

(上接 C3版)

客户服务电话:400-166-1188
网址: http://jr.fund.com.cn
(54) 恒信晋泽(北京)基金销售有限公司
注册地址:北京市顺义区东沙峪镇高富街 8 号 9 号楼 15 层 1809
法定代表人:闫京
联系人:王日明
联系电话:010-52855650
客户服务电话:400-6099-200
网址: www.xinjinfund.com
(55) 中期资产管理有限公司
注册地址:北京市朝阳区建国门外光华路 16 号 1 幢 11 层
办公地址:北京市朝阳区建国门外光华路 16 号 1 幢 2 层
法定代表人:路瑶
联系人:侯英建
联系电话:010-65807865
客户服务电话:010-65807609
网址: www.cifund.com
(56) 北京展恒基金销售有限公司
注册地址:北京市顺义区东沙峪镇高富街 6 号
办公地址:北京市朝阳区华严北里 2 号 2 号楼 215A
法定代表人:闫振杰
联系人:马林
联系电话:010-62020888-7024
客户服务电话:4008188000
网址: www.myfund.com
(57) 中国国际期货有限公司
注册地址:北京市朝阳区建国门外光华路 14 号 1 层 L2、9 层、11 层、12 层

办公地址:北京市朝阳区麦子店西路 3 号新恒基国际大厦 15 层
法定代表人:王兵
联系人:赵森
联系电话:010-59539864
客户服务电话:95162,400-8888-160
网址: www.cifco.net
(58) 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 712 号
法定代表人:梁睿
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
(59) 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 CS 栋汇付天下总部大楼 2 楼
法定代表人:冯修敏
联系人:陈云升
联系电话:021-33323999-5611
客户服务电话:400-820-2819
网址: fund.91fund.com
(60) 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 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:胡学勤
联系人:宁宇宇
联系电话:021-20665952
客户服务电话:4008219031
网址: www.lufunds.com
(61) 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 楼 3 层
法定代表人:燕斌
联系人:陈东
联系电话:021-52822063
客户服务电话:4000-466-788
网址: www.68ficha.com
(62) 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
客户服务电话:4000 178 000
网址: www.vstonewealth.com
(63) 深圳瑞齐基金销售有限公司
注册地址(办公地址):深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦 35 层 01B、02、03、04 单元

法定代表人:刘鹏宇
联系人:刘勇
联系电话:0755-83999007-8814
客户服务电话:0755-83999007
网址: www.lufund.com
(64) 北京钱景基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012
办公地址:北京市海淀区丹棱街 6 号丹棱 SOHO 大厦 1008
法定代表人:赵荣春
联系人:陈剑伟
联系电话:010-57418813
客户服务电话:400-893-6885
网址: www.qianjing.com
(65) 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
客户服务电话:400-921-1755
网址: www.leadfund.com.cn
(66) 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:黄敏娟
联系电话:020-89629099
客户服务电话:020-89629066
公司网址: www.yingmi.com
(67) 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一号新华社第三工作区 A 座 5 层
法定代表人:钱昊昊
联系人:孙雯
联系电话:010-59336519
客户服务电话:4008-909-998
公司网址: www.jnlc.com
(68) 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
客户服务电话:400-619-9059
网址: www.hcjd.com
(69) 大泰金石基金销售有限公司
注册地址(办公地址):上海市浦东新区峨山路 505 号东方大一大厦 15 楼
法定代表人:袁勇明
联系人:何宇宁
联系电话:13917252742
客户服务电话:400-928-2266
网址: www.vstonewealth.com
(70) 深圳市金斧子基金销售有限公司
注册地址: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
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 7 层
法定代表人:赖启军
联系人:刘斯微
联系电话:0755-29330513
客户服务电话:400-930-0660
网址: www.jfzq.com
(71) 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 2 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:徐彦宇
联系电话:021-51327185
客户服务电话:400-821-0203
网址: www.52fund.com.cn
(72) 北京新浪仓石基金销售有限公司
注册地址(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:010-62764045
客户服务电话:010-62765369
网址: www.xincai.com
(73) 北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区高亮桥东三街 7 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:徐伊宁
联系电话:010-89189285
客户服务电话:95118/400-088-8816

