 2 日   | 2013 年 11 月 22 日 | 7      | 南开大学经济学硕士。曾任诺安基金管理公司行业分析师，信达澳银基金管理公司高级分析师，广发基金管理公司行业分析师。2011 年 5 月加入本公司。                                                                                                          |

注：1、基金经理、基金经理助理的任职日期、离任日期均为根据本公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、基金经理任职和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变更；

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 公平交易制度和控制方法

基金管理人遵照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规的要求，制订了《摩根士丹利华鑫基金管理有限公司公平交易管理办法》、《摩根士丹利华鑫基金管理有限

公司异常交易报告管理办法》、《摩根士丹利华鑫基金管理有限公司公平交易分析报告实施细则》等内部制度，形成较为完备的公平交易制度及异常交易分析体系。

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

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及内部相关制度和流程，通过流程和系统控制保证有效实现公平交易管理要求，并通过对投资交易行为的监控和分析，确保基金管理人旗下各投资组合在研究、决策、交易执行等各方面均得到公平对待。本报告期，基金管理人严格执行各项公平交易制度及流程。

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013 年，宏观经济总体表现偏弱，经济体仍处于结构性调整周期中，传统中上游行业继续去产能、去杠杆，景气度低。符合经济转型方向的新兴行业在政策和市场需求推动下景气向上。在股票市场上，结构性行情演绎的淋漓尽致，市值占比较大的传统中上游行业表现低迷，而文化传媒、TMT、环保、医药等行业表现突出。

报告期，本基金上半年开始逐步降低了金融、地产等传统行业的投资比重，开始增加成长类公司的配置。债券投资四季度前以企业债为主，四季度重点增持了到期收益率较高且转股溢价率较低的可转债。全年来看，本基金资产配置相对均衡，净值表现好于沪深 300 指数，但与创业板

指数差距较大。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期截至 2013 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.4382 元，累计份额净值为 1.9832 元，报告期内基金份额净值增长率为 11.02%，同期业绩比较基准收益率为-1.91%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2014 年，预计政府将继续推进经济结构调整并推动社会和经济的各项改革。传统行业去产能和去杠杆仍将继续，这种调整的影响是短空长多，短期带来经济冲击进而压制相应股票的估值，长期则为经济创造更为合理的增长环境和结构。

2014 年股票投资将要面临估值水平严重分化的局面。传统周期股股价处于低位，部分股票的估值水平也打破了以往的体系下限，其股价对悲观预期反映较为充分，但由于基本面处于被压制情形，估值修复时间点较难把握。而受益转型的成长股，由于 2013 年行情高企，多数已到达估值体系上限，其股价对于基本面存在透支，未来可能面临预期不达标或者需要时间来消化估值的情形。因此，如何在分化的市场中寻找投资机遇是 2014 年的重大挑战。

本基金 2014 年股票投资将在防范高估值风险基础上寻求投资机会。在投资标的选择上，重点在以下两类优势企业中寻找投资机会：（1）企业产品面临巨大市场空间，需求稳定增长，所处行业经过充分竞争，格局越来越有利于优势龙头企业的发展。这类企业属于长期优势型企业，具有强大的品牌优势和定价能力，良好的现金流，经营不依赖于高杠杆，净资产收益率较高且稳固，例如消费品、医药、农业、保健品行业的龙头企业。（2）企业产品或服务符合经济转型方向，市场潜力广阔，需求高速启动，所处行业处于发展初期，部分具有差异化经营策略的企业有望成为未来优势型企业。例如平台商、广告营销、软件、高端装备、环保、新材料等企业。在债券投资上，本基金将重点投资到期收益率高且转股溢价率相对较低的可转债。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

本报告期，基金管理人完成的主要监察稽核工作如下：

（1）完成专项检查工作。检查范围覆盖投资交易、基金销售、客户服务、专户业务、主要应用系统管理、IT 合规检查、系统开发、自有资金投资及风险准备金、反洗钱业务等方面。（2）做好日常监控工作。严格规范基金投资、销售以及运营等各项业务管理，通过监控基金投资运作、

优化关键业务流程、审核宣传推介材料、监督后台运营业务等工作，加强日常风险监控，确保公司和基金运作合法合规。（3）持续完善公司内控制度体系。对业务制度和流程进行合规审核，同时，适时以“合规指引”方式及时清晰地解读监管政策与要求，加强各项业务流程控制。公司已建立起覆盖公司业务各个方面，更为全面、完善的内控制度体系，保障公司合规、安全、高效运营。

（4）加强员工合规行为管理。根据法律法规和业务环境的变化不断修订并充实培训材料，并制作学习手册，改进合规培训形式，进一步提升员工风控意识及合规意识。（5）有效地推进投资风险管理系统等合规监控系统的建设，加强风险管理手段，提高工作实效。（6）积极深入参与新产品设计、新业务拓展工作，就相关的合规及风控问题提供意见和建议。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

基金管理人旗下基金持有的资产按规定以公允价值进行估值。对于相关品种，特别是长期停牌股票等没有市价的投资品种，基金管理人根据中国证监会发布的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的要求进行估值，具体采用的估值政策和程序说明如下：

