

# 摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金

## 招募说明书（更新）

（2018 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

摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金（以下简称“本基金”）于2004年2月3日经中国证券监督管理委员会证监基金字[2004]11号文《关于同意巨田基础行业证券投资基金设立的批复》核准公开募集。本基金的基金合同于2004年3月26日正式生效。本基金为契约型开放式基金。

本基金管理人以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议通过《修改基础行业定义并相应修改基金合同中投资比例和业绩比较基准及分红条款的议案》。基金份额持有人大会决议于2012年3月5日经中国证券监督管理委员会证监许可[2012]277号文核准。本基金基金合同修改自2012年3月5日起生效。基金合同全文已登载于本基金管理人网站。

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价值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，也可能面临基金份额净值大幅波动风险。

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。

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法律法规及本基金基金合同的有关规定，经与基金托管人协商一致并报中国证监会相关派出机构备案，本基金对基金合同中的释义、申购赎回、基金的投资、估值和信息披露等有关条款进行了修订。上述修订于2018年3月24日起生效，系因相应的法律法规发生变动而进行，不涉及基金份额持有人权利义务关系的变化，对基金份额持有人的利益无实质性不利影响，且已履行适当程序。有关详细信息参见本公司于2018年3月24日发布的《摩根士丹利华鑫基金管理有限公司关于修订旗下基金基金合同、托管协议条款的公告》及本公司网站最新披露的本基金基金合同。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为2018年9月26日，有关财务数据和净值表现截止日为2018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.....	3
四、基金托管人.....	11
五、相关服务机构.....	13
六、基金的募集.....	34
七、基金合同的生效.....	34
八、基金份额的申购、赎回与转换.....	34
九、基金份额的非交易过户、转托管与冻结解冻.....	39
十、基金的投资.....	40
十一、基金的业绩.....	48
十二、基金的财产.....	50
十三、基金资产的估值.....	51
十四、基金的收益分配.....	56
十五、基金的费用与税收.....	57
十六、基金的会计与审计.....	60
十七、基金的信息披露.....	60
十八、风险揭示.....	63
十九、基金的终止与清算.....	67
二十、基金合同的内容摘要.....	68
二十一、基金托管协议的内容摘要.....	77
二十二、对基金份额持有人的服务.....	81
二十三、其他应披露事项.....	83
二十四、招募说明书的存放及查阅方式.....	84
二十五、备查文件.....	84

## 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》、《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》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法律法规以及《摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金基金合同》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本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、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

<b>基金或本基金</b>	指摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金
<b>基金合同</b>	指《摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金基金合同》及对本合同的任何修订和补充
<b>托管协议</b>	指《摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金托管协议》及对该协议的任何修订和补充
<b>招募说明书</b>	指《摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金招募说明书》及其更新
<b>发售公告</b>	指《巨田基础行业证券投资基金发售公告》
<b>中国证监会</b>	指中国证券监督管理委员会
<b>中国银监会</b>	指中国银行业监督管理委员会
<b>《基金法》</b>	指《中华人民共和国证券投资基金法》及立法机关对其作出的修订
<b>《流动性规定》</b>	指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订
<b>基金合同当事人</b>	指受基金合同约定，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

<b>基金管理人</b>	指摩根士丹利华鑫基金管理有限公司
<b>基金托管人</b>	指中国光大银行股份有限公司
<b>注册登记业务</b>	指本基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等
<b>注册登记人</b>	指办理本基金注册登记业务的机构。本基金的注册登记人为摩根士丹利华鑫基金管理有限公司或接受摩根士丹利华鑫基金管理有限公司委托代为办理本基金注册登记业务的机构
<b>销售代理人</b>	指依据有关销售代理协议办理本基金认购、申购、赎回和其他基金业务的代理机构
<b>销售机构</b>	指基金管理人及销售代理人
<b>基金份额持有人</b>	指依法或依基金合同、招募说明书取得基金份额的投资者
<b>基金投资者</b>	指个人投资者和机构投资者
<b>个人投资者</b>	指依法可以投资证券投资基金的具有中华人民共和国国籍的中国公民
<b>机构投资者</b>	指在中华人民共和国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立的企业法人、事业法人、社会团体法人或其他组织，及中国证监会批准的可以投资开放式证券投资基金的其他机构投资者（如QFII）。
<b>基金合同生效日</b>	指 2004 年 3 月 26 日
<b>基金终止日</b>	指基金合同规定的基金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的日期
<b>基金募集期</b>	指自招募说明书公告之日起到基金认购截止日的时间段，最长不超过 3 个月
<b>存续期</b>	指基金合同生效后合法存续的不定期之期限
<b>开放日</b>	指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日
<b>工作日</b>	指上海证券交易所、深圳证券交易所及其他相关证券交易场所的正常交易日
<b>T 日</b>	指销售机构在规定时间受理投资者申购、赎回或其他业务申请的日期
<b>申购</b>	指基金合同生效后，投资者通过销售人向基金管理人购买基金份额的行为
<b>赎回</b>	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

<b>基金账户</b>	指注册登记人为基金份额持有人开立的记录其持有的由该注册登记人办理注册登记的基金份额余额及其变动情况的账户
<b>基金交易账户</b>	指销售人为投资者开立的记录投资者通过该销售人买卖本基金基金份额引起的份额变动及结余情况的账户
<b>元</b>	指人民币元
<b>基金收益</b>	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
<b>基金资产总值</b>	指基金购买的各类证券、银行存款本息、基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和
<b>基金资产净值</b>	指基金资产总值减去负债后的价值
<b>基金资产估值</b>	指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程
<b>基础行业</b>	本基金定义的基础行业包括：基础工业行业、基础设施业和基础服务行业等国民经济中承担基本经济职能的行业和产业
<b>指定媒体</b>	指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体
<b>不可抗力</b>	指任何无法预见、无法克服并无法避免的事件或因素，包括：相关法律、法规和规定的变更；国际、国内金融市场风险事故的发生；自然或人为破坏造成的交易系统或交易场所无法正常工作；战争或动乱等
<b>流动性受限资产</b>	指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等

### 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：广东省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：广东省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：人民币22,750万元

联系人：赵婧

联系电话：(0755) 88318883

股权结构应为：华鑫证券有限责任公司(39.560%)、摩根士丹利国际控股公司(37.363%)、深圳市招融投资控股有限公司(10.989%)、深圳市基石创业投资有限公司(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。现任本公司董事长兼任代理总经理。

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、华鑫证券有限责任公司总裁、党委副书记、董事、华鑫证券投资有限公司董事长、华鑫期货有限公司董事。2017年5月至今任上海华鑫股份有限公司总经理，现任本公司副董事长。

田明先生，上海交通大学学士、香港中文大学专业会计学硕士。曾任上海广电(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、上海华鑫股份有限公司总会计师、华鑫证券有限责任公司财务副总监、总监、财务负责人。2017年5月至今任上海华鑫股份有限公司总会计师。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学博士研究生。曾先后担任兰州炼油化工总厂自动化研究所职员、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、华鑫证券有限责任公司副总经理，华鑫证券投资有限公司法定代表人、董事长。现任华鑫证券有限责任公司监事会主席，华鑫宽众投资有限公司法定代表人、董事长，本公司董事。

Todd Coltman 先生，毕业于加利福尼亚州立大学通讯专业，并于乔治敦大学获得法学博士学位。曾任美国银行高级政策分析师、年利达律师事务所律师、众达律师事务所律师。



2004年加入摩根士丹利负责亚洲地区不动产投资（REI）业务的不动产收购融资工作，2016年至今担任摩根士丹利亚洲有限公司投资管理业务亚洲地区运营总监。现任本公司董事。

Jeremy Alton Huff先生，杜克大学文学学士，哈佛大学法学博士。曾任美国世达律师事务所律师、NBA中国法律副总监、NBA中国品牌娱乐的副总裁。2017年3月至今任摩根士丹利董事总经理并担任中国首席运营官。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，招商局金融集团有限公司总经理助理。2016年4月至今任招商局金融集团有限公司副总经理。现任本公司董事。

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2017年11月任天衡会计师事务所注册会计师、高级合伙人，2017年11月起至今任中天运会计师事务所（特殊普通合伙）担任合伙人，兼任俊知集团有限公司独立董事、倍加洁集团股份有限公司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，中国人民大学法学硕士。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（深圳）律师事务所合伙人，兼任华南经济贸易仲裁委员会和深圳仲裁委员会仲裁员，广东省知识产权局入库专家。现任本公司独立董事。

苗复春先生，中国人民大学经济学硕士。2007年5月至今任中国人寿养老保险公司顾问。曾任内蒙古商业局计委科长，中国社科院技术经济研究所助理研究员，国务院技术经济研究中心研究员，国务院办公厅副局长，外经贸部办公厅主任，中央财经领导小组办公室局长，中国人寿保险公司副总经理，中国人寿保险股份有限公司执行董事、执行副总裁，中国人寿保险集团公司党委副书记、副总裁，退休后任中国人寿养老保险公司顾问，兼任中国生产力学会副会长。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，2017年6月起任上海华鑫股份有限公司副总经理。现任本公司监事长。

Mok Tuang Wei 先生，加州大学伯克利分校学士、硕士。曾经在瓦乔维亚证券负责发行结构化和证券化产品，并在安永会计师事务所提供企业融资咨询服务。2010年9月加入摩根士丹利亚太区，2014年加入摩根士丹利风险投资管理团队，现任摩根士丹利投资风险管

理的执行董事。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、招商局金融集团有限公司财务部总经理，2016年5月起担任招商局金融集团有限公司总经理助理。现任本公司监事。

赵婧女士，英国雷丁大学国际证券投资及银行学理学学士、英国诺丁汉大学风险管理硕士。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，现任本公司助理总经理兼任综合管理部总监、规划发展部总监、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、渠道业务二部总监、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，历任研究管理部研究员，现任本公司权益投资部总监助理、基金经理、职工监事。

### 3、公司高管人员

于华先生，董事长、代理总经理，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。21年证券基金行业从业经历。曾任职于西安证券有限责任公司总经理办公室、华鑫证券有限责任公司总裁办公室，曾任华鑫证券有限责任公司深圳营业部总经理。2009年4月加入本公司，现任本公司副总经理兼董事会秘书。

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，21年证券基金行业从业经历。曾就职于巨田证券有限责任公司，历任交易管理总部综合管理部经理助理，总经理办公室主任助理，资产管理部理财部副经理、经理，研究所研究员，2003年9月加入本公司，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、督察长。现任本公司副总经理兼风险管理部总监。

