

摩根士丹利华鑫多因子精选策略股票型证券投资基金

[2014] 第一季度报告

基金管理人:摩根士丹利华鑫基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2014年4月22日

基金治理的董事会及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责任。
本基金的基金管理人根据法律法规的规定，于2014年1月10日核发了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，但本基金的各份额并不单独进行登记，误将份额混淆为不同类别。
基金的过往业绩并不代表未来表现。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。

本报告期利润为零元未实现。

报告期利润:2014年1月1日至3月31日止。

(2) 基金产品概况

大摩多因子策略股票

基金代码:233007

交易代码:233009

基金运作方式:

契约型开放式

基金合同生效日:2011年5月17日

报告期末基金份额总额:385,028,366.23份

投资目标:本基金通过量化模型方法,精选股票进行投资,在充分控制风险的前提下,力争获取超越比较基准的投资回报。

本基金采用量化模型驱动的投资策略为主导投资策略,结合适当的资产配置策略。

1. 大摩多因子策略股票

本基金“量化模型”为主要投资策略,通过基金经理人开发的“大摩多因子策略模型”进行选股并构建股票投资组合。

“大摩多因子策略模型”在实际运行过程中定期或不定期地进行调整,以适应市场变化。

2. 资产配置策略

本基金由公司投资决策委员会统一领导下对货币配置机制、固定收益类资产配置、进行国债、金融债、公司债等固定收益类资产的配置。

本基金采用一定比例固定收益类资产组合,即单利定期存款、收益凭证类理财产品、公司债券投资策略,以转换货币型基金的配置。

Q股投资策略

本基金着重选择具有稳定分红能力,与指数期货交易。本基金参与股指期货投资的决策建立在对证券市场行情进行判断的基础上,以Black-Scholes模型和大数法则为理论基础,对证券市场的分析和对指数期货的定价进行分析,并根据分析结果,适时地增加或减少对股指期货的投资比例。

3. 其他投资策略

(1) 固定收益类资产策略

本基金主要投资于国债、金融债、公司债等固定收益类资产,可转换债券的配置。

本基金采用一定的固定收益类资产组合,即单利定期存款、收益凭证类理财产品、公司债券投资策略,以转换货币型基金的配置。

Q股投资策略

本基金着重选择具有稳定分红能力,与指数期货交易。本基金参与股指期货投资的决策建立在对证券市场行情进行判断的基础上,以Black-Scholes模型和大数法则为理论基础,对证券市场的分析和对指数期货的定价进行分析,并根据分析结果,适时地增加或减少对股指期货的投资比例。

4. 其他投资策略

本基金主要投资于国债、金融债、公司债等固定收益类资产,可转换债券的配置。

本基金采用一定的固定收益类资产组合,即单利定期存款、收益凭证类理财产品、公司债券投资策略,以转换货币型基金的配置。

5. 公开募集的其他投资品种

本基金通过量化模型方法,精选股票进行投资,在充分控制风险的前提下,力争获取超越比较基准的投资回报。

本基金采用量化模型驱动的投资策略为主导投资策略,结合适当的资产配置策略。

1. 大摩多因子策略股票

本基金“量化模型”为主要投资策略,通过基金经理人开发的“大摩多因子策略模型”进行选股并构建股票投资组合。

“大摩多因子策略模型”在实际运行过程中定期或不定期地进行调整,以适应市场变化。

2. 资产配置策略

本基金由公司投资决策委员会统一领导下对货币配置机制、固定收益类资产配置、进行国债、金融债、公司债等固定收益类资产的配置。

本基金采用一定比例固定收益类资产组合,即单利定期存款、收益凭证类理财产品、公司债券投资策略,以转换货币型基金的配置。

Q股投资策略

本基金着重选择具有稳定分红能力,与指数期货交易。本基金参与股指期货投资的决策建立在对证券市场行情进行判断的基础上,以Black-Scholes模型和大数法则为理论基础,对证券市场的分析和对指数期货的定价进行分析,并根据分析结果,适时地增加或减少对股指期货的投资比例。

3. 其他投资策略

(1) 固定收益类资产策略

本基金主要投资于国债、金融债、公司债等固定收益类资产,可转换债券的配置。

本基金采用一定的固定收益类资产组合,即单利定期存款、收益凭证类理财产品、公司债券投资策略,以转换货币型基金的配置。

Q股投资策略

本基金着重选择具有稳定分红能力,与指数期货交易。本基金参与股指期货投资的决策建立在对证券市场行情进行判断的基础上,以Black-Scholes模型和大数法则为理论基础,对证券市场的分析和对指数期货的定价进行分析,并根据分析结果,适时地增加或减少对股指期货的投资比例。

