

摩根士丹利华鑫资源优选混合型
证券投资基金（LOF）
招募说明书（更新）

（2016年第2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：中国光大银行股份有限公司

重要提示

摩根士丹利华鑫资源优选混合型证券投资基金(LOF)（以下简称“本基金”）于2005年5月9日经中国证券监督管理委员会证监基金字[2005]79号文《关于同意巨田资源优选混合型证券投资基金募集的批复》核准公开募集。本基金的基金合同于2005年9月27日正式生效。本基金为上市契约型开放式基金。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。

本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的投资价值、市场前景和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

证券投资基金（以下简称“基金”）是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资人购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

基金在投资运作过程中可能面临各种风险，既包括市场风险，也包括基金自身的管理风险、技术风险和合规风险等。巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险，当基金在开放期发生巨额赎回时，投资人将可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资人在获得基金投资收益的同时，亦承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回本基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，信用风险，本基金的特定风险等。

基金分为股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金等不同类型，投资人投资不同类型的基金将获得不同的收益预期，也将承担不同程度的风险。一

一般来说，基金的收益预期越高，投资人承担的风险也越大。本基金为混合型基金，理论上其长期平均风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

投资有风险，投资者认购（或申购）基金时应认真阅读本基金的基金合同、招募说明书等法律文件，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断本基金是否和投资者的风险承受能力相适应，同时，理性判断市场，对认购（或申购）本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立、谨慎决策。

投资者应当通过本基金管理人或销售机构购买和赎回基金。本基金在募集期内按1.00元面值发售并不改变基金的风险收益特征。投资者按1.00元面值购买基金份额以后，有可能面临基金份额净值跌破1.00元、从而遭受损失的风险。

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预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为2016年9月27日，有关财务数据和净值表现截止日为2016年9月30日（财务数据未经审计）。

目录

一、绪言	1
二、释义	1
三、基金管理人	5
四、基金托管人	13
五、相关服务机构	16
六、基金的募集	37
七、基金合同的生效	38
八、基金份额的上市交易	38
九、基金份额的申购和赎回	39
十、基金份额的登记、非交易过户、系统内转托管和跨系统转登记	46
十一、基金转换	47
十二、基金的投资	48
十三、基金的业绩	57
十四、基金的财产	58
十五、基金资产的估值	60
十六、基金的收益分配	65
十七、基金的费用与税收	66
十八、基金的会计与审计	69
十九、基金的信息披露	70
二十、风险揭示	73
二十一、基金合同的终止与基金财产清算	78
二十二、基金合同的内容摘要	79
二十三、基金托管协议的内容摘要	89
二十四、对基金份额持有人的服务	96
二十五、其他应披露事项	97
二十六、招募说明书的存放及查阅方式	99
二十七、备查文件	100

一、绪 言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）及相关法律法规和《摩根士丹利华鑫资源优选混合型证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，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》、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。

二、释 义

在本招募说明书中除非文义另有所指，下列词语具有以下含义：

基金或本基金：	指摩根士丹利华鑫资源优选混合型证券投资基金（LOF）
基金合同或本基金合同：	指《摩根士丹利华鑫资源优选混合型证券投资基金（LOF）基金合同》及基金合同当事人对其不时做出的修订
招募说明书：	指《摩根士丹利华鑫资源优选混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》以及基金管理人在基金合同生效后每6个月结束之日起45日内进行的对招募说明书的更新
基金份额发售公告：	指《巨田资源优选混合型证券投资基金（LOF）基金份额发售公告》
托管协议：	指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《摩根士丹利华鑫资源优选混合型证券投资基金（LOF）托管协议》及协议当事人对其不时做出的补充及修订

《证券法》:	指《中华人民共和国证券法》
《基金法》:	指《中华人民共和国证券投资基金法》
《运作办法》:	指《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
《销售办法》:	指《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
《信息披露办法》:	指《证券投资基金信息披露管理办法》
《业务规则》:	指《深圳证券交易所上市开放式基金业务规则》及颁布机关对其不时做出的修订
中国证监会:	指中国证券监督管理委员会
银行业监管机构:	指中国银行业监督管理委员会、中国人民银行或其他经国务院授权的机构
基金合同当事人:	指受基金合同约束,根据基金合同享受权利并承担义务的基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
基金管理人:	指摩根士丹利华鑫基金管理有限公司
基金托管人:	指中国光大银行
基金销售代理人:	指符合中国证监会有关规定的条件并与基金管理人签订了销售服务代理协议,代为办理基金销售服务业务的机构,简称代销人
销售机构:	指基金管理人和基金销售代理人
注册登记业务:	指基金登记、存管、过户、清算和结算业务,具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、基金交易确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等
注册登记人:	指办理本基金注册登记业务的机构。本基金的注册登记人是中国证券登记结算有限责任公司
个人投资者:	指依据中华人民共和国有关法律法规及其他有关规定可以投资于证券投资基金的自然人投资者

机构投资者：	指依据中华人民共和国有关法律法规及其他有关规定可以投资于证券投资基金的法人、社会团体或其他组织
合格境外机构投资者：	指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》规定的条件，经中国证监会批准投资于中国证券市场，并取得国家外汇管理局额度批准的中国境外基金管理机构、保险公司、证券公司以及其他资产管理机构
基金份额持有人：	指依法或依基金合同、招募说明书取得基金份额的投资人
元：	指人民币元
基金合同生效日：	指本基金募集符合基金合同规定的条件，并获得中国证监会书面确认之日
基金合同终止日：	指基金合同规定的终止事由出现后按照基金合同规定的程序并经中国证监会批准终止基金合同的日期
开放日：	指销售机构为投资人办理基金申购、赎回等业务的工作日
基金募集期：	指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不超过3个月
基金存续期：	指基金合同生效至基金合同终止，基金存续的不定期之期限
工作日：	指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日
T 日：	指认购、申购、赎回或其他交易的申请日
T+n 日：	指自T 日起第n 个工作日（不包含T 日）
日/天：	指公历日
月：	指公历月
认购：	指在基金募集期内，投资人购买本基金份额的行为
申购：	指在基金合同生效后投资人申请购买本基金份额的行为
赎回：	指基金份额持有人按基金合同规定的条件要求基金管理人购回基金份额的行为
巨额赎回：	指基金单个开放日，基金净赎回申请超过上一日基金总份额10%时的情形
基金转换：	指基金份额持有人按基金管理人规定的条件申请将其持有的某一基金（包括本基金）的基金份额转为基金管理人管理的、

	由同一注册登记人办理注册登记的其他基金（包括本基金）的基金份额的行为
销售场所：	指场外销售场所和场内交易场所，分别简称场外和场内
场外：	指通过深圳证券交易所外的销售机构进行基金份额认购、申购和赎回的场所
场内：	指通过深圳证券交易所内的会员单位进行基金份额认购、申购、赎回和上市交易的场所
注册登记系统：	指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统
证券登记结算系统：	指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统
发售：	指场外认购和场内认购
场外认购：	指基金募集期内投资人通过场外销售机构申请购买本基金份额的行为
场内认购：	指基金募集期内投资人通过场内会员单位申请购买本基金份额的行为
日常交易：	指申购、赎回和上市交易
场内申购、赎回	指场内会员单位接受投资人委托向深圳证券交易所交易系统申报的基金份额的申购、赎回
上市交易：	指基金存续期间投资人通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为
系统内转托管：	指持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为
跨系统转登记：	指持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统间进行转登记的行为
基金收益：	指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息及其他合法收入
基金资产总值：	指基金所购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和

基金资产净值：	指基金资产总值减去基金负债后的价值
基金资产估值：	指计算评估基金财产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程
基金账户：	指基金注册登记人为投资人开立的记录其持有的基金份额及其变更情况的账户
基金交易账户：	指销售机构为投资人开立的记录其通过该销售机构买卖基金份额的变动及结余情况的账户
指定媒体：	指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站或其他媒体
不可抗力：	指任何无法预见、不能避免、无法克服的事件或因素，包括：相关法律、法规或规章的变更；国际、国内金融市场风险事故的发生；自然或无人为破坏造成的交易系统或交易场所无法正常工作、战争、动乱或瘟疫等

三、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

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）

成立时间：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

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。

孙辰健先生，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，花旗集团资产管理公司董事总经理，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，中国人寿养老保险公司副总经理，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，现任本公司综合管理和人力资源部总监、规划发展部总监、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、公司高管人员

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工作经历。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年证券基金行业工作经历。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年证券基金行业工作经历。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，历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、本基金基金经理简介

王大鹏先生，中山大学金融学博士，8年证券从业经历。曾任长春工业大学工商管理学院金融学专业教师，宝盈基金管理有限公司医药行业研究员。2010年12月加入本公司，现任研究管理部副总监、基金经理。2015年1月起担任本基金基金经理，2016年2月起任摩根士丹利华鑫沪港深新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

徐达女士，美国弗吉尼亚大学经济学和商业学学士，4年证券从业经历，2012年7月加入本公司，历任研究管理部研究员、基金经理助理。2016年6月起担任本基金基金经理。

本基金历任基金经理：冀洪涛先生，自本基金合同生效之日起至2008年4月管理本基金；徐强先生，2011年6月至2012年4月管理本基金；何滨女士，2008年4月至2013年8月管理本基金；卞亚军先生，2013年6月至2015年1月管理本基金；孙海波先生，2015年1月至2016年6月管理本基金。

5、投资决策委员会成员

主任委员：高潮生（代理），本公司总经理

副主任委员：王大鹏，研究管理部总监、基金经理

委员：李轶，助理总经理、固定收益投资部总监、基金经理；胡明，交易管理部总监

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

（三）基金管理人的职责

- 1、依法募集基金，办理基金份额的发售、申购、赎回、转换和登记事宜；
- 2、办理基金备案手续；
- 3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；
- 4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、编制季度、半年度和年度基金报告；
- 7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- 8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、按照规定召集基金份额持有人大会；

- 10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 12、有关法律法规、中国证监会规定的和基金合同约定的其他职责。

（四）基金管理人的承诺

1、基金管理人承诺严格遵守法律法规和基金合同，按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制全权处理本基金的投资。

2、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《中华人民共和国证券法》行为的发生；

3、基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，禁止基金财产用于下列投资或活动：

- （1）承销证券；
- （2）违反规定向他人贷款或者提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- （5）向基金管理人、基金托管人出资；
- （6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- （7）法律法规和中国证监会及基金合同禁止的其他活动。

上述禁止行为为引用当时有效的相关法律法规或监管部门的有关禁止性规定，如法律、行政法规或监管机构取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

4、基金管理人承诺严格遵守法律法规，建立健全内部控制制度，采取有效措施，禁止发生下列行为：

- （1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- （2）不公平地对待其管理的不同基金财产；
- （3）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- （4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- （5）法律法规、中国证监会及基金合同禁止的其他行为。

5、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律

法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下行为：

- （1）越权或违规经营；
- （2）违反《基金合同》或《托管协议》；
- （3）故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益；
- （4）在向中国证监会报送的资料中故意弄虚作假；
- （5）拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- （6）玩忽职守、滥用职权；
- （7）违反现行有效的有关法律、法规、规章、《基金合同》和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- （8）违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- （9）贬损同行，以抬高自己；
- （10）以不正当手段谋求业务发展；
- （11）在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- （12）法律法规、中国证监会及基金合同禁止的其他行为。

6、基金经理承诺

- （1）依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；
- （2）不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何其他第三人牟取不当利益；
- （3）不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- （4）不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

（五）基金管理人的内部控制制度

1、内部控制目标

- （1）保证基金管理人的经营运作严格遵守法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念；
- （2）防范和化解经营风险，提高经营管理效益，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，实现基金管理人的持续、稳定、健康发展；
- （3）确保基金、基金管理人应披露的信息真实、准确、完整、及时；

(4) 确保基金管理人成为一个决策科学、经营规范、管理高效、运作安全的持续、稳定、健康发展的基金管理公司。

2、内部控制原则

(1) 健全性原则。内部控制机制覆盖基金管理人的各项业务、各个部门和各级岗位，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

(2) 有效性原则。通过科学的内控手段和方法，建立合理的内部控制程序，维护内控制度的有效执行。

(3) 独立性原则。基金管理人各机构、部门和岗位职责保持相对独立，基金财产、基金管理人固有财产、其他财产的运作必须相互分离。

(4) 相互制约原则。基金管理人内部部门和岗位的设置须权责分明、相互制衡。

(5) 成本效益原则。基金管理人运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

3、内部控制体系

基金管理人的内部控制体系结构是一个分工明确、相互制约的组织结构，具体包括：

(1) 董事会负责决定基金管理人内部管理机构的设置、制定基金管理人基本管理制度，对确保基金管理人建立及维持适当而有效的内部控制负有最终责任。董事会下设的风险控制和审计委员会负责审核基金管理人内部控制制度、检查公司和基金运作的合法合规情况等事项，并向董事会汇报。

(2) 经营管理层负责组织设计公司的内部控制制度，拟订公司的基本管理制度和制定公司的部门业务规章，并确保公司的日常经营运作活动合法合规。

(3) 督察长负责监督检查基金管理人运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况，并依据相关规定可独立向董事会和中国证监会报告。

(4) 经营管理层下设的风险管理委员会协助经营管理层实施对各类业务和风险的总体控制以及解决公司内部控制中出现的问题。

(5) 风险管理部负责跟踪和报告投资管理中的市场风险，评价基金投资业绩，并根据风险收益情况及时提出改进意见，为投资业务的稳健发展提供支持。

(6) 监察稽核部独立于基金管理人其他部门和业务活动，对基金管理人内部控制制度、风险管理政策和措施的执行情况实行严格检查和及时反馈，并向督察长、风险管理委员会和经营管理层定期或不定期报告。

(7) 各业务部门及员工对风险管理负有直接责任。各业务部门负责人在权限范围内，执行公司的各项风险管理程序，负责本部门业务风险的识别、监控，对本部门的风险管理负全部责任。每一位员工均负有一线风险控制职责，负责把公司的风险管理理念和控制措施落实到每一个业务环节当中，并在发现风险隐患和问题时负有报告、反馈和改进的义务。