陈竽女士，英国约克大学项目分析、金融与投资硕士，14年证券基金行业从业经历。曾任泰达宏利基金管理有限公司高级风险管理经理，农银汇理基金管理有限公司监察稽核部

副总经理（主持工作），中信保诚基金管理有限公司监察稽核总监。现任本公司督察长。

#### 4、本基金基金经理

王大鹏先生，中山大学金融学博士，10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，历任研究管理部研究员、总监助理、副总监，现任研究管理部总监、基金经理。2015年1月至2017年6月期间任摩根士丹利华鑫资源优选混合型证券投资基金(LOF)基金经理，2016年2月至2017年4月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，2016年6月起任摩根士丹利华鑫健康产业混合型证券投资基金基金经理，2017年5月任本基金基金经理，2017年6月起任摩根士丹利华鑫品质生活精选股票型证券投资基金基金经理和摩根士丹利华鑫卓越成长混合型证券投资基金基金经理。

本基金历任基金经理：管卫泽，于2004年3月至2005年3月管理本基金；陈守红，于2005年4月至2007年10月管理本基金；廖京胜，于2007年11月至2009年8月管理本基金；李君，于2009年8月至2012年1月管理本基金；盛军锋，于2012年1月至2013年10月管理本基金；王增财，2013年10月至2017年1月管理本基金；孙海波，2017年1月至2017年5月管理本基金。

#### 5、投资决策委员会成员

主任委员：何晓春，助理总经理、权益投资部总监、基金经理

副主任委员：李轶，助理总经理、北京分公司总经理、固定收益投资部总监、基金经理

委员：王大鹏，研究管理部总监、基金经理；夏青，数量化投资部总监、组合投资部总监、基金经理；李功舜，交易管理部总监；张雪，固定收益投资部副总监、基金经理

秘书：王大鹏，研究管理部总监、基金经理

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、本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、本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、本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、本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，维护内部控制制度的有效执行。

(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、甲 25 号中国光大中心

成立日期：1992 年 6 月 18 日

批准设立机关和批准设立文号：国务院、国函[1992]7 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：466.79095 亿元人民币

法定代表人：李晓鹏

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【2002】75 号

投资与托管业务部总经理：张博

电话：(010) 63636363

传真：(010) 63639132

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

### (二) 投资与托管业务部部门及主要人员情况

法定代表人李晓鹏先生，曾任中国工商银行河南省分行党组成员、副行长，中国工商银行总行营业部总经理，中国工商银行四川省分行党委书记、行长，中国华融资产管理公司党委委员、副总裁，中国工商银行党委委员、行长助理兼北京市分行行长，中国工商银行党委委员、副行长，中国工商银行股份有限公司党委委员、副行长、执行董事；中国投资有限责任公司党委副书记、监事长；招商局集团副董事长、总经理、党委副书记。曾兼任工银国际

控股有限公司董事长、工银金融租赁有限公司董事长、工银瑞信基金管理公司董事长，招商银行股份有限公司副董事长、招商局能源运输股份有限公司董事长、招商局港口控股有限公司董事会主席、招商局华建公路投资有限公司董事长、招商局资本投资有限责任公司董事长、招商局联合发展有限公司董事长、招商局投资发展有限公司董事长等职务。现任中国光大集团股份公司党委书记、董事长，兼任中国光大银行股份有限公司党委书记、董事长，中国光大集团有限公司董事长，中国旅游协会副会长、中国城市金融学会副会长、中国农村金融学会副会长。武汉大学金融学博士研究生，经济学博士，高级经济师。

张博先生，曾任中国光大银行厦门分行副行长，西安分行行长，乌鲁木齐分行筹备组组长、分行行长，青岛分行行长，光大消费金融公司筹备组组长。曾兼任中国光大银行电子银行部副总经理（总经理级），负责普惠贷款团队业务。现任中国光大银行投资与托管业务部总经理。

### （三）证券投资基金托管情况

截至 2018 年 9 月 30 日，中国光大银行股份有限公司托管华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金、天弘尊享定期开放债券型发起式证券投资基金、汇安多策略灵活配置混合型证券投资基金等共 118 只证券投资基金，托管基金资产规模 3106.78 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。投资与托管业务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投资与托管业务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》、《中国光大银行投资与托管业务部保密规定》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。中国光大银行投资与托管业务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，安装了录像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。基金管理人对基金托管人通知的违规事项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、时亚蒙

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) 50429808

(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”、快付通等支付渠道以及基金汇款交易业务。支持银联通渠道、汇付天下“天天盈”渠道、快付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](mailto: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：北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心

办公地址：北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心

法定代表人：李晓鹏

客户服务电话：95595（全国）

网址：[www.cebbank.com](http://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：易会满

客户服务电话：95588（全国）

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

## (3) 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：陈四清

客户服务电话：95566（全国）

网址：www.boc.cn

## (4) 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：田国立

客户服务电话：95533

网址：www.ccb.com

## (5) 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

## (6) 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

## (7) 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

## (8) 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：谢永林

联系人：施艺帆

联系电话：021-50979384

客户服务电话：95511-3

网址：www.bank.pingan.com

## (9) 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

## (10) 烟台银行股份有限公司

注册（办公）地址：山东省烟台市芝罘区海港路 25 号

法定代表人：叶文君

联系人：王淑华

联系电话：0535-6699660

客户服务电话：4008-311-777

网址：www.yantaibank.net

## (11) 河北银行股份有限公司

注册（办公）地址：石家庄市平安北大街 28 号

法定代表人：乔志强

客户服务电话：400-612-9999

网址：www.hebbank.com

## (12) 哈尔滨银行股份有限公司

注册（办公）地址：哈尔滨市道里区尚志大街 160 号

法定代表人：郭志文

客户服务电话：95537、400-60-95537

网址：www.hrbb.com.cn

## (13) 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

## (14) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：王东明

联系人：侯艳红

联系电话：010-60838995

客户服务电话：400-889-5548

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

(15) 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](http://www.csc108.com)

(16) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

法定代表人：陈共炎

联系人：邓颜

联系电话：010-66568292

客户服务电话：4008-888-888 或 95551

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

(17) 信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区宣武门西大街甲 127 号大成大厦 6 层法定代表人：张志刚

联系人：尹旭航

联系电话：(010) 63081000

客户服务电话：95321

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

(18) 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>

(19) 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

(20) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号  
办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼  
法定代表人：杨德红  
联系人：芮敏祺、朱雅崑  
联系电话：(021) 38676161  
客户服务电话：95521  
网址：www.gtja.com

(21) 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

(22) 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

(23) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号  
办公地址：上海市浦东新区长柳路 36 号  
法定代表人：杨华辉  
联系人：乔琳雪  
联系电话：021-38565547

客户服务电话：95562

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

(24) 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](http://www.95579.com)

(25) 中银国际证券股份有限公司

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](http://www.bocichina.com)

(26) 东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山南路318号2号楼22层、23层、25层-29层

办公地址：上海市中山南路318号2号楼13层、21层-23层、25-29层、32层、36层、39层、40层

法定代表人：潘鑫军

联系人：孔亚楠

联系电话：021-63325888

客户服务电话：95503

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

(27) 湘财证券股份有限公司

注册（办公）地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼

法定代表人：孙永祥

联系人：李欣

联系电话：021-38784580-8918

客户服务电话：95351

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

(28) 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

(29) 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.zts.com.cn

(30) 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

(31) 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

(32) 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

(33) 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

（34）东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州工业园区翠园路 181 号商旅大厦

办公地址：苏州工业园区星阳街 5 号

法定代表人：范力

联系人：方晓丹

联系电话：0512-65581136

客户服务电话：4008-601555

网址：www.dwzq.com.cn

（35）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：高利

联系电话：0731-85832507

客户服务电话：95571

网址：www.foundersc.com

（36）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

（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：霍达

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) 华西证券股份有限公司

注册（办公）地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

法定代表人：杨炯洋

联系人：谢国梅

联系电话：010-52723273

客户服务热线：95584

网址：www.hx168.com.cn

## (42) 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

(43) 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：深圳市福田区深南大道 7028 号时代科技大厦 20 楼西

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：4008-882-882

网址：www.wanhesec.com

(44) 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

(45) 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

(46) 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

(47) 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

（48）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

（49）中国民族证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼

办公地址：北京市朝阳区北四环中路盘古大观 40 层-43 层

法定代表人：何亚刚

联系人：齐冬妮

联系电话：010-59355807

客户服务电话：40088-95618

网址：www.e5618.com

（50）中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 6 层

法定代表人：丁学东

联系人：任敏、陈曦

联系电话：010-65051166

客户服务热线：010-65051166

网址：www.cicc.com

（51）上海证券有限责任公司

注册（办公）地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

法定代表人：李俊杰

联系电话：021-53686888

客户服务电话：021-962518

网址：[www.962518.com](http://www.962518.com)

(52) 天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

办公地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 5 层

法定代表人：林义相

联系人：尹伶

联系电话：(010) 66045529

客户服务电话：010-66045678

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

(53) 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](http://licaike.hexun.com)

(54) 深圳众禄基金销售股份有限公司

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

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

联系电话：(0755) 33227950

客户服务电话：4006-788-887

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

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

(55) 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](http://www.fund123.cn)

(56) 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>

(57) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

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

法定代表人：杨文斌

联系人：张茹

联系电话：021-20613999

客户服务电话：400-700-9665

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

(58) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 7 楼宛平南路 88 号东方财富大厦

法定代表人：其实

联系人：黄妮娟

联系电话：021-54509998

客户服务电话：400-1818-188

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

(59) 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：上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层

法定代表人：张跃伟

联系人：沈雯斌

联系电话：021-58788678-8201

客户服务电话：400-820-2899

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

(60) 诺亚正行基金销售有限公司

注册地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室

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

法定代表人：汪静波

联系人：方成

联系电话：021-38602377

客户服务电话：400-821-5399

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

(61) 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>

(62) 宜信普泽（北京）基金销售有限公司

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

法定代表人：戎兵

联系人：王巨明

联系电话：010-52855650

客户服务电话：400-6099-200

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

(63) 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.cifcofund.com](http://www.cifcofund.com)

(64) 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](http://www.myfund.com)

(65) 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幢1层、2层、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