网址: http://fund.jd.com
(76) 南京苏宁基金销售有限公司
注册地址(办公地址):南京玄武区苏宁大道 1-5 号
法定代表人:陈海燕
联系人:赵颖
联系电话:18551602256
客户服务电话:95177
网址: www.snjin.com
(77) 泛安财富(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
法定代表人:杨健
联系人:李海燕
联系电话:010-65309516
客户服务电话:400-673-7010
网址: www.jianfortune.com
(78) 上海鸿湾基金销售有限公司
注册地址(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:戴新蓉
联系人:朱学勇
联系电话:021-20530012
客户服务电话:400-820-1515
网址: www.zhongtongfund.com
(79) 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高南路 799 号 3 号楼 9 楼
法定代表人:兰奇
联系电话:021-60818588
客户服务电话:400-66-95156
网址: www.tonghuafund.com
(80) 上海控财基金销售有限公司
注册地址(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:孙琦
联系电话:021-50810687
客户服务电话:021-50810673
网址: www.wacaijin.com
(81) 上海煜盛基金销售有限公司
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 1503 室
法定代表人:王翔
联系人:李关洲
联系电话:021-65370077
客户服务电话:400-820-5369
网址: www.yuevifund.com.cn
(82) 北京蛋卷基金销售有限公司
注册地址(办公地址):北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507
法定代表人:钟奕斐
联系人:袁庆旋
联系电话:010-61840688
客户服务电话:4000-618-518
网址: www.danjuanapp.com
基金管理人可以根据情况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增加或者减少其销售城市、网点,并另行公告。

(二)登记机构
名称:摩根士丹利华鑫基金管理有限公司
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
法定代表人:YU HUA(于华)
联系人:赵旭
电话:(0755)88318709
(三)出具法律意见书的律师事务所
名称:北京国枫凯文律师事务所
注册地址:北京市西城区金融大街一号楼写字楼 A 座 12 层
办公地址:北京市西城区金融大街一号楼写字楼 A 座 12 层
负责人:张利国
联系人:徐秋迪
电话:010-66090088
经办律师:张清伟、殷长龙
(四)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:021-23231819
联系人:曹伟敏
经办注册会计师:许康玮、周伟敏

四、基金的投资
五、基金的投资目标
六、基金的投资范围
七、基金的投资策略
八、基金的投资策略

(一)投资策略
1. 大类资产配置策略
本基金采取积极的大类资产配置策略,通过宏观策略研究,对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪,决定大类资产配置比例。
在大类资产配置过程中,本基金主要考虑以下三类指标:
(1)宏观经济方面:季度 GDP 增速、消费价格指数、采购经理人指数、月度工业增加值、工业增加值、月度进出口数据以及汇率等因素;
(2)宏观经济政策方面:财政政策、货币政策等;
(3)市场流动性方面:市场资金的供需等。
2. 股票投资策略
(1) 经济生活相关股票的界定
在经济结构转型、人民生活水平和各项需求不断提升的背景下,只有提供的产品和服务能够不断提升民众生活品质的企业才会更有长久的生命力,其股票的投资价值也更为明显。
本基金重点关注那些提供的产品或服务能够切实提升民众生活品质的企业,这些产品和服务包括但不限于:医疗保健、衣食住行、文化服务、旅游服务、金融服务、环境保护、安全服务等以及其它由新技术所催生的产品和服务。
(2) 选股策略
本基金主要采取“自下而上”的选股策略,精心挖掘那些具有竞争优势和估值优势的优质上市公司,通过对上市公司品牌力、执行力、财务状况、管理层、管理体制的分析,仔细甄别出高品质公司的各项关键,判断公司发展趋势,精选出未来发展前景看好且有助于推动人民生活品质提升的上市公司股票进行投资,在严格控制投资风险的前提下,追求基金资产长期稳定增值。
此外,本基金重点关注和选择具有成长性的股票,那些收益增长潜力尚未完全反映在目前股价上的股票构成了我们投资组合的基础。在我们看来,独特的产品领域、特有的生产技术、出色的财务状况、良好的企业管理和领先的行业地位是驱动成长的关键因子,也是我们选择股票的最重要的观察指标。
本基金将依靠定量与定性相结合的方法:
1) 定量的方法包括分析相关的财务指标和市场指标,选择财务健康、成长性良好、估值合理的股票。具体分析指标为:
I. 成长指标:
-- 预期未来两年主营业务收入;
-- 主营业务收入复合增长率等;
II. 盈利指标:
-- 毛利率
-- 净利率
-- 净资产收益率等;
III. 价值指标:PE、PB、PEG、PS 等。
2) 定性的方法则是结合本基金研究团队的案头研究和实地调研,深入分析企业的基本面和长期发展前景,精选符合以下一项或数项定性判断标准的股票:
I. 公司在相关领域渠道、品牌、技术或上下游产业链等护城河,业务创新体系顺畅,进入壁垒高;
II. 公司是细分行业的龙头企业,即在细分市场中市场占有率及盈利能力综合指标位居前列的企业,也包括快速增长或长期将成为行业龙头的企业;
III. 公司拥有一项管理技术驱动的经营团队,治理结构较为完善,并制定了对于管理层有效激励约束的薪酬制度。
IV. 经营管理机制灵活,能根据市场变化及时调整经营策略,并充分考虑了产业发展的规律和企业的竞争优势;已形成或初步形成较完备的生产管理、成本管理、薪酬管理、技术开发管理、营销管理的制度体系。
3. 债券投资策略
本基金将结合宏观经济变化趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素,运用利率预期、久期管理、收益率曲线等投资管理策略,权衡预期收益与市场流动性相协调和调整债券组合,在追求投资收益的同时兼顾债券资产的流动性和安全性。
久期策略是指通过对宏观面、货币和财政政策、市场结构变化等的分析,可以预测整个债券市场的下一步趋势,确定债券组合的久期;类属配置是分析不同债券类别包括国债、企业债、金融债和可转债债券未来的不同表现,同时可以确定在不同市场上交易的不同类型、不同到期期限债券的预期价格,据此可以发现市场的不平衡情况,确定债券的类属配置;个券选择是指通过对比个券的久期、到期收益率、信用等级、税收因素等其他决定债券价值的因素,确定个券的投资价值并精选个券。

