

摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金招募说明书

(更新)摘要

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：中国建设银行股份有限公司

【重要提示】

摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2011 年 8 月 2 日经中国证券监督管理委员会证监许可【2011】1218 号文核准募集。本基金的基金合同于 2011 年 11 月 15 日正式生效。本基金为契约型开放式基金。

投资有风险，投资人投资基金时应认真阅读本基金的招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，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》、《运作办法》、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。

本招募说明书（更新）摘要所载内容截止日为 2016 年 5 月 15 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2016 年 3 月 31 日(财务数据未经审计)。

目 录

一、基金管理人	1
二、基金托管人	5
三、相关服务机构	7
四、基金的名称	26
五、基金的运作方式与类型	27
六、基金的投资目标	27
七、基金的投资方向	27
八、基金的投资策略	27
九、基金的业绩比较基准	30
十、基金的风险收益特征	31
十一、基金的投资组合报告	31
十二、基金的业绩	31
十三、基金的费用与税收	36
十四、对招募说明书更新部分的说明	41

一、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)

成立日期：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%）、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，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。

Edmond N. Moriarty 先生，汉密尔顿学院学士，弗吉尼亚大学达顿商学院工商管理硕士。2011年3月起任摩根士丹利商业银行与房地产投资部主管。曾任摩根士丹利投资管理部首席运营官、美林证券公司联席首席风险管理官、环球信贷与债务部主管、GMI 资产配置与债务部主管、证券投资银行部总经理。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。曾供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研究员、职工监事。

3、公司高级管理人员

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任董事会秘书。

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。现任本公司督察长。

4、本基金基金经理

周宁先生，首都经济贸易大学会计学硕士，特许金融分析师（CFA），8年证券从业经历。曾担任东兴证券研究所分析师。2010年9月加入本公司，历任研究员、基金经理助理，现任基金投资部副总监。2014年12月起任本基金基金经理，2015年6月起担任摩根士丹利华鑫新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015年11月起任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：赵立松先生，自本基金合同生效起至2013年3月管理本基金；程志田先生，自本基金合同生效起至2013年4月管理本基金。周志超先生，2013年11月至2014年12月管理本基金。刘钊先生，2013年4月至2014年12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。

二、基金托管人（一）基金托管人情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：王洪章

成立时间：2004年09月17日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号

联系人：田青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于1954年10月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于2005年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码939)，于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。

2015年末，本集团资产总额18.35万亿元，较上年增长9.59%；客户贷款和垫款总额10.49万亿元，增长10.67%；客户存款总额13.67万亿元，增长5.96%。净利润2,289亿元，增长0.28%；营业收入6,052亿元，增长6.09%。其中，利息净收入增长4.65%，手续费及佣金净收入增长4.62%。平均资产回报率1.30%，加权平均净资产收益率17.27%，成本收入比26.98%，资本充足率15.39%，主要财务指标领先同业。

物理与电子渠道协同发展。营业网点“三综合”建设取得新进展，综合性网点数量达1.45万个，综合营销团队2.15万个，综合柜员占比达到88%。启动深圳等8家分行物理渠道全面转型创新试点，智慧网点、旗舰型、综合型和轻型网点建设有序推进。电子银行主渠道作用进一步凸显，电子银行和自助渠道账务性交易量占比达95.58%，较上年提升7.55个百分点；同时推广账号支付、手机支付、跨行付、龙卡云支付、快捷付等五种在线支付方式，成功实现绝大多数主要快捷支付业务的全行集中处理。

转型业务快速增长。信用卡累计发卡量8,074万张，消费交易额2.22万亿元，多项核心指标继续保持同业领先。金融资产1,000万以上的私人银行客户数量增长23.08%，客户金融资产总量增长32.94%。非金融企业债务融资工具累计承销5,316亿元，承销额市场领先。资产托管业务规模7.17万亿元，增长67.36%；托管证券投资基金数量和新增只数均为市场第一。人民币国际清算网络建设再获突破，继伦敦之后，再获任瑞士、智利人民币清算行资格；上海自贸区、新疆霍尔果斯特殊经济区主要业务指标居同业首位。

2015年，本集团先后获得国内外各类荣誉总计122项，并独家荣获美国《环球金融》杂志“中国最佳银行”、香港《财资》杂志“中国最佳银行”及香港《企业财资》杂志“中国最佳银行”等大奖。本集团在英国《银行家》杂志2015年“世界银行品牌1000强”中，以一级资本总额位列全球第二；在美国《福布斯》杂志2015年度全球企业2000强中位列第二。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等10个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工220余人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

2、主要人员情况

赵观甫，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张力铮，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部，并在总行集团客户部和中国建设银行北

京市分行担任领导职务，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

3、基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2016 年一季度末，中国建设银行已托管 584 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行自 2009 年至今连续六年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”。

