摩根士丹利华鑫货币市场基金 2008年半年度报告摘要

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:交通银行股份有限公司
送出日期:2008 年 8 月 26 日

重要提示

基金管理人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。

基金托管人交通银行根据本基金合同规定,于 2008 年 8 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告相关财务资料未经审计。

一、基金简介

(一)基金基本情况

1、基金名称:摩根士丹利华鑫货币市场基金

2、基金简称:摩根士丹利华鑫货币市场基金

3、交易代码:163303

4、基金运作方式:契约型开放式

5、基金合同生效日:2006 年 8 月 17 日

6、报告期末基金份额总额:120,872,267.01 份

7、基金投资目标:

在力争本金安全和保证资产高流动性的前提下,追求高于业绩比较基准的收益率。

8、投资策略:

本基金主要为投资人提供短期现金管理工具,最主要的投资策略是,通过优化以久期为核心的资产配置和品种选择,在保证安全性和流动性的前提下,最大限度地提升基金资产的收益。投资策略分为两个层次:战略资产配置和战术资产配置。

战略资产配置:根据对宏观经济指标、国家财政与货币政策、资金供需、利率期限结构等因素的研究和分析,预测短期市场利率水平,从而确定投资组合的久期和品种配置。

战术资产配置:主要包括对交易市场、投资品种、投资时机、套利的选择与操作,并根据市场环境变化,寻找价值被低估的投资品种和无风险套利机会,努力实现超额收益。

9、业绩比较基准

一年期银行定期储蓄存款的税后利率 =(1– 利息税率)× 一年期银行定期储蓄存款利率。

本基金管理人在合理的市场化利率基准推出的情况下,可根据投资目标、投资方向和投资策略,确定变更业绩比较基准,并提前公告。

10、风险收益特征

本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种,预期风险和预期收益都低于债券基金、混合基金和股票基金。

(二)基金管理人情况

1、基金管理人名称:摩根士丹利华鑫基金管理有限公司

2、信息披露负责人:李锦

3、联系电话:0755 – 82993636

4、传真:0755 – 82990384

5、电子邮箱:xxpl@msfunds.com.cn

(三)基金托管人

1、基金托管人名称:交通银行股份有限公司

2、信息披露负责人:张咏东

3、联系电话:021–68888917

4、传真:021–58408836

5、电子信箱:zhangyd@bankcomm.com

(四)信息披露报刊、网站及置备地点

基金选定的信息披露报纸:《上海证券报》

登载半年度报告正文的基金管理人互联网网址:http://www.msfunds.com.cn

基金半年度报告置备地点:基金管理人与基金托管人处

(五)注册登记机构情况

1、名称:中国证券登记结算有限责任公司

2、办公地址:北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

二、主要财务指标和基金净值表现

(一)主要财务指标(未经审计)

单位:人民币元

序号	本报告期主要财务指标	2008年1月1日至2008年6月30日
1	本期利润	2,000,508.81
2	加权平均基金份额本期利润	0.0127
3	期末基金资产净值	120,872,267.01
4	期末基金份额净值	1.0000
5	本期基金份额净值增长率	1.2813%
6	基金份额累计净值增长率	6.2024%

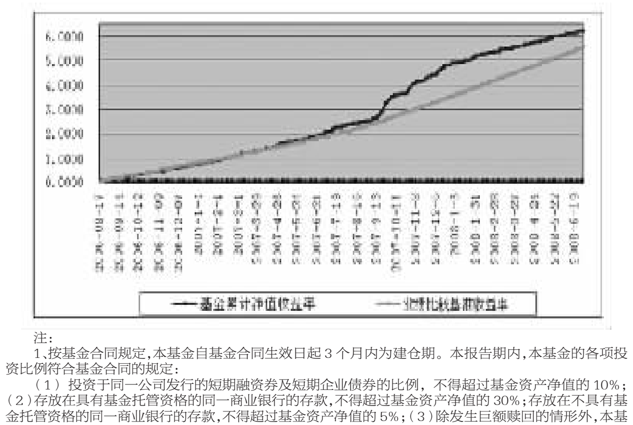
注:本基金收益分配是按月结转份额。

(二)基金净值表现

1、本报告期收益率与同期业绩比较基准收益率比较

阶段	基金净值收益率①	基金净值收益率标准差②	比较基准收益率③	比较基准收益率标准差④	①–③	②–④
过去一个月	0.1866%	0.0006%	0.3233%	0.0000%	–0.1367%	0.0006%
过去三个月	0.6204%	0.0037%	0.9806%	0.0000%	–0.3602%	0.0037%
过去六个月	1.2813%	0.0043%	1.9611%	0.0000%	–0.6798%	0.0043%
过去一年	4.1348%	0.0113%	3.6588%	0.0012%	0.4760%	0.0101%
自基金合同生效起至今	6.2024%	0.0089%	5.5016%	0.0023%	0.7008%	0.0066%

2、自基金合同生效以来基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比



注:

1、按基金合同规定,本基金自基金合同生效日起 3 个月内为建仓期。本报告期内,本基金的各项投资比例符合基金合同的规定:

(1)投资于同一公司发行的短期融资券及短期企业债券的比例, 不得超过基金资产净值的 10%;(2)存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的 30%;存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的 5%;(3)除发生巨额赎回的情形外,本基金的投资组合中,债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%;(4)本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和,不超过该证券的 10%;(5)本基金投资组合在每个交易日的平均剩余期限不得超过 180 天;(6) 本基金持有的剩余期限不超过 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券摊余成本总计不得超过当日基金资产净值的 20%; 本基金不得投资于以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券;(7)买断式回购融入基本债券的剩余期限不得超过 397 天;(8)本基金投资于银行定期存款的比例,不得超过基金资产净值的 30%;(9)法律法规或监管部门规定的其他投资比例限制。

由于基金规模或市场的变化导致的投资组合超过上述约定的比例不在限制之内,但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整,以达到标准。因发生巨额赎回致使本基金债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的,基金管理人应当在 5 个交易日内进行调整。

2、本基金基金合同生效日为 2006 年 8 月 17 日。

三、基金管理人报告

(一)基金管理人及基金经理简介

1、基金管理人简介

摩根士丹利华鑫基金管理有限公司是一家中外合资基金管理公司,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。基金管理人旗下共管理三只开放式基金,即本基金和摩根士丹利华鑫资源优选混合型证券投资基金(LOF),摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金。本基金是基金管理人管理的第三只基金。

2、基金经理简介

孙健先生,经济学硕士,八年证券从业经验。曾先后任湘财证券资产管理总部债券投资经理、太平人寿保险有限公司投资部投资经理、太平资产管理有限公司投资部投资经理。2006 年 6 月起就职于本公司,曾任本基金基金经理助理;2007 年 1 月起任本基金基金经理,现任本公司投资管理部总监助理。

本基金前任基金经理:冀洪涛先生,任职时间自本基金合同生效起至 2007 年 1 月。

(二)基金运作合法合规性声明

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》及相关法律法规、《摩根士丹利华鑫货币市场基金基金合同》的规定,以为基金份额持有人谋求长期、稳定的投资回报为目标,管理和运用基金资产,没有损害基金份额持有人利益的行为。

基金管理人依据中国证监会 2008 年 3 月 20 日颁布《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求,对投资、研究、交易等相关业务制度进行检视梳理,并加强对相关环节的行为监控及分析评估。

基金管理人建立了以投资决策委员会领导下的基金经理负责制的投资决策及授权制度。在投资研究过程中,坚持价值投资分析方法,强调以数据及事实为研究基础,降低主观估计给研究报告带来的影响,并以此建立了投资对象备选库、投资交易对手库,通过制度明确备选库、对手库的更新维护机制。同时基金管理人还建立了一系列交易管理制度以及内控实施细则,以确保在投资过程中的可能导致不公平交易行为以及其它各种异常交易行为得到有效监控及防范。基金管理人还将进一步建立异常交易监控及评估细则以确保监控评估得以有效实施。

基金管理人依据指导意见要求,对本报告期内本基金交易情况进行了分析。本基金为货币型基金,基金管理人旗下尚无与其投资风格相似的基金。未发现本基金在报告期内出现异常交易行为。

(三)基金经理工作报告及展望

1、经济增长放缓,宏观经济回落

2008 年中国宏观经济的内外环境发生了较为明显的变化, 一是美国次贷危机引发全球经济增长放缓,外需减缓;二是从紧的宏观调控政策和成本上升压力使国内出口、投资增速逐步回落,自然灾害也给经济运行带来一定负面影响。上半年 GDP 同比增长 10.4%,从去年宏观经济的景气周期顶点出现趋势性下滑,其中出口和投资增速为 21.9%和 25%,下滑趋势明显,消费的名义增速虽然延续了快速增长态势,但扣除物价因素实际表现平稳。展望下半年,在全球经济减速的大背景下,由于中国对外贸易的依存度超过了 65%,全球一体化使中国很难独善其身。在通胀和信贷危机的压力下,全球经济将继续调整,这将加剧中国出口的下滑趋势;宏观调控的持续从紧、信贷管制、企业利润的压缩将使得投资也难以成为经济增长的亮点。在外部环境恶化和国内宏观调控的双重压力下,宏观经济存在继续回落的风险,世界经济的周期性调整将成为引导中国宏观经济波动的核心因素之一,全球经济下滑和通胀将使中国在中期阶段面临外部环境持续恶化的挑战。

2、通胀暂时回落难改趋势性高位运行

上半年 CPI、PPI 分别同比上涨 7.9%和 7.6%,增速比去年上升 3.1%和 4.46%。2008 年下半年,决定通胀走势的三大主要力量即要素价格回归、外部通胀压力输入与需求因素将向纵深发展,尽管食品价格季节性的回落和翘尾因素下降有望缓解 CPI 上涨的压力,但是数据放缓的背后,通胀更深层次的决定因素依然在积累力量。本轮通胀是经济运行深层次问题的集中体现,首先是粗放式高速增长模式所积累的矛盾的爆发,这其实是中国经济转型与市场化改革深化所必经的历史阶段,再则是在全球通胀背景下,中国在全球经济一体化过程中难以独善其身的现实反映。因此,尽管通胀走势存在短期缓解的可能,但在深层次问题没有有效解决之前,通胀不可能出现趋势性回落。在通胀三大推动力的作用下下半年通胀走势具有相当的不确定性,潜在通胀压力依然很大。

