

# 摩根士丹利华鑫新机遇灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)摘要 (2016 年第 1 号)

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：中国民生银行股份有限公司

## 【重要提示】

摩根士丹利华鑫新机遇灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2015 年 5 月 11 日经中国证券监督管理委员会证监许可【2015】884 号文准予注册募集。本基金的基金合同于 2015 年 6 月 24 日正式生效。本基金为契约型开放式基金。

投资有风险，投资人投资于本基金时应认真阅读招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为 2016 年 6 月 24 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2016 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。

## 目 录

- 一、基金管理人 3
- 二、基金托管人 7
- 三、相关服务机构 11
- 四、基金的名称 24
- 五、基金的运作方式与类型 24
- 六、基金的投资目标 25
- 七、基金的投资方向 25
- 八、基金的投资策略 25
- 九、基金的业绩比较基准 27

- 十、基金的风险收益特征 28
- 十一、基金的投资组合报告 28
- 十二、基金的业绩 31
- 十三、基金的费用与税收 33
- 十四、对招募说明书更新部分的说明 36

## 一、基金管理人

### （一）基金管理人概况

名称：摩根士丹利华鑫基金管理有限公司

住所：深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第二座第17层01-04室

办公地址：深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第二座第17层

法定代表人：YU HUA（于华）

成立日期：2003年3月14日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2003]33号

注册资本：22,750万元人民币

联系人：赵婧

联系电话：（0755）88318883

股权结构应为：

华鑫证券有限责任公司（39.560%）、摩根士丹利国际控股公司（37.363%）、深圳市招融投资控股有限公司（10.989%）、汉唐证券有限责任公司（6.593%）、深圳市中技实业（集团）有限公司（5.495%）。

### （二）主要人员情况

#### 1. 董事会成员

于华先生，北京大学经济学学士，鲁汶大学工商管理硕士、金融博士，美国注册金融分析师（CFA）。曾任深圳证券交易所综合研究所所长，加拿大鲍尔集团亚太分公司基金与保险业务副总裁，加拿大伦敦人寿保险公司北京代表处首席代表，大成基金管理有限公司董事、总经理，摩根士丹利亚洲有限公司董事总经理、中国投资管理业务主管，摩根士丹利华鑫基金管理有限公司总经理。现任本公司董事长。

俞洋先生，澳门科技大学工商管理硕士，上海财经大学工商管理硕士。曾任常州

市证券公司延陵东路营业部总经理、巨田证券有限责任公司无锡营业部总经理、华鑫证券有限责任公司总裁助理、华鑫证券有限责任公司副总裁。2014年5月至今任华鑫证券有限责任公司总裁、党委副书记、董事，兼任华鑫证券投资有限公司董事长、华鑫期货有限公司董事。现任本公司副董事长。

田明先生，香港中文大学、上海国家会计学院研究生。曾先后担任上海舒天（集团）有限公司财务部主管、大昌行汽车集团华东总部财务部副经理、上海广电（集团）有限公司财务经济部主管、上海广电电子股份有限公司财务会计部经理、上海广电信息产业股份有限公司总会计师和上海华鑫股份有限公司总会计师。

2015年9月至今，任华鑫证券有限责任公司财务副总监、董事，兼任华鑫宽众投资有限公司董事。现任本公司董事。

孙辰健，西安交通大学工业自动化专业学士、西安交通大学经济金融学院产业经济博士研究生。曾先后担任兰州炼油化工总厂研究所职员、中国水电三局技术管理、深圳证券交易所电脑工程部业务主任、深圳证券交易所交易运行部副经理、深圳证券交易所西北中心主任、深圳证券通信公司董事、总经理、深圳证券交易所信息管理部总监、中国证券登记结算有限责任公司北京数据技术分公司和中证信息技术服务有限责任公司党委委员、副总经理。2015年7月至今担任华鑫证券有限责任公司副总经理，兼任华鑫证券投资有限公司法定代表人、董事长。现任本公司董事。

Feta Zabeli 先生，伦斯勒理工学院获航天机械工程学士，南加州大学电气工程硕士，加州大学洛杉矶分校获工商管理学硕士。曾任诺斯洛普公司工程分析师，天合汽车集团项目经理，BARRA 公司权益类产品管理总监，花旗资产管理董事总经理，联博资产管理公司高级副总裁，现任摩根士丹利投资管理公司董事总经理、首席风险官及董事会成员，兼任 Ceres 期货管理有限责任公司董事。现任本公司董事。

张文础先生，悉尼大学法律荣誉学士和经济学学士。曾任职于富而德律师事务所的香港和伦敦办公室。加入摩根士丹利之后，历任摩根士丹利大中华区法律负责人及公司法律与合规部其他高级职务，现任摩根士丹利董事总经理和中国区首席运营官。现任本公司董事。

彭磊女士，西南财经大学经济学学士，北京大学经济学硕士。曾任中国南山开发集团金融投资部主管、深圳经济特区证券公司资产管理部、友联资产管理公司执行董事、招商局金融集团有限公司综合管理部副总经理、审计稽核部总经理、中国业务部总经理、证券部总经理。2012年4月至今任招商局金融集团有限公司总经理助理。现任本公司董事。

高潮生(Sheldon Gao)先生，美国康奈尔大学工商管理硕士，金融博士。曾任汇添富资产管理（香港）公司总经理，英国施罗德投资管理公司董事总经理、中国总裁，美国联博资产管理公司投资分析总监，美国晨星公司全球研究总监和美国道琼斯公司全球研究与战略总监，并曾在多家美国对冲基金公司担任资深基金经理。现任本公司董事、总经理。