三、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

联系人：吴海灵

电话：（0755）88318898

传真：（0755）82990631

（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.msfunds.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.msfunds.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@msfunds.com.cn

深圳、北京或上海的投资人单笔申购金额超过 100 万元（含 100 万元）人民币的，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

(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：刘士余
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) 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

(6) 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

(7) 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

(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：常振明
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：王继伟

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：马梦洁

联系电话：0755-25878124

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) 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

(13) 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

(14) 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

(15) 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

(16) 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

(17) 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

(18) 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

(19) 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

(20) 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>

(21) 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

(22) 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

(23) 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

(24) 光大证券股份有限公司

注册（办公）地址：上海市静安区新闸路 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

(25) 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

(26) 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：崔少华

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

(27) 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

(28) 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

(29) 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

(30) 华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

办公地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 24 楼

法定代表人：吴万善

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

(31) 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](http://www qlzq.com.cn)

(32) 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

(33) 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

（34）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

（35）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：<http://www.dwzq.com.cn>

（36）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

（37）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

（38）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

（39）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

（40）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：宫少林

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

（41）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

（42）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

（43）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

（44）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

（45）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

(46) 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

(47) 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

(48) 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

(49) 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

(50) 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

(51) 杭州数米基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号
办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼
法定代表人：陈柏青
联系人：周熾旻
联系电话：（0571）28829790；（021）60897869
客户服务电话：4000-766-123
网址：www.fund123.cn

（52）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>

（53）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

（54）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

（55）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

（56）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

（57）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>

（58）宜信普泽投资顾问（北京）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：沈伟桦

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

（59）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

（60）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

（61）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

（62）北京创金启富投资管理有限公司

注册（办公）地址：北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A

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

（63）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

（64）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

（65）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

（66）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

（67）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

(68) 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: 盛海娟

联系电话: 010-57418813

客户服务热线: 400-893-6885

网址: www.qianjing.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) 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: 北京市竞天公诚律师事务所

注册地址: 北京市朝阳区建国路77号华贸中心3号写字楼34层

办公地址: 北京市朝阳区建国路77号华贸中心3号写字楼34层

负责人: 赵洋

联系人: 黄亮

电话: 010-58091000 0755-23982200

经办律师: 黄亮、孔雨泉

(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)

注册地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦1604-1608室

办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6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

四、基金的名称本基金名称: 摩根士丹利华鑫深证300指数增强型证券投资基金

五、基金的运作方式与类型(一) 本基金的运作方式: 契约型开放式

(二) 本基金的类型: 股票型证券投资基金

六、基金的投资目标本基金为股票指数增强型基金, 以深证300指数作为本基金投资组合跟踪的目标指数。本基金在有效跟踪深证300指数的基础上, 通过运用增强型投资策略, 力争获取超越业绩比较基准的投资收益, 谋求基金资产的长期增长。

本基金对业绩比较基准的跟踪目标是: 力求控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%, 年化跟踪误差不超过7.75%。

七、基金的投资方向本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。基金的投资组合比例为: 股票资产占基金资产的比例范

围为 90%—95%，其中投资于深证 300 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产的 80%；除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 5%—10%，保持现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，股指期货、权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略(一)投资策略

本基金以深证 300 指数为目标指数，采用指数化投资为主要投资策略，适度增强型投资策略为辅助投资策略。在严格控制跟踪误差的前提下，力争获得适度超越业绩比较基准的投资收益。为控制基金业绩偏离比较基准的风险，本基金力求控制基金份额净值增长率与业绩比较基准间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。

1、资产配置策略

本基金为指数基金，保持对目标指数的紧密跟踪，股票资产占基金资产的比例不低于 90%，投资于深证 300 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产的 80%。本基金将根据申购、赎回情况、股票市场状况、宏观经济政策等因素的变化，在本基金的投资范围内进行适度调整股票、债券等资产的配置比例。在控制与目标指数的跟踪误差的前提下，适度获取超越业绩比较基准的投资收益。

2、股票投资策略

本基金股票投资策略由指数化投资策略和增强型投资策略组成。本基金以深证 300 指数为目标指数，通过复制目标指数的方法，即按照目标指数的成份股及其权重构建指数投资组合，并根据目标指数成份股及其权重的变动进行定期和不定期调整，对于受法律法规限制不能投资的股票将选择其他品种进行替代。另外，本基金将对目标指数成份股及非成份股分别采取相应的适度增强的投资策略，力求提高本基金的投资收益。

(1) 指数化投资策略

指数化投资策略是本基金主要股票投资策略，通过采用复制指数的方法，根据目标指数即深证 300 指数的成份股及其权重构建指数投资组合。在构建指数投资组合的过程中，尤其是在初始建仓过程中，本基金可采取适当的交易策略，以降低交易成本。