4. 其他投资策略

本基金主要投资于国债、金融债、公司债等固定收益类资产,可转换债券的配置。

本基金采用一定的固定收益类资产组合,即单利定期存款、收益凭证类理财产品、公司债券投资策略,以转换货币型基金的配置。

5. 公开募集的其他投资品种

本基金通过量化模型方法,精选股票进行投资,在充分控制风险的前提下,力争获取超越比较基准的投资回报。

本基金采用量化模型驱动的投资策略为主导投资策略,结合适当的资产配置策略。

1. 大摩多因子策略股票

本基金“量化模型”为主要投资策略,通过基金经理人开发的“大摩多因子策略模型”进行选股并构建股票投资组合。

“大摩多因子策略模型”在实际运行过程中定期或不定期地进行调整,以适应市场变化。

2. 资产配置策略

本基金由公司投资决策委员会统一领导下对货币配置机制、固定收益类资产配置、进行国债、金融债、公司债等固定收益类资产的配置。

本基金采用一定比例固定收益类资产组合,即单利定期存款、收益凭证类理财产品、公司债券投资策略,以转换货币型基金的配置。

Q股投资策略

本基金着重选择具有稳定分红能力,与指数期货交易。本基金参与股指期货投资的决策建立在对证券市场行情进行判断的基础上,以Black-Scholes模型和大数法则为理论基础,对证券市场的分析和对指数期货的定价进行分析,并根据分析结果,适时地增加或减少对股指期货的投资比例。

3. 其他投资策略

(1) 固定收益类资产策略

本基金主要投资于国债、金融债、公司债等固定收益类资产,可转换债券的配置。

本基金采用一定的固定收益类资产组合,即单利定期存款、收益凭证类理财产品、公司债券投资策略,以转换货币型基金的配置。

Q股投资策略

本基金着重选择具有稳定分红能力,与指数期货交易。本基金参与股指期货投资的决策建立在对证券市场行情进行判断的基础上,以Black-Scholes模型和大数法则为理论基础,对证券市场的分析和对指数期货的定价进行分析,并根据分析结果,适时地增加或减少对股指期货的投资比例。

4. 其他投资策略

本基金主要投资于国债、金融债、公司债等固定收益类资产,可转换债券的配置。

本基金采用一定的固定收益类资产组合,即单利定期存款、收益凭证类理财产品、公司债券投资策略,以转换货币型基金的配置。

5. 公开募集的其他投资品种

本基金通过量化模型方法,精选股票进行投资,在充分控制风险的前提下,力争获取超越比较基准的投资回报。

本基金采用量化模型驱动的投资策略为主导投资策略,结合适当的资产配置策略。

1. 大摩多因子策略股票

本基金“量化模型”为主要投资策略,通过基金经理人开发的“大摩多因子策略模型”进行选股并构建股票投资组合。

“大摩多因子策略模型”在实际运行过程中定期或不定期地进行调整,以适应市场变化。

2. 资产配置策略

本基金由公司投资决策委员会统一领导下对货币配置机制、固定收益类资产配置、进行国债、金融债、公司债等固定收益类资产的配置。

本基金采用一定比例固定收益类资产组合,即单利定期存款、收益凭证类理财产品、公司债券投资策略,以转换货币型基金的配置。

Q股投资策略

本基金着重选择具有稳定分红能力,与指数期货交易。本基金参与股指期货投资的决策建立在对证券市场行情进行判断的基础上,以Black-Scholes模型和大数法则为理论基础,对证券市场的分析和对指数期货的定价进行分析,并根据分析结果,适时地增加或减少对股指期货的投资比例。

3. 其他投资策略

(1) 固定收益类资产策略

本基金主要投资于国债、金融债、公司债等固定收益类资产,可转换债券的配置。

本基金采用一定的固定收益类资产组合,即单利定期存款、收益凭证类理财产品、公司债券投资策略,以转换货币型基金的配置。

Q股投资策略

本基金着重选择具有稳定分红能力,与指数期货交易。本基金参与股指期货投资的决策建立在对证券市场行情进行判断的基础上,以Black-Scholes模型和大数法则为理论基础,对证券市场的分析和对指数期货的定价进行分析,并根据分析结果,适时地增加或减少对股指期货的投资比例。