贾丽娜女士，东北财经大学商业经济系学士、东北财经大学商业经济系硕士。曾于金陵科技学院任教，1994年8月至今，任天衡会计师事务所注册会计师、高级合伙人，兼任俊知集团有限公司独立董事和江苏林洋能源股份有限公司独立董事。现任本公司独立董事。彭章键先生，中国人民大学法学学士。曾供职于海南省高级人民法院，广东信达律师事务所。2008年至今担任北京市中银律师事务所深圳分所合伙人，兼任华南经济贸易仲裁委员会和深圳仲裁委员会仲裁员。现任本公司独立董事。

彭章键先生，中国人民大学法学学士。曾任职于海南省高级人民法院，广东信达律师事务所。2008年至今担任北京市中银律师事务所深圳分所合伙人，兼任华南经济贸易仲裁委员会和深圳仲裁委员会仲裁员。现任本公司独立董事。

苗复春先生，中国人民大学经济专业硕士。2007年5月至今任中国人寿养老保险公司顾问。曾任内蒙古商业局、计委科长，中国社科院技术经济研究所助理研究员，国务院技术经济研究中心研究员，国务院办公厅副局长，外经贸部办公厅主任，中央财经领导小组办公室局长，中国人寿保险公司副总经理，中国人寿保险股份有限公司执行董事、执行副总裁，中国人寿保险集团公司副总裁。现任本公司独立董事。

Paul M. Theil 先生，耶鲁大学东亚研究学士、硕士，哈佛大学商学院工商管理硕士（MBA）、法学院法律博士（JD）。目前担任中安信业董事长，曾任摩根士丹利亚洲私募股权部门主管、美国驻华大使馆一秘。现任本公司独立董事。

## 2、监事会成员

赵恒先生，西安大学计划统计学学士，上海财经大学工商管理硕士。曾任中国人民银行西安分行干部、西安证券有限责任公司总经理、华鑫证券有限责任公司总监、摩根士丹利华鑫基金管理有限公司董事。2008年至今任华鑫证券有限责任公司副总裁，兼任华鑫期货有限公司董事长。现任本公司监事长。

蒋蓓怡女士，新加坡南洋理工大学会计学士。美国注册金融分析师（CFA）。

2011年12月至今担任摩根士丹利中国区首席风险官执行董事，曾任德意志银行（中国）有限公司上海分行风险管理部董事、德意志银行亚太总部风险管理部助理副总裁、德勤会计师事务所高级分析师，安达信会计师事务所高级分析师。现

任本公司监事。

王章为先生，东北财经大学学士，南澳大学工商管理硕士，中国注册会计师、国际注册内部审计师。曾任深圳三九集团会计、深圳中华会计师事务所项目经理、招商局蛇口控股股份有限公司审计部经理、招商局科技集团有限公司财务部经理、招商局集团有限公司审计部高级经理。2008年6月至今任招商局金融集团有限公司财务部总经理。现任本公司监事。

赵婧女士，英国雷丁大学学士、英国诺丁汉大学硕士。曾任信诚人寿保险公司管理培训生、广州英国文化教育处财务官员。2007年加入本公司，现任本公司规划发展部总监、综合管理和人力资源部总监、北京分公司总经理、上海分公司总经理、职工监事。

周苑洁女士，华东政法大学国际经济法法学学士，复旦大学管理学院工商管理硕士。曾任大鹏资产管理有限责任公司客户关系管理经理。2004年加入本公司，历任客户服务中心负责人、上海理财中心负责人、营销策划经理、市场发展部总监助理、销售服务部副总监，现任本公司销售服务部总监、职工监事。

周源女士，湘潭大学计算机应用专业学士、湖南大学金融学院国际金融硕士。曾任招商基金管理有限公司基金会计（高级经理）。2010年起加入本公司，曾任基金运营部副总监、专户理财部副总监，现任本公司专户理财部总监、职工监事。

许菲菲女士，中南财经大学国际会计专业学士。曾任职于深圳市华新股份有限公司财务部、宝盈基金管理有限公司基金运营部。2005年加入本公司，历任基金运营部基金会计、监察稽核部高级监察稽核员、总监助理、副总监，现任本公司监察稽核部总监、职工监事。

徐达女士，弗吉尼亚大学商业与经济学士。2012年加入本公司，现任本公司研究管理部基金经理、职工监事。

### 3、公司高级管理人员

高潮生(Sheldon Gao)先生，总经理，简历同上。

孙要国先生，英国格林威治大学项目管理专业硕士，19年证券基金行业从业经历。曾任职于西安证券有限责任公司总经理办公室，华鑫证券有限责任公司总裁办公室，曾任华鑫证券有限责任公司深圳营业部总经理。2009年4月加入本公司，现任本公司副总经理兼任董事会秘书。

高见先生，北京大学经济学硕士，香港科技大学 MBA，清华大学五道口金融学院经济学博士。16年证券基金行业从业经历。曾任职华夏基金管理有限公司基金管理部高级经理、市场部执行副总经理（主持工作），大成基金管理有限公司规划

发展部产品总监、委托投资部总监，中国民生银行私人银行事业部首席投资顾问兼产品与资产管理中心总监，中国国际金融有限公司执行总经理。2014年2月加入本公司，现任本公司副总经理。

李锦女士，吉林大学经济管理学院国际金融专业硕士研究生，19年证券基金行业从业经历。曾就职于巨田证券有限责任公司，历任交易管理总部综合管理部经理助理，总经理办公室主任助理，资产管理部理财部副经理、经理，研究所研究员。2003年9月加入本公司，曾任基金运营部副总监、总监，总经理助理兼基金运营部总监。现任本公司督察长。

#### 4、本基金基金经理

周宁先生，首都经济贸易大学会计学硕士，特许金融分析师（CFA），8年证券从业经历。曾担任东兴证券研究所分析师。2010年9月加入本公司，历任研究员、基金经理助理，2014年12月起任大摩华鑫深证300指数增强型基金基金经理，2015年6月起任本基金基金经理，2015年11月起任摩根士丹利华鑫卓越成长混合型证券投资基金基金经理。