1) 定期调整

本基金将根据深证 300 指数的编制规则和定期调整公告，参照成份股及其权重的调整方案，在尽量减小跟踪误差的基础上，优化调整方案，对股票指数化投资组合进行相应调整。

2) 不定期调整

a. 本基金将密切跟踪目标指数成份股临时调整公告，并及时制定相应的指数化投资组合调整策略；

b. 本基金将密切跟踪目标指数成份股及其备选成份股可能导致股本发生变化的信息，包括但不限于增发、配股、分红等，本基金将根据目标指数编制规则，在考虑跟踪误差风险的基础上，对指数化投资组合进行相应调整；

c. 本基金还将根据申购、赎回情况，结合现金头寸管理，制定相应的调整策略。

3) 特殊调整

当发生法律法规限制、基金规模、流动性等特殊情况下，如基金管理人无法按照其所占目标指数权重构建投资组合时，基金管理人将综合考虑跟踪误差最小化和投资人利益，决定部分持有现金或买入相关的替代性组合。

(2) 增强型主动投资策略

增强型主动投资策略是本基金辅助股票投资策略，包括：成份股增强策略和非成份股增强策略。

1) 成份股增强策略

本基金在复制目标指数构建投资组合的基础上，基金管理人将以对当前及未来国内外宏观经济形势的判断和经济景气周期预测作为基础，结合经济周期的各发展阶段，从行业发展政策因素、产业结构变化趋势因素以及行业自身景气周期因素等多个指标把握不同行业的景气度变化情况和上市公司业绩增长的趋势，通过对目标指数成份股的深入研究，选择景气度处于上升行业中价值被市场低估的个股对指数投资组合进行优化增强。

2) 非成份股增强策略

本基金将在充分利用公司研究团队研究成果的基础上，以“自上而下”与“自下而上”相结合的方法，精选出少量具备估值优势、持续成长能力的成份股之外的股票建立增强股票库。基金经理参考研究团队提供的策略、行业及个股研究支持，根据自身的综合判断，选择增强股票库中的股票进行适度投资，优化股票投资组合，力争获取超过目标指数的投资收益，增强投资组合整体收益水平。

3、债券投资策略

本基金债券投资的目的是基金资产流动性管理，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。本基金将根据国内外宏观经济形势、货币政策、债券市场供求状况以及市场利率走势等因素，合理预期债券市场利率变动趋势，制定以久期控制下的债券资产配置策略，主要投资于到期日在一年以内的政府债券、金融债等。

4、股指期货投资策略

本基金可运用股指期货，以提高投资效率，有效控制指数的跟踪误差，更好地实现投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，本着审慎原则，适度参与股指期货投资，改善投资组合风险收益特征。另外，本基金将利用股指期货流动性好、杠杆交易的特点，进行现金管理，以应对大额申购赎回、大额现金分红等，管理流动性风险，优化投资组合对目标指数的跟踪效果，提高投资组合的运作效率等。

5、跟踪误差的控制

本基金为控制基金业绩偏离比较基准的风险，设定跟踪目标为：力求控制基金份额净值增长率与业绩比较基准间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。

本基金每日对基金净值增长率与业绩比较基准收益率偏离度进行跟踪，每月末定期分析基金跟踪误差变化情况及原因。如日均跟踪偏离度的绝对值接近或大于 0.5%，基金管理人须进行归因分析，辨认造成跟踪误差引致因素，提出组合调整建议，基金经理须及时对投资组合进行相应调整，使跟踪误差回到限制值内。

(二) 投资程序

1、投资决策依据

- (1) 国家有关法律、法规和基金合同的有关规定；
- (2) 国内外宏观经济发展状况、国家财政政策、货币政策、产业政策、证券市场政策环境、市场资金供求状况、上市公司的经济运行状况；
- (3) 深证 300 指数的编制方法及调整公告等；
- (4) 深证 300 指数备选成份股的预测与分析。

2、投资程序

(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；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。

九、基金的业绩比较基准本基金的业绩比较基准为：深证 300 价格指数收益率×95% + 银行活期存款利率（税后）×5%

由于本基金为指数基金，并以深证 300 指数为目标指数进行跟踪复制，因此上述业绩比较基准适用于本基金。

深证 300 指数是深圳证券信息有限公司受深圳证券交易所委托，于 2009 年推出的作为可供跟踪交易的深圳市场指数。深证 300 指数选取在深圳证券交易所上市的 300 只 A 股组成，深证 300 指数的覆盖率较深证 100 指数大幅提高，对中小板和创业板公司的吸纳能力显著加强，使指数能更好地反映深市多层次资本市场的特点。