基金管理人成立基金估值委员会，委员会由主任委员（分管基金运营部的副总经理）以及相关成员（包括基金运营部负责人、基金会计、风险管理部及监察稽核部相关业务人员）构成。估值委员会的相关人员均具有一定年限的专业从业经验，具有良好的专业能力，并能在相关工作中保持独立性。其中基金运营部负责具体执行公允价值估值、提供估值建议、跟踪长期停牌股票对资产净值的影响并就调整估值方法与托管行、会计师事务所进行沟通；风险管理部负责评估公允价值估值数据模型，计算并向基金运营部提供使用数据模型估值的证券价格；监察稽核部负责与监管机构的沟通、协调以及检查公允价值估值业务的合法、合规性。

由于基金经理及相关投资研究人员对特定投资品种的估值有深入的理解，经估值委员会主任委员同意，在需要时可以参加估值委员会议并提出估值的建议。估值委员会对特定品种估值方法需经委员充分讨论后确定。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，估值过程中基金经理并未参与。报告期内，本基金管理人未与任何第三方签订与估值相关的任何定价服务。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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，本基金本报告期末未实施利润分配。

## § 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

2013 年度，中国光大银行在摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定，依法安全托管了基金的全部资产，对摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2013 年度，中国光大银行依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人——摩根士丹利华鑫基金管理有限公司的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规的要求。该基金在运作中遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规的要求；各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行依法对基金管理人——摩根士丹利华鑫基金管理有限公司编制的“摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金 2013 年年度报告”进行了复核，报告中相关财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容是真实、准确的。

## § 6 审计报告

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

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金

报告截止日：2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产             | 附注号        | 本期末<br>2013 年 12 月 31 日         | 上年度末<br>2012 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>     |            |                                 |                                  |
| 银行存款            | 7.4.7.1    | 4,116,232.52                    | 8,943,288.92                     |
| 结算备付金           |            | 208,682.27                      | 582,477.67                       |
| 存出保证金           |            | 63,138.47                       | 500,000.00                       |
| 交易性金融资产         | 7.4.7.2    | 57,514,472.00                   | 54,893,193.75                    |
| 其中：股票投资         |            | 48,200,872.73                   | 43,912,503.25                    |
| 基金投资            |            | -                               | -                                |
| 债券投资            |            | 9,313,599.27                    | 10,980,690.50                    |
| 资产支持证券投资        |            | -                               | -                                |
| 衍生金融资产          | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 买入返售金融资产        | 7.4.7.4    | 1,200,000.00                    | -                                |
| 应收证券清算款         |            | 1,282,855.17                    | 345,676.00                       |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 56,087.10                       | 89,848.18                        |
| 应收股利            |            | -                               | -                                |
| 应收申购款           |            | 14,827.48                       | 57,093.87                        |
| 递延所得税资产         |            | -                               | -                                |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                               | -                                |
| 资产总计            |            | 64,456,295.01                   | 65,411,578.39                    |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2013 年 12 月 31 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          | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                               | -                                |
| 应付证券清算款         |            | -                               | -                                |
| 应付赎回款           |            | 20,683.41                       | 23,012.62                        |
| 应付管理人报酬         |            | 80,702.07                       | 77,353.48                        |
| 应付托管费           |            | 13,450.35                       | 12,892.23                        |
| 应付销售服务费         |            | -                               | -                                |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 193,290.77                      | 126,304.10                       |
| 应交税费            |            | 358,034.67                      | 337,208.07                       |
| 应付利息            |            | -                               | -                                |
| 应付利润            |            | -                               | -                                |

|               |          |                |                |
|---------------|----------|----------------|----------------|
| 递延所得税负债       |          | -              | -              |
| 其他负债          | 7.4.7.8  | 176,661.06     | 666,755.65     |
| 负债合计          |          | 842,822.33     | 1,243,526.15   |
| <b>所有者权益：</b> |          |                |                |
| 实收基金          | 7.4.7.9  | 145,167,895.17 | 162,588,179.82 |
| 未分配利润         | 7.4.7.10 | -81,554,422.49 | -98,420,127.58 |
| 所有者权益合计       |          | 63,613,472.68  | 64,168,052.24  |
| 负债和所有者权益总计    |          | 64,456,295.01  | 65,411,578.39  |

注：报告截止日 2013 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.4382 元，基金份额总额 145,167,895.17 份。

## 7.2 利润表

会计主体：摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目                   | 附注号      | 本期<br>2013 年 1 月 1 日至<br>2013 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2012 年 1 月 1 日至<br>2012 年 12 月 31 日 |
|-----------------------|----------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>           |          | 9,182,703.30                              | 1,665,117.32                                   |
| 1.利息收入                |          | 580,551.41                                | 791,804.30                                     |
| 其中：存款利息收入             | 7.4.7.11 | 57,292.90                                 | 70,477.74                                      |
| 债券利息收入                |          | 486,651.25                                | 655,707.65                                     |
| 资产支持证券利息收入            |          | -                                         | -                                              |
| 买入返售金融资产收入            |          | 36,607.26                                 | 65,618.91                                      |
| 其他利息收入                |          | -                                         | -                                              |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |          | 10,589,307.61                             | -4,545,800.39                                  |
| 其中：股票投资收益             | 7.4.7.12 | 10,506,548.19                             | -5,155,016.66                                  |
| 基金投资收益                |          | -                                         | -                                              |
| 债券投资收益                | 7.4.7.13 | -391,619.75                               | 161,520.86                                     |
| 资产支持证券投资收益            |          | -                                         | -                                              |
| 衍生工具收益                | 7.4.7.14 | -                                         | -                                              |
| 股利收益                  | 7.4.7.15 | 474,379.17                                | 447,695.41                                     |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.16 | -1,999,233.63                             | 5,263,124.20                                   |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |          | -                                         | -                                              |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.17 | 12,077.91                                 | 155,989.21                                     |
| <b>减：二、费用</b>         |          | 2,262,796.23                              | 2,786,529.04                                   |
| 1. 管理人报酬              |          | 983,644.07                                | 1,013,683.53                                   |
| 2. 托管费                |          | 163,940.64                                | 168,947.21                                     |
| 3. 销售服务费              |          | -                                         | -                                              |
| 4. 交易费用               | 7.4.7.18 | 948,176.70                                | 1,372,609.94                                   |
| 5. 利息支出               |          | -                                         | 2,331.18                                       |