期后事项：

孙海波先生于2016年7月16日起担任本基金基金经理，周宁先生自该日起不再担任本基金基金经理。本公司已按规定在中国证券投资基金业协会完成基金经理变更，并于7月16日公告上述调整事项。

孙海波先生，南开大学政治经济学博士，9年证券从业经历。曾任职于华泰联合证券研究所及民生加银基金管理有限公司，担任研究员。2010年9月加入本公司，历任研究员、基金经理助理，现任基金投资部总监。2016年7月起任本基金基金经理。

#### 5、投资决策委员会成员

主任委员：高潮生先生（代理），本公司总经理。

副主任委员：王大鹏先生，研究管理部总监、基金经理。

委员：李轶女士，助理总经理、固定收益投资部总监、基金经理；胡明女士，交易管理部总监。

#### 6、上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### （一）基金托管人概况

#### 1、基本情况

名称：中国民生银行股份有限公司（以下简称“中国民生银行”）

住所：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：洪崎

成立时间：1996 年 2 月 7 日

基金托管业务批准文号：证监基金字 [2004] 101 号

组织形式：其他股份有限公司（上市）

注册资本：28,365,585,227 元人民币

存续期间：持续经营

电话：010-58560666

联系人：罗菲菲

中国民生银行于 1996 年 1 月 12 日在北京正式成立，是我国首家主要由非公有制企业入股的全国性股份制商业银行，同时又是严格按照《公司法》和《商业银行法》建立的规范的股份制金融企业。多种经济成份在中国金融业的涉足和实现规范的现代企业制度，使中国民生银行有别于国有银行和其他商业银行，而为国内外经济界、金融界所关注。中国民生银行成立二十年来，业务不断拓展，规模不断扩大，效益逐年递增，并保持了快速健康的发展势头。

2000 年 12 月 19 日，中国民生银行 A 股股票（600016）在上海证券交易所挂牌上市。2003 年 3 月 18 日，中国民生银行 40 亿可转换公司债券在上交所正式挂牌交易。2004 年 11 月 8 日，中国民生银行通过银行间债券市场成功发行了 58 亿元人民币次级债券，成为中国第一家在全国银行间债券市场成功私募发行次级债券的商业银行。2005 年 10 月 26 日，民生银行成功完成股权分置改革，成为国内首家完成股权分置改革的商业银行，为中国资本市场股权分置改革提供了成功范例。

2009 年 11 月 26 日，中国民生银行在香港交易所挂牌上市。

中国民生银行自上市以来，按照“团结奋进，开拓创新，培育人才；严格管理，规范行为，敬业守法；讲究质量，提高效益，健康发展”的经营发展方针，在改革发展与管理等方面进行了有益探索，先后推出了“大集中”科技平台、“两率”考核机制、“三卡”工程、独立评审制度、八大基础管理系统、集中处理商业模式及事业部改革等制度创新，实现了低风险、快增长、高效益的战略目标，树立了充满生机与活力的崭新的商业银行形象。

2009 年 6 月，民生银行在“2009 年中国本土银行网站竞争力评测活动”中获 2009 年中国本土银行网站“最佳服务质量奖”。

2009 年 9 月，在大连召开的第二届中国中小企业融资论坛上，中国民生银行被评为“2009 中国中小企业金融服务十佳机构”。在“第十届中国优秀财经证券网站

评选”中，民生银行荣膺“最佳安全性能奖”和“2009年度最佳银行网站”两项大奖。

2009年11月21日，在第四届“21世纪亚洲金融年会”上，民生银行被评为“2009年·亚洲最佳风险管理银行”。

2009年12月9日，在由《理财周报》主办的“2009年第二届最受尊敬银行评选暨2009年第三届中国最佳银行理财产品评选”中，民生银行获得了“2009年中国最受尊敬银行”、“最佳服务私人银行”、“2009年最佳零售银行”多个奖项。

2010年2月3日，在“卓越2009年度金融理财排行榜”评选活动中，中国民生银行一流的电子银行产品和服务获得了专业评测公司、网友和专家的一致好评，荣获卓越2009年度金融理财排行榜“十佳电子银行”奖。

2010年10月，在经济观察报主办的“2009年度中国最佳银行评选”中，民生银行获得评委会奖——“中国银行业十年改革创新奖”。这一奖项是评委会为表彰在公司治理、激励机制、风险管理、产品创新、管理架构、商业模式六个方面创新表现卓越的银行而特别设立的。

2011年12月，在由中国金融认证中心（CFCA）联合近40家成员行共同举办的2011中国电子银行年会上，民生银行荣获“2011年中国网上银行最佳网银安全奖”。这是继2009年、2010年荣获“中国网上银行最佳网银安全奖”后，民生银行第三次获此殊荣，是第三方权威安全认证机构对民生银行网上银行安全性的高度肯定。

2012年6月20日，在国际经济高峰论坛上，民生银行贸易金融业务以其2011-2012年度的出色业绩和产品创新最终荣获“2012年中国卓越贸易金融银行”奖项。这也是民生银行继2010年荣获英国《金融时报》“中国银行业成就奖—最佳贸易金融银行奖”之后第三次获此殊荣。

2012年11月29日，民生银行在《The Asset》杂志举办的2012年度AAA国家奖项评选中获得“中国最佳银行-新秀奖”。

2013年度，民生银行荣获中国投资协会股权和创业投资专业委员会年度中国优秀股权和创业投资中介机构“最佳资金托管银行”及由21世纪传媒颁发的2013年PE/VC最佳金融服务托管银行奖。

2013年荣获中国内部审计协会民营企业内部审计优秀企业。

在第八届“21世纪亚洲金融年会”上，民生银行荣获“2013·亚洲最佳投资金融服务银行”大奖。

在“2013第五届卓越竞争力金融机构评选”中，民生银行荣获“2013卓越竞争



力品牌建设银行”奖。

在中国社科院发布的《中国企业社会责任蓝皮书（2013）》中，民生银行荣获“中国企业上市公司社会责任指数第一名”、“中国民营企业社会责任指数第一名”、“中国银行业社会责任指数第一名”。