(66) 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

(67) 上海汇付基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区中山南路100号19层

办公地址：上海市宜山路700号普天信息产业园2期C5栋汇付天下总部大楼2楼

法定代表人：冯修敏

联系人：陈云卉

联系电话：021-33323999-5611

客户服务电话：400-820-2819

网址：fund.bundtrade.com

(68) 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：宁博宇

联系电话：021-20665952

客户服务电话：4008219031

网址：www.lufunds.com

(69) 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

（70）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.vstonewealth.com

（71）深圳富济基金销售有限公司

注册（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单位

法定代表人：刘鹏宇

联系人：刘勇

联系电话：0755-83999907-8814

客户服务热线：0755-83999907

网址：www.jinqianwo.cn

（72）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：陈剑炜

联系电话：010-57418813

客户服务热线：400-893-6885

网址：www.qianjing.com

（73）上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室

办公地址：上海市虹口区东大名路1098号浦江金融世纪广场18层

法定代表人：李兴春

联系人：陈洁

联系电话：021-60195121

客户服务热线：400-921-7755

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

(74) 珠海盈米财富管理有限公司

注册地址: 珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

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

法定代表人: 肖雯

联系人: 黄敏嫦

联系电话: 020-89629099

客户服务电话: 020-89629066

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

(75) 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](http://www.jnlc.com)

(76) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址: 北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界财富中心 A 座 11 层 1108 号

办公地址: 北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界财富中心 A 座 11 层

法定代表人: 王伟刚

联系人: 丁向坤

联系电话: 010-56282140

客户服务热线: 400-619-9059

网址: [www.hc jijin.com](http://www.hc jijin.com)

(77) 大泰金石基金销售有限公司

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: [www.vstonewealth.com](http://www.vstonewealth.com)

(78) 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：赖任军

联系人：刘昕霞

联系电话：0755-29330513

客户服务热线：400-930-0660

网址：www.jfzinv.com

(79) 上海万得基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址：上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼

法定代表人：王廷富

联系人：徐亚丹

联系电话：021-51327185

客户服务热线：400-821-0203

网址：www.520fund.com.cn

(80) 北京新浪仓石基金销售有限公司

注册（办公）地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块  
新浪总部科研楼 5 层 518 室

法定代表人：李昭琛

联系人：付文红

联系电话：010-62676405

客户服务热线：010-62675369

网址：www.xincai.com

(81) 北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路甲 19 号 SOHO 嘉盛中心 30 层

法定代表人：周斌

联系人：张晔

联系电话：010-59313591

客户服务热线：4008-980-618

网址：www.chtfund.com

(82) 北京晟视天下投资管理有限公司

注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街甲六号万通中心 D 座 28 层

法定代表人：蒋煜

联系人：杨雪

联系电话：010-58170963

客户服务热线：400-818-8866

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

(83) 北京肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15

办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院A座17层

法定代表人：江卉

联系人：徐伯宇

联系电话：010-89189285

客户服务热线：95118/400-088-8816

网址：<http://fund.jd.com>

(84) 南京苏宁基金销售有限公司

注册（办公）地址：南京玄武区苏宁大道1-5号

法定代表人：钱燕飞

联系人：赵耶

联系电话：18551602256

客户服务热线：95177

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

(85) 济安财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环中路7号4号楼40层4601室

法定代表人：杨健

联系人：李海燕

联系电话：010-65309516

客户服务热线：400-673-7010

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

(86) 上海云湾基金销售有限公司

注册（办公）地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层

法定代表人：戴新装

联系人：朱学勇

联系电话：021-20530012

客户服务热线：400-820-1515

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

(87) 通华财富（上海）基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区同丰路667弄107号201室

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场杨高南路799号3号楼9楼

法定代表人：兰奇

联系电话：021-60818588

客户服务热线：400-66-95156

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

(88) 上海挖财基金销售有限公司

注册（办公）地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

法定代表人：冷飞

联系人：孙琦

联系电话：021-50810687

客户服务热线：021-50810673

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

(89) 上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发展区）

办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

法定代表人：王翔

联系人：李关洲

联系电话：021-65370077

客户服务热线：400-820-5369

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

(90) 北京蛋卷基金销售有限公司

注册（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：钟斐斐

联系人：袁永姣

联系电话：010-61840688

客户服务热线：4000-618-518

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

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构销售本基金，并及时公告。销售机构可以根据情况变化增加或减少其销售城市、网点，并另行公告。

## （二）注册登记机构

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：赵恒

电话：(0755) 88318709

### (三) 出具法律意见书的律师事务所

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

联系人：冯艾

电话：(010) 58785588、(0755) 22163333

经办律师：宋萍萍、靳庆军

### (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：021-23238189

联系人：俞伟敏

经办注册会计师：许康玮、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 2004 年 2 月 3 日核准，核准文件名称为证监基金字[2004]11 号文《关于同意巨田基础行业证券投资基金设立的批复》。

本基金募集期为 2004 年 2 月 23 日至 2004 年 3 月 23 日。经深圳天健信德会计师事务所验资，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 1,854,893,478.59 份基金份额，有效认购户数为 17,274 户。

## 七、基金合同的生效

本基金合同已于 2004 年 3 月 26 日生效。

## 八、基金份额的申购、赎回与转换

### (一) 申购和赎回场所

投资者应当在销售机构办理开放式基金业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金的申购与赎回。

#### 1、直销机构

摩根士丹利华鑫基金管理有限公司的直销中心受理机构投资者和个人投资者的日常申

购、赎回业务。详情见“五、相关服务机构”部分相关内容。

## 2、其他销售机构

经本公司委托，具有销售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）；摩根士丹利华鑫基金管理有限公司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）申购、赎回开放日及开放时间

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，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回除外。

申购开始日：2004年4月1日。

赎回开始日：2004年5月14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。

### （三）申购、赎回的原则

1、“未知价”原则，即基金申购与赎回以申请受理当日的基金份额净值为基准进行交易；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即本基金申购以金额申请，基金赎回以基金份额申请；

3、当日的申购和赎回申请可以在基金管理人规定的时间以前撤销；

4、基金管理人可根据基金运作的实际情况在不损害基金份额持有人利益的前提下更改上述原则。基金管理人必须于新规则开始实施日的两日前在至少1种中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。

### （四）申购和赎回的程序

1、申请方式：书面申请或销售人公布的其他方式。

2、申购、赎回的确认：T日提交的有效申请，本基金注册登记人在T+1日内为投资者对该交易的有效性进行确认，投资者可在T+2日到销售网点柜台或以销售人规定的其他方式查询申购与赎回的确认情况。

3、申购、赎回款项的支付方式与时间：基金申购采用全额缴款方式。基金份额持有人赎回申请确认后，赎回款项在T+6日内支付。在发生延期支付的情形时，款项的支付办法参照基金合同的有关条款处理。

### （五）申购与赎回的数额限制

1、每个账户每笔申购的最低金额为人民币10元，其中个人投资者通过本公司直销中

心首次申购公司旗下基金的单笔最低限额为 100 万元（含），已有认购本基金记录的个人投资人不受首次申购最低金额 100 万元（含）的限制，但受追加申购最低金额的限制；

2、赎回的最低份额为 10 份，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、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。具体请参见相关公告；

4、基金管理人可根据市场情况，调整申购金额和赎回份额的数量限制，或者新增基金规模控制措施。基金管理人必须在调整前 3 个工作日至少在 1 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。

#### （六）申购份额与净赎回金额的计算

##### 1、申购份额的计算（外扣法）

申购份额为申购金额减去申购费用后除以以当日的基金份额净值为基准计算的申购价格，基金份额保留到小数点后两位，剩余部分舍去，舍去部分所代表的资产归属基金财产。

基金的申购金额包括申购费用和净申购金额，计算公式如下：

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

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

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

例 1：某非养老金投资者在基金存续期间投资 50000 元申购本基金，该日基金份额净值为 1.8000 元，则其可得到的申购份数计算如下：

$$\text{净申购金额} = 50000 / (1 + 1.5\%) = 49261.08 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 50000 - 49261.08 = 738.92 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 49261.08 / 1.8000 = 27367.26 \text{ 份}$$

即投资者投资 50000 元申购本基金，可得到 27367.26 份基金份额。

##### 2、净赎回金额的计算

净赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以以当日的基金份额净值为基准计算的赎回价格减去赎回费用，净赎回金额单位为元，以四舍五入方式保留到小数点后两位。计算公式如下：

$$\text{赎回金额} = \text{赎回份数} \times \text{赎回价格}$$

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

$$\text{赎回价格} = \text{申请日基金份额净值}$$

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

例 2：假定某投资者在 T 日赎回 10000 份基金份额，持有时间为 5 个月，该日基金份额净值为 1.2500 元，则其获得的净赎回金额计算如下：

$$\text{赎回金额} = 10000 \times 1.250 = 12500 \text{ 元}$$



赎回费用=12500×0.5%=62.50 元

净赎回金额=12500-62.50=12437.50 元

### 3、基金份额资产净值的计算

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。

#### （七）申购和赎回的注册登记

投资者申购基金成功后，注册登记机构在 T+1 日为投资者办理增加权益的登记手续，投资者自 T+2 日起有权赎回该部分基金份额。

投资者赎回基金份额成功后，注册登记机构在 T+1 日为投资者办理扣除权益的登记手续。

基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前两日在至少 1 种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

#### （八）拒绝或暂停接受申购

1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

（1）不可抗力导致基金无法正常工作；  
（2）证券交易场所交易时间非正常停市导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；  
（3）基金资产规模过大，可能对基金业绩产生负面影响并损害基金份额持有人的利益，或基金管理人认为无法找到合适的投资机会；

（4）基金管理人认为会有损于已有基金份额持有人利益的其他申购；

（5）当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请；

（6）基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过基金份额总数的 50%，或者有可能导致投资者变相规避前述 50%比例要求的情形；

（7）当一笔新的申购申请被确认成功，使本基金总规模超过基金管理人规定的本基金总规模上限时；或使本基金单日申购金额或净申购比例超过基金管理人规定的单日申购金额或净申购比例上限时；或该投资人累计持有的份额超过单个投资人累计持有的份额上限时；或该投资人单日或单笔申购金额超过单个投资人单日或单笔申购金额上限时；

（8）法律、法规规定或经中国证监会批准的其他情形。

当发生上述第（6）项情形时，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的申购申请进行限制，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。

2、在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请：

（1）不可抗力导致基金无法正常工作；

(2) 证券交易所非正常停市或者其他情形，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他原因，基金连续两个开放日及以上发生巨额赎回或在 10 个工作日内发生 3 次及以上巨额赎回；

(4) 当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金赎回申请或延缓支付赎回款项；

(5) 法律、法规规定或经中国证监会批准的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应当在当日立即向中国证监会备案。已接受的赎回申请，基金管理人应当足额兑付；如暂时不能足额兑付，应当按单个账户已被接受的赎回申请量占已接受的赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分在后续开放日予以兑付，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。投资者在申请赎回时可选择将当日未获受理部分予以撤销。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。

