

2020年1月23日 星期四

(上接B132版)

法定代表人:张跃伟
联系人:沈斌
联系电话:021-58788678-8201
客户服务电话:400-820-2899
网址:www.erichfund.com
(43) 诺亚正行基金销售有限公司
注册地址:上海市金山区廊下漕港公路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
(44) 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.jrfc.com.cn

(45) 宜信普惠(北京)基金销售有限公司
注册(办公)地址:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层

法定代表人:戎兵
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

(46) 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

(47) 北京创金启富基金销售有限公司
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112号
法定代表人:梁蓉
联系人:张旭
联系电话:011-66154828
客户服务电话:400-6262-818
网址:www.5rich.com

(48) 上海汇付基金销售有限公司
注册地址:上海市黄浦区中山南路100号19层
办公地址:上海市宜山路700号普天信息产业园2期C5栋汇付天下总部大楼2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
(49) 上海陆金所基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼109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:胡学勤
联系人:宁博宇
联系电话:021-20665952
客户服务电话:4008219031
网址:www.lufunds.com
(50) 上海联泰基金销售有限公司
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
(51) 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:4000-893-6885
网址:www.qianjing.com
(54) 上海利得基金销售有限公司
注册地址:上海市宝山区蕴川路5475号1033室
办公地址:上海市虹口区东大名路1098号浦江金融世纪广场18层
法定代表人:李兴春
联系人:陈洁
联系电话:021-60195121
客户服务热线:400-921-7755
网址:www.leadfund.com.cn
(55) 珠海盈米基金销售有限公司
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:黄敏娟
联系电话:020-89629099
客户服务电话:020-89629066
公司网址:www.yingmi.com
(56) 中证金牛(北京)投资咨询有限公司
注册地址:北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室
办公地址:北京市宣武门外大街甲1号新华社第三工作区A座5层
法定代表人:钱昊昱
联系人:孙雯
联系电话:010-59336519
客户服务热线:4008-909-998
公司网址:www.jnfc.com
(57) 北京汇成基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村大街11号E世界财富中心A座11层1108号
办公地址:北京市海淀区中关村大街11号E世界财富中心A座11层
法定代表人:王伟刚
联系人:丁向坤
联系电话:010-56282140
客户服务热线:400-619-9059
网址:www.hcjijin.com
(58) 大泰金石基金销售有限公司
注册地址:南京市建邺区江东中路102号708室
办公地址:上海市浦东新区峨山路505号东方纯一大厦15层
法定代表人:姚杨
联系人:孟召社
联系电话:021-20324176