4、内部控制措施

（1）建立合理、完备、有效并易于执行的内部控制制度体系。基金管理人内部控制制度体系由不同层面的制度构成，按照其所管理的层次可以分为四个级别：第一级别是公司章程；第二级别是公司内部控制大纲；第三级别是公司基本管理制度；第四级别是公司各委员会、各部门根据业务需要制定的各种制度及实施细则等。基金管理人根据业务需要持续修订和更新各项制度，使其内部控制制度体系日趋完善。

（2）建立浓厚的风险管理文化。经营管理层牢固树立内控优先的风险管理理念，注重培养全体员工的风险防范意识，通过制度约束、学习培训使全体员工及时了解国家法律法规和公司规章制度，使风险管理意识深入人心，并贯穿到各个业务环节。

（3）建立严密有效的内控防线。依据自身经营特点，基金管理人建立起各岗位的自控与互控、相关部门之间的监督制衡、监察稽核部和督察长的独立监督等内控防线。

（4）建立并持续完善风险管理体系。基金管理人通过建立风险分类、识别、评估、报告及监督等程序，定期或不定期地对风险进行评估、预警，并通过清晰的汇报路径，使相关部门及经营管理层即时把握风险状况，及时、快速地采取风险控制措施。

（5）强化风险管理措施。随着业务发展及技术进步，基金管理人开始更多地采取系统化监控措施，增强风险管理的全面性、实时性和有效性。同时，采用数量化分析方法，提高风险管理的科学性。

5、基金管理人关于内部控制制度的声明

（1）本基金管理人确知建立、实施、维持和完善内部控制制度是本基金管理人董事会及管理层的责任；

（2）本基金管理人承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；

（3）本基金管理人承诺将根据市场环境的变化和业务的发展不断完善内部控制制度。

四、基金托管人

（一）基本情况

名称：中国光大银行股份有限公司

住所及办公地址：北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心

设立日期：1992 年 8 月 18 日

批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行，银复 1992[152]号

组织形式：股份有限公司

注册资本：404.3479 亿元人民币

法定代表人：唐双宁

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【2002】75 号

投资与托管部总经理：曾闻学

托管部门联系人：李宁

电话：（010） 63636363

传真：（010） 63639132

网址：www.cebbank.com

（二）基金托管部门及主要人员情况

法定代表人唐双宁先生，历任中国人民建设银行沈阳市分行常务副行长、中国人民银行沈阳市分行行长，中国人民银行信贷管理司司长、货币金银局局长、银行监管一司司长，中国银行业监督管理委员会副主席，中国光大（集团）总公司董事长、党委书记等职务。现任十二届全国人大农业与农村委员会副主任，十一届全国政协委员，中国光大集团股份公司董事长、党委书记，中国光大集团有限公司董事长，兼任中国光大银行股份有限公司董事长、党委书记，中国光大控股有限公司董事局主席，中国光大国际有限公司董事局主席。

行长张金良先生，曾任中国银行财会部会计制度处副处长、处长、副总经理兼任 IT 蓝图实施办公室主任、总经理，中国银行北京市分行行长、党委书记，中国银行副行长、党委委员。现任中国光大集团股份公司党委委员，兼任中国光大银行行长、党委副书记。

曾闻学先生，曾任中国光大银行办公室副总经理，中国光大银行北京分行副行长。现任中国光大银行股份有限公司投资托管部总经理。

（三）证券投资基金托管情况

截至 2016 年 6 月 30 日，中国光大银行股份有限公司托管国投瑞银创新动力股票型证券投资基金、国投瑞银景气行业证券投资基金、国投瑞银融华债券型证券投资基金、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、工银瑞信保本混合型证券投资基金、博时转债增强债券型证券投资基金、大成策略回报股票型证券投资基金、大成货币市场基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、光大保德信量化核心证券投资基金、光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金、国联安双佳信用分级债券型证券投资基金、泰信先行策略开放式证券投资基金、招商安本增利债券型证券投资基金、中欧新动力股票型证券投资基金(LOF)、国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金、农银汇理深证 100 指数增强型证券投资基金、益民核心增长灵活配置混合型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、兴业商业模式优选股票型证券投资基金、工银瑞信保本 2 号混合型发起式证券投资基金、国金通用沪深 300 指数分级证券投资基金、中加货币市场基金、益民服务领先灵活配置混合型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、鑫元一年定期开放债券型证券投资基金、江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元稳利债券型证券投资基金、国金通用鑫安保本混合型证券投资基金、鑫元合享分级债券型证券投资基金、鑫元半年定期开放债券型证券投资基金、东方红睿阳灵活配置混合型证

券投资基金、建信信息产业股票型证券投资基金、泓德优选成长混合型证券投资基金、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金、中融新动力灵活配置混合型证券投资基金、红塔红土盛金新动力灵活配置混合型证券投资基金、金鹰产业整合灵活配置混合型证券投资基金、国金通用鑫运灵活配置混合型证券投资基金、大成景裕灵活配置混合型证券投资基金、财通多策略精选混合型证券投资基金、鹏华添利宝货币市场基金、江信同福灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信耀钱包货币市场基金、大成景沛灵活配置混合型证券投资基金、易方达瑞选灵活配置混合型证券投资基金、中加心享灵活配置混合型证券投资基金、建信稳定丰利债券型证券投资基金、南方弘利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元兴利债券型证券投资基金、博时安泰 18 个月定期开放债券型证券投资基金、建信安心保本五号混合型证券投资基金、银华添益定期开放债券型证券投资基金、中欧强盈定期开放债券型证券投资基金、华夏恒利 6 个月定期开放债券型证券投资基金、易方达裕景添利 6 个月定期开放债券型证券投资基金、博时安怡 6 个月定期开放债券型证券投资基金、江信汇福定期开放债券型证券投资基金、鑫元双债增强债券型证券投资基金、工银瑞信瑞丰纯债半年定期开放债券型证券投资基金、富国泰利定期开放债券型发起式证券投资基金、大成景荣保本混合型证券投资基金、鹏华兴华定期开放灵活配置混合型证券投资基金共 64 只证券投资基金，托管基金资产规模 1,381.42 亿元。同时，开展了证券公司资产管理计划、专户理财、企业年金基金、QDII、银行理财、保险债权投资计划等资产的托管及信托公司资金信托计划、产业投资基金、股权基金等产品的保管业务。

（四）托管业务的内部控制制度

1、内部控制目标

确保有关法律法规在基金托管业务中得到全面严格的贯彻执行；确保基金托管人有关基金托管的各项管理制度和业务操作规程在基金托管业务中得到全面严格的贯彻执行；确保基金财产安全；保证基金托管业务稳健运行；保护基金份额持有人、基金管理公司及基金托管人的合法权益。

2、内部控制的原则

（1）全面性原则。内部控制必须渗透到基金托管业务的各个操作环节，覆盖所有的岗位，不留任何死角。

（2）预防性原则。树立“预防为主”的管理理念，从风险发生的源头加强内部控制，防患于未然，尽量避免业务操作中各种问题的产生。

（3）及时性原则。建立健全各项规章制度，采取有效措施加强内部控制。发现问题，及时处理，堵塞漏洞。

（4）独立性原则。基金托管业务内部控制机构独立于基金托管业务执行机构，业务操作人员和内控人员分开，以保证内控机构的工作不受干扰。

3、内部控制组织结构

中国光大银行股份有限公司董事会下设风险管理委员会、审计委员会，委员会委员由相关部门的负责人担任，工作重点是对总行各部门、各类业务的风险和内控进行监督、管理和协调，建立横向的内控管理制约体制。各部门负责分管系统内的内部控制的组织实施，建立纵向的内控管理制约体制。基金托管部建立了严密的内控督察体系，设立了风险管理处，负责证券投资基金托管业务的风险管理。

4、内部控制制度

中国光大银行股份有限公司基金托管部自成立以来严格遵照《基金法》、《中华人民共和国商业银行法》、《信息披露办法》、《运作办法》、《销售办法》等法律、法规的要求，并根据相关法律法规制订、完善了《中国光大银行证券投资基金托管业务内部控制规定》、《中国光大银行基金托管部保密规定》等十余项规章制度和实施细则，将风险控制落实到每一个工作环节。中国光大银行基金托管部以控制和防范基金托管业务风险为主线，在重要岗位（基金清算、基金核算、监督稽核）还建立了安全保密区，安装了录象监视系统和录音监听系统，以保障基金信息的安全。

（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据法律、法规和基金合同等的要求，基金托管人主要通过定性和定量相结合、事前监督和事后控制相结合、技术与人工监督相结合等方式方法，对基金投资品种、投资组合比例每日进行监督；同时，对基金管理人就基金资产净值的计算、基金管理人和基金托管人报酬的计提和支付、基金收益分配、基金费用支付等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的违反法律、法规和基金合同等规定的行为，及时以书面或电话形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

五、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

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

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01-04室

联系人：吴海灵

电话：(0755) 88318898

传真：(0755) 82990631

全国统一客服电话：400-8888-668

(2) 摩根士丹利华鑫基金管理有限公司北京分公司

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) 66155568-6100

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

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.msfnfunds.com.cn/etrading>

目前已开通建设银行、工商银行、农业银行、招商银行、银联通、汇付天下“天天盈”等支付渠道。支持汇付天下“天天盈”渠道支付以及支持银联通渠道支付的银行卡详见本公司官方网站（<http://www.msfnfunds.com.cn>）。以上支付渠道支持的银行卡均指银行借记卡，信用卡等贷记卡不支持购买基金。

全国统一客服电话：400-8888-668

客户服务信箱：Services@msfnfunds.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、销售机构

(1) 中国光大银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦

办公地址：北京市西城区太平桥大街25号A座6层财富管理中心

法定代表人：唐双宁

客户服务电话：95595（全国）

网址：www.cebbank.com

（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

（3）中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：周慕冰

电话：010-85108227

传真：010-85109219

客户服务电话：95599

网址：www.abchina.com

（4）中国银行股份有限公司

注册（办公）地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：田国立

客户服务电话：95566（全国）

网址：www.boc.cn

（5）中国建设银行股份有限公司

注册（办公）地址：北京市西城区金融大街 25 号

法定代表人：王洪章

客户服务电话：95533

网址：www.ccb.com

（6）交通银行股份有限公司

注册（办公）地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

联系电话：021-58781234

传真：021-58408483

客户服务电话：95559

网址：www.bankcomm.com

（7）招商银行股份有限公司

注册（办公）地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：李建红

客户服务电话：95555

网址：www.cmbchina.com

（8）中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 9 号文化大厦

法定代表人：李庆萍

客户服务电话：95558

网址：www.bank.ecitic.com

（9）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

（10）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：鲁承文

联系电话：021-50979378

客户服务电话：95511-3

网址：www.bank.pingan.com

（11）上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

客户服务热线：95528

公司网站：www.spdb.com.cn

（12）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

（13）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

（14）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

（15）中国银河证券股份有限公司

注册（办公）地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈有安

联系人：邓颜

联系电话：010-66568292

客户服务电话：4008-888-8888

网址：www.chinastock.com.cn

（16）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

（17）民生证券股份有限公司

注册（办公）地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-18层

法定代表人：余政

联系人：赵明

联系电话：（010）85127622

客户服务电话：4006-19-8888

网址：<http://www.msza.com>

（18）海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路98号

办公地址：上海市广东路689号海通证券大厦10楼

法定代表人：王开国

联系人：李笑鸣

联系电话：021-23219000

客户服务电话：95553

网址：www.htsec.com

（19）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、朱雅岚

联系电话：(021) 38676161

客户服务电话：95521

网址：www.gtja.com

(20) 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

(21) 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

(22) 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

(23) 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：尤习贵

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

(24) 中银国际证券有限责任公司

注册（办公）地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

法定代表人：许刚

联系人：李丹

联系电话：(021) 20328216

客户服务电话：400-620-8888

网址：www.bocichina.com

(25) 东方证券股份有限公司

注册（办公）地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 21 层-29 层

法定代表人：潘鑫军

联系人：胡月茹

联系电话：(021) 63325888

客户服务电话：95503

网址：www.dfzq.com.cn

(26) 湘财证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼

办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号标志商务中心 11 楼

法定代表人：林俊波

联系人：钟康莺

联系电话：(021) 68634518

客户服务电话：400-888-1551

网址：www.xcsc.com

(27) 华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场

法定代表人：周易

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

（28）中泰证券股份有限公司

注册（办公）地址：济南市经七路 86 号

法定代表人：李玮

联系人：王霖

联系电话：（0531）68889157

客户服务电话：95538

网址：www.qlzq.com.cn

（29）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

（30）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

（31）华龙证券股份有限公司

注册（办公）地址：甘肃省兰州市东岗西路 638 号财富大厦

法定代表人：李晓安

联系人：李昕田

联系电话：0931-8784656

客户服务电话：400-689-8888

网址：www.hlzqgs.com

（32）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：赵俊

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

（33）国元证券有限责任公司

注册（办公）地址：安徽省合肥市寿春路 179 号

法定代表人：蔡咏

联系人：李飞

联系电话：0551-62246298

客户服务电话：全国统一热线 95578，4008888777，安徽省内热线 96888

网址：www.gyzq.com.cn

（34）方正证券股份有限公司

注册（办公）地址：湖南长沙芙蓉中路 2 段华侨国际大厦 22-24 层

法定代表人：何其聪

联系人：邵艳霞

联系电话：（0731）85832507

客户服务电话：95571

网址：www.foundersc.com

（35）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

（36）中航证券有限公司

注册（办公）地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

法定代表人：杜航

联系人：史江蕊

联系电话：010-64818301

客户服务电话：400-8866-567

公司网址：www.avicsec.com

（37）安信证券股份有限公司

注册（办公）地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

法人代表人：牛冠兴

联系人：郑向溢

联系电话：（0755）82558038

客户服务电话：4008-001-001

网址：www.essence.com.cn

（38）中国中投证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层 01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23 单元