在2013年第十届中国最佳企业公民评选中，民生银行荣获“2013年度中国最佳企业公民大奖”。

2013年还获得年度品牌金博奖“品牌贡献奖”。

2014年获评中国银行业协会“最佳民生金融奖”、“年度公益慈善优秀项目奖”。

2014年荣获《亚洲企业管治》“第四届最佳投资者关系公司”大奖和“2014亚洲企业管治典范奖”。

2014年被英国《金融时报》、《博鳌观察》联合授予“亚洲贸易金融创新服务”称号。

2014年还荣获《亚洲银行家》“中国最佳中小企业贸易金融银行奖”，获得《21世纪经济报道》颁发的“最佳资产管理私人银行”奖，获评《经济观察》报“年度卓越私人银行”等。

2015年度，民生银行在《金融理财》举办的2015年度金融理财金貔貅奖评选中荣获“金牌创新力托管银行奖”。

2015年度，民生银行荣获《EUROMONEY》2015年度“中国最佳实物黄金投资银行”称号。

2015年度，民生银行连续第四次获评《企业社会责任蓝皮书（2015）》“中国银行业社会责任发展指数第一名”。

2015年度，民生银行在《经济观察报》主办的2014-2015年度中国卓越金融奖评选中荣获“年度卓越创新战略创新银行”和“年度卓越直销银行”两项大奖。

## 2、主要人员情况

杨春萍：女，北京大学本科、硕士。资产托管部副总经理。曾就职于中国投资银行总行，意大利联合信贷银行北京代表处，中国民生银行金融市场部和资产托管部。历任中国投资银行总行业务经理，意大利联合信贷银行北京代表处代表，中国民生银行金融市场部处长、资产托管部总经理助理、副总经理等职务。具有近三十年的金融从业经历，丰富的外资银行工作经验，具有广阔的视野和前瞻性的战略眼光。

## 3、基金托管业务经营情况

中国民生银行股份有限公司于2004年7月9日获得基金托管资格，成为《中华

《中华人民共和国证券投资基金法》颁布后首家获批从事基金托管业务的银行。为了更好地发挥后发优势，大力发展托管业务，中国民生银行股份有限公司资产托管部从成立伊始就本着充分保护基金持有人的利益、为客户提供高品质托管服务的原则，高起点地建立系统、完善制度、组织人员。资产托管部目前共有员工 63 人，平均年龄 36 岁，100%员工拥有大学本科以上学历，80%以上员工具有硕士以上文凭。基金业务人员 100%都具有基金从业资格。

中国民生银行坚持以客户需求为导向，秉承“诚信、严谨、高效、务实”的经营理念，依托丰富的资产托管经验、专业的托管业务服务和先进的托管业务平台，为境内外客户提供安全、准确、及时、高效的专业托管服务。截至 2016 年 3 月 31 日，中国民生银行已托管 86 只证券投资基金，托管的证券投资基金总净值达到 1960.97 亿元。中国民生银行于 2007 年推出“托付民生·安享财富”托管业务品牌，塑造产品创新、服务专业、效益优异、流程先进、践行社会责任的托管行形象，赢得了业界的高度认可和客户的广泛好评，深化了与客户的战略合作。自 2010 年至今，中国民生银行荣获《金融理财》杂志颁发的“最具潜力托管银行”、“最佳创新托管银行”和“金牌创新力托管银行”奖，荣获《21 世纪经济报道》颁发的“最佳金融服务托管银行”奖。

### 三、相关服务机构

#### （一）基金份额销售机构

##### 1、直销机构

###### （1）摩根士丹利华鑫基金管理有限公司直销中心

注册地址：深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第二座第 17 层 01-04 室

办公地址：深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第二座第 17 层

联系人：吴海灵

电话：（0755）88318898

传真：（0755）82990631

###### （2）摩根士丹利华鑫基金管理有限公司北京分公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街 18 号丰融国际大厦 1005 室

办公地址：北京市西城区太平桥大街 18 号丰融国际大厦 1005 室

联系人：张宏伟

电话：（010）66155568

传真：（010）66158135

###### （3）摩根士丹利华鑫基金管理有限公司上海分公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1000 号恒生银行大厦 45 楼 011-111 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1000 号恒生银行大厦 45 楼 011-111 单元

联系人：朱冰楚

电话：（021）63343311-2100

传真：（021）63343988

（4）摩根士丹利华鑫基金管理有限公司网上直销系统

交易系统网址：<https://etrade.msfunds.com.cn/etrading>

目前已开通工商银行、建设银行、农业银行、招商银行、银联通、汇付天下“天天盈”等支付渠道。

全国统一客服电话：400-8888-668

客户服务信箱：[Services@msfunds.com.cn](mailto:Services@msfunds.com.cn)

深圳、北京或上海的投资人单笔认（申）购金额超过 100 万元（含 100 万元）人民币以上的，可拨打直销中心的上述电话进行预约，本公司将提供上门服务。

## 2、其他销售机构

（1）中国民生银行股份有限公司

注册（办公）地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：洪崎

联系人：穆婷

联系电话：010-58560666

客户服务热线：95568

网址：[www.cmbc.com.cn](http://www.cmbc.com.cn)

（2）中国工商银行股份有限公司

注册（办公）地址：中国北京复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

客户服务电话：95588（全国）

网址：[www.icbc.com.cn](http://www.icbc.com.cn)

（3）平安银行股份有限公司

注册（办公）地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

法定代表人：孙建一

联系人：马梦洁

联系电话：0755-25878124

客户服务电话：95511-3

网址: [www.bank.pingan.com](http://www.bank.pingan.com)