3、宏观调控效果显现,货币信贷增长放缓

上半年贷款新增 24525 亿元,同比减少 899 亿元,信贷余额同比增速较 2007 年有明显回落,显示在央行加强信贷控制力度下调控政策效果显现。货币供应的减缓,意味着经济活动的萎缩和企业经营的收缩。从货币层面看,货币供应指标的回落将有利于通胀的下行,一旦放松货币政策,则通胀反弹压力增大。鉴于抗通胀是央行的首要任务,下半年货币信贷放松的可能性较小。外汇方面,热钱在人民币升值预期下加快流入,并很可能将对我国流动性管理造成更大困难,而央行也将继续采用数量化工具回收流动。

4、政策预期

虽然宏观调控、外需放缓对我国的经济增长造成一定的影响,出口和投资增速有所放缓,但是通胀仍然是中国经济的主要风险,预计未来国家将继续保持从紧的货币政策以防通胀,通过适当调整财政政策保持经济增长。

(1)数量调控将持续,流动性管理不放松

热钱流入导致的基础货币大量投放是央行选择数量调控的主要原因,未来一段时间来看,美国经济依然十分疲软,中国经济相对来讲具有明显的吸引力,下半年热钱仍可能继续大量流入,为了达到 M2 预期增速为 16%的调控目标,央行将继续采用数量型的调控手段回收流动性,存款准备金率还有 2%的上调空间。

(2)通胀打开加息空间,但幅度有限

对于高企的 CPI,负利率状态持续时间越长,未来通胀持续扩散的可能性越大。在全球经济增长不确定性增加的情况下,工业增加值增速逐步放缓,再次加息使经济出现硬着陆的风险加大,因此央行在权衡利弊之间对加息保持谨慎。但是如果未来美国为抑制通胀而采取加息政策,并且国内通胀继续居高不下,那国内在负利率的状况下加息的概率就会大大上升。预计年内结构性加息的可能性较大。

(3)汇率升值有望放缓,套利资金流入压力减缓

上半年人民币汇率升值超过 6%,在经历快速升值后,出口增速已经出现明显下滑,外向型企业承受压力日渐增强,在渐进升值的原则下,下半年升值节奏将有所放缓,汇率双向波动的弹性将增大。

(4)财政政策

经济增长放缓和通胀上升是宏观经济面临的突出问题,单纯的货币政策难以解决经济中的多层次问题,财政政策的使用将在未来发挥更大作用。一方面将通过财政支付转移保障部分群体收入增长,起到结构优化作用,另一方面将配合紧缩货币的政策,保持经济和通胀的平衡治理。

5、投资回顾及策略

上半年本基金净值增长率为 1.2813%,收益率属于偏低水平,主要原因是今年以来基于国际和国内不稳定的宏观经济状况和高通货膨胀预期,本基金制定的全年投资策略是以缩短久期,回避风险为主,组合平均剩余期限第一季度末为 58 天,第二季度末为 43 天,持仓组合保持了充裕的现金和回购资产,为避免因基金规模缩减所产生的流动性风险起到了积极作用;另一方面,因为股市大幅度下跌带来新股发行申购热情剧减,回购收益率较去年出现较大幅度下降,导致保留大量现金资产回避流动性风险的组合收益率随之下降。上半年,本基金在控制低久期的大策略下对投资组合进行了微调,减少了短期融资券和金融债,增加了 3 月期的短期央行票据,虽然上半年市场利率并未出现我们预计的大幅度上涨,但是引导利率上升的因素仍然存在。

展望下半年,国际金融经济形势动荡给国内经济和金融走向带来更多的不确定性,在市场风险未释放或前景未出现转机之前,保持谨慎的策略预防市场出现剧烈波动,牺牲局部收益率保证基金的安全和流动性,是在目前时局下本基金将坚定贯彻的原则。

四、基金托管人报告

2008 年上半年度,托管人在摩根士丹利华鑫货币市场基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

2008 年上半年度, 摩根士丹利华鑫基金管理有限公司在摩根士丹利华鑫货币市场基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。根据《关于货币市场基金投资等相关问题的通知》的规定,托管人发现基金在个别工作日存在以下情况:“基金债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%”。对于上述情况,托管人对基金管理人进行了提示,基金管理人根据规定进行了调整。

2008 年上半年度, 由摩根士丹利华鑫基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关摩根士丹利华鑫货币市场基金的半年度报告中财务指标、收益表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

五、基金半年度财务会计报告(未经审计)