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层

法定代表人：高涛

联系人：刘毅

联系电话：（0755）82023442

客户服务电话：400-600-8008、95532

网址：www.china-invs.cn

（39）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：官少林

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

（40）国信证券股份有限公司

注册（办公）地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

联系人：周杨

联系电话：（0755）82130833

客户服务电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

（41）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

（42）国海证券股份有限公司

注册地址：广西南宁市滨湖路 46 号

办公地址：深圳市福田区竹子林四路紫竹七道 18 号光大银行大厦 30 楼

法定代表人：张雅锋

联系人：牛孟宇

联系电话：（0755）83709350

客户服务电话：95563

网址：www.ghzq.com.cn

（43）华西证券股份有限公司

注册（办公）地址：四川省成都市陕西街 239 号

法定代表人：杨炯阳

联系人：金达勇

联系电话：（0755）83025723

客户服务电话：400—8888—818

网址：www.hx168.com.cn

（44）世纪证券有限责任公司

注册（办公）地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 41/42 层

法人代表：卢长才

联系人：张婷

联系电话：(0755) 83199599

网址：www.csc.com.cn

（45）长城证券股份有限公司

注册（办公）地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人：黄耀华

联系人：刘阳

联系电话：0755-83516289

客户服务电话：400-6666-888

网址：www.cgws.com

（46）万和证券有限责任公司

注册地址：海南省海口市南沙路 49 号通讯广场二楼

办公地址：深圳市罗湖区笋岗东路 1002 号宝安广场 A 座 27 楼

法定代表人：朱治理

联系人：周小钰

联系电话：0755-88694888-857

客户服务电话：0755-25170332

网址：www.vanho.cn

（47）金元证券股份有限公司

注册地址：海南省海口市南宝路 36 号证券大厦 4 层

办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 17 层

法定代表人：陆涛

联系人：马贤清

联系电话：(0755)_83025022

客户服务电话：4008-888-228

网址：www.jyzq.cn

（48）德邦证券有限责任公司

注册地址：沈阳市沈河区小西路 49 号

办公地址：上海市浦东新区福山路 500 号“城建国际中心”26 楼

法定代表人：王军

联系人：罗芳

联系电话：(021) 68761616

网址：www.tebon.com.cn

(49) 广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）

办公地址：广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

联系电话：(020) 87555888

客户服务电话：95575

网址：www.gf.com.cn

(50) 华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层

法定代表人：黄金琳

联系人：张腾

联系电话：(0591) 87383623

客户服务电话：96326（福建省外请加拨 0591）

网站：www.hfzq.com.cn

(51) 东莞证券股份有限公司

注册（办公）地址：广东省东莞市可园南路 1 号金源中心 30 楼

法定代表人：张运勇

联系人：苏卓仁

联系电话：(0769) 22112062

客服电话：961130

网址：www.dgzq.com.cn

(52) 中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼 7 层、8 层

办公地址：深圳市华侨城深南大道 9010 号

法定代表人：黄扬录

联系人：李珍

联系电话：(0755) 82570586

客户服务电话：4001022011

网址：www.zszq.com

(53) 万联证券有限责任公司

注册（办公）地址：广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 楼

法定代表人：张建军

联系人：王鑫

联系电话：(020) 38286651

客户服务电话：400—8888—133

网址：www.wlzq.com.cn

(54) 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

(55) 国金证券股份有限公司

注册（办公）地址：成都市青羊区东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

联系人：刘婧漪、贾鹏

联系电话：028-86690057、028-86690058

客户服务热线：95310

网址：www.gjzq.com.cn

(56) 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

(57) 和讯信息科技有限公司

注册（办公）地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层

法定代表人：王莉

联系人：梁檐

联系电话：021-20835789

客户服务电话：400-920-0022

网址：licaike.hexun.com

(58) 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

基金买卖网 www.jjmmw.com

(59) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1栋202室

办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F

法定代表人：陈柏青

联系人：韩爱彬

联系电话：0571-26888888-37494

客户服务电话：4000-766-123

网址：www.fund123.cn

(60) 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>

(61) 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

(62) 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

(63) 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

（64）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

（65）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>

（66）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

（67）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

（68）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

（69）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

（70）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

（71）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

（72）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

（73）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

（74）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>

（75）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

（76）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：钱昊旻

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.jnlc.com

（77）北京汇成基金销售有限公司

注册（办公）地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108

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：4006199059

网址：www.fundzone.cn

（78）大泰金石投资管理有限公司

注册（办公）地址：上海市浦东新区峨山路505号东方纯一大厦15楼

法定代表人：袁顾明

联系人：何庭宇

联系电话：13917225742

客户服务热线：400-928-2266

网址：<https://www.dtfunds.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城市、网点，并另行公告。

（二）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司
注册地址：北京西城区太平桥大街 17 号
办公地址：北京西城区太平桥大街 17 号
法定代表人：周明
电话：（010）50938856
传真：（010）50938991
联系人：崔巍

（三）律师事务所和经办律师

名称：北京市金杜律师事务所
注册地址：北京市朝阳区东三环中路 39 号建外 SOHU A 座 31 层
办公地址：北京市朝阳区东三环中路 39 号建外 SOHU A 座 31 层
负责人：王玲
电话：（010）58785588、（0755）22163333
联系人：冯艾
经办律师：宋萍萍、靳庆军

（四）会计师事务所和经办注册会计师

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：上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
法人代表：杨绍信
联系人：俞伟敏
联系电话：（021）23238189
经办注册会计师：单峰、俞伟敏

六、基金的募集

本基金由基金管理人依照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》及有关法律法规和基金合同募集，基金募集申请经中国证监会于 2005 年 5 月 9 日核准，核准文件名称为中国证监会证监基金字【2005】79 号文《关于同意巨田资源优选混合型证券投资基金募集的批复》。

本基金募集期为2005年8月8日至2005年9月20日。业经德勤华永会计师事务所有限公司德师报（验）字（05）第SZ001号验证，按照每份基金份额面值人民币1.00元计算，本基金募集期共募集309,568,999.66份基金份额，有效认购户数为1,644户。

七、基金合同的生效

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《摩根士丹利华鑫资源优选混合型证券投资基金（LOF）基金合同》及其它相关规定，本基金募集符合有关规定和条件，已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于2005年9月27日获书面确认，基金合同自该日起正式生效。

八、基金份额的上市交易

（一）上市交易的地点

深圳证券交易所。

（二）上市交易的时间

本基金已于2007年7月5日在深圳证券交易所上市交易。投资者可在交易日的交易时间使用深圳证券账户通过各深圳证券交易所会员单位的营业网点报盘买入和卖出本基金。

（三）上市交易的规则

- 1、本基金上市首日的开盘参考价为前一交易日基金份额净值；
- 2、本基金实行价格涨跌幅限制，涨跌幅比例为10%，自上市首日起实行；
- 3、本基金买入申报数量为100份或其整数倍；
- 4、本基金申报价格最小变动单位为0.001元人民币；
- 5、本基金上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》及《业务规则》的相关规定。

（四）上市交易的费用

本基金上市交易的费用按《业务规则》有关规定办理。

（五）上市交易的行情揭示

本基金在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示基金前一交易日的基金份额净值。

（六）上市交易的注册登记

投资人T日买入成功后,注册登记人在T日自动为投资人登记权益并办理注册登记手续,投资人自T+1日(含该日)后有权卖出该部分基金;

投资人T日卖出成功后,注册登记人在T日自动为投资人办理扣除权益的注册登记手续。

(七) 上市交易的停复牌

本基金的停复牌按照《业务规则》的相关规定执行。

(八) 暂停上市的情形和处理方式

本基金上市后,发生下列情况之一时,应暂停上市交易:

- 1、基金份额持有人数连续20个工作日低于1000人;
- 2、基金总份额连续20个工作日低于2亿份;
- 3、违反国家有关法律、法规,被中国证监会决定暂停上市;
- 4、深圳证券交易所认为须暂停上市的其他情况。

发生上述暂停上市情形时,基金管理人在接到深圳证券交易所通知后,应立即在至少一种指定报刊和网站上刊登暂停上市公告。

(九) 恢复上市的公告

暂停上市情形消除后,基金管理人可向深圳证券交易所提出恢复上市申请,经深圳证券交易所核准后,可恢复本基金上市,并在至少一种指定报刊和网站上刊登恢复上市公告。

(十) 终止上市的情形和处理方式

发生下列情况之一时,本基金应终止上市交易:

- 1、自暂停上市之日起半年内未能消除暂停上市原因的;
- 2、基金合同终止;
- 3、基金份额持有人大会决定终止上市;
- 4、深圳证券交易所认为须终止上市的其他情况。

发生上述终止上市情形时,基金管理人在报经中国证监会批准后终止本基金的上市,并在至少一种指定报刊和网站上刊登终止上市公告。

九、基金份额的申购和赎回

(一) 场内基金份额的申购与赎回

1、申购与赎回办理的场所

具有基金代销业务资格、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的

深圳证券交易所会员单位，具体名单详见深圳证券交易所网站（<http://www.szse.cn/>）。

2、申购、赎回账户

投资者通过场内申购、赎回应使用中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的人民币普通股票账户或证券投资基金账户。

3、申购与赎回办理的开放日及开放时间

（1）开放日及开放时间

深圳证券交易所的工作日为本基金的场内申购赎回开放日。业务办理时间为深圳证券交易所交易时间。

（2）申购、赎回开始日：2005年10月26日。

若出现新的证券交易市场或交易所交易时间改变，基金管理人可视情况对营业时间进行相应的调整并公告，并报中国证监会备案。

4、申购与赎回的原则

（1）“未知价”原则，即基金的申购与赎回价格以受理申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算。

（2）基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请。申购申报单位为1元人民币，赎回申报单位为1份基金份额。

（3）当日的申购与赎回申请可以在当日交易结束时间前撤销，在当日的交易时间结束后不得撤销。

5、申购份额、赎回金额的计算方式

本基金根据基金份额净值计算申购份额和赎回金额。

（1）申购份额的计算方法（外扣法）：

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日基金份额净值

场内申购份额保留到整数位，不足1份对应的资金返还至投资者资金账户。

例：某非养老金投资者通过场内投资10000元申购本基金，假设申购费率为1.5%，申购当日基金份额净值为1.0250元，则其申购费用、可得到的申购份额及返还的资金余额为：

净申购金额 = 10000 / (1 + 1.5%) = 9852.22 元

申购费用 = 10000 - 9852.22 = 147.78 元

申购份额 = 9852.22 / 1.0250 = 9611.92 份

因场内份额保留至整数份，故该投资者申购所得份额为 9611 份，不足 1 份部分对应的申购资金返还给该投资者。

$$\text{实际净申购金额} = 9611 \times 1.025 = 9851.28 \text{ 元}$$

$$\text{退款金额} = 10000 - 9851.28 - 147.78 = 0.94 \text{ 元}$$

（2）赎回金额的计算方法

$$\text{赎回总金额} = \text{赎回份额} \times \text{赎回当日基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总金额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回总金额} - \text{赎回费用}$$

赎回金总额、净赎回金额按四舍五入的原则保留到小数点后两位。

例：某投资者赎回本基金 10000 份基金份额，持有时间为 10 个月，赎回费率为 0.35%，假设赎回当日基金份额净值为 1.0250 元，则其可得净赎回金额为：

$$\text{赎回总金额} = 10000 \times 1.0250 = 10250 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 10250 \times 0.0035 = 35.88 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 10250 - 35.88 = 10214.12 \text{ 元}$$

即：投资者赎回 10000 份基金份额，假设赎回当日基金份额净值为 1.0250 元，则得到 10214.12 元净赎回金额。

6、申购与赎回的登记结算

基金申购、赎回的登记结算按照中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

（二）场外基金份额的申购与赎回

1、申购与赎回场所

（1）本公司直销网点（见“五、相关服务机构”部分相关内容）；

（2）经本公司委托，具有代销本基金资格的商业银行或其他机构的营业网点（见“五、相关服务机构”部分相关内容）；

（3）本基金管理人同时考虑在适当的时候，投资人可通过基金管理人或指定基金代销机构进行电话、传真或网上等形式的申购、赎回，具体规则由基金管理人另行确定并公告。

2、申购与赎回的开放日及开放时间

申购、赎回的开放日为证券交易所的正常交易日。开放日的具体业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所及其他证券交易场所交易日的交易时间。

申购、赎回开始日：2005 年 10 月 26 日。

若出现新的证券交易市场或交易所交易时间改变，基金管理人可视情况对营业时间进

行相应的调整并公告，并报中国证监会备案。

投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

3、申购和赎回数额限制

（1）申购数额的限制

投资人通过代销网点首次单笔最低申购金额为100元，追加最低申购金额为100元；直销网点投资人首次单笔最低申购金额为人民币100元，追加最低申购金额为人民币100元（含申购费）。当期分配的基金收益转购基金份额时，不受最低申购金额的限制；投资人可多次申购，对单个投资人累计持有份额不设上限限制，但法律法规、中国证监会、本基金招募说明书另有规定的除外。

（2）赎回数额的限制

赎回的最低份额为10份基金份额，基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回，但某笔赎回导致单个发生交易账户的基金份额余额少于10份时，余额部分基金份额必须一同赎回。

（3）基金管理人可以根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述申购金额和赎回份额的数量限制，基金管理人必须在调整前3个工作日至少在一种中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告并报中国证监会备案。

4、申购与赎回的原则

（1）“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日的基金份额净值为基准进行计算；

（2）“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

（3）当日的申购、赎回申请可以在当日15:00以前撤销；

（4）基金管理人可根据基金运作的实际情况更改上述原则。基金管理人必须于新规则开始实施日前3个工作日在至少一种指定报刊和网站上刊登公告。

5、申购、赎回的程序

（1）申购与赎回的申请方式

基金投资人必须根据基金销售机构规定的手续，在开放日的业务办理时间向基金销售机构提出申购、赎回的申请。

投资人在申购本基金时须按销售机构规定的方式备足申购资金。投资人在提交赎回申请时，必须有足够的基金份额余额。否则所提交的申购、赎回的申请无效而不予成交。

（2）申购、赎回申请的确认

T日规定时间受理的申请，正常情况下，基金注册登记人在T+1日内为投资人对该交易的有效性进行确认，在T+2日后（包括该日）投资人可向销售机构或以销售机构规定的其它方式查询申购、赎回的成交情况。