4. 权证投资策略
本基金在确保与基金投资目标相一致的前提下,通过对权证的证券的基本面研究,并结合权证定价模型估计权证价值,本着谨慎和风险可控的原则,为取得与承担风险相称的收益,投资于权证。
依据现代金融投资组合理论,计算权证的理论价值,结合对权证的证券的基本面进行分析,评估权证投资价值;同时结合对未来走势的判断,充分评估权证的风险和收益特征,在严格控制风险的前提下,谨慎进行投资。

(二)投资决策程序
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
本基金管理人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,并对基金投资进行授权,对基金的投资进行总体把控,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
基金经理根据投资决策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投资建议,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
投资风险管理工作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;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。
本基金管理人通常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决策程序,并在更新的招募说明书中公告。

九、基金的业绩比较基准
依据本基金基金合同的约定,经与相关基金托管人协商一致,并报中国证监会备案,自 2015 年 9 月 29 日起,本基金的业绩比较基准变更为:
85%沪深 300 指数收益率+15%标普中国债券指数收益率
本基金股票投资部分的业绩比较基准是沪深 300 指数,债券投资部分的业绩比较基准是标普中国债券指数。
沪深 300 指数是沪深证券交易所首次联合发布的反映 A 股市场整体走势的指数,由中证指数公司编制和维护,是在上海和深圳证券市场中选取 300 只 A 股作为样本编制而成。该指数样本对沪深市场的覆盖率高,具有良好的市场代表性,投资人可以方便地从报纸、互联网等财经媒体中获得。同时,该指数编制方法清晰透明,具有独立性和良好的市场流动性;与市场整体表现具有较高的相关性,且指数的历史表现强于市场平均收益水平,适合作为本基金的权益投资部分业绩基准。
标普中国债券指数是中信标普指数信息服务公司所开发的债券系列指数之一,该系列指数包括 6 只固定收益指数,分别跟踪中国政府债、企业债、金融债、服务债、工业债和公用事业债的业绩表现以及具有隐含意义的全球债指数。标普中国债券指数旨在跟踪中国的政府债、企业债、金融债、服务债、公用事业债和工业债券市场,它涵盖了在上海证券交易所和深圳证券交易所上市的债券。纳入标普中国债券指数的债券的信用评级都在投资级以上。适合作为本基金的固定收益投资部分业绩基准。

此外,本基金按照预期的大类资产配置比例设置了业绩基准的权重。长期看,业绩基准中的资产配置比例基本可反映出本基金的风险收益特征。
如果上述资产配置停止计算编制或更改名称,或者今后法律法规发生变化,又或者市场推出更具权威、且更能表征本基金风险收益特征的指数,则本基金管理人将视情况与基金托管人协商一致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,并及时公告并报备证监会备案,同时在更新的招募说明书中列示。
上述事项已于 2015 年 9 月 29 日在指定媒体上公告。

十、基金的风险收益特征
本基金为股票型基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金,属于证券投资基金中较高风险、较高预期收益的基金品种。

十一、基金的投资组合报告
基金管理人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。
基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金基金合同约定,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	439,686,917.89	93.77
	其中:股票	439,686,917.89	93.77
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	银行承兑和结算备付金	25,706,732.96	5.48
8	其他资产	3,524,344.64	0.75
9	合计	468,917,995.49	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	--	--
B	采矿业	--	--
C	制造业	250,238,540.08	53.71
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	1,119,118.00	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	--	--
H	住宿和餐饮业	--	--
I	信息技术、软件和信息技术服务业	62,994,714.94	13.52
J	金融业	106,104,159.87	22.78
K	房地产业	15,239,125.00	3.27
L	租赁和商务服务业	--	--
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	3,991,260.00	0.86
R	文化、体育和娱乐业	--	--
S	综合	--	--
	合计	439,686,917.89	94.38