发生基金合同、招募说明书中未予载明的重大事项，但基金管理人认为需要暂停接受基金申购、赎回申请的，报经中国证监会批准后可以暂停接受投资者的申购、赎回申请。

暂停基金的申购、赎回，基金管理人应及时在至少 1 种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

暂停期间结束，基金重新开放时，基金管理人应予公告。

如果发生暂停的时间为 1 天，基金管理人将于重新开放日在至少 1 种中国证监会指定的信息披露媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告并公告最新的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过 1 天但少于 2 周，暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人将提前 1 个工作日在至少 1 种中国证监会指定的信息披露媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最新的基金份额净值。

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 周至少重复刊登暂停公告 1 次；暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前两日在至少 1 种中国证监会指定的信息披露媒体连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最新的基金份额净值。

#### (九) 巨额赎回的情形及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

单个开放日基金净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的份额余额)超过上一日基金总份额的 10%时，为巨额赎回。

##### 2、巨额赎回的处理方式

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接受全额赎回、部分延期赎回或暂停赎回。

(1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力兑付投资者的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

(2) 部分延期赎回：巨额赎回申请发生时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于基金总份额的 10%的前提下，可以对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当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开放日办理，但基金份额持有人可在申请赎回时选择将当日未获受理部分予以撤销；转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权并将以该下一个开放日的基金份额净值为准计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。发生巨额赎回并延期支付时，基金管理人将通过邮寄、传真或者基金合同、招募说明书规定的其他方式、在规定的时间内通知基金份额持有人，说明有关处理方法。同时在至少 1 种中国证监会指定的信息披露媒体上公告，通知投资者，并说明有关处理方法；通知和公告的时间最长不得超过两日。

(3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额 20%的，基金管理人有权对该单个基金份额持有人超出该比例的赎回申请实施延期办理，对该单个基金份额持有人剩余赎回申请与其他账户赎回申请按前述条款处理。

(4) 暂停赎回：基金连续 2 个开放日及以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经确认的赎回申请可以延期支付赎回款项，但不得超过正常支付时间的 20 个工作日，并应当在中国证监会指定的信息披露媒体上公告。

#### (十) 基金的转换

本基金于 2011 年 2 月 21 日起开放本基金与本公司作为注册登记机构的其他开放式基金之间的转换业务。

可办理转换业务的具体基金名称、转换业务办理时间、转换业务规则、转换费用等相关事项详见本公司 2011 年 2 月 17 日刊登的《摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金开放转换业务公告》。

由于本基金转换视同为转出基金的赎回和转入基金的申购，因此有关转出基金和转入基金暂停或拒绝申购、暂停赎回的有关规定适用于基金转换。

#### (十一) 定期定额投资计划

投资者可通过基金管理人指定的基金销售机构办理基金定期定额投资业务，约定每期扣款日和扣款金额，由销售机构于每期约定扣款日在投资者指定资金账户内自动完成扣款和基金申购申请。本基金定期定额申购的每期最低扣款金额为 10 元。投资者办理基金定期定额投资业务的具体实施方法，请参见基金管理人的相关公告。

## 九、基金份额的非交易过户、转托管与冻结解冻

### (一) 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《摩根士丹利华鑫基金管理有限公司开放式基金业务规则》为准。

## （二）转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管。转托管的具体办理依照《摩根士丹利华鑫基金管理有限公司开放式基金业务规则》办理。

## （三）基金的冻结和解冻

基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金账户或份额的冻结与解冻，以及注册登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

# 十、基金的投资

## （一）投资目标

分享中国经济持续发展过程所带来的基础行业的稳定增长，为基金份额持有人谋求长期、稳定的投资回报。

## （二）投资方向

本基金的投资对象为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，其中投资于基础行业类股票的比例不低于股票资产的 80%。

## （三）投资策略

本基金采用“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、股票选择和债券选择的过程中。

### （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，股票等权益类资产占基金资产的 30%-80%，其中投资于基础行业的

上市公司股票市值不低于股票等权益类资产的 80%，持有权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现金、债券等固定收益类资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 20%-70%；其中现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。除上述“现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%”项外，因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述要求的，基金管理人应当在十个交易日之内调整完毕。

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、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

本基金将根据对宏观经济变化及基础行业间的结构性差异和运行状况差异进行分析判断，及时适当调整各类别行业的配置比例，在保持与国民经济同步发展的基础上，重点投资于基础行业各发展阶段中的优势行业。这样既能实现本基金的投资目标并力求使基金持有人的利益最大化，也是降低本基金投资组合非系统风险的重要手段。

二级资产配置主要依据的内容按重要性排列如下：

1) 各行业增长与 GDP 增长的相关性分析；

2) 各行业发展趋势分析，包括政府对行业的扶持力度、相关产业政策、行业内投资增长趋势、未来市场空间、相关产业链（上下游）发展状况等；

3) 行业内上市公司对所属行业的代表性分析，包括产出、收入、利润等指标的代表性，增长趋势的代表性等；

4) 行业内上市公司规模和可投资容量分析，这里须结合行业内股票选择结果进行。

综合比较各类别行业在上述几个方面的优势和劣势，并结合股票选择结果确定在各行业配置比重。本基金投资于基础行业股票的比例不低于股票资产的 80%。

#### (3) 股票投资策略：

我们看好基础行业的稳定增长趋势，对于精选出来的个股，我们将坚持中长期持有的策略。

精选个股主要采用自下而上的方法：根据基础行业股票综合评级系统对备选库股票进行评级排序。选股的标准主要是针对基础行业特点，对上市公司进行财务状况分析、内在价值分析和相对价值分析，研究内容包括上市公司核心竞争力、持续经营能力、公司治理结构、

未来经营状况和现金流、财务状况和相对价值等方面。以持续盈利和稳定增长为核心标准，对上市公司进行分行业综合评级。

我们根据综合评级，从中寻找出业绩优良，发展前景较好并能代表行业发展趋势、价值被低估的公司进行实地调研，最终做出投资价值分析。对于这些精选出来的个股，我们采用中长期持有的策略。

我国证券市场处于新兴加转轨的阶段，市场的波动性依然较大，所以我们将依据市场判断和政策分析，适当采用时机选择策略，以优化组合表现。

#### （4）债券投资策略

我们以“类别资产配置、久期管理”为核心，通过“自上而下”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、不同市场间的资产配置券种选择三个层面进行投资管理；并结合使用“自下而上”的投资策略，即收益率曲线分析、久期管理、新债分析、信用分析、流动性分析等方法，实施动态投资管理，动态调整组合的投资品种，以达到预期投资目标。

##### 1) 自上而下的投资策略

a. 类别资产配置，是指通过对宏观经济、市场利率、市场供求等因素的综合分析，选择债券、可转换债券、回购、现金四类资产的配置比例；

b. 不同市场间资产配置，是按照目前市场结构将市场划分为，交易所国债市场、银行间国债市场、交易所企业债市场、银行间金融债市场与可转债市场，在不同市场间进行资产配置；

c. 券种选择，将根据市场的预期利率，收益率曲线的变动趋势，进行具体券种的选择。

##### 2) 自下而上的投资策略

###### a. 久期管理

久期是度量一个债券或者组合的价格对收益率变化敏感度的指标。久期管理就是以久期和凸性指标为工具，以对长期利率预期为基础，对组合的期限和品种进行合理配置，将收益率变化对于债券组合的影响控制在一定的范围之内。在预期利率下降时，增加组合久期，提高债券价格上升产生的收益；在预期利率上升时，减小组合久期，降低债券价格下降产生的损失。如果预期市场收益率曲线作强烈的整体向上平移，则降低债券组合的整体持仓比例，同时降低组合久期，来使组合损失降到最低。

###### b. 收益率曲线结构配置

收益率曲线是描述在未来所有到期时点（0-30年）上债券收益率的图形。收益率曲线形状的变化受到央行政策、经济增长率、通货膨胀率和货币供应量等多种因素的影响。收益率曲线结构配置就是以收益率曲线分析为基础，通过子弹形、哑铃形和梯形等配置方法，在短、中、长期债券间确定比例，以期从短、中、长期债券的相对价格差中取得收益。

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

###### （6）组合调整

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

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

#### （五）业绩比较基准

沪深300指数×55% + 中证综合债券指数×45%

#### （六）风险收益特征

本基金为混合型证券投资基金，其预期收益和风险高于货币型基金、债券型基金，而低

于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险、中高收益品种。

#### （七）投资限制

基金财产不得用于下列投资或者活动：

- 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。

#### （八）基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

基金管理人将按照国家有关规定代表本基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益。基金管理人在代表基金行使股东权利时应遵守以下原则及方法：

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 2、有利于基金资产的安全与增值；
- 3、独立行使股东权益，保护基金份额持有人的利益；
- 4、基金管理人按照国家有关规定代表本基金行使股东权利和债权人权利。

#### （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2018年10月24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2018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	80,352,026.92	78.92
	其中：股票	80,352,026.92	78.92
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	20,952,450.35	20.58
8	其他资产	514,084.99	0.50
9	合计	101,818,562.26	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	63,162,276.58	62.62
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	1,004,701.18	1.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,943,900.00	2.92
J	金融业	13,241,149.16	13.13
K	房地产业	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-

	合计	80,352,026.92	79.66
--	----	---------------	-------

## 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	600566	济川药业	191,306	7,535,543.34	7.47
2	000661	长春高新	29,600	7,015,200.00	6.95
3	002262	恩华药业	405,600	5,658,120.00	5.61
4	002376	新北洋	315,001	5,584,967.73	5.54
5	600132	重庆啤酒	172,361	5,034,664.81	4.99
6	601939	建设银行	669,909	4,850,141.16	4.81
7	000703	恒逸石化	246,700	4,181,565.00	4.15
8	603866	桃李面包	56,362	3,297,177.00	3.27
9	600036	招商银行	107,000	3,283,830.00	3.26
10	603517	绝味食品	77,923	3,264,973.70	3.24

## 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山东新北洋信息技术股份有限公司（以下简称“新北洋”）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。

2018年9月，新北洋收到中国证券监督管理委员会山东监管局下发的《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。

本基金投资新北洋（002376）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) 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。

(3) 其他资产的构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	91,334.65
2	应收证券清算款	407,683.24
3	应收股利	-
4	应收利息	4,434.21
5	应收申购款	10,632.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	514,084.99

(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。

## 十一、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 2018 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
2004 年 3 月 26 日至 2004 年 12 月 31 日	-6.60%	0.69%	-21.96%	1.00%	15.36%	-0.31%
2005 年 1 月 1 日至 2005 年 12 月 31 日	-6.77%	0.99%	-4.62%	1.06%	-2.15%	-0.07%
2006 年 1 月 1 日至 2006 年 12 月 31 日	66.36%	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%
2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	-30.03%	0.93%	-18.28%	0.91%	-11.75%	0.02%
2012 年 1 月 1 日至 2012 年 3 月 4 日	5.71%	0.96%	9.22%	1.10%	-3.51%	-0.14%
2012 年 3 月 5 日至 2012 年 12 月 31 日	-7.76%	0.89%	-1.50%	0.66%	-6.26%	0.23%
2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	11.02%	1.11%	-1.91%	0.77%	12.93%	0.34%