客户服务热线:400-928-2266
网址:www.dtffunds.com
注:仅开放赎回
(59) 深圳市金斧子基金销售有限公司
注册(办公)地址:深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元11层1108
法定代表人:赖任军
联系人:刘昕霞
联系电话:0755-29330513
客户服务热线:400-930-0660
网址:www.fjzinv.com
(60) 上海万得基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址:上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼
法定代表人:王廷富
联系人:徐亚丹
联系电话:021-51327185
客户服务热线:400-821-0203
网址:www.520fund.com.cn
(61) 北京新浪仓石基金销售有限公司
注册(办公)地址:北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室
法定代表人:李昭琛
联系人:付文红
联系电话:010-62676405
客户服务热线:010-62675369
网址:www.xincain.com
(62) 北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址:北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路甲19号SOHO嘉盛中心30层
法定代表人:周斌
联系人:张晔
联系电话:010-59313591
客户服务热线:4008-980-618
网址:www.chtfund.com
(63) 北京景悦天下基金销售有限公司
注册地址:北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室
办公地址:北京市朝阳区朝外大街甲六号万通中心D座28层
法定代表人:蒋煜
联系人:杨雪
联系电话:010-58170963
客户服务热线:400-818-8866
网址:www.shengshiview.com
(64) 北京肯特瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15
办公地址:北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院A座17层
法定代表人:江卉
联系人:徐伯宇
联系电话:010-89189285
客户服务热线:95118/400-088-8816
网址:http://fund.jt.com
(65) 南京苏宁基金销售有限公司
注册(办公)地址:南京玄武区苏宁大道1-5号
法定代表人:钱燕飞
联系人:赵超
联系电话:18551602256
客户服务热线:95177
网址:www.snnjjn.com
(66) 济安财富(北京)基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区东三环中路7号4号楼40层4601室
办公地址:北京市朝阳区东三环中路7号4号楼40层4601
法定代表人:杨健
联系人:李海燕
联系电话:010-65309516
客户服务热线:400-673-7010
网址:www.jianfortune.com
(67) 上海云湾基金销售有限公司
注册(办公)地址:中国(上海)自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层
法定代表人:戴新装
联系人:朱学勇
联系电话:021-20530012
客户服务热线:400-820-1515
网址:www.zhengtongfunds.com
(68) 通华财富(上海)基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区同丰路667弄107号201室
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场杨高南路799号3号楼
法定代表人:兰奇
联系人:021-60818588
客户服务热线:400-66-95156
网址:www.tonghuafund.com
(69) 上海挖财基金销售有限公司
注册(办公)地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5层01-02,03室
法定代表人:冷飞
联系人:孙璐
联系电话:021-50810687
客户服务热线:021-50810673
网址:www.wacaijiin.com
(70) 上海基煜基金销售有限公司
注册地址:上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室(上海泰和经济发展区)
办公地址:上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1502室
法定代表人:王翔
联系人:李光洲
联系电话:021-65370077
客户服务热线:400-820-5369
网址:www.jiyufund.com.cn
(71) 北京蛋卷基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
办公地址:北京市朝阳区创远路34号院融新科技中心C座17层
法定代表人:钟斐斐
联系人:袁永姣
联系电话:010-61840688
客户服务热线:4000-618-518
网址:www.danjuanapp.com
(72) 上海华夏财富基金管理有限公司
注册地址:上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室
法定代表人:毛淮平
联系人:张静怡
联系电话:010-88066184
客户服务热线:400-817-5666
网址:www.amcfortune.com
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网点,并另行公告。

(3) 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:周熙
联系人:赵恒
电话:(0755)88318709

(4) 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:021-31368666
经办律师:安冬,陆奇

(5) 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:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展

银行大厦6楼
办公地址:上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼
执行事务合伙人:李丹
电话:021-23238189
联系人:俞伟敏
经办注册会计师:许康伟、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)。

本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%,权证投资比例不高基金资产净值的3%。每个交易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%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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断,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“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,合理利用股指期权、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,追寻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
本基金将在套保保值为主要目的,有选择地投资于股指期货。套保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。

(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交易的机会。
(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
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
基金管理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,同时承担一线风控监控行职责。

(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共告。

九、基金的业绩比较基准

依据本基金合同的约定,经与相关基金托管人协商一致,并报中国证监会备案,自2016年4月1日起,本基金的业绩比较基准变更为:

沪深300指数收益率×50%+中证综合债券指数收益率×50%

本基金为灵活配置混合型基金,中长期的股债配置比例较为均衡,作为专业数据提供商提供的指数,中证指数公司提供的中证系列指数体系具有一定的优势和市场影响力;在中证系列指数中,沪深300指数的市场代表性比较强,适合作为本基金股票投资的基本基准,而中证综合债券指数能够较好的反映债券市场变动的全貌,适合作为本基金债券投资的基本基准。因此选择沪深300指数收益率×50%+中证综合债券收益率×50%符合本基金的风险收益特征。

如果今后法律法规发生变化,又或者市场推出更具权威、且更能体现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2019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2019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	37,851,308.40	90.15
	其中:股票	37,851,308.40	90.15
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	4,081,392.38	9.72
8	其他资产	56,392.93	0.13
9	合计	41,989,093.71	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合