（3）申购与赎回的款项支付的方式与时间

基金申购采用全额缴款方式。投资人赎回申请成功后，基金管理人应会同基金托管人按有关规定在T+7日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回的情形时，款项的支付办法参照基金合同的有关条款处理。

6、申购份额与赎回金额的计算方式

（1）基金申购份额的计算（外扣法）

申购份额以当日基金份额净值为基准计算，计算结果以四舍五入的方式保留到小数点后2位。

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{申购净金额} / \text{申购当日基金份额净值}$$

例：某投资人投资10000元申购本基金，申购费率为1.5%，假设申购当日基金份额净值为1.0500元，则：

$$\text{净申购金额} = 10000 / (1 + 1.5\%) = 9852.22 \text{元}$$

$$\text{申购费用} = 10000 - 9852.22 = 147.78 \text{元}$$

$$\text{申购份额} = 9852.22 / 1.0500 = 9383.07 \text{份}$$

即：投资人投资10000元申购本基金，假设申购当日基金份额净值为1.0500元，则得到9383.07份基金份额。

（2）基金赎回金额的计算

赎回金额以当日基金份额净值为基准计算，计算结果以四舍五入的方式保留到小数点后2位。

$$\text{赎回总金额} = \text{赎回份数} \times \text{赎回当日基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总金额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回总金额} - \text{赎回费用}$$

例：某投资人赎回10000份基金份额，对应的赎回费率为0.5%，假设赎回当日基金份额净值是1.0500元，则：

$$\text{赎回总金额} = 10000 \times 1.0500 = 10500 \text{元}$$

赎回费用=10500×0.5%=52.5元

净赎回金额=10500-52.5=10447.5元

即：投资人赎回本基金10000份基金份额，假设赎回当日基金份额净值是1.0500元，则其可得到的净赎回金额为10447.5元。

（3）基金份额净值的计算

T日基金份额净值=T日收市后基金资产净值/T日基金份额余额。

T日的基金份额净值采用四舍五入方法保留到小数点后4位，在当天收市后计算，并于次日公告。遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

（三）暂停或拒绝申购的情形和处理方式

1、除出现如下情形，基金管理人不得拒绝或暂停基金投资人的申购申请：

- （1）不可抗力的原因导致基金无法正常工作；
- （2）证券交易场所在交易时间非正常停市，导致无法计算当日的基金资产净值；
- （3）基金财产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益；
- （4）基金管理人、基金托管人、基金销售代理人或基金注册登记人的技术保障和人员支持等不充分；
- （5）法律、法规规定或中国证监会认定的其它可暂停申购的情形；
- （6）基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购。

2、发生上述（1）到（5）项暂停申购情形时，基金管理人应当在指定媒体上刊登暂停申购公告。

（四）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

1、除下列情形外，基金管理人不得拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请：

- （1）因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项；
- （2）证券交易场所依法决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- （3）因市场剧烈波动或其它原因而出现连续巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；
- （4）法律、法规规定或中国证监会认定的其它情形；
- （5）基金合同约定的其他特殊情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应在当日向中国证监会报告备案。

已接受的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能足额支付的，可支付的部分按

每个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以支付。同时，在出现上述第（3）款的情形时，对已接受的赎回申请可延期支付赎回款项，最长不超过正常支付时间20个工作日，并在指定媒体上公告。投资人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。

2、在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理。

（五）其它暂停申购、赎回及延缓支付赎回款项的情形及处理方式

发生基金合同或招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人认为有正当理由认为需要暂停基金份额申购、赎回申请的，应当报经中国证监会备案。经备案后，基金管理人应当及时在指定媒体上刊登暂停申购、赎回公告。在暂停申购、赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购、赎回业务的办理。

（六）拒绝或暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生暂停申购和赎回情况的，基金管理人应在当日立即向中国证监会备案并应在规定期限内至少一种指定媒体上刊登暂停公告；

2、如果发生暂停的时间为一日，第2个工作日基金管理人应在至少一种中国证监会指定媒体上刊登基金重新开放申购、赎回公告并公布最近一个工作日的基金份额净值；

3、如果发生暂停的时间超过一日但少于2周，暂停结束基金重新开放申购、赎回时，基金管理人应提前一个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上刊登基金重新开放申购、赎回公告，并在重新开放申购、赎回日公告最近一个工作日的基金份额净值。

4、如果发生暂停的时间超过2周，暂停期间，基金管理人应每2周至少重复刊登提示性公告一次；当连续暂停时间超过2个月时，可将重复刊登暂停公告的频率调整为每月一次。暂停结束基金重新开放申购、赎回时，基金管理人应提前3个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上连续刊登基金重新开放申购、赎回公告并在重新开放申购、赎回日公告最近一个工作日的基金份额净值。

（七）巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

若单个开放日基金份额净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日本基金总份额的10%时，即认为基金发生了巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

当本基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

（1）全额赎回：当基金管理人认为有能力兑付基金投资人的赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为兑付投资人的赎回申请可能导致本基金份额持有人的利益受损或无法实现时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日本基金总份额的10%的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；未受理部分可延迟至下一个工作日办理。转入第2个工作日的赎回申请不享有优先权并以该开放日的本基金份额净值为依据计算赎回金额，依此类推，直到全部赎回为止。基金份额持有人在申请赎回时可选择将当日未获受理部分予以撤销。场内的赎回申请在遇到巨额赎回时不予办理延期赎回，当日未获受理部分予以撤销。

（3）巨额赎回的公告：当本基金发生巨额赎回并部分延期赎回时，基金管理人应立即向中国证监会备案并在3个工作日内公告，并说明有关处理方法。

本基金连续2个工作日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过正常支付时间20个工作日，并应当在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上进行公告。

（八）定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人在届时发布公告或更新的招募说明书中确定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

十、基金份额的登记、非交易过户、系统内转托管和跨系统转登记

（一）基金份额的登记

1、本基金的份额采用分系统登记的原则。场外认购或申购买的基金份额登记在注册登记系统持有人开放式基金账户下；场内认购、申购或上市交易买入的基金份额登记在证券登记结算系统持有人证券账户下。

2、登记在证券登记结算系统中的基金份额既可上市交易，也可直接申请赎回。

（二）非交易过户

基金注册登记人受理继承、捐赠和司法强制执行等情况下的非交易过户。继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承。捐赠是指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体。司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其它自然人、法人、社会团体或其它组织。具体条件、程序以《中国证券登记结算有限公司开放式证券投资基金登记结算业务指南》为准。

（三）系统内转托管

1、系统内转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为。

2、基金份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理基金赎回业务的销售机构（网点）时，销售机构（网点）之间不能通存通兑的，可办理已持有基金份额的系统内转托管。

3、基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理上市交易的会员单位（席位）时，可办理已持有基金份额的系统内转托管。

（四）跨系统转登记

1、跨系统转登记是指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转登记的行为。

2、本基金跨系统转登记的具体业务按照中国证券登记结算有限公司的相关规定办理。

十一、基金转换

基金转换指基金份额持有人按基金管理人规定的条件申请将其持有的某一基金的基金份额转为同一基金管理人管理的、由同一注册登记人办理注册登记的其他基金的基金份额。

基金管理人于2006年10月26日开通本基金与基金管理人管理的摩根士丹利华鑫货币市场基金间的转换业务。因摩根士丹利华鑫货币市场基金基金合同终止，本基金于2015年1月22日起暂停基金转换业务。本基金恢复基金转换业务时，基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定相关规则并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

十二、基金的投资

本基金所指的资源是指能够被企业占有和利用，为企业创造经济价值，提升企业核心竞争力，具有战略发展意义的自然资源，具体包括土地资源、水资源、生物资源、矿产资源、旅游资源等。

资源类上市公司为拥有自然资源、开采自然资源或直接对自然资源进行加工、开发的上市公司。具体包括：拥有土地资源、水资源或者生物资源的农林牧渔业上市公司；拥有或开采矿产资源的采掘业上市公司；拥有基础原材料基地的制造业上市公司；对水资源进行开发的水电、自来水类上市公司；对土地资源、水资源进行开发的交通设施类上市公司；对土地资源进行开发的房地产上市公司；对旅游资源进行经营、开发的旅游业上市公司。

本基金管理人认为：在我国及世界范围内，自然资源具有绝对稀缺和相对稀缺的总体特征。有限的资源储量与持续增长的需求，以及资源定价的市场化决定了自然资源价值将长期持续提升。

本基金管理人研究表明，目前我国资源类上市公司的盈利能力高于市场平均水平，充分体现了资源类公司的价值性；同时，资源类上市公司的市盈率、市净率、企业总价值与息税、折旧及摊销前盈利之比(EV/EBITDA)均低于市场平均水平，其相对投资价值比较明显。

本基金立足于充分把握自然资源价值性、稀缺性和独占性的特点，通过投资于拥有优质土地资源、水资源、生物资源、矿产资源、旅游资源的上市公司，为投资者获取长期、稳定、丰厚的投资回报。

（一）投资目标

将中国资源的经济价值转换为持续的投资收益，为基金份额持有人谋求长期、稳定的投资回报。

本基金将把握资源的价值变化规律，对各类资源的现状和发展进行分析判断，及时适当调整各类资源行业的配置比例，重点投资于各类资源行业中的优势企业，分享资源长期价值提升所带来的投资收益。

（二）投资方向

在国内证券市场依法发行上市的A股、债券及经中国证监会批准的允许本基金投资的其他金融工具，其中投资于资源类上市公司股票的比例不低于基金股票资产的80%。

（三）投资策略

本基金将中长期持有以资源类股票为主的股票投资组合，并注重资产在资源类各相关行

业的配置，适当进行时机选择。采用“自上而下”为主、结合“自下而上”的投资方法，将资产管理策略体现在资产配置、行业配置、股票及债券选择的过程中。

（1）一级资产配置

1) 本基金通过资产配置来确定投资组合中股票、债券和现金的比例。资产配置主要根据以下内容进行：

- a、国家有关法律、法规和基金契约的有关规定；
- b、国内外宏观经济环境及相关指标，包括 GDP 增长率、消费需求变化趋势、进出口增长变化趋势、总投资变化趋势；
- c、国家财政政策包括国债发行趋势、政府财政收支状况、税收政策及政府转移支付政策等；
- d、国家货币政策、利率走势及通货膨胀预期、物价变化趋势；
- e、国家产业政策、产业投资增长变化、投入产出状况；
- f、各地区、各行业发展状况；
- g、证券市场政策环境、市场资金供求状况、投资者状况及市场发展趋势。

在正常市场情况下，本基金资产中股票投资比例的变动范围为：基金资产净值的 30%-95%；债券投资比例的变动范围为：基金资产净值的 0%-65%；现金或到期日在一年以内的政府债券比例不低于基金资产净值的 5%。法律法规和监管部门对上述比例另有规定时从其规定。

2) 根据本基金管理人关于旗下基金权证投资方案：

- a、本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的千分之五；
- b、本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的百分之三；
- c、公司管理的全部基金持有的同一权证不得超过该权证的百分之十。

中国证监会另有规定的，不受前款第 a、b、c 项规定的比例限制。因证券市场波动、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述投资比例的，本公司将在十个交易日之内调整完毕。

（2）二级资产配置

本基金采用“自上而下”为主、结合“自下而上”的投资方法，主要配置方法如下：

A、根据上市公司资源的类别、数量、与主营业务的密切程度判断公司是否属于资源类公司，所有资源类公司形成资源类股票库；

B、在资源类股票库的基础上剔除 ST 等财务异常公司股票形成投资的基准库；

C、运用资源评价体系对基准库公司所拥有的资源进行评级并作三级分类，由一级资源类公司形成备选库；

D、运用投资价值综合评价系统对备选库公司的财务状况、内在价值、相对价值进行综合评级，依据系统评价的结果，并结合公司实地调研的结论建立起基金的投资组合；

E、对投资组合内股票的收益、风险特征、流动性指标、预期收益率进行量化分析，在分析结果基础上构造有效投资组合，以实现组合整体的风险收益最优化。

（3）股票投资策略

A、根据资源的经济价值，注重对资源类上市公司所拥有的资源价值评估和公司证券价值的估值分析；对于精选个股将坚持中长期持有为主的策略。

B、我国证券市场处于新兴加转轨的阶段，市场的波动性较强，所以本基金将依据市场判断和政策分析，同时根据类别行业的周期性特点，采取适当的时机选择策略，以优化组合表现。

（4）债券投资策略

本基金采取“自上而下”为主，“自下而上”为辅的投资策略，以长期利率趋势分析为基础，兼顾中短期经济周期、政策方向等因素在类别资产配置、市场资产配置、券种选择 3 个层面进行主动性投资管理。积极运用“久期管理”，动态调整组合的投资品种，以达到预期投资目标。

（5）权证投资策略

对权证的投资建立在对标的证券和组合收益风险进行分析的基础之上，权证在基金的投资中将主要起到锁定收益和控制风险的作用。

以 BS 模型和二叉树模型为基础来对权证进行定价，并根据市场情况对定价模型和参数进行适当修正。

在组合构建和操作中运用的投资策略主要包括但不限于保护性看跌策略、抛补的认购权证、双限策略等。

（四）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团队和监察稽核团队组成。风险管理团队定期或不定期对基金投资风险与绩效进行评估；监察稽核团队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

基金经理将跟踪行业状况、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。

(五) 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：

沪深300指数收益率×70%+标普中国债券指数收益率×30%

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第一次联合发布的反映 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度高，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取。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有限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综合意义的全债指数。标普中国债券指数旨在追踪中国的政府债、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。

如果上述基准指数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、且更能够表征本基金风险收益特征的指数，则基金管理人将视情况经与基金托管人协商同意并按照监管部门要求履行适当程序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。

（六）风险收益特征

本基金为混合型基金，长期平均风险介于股票型和债券型基金之间，适于能承担一定风险、追求较高收益和长期资本增值的投资人投资。

（七）投资限制

1、组合限制

本基金以《基金法》、《运作办法》等相关法律、法规和基金合同为基础，通过构造投资组合降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：