(一)基金会计报表

1、摩根士丹利华鑫货币市场基金资产负债表

单位:人民币元

	附注	2008年6月30日	2007年12月31日
资产			
银行存款		1,126,845.00	1,151,414.12
结算备付金		20,475,794.98	14,882,045.93
交易性金融资产		74,630,848.87	128,134,958.35
其中:债券投资		74,630,848.87	128,134,958.35
买入返售金融资产		25,000,062.50	260,801,996.20
应收利息		42,519.23	393,725.68
应收申购款		189,041.48	–
资产总计		121,465,112.06	405,364,140.28
负债和所有者权益			
负债			
应付赎回款		356,413.98	9,914,051.03
应付管理人报酬		31,116.98	85,606.76
应付托管费		9,429.35	25,941.46
应付销售服务费		23,573.44	64,853.59
应付交易费用		2,061.80	4,796.20
应付利润		92,810.95	374,090.27
其他负债		77,438.55	53,784.01
负债合计		592,845.05	10,523,123.32
所有者权益			
实收基金		120,872,267.01	394,841,016.96
负债和所有者权益总计		121,465,112.06	405,364,140.28
基金份额总额(份)		120,872,267.01	394,841,016.96
基金份额净值		1.0000	1.0000

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

2、摩根士丹利华鑫货币市场基金利润表

单位:人民币元

	附注	2008年1月1日至 2008年6月30日	2007年1月1日至 2007年6月30日
收入			
利息收入		2,661,665.96	2,583,806.97
其中:存款利息收入		256,413.13	170,971.27
债券利息收入		1,208,822.68	1,601,561.81
买入返售金融资产收入		1,196,430.15	811,273.89
投资收益 /(损失)		35,111.55	50,095.96
其中:债券投资收益 /(损失)		35,111.55	50,095.96
其他收入		–	–
收入合计		2,696,777.51	2,633,902.93
费用			
管理人报酬		(270,998.90)	(255,259.30)
托管费		(82,120.82)	(77,351.23)
销售服务费		(205,302.14)	(193,378.29)
利息支出		(56,069.65)	(104,366.69)
其中:卖出回购金融资产支出		(56,069.65)	(104,366.69)
其他费用		(81,777.19)	(87,970.13)
费用合计		(696,268.70)	(718,325.64)
利润总额		2,000,508.81	1,915,577.29

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

3、摩根士丹利华鑫货币市场基金所有者权益(基金净值)表

单位:人民币元

	2008年1月1日至2008年6月30日止		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
期初所有者权益(基金净值)	394,841,016.96	–	394,841,016.96
本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	–	2,000,508.81	2,000,508.81
本期基金份额交易产生的基金净值变动数	(273,968,749.95)	–	(273,968,749.95)
其中:基金申购款	439,669,261.65	–	439,669,261.65
基金赎回款	(713,638,011.60)	–	(713,638,011.60)
本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数	–	(2,000,508.81)	(2,000,508.81)
期末所有者权益(基金净值)	120,872,267.01	–	120,872,267.01
	2007年1月1日至2007年6月30日止		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
期初所有者权益(基金净值)	214,077,842.58	–	214,077,842.58
本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	–	1,915,577.29	1,915,577.29
本期基金份额交易产生的基金净值变动数	(88,346,322.70)	–	(88,346,322.70)
其中:基金申购款	252,577,971.13	–	252,577,971.13
基金赎回款	(340,924,293.83)	–	(340,924,293.83)
本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数	–	(1,915,577.29)	(1,915,577.29)
期末所有者权益(基金净值)	125,731,519.88	–	125,731,519.88

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

(二)基金会计报表附注(除特别表明外金额单位为人民币元)

1、基金基本情况

摩根士丹利华鑫货币市场基金(原巨田货币市场基金)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[2006]第 120 号《关于同意巨田货币市场基金募集的批复》核准,由摩根士丹利华鑫基金管理有限公司(原巨田基金管理有限公司)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和本基金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。本基金首次设立募集期为 2006 年 8 月 1 日至 2006 年 8 月 11 日,不包括认购资金利息共募集 1,331,917,312.48 元,业经德勤华永会计师事务所有限公司德师(上海)报验字(06)第 SZ003 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,本基金基金合同于 2006 年 8 月 17 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,332,065,230.28 份基金份额,其中认购资金利息折合 147,917.80 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,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《货币市场基金管理暂行规定》和本基金基金合同的有关规定,本基金的投资范围为:现金;一年以内的银行定期存款、大额存单;剩余期限在 397 天以内的债券;期限在一年以内的债券回购;期限在一年以内的中央银行票据以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

2、会计报表编制基础

本基金原以 2006 年 2 月 15 日以前颁布的企业会计准则、《金融企业会计制度》和《证券投资基金会计核算办法》(以下合称“原会计准则和制度”)、《摩根士丹利华鑫货币市场基金基金合同》以及中国证监会允许的基金行业实务操作的规定编制财务报表。自 2007 年 7 月 1 日起,本基金开始执行财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的企业会计准则(以下简称“企业会计准则”)和中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》。