(4) 烟台银行股份有限公司

注册(办公)地址: 山东省烟台市芝罘区海港路 25 号

法定代表人: 叶文君

联系人: 王淑华

联系电话: 0535-6699660

客户服务电话: 4008-311-777

网址: [www.yantaibank.net](http://www.yantaibank.net)

(5) 哈尔滨银行股份有限公司

注册(办公)地址: 哈尔滨市道里区尚志大街 160 号

法定代表人: 郭志文

客户服务电话: 95537、400-60-95537

网址: [www.hrbb.com.cn](http://www.hrbb.com.cn)

(6) 华鑫证券有限责任公司

注册地址: 深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01 (b) 单元

办公地址: 上海市徐汇区宛平南路 8 号

法定代表人: 俞洋

联系人: 杨莉娟

联系电话: 021-54967202

客户服务电话: 021-32109999; 029-68918888; 4001099918

网址: [www.cfsc.com.cn](http://www.cfsc.com.cn)

(7) 中信证券股份有限公司

注册地址: 广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座

办公地址: 北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人: 王东明

联系人: 侯艳红

联系电话: 010-60838995

客户服务电话: 400-889-5548

网址: [www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

(8) 中信建投证券股份有限公司

注册地址: 北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址: 北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人: 王常青

联系人：魏明

联系电话：（010）85130588

客户服务电话：4008888108

网址：www.csc108.com

（9）信达证券股份有限公司

注册（办公）地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：张志刚

联系人：唐静

联系电话：（010）63081000

客户服务电话：400-800-8899

公司网址：www.cindasc.com

（10）国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路618号

办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼

法定代表人：杨德红

联系人：芮敏祺、朱雅崑

联系电话：（021）38676161

客户服务电话：95521

网址：www.gtja.com

（11）申万宏源证券有限公司

注册（办公）地址：上海市徐汇区长乐路989号45层

法定代表人：李梅

联系人：曹晔

联系电话：（021）33389888

客户服务电话：95523 或 4008895523

网址：www.swhysc.com

（12）光大证券股份有限公司

注册（办公）地址：上海市静安区新闻路1508号

法定代表人：薛峰

联系人：刘晨、李芳芳

联系电话：（021）22169999

客户服务电话：400-8888-788、10108998

网址：www.ebscn.com

(13) 兴业证券股份有限公司

注册（办公）地址：福州市湖东路 268 号

法定代表人：兰荣

联系人：谢高得

联系电话：（021）38565785

客户服务电话：400-8888-123

网址：www.xyzq.com.cn

(14) 长江证券股份有限公司

注册（办公）地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：崔少华

联系人：奚博宇

联系电话：（027）65799999

客户服务电话：95579 或 4008-888-999

网址：www.95579.com

(15) 华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

办公地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 24 楼

法定代表人：吴万善

联系人：庞晓芸

联系电话：（0755）82492193

客户服务电话：95597

网址：www.htsc.com.cn

(16) 中信证券（山东）有限责任公司

注册（办公）地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

法定代表人：杨宝林

联系人：孙秋月

联系电话：（0532）85022026

客户服务电话：95548

公司网址：www.citicssd.com

(17) 山西证券股份有限公司

注册（办公）地址：太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

联系人：郭熠

联系电话：（0351）8686659

客户服务电话：400-666-1618

网址：www.i618.com.cn

（18）东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州延陵西路23号投资广场18层

办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦

法定代表人：朱科敏

联系人：王一彦

联系电话：021-20333333

客户服务电话：95531；400-8888-588

网址：www.longone.com.cn

（19）东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州工业园区翠园路181号商旅大厦

办公地址：苏州工业园区星阳街5号

法定代表人：范力

联系人：方晓丹

联系电话：0512-65581136

客户服务电话：4008-601555

网址：<http://www.dwzq.com.cn>

（20）宏信证券有限责任公司

注册（办公）地址：四川省成都市人民南路二段18号川信大厦10楼

法定代表人：吴玉明

联系人：刘进海

联系电话：028-86199278

客户服务电话：4008-366-366

网址：www.hxzq.cn

（21）招商证券股份有限公司

注册（办公）地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层

法定代表人：宫少林

联系人：黄婵君

联系电话：（0755）82943666

客户服务热线：95565、400-8888-111

网址：[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

(22) 平安证券有限责任公司

注册（办公）地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人：谢永林

联系人：周一涵

联系电话：（0755）38637436

客户服务电话：95511-8

网址：[stock.pingan.com](http://stock.pingan.com)

(23) 申万宏源西部证券有限公司

注册（办公）地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

法定代表人：李季

联系人：王怀春

联系电话：0991-2307105

客户服务热线：4008-000-562

网址：[www.hysec.com](http://www.hysec.com)

(24) 天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

办公地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 5 层

法定代表人：林义相

联系人：尹伶

联系电话：（010）66045529

客户服务电话：010-66045678

网址：[www.txsec.com](http://www.txsec.com)

(25) 深圳众禄金融控股股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

联系电话：（0755）33227950

客户服务电话：4006-788-887

网址：众禄基金网 [www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn)



基金买卖网 [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

(26) 杭州数米基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

联系人：周瑾旻

联系电话：(0571) 28829790；(021) 60897869

客户服务电话：4000-766-123

网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

(27) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路 1 号元茂大厦 903

办公地址：浙江省杭州市余杭区五常街道同顺街 18 号 同花顺大楼 4 层

法定代表人：凌顺平

联系人：吴强

联系电话：0571-88911818

客户服务电话：4008-773-772

网址：<http://www.5ifund.com>

(28) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903-906 室

法定代表人：杨文斌

联系人：张茹

联系电话：021-20613999

客户服务电话：400-700-9665

网址：[www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

(29) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：浦东新区峨山路 613 号 6 幢 551 室

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼

法定代表人：其实

联系人：潘世友

联系电话：021-54509998-7019

客户服务电话：400-1818-188

网址：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

(30) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

联系人：沈雯斌

联系电话：021-58788678-8201

客户服务电话：400-820-2899

网址：[www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

(31) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801

法定代表人：汪静波

联系人：方成

联系电话：021-38602377

客户服务电话：400-821-5399

网址：[www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com)

