

更新)摘要

序号	债券品种	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
	企业短期融资券	-	-

6	中微有限			-	-
7	同利信			6,970,831.10	11.69
8	其他				
9	合计			6,970,831.10	11.69

截至期末按公允价值计量且其变动计入损益的大宗持有的前五名金融资产

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值 (元)	占期末资产总额比例 (%)
1	110005	平安转债	31,910	3,154,203.50	5.29
2	100020	南钢转债	21,460	1,928,824.80	3.23
3	100015	石药转债	18,440	1,867,792.80	3.17

期末按公允价值计量的金融资产公允价值变动损益前五名金融资产公允价值变动损益

本基金为境内人民币市场开放式证券投资基金。

报告期内本基金投资的前十名证券中未持有中国上市公司发行的可转债和资产支持证券。报告期内本基金投资的前五名基金均为公募基金，且符合中国证监会规定的可投资基金类别。

报告期内本基金投资的股票资产净值比例大于等于规定比例的股票投资明细

报告期内本基金投资的债券资产净值比例小于等于规定比例的债券投资明细

报告期内本基金投资的股指期货交易情况说明

(1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓情况和损益说明

报告期内本基金未参与股指期货交易。

(2) 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期末符合合同约定，本基金不参与股指期货交易。

(3) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1、本基金报告期内未投资国债期货。

2、报告期内本基金投资的国债期货持仓情况和损益说明

报告期内本基金未参与国债期货交易。

3、报告期末本基金投资的国债期货持仓情况和损益说明

[illegible]

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	58,969.62
2	应收证券清算款	2,119,931.31
3	应收股利	-
4	应收利息	38,503.28
5	应收中融款	14,029.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

(9) 合计				2,231,413.45	
4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细					
序号	债券代码	债券名称	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)	
1	110020	南山转债	1,928,824.80	3.23	
2	110015	石化转债	1,887,702.80	3.17	
5) 报告期末前十名股票持仓存在流通受限情况的说明					
序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明

1	020063	泓志软件	3,648,914.00	6.12	重大事项停牌		
十二、基金的投资							
本基金管理人依照相关法规、基金合同、投资策略等原则进行管理和运用基金资产，但不保证基金一定获利，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，投资者在投资前应认真阅读本基金的招募说明书。							
自基金合同生效至 2014 年 12 月 31 日止，基金资产净值及基金份额净值如下：							
	阶段	净值增长 率	净值增长率 差益	业绩比较基准 差益	业绩比较基准点 差益	①-③	②-④
2014 年 6 月 26 日至 2014 年 12 月 31 日		-6.60%	0.69%	-21.96%	1.00%	15.36%	-0.31%
2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		-6.77%	0.09%	-4.62%	1.00%	-2.15%	-0.07%

2006年1月1日至2006年12月31日	-0.36%	1.20%	81.57%	1.00%	-15.21%	0.20%
2007年1月1日至2007年12月31日	128.02%	2.05%	80.15%	1.65%	47.87%	0.40%
2008年1月1日至2008年12月31日	-66.42%	2.42%	-52.01%	2.15%	-14.41%	0.27%
2009年1月1日至2009年12月31日	39.04%	1.57%	62.78%	1.45%	-23.74%	0.12%
2010年1月1日至2010年12月31日	-0.89%	1.34%	-6.18%	1.09%	5.29%	0.25%

自2019年12月31日至2020年3月31日	-30.03%	0.93%	-18.28%	0.91%	-11.75%	0.02%
自2020年1月1日至2020年3月31日	5.71%	0.96%	9.22%	1.10%	-3.51%	-0.14%
自2020年2月1日至2020年2月28日	-7.76%	0.89%	-1.50%	0.66%	-6.26%	0.23%
自2020年3月1日至2020年3月31日	11.02%	1.11%	-1.91%	0.77%	12.93%	0.34%
自2020年3月1日至2020年3月31日	13.08%	1.53%	59.27%	1.37%	-46.19%	0.16%
基金合同生效日至2020年3月31日	-1.78%	1.65%	-7.02%	0.71%	5.24%	0.34%

注：1、本基金自2020年3月31日起修改了基金合同中基金资产定义及投资比例，并相应调整了基金业绩比较基准。

基金合同规定基金资产的业绩比较基准计算公式为：

$$基准收益率 = 中证红利指数收益率 \times 75\% + 中国国债收益率 \times 25\% + 银行活期存款利率 \times 5\%;$$

其中，中证红利指数收益率以中证红利指数收益率 X_1 表示，中国国债收益率以 X_2 表示，银行活期存款利率以 X_3 表示。

基金资产的构成主要有三个部分：股票资产、固定收益资产和现金资产。本基金投资于股票资产占基金资产净值的比例不低于 60%，投资于固定收益资产占基金资产净值的比例不高于 35%，现金资产占基金资产净值的比例不低于 5%。