- （1）本基金持有一家上市公司的股票，其市值不得超过本基金资产净值的 10%；
- （2）本基金与本基金管理人管理的其他基金持有一家公司的发行的证券，不超过该证券的 10%；
- （3）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基

金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

（4）本《基金合同》关于投资范围、投资策略和投资比例的约定；

（5）法律法规或中国证监会规定的其他比例限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合第（1）和第（2）项规定的比例或者基金合同约定的投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内调整完毕。

2、建仓期

本基金建仓时间为基金合同生效之日起3个月。

3、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

（1）承销证券；

（2）向他人贷款或者提供担保；

（3）从事承担无限责任的投资；

（4）买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；

（5）向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

（6）买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

（7）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（8）依照法律、行政法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。如法律法规有关规定发生变更，上述禁止行为应相应变更。

（八）基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

1、不谋求对上市公司的控股；

2、有利于基金财产的安全和增值；

3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益。

（九）基金投资组合报告

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。

基金托管人中国光大银行根据本基金合同规定，于2016年10月21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9月30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	650,606,159.03	82.72
	其中：股票	650,606,159.03	82.72
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	134,405,852.06	17.09
8	其他资产	1,461,799.14	0.19
9	合计	786,473,810.23	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	404,811,208.23	52.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	82,741,802.50	10.66
E	建筑业	20,493,784.04	2.64
F	批发和零售业	18,289,731.39	2.36
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	18,551,698.00	2.39
I	信息传输、软件和信息技术服务业	35,657,663.91	4.59
J	金融业	-	-
K	房地产业	6,742,852.88	0.87
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	41,342,588.08	5.32
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	21,974,830.00	2.83
S	综合	-	-
	合计	650,606,159.03	83.80

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	002271	东方雨虹	1,573,370	40,388,407.90	5.20
2	600681	百川能源	2,649,807	34,341,498.72	4.42
3	002050	三花股份	3,000,000	31,200,000.00	4.02
4	601677	明泰铝业	1,839,617	29,544,249.02	3.81
5	600056	中国医药	1,457,286	28,344,212.70	3.65
6	002372	伟星新材	1,599,887	27,662,046.23	3.56
7	000895	双汇发展	1,137,400	26,831,266.00	3.46
8	002597	金禾实业	1,599,901	23,342,555.59	3.01
9	002637	赞宇科技	1,800,000	23,040,000.00	2.97
10	600461	洪城水业	2,714,157	22,310,370.54	2.87

4、报告期末按券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

(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。

(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

(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。

(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。

(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

(1) 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体除河南明泰铝业股份有限公司（以下简称“明泰铝业”）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。

2015年10月28日，河南证监局发布《关于对河南明泰铝业股份有限公司实施责令改正措施的决定》，对明泰铝业违反《上市公司信息披露管理办法》的违规行为给予责令改正措施。

本基金投资明泰铝业（601677）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，认为上述事件对明泰铝业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。

(2) 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。

(3) 其他资产的构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,155,243.53
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	25,473.03
5	应收申购款	255,944.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	25,137.64

8	其他	-
9	合计	1,461,799.14

(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。

(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。

十三、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9月30日，本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较表：

阶段	净值增长率 ①	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
2005年9月27日至 2005年12月31日	1.95%	0.12%	0.52%	0.61%	1.43%	-0.49%
2006年1月1日至 2006年12月31日	115.15%	1.27%	76.97%	0.98%	38.18%	0.29%
2007年1月1日至 2007年12月31日	159.00%	2.21%	98.12%	1.61%	60.88%	0.60%
2008年1月1日至 2008年12月31日	-47.62%	1.84%	-49.18%	2.10%	1.56%	-0.26%
2009年1月1日至 2009年12月31日	76.75%	1.67%	61.47%	1.43%	15.28%	0.24%
2010年1月1日至 2010年12月31日	18.51%	1.30%	-6.77%	1.09%	25.28%	0.21%
2011年1月1日至 2011年12月31日	-18.09%	0.95%	-17.46%	0.93%	-0.63%	0.02%
2012年1月1日至 2012年12月31日	-0.97%	0.82%	6.71%	0.88%	-7.68%	-0.06%
2013年1月1日至 2013年12月31日	11.93%	1.33%	-2.90%	0.96%	14.83%	0.37%
2014年1月1日至 2014年12月31日	4.97%	1.46%	36.26%	-3.11%	-30.29%	0.62%

2015年1月1日至 2015年12月31日	42.45%	2.56%	8.56%	1.71%	33.89%	0.85%
2016年1月1日至 2016年6月30日	-18.35%	1.96%	-10.30%	1.29%	-8.05%	0.67%
自基金合同生效起至 2016年9月30日	645.37%	1.61%	214.52%	1.30%	430.86%	0.31%

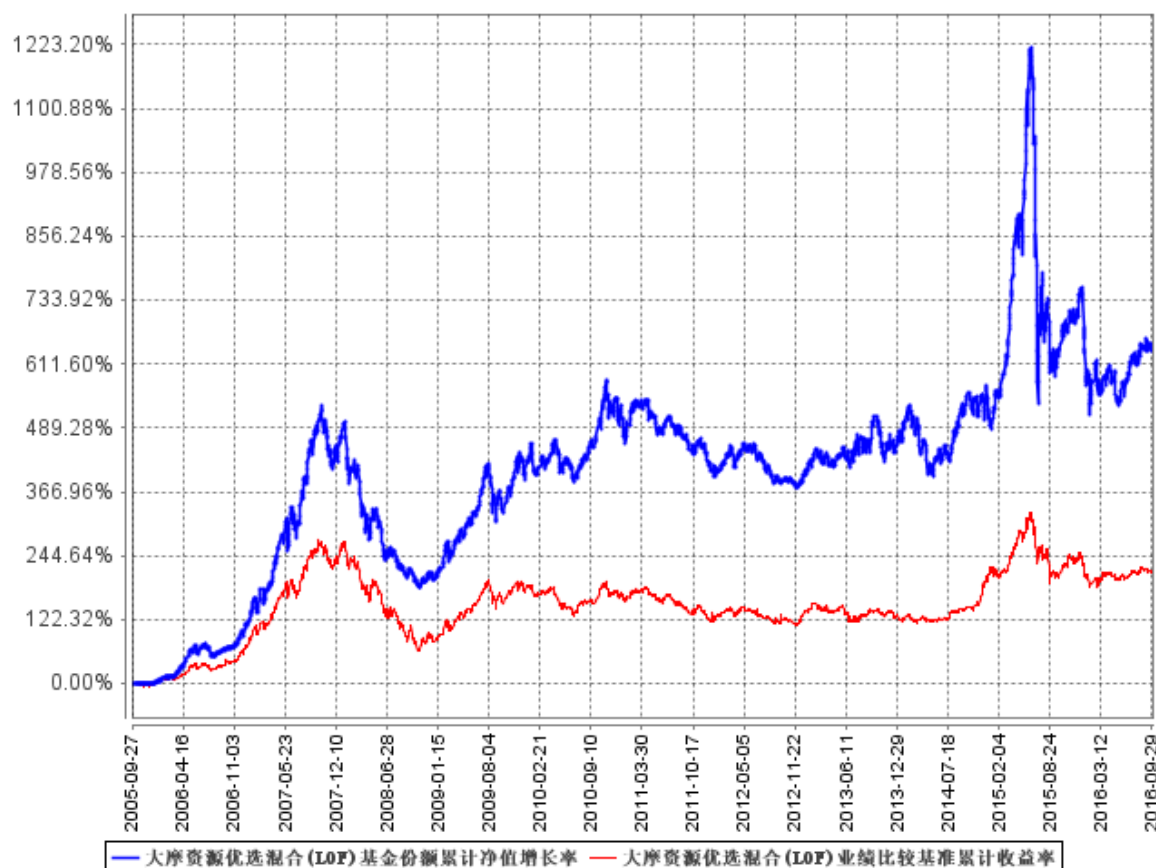
2、自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

摩根士丹利华鑫资源优选混合型证券投资基金 (LOF)

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

(2005年9月27日至2016年9月30日)

大摩资源优选混合 (LOF) 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



十四、基金的财产

(一) 基金财产的构成

1、基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款以及其他资产的价值总和。

其构成主要有：

- （1）银行存款及其应计利息；
- （2）清算备付金及其应计利息；
- （3）根据有关规定缴纳的保证金；
- （4）应收证券交易清算款；
- （5）应收申购款；
- （6）股票投资及其估值调整；
- （7）债券投资及其估值调整和应计利息；
- （8）权证投资及其估值调整；
- （9）其他投资及其估值调整；
- （10）其他资产等。

2、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

（二）基金财产的账户

本基金财产以基金托管人名义开立基金托管专户、以基金的名义在基金托管人营业机构开设基金银行存款账户和证券交易资金账户，以基金托管人和基金联名的方式开立基金证券账户，以基金的名义开立银行间债券托管账户，并报中国证监会及银行业监管机构备案。开立的基金各类专用账户，与基金管理人、基金托管人、销售代理人、注册登记人自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

（三）基金财产的保管与处分

1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产。

2、基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归入基金财产。

3、基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。

4、非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

十五、基金资产的估值

（一）估值日

基金资产估值日为相关的证券交易所的正常交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

（二）估值方法

1、股票估值方法

（1）上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

对旗下基金持有的长期停牌股票参照“指数收益法”进行估值，其中行业指数参照交易所行业分类指数。

（2）未上市股票的估值：

①首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本价估值。

②首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日其所在证券交易所上市的同一股票的市价进行估值。

③送股、转增股、配股和公开增发新股等方式发行的未上市股票，按估值日其所在证券交易所上市的同一股票的市价进行估值。

④非公开发行有明确锁定期流通受限的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

（3）在任何情况下，基金管理人如采用本项第（1）—（2）小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第（1）—（2）小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

（4）国家有最新规定的，按其规定进行估值。

2、债券估值方法

（1）在证券交易所市场挂牌交易的实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的收盘价估值；估值

日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

（2）在证券交易所市场挂牌交易的未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值，估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日债券收盘价减去所含的债券应收利息后的净价进行估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

（3）首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

（4）在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

（5）交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量。

（6）同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

（7）在任何情况下，基金管理人如采用本项第（1）—（6）小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第（1）—（6）小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，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价格估值。

（8）国家有最新规定的，按其规定进行估值。

为确保证券投资基金估值的合理性和公允性，根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”）的有关规定，经与相关基金托管人、会计师事务所协商一致，自 2015 年 3 月 25 日起，对本基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）的估值方法进行调整，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。上述调整事项已于 2015 年 3 月 26 日在指定媒体上公告。

3、权证估值方法

（1）基金持有的权证，从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日其所在证券交易所挂牌的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生

重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

（2）首次发行未上市的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

（3）因持有股票而享有的配股权，以及停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

（4）在任何情况下，基金管理人如采用本项第（1）—（3）小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第（1）—（3）小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

（5）国家有最新规定的，按其规定进行估值。

4、其他有价证券等资产按国家有关规定进行估值。

5、根据有关法律法规，本基金的基金会计责任方由基金管理人担任。因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，基金管理人有权按照其对基金净值的计算结果对外予以公布。

（三）估值对象

基金所拥有的股票、债券、权证和银行存款本息、应收款项和其他投资等资产。

（四）估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式并加盖业务公章发送给基金托管人，基金托管人按法律法规和基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后加盖业务公章返回给基金管理人；月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

（五）基金份额净值计价错误的确认与处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。基金份额净值的计算采用四舍五入方法保留到小数点后4位。当基金份额净值小数点后4位以内（含第4位）发生差错时，视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

1、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记结算机构、或代销机构、

或投资人自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

2、差错处理原则

（1）差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的，由差错责任方承担赔偿责任；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。

（2）差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

（3）因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方。

（4）差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

（5）差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿；追偿过程中产生的有关费用，应列入基金费用，从基金资产中支付。

（6）如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、基金合同或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基

金管理人有权向出现过错的当事人进行追索,并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失。

(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

3、差错处理程序

差错被发现后,有关的当事人应当及时进行处理,处理的程序如下:

(1) 查明差错发生的原因,列明所有的当事人,并根据差错发生的原因确定差错的责任方;

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估;

(3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失;

(4) 根据差错处理的方法,需要修改基金登记结算机构交易数据的,由基金登记结算机构进行更正,并就差错的更正向有关当事人进行确认。

4、基金份额净值差错处理的原则和方法如下:

(1) 基金份额净值计算出现错误时,基金管理人应当立即予以纠正,通报基金托管人,并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(2) 错误偏差达到基金份额净值的 0.25%时,基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案;错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时,基金管理人应当公告。

(3) 因基金份额净值计算错误,给基金或基金份额持有人造成损失的,应由基金管理人先行赔付,基金管理人按差错情形,有权向其他当事人追偿。

(4) 基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差,以基金管理人计算结果为准。

(5) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的,从其规定处理。

(六) 暂停估值的情形及处理

1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;

2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时;

3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变,而基金管理人为保障投资人的利益,已决定延迟估值;

4、如出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况,会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的;

5、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

(七) 基金资产净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

（八）特殊情形的处理

1、基金管理人或基金托管人按股票估值方法中的第（3）项、债券估值方法的第（7）项、权证估值方法的第（4）项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理；

2、由于证券交易所或登记结算公司发送的数据错误，或战争、火灾、地震、洪水等不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金份额净值计价错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响；

3、如遇国家颁布的有关基金会计制度的变化所造成的误差，不作为基金份额净值错误处理。

十六、基金的收益分配

（一）基金收益的构成

- 1、买卖证券差价；
- 2、基金投资所得红利、股息、债券利息；
- 3、存款利息；
- 4、其他收入。

因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。

（二）基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按照国家有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

（三）基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益每年至少分配1次，最多6次，基金每次收益分配比例最低不低于已实现收益的60%，但若基金合同生效不满3个月则可不进行收益分配；