2014年1月1日至 2014年12月31日	29.05%	1.20%	29.10%	0.67%	-0.05%	0.53%
2015年1月1日至 2015年12月31日	55.83%	2.38%	7.15%	1.37%	48.68%	1.01%
2016年1月1日至 2016年12月31日	-1.09%	1.57%	-4.00%	0.77%	2.91%	0.80%
2017年1月1日至 2017年12月31日	13.52%	0.67%	13.65%	0.35%	-0.13%	0.32%
2018年1月1日至 2018年6月30日	-3.88%	1.12%	-6.26%	0.64%	2.38%	0.48%
自基金合同生效起 至2012年3月4日	13.08%	1.53%	59.27%	1.37%	-46.19%	0.16%
基金合同修改后： 2012年3月5日至 2018年9月30日	113.20%	1.40%	35.96%	0.81%	77.24%	0.59%

注：1. 本基金自2012年3月5日起修改了基金合同中基础行业定义及投资比例，并相应调整基金业绩比较基准为：

沪深300指数×55% + 中证综合债券指数×45%

2. 基金合同修改前本基金的业绩比较基准计算公式为：

上证综指与深证综指的复合指数×75%+中信标普全债指数×20%+同业存款利率×5%；

其中：上证综指与深证综指的复合指数=（上证A股流通市值/A股总流通市值）×上证综指+（深证A股流通市值/A股总流通市值）×深证综指

基准指数的构建考虑了三个原则：

（1）由于当前并不存在一个为投资者广泛接受的基础行业指数，所以以自定义方式来构建业绩比较基准，若将来出现一个能得到市场认可的基础行业指数，我们将在研究对比的基础上选择更为合理的业绩比较基准。

（2）投资者认同度。选择被市场广泛认同的上证综指、深证综指、中信标普全债指数作为计算的基础指数，并以流通市值比例为权数对上证综指、深证综指作加权计算。

（3）业绩比较的合理性。基金投资业绩受到资产配置比例限制的影响，根据基金资产配置比例来确定加权计算的权数，使业绩比较更具有合理性。

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合合同要求，基准指数每日按照75%、20%、5%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

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

自基金合同生效以来至基金合同修改前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

摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金

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

(2004年3月26日至2012年3月4日)

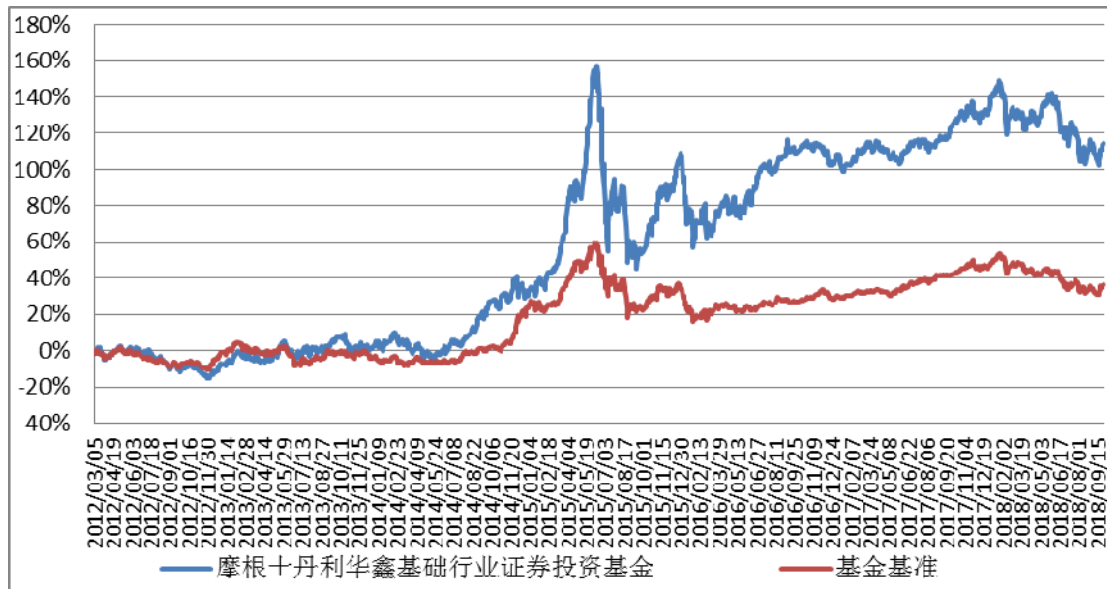


自基金合同修改以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金

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

(2012年3月5日至2018年9月30日)



十二、基金的财产

(一) 基金财产的构成

- 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、其它投资及其估值调整；
- 10、其它资产等。

#### （二）基金财产的账户

基金托管人以托管人和基金联名的方式开设的证券账户、以基金名义开立的银行账户，与基金管理人、基金托管人、基金销售服务代理人、注册登记人自有资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

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。

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。

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。

非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

### 十三、基金资产的估值

#### （一）估值目的

基金资产估值的目的是客观、准确地反映基金资产的公允价值，依据经基金资产估值后确定的基金资产净值而计算出的基金份额净值，是计算基金申购与赎回的基础。

#### （二）估值日

本基金的估值日为基金相关的证券交易场所的正常营业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。

#### （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）估值方法

##### 1、股票估值方法

- （1）上市流通股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，均应当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，确定公允价格。

(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，均应当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。

### (五) 估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金资产净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式报给基金托管人，基金托管人按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签字返回给基金管理人；月末、年中和年末估值复核与基金会计帐目的核对同时进行。

#### （六）估值差错的确认与处理

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

A、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。

B、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。

C、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。

D、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。

E、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。

F、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。

G、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：

A、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；

B、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；

C、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；

D、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：

A、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。

B、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。

C、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。

D、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。

E、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。

### （七）暂停估值的情形

1、基金投资涉及的证券交易所因法定节假日或其他原因暂停营业；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值；

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、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；

5、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；

6、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

#### （八）基金净值的确认

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。

#### （九）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、由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，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，但是未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理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。

### 十四、基金的收益分配

#### （一）基金收益的构成

- 1、基金投资所得红利、股息、国债利息；
- 2、买卖证券的价差收入；
- 3、银行存款利息；
- 4、其他收入。

因运用基金资产带来的成本或费用的节约计入基金收益。

#### （二）基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

#### （三）收益分配原则

- 1、基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 90%；
- 2、本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资者可事先选择将所获分配的现金收益按照基金合同有关基金份额申购的约定转为基金份额；基金份额持有人事先未做出选择的，基金管理人应当支付现金；
- 3、在符合基金分配条件的前提下，基金收益分配每年最多 4 次，基金成立不满 3 个月，则可不进行收益分配；
- 4、基金当年收益须先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；
- 5、每一基金份额享有同等收益分配权；
- 6、法律法规或监管机关另有规定的，按规定执行。

#### （四）收益分配方案

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。

#### （五）收益分配方案的确定与公告

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人核实后确定，在报中国证监会备案后 5 个工作日内公告。

### 十五、基金的费用与税收

#### （一）与基金运作有关的费用

与基金运作有关的费用包括：基金管理人的管理费、基金托管人的托管费、证券交易费用、基金合同生效后的信息披露费用、基金份额持有人大会费用、基金合同生效后的会计师费和律师费、按照国家有关规定可以从基金财产中列支的其他费用。

##### 1、基金管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。具体计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数};$$

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管理人。

##### 2、基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 2.5% 的年费率计提，具体计算方法如下：

$$H = E \times 2.5\% \div \text{当年天数};$$

H 为每日应支付的基金托管费；

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财产中一次性支取。

3、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，由基金托管人从基金财产中支付。基金合同生效前的验资费、律师费、基金合同、招募说明书、发售公告等信息披露费用由基金管理人承担。

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列入基金费用。

基金管理人和基金托管人可磋商酌情降低基金管理费和基金托管费，经中国证监会核准后公告，无须召开基金份额持有人大会。

(二) 与基金销售有关的费用

自基金合同生效以来，本基金的申购赎回实行的是固定费率，即申购费率 1.5%、赎回费率 0.5%。为了鼓励投资者积极申购及长期持有本基金，从 2004 年 11 月 12 日开始，本基金的申购和赎回费率标准作部分调整，费率标准如下：

1、申购费

(1) 申购费率

本基金以申购金额为基数采用比例费率计算申购费，投资人在一天内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。申购费用由投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

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	申购费率
100万元以下	0.6%
100万元(含)－500万元	0.4%
500万元(含)以上	每笔1000元

除养老金客户外的其他投资者申购本基金基金份额申购费率见下表：

申购金额	申购费率
100万元以下	1.5%
100万元(含)－500万元	1.0%
500万元(含)以上	每笔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

(1) 赎回费率

赎回费用由赎回人承担，所收取的赎回费 40%归基金财产，60%用于支付注册登记费及其他必要的手续费，但本基金对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。费率表如下：

持有基金份额期限	赎回费率
----------	------

7天以内	1.5%
满7天不满365天	0.5%
满365天不满730天	0.25%
满730天后	0%

### (2) 赎回费用计算方式

赎回金额=赎回份数×赎回价格

赎回费用=赎回金额×赎回费率

### 3、转换费用

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

转出金额=转出份额×转出基金当日基金份额净值

转出基金赎回费=转出金额×转出基金赎回费率

申购补差费=(转出金额-转出基金赎回费)×申购补差费率/(1+申购补差费率)

转换费用=转出基金赎回费+申购补差费

(1) 对于实行级差申购费率(不同申购金额对应不同申购费率)的基金,以转入总金额对应的转出基金申购费率、转入基金申购费率计算申购补差费用。

(2) 转出基金赎回费不低于25%的部分归入转出基金资产。

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

4、经报中国证监会批准,基金管理人可以在上述范围内调整申购费率和赎回费率,并最迟于新费率开始实施前3个工作日在至少一种指定媒体予以公告。如果调高申购或赎回费率,则须经基金份额持有人大会通过。

在法规允许的情况下,基金管理人可以根据投资人的认购金额、申购金额的数量适用不同的认购、申购费率标准,但须按规定提前公告。

在法规允许的情况下,基金管理人可以对选择在赎回时缴纳认购费或者申购费的基金份额持有人,根据其持有基金份额的期限适用不同的认购、申购费率标准,但须按规定提前公告。

在法规允许的情况下,基金管理人可以根据基金份额持有人持有基金份额的期限适用不同的赎回费率标准,但须按规定提前公告。

### (三) 基金的税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体,依照国家法律、法规的规定履行纳税义务。

## 十六、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年度的1月1日至12月31日；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、基金会计核算按国家相关规定执行；
- 5、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、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；
- 6、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，并报中国证监会备案。
- 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，须经基金托管人（或基金管理人）同意，并报中国证监会备案后可以更换。更换会计师事务所在两日内公告。