|                     |          |              |               |
|---------------------|----------|--------------|---------------|
| 其中：卖出回购金融资产支出       |          | -            | 2,331.18      |
| 6. 其他费用             | 7.4.7.19 | 167,034.82   | 228,957.18    |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |          | 6,919,907.07 | -1,121,411.72 |
| 减：所得税费用             |          | -            | -             |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |          | 6,919,907.07 | -1,121,411.72 |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日      |                 |                |
|----------------------------------------|---------------------------------------------|-----------------|----------------|
|                                        | 实收基金                                        | 未分配利润           | 所有者权益合计        |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 162,588,179.82                              | -98,420,127.58  | 64,168,052.24  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                           | 6,919,907.07    | 6,919,907.07   |
| 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）      | -17,420,284.65                              | 9,945,798.02    | -7,474,486.63  |
| 其中：1.基金申购款                             | 15,472,752.58                               | -8,923,940.83   | 6,548,811.75   |
| 2.基金赎回款                                | -32,893,037.23                              | 18,869,738.85   | -14,023,298.38 |
| 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）                        | 145,167,895.17                              | -81,554,422.49  | 63,613,472.68  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日 |                 |                |
|                                        | 实收基金                                        | 未分配利润           | 所有者权益合计        |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 166,962,872.76                              | -99,370,677.30  | 67,592,195.46  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                           | -1,121,411.72   | -1,121,411.72  |
| 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）      | -4,374,692.94                               | 2,071,961.44    | -2,302,731.50  |
| 其中：1.基金申购款                             | 196,028,616.98                              | -116,895,647.22 | 79,132,969.76  |
| 2.基金赎回款                                | -200,403,309.92                             | 118,967,608.66  | -81,435,701.26 |
| 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）                        | 162,588,179.82                              | -98,420,127.58  | 64,168,052.24  |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

|             |             |              |
|-------------|-------------|--------------|
| _____<br>于华 | _____<br>张力 | _____<br>谢先斌 |
| 基金管理人负责人    | 主管会计工作负责人   | 会计机构负责人      |

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

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

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

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

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

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

准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2013 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2013 年 12 月 31 日的财务状况以及 2013 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 7.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

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

(3)对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。对

基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### 7.4.7 关联方关系

| 关联方名称                  | 与本基金的关系             |
|------------------------|---------------------|
| 摩根士丹利华鑫基金管理有限公司        | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国光大银行股份有限公司（“中国光大银行”） | 基金托管人、基金代销机构        |
| 华鑫证券有限责任公司（“华鑫证券”）     | 基金管理人的股东、基金代销机构     |
| 摩根士丹利国际控股公司            | 基金管理人的股东            |
| 深圳市中技实业（集团）有限公司        | 基金管理人的股东            |
| 汉唐证券有限责任公司             | 基金管理人的股东            |
| 深圳市招融投资控股有限公司          | 基金管理人的股东            |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

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交易。

##### 7.4.8.2 关联方报酬

##### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2013 年 1 月 1 日至<br>2013 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2012 年 1 月 1 日至<br>2012 年 12 月 31 日 |
|-----------------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 983,644.07                                | 1,013,683.53                                   |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 115,281.78                                | 118,490.57                                     |

注：支付基金管理人摩根士丹利华鑫基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

##### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2013 年 1 月 1 日至<br>2013 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2012 年 1 月 1 日至<br>2012 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 163,940.64                                | 168,947.21                                     |

注：支付基金托管人中国光大银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目                    | 本期<br>2013 年 1 月 1 日至<br>2013 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2012 年 1 月 1 日至<br>2012 年 12 月 31 日 |
|-----------------------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| 期初持有的基金份额             | 8,090,552.04                              | 8,090,552.04                                   |
| 期间申购/买入总份额            | -                                         | -                                              |
| 期间因拆分变动份额             | -                                         | -                                              |
| 减：期间赎回/卖出总份额          | -                                         | -                                              |
| 期末持有的基金份额             | 8,090,552.04                              | 8,090,552.04                                   |
| 期末持有的基金份额<br>占基金总份额比例 | 5.57%                                     | 4.98%                                          |

##### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方<br>名称 | 本期<br>2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日 |           | 上年度可比期间<br>2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日 |           |
|-----------|----------------------------------------|-----------|---------------------------------------------|-----------|
|           | 期末余额                                   | 当期利息收入    | 期末余额                                        | 当期利息收入    |
| 中国光大银行    | 4,116,232.52                           | 49,311.65 | 8,943,288.92                                | 59,881.84 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.9 期末（2013 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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。

##### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

##### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

###### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1)公允价值

###### (a)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

###### (b)以公允价值计量的金融工具

###### (i)金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

###### (ii)各层级金融工具公允价值

于 2013 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 57,514,472.00 元，无属于第二层级及第三层级的余额(2012 年 12 月 31 日：第一层级的余额为 54,893,193.75 元，无属于第二层级及第三层级的余额)。