(32) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 16 层

法定代表人：杨懿

联系人：张燕

联系电话：400-166-1188

客户服务电话：400-166-1188

网址：<http://8.jrj.com.cn>

(33) 宜信普泽投资顾问（北京）有限公司

注册（办公）地址：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

法定代表人：沈伟桦

联系人：王巨明

联系电话：010-52855650

客户服务电话：400-6099-200

网址：[www.yixinfund.com](http://www.yixinfund.com)

(34) 北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址：北京市朝阳区华严北里 2 号民建大厦 6 层

法定代表人：闫振杰

联系人：马林

联系电话：010-62020088- 7024

客户服务电话：4008188000

网址：www.myfund.com

（35）北京创金启富投资管理有限公司

注册地址：北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A

办公地址：北京市西城区白纸坊东街 2 号经济日报社 A 座综合楼 712 号

法定代表人：梁蓉

联系人：张旭

联系电话：010-66154828

客户服务电话：400-6262-818

网址：www.5irich.com

（36）上海汇付金融服务有限公司

注册地址：上海市黄浦区中山南路 100 号 19 层

办公地址：上海市黄浦区中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

法定代表人：冯修敏

联系人：陈云卉

联系电话：021-33323999-5611

客户服务电话：400-820-2819

网址：fund.bundtrade.com

（37）上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：郭坚

联系人：宁博宇

联系电话：021-20665952

客户服务电话：4008219031

网址：www.lufunds.com

（38）上海联泰资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层

法定代表人：燕斌

联系人：陈东

联系电话：021-52822063

客户服务热线：4000-466-788

网址：www.66zichan.com

（39）上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏南路765号602-115室

办公地址：上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼

法定代表人：陈继武

联系人：李晓明

联系电话：021-63333319

客户服务热线：4000 178 000

网址：www.lingxianfund.com

（40）深圳富济财富管理有限公司

注册（办公）地址：深圳市南山区粤海街道高新南七道惠恒集团二期418室

法定代表人：齐小贺

联系人：刘勇

联系电话：0755-83999907-814

客户服务热线：0755-83999907

网址：www.jinqianwo.cn

（41）北京钱景财富投资管理有限公司

注册（办公）地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012

法定代表人：赵荣春

联系人：崔丁元

联系电话：010-57418813

客户服务热线：400-893-6885

网址：www.qianjing.com

（42）上海利得基金销售有限公司

注册（办公）地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室

法定代表人：沈继伟

联系人：徐鹏

联系电话：021-50583533

客户服务热线：400-067-6266

网址：<http://a.leadfund.com.cn>

(43) 珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203

法定代表人：肖雯

联系人：黄敏嫦

联系电话：020-89629099

客户服务电话：020-89629066

公司网址：[www.yingmi.cn](http://www.yingmi.cn)

基金管理人可以根据情况变化增加或者减少销售机构，并另行公告。销售机构可以根据情况变化增加或者减少其销售城市、网点，并另行公告。

(三) 登记机构

名称：摩根士丹利华鑫基金管理有限公司

住所：深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第二座第17层01-04室

办公地址：深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第二座第17层

法定代表人：YU HUA（于华）

联系人：赵恒

电话：（0755）88318709

(四) 出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：俞卫锋

联系人：陆奇

电话：021-31358666

经办律师：安冬、陆奇

(五) 审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

法定代表人：杨绍信

电话：021-23238889

联系人：俞伟敏

经办注册会计师：单峰、俞伟敏

#### 四、基金的名称

本基金名称：摩根士丹利华鑫新机遇灵活配置混合型证券投资基金

#### 五、基金的运作方式与类型

（一）本基金的运作方式：契约型开放式

（二）本基金的类型：混合型证券投资基金

#### 六、基金的投资目标

本基金采取主动管理的投资策略，在严控风险的基础上，力争为投资人获取稳健回报。

#### 七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、次级债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、资产支持证券，债券回购、银行存款等固定收益类资产以及现金）、权证、股指期货、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

基金的投资组合比例：股票资产占基金资产的比例范围为 0%-95%，权证投资比例不高于基金资产净值的 3%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后，本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。权证、股指期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

#### 八、基金的投资策略

##### （一）投资策略

本基金为灵活配置混合型基金，根据各类资产的市场趋势和预期收益风险的比较判别，对股票、债券及货币市场工具等类别资产的配置比例进行动态调整，以期在投资中达到风险和收益的优化平衡。

##### 1、股票投资策略

在行业选择中，本基金将根据宏观经济产业结构变化趋势、技术发展方向、社会经济人口变化趋势等变化，动态分析行业发展所处阶段，筛选宏观经济环境中技术发展过程中未来有望受益程度较高或持续提升的行业；本基金也将根据经济周期、上下游行业联动关系等，选择行业景气有望反转、或其在产业链中地位由弱转强或优势扩大的行业。

在个股选择中，本基金“自下而上”精选个股，通过定性和定量相结合的方法，

依据稳健投资原则，在 A 股市场中精选优质个股，构建股票组合。定性分析主要包括对公司战略定位、所处产业受国家产业政策的影响、公司的盈利模式、公司竞争力分析、盈利能力、公司治理结构、股东方面的支持等方面的分析，选择未来具有广阔成长空间且具有可持续竞争优势的上市公司。定量分析主要是通过定量分析工具以判断上市公司的估值高低，具体方法包括 PE、PB、PEG、PS 等相对估值方法，以及企业自由现金流折现、股息折现模型等绝对估值方法。

## 2、衍生品投资策略

本基金的衍生品投资将严格遵守相关法律法规的规定，合理利用股指期货、权证等衍生工具，充分考虑衍生品的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，追求稳定的当期收益或降低投资组合的整体风险。