4. 其他投资策略

本基金主要投资于国债、金融债、公司债等固定收益类资产,可转换债券的配置。

本基金采用一定的固定收益类资产组合,即单利定期存款、收益凭证类理财产品、公司债券投资策略,以转换货币型基金的配置。

5. 公开募集的其他投资品种

本基金通过量化模型方法,精选股票进行投资,在充分控制风险的前提下,力争获取超越比较基准的投资回报。

本基金采用量化模型驱动的投资策略为主导投资策略,结合适当的资产配置策略。

1. 大摩多因子策略股票

本基金“量化模型”为主要投资策略,通过基金经理人开发的“大摩多因子策略模型”进行选股并构建股票投资组合。

“大摩多因子策略模型”在实际运行过程中定期或不定期地进行调整,以适应市场变化。

2. 资产配置策略

本基金由公司投资决策委员会统一领导下对货币配置机制、固定收益类资产配置、进行国债、金融债、公司债等固定收益类资产的配置。

本基金采用一定比例固定收益类资产组合,即单利定期存款、收益凭证类理财产品、公司债券投资策略,以转换货币型基金的配置。

Q股投资策略

本基金着重选择具有稳定分红能力,与指数期货交易。本基金参与股指期货投资的决策建立在对证券市场行情进行判断的基础上,以Black-Scholes模型和大数法则为理论基础,对证券市场的分析和对指数期货的定价进行分析,并根据分析结果,适时地增加或减少对股指期货的投资比例。

3. 其他投资策略

(1) 固定收益类资产策略

本基金主要投资于国债、金融债、公司债等固定收益类资产,可转换债券的配置。

本基金采用一定的固定收益类资产组合,即单利定期存款、收益凭证类理财产品、公司债券投资策略,以转换货币型基金的配置。

Q股投资策略

本基金着重选择具有稳定分红能力,与指数期货交易。本基金参与股指期货投资的决策建立在对证券市场行情进行判断的基础上,以Black-Scholes模型和大数法则为理论基础,对证券市场的分析和对指数期货的定价进行分析,并根据分析结果,适时地增加或减少对股指期货的投资比例。

4. 其他投资策略

本基金主要投资于国债、金融债、公司债等固定收益类资产,可转换债券的配置。

本基金采用一定的固定收益类资产组合,即单利定期存款、收益凭证类理财产品、公司债券投资策略,以转换货币型基金的配置。

5. 公开募集的其他投资品种

本基金通过量化模型方法,精选股票进行投资,在充分控制风险的前提下,力争获取超越比较基准的投资回报。

本基金采用量化模型驱动的投资策略为主导投资策略,结合适当的资产配置策略。

1. 大摩多因子策略股票

本基金“量化模型”为主要投资策略,通过基金经理人开发的“大摩多因子策略模型”进行选股并构建股票投资组合。

“大摩多因子策略模型”在实际运行过程中定期或不定期地进行调整,以适应市场变化。

2. 资产配置策略

本基金由公司投资决策委员会统一领导下对货币配置机制、固定收益类资产配置、进行国债、金融债、公司债等固定收益类资产的配置。

本基金采用一定比例固定收益类资产组合,即单利定期存款、收益凭证类理财产品、公司债券投资策略,以转换货币型基金的配置。

Q股投资策略

本基金着重选择具有稳定分红能力,与指数期货交易。本基金参与股指期货投资的决策建立在对证券市场行情进行判断的基础上,以Black-Scholes模型和大数法则为理论基础,对证券市场的分析和对指数期货的定价进行分析,并根据分析结果,适时地增加或减少对股指期货的投资比例。

3. 其他投资策略

(1) 固定收益类资产策略

本基金主要投资于国债、金融债、公司债等固定收益类资产,可转换债券的配置。

本基金采用一定的固定收益类资产组合,即单利定期存款、收益凭证类理财产品、公司债券投资策略,以转换货币型基金的配置。

Q股投资策略

本基金着重选择具有稳定分红能力,与指数期货交易。本基金参与股指期货投资的决策建立在对证券市场行情进行判断的基础上,以Black-Scholes模型和大数法则为理论基础,对证券市场的分析和对指数期货的定价进行分析,并根据分析结果,适时地增加或减少对股指期货的投资比例。

4. 其他投资策略

本基金主要投资于国债、金融债、公司债等固定收益类资产,可转换债券的配置。

本基金采用一定的固定收益类资产组合