

摩根士丹利华鑫双利增强债券型证券投资基金

2013 半年度报告摘要

基金管理人: 摩根士丹利华鑫基金管理有限公司
基金托管人: 中国建设银行股份有限公司
送出日期: 2013年8月27日

组合的构成、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配置机会。
本基金经理人兼任任何一方,均与估值定价无任何利益冲突,估值过程中基金经理并未参与、报告

Table with 2 columns: 基金代码, 基金名称. Includes 000024 大摩双利增强债券 and 000025 大摩双利增强债券C.

4.6 管理人对于基金估值程序等事项的说明
基金管理人对于基金估值程序等事项的说明,对于相关品种,特别是长期停牌股票等,管理人根据中国证监会的有关规定,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程序如下:

2.1 基金基本情况
基金名称: 大摩双利增强债券
基金代码: 000024
基金运作方式: 契约型开放式

4.7 基金管理人参与估值定价行为之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
4.8 基金管理人对于基金估值程序等事项的说明
本基金经理人兼任任何一方,均与估值定价无任何利益冲突,估值过程中基金经理并未参与、报告

投资目标
本基金将保持稳健配置策略,在严格控制风险的基础上,力争使投资者获得长期稳定的投资回报。

5.1 报告期内基金托管人履职情况说明
本报告期内,中国建设银行(以下简称“本托管人”)严格按照了《证券投资基金托管协议》、《基金合同》、《托管协议》及其他有关规定,不存在任何违反法律法规、基金合同及托管协议约定的行为,完全尽职尽责履行了基金托管人职责。

业绩比较基准
中债企业债总全价指数收益率*40%+天相可转债指数收益率*40%+中债国债总全价指数收益率*20%

6.1 资产负债表
会计主体: 摩根士丹利华鑫双利增强债券型证券投资基金
报告截止日: 2013年6月30日

Table with 2 columns: 姓名, 职务. Lists 李颖 (基金经理) and 田晋 (基金托管人).

Table with 3 columns: 资产, 负债和所有者权益. Financial statement for 2013年6月30日.

3.1 主要会计数据和财务指标
基金级别: 大摩双利增强债券A, 大摩双利增强债券C

6.2 利润表
会计主体: 摩根士丹利华鑫双利增强债券型证券投资基金
报告截止日: 2013年6月30日

Table with 4 columns: 阶段, 份额净值增长率, 业绩比较基准收益率, 业绩比较基准差.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上年度可比期间. Income statement for 2013年6月30日.

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

6.3 所有者权益变动表
会计主体: 摩根士丹利华鑫双利增强债券型证券投资基金
报告截止日: 2013年6月30日

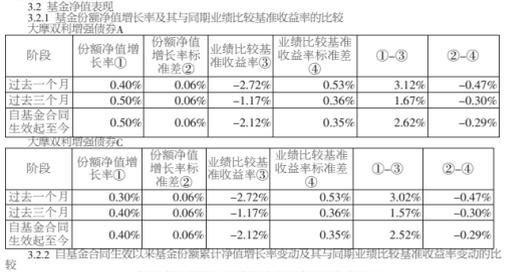


Table with 3 columns: 项目, 本期, 上年度可比期间. Balance sheet for 2013年6月30日.

4.1 基金管理人及基金托管人
4.1.1 基金管理人及其基金托管人的经验

6.4 关联交易
6.4.1 关联方名称
6.4.2 关联交易类型

Table with 3 columns: 姓名, 职务, 任期日期. Lists 洪天阳 (基金经理).

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上年度可比期间. Balance sheet for 2013年6月30日.

4.2 基金投资
4.2.1 基金投资组合报告

6.4.3 关联方名称
6.4.4 关联交易类型

Table with 3 columns: 姓名, 职务, 任期日期. Lists 洪天阳 (基金经理).

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上年度可比期间. Balance sheet for 2013年6月30日.

4.3 基金业绩
4.3.1 基金业绩表现

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上年度可比期间. Balance sheet for 2013年6月30日.

4.4 基金费用
4.4.1 基金费用概览

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上年度可比期间. Balance sheet for 2013年6月30日.

4.5 基金收益
4.5.1 基金收益分配

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上年度可比期间. Balance sheet for 2013年6月30日.

4.6 基金风险
4.6.1 基金风险揭示

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上年度可比期间. Balance sheet for 2013年6月30日.

4.7 基金其他
4.7.1 基金其他事项

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上年度可比期间. Balance sheet for 2013年6月30日.

4.8 基金其他
4.8.1 基金其他事项

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上年度可比期间. Balance sheet for 2013年6月30日.

4.9 基金其他
4.9.1 基金其他事项

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上年度可比期间. Balance sheet for 2013年6月30日.

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%). Top 10 holdings.

Table with 4 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金总资产比例(%).

Table with 4 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金总资产比例(%).

Table with 4 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金总资产比例(%).

Table with 4 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金总资产比例(%).

Table with 4 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金总资产比例(%).

Table with 4 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金总资产比例(%).

Table with 4 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金总资产比例(%).

Table with 4 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金总资产比例(%).

Table with 4 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金总资产比例(%).

Table with 4 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金总资产比例(%).

Table with 4 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金总资产比例(%).

Table with 4 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金总资产比例(%).

Table with 4 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金总资产比例(%).

Table with 4 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金总资产比例(%).

Table with 4 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金总资产比例(%).

Table with 4 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金总资产比例(%).

Table with 4 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金总资产比例(%).

Table with 4 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金总资产比例(%).

Table with 4 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金总资产比例(%).

Table with 4 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金总资产比例(%).

Table with 4 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金总资产比例(%).

Table with 4 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金总资产比例(%).