### （1）权证投资策略

本基金在进行权证投资时，将通过对权证标的证券基本面的研究，结合权证定价模型寻求其合理估值水平，利用正股和权证之间的不同组合来套取无风险收益。

### （2）股指期货投资策略

本基金将以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场 and 期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

### （3）资产支持证券投资策略

本基金通过对资产支持证券的发行条款、支持资产的构成及质量等基本面研究，结合相关定价模型评估其内在价值，谨慎参与资产支持证券投资。

## 3、债券投资策略

本基金对于债券的投资主要为久期管理策略、收益率曲线策略、个券选择策略、跨市场套利策略等，并择机把握市场有效性不足情况下的交易机会。

## （二）投资程序

### 1、投资决策依据

- 1) 国家有关法律、法规和基金合同的有关规定；
- 2) 国内外宏观经济发展状况、微观经济运行环境和证券市场发展趋势；
- 3) 投资品种的预期收益率和风险水平。

### 2、投资决策程序

#### （1）投资研究

本基金管理人研究团队充分利用外部和内部的研究资源提供研究成果，挖掘投资

机会，为投资决策委员会和基金经理提供决策支持。

#### （2）投资决策

投资决策委员会是基金投资的最高决策机构，负责制定基金的投资原则、投资目标及整体资产配置策略和风险控制策略，并对基金经理进行授权，对基金的投资进行总体监控。如遇重大事项，投资决策委员会及时召开临时会议做出决议。

#### （3）组合构建

基金经理根据投资委员会确定的总体投资策略和原则以及研究团队提供的分析和建议等信息，在遵守基金合同的前提下，在投资决策委员会的授权范围内构建具体的投资组合，进行组合的日常管理。

#### （4）交易执行

本基金实行集中交易制度。交易团队负责执行基金经理投资指令，同时承担一线风险监控职责。

#### （5）风险与绩效评估

投资风险管理团队由风险管理部和监察稽核部组成。风险管理部定期或不定期地对基金投资绩效及风险进行评估；监察稽核部对基金投资的合规性进行日常监控及事后检查；风险管理委员会定期召开会议，结合市场、法律等环境的变化，对基金投资组合进行风险评估，并提出风险防范措施及意见。

#### （6）组合调整

基金经理根据行业状况、证券市场和上市公司的发展变化、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合风险与绩效评估的结果，对投资组合进行动态调整。

本基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下，有权根据市场环境变化和实际需要调整上述投资程序，并在更新的招募说明书中公告。

### 九、基金的业绩比较基准

中国人民银行公布的一年期定期存款利率（税后）+1%

其中，一年期银行定期存款利率是指中国人民银行公布并执行的金融机构一年期人民币存款基准利率。本基金以实现绝对收益作为投资目标，力争在混合型基金的投资限定之下，追求较高的投资回报。银行定期存款可以近似理解为定息产品，而一年期银行定期存款收益较符合本基金的预期。因此，本基金采用一年期银行定期存款利率（税后）+1%作为业绩比较基准，与本基金追求的预期收益水平相符。

如果今后法律法规发生变化，又或者市场推出更具权威、且更能够表征本基金风险收益特征的业绩比较基准，则基金管理人将视情况经与基金托管人协商同意后调整本基金的业绩比较基准，而无需召开基金份额持有人大会审议，并应及时公



告并报中国证监会备案，同时在更新的招募说明书中列示。

#### 十、基金的风险收益特征

本基金为混合型证券投资基金，理论上长期来看其预期风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

#### 十一、基金的投资组合报告

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。

基金托管人中国民生银行根据本基金合同规定，于2016年4月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。本投资组合报告所载数据截至2016年3月31日，本报告中所列财务数据未经审计。

##### 1、报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额（元） 占基金总资产的比例（%）

1 权益投资 71,441,023.33 71.63

其中：股票 71,441,023.33 71.63

2 基金投资 --

3 固定收益投资 --

其中：债券 --

资产支持证券 --

4 贵金属投资 --

5 金融衍生品投资 --

6 买入返售金融资产 --

其中：买断式回购的买入返售金融资产 --

7 银行存款和结算备付金合计 27,843,122.65 27.92

8 其他资产 451,482.32 0.45

9 合计 99,735,628.30 100.00

##### 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码 行业类别 公允价值（元） 占基金资产净值比例（%）

A 农、林、牧、渔业 1,475,782.00 1.71

B 采矿业 --

C 制造业 44,480,467.58 51.40

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	--
E	建筑业	--
F	批发和零售业	4,734,932.75 5.47
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	17,242,346.00 19.92
J	金融业	--
K	房地产业	--
L	租赁和商务服务业	3,507,495.00 4.05
M	科学研究和技术服务业	--
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	--
S	综合	--
	合计	71,441,023.33 82.55

### 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

序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1	002462	嘉事堂	128,075	4,734,932.75	5.47
2	000910	大亚科技	300,000	4,389,000.00	5.07
3	600476	湘邮科技	100,000	3,643,000.00	4.21
4	000488	晨鸣纸业	427,182	3,618,231.54	4.18
5	000800	一汽轿车	250,000	3,522,500.00	4.07
6	002183	怡亚通	119,100	3,507,495.00	4.05
7	002450	康得新	100,000	3,299,000.00	3.81
8	300253	卫宁健康	100,000	3,270,000.00	3.78
9	600594	益佰制药	200,000	3,250,000.00	3.76
10	600285	羚锐制药	263,300	2,698,825.00	3.12

#### 4、 报告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。

#### 5、 报告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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 6、 报告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。

#### 7、 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

根据本基金基金合同规定，本基金不参与贵金属投资。

#### 8、 报告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。

#### 9、 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

报告期内，本基金未参与股指期货交易；截至报告期末，本基金未持有股指期货合约。

##### 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的规定，本基金将以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

