

摩根士丹利华鑫品质生活精选股票型证券投资基金

2014 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:2014年8月26日

1.1 重要提示
基金管理人、基金托管人、基金销售机构所披露的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法律责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年8月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证基金资产净值不存在虚假记载或重大遗漏。

2.1 基金基本情况
基金名称:摩根士丹利华鑫品质生活精选股票型证券投资基金
基金代码:000908
基金运作方式:契约型开放式

2.2 基金产品说明
投资目标:本基金通过投资于国内精选股票,追求超越业绩比较基准的长期稳定增值。

2.3 基金管理人及基金托管人
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

2.4 信息披露方式
信息披露网站:www.mofund.com.cn
基金半年度报告备置地点:基金管理人、基金托管人处

3.1 主要会计数据和财务指标
3.1.1 期间数据和指标
3.1.2 期末数据和指标

3.2 基金净值表现
3.2.1 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:1.本基金基金合同于2013年10月29日正式生效,截至本报告期末未滿一年;
2.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。

委员会的相关人均均具有一定年限的专业从业经验,具有良好的专业能力,并在相关工作中保持独立性。

4.7 管理人对于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。

5.1 报告期内本基金托管人履行情况的说明
本报告期,中国建设银行股份有限公司作为本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定。

5.2 托管人对本半年度报告中财务信息的真实、准确和完整发表意见
本托管人复核了本报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

6.1 资产负债表
会计主体:摩根士丹利华鑫品质生活精选股票型证券投资基金
报告截止日:2014年6月30日

Table with 3 columns: Item, 2014年6月30日, 2013年12月31日. Rows include assets, liabilities, and net assets.

6.2 利润表
会计主体:摩根士丹利华鑫品质生活精选股票型证券投资基金
报告截止日:2014年1月1日至2014年6月30日

Table with 3 columns: Item, 2014年1月1日至2014年6月30日, 2013年1月1日至2013年6月30日. Rows include income, expenses, and net income.

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:摩根士丹利华鑫品质生活精选股票型证券投资基金
报告截止日:2014年1月1日至2014年6月30日

Table with 3 columns: Item, 2014年1月1日, 2014年6月30日. Rows include net assets at the beginning, end, and during the period.

注:1.本基金基金合同于2013年10月29日正式生效,截至本报告期末未滿一年,无上年度对比数据。

6.4 投资组合报告
6.4.1 报告期末基金资产组合情况
6.4.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table showing portfolio composition by industry: 医药生物, 食品饮料, 信息技术, etc.

6.4.3 报告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

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值. Lists top 10 stock holdings.

6.4.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(份), 公允价值. Lists top 10 warrant holdings.

6.4.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

6.4.6 报告期末前十名资产支持证券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金资产净值比例(%)

6.4.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

Table with 5 columns: 序号, 品种, 持仓量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

6.4.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

Table with 5 columns: 序号, 品种, 持仓量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

6.4.9 投资组合报告附注
6.4.9.1 本基金投资的前十名股票中,没有投资于发行前未履行上市承诺的股票。

6.4.9.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资于涉及证券期货市场内幕交易和操纵市场等违法违规行为的股票。

6.4.9.3 本基金投资的前十名股票中,没有投资于流通受限股票。

6.4.9.4 本基金投资的前十名股票中,没有投资于被监管机构立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的股票。

6.4.9.5 本基金投资的前十名股票中,没有投资于其他关联方发行的股票。

6.4.9.6 本基金投资的前十名股票中,没有投资于其他关联方发行的股票。

6.4.9.7 本基金投资的前十名股票中,没有投资于其他关联方发行的股票。

6.4.9.8 本基金投资的前十名股票中,没有投资于其他关联方发行的股票。

6.4.9.9 本基金投资的前十名股票中,没有投资于其他关联方发行的股票。

6.4.9.10 本基金投资的前十名股票中,没有投资于其他关联方发行的股票。

6.4.9.11 本基金投资的前十名股票中,没有投资于其他关联方发行的股票。

6.4.9.12 本基金投资的前十名股票中,没有投资于其他关联方发行的股票。

6.4.9.13 本基金投资的前十名股票中,没有投资于其他关联方发行的股票。

6.4.9.14 本基金投资的前十名股票中,没有投资于其他关联方发行的股票。

6.4.9.15 本基金投资的前十名股票中,没有投资于其他关联方发行的股票。

(2) 从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) 对基金取得的股票股息红利收入,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。

(4) 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,估值过程中基金管理人并未参与,报告期内,本基金管理人未与任何关联方发生任何定价服务。

4.7 管理人对于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。

5.1 报告期内本基金托管人履行情况的说明
本报告期,中国建设银行股份有限公司作为本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定。

5.2 托管人对本半年度报告中财务信息的真实、准确和完整发表意见
本托管人复核了本报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

6.1 资产负债表
会计主体:摩根士丹利华鑫品质生活精选股票型证券投资基金
报告截止日:2014年6月30日

Table with 3 columns: Item, 2014年1月1日至2014年6月30日, 2013年1月1日至2013年6月30日. Rows include assets, liabilities, and net assets.

6.2 利润表
会计主体:摩根士丹利华鑫品质生活精选股票型证券投资基金
报告截止日:2014年1月1日至2014年6月30日

Table with 3 columns: Item, 2014年1月1日至2014年6月30日, 2013年1月1日至2013年6月30日. Rows include income, expenses, and net income.