2、场外投资人可以选择现金分红或红利再投资（即基金份额持有人将所获分配的现金收益按照本基金合同有关基金份额申购的约定转为基金份额）；场内投资人只能选择现金分

红；本基金分红的默认方式为现金分红；

- 3、基金当期收益应先弥补前期亏损后，才可进行当期收益分配；
- 4、每一基金份额享有同等分配权；
- 5、法律、法规或监管机关另有规定的，从其规定。

（四）基金收益分配方案的确定与公告

基金收益方案中应载明基金收益的范围、基金净收益、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，由基金托管人复核，报中国证监会备案后公告。

（五）基金收益分配中发生的费用

- 1、红利分配采用红利再投资方式的，免收申购费用。
- 2、收益分配时所发生的银行转帐或其他手续费用由基金份额持有人自行承担。

十七、基金的费用与税收

（一）与基金运作有关的费用

1、与基金运作有关的基金费用种类：

- （1）基金管理人的管理费；
- （2）基金托管人的托管费；
- （3）基金的证券交易费用；
- （4）基金合同生效后的信息披露费用；
- （5）基金份额持有人大会费用；
- （6）基金合同生效后的会计师费和律师费；
- （7）在中国证监会有明确规定的情况下，基金管理人按照有关规定收取的基金持续销售和服务基金份额持有人的销售服务费；
- （8）按照国家有关规定和基金合同约定可以列入的其他费用。

上述费用从基金财产中支付。

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

在通常情况下，本基金的管理费按前一日基金资产净值 1.5%的年费率计算，计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费；

E 为前一日基金资产净值。

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据基金管理人的划款指令，于次月的前 2 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

（2）基金托管人的托管费

在通常情况下，本基金的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计算，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，由基金托管人根据基金管理人的划款指令，于次月的前 2 个工作日内从基金资产中一次性支取。

（3）上述第一条中 3—8 项基金费用根据有关法规、基金合同及相应协议的规定，按费用实际支出金额，列入当期基金费用。

3、管理费和托管费的调整

基金管理人和基金托管人可磋商酌情降低基金管理费、基金托管费，下调前述费率无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定报刊刊登公告。

（二）与基金销售有关的费用

1、申购费用

本基金的申购包括柜台（场外）申购和深圳证券交易所（场内）申购两种方式。

本基金申购费用在申购时收取并由申购人承担，用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

（1）申购费率

本基金的申购费率为最高不超过 1.5%，投资人在一天之内如果有多笔申购，适用按单笔分别计算。

本基金自 2013 年 11 月 1 日起，对于通过本公司直销中心申购本基金的养老金客户实施特定申购费率。养老金客户指基本养老保险基金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等，包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方和行业社会保障

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。

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：

申购金额 (M)	申购费率
M < 100 万元	0.6%
100 万元 ≤ M < 500 万元	0.4%
M ≥ 500 万元	收取固定费用 1000 元

除养老金客户外的其他投资者申购本基金基金份额的申购费率按申购金额分段设定如下：

申购金额 (M)	申购费率
M < 100 万元	1.5%
100 万元 ≤ M < 500 万元	1.0%
M ≥ 500 万元	收取固定费用 1000 元

(2) 申购费用计算方式

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

2、赎回费用

(1) 赎回费率

赎回费率为最高不超过 0.5%，投资人在场外赎回的赎回费率按持有时间分段设定如下：

持有基金份额期限	赎回费率
1 年以内	0.5%
1 年(含)至 2 年	0.25%
持有期 2 年(含)以上	0%

投资人场内赎回的赎回费率为 0.35%。

(2) 赎回费用计算方式

赎回总金额 = 赎回份额 × 赎回当日基金份额净值

赎回费用 = 赎回总金额 × 赎回费率

本基金的赎回费在投资人赎回基金份额时收取，所收取的赎回费 25% 归基金资产，其余

的用于支付注册登记费及其他必要的手续费。

3、基金转换费用

本基金的转换费用的费率水平、计算公式、收取方式等详见“基金转换”一章。

基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

4、与基金销售有关的费率的调整

基金管理人可以在基金合同规定的范围内调整与基金销售有关费用标准，调整后的费用标准在最新的招募说明书中列示。上述费用标准如发生变更，基金管理人最迟应于新的费用标准实施前3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

5、其他费用

其他基金费用根据有关法规及相关协议规定，按费用实际支出金额，列入当期费用，从基金财产中支付。基金合同生效前的验资费、律师费、基金合同、招募说明书、基金份额发售公告等信息披露费用由基金管理人承担。

（三）不列入基金费用的项目

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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不得列入基金费用。

其他不得列入基金费用的项目依据有关规定执行。

（四）基金的税收

本基金运作过程中涉及各纳税主体，其纳税义务按国家税收的有关法律法规执行。

十八、基金的会计与审计

（一）基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- 2、基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日；
- 3、基金核算以人民币为记帐本位币，以人民币元为记帐单位；
- 4、会计核算制度依据国家相关规定执行；
- 5、本基金独立建帐、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计帐目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；

7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

（二）基金审计

1、基金管理人应聘请与基金管理人、基金托管人相独立的、具有从事证券相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对基金年度财务报表及其他规定事项进行审计；

2、会计师事务所更换经办注册会计师，须事先征得基金管理人和基金托管人同意；

3、基金管理人（或基金托管人）认为有充足理由更换会计师事务所，经基金托管人（或基金管理人）同意，并报中国证监会备案后可以更换。更换会计师事务所应在2日内公告。

十九、基金的信息披露

（一）信息披露的形式

本基金的信息披露将严格按照《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》、《证券投资基金信息披露编报规则》、《业务规则》、基金合同及其他有关规定进行。应予披露的基金信息将通过中国证监会指定的至少一种全国性报刊和基金管理人的互联网网站（<http://www.msfunds.com.cn>）、基金托管人的互联网网站（<http://www.cebbank.com>）等媒介披露。

（二）信息披露的内容及时间

1、基金募集信息

（1）基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人将在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书、基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应当同时将基金合同、基金托管协议登载在网站上。

（2）基金管理人就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。

（3）基金管理人在基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。

（4）基金合同生效后，基金管理人在每6个月结束之日起45日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定报刊上。

2、基金运作信息

（1）基金份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易的3个工作日前，将基金份额上市交易公告书登载在指定报刊和网站上。

(2) 基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

(3) 基金管理人在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

(4) 基金管理人将公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。

基金管理人在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

(5) 基金管理人在基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资人能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

(6) 基金管理人在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定报刊上。

基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

(7) 基金管理人在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定报刊上。

(8) 基金管理人在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定报刊和网站上。

基金合同生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

3、基金临时信息

基金发生以下重大事件时，有关信息披露义务人在 2 日内编制临时报告书，予以公告。

- (1) 基金份额持有人大会的召开；
- (2) 终止基金合同；
- (3) 转换基金运作方式；
- (4) 更换基金管理人、基金托管人；
- (5) 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- (6) 基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- (7) 基金募集期延长；
- (8) 基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金

托管部门负责人发生变动；

- (9) 基金管理人的董事在一年内变更超过 50%；
- (10) 基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过 30%；
- (11) 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；
- (12) 基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- (13) 基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；
- (14) 重大关联交易事项；
- (15) 基金收益分配事项；
- (16) 管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- (17) 基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；
- (18) 基金改聘会计师事务所；
- (19) 变更基金份额发售机构；
- (20) 基金更换注册登记机构；
- (21) 基金开始办理申购、赎回；
- (22) 基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- (23) 基金发生巨额赎回并延期支付；
- (24) 基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- (25) 基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- (26) 中国证监会规定的其他事项。

召开基金份额持有人大会的，召集人应当至少提前 30 日公告基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。

基金份额持有人依法自行召集持有人大会，基金管理人、基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务的，召集人应当履行相关信息披露义务。

在基金合同期限内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的，相关信息披露义务人知悉后将立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会、基金上市交易的证券交易所。

（三）基金信息披露事务管理

1、基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专人负责管理信息披露事务。

2、基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则的规定。

基金托管人应当按照相关法律、行政法规、中国证监会的规定和基金合同的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

3、基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择披露信息的报刊。

基金管理人、基金托管人除依法在指定报刊和网站上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒体披露信息，但是其他公共媒体不得早于指定报刊和网站披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

4、招募说明书（包括定期更新的招募说明书）公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金份额发售机构的住所，供公众查阅、复制。

上市交易公告书公布后，应当分别置备于基金管理人的住所和基金上市交易的证券交易所，供公众查阅、复制。

基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，以及基金上市交易的证券交易所，供公众查阅、复制。

基金管理人和基金托管人应保证文本内容与所公告的内容完全一致。

二十、风险揭示

一、投资于本基金面临的主要风险

基金风险表现为基金收益的波动，基金管理过程中任何影响基金收益的因素都是基金风险的来源。基金的风险按来源可以分为市场风险、管理风险、流动性风险、操作风险、合规性风险、政策变更风险、本基金特有的风险、法律风险和其他风险等。

1、市场风险

本基金为混合型证券投资基金，证券市场的变化将影响基金的业绩。因此，宏观和微观经济因素、国家政策、市场变动、行业与个股业绩的变化、投资人风险收益偏好和市场流动程度等影响证券市场的各种因素将影响到本基金业绩，从而产生市场风险，这种风险主要包括：

（1）经济周期风险

随着宏观、微观经济运行的周期性变化，上市公司的收益水平及证券市场也将呈现周期性变化。本基金投资于股票、债券等金融工具的收益水平也会随之变化，从而产生风险。

（2）政策风险

因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、产业政策、地区发展政策等）发生变化，导致证券市场价格波动而产生风险。

（3）上市公司经营风险

本基金所投资的上市公司可能会因为经营不善，基本面状况恶化而导致其股票价格下跌，使得基金投资收益下降。此外，股票价格也会受到市场整体估值水平的影响，并可能会低于上市公司的合理价值。虽然本基金可通过分散化投资减少非系统性风险，但并不能完全消除该种风险。

（4）利率风险

金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着国债的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。本基金直接投资于股票和债券，其收益水平会受到利率变化的影响而产生波动。

（5）信用风险

指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或者债券发行人信用质量降低，或者上市公司信息披露不真实、不完整，都可能导致基金资产损失和收益变化。

（6）购买力风险

基金份额持有人所取得的收益率有可能低于通货膨胀率，从而导致委托人持有本基金的购买力下降。

（7）再投资风险

再投资风险反映了利率下降对固定收益证券收回本息后以及回购到期后再投资收益的影响。当利率下降时，基金收回固定收益证券本息以及回购到期后进行再投资时，将获得比之前较少的收益率。

（8）市场供需风险

如果宏观经济环境、政府财政政策、市场监管政策、市场参与主体经营环境等发生变化，证券市场参与主体可用资金数量和证券市场可供投资的证券数量可能发生相应的变化，最终影响证券市场的供需关系，造成基金投资收益的变化。

（9）债券收益率曲线变动风险

债券收益率曲线变动风险是指与收益率曲线非平行移动有关的风险。

（10）利差风险

债券市场不同期限、不同类属债券之间的利差变动导致相应期限和类属债券价格变化的风险。

（11）债券回购风险

债券回购为提升基金整体投资收益提供了可能，但也存在一定的风险。在进行回购操作时，可能存在回购利率大于债券投资收益而导致的风险以及由于回购操作导致投资总量放大，同时对投资组合的波动性进行了放大，致使整个组合风险放大的风险。回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对基金净值造成损失的可能性也就越大。

2、管理风险

在基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。因此，本基金可能因为基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等因素影响基金收益水平。

3、流动性风险

流动性风险是指基金所持证券资产变现的难易程度，因市场交易量不足，导致证券不能迅速、低成本地转变为现金的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资人的集中巨额赎回，另一方面来自于其投资组合或其中的部分资产变现能力变弱所产生的风险。主要包括：

巨额赎回风险：本基金属于开放式基金，在本基金存续期间，可能会发生巨额赎回的情形。由于我国证券市场的波动性较大，在市场价格下跌时会出现交易量急剧减少的情形，此时出现巨额赎回可能会导致基金资产变现困难，从而产生流动性风险，甚至影响基金份额净值。

变现风险：投资组合的变现能力较弱所导致基金收益变动的风险。当持有的部分证券品种交投不活跃、成交量不足或是处于跌停板时，资产变现的难度可能会加大，若存在证券停牌的情形，资产可能难以在短时间内迅速变现。或者，由于基金持有的某种资产集中度过高，导致难以在短时间内迅速变现，有可能导致基金的净值出现损失。

4、操作风险

相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT 系统故障等风险。

在开放式基金的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而

影响交易的正常进行或者导致基金份额持有人的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、登记机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等等。

5、合规性风险

指基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者基金投资违反法规及基金合同有关规定的风险。

6、政策变更风险

因相关法律法规或监管机构政策修改等资产管理人无法控制的因素的变化，使基金或投资者利益受到影响的的风险，例如，监管机构基金估值政策的修改导致基金估值方法的调整而引起基金净值波动的风险、相关法规的修改导致基金投资范围变化基金管理人为调整投资组合而引起基金净值波动的风险等。

7、本基金特有的风险

（1）本基金为混合型基金，存在大类资产配置风险，有可能受到经济周期、市场环境或管理人对市场所处的经济周期和产业周期的判断不足等因素的影响，导致基金的大类资产配置比例偏离最优化水平，给基金投资组合的绩效带来风险。本基金在股票投资中重点投资资源类上市公司股票，这种评估具有一定的主观性，将在个股投资决策中给基金带来一定的不确定性的风险。该类型股票的波动会受到宏观经济环境、行业周期和公司自身经营状况等因素的影响。因此，本基金整体表现可能在特定时期内低于其他基金。此外，本基金以对资源类行业作为重点配置对象，也面临行业投资过于集中而带来的投资风险。本基金坚持价值和长期投资理念，重视股票投资风险的防范，但是基于投资范围的规定，本基金无法完全规避股票市场和债券市场的下跌风险。

（2）本基金可参与股票申购，由于股票发行政策、发行机制等影响新股发行的因素变动，将影响本基金的资产配置，从而影响本基金的风险收益水平。另外，发行股票的配售比例、中签率的不确定性，或其他发售方式的不确定性，也可能使本基金面临更多的不确定因素。