###### (iii)公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层级；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层级还是第三层级。

(iv)第三层级公允价值余额和本期变动金额

于本期末，本基金未持有公允价值归属于第三层级的金融工具(2012 年 12 月 31 日：同)。本基金本期净转入/(转出)第三层级的金额为零元，计入损益的第三层级金融工具公允价值变动为零元，涉及广州白云山制药股份有限公司发行的股票(2012 年度：无)。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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              | 48,200,872.73 | 74.78         |
|    | 其中：股票             | 48,200,872.73 | 74.78         |
| 2  | 固定收益投资            | 9,313,599.27  | 14.45         |
|    | 其中：债券             | 9,313,599.27  | 14.45         |
|    | 资产支持证券            | -             | -             |
| 3  | 金融衍生品投资           | -             | -             |
| 4  | 买入返售金融资产          | 1,200,000.00  | 1.86          |
|    | 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      | 4,324,914.79  | 6.71          |
| 6  | 其他各项资产            | 1,416,908.22  | 2.20          |
| 7  | 合计                | 64,456,295.01 | 100.00        |

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别     | 公允价值          | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|----------|---------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业 | -             | -             |
| B  | 采矿业      | 1,031,800.00  | 1.62          |
| C  | 制造业      | 36,253,111.81 | 56.99         |

|   |                  |               |       |
|---|------------------|---------------|-------|
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -             | -     |
| E | 建筑业              | 1,259,454.00  | 1.98  |
| F | 批发和零售业           | -             | -     |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | -             | -     |
| H | 住宿和餐饮业           | -             | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 2,337,663.00  | 3.67  |
| J | 金融业              | -             | -     |
| K | 房地产业             | -             | -     |
| L | 租赁和商务服务业         | 3,911,454.40  | 6.15  |
| M | 科学研究和技术服务业       | 2,478,257.52  | 3.90  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业    | -             | -     |
| O | 居民服务、修理和其他服务业    | -             | -     |
| P | 教育               | -             | -     |
| Q | 卫生和社会工作          | -             | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业        | 929,132.00    | 1.46  |
| S | 综合               | -             | -     |
|   | 合计               | 48,200,872.73 | 75.77 |

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）   | 公允价值         | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 002450 | 康得新  | 156,513 | 3,803,265.90 | 5.98         |
| 2  | 600332 | 白云山  | 127,082 | 3,515,088.12 | 5.53         |
| 3  | 600519 | 贵州茅台 | 24,700  | 3,170,986.00 | 4.98         |
| 4  | 000423 | 东阿阿胶 | 67,359  | 2,664,722.04 | 4.19         |
| 5  | 600518 | 康美药业 | 142,100 | 2,557,800.00 | 4.02         |
| 6  | 300058 | 蓝色光标 | 49,058  | 2,541,204.40 | 3.99         |
| 7  | 600436 | 片仔癀  | 26,710  | 2,519,020.10 | 3.96         |
| 8  | 600703 | 三安光电 | 86,700  | 2,149,293.00 | 3.38         |
| 9  | 002063 | 远光软件 | 102,000 | 1,983,900.00 | 3.12         |
| 10 | 002038 | 双鹭药业 | 35,192  | 1,778,955.60 | 2.80         |

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

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 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  | 002063 | 远光软件 | 6,974,743.20 | 10.87           |
| 2  | 000651 | 格力电器 | 6,554,278.76 | 10.21           |
| 3  | 600000 | 浦发银行 | 5,565,078.39 | 8.67            |
| 4  | 000002 | 万科 A | 5,452,735.83 | 8.50            |
| 5  | 600519 | 贵州茅台 | 5,442,141.44 | 8.48            |
| 6  | 600518 | 康美药业 | 5,424,559.30 | 8.45            |
| 7  | 002022 | 科华生物 | 4,679,943.24 | 7.29            |
| 8  | 600546 | 山煤国际 | 4,487,761.05 | 6.99            |
| 9  | 600837 | 海通证券 | 4,329,228.70 | 6.75            |
| 10 | 300071 | 华谊嘉信 | 4,291,317.74 | 6.69            |
| 11 | 600332 | 白云山  | 4,201,410.88 | 6.55            |
| 12 | 601058 | 赛轮股份 | 3,966,746.57 | 6.18            |
| 13 | 300039 | 上海凯宝 | 3,804,268.86 | 5.93            |
| 14 | 601601 | 中国太保 | 3,627,814.54 | 5.65            |
| 15 | 600199 | 金种子酒 | 3,565,942.05 | 5.56            |
| 16 | 600048 | 保利地产 | 3,399,258.68 | 5.30            |
| 17 | 600201 | 金宇集团 | 3,336,161.50 | 5.20            |
| 18 | 600703 | 三安光电 | 3,318,470.73 | 5.17            |
| 19 | 601928 | 凤凰传媒 | 3,314,490.01 | 5.17            |
| 20 | 600436 | 片仔癀  | 3,003,641.46 | 4.68            |
| 21 | 000423 | 东阿阿胶 | 2,895,020.04 | 4.51            |
| 22 | 002305 | 南国置业 | 2,887,632.08 | 4.50            |
| 23 | 600571 | 信雅达  | 2,870,214.99 | 4.47            |
| 24 | 600085 | 同仁堂  | 2,847,280.87 | 4.44            |
| 25 | 600728 | 佳都新太 | 2,804,384.24 | 4.37            |
| 26 | 002450 | 康得新  | 2,713,955.66 | 4.23            |