在编制本报告期财务报表时, 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日止期间的相关数字已按照《企业会计准则第 38 号—首次执行企业会计准则》的要求进行追溯调整,所有项目已按照企业会计准则和《证券投资基金会计核算业务指引》重新列报。追溯调整涉及的主要内容为将所持有的债券投资划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。鉴于货币市场基金的运作特性,本基金持有的债券投资继续采用摊余成本法计价,并通过“影子定价”机制确保债券投资的账面价值近似反映其公允价值。

上述追溯调整未对 2007 年 6 月 30 日的所有者权益, 以及 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日止期间的净损益产生需要调节的影响。

3、遵循企业会计准则的声明

本基金本报告期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 2008 年 6 月 30 日的财务状况以及 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

4、主要会计政策和会计估计

(a)会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日。比较财务报表的实际编制期间为 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日。

(b)记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

(c)金融资产和金融负债的分类及抵销

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前持有的债券投资划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,其他金融资产划分为贷款和应收款项,暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示。

金融负债于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。除衍生工具所产生的金融负债外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融负债在资产负债表中以交易性金融负债列示。衍生工具所产生的金融负债在资产负债表中以衍生金融负债列示。

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表列示。

(d)基金资产的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。存在活跃市场的金融资产或金融负债以活跃市场中的报价确定公允价值。不存在活跃市场的金融资产或金融负债采用估值技术确定公允价值。采用估值技术得出的结果反映估值日在公平交易中可能采用的交易价格。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。本基金以上述原则确定的公允价值进行基金资产估值,主要资产的估值方法如下:

本基金的债券投资采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率每日计提应收利息,并于 2007 年 7 月 1 日前按直线法、2007 年 7 月 1 日起按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价。

为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按上述公允价值估值原则计算的基金资产净值发生重大偏离,从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果,基金管理人于每一计价日采用上述公允价值估值原则计算影子价格。当基金资产净值与影子价格的偏离达到或超过基金资产净值的 0.25% 时,基金管理人应根据风险控制的需要调整组合,使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。

如有确凿证据表明按上述方法进行计价不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的方法计价。

(e)证券投资基金成本计价方法

(i)以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 – 债券投资

2007 年 7 月 1 日之前,买入银行间同业市场交易的债券于实际支付价款时确认为债券投资。债券投资成本按交易日应支付的全部价款并扣除债券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)后的金额确认。

自 2007 年 7 月 1 日起,买入银行间同业市场交易的债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本按交易日债券的公允价值确认,上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)。

2007 年 7 月 1 日之前,卖出银行间同业市场交易的债券于实际支付价款时确认债券投资收益 /(损失);自 2007 年 7 月 1 日起,卖出银行间同业市场交易的债券于交易日确认债券投资收益 /(损失)。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

(ii)贷款和应收款项

2007 年 7 月 1 日之前,贷款和应收款项按实际支付或应收取的金额入账,并采用名义利率法确认相关的利息收入,其中买入返售金融资产以协议融出资金额作为入账金额;自 2007 年 7 月 1 日起,贷款和应收款项以公允价值作为初始确认金额,采用实际利率法以摊余成本进行后续计量,终止确认或摊销时的收入或支出计入当期损益,直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法,其中买入返售金融资产以融出资金应付或实际支付的总额作为初始确认金额。

(iii)其他金融负债

2007 年 7 月 1 日之前,其他金融负债按实际收取或应支付的金额入账,并采用名义利率法确认负债相关的利息支出,其中卖出回购金融资产款以协议融入资金额作为入账金额;自 2007 年 7 月 1 日起,其他金融负债以公允价值作为初始确认金额,采用实际利率法以摊余成本进行后续计量,终止确认或摊销时的收入或支出计入当期损益,直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法,其中卖出回购金融资产款以融入资金应收或实际收到的总额作为初始确认金额。

(f)收入 /(损失)的确认和计量

债券投资收益 /(损失)按卖出债券成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

债券利息收入按摊余成本和实际利率计算确定的金额扣除适用情况下应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额,在债券实际持有期内逐日确认。

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

2007 年 7 月 1 日之前, 买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额在回购期内按直线法逐日确认;自 2007 年 7 月 1 日起,买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额在回购期内按实际利率法逐日确认,直线法与实际利率法确定的收入差异较小的,可采用直线法。

(g)费用的确认和计量

本基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.33%的年费率逐日计提。

本基金的托管费按前一日基金资产净值 0.1%的年费率逐日计提。

本基金的基金销售服务费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率逐日计提。

2007 年 7 月 1 日之前, 卖出回购金融资产支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额在回购期内以直线法逐日确认;自 2007 年 7 月 1 日起,卖出回购金融资产支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额在回购期内以实际利率法逐日确认,直线法与实际利率法确定的支出差异较小的,可采用直线法。

(h)实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

(i)基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。申购的基金份额享有确认当日的分红权益,而赎回的基金份额不享有确认当日的分红权益。本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式,每日计算当日收益并全部结转至应付利润科目,每月以红利再投资方式集中支付累计收益。基金投资当期亏损时,采用等比例调减基金份额持有人持有份额的方式,将基金份额净值维持在份额面值 1.00 元。

5、主要税项

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》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。