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:摩根士丹利华鑫品质生活精选股票型证券投资基金
报告截止日:2014年1月1日至2014年6月30日

Table with 3 columns: Item, 2014年1月1日, 2014年6月30日. Rows include net assets at the beginning, end, and during the period.

注:1.本基金基金合同于2013年10月29日正式生效,无上年度可比期间数据。

6.4.1.1 股票投资
注:1. 本基金基金合同于2013年10月29日正式生效,无上年度可比期间数据。

6.4.1.2 权证投资
注:1. 本基金本报告期无通过关联方交易方式进行权证投资。

6.4.1.3 应收关联方款项
注:1. 本基金本报告期无关联方应收款项。

6.4.1.4 其他资产
注:1. 本基金本报告期无其他资产。

6.4.1.5 其他负债
注:1. 本基金本报告期无其他负债。

6.4.1.6 其他所有者权益
注:1. 本基金本报告期无其他所有者权益。

6.4.1.7 其他资产支持证券
注:1. 本基金本报告期无其他资产支持证券。

6.4.1.8 其他负债
注:1. 本基金本报告期无其他负债。

6.4.1.9 其他所有者权益
注:1. 本基金本报告期无其他所有者权益。

6.4.1.10 其他资产支持证券
注:1. 本基金本报告期无其他资产支持证券。

6.4.1.11 其他负债
注:1. 本基金本报告期无其他负债。

6.4.1.12 其他所有者权益
注:1. 本基金本报告期无其他所有者权益。

6.4.1.13 其他资产支持证券
注:1. 本基金本报告期无其他资产支持证券。

6.4.1.14 其他负债
注:1. 本基金本报告期无其他负债。

6.4.1.15 其他所有者权益
注:1. 本基金本报告期无其他所有者权益。

6.4.1.16 其他资产支持证券
注:1. 本基金本报告期无其他资产支持证券。

6.4.1.17 其他负债
注:1. 本基金本报告期无其他负债。

6.4.1.18 其他所有者权益
注:1. 本基金本报告期无其他所有者权益。

6.4.1.19 其他资产支持证券
注:1. 本基金本报告期无其他资产支持证券。

6.4.1.20 其他负债
注:1. 本基金本报告期无其他负债。

6.4.1.21 其他所有者权益
注:1. 本基金本报告期无其他所有者权益。

6.4.1.22 其他资产支持证券
注:1. 本基金本报告期无其他资产支持证券。

6.4.1.23 其他负债
注:1. 本基金本报告期无其他负债。

6.4.1.24 其他所有者权益
注:1. 本基金本报告期无其他所有者权益。

6.4.1.25 其他资产支持证券
注:1. 本基金本报告期无其他资产支持证券。

6.4.1.26 其他负债
注:1. 本基金本报告期无其他负债。

6.4.1.27 其他所有者权益
注:1. 本基金本报告期无其他所有者权益。

6.4.1.28 其他资产支持证券
注:1. 本基金本报告期无其他资产支持证券。

6.4.1.29 其他负债
注:1. 本基金本报告期无其他负债。

6.4.1.30 其他所有者权益
注:1. 本基金本报告期无其他所有者权益。

Table with 5 columns: 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(%)

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

Table with 2 columns: 项目, 金额. Rows include total cost of stocks bought and total income from stocks sold.

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
本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

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

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策
根据本基金基金合同约定,本基金不参与股指期货交易。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
7.11.1 本期国债期货投资政策
根据本基金基金合同约定,本基金不参与国债期货交易。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
7.11.3 本期国债期货投资政策
根据本基金基金合同约定,本基金不参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注
7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内未出现监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名股票未构成基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额. Rows include cash, receivables, etc.

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 流通受限部分的公允价值, 占基金资产净值比例(%)

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

Table with 2 columns: 持有人户数(户), 持有人结构. Rows include institutional and individual investors.

8.2 期末基金份额持有人的从业人员持有本基金的情况

Table with 2 columns: 持有基金份额(份), 占基金份额比例(%)

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量的情况

Table with 2 columns: 持有基金份额总量占基金总份额比例(%)

9 开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 基金合同生效日(2013年10月29日), 基金份额总额

10.1 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18位工作人员变动

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

10.4 基金投资策略的改变

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

Table with 5 columns: 券商名称, 交易单元数量, 股票交易, 债券交易, 权证交易

注:1. 专用交易单元的选择标准
(1) 实力雄厚,信誉良好;
(2) 财务状况良好,经营行为规范;

(3) 内部控制严格,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,交易设施运作代理基金进行证券交易的需要,并能与本基金提供综合信息服务;

(5) 研究实力较强,能及时、定期、全面地为本基金提供研究报告;

(6) 为基金提供持续、高水平的综合服务。

3. 本报告期末,本基金新申购3个交易单元,中信证券、长城证券、安信证券交易单元各1个。

4. 本报告期内,“中信万通证券有限责任公司”(简称“中信万通”)于2014年4月15日起更名为“中信证券(山东)有限责任公司”,简称“中信证券(山东)”。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券交易的情况

Table with 5 columns: 券商名称, 股票交易, 债券交易, 权证交易, 基金交易