|    |        |       |              |      |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 27 | 600028 | 中国石化  | 2,693,755.00 | 4.20 |
| 28 | 600467 | 好当家   | 2,682,540.00 | 4.18 |
| 29 | 002375 | 亚厦股份  | 2,665,110.00 | 4.15 |
| 30 | 600315 | 上海家化  | 2,660,494.64 | 4.15 |
| 31 | 000522 | 白云山 A | 2,656,136.69 | 4.14 |
| 32 | 002028 | 思源电气  | 2,604,592.06 | 4.06 |
| 33 | 300045 | 华力创通  | 2,603,672.41 | 4.06 |
| 34 | 300098 | 高新兴   | 2,572,379.00 | 4.01 |
| 35 | 600704 | 物产中大  | 2,514,645.00 | 3.92 |
| 36 | 600889 | 南京化纤  | 2,512,739.89 | 3.92 |
| 37 | 000069 | 华侨城 A | 2,446,995.12 | 3.81 |
| 38 | 600637 | 百视通   | 2,423,117.07 | 3.78 |
| 39 | 600993 | 马应龙   | 2,411,507.80 | 3.76 |
| 40 | 300058 | 蓝色光标  | 2,407,670.28 | 3.75 |
| 41 | 002311 | 海大集团  | 2,404,067.16 | 3.75 |
| 42 | 002104 | 恒宝股份  | 2,400,063.80 | 3.74 |
| 43 | 300157 | 恒泰艾普  | 2,395,835.94 | 3.73 |
| 44 | 000501 | 鄂武商 A | 2,381,092.89 | 3.71 |
| 45 | 002241 | 歌尔声学  | 2,375,822.81 | 3.70 |
| 46 | 002161 | 远 望 谷 | 2,349,126.00 | 3.66 |
| 47 | 600016 | 民生银行  | 2,309,274.00 | 3.60 |
| 48 | 000581 | 威孚高科  | 2,300,974.87 | 3.59 |
| 49 | 600587 | 新华医疗  | 2,253,548.86 | 3.51 |
| 50 | 300251 | 光线传媒  | 2,249,698.70 | 3.51 |
| 51 | 002191 | 劲嘉股份  | 2,225,695.00 | 3.47 |
| 52 | 600481 | 双良节能  | 2,172,895.00 | 3.39 |
| 53 | 300332 | 天壕节能  | 2,054,865.00 | 3.20 |
| 54 | 600369 | 西南证券  | 1,989,680.00 | 3.10 |
| 55 | 300105 | 龙源技术  | 1,968,269.29 | 3.07 |
| 56 | 600329 | 中新药业  | 1,915,495.40 | 2.99 |
| 57 | 601117 | 中国化学  | 1,910,600.00 | 2.98 |
| 58 | 300015 | 爱尔眼科  | 1,886,102.39 | 2.94 |
| 59 | 300079 | 数码视讯  | 1,786,149.96 | 2.78 |
| 60 | 000538 | 云南白药  | 1,759,050.00 | 2.74 |
| 61 | 002038 | 双鹭药业  | 1,664,153.92 | 2.59 |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 62 | 600572 | 康恩贝  | 1,658,133.82 | 2.58 |
| 63 | 600489 | 中金黄金 | 1,646,103.07 | 2.57 |
| 64 | 600422 | 昆明制药 | 1,579,889.40 | 2.46 |
| 65 | 002385 | 大北农  | 1,559,968.00 | 2.43 |
| 66 | 300259 | 新天科技 | 1,545,895.00 | 2.41 |
| 67 | 000970 | 中科三环 | 1,512,249.15 | 2.36 |
| 68 | 002312 | 三泰电子 | 1,508,513.00 | 2.35 |
| 69 | 002230 | 科大讯飞 | 1,493,233.96 | 2.33 |
| 70 | 002668 | 奥马电器 | 1,489,833.00 | 2.32 |
| 71 | 000625 | 长安汽车 | 1,487,750.00 | 2.32 |
| 72 | 600702 | 沱牌舍得 | 1,423,987.00 | 2.22 |
| 73 | 600509 | 天富热电 | 1,418,596.93 | 2.21 |
| 74 | 002285 | 世联地产 | 1,389,329.30 | 2.17 |
| 75 | 300155 | 安居宝  | 1,379,394.20 | 2.15 |
| 76 | 300215 | 电科院  | 1,353,983.61 | 2.11 |
| 77 | 601901 | 方正证券 | 1,349,500.00 | 2.10 |
| 78 | 300008 | 上海佳豪 | 1,331,782.00 | 2.08 |
| 79 | 601555 | 东吴证券 | 1,323,846.00 | 2.06 |
| 80 | 000811 | 烟台冰轮 | 1,323,229.55 | 2.06 |
| 81 | 002289 | 宇顺电子 | 1,318,380.00 | 2.05 |
| 82 | 002221 | 东华能源 | 1,316,572.88 | 2.05 |
| 83 | 002594 | 比亚迪  | 1,309,444.84 | 2.04 |
| 84 | 600120 | 浙江东方 | 1,305,147.40 | 2.03 |
| 85 | 600111 | 包钢稀土 | 1,302,248.00 | 2.03 |
| 86 | 300349 | 金卡股份 | 1,301,344.50 | 2.03 |
| 87 | 300348 | 长亮科技 | 1,300,950.00 | 2.03 |
| 88 | 002131 | 利欧股份 | 1,299,852.98 | 2.03 |
| 89 | 002081 | 金螳螂  | 1,292,250.62 | 2.01 |
| 90 | 002440 | 闰土股份 | 1,289,763.46 | 2.01 |
| 91 | 002017 | 东信和平 | 1,288,641.00 | 2.01 |
| 92 | 600478 | 科力远  | 1,285,222.34 | 2.00 |
| 93 | 600976 | 武汉健民 | 1,284,403.00 | 2.00 |
| 94 | 300024 | 机器人  | 1,283,971.62 | 2.00 |