6、本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7、重大关联方关系及关联交易

(a)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(“摩根士丹利华鑫基金”)基金管理人、基金销售机构

交通银行股份有限公司(“交通银行”)基金托管人、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

华鑫证券有限责任公司(“华鑫证券”)基金管理人的股东

汉唐证券有限责任公司(“汉唐证券”)基金管理人的股东

深圳招融投资控股有限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

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(b)通过关联方席位进行的证券交易及交易佣金

本基金在本会计期间未通过关联方席位进行交易所交易。

(c)基金管理人报酬

支付基金管理人摩根士丹利华鑫基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.33%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 X0.33%/ 当年天数。

本基金在本会计期间需支付管理人报酬 270,998.90 元(上年同期:255,259.30 元)。

(d)基金托管费

支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1%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 X0.1%/ 当年天数。

本基金在本会计期间需支付托管费 82,120.82 元(上年同期:77,351.23 元)。

(e)基金销售服务费

支付基金销售机构的基金销售服务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,按月支付给摩根士丹利华鑫基金,再由摩根士丹利华鑫基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:

日基金销售服务费 = 前一日基金资产净值 X0.25%/ 当年天数。

本基金在本会计期间需向关联方支付的基金销售服务费如下:

关联方名称	2008年1月1日至2008年6月30日止期间
摩根士丹利华鑫基金	79,770.35
交通银行	77,957.28
华鑫证券	0.90
合计	157,728.53

(f)由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管,按银行同业利率计息。基金托管人于 2008 年 6 月 30 日保管的银行存款余额为 1,126,845.00 元(2007 年 6 月 30 日:717,227.76 元)。本会计期间由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 7,783.93 元(上年同期 15,582.23 元)。

本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司,按银行同业利率计息。于 2008 年 6 月 30 日的相关余额 20,475,794.98 元计入“结算备付金”科目(2007 年 6 月 30 日:22,736,694.63 元)。

(g)与关联方通过银行间同业市场进行的债券及回购交易

本基金在本会计期间未与基金托管人交通银行通过银行间同业市场进行的债券及回购交易。

(h)关联方持有的基金份额

	2008年6月30日			2007年6月30日		
	基金份额	净值	占基金总份额的比例	基金份额	净值	占基金总份额的比例
摩根士丹利华鑫基金	10,409,785.90	10,409,785.90	8.61%	10,000,000.00	10,000,000.00	7.95%

基金管理人摩根士丹利华鑫基金在 2007 年 6 月 27 日运用固有资金 10,000,000.00 元经代销机构购入本基金 10,000,000.00 份基金份额,至 2007 年 6 月 30 日,本基金管理人持有本基金的份额未发生变动。

截至 2008 年 6 月 30 日, 本基金管理人持有本基金的份额比上年同期增加 409,785.90 份基金份额,均为本基金分配收益以红利再投资方式转入的基金份额。

其他关联方本报告期和上年同期均未持有本基金份额。

8、流通受限制不能自由转让的基金资产

截至 2008 年 6 月 30 日止,本基金未持有流通受限制不能自由转让的债券。

9、风险管理

(a) 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险,并设定适当的风险限额及内部控制流程,通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设,在董事会下设立风险控制委员会,负责制定风险管理的内部政策,审议通过风险控制的总体措施等;在管理层层面设立风险管理委员会,讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施;在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责,协调并与各部门合作完成运作风险管理。监察稽核部对公司总经理负责,并由督察长分管。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的,由风险控制委员会、督察长、风险管理委员会、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

(b) 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,导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券,且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券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发行的证券,不得超过该证券的 10%。

本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估,以控制相应的信用风险。

(c) 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 180 天。本基金能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求,还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,正回购上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值且正回购余额在每个交易日均不超过基金资产净值的 20%。本基金所持有的金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息,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。

本基金的基金管理人每日预测本基金的流动性需求,并在相关部门间建立起充分的沟通机制,对流动性指标进行持续的监测和分析。

(d) 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,包括市场价格风险、利率风险和外汇风险。

(i) 市场价格风险

市场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。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种,且以摊余成本计价,因此无重大市场价格风险。

(ii) 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。除买入返售金融资产,本基金主要投资于银行间市场交易的固定收益品种,以摊余成本计价,并通过“影子定价”机制使按摊余成本确认的基金资产净值能近似反映基金资产的公允价值,因此本基金的运作仍然存在相应的利率风险。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感度缺口进行监控。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值,其中交易性债券投资以摊余成本近似反映其公允价值,并按合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