本基金在投资股票资产时，将综合考虑行业景气度、行业估值、行业成长性、行业集中度、行业政策等因素，选择具有良好发展前景的行业进行投资。在投资固定收益资产时，将综合考虑信用风险、流动性风险、利率风险等因素，选择具有良好发展前景的固定收益资产进行投资。在投资现金资产时，将综合考虑流动性风险、利率风险等因素，选择具有良好发展前景的现金资产进行投资。

本基金在投资过程中，将严格遵守基金合同关于投资范围、投资策略、投资比例等方面的规定，确保基金资产的安全和增值。同时，本基金也将根据市场变化和基金资产的表现，适时调整投资策略，以最大限度地保护基金份额持有人的利益。

度, 再应用统计计算的方式得到基准指数的时间序列。

③ 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

自基金合同生效以来本基金合同规定的基金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

摩根士丹利华鑫鑫利中证红利指数

基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的历史走势对比图

(2004年3月26日至2012年3月4日)



基金净值增长率

业绩比较基准收益率

[illegible][illegible]

③ 基金托管人的管理费：

$$H=1.50\% \times \text{当年天数}$$

$$H$$
 为每日应付的基金管理费；

$$E$$
 为前一日的基金资产净值。
 基金托管管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人于次月的前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。
 ④ 基金托管人的托管费：

$$H=0.25\% \times \text{当年天数}$$

$$H$$
 为每日应付的基金托管费；

$$E$$
 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，由基金托管人于次月的前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

[illegible]

截至2017年1月1日，对于通过本公司直销中心申购本基金的老客户实施特定申购费率。老客户指非养老金基金业务依法设立并有效存续的法人或其他组织，且为符合法律法规规定的合格投资者，因认购或申购基金份额而持有该基金份额的客户。

计划于2017年1月1日起，按照下列标准对非养老金基金业务合格投资者可以享有的基金优惠费率、基金管理人对已到期赎回费更新时或发生其他影响养老金基金客户服务，并按规定向中国证监会备案。

基金管理人确定的直销中心申购本基金基金金额对应的养老金客户申购费率如下表：

申购金额	申购费率
万元以下	0.6%
1万元-5万元	0.4%
5万元 以上	每笔1000元

基金资产外的其他投资者申购本基金基金份额申购费率见下表：	申购费率
1. 1000元以下	1.5%
2. 1000元（含）-5000元	1.0%
3. 5000元（含）以上	每笔1000元
2) 申购费用计算方式	
申购金额=申购金额/(1+申购费率)	
申购费用=申购金额-申购金额	
赎回费	

赎回费用由赎回人承担,所收取的赎回费归基金财产,60%用于支付注册登记费及其他必要的手续费,费率表如下:	赎回费率
持有基金份额期限	
7天以内	0.5%
7至30天	0.25%
30天以上	0%
2.赎回费计算方法	
赎回金额=赎回份数×赎回价格	
赎回费用=赎回金额×赎回费率	

基金转换费用包括转出基金的赎回费用和转入基金的申购补差两部分组成,具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率高低及持有期限长短而定。基金转换费用按基金金额乘以基金转换费率计算,计算方法如下:

转出基金赎回的金额=基金金额×赎回费率

转出基金赎回的金额=基金金额×基金赎回费率

申购补差费用=转出基金赎回的金额×(申购补差费率)÷(1+申购补差费率)

申购补差费用=转出基金赎回的金额×申购补差费率

基金转换费用=赎回费用+申购补差费用

基金转换费用不得低于 0 元。赎回费用不适用不同申购费率,基金以转入基金对应的转出基金申购费率,转入基金申购费率计算。

基金转换费用最高不得超过 25% 的转出基金资产。

基金转换费用由基金持有人承担,基金转换费用在基金管理人网站、招募说明书及基金公告中列明,按照相关法律法规的规定费率执行,对于通过本公司网上交易、直销渠道购买及定投的基金持有人,按照本公司公告的相应基金申购费率执行。

[illegible]

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內容,更新了基金托管人的有关資料
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	十、基金的投资	更新了截至上一期投资组合报告期末,即截至2014年3月31日的基金投资组合报告
5	十一、基金的业绩	更新了基金业绩的说明,截至2014年3月31日的基金投资收益情况
6	十五、基金的费用和收益	更新了“为基金销售有关費用”中“通过对申购中心申请的养老金客户实施申购中优惠費率的相关说明”

7	二十二、对基金管理人持有的金融资产	根据最新情况对二十二、对基金管理人持有的金融资产信息
8	二十三、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
二〇一四年五月九日

摩根士丹利华鑫基金管理有限公司
二〇一四年五月九日