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

## 8.4.2 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  | 000651 | 格力电器  | 6,797,079.95 | 10.59          |
| 2  | 600000 | 浦发银行  | 5,963,781.00 | 9.29           |
| 3  | 600571 | 信雅达   | 5,417,619.08 | 8.44           |
| 4  | 002063 | 远光软件  | 5,375,719.94 | 8.38           |
| 5  | 000002 | 万 科 A | 5,010,917.55 | 7.81           |
| 6  | 300071 | 华谊嘉信  | 4,963,554.10 | 7.74           |
| 7  | 002022 | 科华生物  | 4,888,876.78 | 7.62           |
| 8  | 601058 | 赛轮股份  | 4,367,779.24 | 6.81           |
| 9  | 601006 | 大秦铁路  | 4,356,386.50 | 6.79           |
| 10 | 600837 | 海通证券  | 4,294,799.28 | 6.69           |
| 11 | 600546 | 山煤国际  | 4,236,665.77 | 6.60           |
| 12 | 600201 | 金宇集团  | 4,007,723.00 | 6.25           |
| 13 | 601601 | 中国太保  | 3,836,038.76 | 5.98           |
| 14 | 300039 | 上海凯宝  | 3,602,583.57 | 5.61           |
| 15 | 000522 | 白云山 A | 3,571,675.80 | 5.57           |
| 16 | 601928 | 凤凰传媒  | 3,526,864.52 | 5.50           |
| 17 | 600587 | 新华医疗  | 3,320,380.72 | 5.17           |
| 18 | 600266 | 北京城建  | 3,268,631.60 | 5.09           |
| 19 | 600728 | 佳都新太  | 3,144,697.49 | 4.90           |
| 20 | 002305 | 南国置业  | 3,034,060.92 | 4.73           |
| 21 | 600199 | 金种子酒  | 3,017,682.38 | 4.70           |
| 22 | 600048 | 保利地产  | 2,930,197.12 | 4.57           |
| 23 | 002375 | 亚厦股份  | 2,770,181.29 | 4.32           |
| 24 | 300054 | 鼎龙股份  | 2,764,286.86 | 4.31           |
| 25 | 600085 | 同仁堂   | 2,762,065.80 | 4.30           |
| 26 | 600340 | 华夏幸福  | 2,712,361.00 | 4.23           |
| 27 | 002311 | 海大集团  | 2,646,313.17 | 4.12           |
| 28 | 600889 | 南京化纤  | 2,640,650.10 | 4.12           |
| 29 | 600704 | 物产中大  | 2,633,557.00 | 4.10           |
| 30 | 601555 | 东吴证券  | 2,619,509.79 | 4.08           |
| 31 | 300045 | 华力创通  | 2,607,555.08 | 4.06           |
| 32 | 000501 | 鄂武商 A | 2,599,086.00 | 4.05           |
| 33 | 000069 | 华侨城 A | 2,595,420.00 | 4.04           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 34 | 600467 | 好当家  | 2,579,426.00 | 4.02 |
| 35 | 002104 | 恒宝股份 | 2,557,110.44 | 3.99 |
| 36 | 600519 | 贵州茅台 | 2,548,837.75 | 3.97 |
| 37 | 300015 | 爱尔眼科 | 2,540,351.69 | 3.96 |
| 38 | 002241 | 歌尔声学 | 2,501,806.40 | 3.90 |
| 39 | 600637 | 百视通  | 2,500,277.18 | 3.90 |
| 40 | 600993 | 马应龙  | 2,450,866.24 | 3.82 |
| 41 | 601328 | 交通银行 | 2,445,214.88 | 3.81 |
| 42 | 600518 | 康美药业 | 2,439,476.76 | 3.80 |
| 43 | 600015 | 华夏银行 | 2,424,698.60 | 3.78 |
| 44 | 600028 | 中国石化 | 2,417,319.12 | 3.77 |
| 45 | 600329 | 中新药业 | 2,364,731.68 | 3.69 |
| 46 | 300098 | 高新兴  | 2,355,409.70 | 3.67 |
| 47 | 002161 | 远望谷  | 2,319,509.57 | 3.61 |
| 48 | 002312 | 三泰电子 | 2,310,926.08 | 3.60 |
| 49 | 002191 | 劲嘉股份 | 2,303,741.00 | 3.59 |
| 50 | 000581 | 威孚高科 | 2,282,489.96 | 3.56 |
| 51 | 002028 | 思源电气 | 2,245,570.64 | 3.50 |
| 52 | 000538 | 云南白药 | 2,234,529.01 | 3.48 |
| 53 | 600016 | 民生银行 | 2,203,803.90 | 3.43 |
| 54 | 600481 | 双良节能 | 2,192,571.76 | 3.42 |
| 55 | 300105 | 龙源技术 | 2,118,100.10 | 3.30 |
| 56 | 600369 | 西南证券 | 2,086,658.24 | 3.25 |
| 57 | 300079 | 数码视讯 | 2,009,468.00 | 3.13 |
| 58 | 601117 | 中国化学 | 1,942,920.30 | 3.03 |
| 59 | 002133 | 广宇集团 | 1,932,098.00 | 3.01 |
| 60 | 000655 | 金岭矿业 | 1,810,894.24 | 2.82 |
| 61 | 600805 | 悦达投资 | 1,790,714.05 | 2.79 |
| 62 | 002594 | 比亚迪  | 1,638,211.15 | 2.55 |
| 63 | 002230 | 科大讯飞 | 1,593,639.54 | 2.48 |
| 64 | 002289 | 宇顺电子 | 1,523,512.42 | 2.37 |
| 65 | 600702 | 沱牌舍得 | 1,519,244.19 | 2.37 |
| 66 | 002668 | 奥马电器 | 1,495,439.80 | 2.33 |
| 67 | 000666 | 经纬纺机 | 1,485,886.35 | 2.32 |
| 68 | 300157 | 恒泰艾普 | 1,481,032.09 | 2.31 |
| 69 | 600509 | 天富热电 | 1,478,082.98 | 2.30 |
| 70 | 600120 | 浙江东方 | 1,476,176.00 | 2.30 |