2008年6月30日	6个月以内	6个月至1年	1至5年	不计息	合计
资产					
银行存款	1,126,845.00	–	–	–	1,126,845.00
结算备付金	20,475,794.98	–	–	–	20,475,794.98
交易性金融资产	74,630,848.87	–	–	–	74,630,848.87
买入返售金融资产	25,000,062.50	–	–	–	25,000,062.50
应收利息	–	–	–	42,519.23	42,519.23
应收申购款				189,041.48	189,041.48
资产总计	121,233,551.35	–	–	231,560.71	121,465,112.06
负债					
应付赎回款	–	–	–	356,413.98	356,413.98
应付管理人报酬	–	–	–	31,116.98	31,116.98
应付托管费	–	–	–	9,429.35	9,429.35
应付销售服务费	–	–	–	23,573.44	23,573.44
应付交易费用	–	–	–	2,061.80	2,061.80
应付利润	–	–	–	92,810.95	92,810.95
其他负债	–	–	–	77,438.55	77,438.55
负债总计	–	–	–	592,845.05	592,845.05
利率敏感度缺口	121,233,551.35	–	–	(361,284.34)	120,872,267.01
2007年12月31日	6个月以内	6个月至1年	1至5年	不计息	合计
资产					
银行存款	1,151,414.12	–	–	–	1,151,414.12
结算备付金	14,882,045.93	–	–	–	14,882,045.93
交易性金融资产	79,150,348.15	48,984,610.20	–	–	128,134,958.35
买入返售金融资产	260,801,996.20	–	–	–	260,801,996.20
应收利息	–	–	–	393,725.68	393,725.68
资产总计	355,985,804.40	48,984,610.20	–	393,725.68	405,364,140.28
负债					
应付赎回款	–	–	–	9,914,051.03	9,914,051.03
应付管理人报酬	–	–	–	85,606.76	85,606.76
应付托管费	–	–	–	25,941.46	25,941.46
应付销售服务费	–	–	–	64,853.59	64,853.59
应付交易费用	–	–	–	4,796.20	4,796.20
应付利润	–	–	–	374,090.27	374,090.27
其他负债	–	–	–	53,784.01	53,784.01
负债总计	–	–	–	10,523,123.32	10,523,123.32
利率敏感度缺口	355,985,804.40	48,984,610.20	–	(10,129,397.64)	394,841,016.96

于 2008 年 6 月 30 日,若市场利率下降 25 个基点且其他市场变量保持不变,本基金资产净值将相应增加约 10 万元(2007 年 12 月 31 日:25 万元);反之,若市场利率上升 25 个基点且其他市场变量保持不变,本基金资产净值则将相应下降约 10 万元(2007 年 12 月 31 日:25 万元)。

(iii) 外汇风险

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。

六、投资组合报告

(一)报告期末基金资产组合情况

资产组合	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
债券投资	74,630,848.87	61.44
买入返售证券	25,000,062.50	20.58
其中:买断式回购的买入返售证券	–	–
银行存款和清算备付金合计	21,602,639.98	17.79
其他资产	231,560.71	0.19
合计	121,465,112.06	100.00

(二)报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比(%)
1	报告期内债券回购融资余额	516,196,075.50	1.89%
	其中:买断式回购融资	–	–
2	报告期末债券回购融资余额	–	–
	其中:买断式回购融资	–	–

报告期内本基金债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的情况:

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值的比例(%)	原因	调整期
1	2008–01–09	20.80%	大额赎回造成被动超标	1个交易日

(三)基金投资组合平均剩余期限情况

1、投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	43
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	71
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	14

报告期内不存在投资组合平均剩余期限违规超过 180 天的情况。

2、期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	38.56%	–
2	30天(含)—60 天	8.23%	–
3	60天(含)—90 天	53.51%	–
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	12.41%	–
4	90天(含)—180 天	–	–
5	180天(含)—397 天(含)	–	–
合计		100.30%	–

(四)报告期末债券投资组合

1、按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	–	–
2	金融债券	14,996,428.72	12.41
	其中:政策性金融债	14,996,428.72	12.41
3	央行票据	59,634,420.15	49.34
4	企业债券	–	–
5	其他	–	–
合计		74,630,848.87	61.74
剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券		14,996,428.72	12.41

2、基金投资前十名债券明细

序号	债券名称	债券数量(张)		成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
		自有投资	买断式回购		
1	07央票 94	200,000		19,890,720.09	16.46
2	05农发 06	150,000		14,996,428.72	12.41
3	08央票 60	100,000		9,952,013.56	8.23
4	08央票 63	100,000		9,945,571.48	8.23
5	08央票 72	100,000		9,926,270.22	8.21
6	08央票 75	100,000		9,919,844.80	8.21

(五)“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25%(含)–0.5%间的次数	–
报告期内偏离度的最高值	0.003%
报告期内偏离度的最低值	–0.164%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.077%

(六)投资组合报告附注

1、基金计价方法说明:本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内平均摊销,每日计提损益。在有关法律法规允许交易所短期债券可以采用摊余成本法估值前,本基金暂不投资于交易所短期债券。

2、本报告期内不存在剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的 20%的情况。

3、本报告期内需说明的证券投资决策程序

本报告期内,本基金严格按照基金合同和招募说明书的规定进行投资决策,所投资品种无超出基金合同规定范围的情形,没有需要特别说明和补充的内容。本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的,在报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