## 十七、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《证券投资基金法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《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》、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全国性报刊和基金管理人、基金托管人的互联网站(以下简称网站)等媒介披露。

### （二）信息披露的内容及时间

#### 1、基金募集信息

基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人在基金份额发售的三日前，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、基金托管人同时将基金合同、基金托管协议登载在网站上，基金管理人、基金托管人保证文本内容与所公告的内容完全一致。

基金管理人应当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。

基金管理人将于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。

基金合同生效后，基金管理人将在每六个月结束之日起四十五日内，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

基金管理人将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。

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。

基金管理人将在每年结束之日起九十日内，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。

基金管理人将在上半年结束之日起六十日内，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。

基金管理人将在每个季度结束之日起十五个工作日内，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。

本基金持续运作过程中，基金管理人应当在基金年度报告和半年度报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

基金运作期间，如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在基金定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

## 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应当在规定时间内编制临时报告书，予以公告。

- (1) 基金份额持有人大会的召开；
- (2) 提前终止基金合同；
- (3) 基金扩募；
- (4) 延长基金合同期限；
- (5) 转换基金运作方式；
- (6) 更换基金管理人、基金托管人；
- (7) 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- (8) 基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- (9) 基金募集期延长；
- (10) 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；
- (11) 基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十；
- (12) 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百分之三十；

- (13) 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；
- (14) 基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- (15) 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；
- (16) 重大关联交易事项；
- (17) 基金收益分配事项；
- (18) 管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- (19) 基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；
- (20) 基金改聘会计师事务所；
- (21) 变更基金份额发售机构；
- (22) 基金更换注册登记机构；
- (23) 开放式基金开始办理申购、赎回；
- (24) 开放式基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- (25) 开放式基金发生巨额赎回并延期支付；
- (26) 开放式基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- (27) 开放式基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- (28) 本基金发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项；
- (29) 中国证监会规定的其他事项。

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应当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。

### （三）信息事务管理

基金管理人、基金托管人指定专人负责管理信息披露事务。本基金信息披露事项将刊登在中国证监会指定的信息披露报刊和网站上。

基金托管人须按照相关法律、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。

招募说明书（包括定期更新的招募说明书）公布后，将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。在办公时间内投资者可免费查阅，亦可按工本费购买复印件。

基金定期报告、基金资产净值公告公布后，将分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，供公众查阅、复制。在办公时间内投资者可免费查阅，亦可按工本费购买复印件。

基金管理人和基金托管人应保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 十八、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

流动性风险是指本基金无法及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险；或是为应对投资者赎回，变现冲击成本较高，给基金资产造成损失的风险。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：

1) 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。当本基金发生单一投资者持有基金份额占比较大的情形时，若上述投资者集中大额赎回本基金，亦可能引发巨额赎回的情形。投资者可能面临以下风险：

A. 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。此外，当出现巨额赎回时，因基金运作特点导致的费用计提、计入基金资产的赎回费以及基金持仓证券价格波动等因素，也可能影响基金份额净值，极端情况下可能会造成基金份额净值的大幅波动。

B. 当发生巨额赎回时，根据《基金合同》的约定，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定部分延期办理赎回或暂停接受基金的赎回申请或延缓支付赎回款，投资者将面临无法及时赎回所持有基金份额的风险。若本基金发生巨额赎回且发生单一投资者的赎回

申请超过上一开放日基金总份额 20%以上的,基金管理人有权采取具体措施对其进行延期办理赎回申请,该投资者可能面临当日的部分赎回申请被延期办理的风险。

2) 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。当本基金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。本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具,其中股票等权益类资产占基金资产的比例为 30%-80%,现金、债券等固定收益类资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 20%-70%,主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%。股票流动性较好,存在部分股票品种停牌或交投不活跃的情况;大部分债券品种流动性较好,存在部分债券品种停牌或是企业债、资产证券化、回购等品种流动性相对较差的情况。综上所述,本基金拟投资市场、行业及资产的流动性良好,流动性风险相对可控。但如果市场短时间内发生较大变化或基金赎回量较大,可能会影响到基金的流动性和投资收益。

本基金由基金管理人作为交易参与者通过交易单元在证券交易所进行证券交易。根据《证券交易资金前端风险控制业务规则》等有关规定,证券交易所、证券登记机构对交易参与者相关交易单元的全天净买入申报金额总量实施额度管理,并通过交易所对交易参与者实施前端控制。因不可抗力、意外事件、技术故障、重大差错等原因导致资金前端控制出现异常的,交易所、证券登记机构可以采取限制交易单元交易权限等处理措施,本基金可能因上述业务规则而无法完成某笔或某些交易,进而可能会影响到基金的流动性,亦有可能导致基金的净值出现损失。

为了控制流动性风险,本基金将在坚持分散化投资和精选个券原则的基础上,通过一系列风险控制措施加强对流动性风险的跟踪、防范和控制。基金管理人经与基金托管人协商,在确保投资者得到公平对待的前提下,可依照法律法规及基金合同的约定,综合运用各类流动性风险管理工具,对赎回申请等进行适度调整,作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施,包括但不限于:

1) 延期办理巨额赎回申请

具体措施,详见招募说明书“八、基金份额的申购、赎回与转换”中“(九)巨额赎回的情形及处理方式”的相关内容。

2) 暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项

具体措施,详见招募说明书“八、基金份额的申购、赎回与转换”中“暂停赎回”的相关内容。

3) 收取短期赎回费

本基金对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费,并将上述赎回费全额计入基金财产。当投资者持有基金的期限少于一定天数时,将需承担较高的基金赎回成本。

4) 暂停基金估值

当本基金发生前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性等暂停基金估值的情形时,经与基金托管人协商确认后,基金管理人应当暂停基金估值,并采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金申购赎回申请的措施,投资者将面临无法及时赎回所持有基金份额或如期进行基金投资的风险。

当本基金出现上述 1)、2)、4) 情形时,本基金可能无法及时满足所有投资者的赎回申请,投资者收到赎回款项的时间也可能晚于预期或可能增加投资者赎回的成本。

#### 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,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基础行业的上市公司股票,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。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。

## 十九、基金的终止与清算

### (一) 基金的终止

有下列情形之一的，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、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、新基金托管人

承接的；

3、基金合同约定的其他情形。

基金合同终止时，基金管理人应当组织清算组对基金财产进行清算。

## （二）基金清算

### 1、基金清算小组

（1）自基金终止之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金清算小组必须在中国证监会的监督下进行基金清算。

（2）基金清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、具有从事证券法律业务资格的律师以及中国证监会指定的人员组成。基金清算小组可以聘请必要的工作人员。

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

### 2、基金清算程序

- （1）本基金终止后，发布基金清算公告；
- （2）由基金清算小组统一接管基金财产，其他任何人不得处理和处置；
- （3）对基金资产进行清理、核查和确认；
- （4）对基金财产进行估值；
- （5）对基金财产进行变现；
- （6）将基金清算结果报告中国证监会；
- （7）公布基金清算结果公告；
- （8）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

基金清算后，基金财产按下列顺序清偿：

- （1）支付清算费用；
- （2）交纳所欠税款；
- （3）清偿基金债务；
- （4）按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

### 5、基金清算的公告

基金终止并报中国证监会备案后两日内由基金清算小组公告；清算过程中的有关重大事项应及时公告；基金清算结果由基金清算小组报经中国证监会批准后两日内公告。

### 6、基金清算帐册及文件的保存

基金清算帐册及有关文件由基金托管人按照国家有关规定保存 15 年以上。

## 二十、基金合同的内容摘要

### （一）基金合同当事人的权利与义务

#### 1、基金份额持有人的权利与义务



### （1）基金份额持有人的权利

- A. 按照基金合同的规定提议召开或自行召开及出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，并行使表决权；
- B. 分享基金财产收益；
- C. 监督基金运作情况，按基金合同的规定查询或者获取公开的基金业务及财务状况资料；
- D. 按基金合同的规定享有申购或赎回基金份额及其他对基金份额处分的权利，并在规定时间内取得有效申请的款项或基金份额；
- E. 取得基金清算后的剩余资产；
- F. 知悉基金合同规定的有关信息披露内容；
- G. 提请基金管理人或基金托管人履行按本合同规定应尽的义务；
- H. 因基金管理人、基金托管人、注册登记人、销售机构的过错导致合法利益受到损害时，有依法提起诉讼的权利；
- I. 法律法规及基金合同规定的其他权利。

### （2）基金份额持有人的义务

- A. 遵守基金合同及相关业务规则；
- B. 缴纳基金认购、申购款项，承担规定的费用；
- C. 在所持有的基金份额范围内承担基金亏损或者终止的有限责任；
- D. 不从事任何有损基金及本基金其他当事人利益的活动；
- E. 法律法规及基金合同规定的其他义务。

## 2、基金管理人的权利与义务

### （1）基金管理人的权利

- A. 自基金合同生效之日起，根据法律、法规和基金合同的规定独立管理和运作基金资产；
- B. 依据有关法律法规和基金合同的规定，获得基金管理费和其他约定和法定的收入；
- C. 依照《基金法》等有关法律法规及基金合同的规定，代表基金行使因基金投资而获得的任何权利；
- D. 依据有关法律法规及基金合同规定决定基金收益的分配方案；
- E. 提议召开基金份额持有人大会；
- F. 选择、更换基金销售代理人，对基金销售代理人的相关行为进行监督。如认为基金销售代理人违反基金合同、基金销售代理协议或国家法律、法规的有关规定，应呈报中国证监会或其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- G. 监督基金托管人。如认为基金托管人违反了基金合同或国家法律、法规有关规定，应呈报中国证监会和中国银监会，并采取必要措施保护基金份额持有人的利益。除非法律法规、基金合同及托管协议另有规定，否则基金管理人对基金托管人的行为不承担任何责任；