|    |        |       |              |      |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 71 | 600489 | 中金黄金  | 1,470,748.30 | 2.29 |
| 72 | 002065 | 东华软件  | 1,448,950.98 | 2.26 |
| 73 | 000970 | 中科三环  | 1,446,720.00 | 2.25 |
| 74 | 300178 | 腾邦国际  | 1,438,345.20 | 2.24 |
| 75 | 600166 | 福田汽车  | 1,435,652.22 | 2.24 |
| 76 | 600724 | 宁波富达  | 1,425,953.93 | 2.22 |
| 77 | 300348 | 长亮科技  | 1,423,719.00 | 2.22 |
| 78 | 600570 | 恒生电子  | 1,397,446.00 | 2.18 |
| 79 | 300155 | 安居宝   | 1,393,185.30 | 2.17 |
| 80 | 002440 | 闰土股份  | 1,382,417.52 | 2.15 |
| 81 | 600645 | 中源协和  | 1,381,762.00 | 2.15 |
| 82 | 300306 | 远方光电  | 1,371,205.00 | 2.14 |
| 83 | 000525 | 红 太 阳 | 1,354,712.26 | 2.11 |
| 84 | 600703 | 三安光电  | 1,353,770.00 | 2.11 |
| 85 | 600572 | 康恩贝   | 1,349,455.42 | 2.10 |
| 86 | 002131 | 利欧股份  | 1,348,913.73 | 2.10 |
| 87 | 300030 | 阳普医疗  | 1,346,428.50 | 2.10 |
| 88 | 300008 | 上海佳豪  | 1,346,105.10 | 2.10 |
| 89 | 000811 | 烟台冰轮  | 1,334,278.80 | 2.08 |
| 90 | 300090 | 盛运股份  | 1,328,876.40 | 2.07 |
| 91 | 002017 | 东信和平  | 1,328,700.00 | 2.07 |
| 92 | 300170 | 汉得信息  | 1,324,134.95 | 2.06 |
| 93 | 600011 | 华能国际  | 1,322,613.00 | 2.06 |
| 94 | 300296 | 利亚德   | 1,322,465.00 | 2.06 |
| 95 | 600884 | 杉杉股份  | 1,320,683.87 | 2.06 |
| 96 | 300287 | 飞利信   | 1,319,965.18 | 2.06 |
| 97 | 601028 | 玉龙股份  | 1,309,199.95 | 2.04 |
| 98 | 002033 | 丽江旅游  | 1,293,110.06 | 2.02 |

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。

#### 8.4.3 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 | 310,113,613.30 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 314,374,988.71 |

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。

**8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合**

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值         | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|--------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -            | -            |
| 2  | 央行票据      | -            | -            |
| 3  | 金融债券      | -            | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -            | -            |
| 4  | 企业债券      | -            | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -            | -            |
| 6  | 中期票据      | -            | -            |
| 7  | 可转债       | 9,313,599.27 | 14.64        |
| 8  | 其他        | -            | -            |
| 9  | 合计        | 9,313,599.27 | 14.64        |

**8.6 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  | 113001 | 中行转债 | 22,290 | 2,147,195.70 | 3.38         |
| 2  | 110015 | 石化转债 | 21,440 | 2,044,518.40 | 3.21         |
| 3  | 125089 | 深机转债 | 21,321 | 2,009,013.87 | 3.16         |
| 4  | 110020 | 南山转债 | 20,090 | 1,830,801.70 | 2.88         |
| 5  | 110007 | 博汇转债 | 12,530 | 1,282,069.60 | 2.02         |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**8.8 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**

本基金本报告期末未持有权证。

**8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****8.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

根据本基金基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

**8.9.2 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，本基金不参与股指期货交易。

**8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****8.10.1 本期国债期货投资政策**

根据本基金基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

**8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

根据本基金基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

**8.10.3 本期国债期货投资评价**

根据本基金基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

**8.11 投资组合报告附注****8.11.1**

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体除贵州茅台酒股份有限公司（以下简称“贵州茅台”）外，其余的未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。