（3）上市交易的风险

本基金已在深圳证券交易所挂牌上市，由于上市期间可能因信息披露导致基金停牌，投资人在停牌期间不能买卖基金份额，产生风险；同时，可能因上市后交易对手不足导致基金流动性风险；另外，当基金份额持有人将份额转向场外交易后导致场内的基金份额或持有人数不满足上市条件时，本基金存在暂停上市或终止上市的可能。

（4）基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

本基金在证券交易所的交易价格可能不同于基金份额净值,从而产生折价或者溢价的情况,虽然基金份额净值反映基金投资组合的资产状况,但是交易价格受到很多因素的影响,比如中国的经济情况、投资人的信心以及本基金的供需情况等。

(5) 本基金可能因持续规模较小或基金持有人人数不足等原因,导致基金转型、合并或终止的风险。

8、法律风险

由于交易合约在法律上无效、合约内容不符合法律的规定,或者由于税制、破产制度的改变等法律上的原因,给交易者带来损失的可能性。例如,在OTC(也称为柜台市场)的交易中,主要来自两个方面:一是合约的不可实施性,包括合约潜在的非合法性,对手缺乏进行该项交易的合法资格,以及现行的法律法规发生变更而使该合约失去法律效力等;二是交易对手因经营不善等原因失去清偿能力或不能依照法律规定对其为清偿合约进行平仓交易。

9、其他风险

(1) 因技术因素而产生的风险,如电脑系统不可靠产生的风险;

(2) 因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险;

(3) 因人为因素而产生的风险,如内幕交易、欺诈等行为产生的风险;

(4) 对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险;

(5) 因业务竞争压力可能产生的风险;

(6) 战争、自然灾害等不可抗力导致基金资产遭受损失产生的风险,以及由此致使基金的申购和赎回不能按正常时限完成而产生的风险;

(7) 其他风险。

二、声明

1、本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。投资人投资于本基金,须自行承担投资风险;

2、除基金管理人直接办理本基金的销售外,本基金还通过基金销售机构销售,基金管理人与基金销售机构都不能保证其收益或本金安全。

3、本基金法律文件投资章节有关风险收益特征的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述,代表了一般市场情况下本基金的长期风险收益特征。销售机构(包括基金管理人直销机构和其他销售机构)根据相关法律法规对本基金进行风险评价,不同的销售机构采用的评价方法也不同,因此销售机构的风险等级评价与基金法律文

件中风险收益特征的表述可能存在不同，投资人在购买本基金时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。

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，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。本基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

二十一、基金合同的终止与基金财产清算

（一）基金合同的终止

出现下列情况之一的，基金合同终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人职责终止，在6个月内没有新基金管理人承接其原有职责的；
- 3、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金托管人承接其原有职责的；
- 4、法律、法规及基金合同约定的其他情形。

（二）基金财产的清算

基金合同终止时，基金管理人应予公告并组织清算小组对基金财产进行清算。

1、基金财产清算小组

基金合同终止之日起30个工作日内成立基金财产清算小组。

（1）基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。清算小组可以聘用必要的工作人员。

（2）基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

2、基金财产清算程序

- （1）基金合同终止后，由清算小组统一接管基金财产；
- （2）清算小组对基金财产进行清理和确认；
- （3）对基金财产进行评估；
- （4）对基金财产进行变现；

- (5) 将基金清算结果报告中国证监会；
- (6) 公布基金清算公告；
- (7) 进行基金剩余财产的分配。

3、清算费用

清算费用是指清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由清算小组优先从基金财产中支付。

4、基金清算剩余财产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余财产扣除基金财产清算费用后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

5、基金财产清算的公告

清算小组作出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。

6、基金财产清算帐册及文件的保存

基金财产清算帐册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

二十二、基金合同的内容摘要

（一）基金合同当事人及权利义务

1、基金管理人的权利与义务

（1）基金管理人的权利

- 1) 依法并依照基金合同的规定独立运用并管理基金资产；
- 2) 依照基金合同的相关规定获得基金管理费及其它约定和法定的收入；
- 3) 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- 4) 有关法律法规和基金合同规定的其他权利。

（2）基金管理人的义务

- 1) 依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- 2) 办理基金备案手续；
- 3) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；
- 4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管

理和运作基金财产；

5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记帐，进行证券投资；

6) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

7) 依法接受基金托管人的监督；

8) 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；编制半年度和年度基金报告；

10) 采取适当、合理的措施，使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定，并按有关规定计算和公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；

11) 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行与基金财产管理业务活动有关的信息披露及报告义务；

12) 保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

13) 保存基金财产管理业务活动的记录、帐册、报表和其他相关资料；

14) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

15) 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

16) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

17) 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

18) 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

19) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或实施其它法律行为；

20) 有关法律法规和基金合同规定的其他义务。

2、基金托管人的权利与义务

(1) 基金托管人的权利

- 1) 获得基金托管费；
- 2) 监督基金管理人对本基金的投资运作；
- 3) 有关法律法规和基金合同规定的其他权利。

(2) 基金托管人的义务

- 1) 安全保管基金财产；
- 2) 对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；
- 3) 设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
- 4) 保存基金托管业务活动的记录、帐册、报表和其他相关资料；保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- 5) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；
- 6) 按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- 7) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- 8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；
- 9) 按照规定监督基金管理人的投资运作；
- 10) 参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；
- 11) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
- 12) 保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
- 13) 对基金财务会计报告、中期和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- 14) 建立并保存基金份额持有人名册；
- 15) 按规定制作相关帐册并与基金管理人核对；
- 16) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- 17) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
- 18) 因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

- 19) 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；
- 20) 有关法律法规和基金合同规定的其他义务。

3、基金份额持有人的权利与义务

(1) 基金份额持有人权利

每份基金份额具有同等的合法权益。基金份额持有人享有下列权利：

- 1) 分享基金财产收益；
- 2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- 3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
- 4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- 5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- 6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- 7) 监督基金管理人的投资运作；
- 8) 对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- 9) 有关法律法规和基金合同规定的其他权利。

(2) 基金份额持有人义务

- 1) 遵守基金合同；
- 2) 交纳基金认购、申购款项及规定的费用；
- 3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- 4) 不从事任何有损基金及其他基金合同当事人合法权益的活动；
- 5) 返还持有基金份额过程中获得的不当得利；
- 6) 有关法律法规和基金合同规定的其他义务。

(二) 基金份额持有人大会

基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人合法的授权代表共同组成。

1、召开事由

(1) 需要决定下列事项之一时，应召开基金份额持有人大会：

- 1) 变更基金类别；
- 2) 变更基金投资目标、范围或策略；
- 3) 变更基金份额持有人大会程序；

- 4) 终止基金合同，但法律法规另有规定或基金合同另有约定的除外；
- 5) 转换基金运作方式；
- 6) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- 7) 更换基金管理人、基金托管人；
- 8) 法律法规或基金合同约定的其他事项。

(2) 出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- 1) 调低基金管理费、基金托管费；
- 2) 在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、赎回费率或收费方式；
- 3) 因相应的法律法规发生变动应当对基金合同进行修改；
- 4) 对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- 5) 对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- 6) 按照法律法规或基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其它情形。

2、召集人和召集方式

- (1) 除法律法规规定或基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集；
- (2) 基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；
- (3) 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集。

(4) 代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%（含 10%）以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开。

- (5) 如在上述第 4 条情况下，基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表

基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前三十日报中国证监会备案。

（6）基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

3、通知

召开基金份额持有人大会，召集人应在会议召开前 30 天，在至少一种指定媒体公告通知。基金份额持有人大会通知至少应载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点和方式；
- （2）会议拟审议的事项；
- （3）会议的议事程序以及表决方式；
- （4）有权出席基金份额持有人大会的权益登记日；
- （5）代理投票授权委托书的内容要求（包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- （6）会务常设联系人姓名、电话；
- （7）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- （8）召集人需要通知的其他事项。

采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见的寄交的截止时间和收取方式。

4、会议召开的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式召开。

会议的召开方式由会议召集人确定，但更换基金管理人和基金托管人必须以现场开会方式召开。

（1）现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托书委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会。若基金托管人或基金管理人经通知但拒绝到场参加会议，不影响该次基金份额持有人大会决议的有效性。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定；

2) 经核对，汇总到会者出示的在权利登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权利登记日基金总份额的 50%（含 50%）。

(2) 通讯开会。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

1) 召集人按《基金合同》规定公布会议通知后，在两个工作日内连续公布相关提示性公告；

2) 召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见。若基金托管人或基金管理人经通知但拒绝到场监督，则召集人可仅在公证机关的监督下收取书面表决意见，而不影响通讯开会方式的有效性；

3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权利登记日基金总份额的 50%（含 50%）；

4) 上述第(3)项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定；

5) 会议通知公布前报中国证监会备案。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者；表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

5、议事内容与程序

(1) 议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大变更、决定终止基金合同、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权利登记日基金总份额 10%（含 10%）以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

基金份额持有人大会的召集人发出召集现场会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开日 30 天前公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少有 30 天的间隔期。

基金份额持有人大会的召集人发出以通讯方式开会的通知后,该次基金份额持有人大会不得增加、减少或修改需由该次基金份额持有人大会审议表决的提案。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核:

1) 关联性。大会召集人对于提案涉及事项与基金有直接关系,并且不超出法律法规和《基金合同》规定的基金份额持有人大会职权范围的,应提交大会审议;对于不符合上述要求的,不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决,应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。

2) 程序性。大会召集人可以对提案涉及的程序性问题做出决定。如将提案进行分拆或合并表决,需征得原提案人同意;原提案人不同意变更的,大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定,并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

单独或合并持有权利登记日基金总份额 10% (含 10%) 以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案,或基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案,未获基金份额持有人大会审议通过,就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议,其时间间隔不少于六个月。

(2) 议事程序

1) 现场开会

在现场开会的方式下,首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人,然后由大会主持人宣读提案,经讨论后进行表决,并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表,在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下,由基金托管人授权其出席会议的代表主持;如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会,则由出席大会的基金份额持有人所持表决权的 50%以上(含 50%)选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。

2) 通讯开会

在通讯开会的情况下,公告会议通知时应当同时公布提案,在所通知的表决截止日期后两个工作日内统计全部有效表决,在公证机关监督下形成决议。

6、表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:

(1) 一般决议,一般决议须经参加大会的基金份额持有人所持表决权的 50%以上(含

50%) 通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

(2) 特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二（含三分之二）以上通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止基金合同以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

7、计票

(1) 现场开会

1) 如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

3) 如果会议主持人或基金份额持有人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

计票过程应由公证机关予以公证。

(2) 通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。若基金托管人（或基金管理人）授权代表经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权 3 名监督员进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

8、生效与公告

基金份额持有人大会决议应当由会议召集人自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案，并自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

除非《基金合同》或法律法规另有规定，生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人和基金托管人均有法律约束力。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 个工作日内在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会决议。

（三）基金合同的变更与终止

1、基金合同的变更

（1）变更下列基金合同的内容，对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，应先召开基金份额持有人大会，决议通过后方可变更。

- 1) 变更基金类别；
- 2) 变更基金投资目标、范围或策略；
- 3) 变更基金份额持有人大会程序；
- 4) 终止基金合同，但法律法规另有规定或基金合同另有约定的除外；
- 5) 转换基金运作方式；
- 6) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- 7) 更换基金管理人、基金托管人；
- 8) 法律法规或基金合同约定的其他事项。

（2）出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会，而是由基金管理人和基金托管人同意变更并报中国证监会备案后公布。

- 1) 调低基金管理费、基金托管费；
- 2) 因相应的法律法规发生变动并且本基金合同必须遵照进行变更；
- 3) 基金合同的变更不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- 4) 基金合同的变更对基金份额持有人利益无实质性不利影响。

2、基金合同的终止

出现下列情况之一的，基金合同终止：

- (1) 基金份额持有人大会决定终止的；

(2) 基金管理人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人承接其原有职责的；

(3) 基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金托管人承接其原有职责的；

(4) 基金合同约定的其他情形。

（四）争议的处理

基金合同当事人发生纠纷的，可以通过协商或者调解解决。基金合同当事人不愿通过协商、调解解决或者协商、调解不成的，可以依据事后达成的书面仲裁协议，向仲裁机构申请仲裁。基金合同当事人之间没有达成书面仲裁协议的，可以向有管辖权的人民法院起诉。

（五）基金合同存放及投资者取得基金合同的方式

本基金合同自生效之日对本基金合同当事人具有同等的法律约束力。

本基金合同正本一式 8 份，除上报中国证监会和银行业监管机构各 2 份外，基金管理人和基金托管人各持有 2 份。每份具有同等的法律效力。

基金合同可印制成册并对外公开散发或供投资人在有关场所查阅，但应以基金合同正本为准。

二十三、基金托管协议的内容摘要

（一）托管协议当事人

1、基金管理人

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

邮政编码：518048

法定代表人：YU HUA（于华）

成立时间：2003 年 3 月 14 日

注册资本：人民币 22,750 万元

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：证监基金字[2003]33 号

组织形式：有限责任公司

营业期限：50 年

经营范围：基金管理和发起设立基金

2、基金托管人

名称：中国光大银行

注册地址：北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦

办公地址：北京市西城区太平桥大街25号光大中心

邮政编码：100045

法定代表人：唐双宁

成立时间：1992年8月18日

注册资本：404.3479亿元人民币

组织形式：股份制商业银行

营业期限：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国人民银行和国家外汇管理局批准的其他业务。

（二）基金托管人和基金管理人之间的业务监督、核查

1、基金托管人对基金管理人的业务监督、核查

（1）根据《基金法》、基金合同、本协议和有关基金法规的规定，基金托管人对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金费用的支付、基金申购资金的到账和赎回资金的划付、基金收益分配、基金的融资条件等行为的合法性、合规性进行监督和核查，其中对基金的投资比例的监督和检查自本基金的基金合同生效之后6个月开始。

（2）基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、本协议或有关基金法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对基金托管人发出回函确认。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人有义务要求基金管理人赔偿因其过失致使投资者遭受的损失。