H. 在基金存续期内，依据有关的法律法规和基金合同的规定，拒绝或暂停受理赎回申请；

I. 在法律法规和基金合同的框架内，制订和调整开放式基金业务规则；

J. 提名新的基金托管人；

K. 选择和更换注册登记人，并对其注册登记代理行为进行监督；

L. 基金终止时，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；

M. 以基金的名义依法为基金进行融资，并以基金资产履行偿还融资和支付利息的义务；

N. 基金托管人或其他第三人造成基金资产损失的，基金管理人可代表基金进行索赔；

O. 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

A. 遵守基金合同；

B. 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作基金资产；

C. 设置相应的部门，并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资产；

D. 设置相应的部门，并配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购和赎回业务或委托其他机构代理该项业务；

E. 配备足够的专业人员进行基金的注册登记或委托其他机构代理该项业务；

F. 建立健全内部控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金资产和管理人的资产相互独立，保证不同基金在资产运作、财务管理等方面相互独立；

G. 除法律法规和基金合同另有规定外，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资产；

H. 接受基金托管人的监督；

I. 按规定计算并公告基金资产净值及基金份额净值；

J. 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

K. 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法律法规另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

L. 在本基金的存续期间内，其有效持有人数量连续 20 个工作日达不到 200 人，或者连续 20 个工作日最低基金资产净额低于 5000 万元的，基金管理人应当及时向中国证监会报告，说明出现上述情况的原因以及解决方案；

M. 依据基金合同决定基金收益分配方案，并按规定向基金份额持有人分配基金收益；

N. 按照有关法律法规和基金合同的规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

O. 不谋求对上市公司的控股和直接管理；

P. 依据《基金法》等有关法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；

Q. 保存基金的会计帐册、报表、记录 15 年以上；

R. 确保向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出；并且保证投资者能够按照招募说明书公告的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，或得到有关资料的复印件；

S. 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；

T. 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

U. 因过错导致基金资产的损失，应承担赔偿责任，采取适当、合理的方式向基金份额持有人进行赔偿，该过错责任不因其退任而免除；

V. 因估值错误导致基金份额持有人的损失，应承担赔偿责任，该过错责任不因其退任而免除；

W. 监督基金托管人按基金合同的规定履行自己的义务，因基金托管人的过错造成基金资产损失时，应代表基金向基金托管人追偿；

X. 不得从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

Y. 法律、法规和基金合同规定的其他义务。

### 3、基金托管人的权利与义务

#### (1) 基金托管人的权利

A. 根据法律、法规和基金合同的规定保管基金资产，监督本基金的投资运作；

B. 依据基金合同及托管协议约定获得基金托管费用；

C. 监督基金管理人，如认为基金管理人违反了基金合同及国家有关法律法规，应及时呈报中国证监会和中国银监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益。除非法律法规、基金合同及托管协议规定，否则，基金托管人对基金管理人的行为不承担任何责任；

D. 有权对基金管理人的违法、违规投资指令不予执行，并向中国证监会报告；

E. 监督基金注册登记人的基金注册及过户登记服务；

F. 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

A. 遵守基金合同；

B. 以诚实信用、勤勉尽责的原则保管基金资产；

C. 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，负责基金资产托管事宜；

D. 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，确保基金资产的安全，保证其托管的基金资产与托管人的资产以及不同的基金资产相互独立；对不同的基金分别设置账户，独立核算，分帐管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、帐册记录等方面相互独立；

E. 除依据《基金法》等有关法律法规及基金合同、托管协议外，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资产；

- F. 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；
- G. 以基金和基金托管人联名的方式设立证券账户、以基金的名义开立银行账户等基金资产账户，负责基金投资于证券的清算交割，执行基金管理人的投资指令，负责办理基金名下的资金往来；
- H. 保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同、托管协议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；
- I. 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值；
- J. 采取适当、合理的措施，使基金份额的认购、申购、赎回等事项符合基金合同、托管协议等有关法律文件的规定；
- K. 采取适当、合理的措施，使基金管理人用以计算基金份额认购、申购、赎回价格的方法符合法律、法规、基金合同或其他法律文件的规定；
- L. 采取适当、合理的措施，使基金投资和融资的条件符合法律、法规、基金合同或其他法律文件的规定；
- M. 按规定出具基金业绩和基金托管情况的报告，并呈报中国证监会和中国银监会；
- N. 负责基金认购、申购和赎回业务的资金保管和清算；
- O. 在定期报告内出具托管人意见，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；
- P. 按有关规定，建立并保存基金份额持有人名册；
- Q. 按有关规定，保存基金的会计帐册、报表和记录 15 年以上；
- R. 按规定制作相关帐册并与基金管理人核对；
- S. 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；
- T. 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；
- U. 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，应及时报告中国证监会和中国银监会，并通知基金管理人；
- V. 因过错导致基金资产的损失，应承担赔偿责任，该过错责任不因其退任而免除；
- W. 监督基金管理人按基金合同的规定履行自己的义务，因基金管理人的过错造成基金资产损失时，应为基金向基金管理人追偿，除法律法规和基金合同规定外，基金托管人不对基金管理人承担连带责任；
- X. 不得从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
- Y. 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

需要决定下列事项之一时，应召开基金份额持有人大会：

- (1) 提前终止基金合同；
- (2) 基金扩募或者延长基金合同期限；
- (3) 转换基金运作方式；
- (4) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- (5) 更换基金管理人、基金托管人；
- (6) 基金合同约定的其他事项。

## 2、召集方式

(1) 正常情况下，基金份额持有人大会由基金管理人召集，基金份额持有人大会的开会时间、地点及权益登记日由基金管理人选择确定；

(2) 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，应当自行召集；

(3) 代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人就同一事项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，代表基金份额百分之十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。

基金管理人和基金托管人都不召集基金份额持有人大会的，基金份额持有人有权自行召集，并报中国证监会备案。

基金份额持有人自行召集基金份额持有人大会的，应当至少提前三十日向中国证监会备案。

(4) 基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

## 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 1 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。

采取通讯方式开会并进行表决的情况下，由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和收取方式。

#### 4、会议的召开方式

开会方式由召集人确定，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基金份额持有人大会。

(1) 现场开会。由基金份额持有人本人出席或以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。

出席会议的基金份额持有人或其授权代表所代表的基金份额达到权益登记日基金总份额的 50%以上的基金份额持有人会议可以召开。

(2) 通讯方式开会。通讯方式开会应以书面方式进行表决。召集人收到的出具书面表决意见书的基金份额持有人所代表的基金份额达到权益登记日基金总份额的 50%以上的，通讯方式开会有效。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。

#### 5、议事内容与程序

##### (1) 议事内容

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如修改基金合同、决定终止基金、转换基金运作方式、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并以及召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

##### (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以所代表的基金份额 50%以上多数（不含 50%）选举产生 1 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。

召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证号码、住所地址、持有或者代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）等

事项。

## ②通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，由召集人至少提前 30 天公布拟讨论事项，在所通知的表决截止日期第二天统计全部有效表决，在公证机构监督下形成决议。

## 6、表决

(1) 基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

(2) 在现场开会之情形下，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授权委托书应符合法律、法规、基金合同和会议通知的规定，否则其所代表的表决权不计入有效表决权份数。

(3) 在通讯开会之情形下，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、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的授权委托书应符合法律、法规、基金合同和会议通知的规定，否则其所代表的表决权不计入有效表决权份数。

(4) 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。一般决议须经出席会议的基金份额持有人所持表决权的半数以上（不含半数）通过方为有效；除下列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。特别决议须经出席会议的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上通过方为有效。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、提前终止基金合同，必须以特别决议通过方为有效。

(5) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

(6) 采取通讯方式进行表决时，除非有充分相反证据证明，否则其符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见视为有效表决。意见模糊或相互矛盾的视为无效表决。

(7) 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如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，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 1 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 3 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如果会议主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新清点；如果会

议主持人未进行重新清点,而出席会议的基金份额持有人或者基金份额持有人代理人对会议主持人宣布的表决结果有异议,有权在宣布表决结果后立即要求重新清点,会议主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。

## (2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下,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的监督下进行计票,并由公证机构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表决通过的事项,召集人应当自通过之日起五日内报中国证监会核准或者备案。

基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

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的决定。

## 9、不可抗力

由于地震、洪水等自然灾害或不可抗力,导致基金份额持有人大会不能按时或按规定方式召开或会议中断,大会召集人应依照法律法规和本基金合同的规定采取必要措施及时通知或尽快召开。

## (三) 基金合同解除和终止的事由、程序

有下列情形之一的,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、基金托管人职责终止,在六个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的;
- 3、基金合同约定的其他情形。

基金合同终止时,基金管理人应当组织清算组对基金财产进行清算。

清算组由基金管理人、基金托管人以及相关的中介服务机构组成。

清算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,报国务院证券监督管理机构备案并公告。

清算后的剩余基金财产,应当按照基金份额持有人所持份额比例进行分配。

## (四) 争议解决方式

本基金合同当事人发生纠纷时,可以通过协商或调解解决。本基金合同当事人不愿通过协商、调解解决或协商、调解不成的,任何一方有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会深圳分会,按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的,对当事人均有约束力。

## (五) 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式。

本基金合同可印制成册,供基金投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构的办公场



所和营业场所查阅；基金投资者也可按工本费购买本基金合同印制件或复印件；如涉及争议事项需协商、仲裁或诉讼的，应以本基金合同正本为准。

## 二十一、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（或简称“管理人”）

名称：摩根士丹利华鑫基金管理有限公司

住所：深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第二座第17层

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

批准设立机关及批准设立文号：证监基金字[2003]33号

企业类型：有限责任公司

营业期限：五十年

#### 2、基金托管人（或简称“托管人”）

名称：中国光大银行股份有限公司

住所：北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心

法定代表人：李晓鹏

注册资本：466.79095亿元人民币

组织形式：股份制商业银行

营业期限：持续经营

### （二）基金托管人与基金管理人之间的业务监督、核查

1、根据相关法律法规和基金合同的规定，托管人应对基金管理人就基金资产的投资对象、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、基金托管人报酬的计提和支付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

（1）基金托管人定期对基金管理人在基金投资、运作等方面的运作是否严格按照相关法律法规和基金合同的规定进行监督和核查，对因基金管理人的过错导致基金资产灭失、减损、或处于危险状态的，基金托管人应立即以书面的方式要求基金管理人予以纠正和采取必要的补救措施。基金托管人有权要求基金管理人赔偿基金因此所遭受的损失。

（2）基金托管人发现基金管理人违反相关法律法规和基金合同规定的行为，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。基金管理人违反基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

(3) 如基金托管人认为基金管理人的作为或不作为违反了法律法规、基金合同或本托管协议,基金托管人应呈报中国证监会和其他监管部门,有权利并有义务行使法律法规、基金合同或本托管协议赋予、给予、规定的基金托管人的任何及所有权利和救济措施,以保护基金资产的安全和基金投资者的利益,包括但不限于就更换基金管理人事宜召集基金份额持有人大会、代表基金对因基金管理人的过错造成的基金资产的损失向基金管理人索赔。