#### 10、 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 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。

##### 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。

##### 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。

#### 11、 投资组合报告附注

11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体除深圳市怡亚通供应链股份有限公司（以下简称“怡亚通”）外，其余的没有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。

怡亚通于 2016 年 3 月 25 日公告，其于 2016 年 2 月 2 日收到中国证券监督管理委员会深圳监管局（以下简称“深圳证监局”）下达的《深圳证监局关于对深圳市怡亚通供应链股份有限公司采取出具警示函措施的决定》（[2016]10 号），怡亚通在公告中陈述了警示函的内容以及公司相关整改情况。

本基金投资怡亚通（002183）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，认为上述事件对怡亚通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。

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。

11.3 其他资产构成

序号 名称 金额（元）

1 存出保证金 437,264.49

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 6,358.64

5 应收申购款 7,859.19

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 451,482.32

11.4 报告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债。

11.5 报告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。

## 十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1、自基金合同生效以来至 2016 年 3 月 31 日，本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表：

阶段 份额净值增长率① 份额净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

自基金合同生效日起至 2016 年 3 月 31 日 2.80% 1.60% 2.08% 0.01% 0.72%  
1.59%

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

摩根士丹利华鑫新机遇灵活配置混合型证券投资基金

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：

（2015 年 6 月 24 日至 2016 年 3 月 31 日）

### 十三、基金的费用与税收

#### （一）与基金运作有关的费用

##### 1. 基金费用的种类

- （1）基金管理人的管理费；
- （2）基金托管人的托管费；
- （3）《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- （4）《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- （5）基金份额持有人大会费用；
- （6）基金的证券交易费用；
- （7）基金的银行汇划费用；
- （8）基金的开户费用、账户维护费用；
- （9）按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

##### 2. 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

###### （1）基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.2% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

###### （2）基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25 \% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

(3) 上述“1、基金费用的种类中第 3—9 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

## (二) 与基金销售有关的费用

### 1. 申购费用

投资人在一天内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

申购费用由投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金对通过直销中心申购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。

养老金客户指基本养老保险与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金，包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围，并按规定向中国证监会备案。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资者。

通过基金管理人的直销中心申购本基金基金份额的养老金客户申购费率见下表：

(单位：元)

申购金额 (M) 申购费率

$M < 100$  万元 0.48%

$100$  万元  $\leq M < 500$  万元 0.32%

$M \geq 500$  万元 每笔 1000 元

其他投资者申购本基金基金份额申购费率见下表：(单位：元)

申购金额 (M) 申购费率

$M < 100$  万 1.20%

$100$  万  $\leq M < 500$  万 0.80%

$M \geq 500$  万 每笔 1000 元

## 2. 赎回费用

本基金的赎回费用按基金份额持有人持有时间的增加而递减。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。

对持续持有期少于 30 日的投资人收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期超过 30 日但少于 90 日的投资人收取的赎回费总额的 75% 计入基金财产；对持续持有期不少于 90 日但少于 180 日的投资人收取的赎回费总额的 50% 计入基金财产；对持续持有期不少于 180 日但少于 730 日的投资人收取的赎回费总额的 25% 计入基金财产。

具体赎回费率结构如下：

持有时间 (Y) 赎回费率 赎回费记入基金资产的比例

$Y < 7$  日 1.5% 100%

$7$  日  $\leq Y < 30$  日 0.75% 100%

$30$  日  $\leq Y < 90$  日 0.5% 75%

$90$  日  $\leq Y < 180$  日 0.5% 50%

$180$  日  $\leq Y < 365$  日 0.1% 25%

$365$  日  $\leq Y < 730$  日 0.05% 25%

$Y \geq 730$  日 0% 0

## 3. 转换费用

本基金转换费用由转出基金的赎回费和转出与转入基金的申购费补差两部分构成，具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率差异情况和赎回费率而定。基金转换费用由基金份额持有人承担，计算方法如下：

转出金额 = 转出份额  $\times$  转出基金当日基金份额净值

转出基金赎回费 = 转出金额  $\times$  转出基金赎回费率

转入总金额 = 转出金额 - 转出基金赎回费

申购补差费 = 转入总金额  $\times$  申购补差费率 / (1 + 申购补差费率)

转换费用=转出基金赎回费+申购补差费

(1) 对于实行级差申购费率(不同申购金额对应不同申购费率)的基金, 申购补差费率 = 转入总金额对应的转入基金申购费率 - 转入总金额对应的转出基金申购费率, 若转入总金额对应的转出基金申购费率 $\geq$ 转入总金额对应的转入基金申购费率, 则申购补差费为0。

(2) 计算基金转换费用所涉及的申购费率和赎回费率均按基金合同、招募说明书及相关公告的规定费率执行, 对于通过本公司网上交易、费率优惠活动期间发生的基金转换业务, 按照本公司最新公告的相关费率计算基金转换费用。

(三) 不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
- 3、《基金合同》生效前的相关费用;
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(四) 基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体, 其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》及其它有关法律法规的要求, 对2016年2月4日刊登的《摩根士丹利华鑫新机遇灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》进行了更新, 主要更新的内容如下:

序号 修改部分 说明

- 1 重要提示 更新了本招募说明书重要提示内容, 以及所载内容截止日期、有关财务数据和净值表现截止日
- 2 三、基金管理人 更新了“主要人员情况”的信息
- 3 四、基金托管人 根据基金托管人提供的信息, 更新了“基金托管人”有关信息
- 4 五、相关服务机构 根据服务机构的实际情况更新了相关机构的信息
- 5 九、基金的投资 更新了最近一期投资组合报告的内容, 即截至2016年3月31日的基金投资组合报告
- 6 十、基金的业绩 更新了基金的投资业绩, 即截至2016年3月31日的基金投



资业绩

7 十七、风险揭示 更新了风险揭示的内容

8 二十二、其他应披露事项 根据最新情况对相关应披露事项进行了更新

摩根士丹利华鑫基金管理有限公司

二〇一六年八月五日