（3）基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

2、基金管理人对其基金托管人的业务监督、核查

(1) 根据《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定，基金管理人就基金托管人是否及时执行基金管理人的划款指令、是否擅自动用基金资产、是否按时将分配给基金份额持有人的收益划入分红派息账户等事项，对基金托管人进行监督和核查。

(2) 基金管理人定期对基金托管人保管的基金资产进行核查。基金管理人发现基金托管人未对基金资产实行分帐管理、擅自挪用基金资产、因基金托管人的过错导致基金资产灭失、减损或处于危险状态的，基金管理人应立即以书面的方式要求基金托管人予以纠正并采取必要的补救措施。基金管理人有权要求基金托管人赔偿基金因此所遭受的损失。

(3) 基金管理人发现基金托管人的行为违反《基金法》、基金合同、本协议或有关基金法规的规定，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。

(4) 基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正。

3、基金托管人与基金管理人在业务监督、核查中的配合、协助

基金管理人和基金托管人有义务配合和协助对方依照本协议对基金业务执行监督、核查。基金管理人或基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经监督方提出警告仍不改正的，监督方应报告中国证监会。

(三) 基金财产保管

1、基金财产保管的原则

(1) 基金托管人依法持有基金财产，应安全保管所收到的基金的全部财产。基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

(2) 基金托管人必须为基金设立独立的账户，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分帐管理。

(3) 基金托管人应安全、完整地保管基金财产；未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。

(4) 对于因为基金投资产生的应收财产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到帐日期并通知托管人，到帐日基金财产没有到达托管人处的，托管人应及时通知基金管理人采

取措施进行催收。

(5) 对于基金申（认）购过程中产生的应收财产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到帐日期并通知基金托管人，到帐日基金财产没有到达托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。

(6) 除依据法律法规和基金合同的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

2、募集资金的验证

认购期内销售机构按销售与服务代理协议的约定，将认购资金划入基金认购专户。基金设立募集期满，由基金管理人聘请具有从事证券业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的2名以上（含2名）中国注册会计师签字有效。验资完成，基金管理人应将募集到的全部资金存入基金托管人为基金开立的基金托管专户中。

若基金募集期限届满，未能达到基金合同生效的条件，由基金管理人按规定办理退款事宜。

3、基金的银行账户的开设和管理

在集中账户托管模式下，基金托管人以基金托管人的名义在其营业机构开设基金托管专户，保管基金的银行存款。该基金托管专户是指基金托管人在集中托管模式下，代表所托管的基金与中国证券登记结算有限责任公司进行一级结算的专用账户。该账户的开设和管理由基金托管人承担。本基金的一切货币收支活动，均需通过基金托管人的基金托管专户进行。在分散账户托管模式下，基金托管人以基金的名义在其营业机构开设基金银行存款账户。

基金托管专户和基金银行账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

基金托管专户和基金银行账户的管理应符合《银行账户管理办法》、《现金管理条例》、《中国人民银行利率管理的有关规定》、《关于大额现金支付管理的通知》、《支付结算办法》以及中国人民银行的其它规定。

4、基金证券账户、证券交易资金账户的开设和管理

基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司/深圳分公司开设证券账户。

基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限公司上海分公司/深圳分

公司开立基金证券交易资金账户，用于证券清算。

5、债券托管乙类账户的开设和管理

（1）基金合同生效后，基金管理人负责向中国证监会和中国银行业监督管理机构申请基金进入全国银行间同业拆借市场进行交易。由基金管理人在中国外汇交易中心开设同业拆借市场交易账户，由基金托管人在中央国债登记结算有限责任公司开设债券托管乙类账户，并由基金托管人负责基金的债券的后台匹配及资金的清算。

（2）同业拆借市场交易账户和债券托管账户根据中国银行业监督管理机构、中国外汇交易中心和中央国债登记结算有限责任公司的有关规定，由基金管理人和基金托管人签订补充协议，进行使用和管理。基金管理人和基金托管人应一起负责为基金对外签订全国银行间国债市场回购主协议，正本由基金托管人保管，基金管理人保存副本。

6、基金有关实物证券的保管

实物证券由基金托管人存放于托管银行的保管库；也可存入中央国债登记结算有限责任公司或中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库。保管凭证由基金托管人持有。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。托管人对托管人以外机构实际有效控制的证券不承担责任。

7、与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同的签署，由基金管理人负责签署。签署时应保证基金一方持有 2 份以上正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。如上述合同只有一份正本先由基金管理人取得，则基金管理人应及时将正本送达基金托管人处保管。

（四）基金资产净值计算和会计核算

1、基金资产净值的计算和复核

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日基金总份额后的价值。

基金管理人应在每个工作日对基金资产进行估值。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值并以加密传真方式或基金管理人、基金托管人双方确认的其他方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后，盖章并以加密传真方式或基金管理人、基金托管人双方确认的其他方式传送给基金管理人，由基金管理人对外发布基金净值公告。

基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。因此，就与本基金有关的

会计问题，本基金的会计责任方是基金管理人，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金净值的计算结果对外予以公布。

2、基金帐册的建立与核对

基金管理人和基金托管人在基金合同生效后，应按照相关各方约定的同一记帐方法和会计处理原则，分别独立地设置、登录和保管本基金的全套帐册，对相关各方各自的帐册定期进行核对，互相监督，以保证基金资产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。

经对帐发现相关各方的帐目存在不符的，基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正，保证相关各方平行登录的帐册记录完全相符。若当日核对不符，暂时无法查找到错帐的原因而影响到基金资产净值的计算和公告的，以基金管理人的帐册为准。

3、基金财务报表与定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后5个工作日内完成。

在本基金的基金合同生效后每6个月结束之日起45日内，基金管理人对招募说明书更新一次。基金管理人在每个季度结束之日起15个工作日内完成季度报告编制并公告；在会计年度半年终了后60日内完成半年度报告编制并公告；在会计年度结束后90日内完成年度报告编制并公告。

基金管理人在月度报表完成当日，对报表加盖公章后，以加密传真方式将有关报表提供基金托管人复核；基金托管人在2个工作日内立即进行复核，并将复核结果及时书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后5个工作日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在半年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后10个工作日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后15个工作日内复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金托管人在复核过程中，发现相关各方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以相关各方认可的帐务处理方式为准。

核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖公章，相关各方各自留存一份。

基金托管人在对财务会计报告、季度报告、更新招募说明书、半年度报告或年度报告复核完毕后，需盖章确认或出具相应的复核确认书，以备有权机构对相关文件审核时提示。

（五）基金份额持有人名册的登记和保管

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人委托中国证券登记结算有限公司担任本基金的注册登记人，基金份额持有人名册的编制及持续保管义务由注册登记人承担，但基金管理人应保证基金份额持有人名册的真实性、准确性和完整性。

基金合同生效日、基金合同终止日、基金权益登记日、基金份额持有人大会权利登记日、每月最后一个交易日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册，由注册登记人编制，由基金管理人审核并交基金托管人保管。基金托管人有权要求基金管理人提供任意一个交易日或全部交易日的基金份额持有人名册，基金管理人应及时提供，不得拖延或拒绝提供，但基金托管人应保证不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

涉及到基金份额持有人名册的所有费用，应从注册登记费用中支取，不得从基金财产中列支，也不得向基金托管人另外收取。

基金托管人和注册登记人对基金份额持有人名册的保管，按国家法律法规及证券监督管理部门的要求执行。

（六）争议处理和法律适用

相关各方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，除经友好协商可以解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在北京，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，相关各方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律管辖。

（七）托管协议的修改和终止

1、本协议相关各方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。修改后的新协议向中国证监会办理完必要的核准或备案手续后生效。

2、发生以下情况，本托管协议终止：

- （1）基金合同终止；
- （2）因基金托管人解散、依法被撤销、破产或其他事由造成本基金更换基金托管人；
- （3）因基金管理人解散、依法被撤销、破产或其他事由造成本基金更换基金管理人；
- （4）发生《基金法》或其他法律法规规定的终止事项。

二十四、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

（一）网上交易服务

投资人除通过基金管理人的直销网点和销售机构的销售网点办理申购、赎回、信息查询等业务外，还可通过基金管理人网站（www.msfnunds.com.cn）享受网上交易服务。具体业务规则详见本公司网站。

（二）网上查询服务

投资人除通过基金管理人的销售机构的销售网点查询基金持有情况之外，还可通过基金账号或者身份证号码和查询密码登陆基金管理人网站（www.msfnunds.com.cn）“账户查询”栏目，可享有账户查询、信息定制、资料修改等多项在线服务。

（三）服务产品的定制及发送

投资人可根据个人需要，通过基金管理人客服电话、网站、电子邮件、短信等方式订阅或取消对账单服务及免费定制信息。投资人还可通过发送邮件、短信进行业务咨询。

1、对账单服务：基金管理人将按照投资人需求，提供电子账单（电子邮件、短信）、纸质账单。上述账单需投资人通过拨打基金管理人客服电话、登录基金管理人网站、发送电子邮件或短信等方式向基金管理人主动定制。对账单服务发送规则如下：

（1）电子账单：如投资人成功定制电子账单（短信或邮件），基金管理人将在每月初五个工作日内发送；

（2）纸质账单：如投资人成功定制纸质账单，基金管理人将在每季度结束后 15 个工作日内，向本季度内有交易的投资人寄送季度纸质对账单；每年度结束后 20 个工作日内，基金管理人向第四季度内有交易或年度末有余额的投资人寄送纸质年度对账单。

2、免费定制信息：投资人可定制的信息包括：基金份额净值、基金交易确认、基金视窗、基金理财刊物、基金公告等信息。基金管理人可通过邮件或短信方式向投资人发送所定制的信息。

（四）在线客服服务

投资人可登录基金管理人网站（www.msfnunds.com.cn）通过“在线客服”进行业务咨询或留言。在线客服提供基金产品信息查询、基金业务咨询、服务投诉和建议等服务。

在线客服服务时间为周一至周五上午9：00-11：00，下午13：00-17：00。

（五）客户服务中心电话服务

客户服务中心自动语音系统提供7×24小时基金净值信息、账户交易情况、基金产品与服务等信息查询。

客户服务中心人工座席提供每周五天，每天不少于8小时的座席服务，投资人可通过该电话查询认购、申购和赎回等交易情况、基金账户余额、信息定制、资料修改、服务投诉及获得其他业务咨询等专项服务。

（六）客户投诉处理

投资人可以通过拨打基金管理人客户服务中心电话或以书信、传真、电子邮件等方式，对基金管理人所提供的服务提出建议或投诉（具体渠道见以下服务联系方式）。

对于工作日受理的投诉，原则上当日回复，不能当日回复的，在3个工作日内回复。对于非工作日受理的投诉，原则上在顺延的第一个工作日回复，不能及时回复的，在3个工作日内回复。

（七）服务联系方式

基金管理人网址：[http:// www.msfnunds.com.cn](http://www.msfnunds.com.cn)

客服电子信箱：services@msfnunds.com.cn

客户服务电话：400-8888-668（免长途费）

传真：（0755）82990631

信件邮寄地址：深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第二座第17楼摩根士丹利华鑫基金客户服务中心

邮编：518048

二十五、其他应披露事项

自上次招募说明书更新截止日以来涉及本基金的公告：

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	本公司关于旗下基金参与浙江同花顺基金销售有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年3月30日
2	本基金2015年年度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年3月30日
3	本公司关于旗下基金参加深圳市新兰德证券投资咨询有限公司费率优惠活动	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年3月31日

	动的公告		
4	本公司关于增加上海联泰资产管理有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年4月1日
5	本公司关于旗下基金参与上海联泰资产管理有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年4月1日
6	本公司关于增加上海凯石财富基金销售有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年4月11日
7	本公司关于旗下基金参与上海凯石财富基金销售有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年4月11日
8	本公司关于增加深圳富济财富管理有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年4月12日
9	本公司关于旗下基金参与深圳富济财富管理有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年4月12日
10	本公司关于增加北京钱景财富投资管理有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年4月15日
11	本公司关于旗下基金参与北京钱景财富投资管理有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年4月15日
12	本基金2016年1季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年4月20日
13	本公司关于旗下基金参与上海好买基金销售有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年6月6日
14	本公司关于增加上海利得基金销售有限公司为销售机构并参与申（认）购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年6月8日
15	本公司关于增加申万宏源西部为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年6月16日
16	本公司关于旗下基金参加申万宏源西部申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年6月16日
17	本公司关于调整开立基金账户证件类型类型的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年6月20日
18	本公司关于增加盈米财富为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年6月22日
19	本公司关于旗下基金参加盈米财富费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年6月22日
20	本公司关于旗下部分基金在上海陆金所资产管理有限公司开通基金定期定额投资业务并参与定期定额投资申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年6月24日
21	本公司关于旗下部分基金参与交通银行网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年6月30日

22	本公司关于旗下基金参与华泰证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年7月1日
23	本公司关于旗下部分基金参加浦发银行财智组合基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年7月1日
24	本公司关于增加中证金牛为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年7月18日
25	本公司关于旗下基金参加中证金牛费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年7月18日
26	本基金2016年2季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年7月21日
27	本公司关于增加国金证券股份有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年7月25日
28	本公司关于增加汇成基金为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年8月2日
29	本公司关于旗下基金参加汇成基金费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年8月2日
30	本公司关于增加大泰金石为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年8月12日
31	本公司关于旗下基金参加大泰金石费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年8月12日
32	本基金2016年半年度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年8月29日
33	本公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司手机银行申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年9月20日

上述公告同时在公司网站 www.msfnfunds.com.cn 上披露。

二十六、招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书存放在本基金管理人、基金托管人和销售代理人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅；投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件，但应以招募说明书正本为准。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

投资者还可以直接登录基金管理人的网站 (<http://www.msfnfunds.com.cn>) 查阅和下载招募说明书。

二十七、备查文件

- （一）中国证监会核准本基金募集的文件；
- （二）本基金基金合同；
- （三）本基金登记结算服务协议；
- （四）本基金托管协议；
- （五）法律意见书；
- （六）基金管理人业务资格批件、营业执照；
- （七）基金托管人业务资格批件、营业执照；
- （八）中国证监会要求的其他文件。

摩根士丹利华鑫基金管理有限公司

二〇一六年十一月八日