2、根据相关法律法规和基金合同规定,基金管理人就基金托管人是否及时执行基金管理人的投资指令、是否将基金资产和自有资产分帐管理、是否擅自动用基金资产、是否按时将赎回资金和分配给基金份额持有人的收益划入基金管理人清算账户等事项,对基金托管人进行监督和核查。

(1) 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和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。

(2) 基金管理人发现基金托管人的行为违反相关法律法规和基金合同规定,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。

(3) 如基金管理人认为基金托管人的作为或不作为违反了法律法规、基金合同或本托管协议,基金管理人应呈报中国证监会和其他监管部门,有权利并有义务行使法律法规、基金合同或本托管协议赋予、给予、规定的基金管理人的任何及所有权利和救济措施,以保护基金资产的安全和基金投资者的利益,包括但不限于就更换基金托管人事宜召集基金份额持有人大会、代表基金对因基金托管人的过错造成的基金资产的损失向基金托管人索赔;

3、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) 基金财产的保管

#### 1、基金资产保管的原则

基金托管人应安全保管基金的全部资产。基金资产应独立于基金托管人和基金管理人的资产。

(1) 本基金所有资产的保管责任,由基金托管人承担。基金托管人将遵守相关法律法规和基金合同规定,为基金份额持有人的最大利益处理基金事务。基金托管人保证恪尽职守,依照诚实信用、勤勉尽责的原则,安全、完整、谨慎、有效地持有并保管基金资产。

(2) 基金托管人应当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,负责基金资产托管事宜;建立健全内部风险监控制度,对负责基金资产托管的部门和人员的行为进行事先控制和事后监督,防范和减少风险。

(3) 基金托管人应当购置并保持对于基金资产的托管所必要的设备和设施(包括硬件和软件),并对设备和设施进行维修、维护和更换,以保持设备和设施的正常运行。

(4) 除依据相关法律法规和基金合同规定外,不为自己及任何第三人谋取利益,基金托管人违反此义务,利用基金资产为自己及任何第三方谋取利益,所得利益归于基金资产;

(5) 基金托管人不得将基金资产转为其自有资产,不得将自有资产与基金资产进行交易,或将不同基金资产进行相互交易;违背此款规定的,将承担相应的责任,包括但不限于恢复基金资产的原状、承担赔偿责任。

(6) 基金托管人必须将基金资产与自有资产严格分开,将本基金资产与其托管的其他基金资产严格分开。

(7) 除依据相关法律法规和基金合同规定外,基金托管人不得委托第三人托管基金资产;

(8) 未经基金管理人的正当指令,不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。

## 2、基金募集资金的验证

基金募集期满或基金管理人宣布停止募集时,基金管理人应将募集的全部资金存入其指定的验资专户;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。

如果基金合同不能生效,按相关法律法规和基金合同规定处理。

## 3、基金的银行账户的开设和管理

(1) 基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。

(2) 基金托管人以本基金的名义在其营业机构开设本基金的银行账户。本基金的银行预留印鉴,由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动,包括但不限于投资、支付赎回款项、转换出金额、支付基金收益、收取认购款、申购款,均需通过本基金的银行账户进行。

(3) 本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其他任何银行账户;亦不得使用基金的任何银行账户进行本基金业务以外的活动。

(4) 基金银行账户的管理应符合中国人民银行和中国银行业监督管理委员会的有关规定。

(5) 涉及基金账户变更或相关事项,由管理人和托管人按有关规定协商后处理。

## 4、基金证券账户和资金账户的开设和管理

(1) 基金托管人应当代表本基金以托管人和本基金的名义在中国证券登记结算有限公司上海和深圳分公司各开立证券账户。

(2) 基金托管人以托管人的名义在中国证券登记结算有限公司上海和深圳分公司各开

立一个结算备付金账户，并通过该账户完成所托管证券投资基金的资金结算。

(3) 本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另一方同意擅自转让本基金的任何证券账户；亦不得使用本基金的任何证券账户进行本基金业务以外的活动。

(4) 基金托管人应当按规定以其自身的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立清算备付金账户，并通过该账户完成本基金的证券资金清算；

(5) 若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许本基金从事其他投资品种的投资业务，则基金托管人应当以本基金的名义开设从事该投资业务的账户，并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

#### (6) 基金资产投资的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，但要与非本基金的其他实物证券分开保管；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。

#### (7) 与基金资产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别由基金托管人、基金管理人保管。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时，应保证基金一方持有两份以上的正本，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且该正本首先由基金管理人取得，则基金管理人应及时将该正本送达基金托管人处。

### 5、国债托管专户的开设和管理

(1) 基金合同生效后，基金管理人负责代表基金向中国证监会和中国人民银行申请进入全国银行间同业拆借市场，并代表基金进行交易。由基金托管人以本基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设国债托管账户，用于银行间国债现券和回购的交易和资金清算。

(2) 基金管理人和基金托管人同时代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议，协议正本由基金托管人保管，协议副本由基金管理人保存。

6、如监管机构关于基金证券账户和资金清算账户的开设和管理另有规定，则按监管机构的最新规定执行。

7、由基金分别按规定的标准向中国证券登记结算有限公司上海和深圳分公司缴纳结算保证金。首次托管的基金缴纳结算保证金后，若托管人新增其他托管基金，则托管人应按比例分摊调整各基金应承担的结算保证金。如监管机构关于基金缴纳结算保证金或其他资金、费用在另有规定，则按监管机构的最新规定执行。

#### (四) 基金资产净值计算与复核

1、基金资产净值是指该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该基金资产净值除以计算日该基金总份额的价值。

2、基金管理人应于每工作日对基金资产估值。估值原则应符合基金合同的规定。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结束后计算得出当日的基金份额净值，并在盖章后以加密传真方式发送给基金托管人。基金托管人应在收到上述传真后马上对净值计算结果进行复核，并在盖章后以加密传真方式将复核结果传送给基金管理人。

3、如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，基金管理人有权按照其对基金资产净值的计算结果对外予以公布，基金托管人有权将相关情况报中国证监会备案。

#### （五）基金份额持有人名册的登记与保管

基金份额持有人名册，包括基金募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册、每月最后一个交易日的基金份额持有人名册，均由基金管理人和托管人负责分别保管。

#### （六）争议解决方式

基金管理人、基金托管人之间因本协议产生的或与本协议有关的争议可首先通过友好协商解决，自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内如果争议未能以协商方式解决，则任何一方有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据提交仲裁时该会的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在北京。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。除提交仲裁的争议之外，各方当事人仍应履行本协议的其他规定。争议处理期间，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，各自继续忠实、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。

#### （七）托管协议的修改与终止

1、本协议双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，报中国证监会批准后生效。

2、发生以下情况，本托管协议终止：

- （1）基金或基金合同终止；
- （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）发生相关法律法规和基金合同规定的终止事项。

## 二十二、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.msfnfunds.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.msfnfunds.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，提供电子邮件账单及短信账单。对于未选择账单寄送方式的投资人，基金管理人将默认提供电子邮件账单。投资人可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短信账单。若投资人因特殊原因需要获取指定期间的纸质对账单，可拨打本公司客服热线400-8888-668（免长途话费）按“9”转人工服务，提供姓名、开户证件号码或基金账号、持有基金名称、购买销售机构、邮寄地址、联系电话，客服人员核对信息无误后，将为投资人免费邮寄纸质对账单。

对账单服务发送规则如下：如投资人成功定制电子邮件账单或短信账单，基金管理人将在每月初五个工作日内发送。

2、免费定制信息：投资人可定制的信息包括：基金份额净值、基金视窗等信息。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.msfnfunds.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（节假日除外）。

## （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周一至周五（节假日除外），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](mailto: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

**二十三、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	本基金 2017 年年度报告	证券时报	2018 年 3 月 29 日
2	本公司关于旗下部分基金继续参与中国工商银行个人电子银行申购费率优惠活动的公告	证券时报	2018 年 3 月 31 日
3	本公司关于旗下部分基金参与东海证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告	证券时报	2018 年 4 月 2 日
4	本公司关于旗下基金增加上海挖财基金销售有限公司为销售机构的公告	证券时报	2018 年 4 月 4 日
5	本公司关于旗下基金参与上海挖财基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证券时报	2018 年 4 月 4 日
6	本公司高级管理人员变更公告	证券时报	2018 年 4 月 10 日
7	本公司高级管理人员变更公告	证券时报	2018 年 4 月 14 日
8	本公司关于旗下基金调整停牌股票“中兴通讯”估值方法的公告	证券时报	2018 年 4 月 19 日
9	本基金 2018 年 1 季度报告	证券时报	2018 年 4 月 21 日
10	本公司关于旗下基金增加上海基煜基金销售有限公司为销售机构并参与费率优惠活动的公告	证券时报	2018 年 4 月 23 日
11	本公司关于旗下基金参与北京恒天明泽基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证券时报	2018 年 4 月 27 日
12	本基金招募说明书（更新）（2018 年第 1 号）	证券时报	2018 年 5 月 8 日
13	本公司关于旗下基金增加北京蛋卷基金销售	证券时报	2018 年 5 月 10 日

	有限公司为销售机构并参与费率优惠活动的公告		
14	本公司关于旗下基金参与中国银河证券股份有限公司费率优惠活动的公告	证券时报	2018年5月31日
15	本公司关于旗下基金调整“中兴通讯”估值方法的公告	证券时报	2018年6月20日
16	本基金2018年2季度报告	证券时报	2018年7月18日
17	本公司关于旗下部分基金在上海挖财基金销售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	证券时报	2018年7月27日
18	本基金2018年半年度报告	证券时报	2018年8月27日
19	本公司关于旗下部分基金参与华龙证券股份有限公司费率优惠活动的公告	证券时报	2018年9月6日
20	本公司关于旗下部分基金在东海证券开通定投业务并参与定投费率优惠活动的公告	证券时报	2018年9月10日
21	本公司关于取消纸质对账单的公告	证券时报	2018年9月19日

上述公告同时在公司网站 [www.msfnfunds.com.cn](http://www.msfnfunds.com.cn) 上披露。

#### 二十四、招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人、基金托管人、销售代理人和注册登记人的办公场所，投资人可在办公时间免费查阅，也可按工本费购买本招募说明书的复印件。

投资人按上述方式所获得的文件或其复印件，基金管理人和基金托管人应保证与所公告的内容完全一致。

#### 二十五、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) 本基金托管协议；
- (四) 法律意见书；
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (六) 基金托管人业务资格批件、营业执照；
- (七) 中国证监会要求的其他文件。

上述文件存放在基金管理人的办公场所，投资人可在办公时间免费查阅。

摩根士丹利华鑫基金管理有限公司



二〇一八年十一月八日