贵州茅台于 2013 年 2 月 23 日公告，其控股子公司贵州茅台酒销售有限公司于 2013 年 2 月 22 日收到贵州省物价局《行政处罚决定书》（黔价处[2013]1 号）。贵州茅台在公告中陈述了《行政处罚决定书》有关内容。

本基金投资贵州茅台（600519）的决策流程符合本基金管理人投资管理制度的相关规定。针对上述情况，本基金管理人进行了分析和研究，认为上述事件对贵州茅台的投资价值未造成实质性影响。本基金管理人将继续对上述公司进行跟踪研究。

**8.11.2**

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。

**8.11.3 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   | 63,138.47    |
| 2  | 应收证券清算款 | 1,282,855.17 |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 56,087.10    |
| 5  | 应收申购款   | 14,827.48    |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 1,416,908.22 |

**8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值         | 占基金资产净值比例<br>(%) |
|----|--------|------|--------------|------------------|
| 1  | 113001 | 中行转债 | 2,147,195.70 | 3.38             |
| 2  | 110015 | 石化转债 | 2,044,518.40 | 3.21             |
| 3  | 125089 | 深机转债 | 2,009,013.87 | 3.16             |
| 4  | 110020 | 南山转债 | 1,830,801.70 | 2.88             |
| 5  | 110007 | 博汇转债 | 1,282,069.60 | 2.02             |

**8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

**§ 9 基金份额持有人信息****9.1 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 |
| 7,533        | 19,270.93     | 12,580,253.07 | 8.67%      | 132,587,642.10 | 91.33%     |

**9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

**§ 10 开放式基金份额变动**

单位：份

|                                |                  |
|--------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2004 年 3 月 26 日）基金份额总额 | 1,854,893,478.59 |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 162,588,179.82   |
| 本报告期基金总申购份额                    | 15,472,752.58    |
| 减:本报告期基金总赎回份额                  | 32,893,037.23    |

|              |                |
|--------------|----------------|
| 本报告期基金拆分变动份额 | -              |
| 本报告期期末基金份额总额 | 145,167,895.17 |

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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。

2014 年 1 月 14 日起，沈良先生不再担任基金管理人副总经理，公司于 2014 年 1 月 15 日公告了上述事项。

2014 年 3 月 6 日起，王文学先生不再担任基金管理人董事长，总经理于华先生代任董事长一职，公司于 2014 年 3 月 8 日公告了上述事项。

2014 年 3 月 14 日起，基金管理人增聘高见先生为公司副总经理，公司于 2014 年 3 月 15 日公告了上述事项。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金未改变投资策略。

### 11.5 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。报告期内应支付给聘任会计师事务所——普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）2013 年度审计的报酬为 50,000.00 元。目前普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已连续八年向本基金提供审计服务。

### 11.6 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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 11.7.1 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 |    |
| 光大证券 | 1      | 141,635,360.03 | 22.80%       | 128,944.79 | 22.86%     | -  |
| 招商证券 | 1      | 110,630,830.31 | 17.81%       | 100,320.55 | 17.78%     | -  |
| 中信证券 | 1      | 91,109,702.96  | 14.67%       | 82,946.54  | 14.70%     | -  |
| 国泰君安 | 1      | 81,790,911.32  | 13.17%       | 74,462.46  | 13.20%     | -  |
| 齐鲁证券 | 1      | 78,654,300.88  | 12.66%       | 70,600.27  | 12.51%     | -  |
| 东兴证券 | 1      | 47,454,738.63  | 7.64%        | 43,202.96  | 7.66%      | -  |
| 海通证券 | 1      | 26,418,018.48  | 4.25%        | 24,051.24  | 4.26%      | -  |
| 申银万国 | 1      | 24,048,633.73  | 3.87%        | 21,893.83  | 3.88%      | -  |
| 国金证券 | 1      | 18,703,334.88  | 3.01%        | 17,027.51  | 3.02%      | -  |
| 平安证券 | 1      | 782,325.03     | 0.13%        | 712.20     | 0.13%      | -  |

注：1. 专用交易单元的选择标准和程序

- (1) 实力雄厚，信誉良好。
- (2) 财务状况良好，经营行为规范。
- (3) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。
- (4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务。
- (5) 研究实力较强，能及时、定期、全面地为本基金提供研究服务。
- (6) 为基金份额持有人提供高水平的综合服务。

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

2. 本基金本报告期内新租用 1 个交易单元：东兴证券股份有限公司（1 个交易单元）。

## 11.7.2 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 |

|      |               |        |                |        |   |   |
|------|---------------|--------|----------------|--------|---|---|
| 光大证券 | 7,524,788.19  | 33.24% | 136,000,000.00 | 59.91% | - | - |
| 招商证券 | -             | -      | -              | -      | - | - |
| 中信证券 | 118,323.72    | 0.52%  | -              | -      | - | - |
| 国泰君安 | -             | -      | 55,000,000.00  | 24.23% | - | - |
| 齐鲁证券 | -             | -      | -              | -      | - | - |
| 东兴证券 | 1,946,071.41  | 8.60%  | -              | -      | - | - |
| 海通证券 | 13,049,725.37 | 57.64% | 19,000,000.00  | 8.37%  | - | - |
| 申银万国 | -             | -      | 17,000,000.00  | 7.49%  | - | - |
| 国金证券 | -             | -      | -              | -      | - | - |
| 平安证券 | -             | -      | -              | -      | - | - |

注：本基金本报告期租用的证券公司交易单元未进行权证及基金投资。

摩根士丹利华鑫基金管理有限公司  
2014 年 3 月 27 日