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	002994	比亚迪	645,126	34,507,789.74	7.41
2	002376	新北洋	1,782,877	31,467,779.05	6.75
3	600030	中信证券	980,040	24,284,400.00	5.21
4	002773	恒汇药业	454,400	23,138,048.00	4.97
5	002212	南洋股份	1,264,993	21,783,179.46	4.68
6	601336	新华保险	390,900	20,939,100.00	4.49
7	000661	长春高新	65,100	20,636,049.00	4.43
8	600837	海南橡胶	1,287,900	18,069,237.00	3.88
9	000016	北药股份	1,767,900	17,908,827.00	3.84
10	300295	顺络电子	1,193,000	15,306,190.00	3.29

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序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. 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投资。
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
根据本基金基金合同规定,本基金不参与股指期货交易。
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规定,本基金不参与股指期货交易。
10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
10.1 本期国债期货投资策略
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经山东新北洋信息技术股份有限公司(以下简称“新北洋”)和新华人寿保险股份有限公司(以下简称“新华保险”)以外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。
2018 年 9 月,新北洋收到中国证监会济南监管局下发的《关于对山东新北洋信息技术股份有限公司采取出具警示函措施的决定》(〔2018〕60 号),对其内幕信息知情人登记不完整和未制作重大事项进程备忘录等问题采取出具警示函的监督管理措施。
2018 年 10 月,中国银保监会发布《中国银保监会派出机构现场检查行政处罚决定书》(银保监处罚决字〔2018〕1 号),对新华保险欺瞒投保人、编制提供虚假资料,未按流程使用批单或者备案的保险费率等违法违规行为,处以罚款。
本基金投资新北洋(002376)和新华保险(601336)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,认为上述事件对新北洋和新华保险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未超出基金合同规定的备选股票库。
11.3 其他资产构成

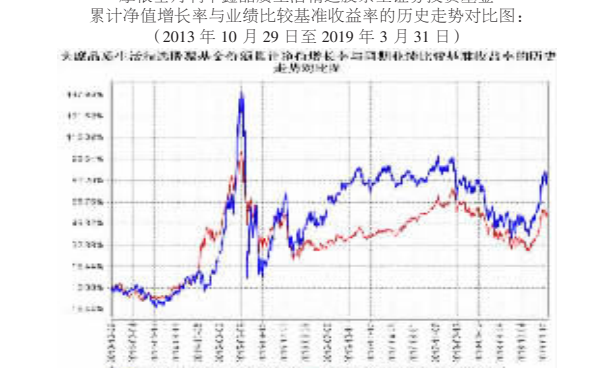
序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	305,406.63
2	应收证券清算款	2,914,979.68
3	应收股利	--
4	应收利息	7,191.50
5	应收申购款	296,766.83
6	其他应收款	--
7	待摊费用	--
8	其他	--
9	合计	3,524,344.64

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换债券。
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 2019 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对比表:

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	业绩比较基准收益标准差④	①-③	②-④
2013 年 10 月 29 日至 2013 年 12 月 31 日	-3.00%	1.02%	-1.40%	0.97%	-1.60%	0.05%
2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	3.51%	1.28%	44.72%	1.04%	-41.21%	0.24%
2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	70.02%	3.18%	6.74%	2.11%	63.28%	1.07%
2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	5.86%	1.74%	-9.11%	1.19%	14.97%	0.55%
2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	5.20%	0.79%	18.26%	0.54%	-13.06%	0.25%
2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	-24.57%	1.52%	-20.88%	1.14%	-3.69%	0.38%
自基金合同生效日起至 2019 年 3 月 31 日	85.10%	1.85%	60.83%	1.30%	24.27%	0.55%

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
摩根士丹利华鑫品质生活精选股票型证券投资基金
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:
(2013 年 10 月 29 日至 2019 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事务所、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 1.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下:
H = E × 1.5% × 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,由托管人根据与管理人核对一致的财务数据,自动在月初 5 个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付,管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。费用自动扣划后,管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系托管人协商解决。
(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 × 0.25% × 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,由托管人根据与管理人核对一致的财务数据,自动在月初 5 个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付,管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。费用自动扣划后,管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系托管人协商解决。
上述 1、2 基金费用的种类中第 3-8 项费用,根据有关法律法规及协议约定,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)与基金销售有关费用
1. 申购费用
投资者在一天之内如果有多笔申购,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。
本基金通过对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金客户及依法设立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益分配的补充养老金,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、企业年金计划以及集合计划。如将养老金客户申购基金,需向基金管理人提供有效的养老金客户证明,并经基金管理人审核后,方可享受养老金客户费率。
通过基金管理人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:

申购金额(M)	申购费率
M < 100 万元	0.60%
100 万元 ≤ M < 500 万元	0.40%
M ≥ 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)