4、其他资产的构成

序号	其他资产	金额(元)
1	应收利息	42,519.23
2	应收申购款	189,041.48
合计		231,560.71

5、本基金本报告期内未投资资产支持证券。

七、基金份额持有人户数、持有人结构

(一)报告期末基金份额持有人户数

基金份额持有人户数(户)	3,524
平均每户持有基金份额(份)	34,299.74

(二)报告期末基金份额持有人结构

投资者类型	持有份额(份)	占总份额的比例
机构投资者	75,184,672.20	62.20%
个人投资者	45,687,594.81	37.80%
合计	120,872,267.01	100%

(三)报告期末基金管理公司从业人员投资本基金的情况

项目	期末持有本开放式基金份额的总量(份)	占本基金总份额的比例
基金管理公司持有本基金的所有从业人员	165,871.84	0.14%

八、开放式基金份额变动

本报告期期初基金份额总额	394,841,016.96 份
本报告期基金总申购份额	439,669,261.65 份
本报告期基金总赎回份额	713,638,011.60 份
本报告期期末基金份额总额	120,872,267.01 份

九、重大事件揭示

(一)基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

(二)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

经基金管理人股东会审议通过,选举 Blair Chilton Pickerell, Michael Benjamin Kollins,Carlos Alfonso Oyarbide Seco,王文学,洪家新,宋斌,洪小源,许明出任非独立董事,苗复春,宋文琪,李相启,Andrew Gordon Williamson 出任独立董事。

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。

(三)基金管理人关于公司名称、基金名称变更

经公司股东会审议通过,并报经中国证监会(证监许可[2008]519 号)、中华人民共和国商务部(商外资资审字[2008]0120 号)批准,公司相关股东完成股权转让,公司名称由“巨田基金管理有限公司”变更为“摩根士丹利华鑫基金管理有限公司”。股权变更后公司股东为摩根士丹利国际控股公司、华鑫证券有限责任公司、汉唐证券有限责任公司、深圳市招融投资控股有限公司、深圳市中技实业(集团)有限公司。公司已于 2008 年 6 月 12 日办理完毕股东出资转让、公司更名的工商变更登记相关手续。公司注册及办公地址不变。

经公司董事会审议通过、经基金托管人同意,并报请中国证监会同意,基金管理人从 2008 年 6 月 16 日起对旗下三只开放式基金更名:

1、原“巨田基础行业证券投资基金”更名为“摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金”,简称为“摩根士丹利华鑫基础行业基金”;深交所净值揭示简称为“大摩基础”,代码保持不变,仍为 163301。

2、原“巨田资源优选混合型证券投资基金(LOF)”更名为“摩根士丹利华鑫资源优选混合型证券投资基金(LOF)”,简称为“摩根士丹利华鑫资源优选基金”;深交所净值揭示简称为“大摩资源”,代码保持不变,仍为 163302。

3、原“巨田货币市场基金”更名为“摩根士丹利华鑫货币市场基金”,简称为“摩根士丹利华鑫货币市场基金”。

上述变更之相关公告刊登于 2008 年 6 月 16 日的 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及公司网站。

(四)涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内没有涉及到基金管理人、基金托管人和基金财产的诉讼。

(五)基金投资策略的改变

报告期内本基金未改变投资策略。

(六)基金收益分配事项

本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式,每日计算当日收益并全部分配,每月以红利再投资方式集中支付累计收益,即按份额面值 1.00 元转为基金份额(本基金收益分配是按月结转份额)。本基金本报告期累计分配收益 2,000,508.81 元。

(七)基金改聘为其审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

(八)基金管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情形

报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员没有受监管部门稽查或处罚。

(九)基金租用证券公司专用交易单元的有关情况

1、债券及回购交易情况(2008 年 1 月 1 日 – 6 月 30 日)

券商名称	席位数量	债券回购成交量	占总成交量比例
招商证券	1	1,414,600,000.00	100%
合计	1	1,414,600,000.00	100%

2、席位的变更情况

本基金在本报告期内新增 1 家证券公司的 1 个交易单元:安信证券(1 个上海交易单元)。

(十)报告期内发生的其他重要事项

序号	其他重要事项	信息披露报刊	披露时间
1	基金恢复申购及转入业务的公告	《上海证券报》	2008年1月7日
2	基金增加安信证券为代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2008年1月23日
3	基金春节长假前暂停申购及转入业务的公告	《上海证券报》	2008年1月30日
4	基金增加光大银行为代销机构的公告	《上海证券报》	2008年2月26日
5	基金增加联合证券为代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》	2008年2月29日
6	基金通过银河证券开办基金定投业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2008年3月13日
7	基金通过光大银行开办基金定投业务的公告	《上海证券报》	2008年4月1日
8	基金增加华鑫证券为代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》	2008年4月29日
9	基金增加中信万通证券为代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》	2008年5月21日
10	公司关于开展地震灾区持有人专项服务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2008年6月2日
11	基金通过中信建投证券开办基金定投业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2008年6月3日
12	公司关于股东出资转让、公司、基金更名及董事变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2008年6月16日
13	基金增加万联证券为代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》	2008年6月18日
14	基金增加国元证券为代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》	2008年6月27日

摩根士丹利华鑫基金管理有限公司
二〇〇八年八月二十六日