如果深证 300 指数被停止编制及发布，或深证 300 指数由其他指数替代（单纯更名除外），或由于指数编制方法等重大变更导致深证 300 指数不宜继续作为本基金的目标指数，本基金管理人可在履行适当程序后变更基金的目标指数和业绩比较基准。经与基金托管人协商一致，本基金变更业绩比较基准应报中国证监会备案，并在中国证监会指定的媒体上及时公告。

十、基金的风险收益特征本基金为股票指数型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的基金产品，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

十一、基金的投资组合报告基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行根据本基金合同规定，于 2016 年 4 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。本投资组合报告所载数据截至 2016 年 3 月 31 日，本报告中所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额（元） 占基金总资产的比例（%）

1 权益投资 42,855,132.02 89.90

其中：股票 42,855,132.02 89.90
 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 3,390,655.94 7.11
 8 其他资产 1,423,597.58 2.99
 9 合计 47,669,385.54 100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末指数投资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 354,836.63 0.75
 B 采掘业 514,700.57 1.09
 C 制造业 24,245,540.79 51.17
 D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 661,730.04 1.40
 E 建筑业 573,787.40 1.21
 F 批发和零售业 672,489.83 1.42
 G 交通运输、仓储和邮政业 33,173.21 0.07
 H 住宿和餐饮业 --
 I 信息传输、软件和信息技术服务业 3,838,393.28 8.10
 J 金融业 2,765,547.99 5.84
 K 房地产业 1,565,046.77 3.30
 L 租赁和商务服务业 1,755,685.50 3.71
 M 科学研究和技术服务业 --
 N 水利、环境和公共设施管理业 713,809.62 1.51
 O 居民服务、修理和其他服务业 --
 P 教育 --
 Q 卫生和社会工作 96,905.56 0.20
 R 文化、体育和娱乐业 643,352.86 1.36
 S 综合 198,480.88 0.42
 合计 38,633,480.93 81.54

2.2 报告期末积极投资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 32,308.00 0.07
 B 采掘业 --
 C 制造业 1,293,500.94 2.73
 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 1,805,842.15 3.81
 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 1,090,000.00 2.30
 J 金融业 --
 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 4,221,651.09 8.91

3、 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	002450	康得新	74,674	2,463,495.26	5.20
2	002594	比亚迪	27,037	1,590,045.97	3.36
3	000858	五粮液	48,440	1,361,648.40	2.87
4	002304	洋河股份	18,220	1,217,096.00	2.57
5	002183	怡亚通	37,900	1,116,155.00	2.36
6	000800	一汽轿车	75,106	1,058,243.54	2.23
7	000651	格力电器	51,280	1,045,599.20	2.21
8	000001	平安银行	94,211	1,002,405.04	2.12
9	000333	美的集团	18,832	580,967.20	1.23
10	300059	东方财富	12,100	536,030.00	1.13

3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	300025	华星创业	50,000	1,090,000.00	2.30
2	002462	嘉事堂	28,800	1,064,736.00	2.25
3	600559	老白干酒	15,000	774,750.00	1.64
4	600865	百大集团	52,700	672,979.00	1.42
5	000982	中银绒业	23,307	191,583.54	0.40

4、 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5、 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

6、 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排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

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

报告期内，本基金未参与股指期货交易；截至报告期末，本基金未持有股指期货合约。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同规定，本基金可运用股指期货，以提高投资效率，有效控制指数的跟踪误差，更好地实现投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，本着审慎原则，适度参与股指期货投资，改善投资组合风险收益特征。另外，本基金将利用股指期货流动性好、杠杆交易的特点，进行现金管理，以应对大额申购赎回、大额现金分红等，管理流动性风险，优化投资组合对目标指数的跟踪效果，提高投资组合的运作效率等。

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

11、投资组合报告附注

11.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体除深圳市怡亚通供应链股份有限公司（以下简称“怡亚通”）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。

怡亚通于 2016 年 3 月 25 日公告，其于 2016 年 2 月 2 日收到中国证券监督管理委员会深圳监管局（以下简称“深圳证监局”）下达的《深圳证监局关于对深圳市怡亚通供应链股份有限公司采取出具警示函措施的决定》（[2016]10 号），怡亚通在公告中陈述了警示函的内容以及公司相关整改情况。

本基金投资怡亚通（002183）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，认为上述事件对怡亚通的投资价值未造成实质性影响。本基金管理人将继续对上述公司进行跟踪研究。

11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

11.3 其他各项资产构成

序号 名称 金额（元）

1 存出保证金 10,334.20

2 应收证券清算款 1,088,520.67

3 应收股利 -

4 应收利息 665.85

5 应收申购款 324,076.86

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 1,423,597.58

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号 股票代码 股票名称 流通受限部分的公允价值(元) 占基金资产净值比例(%) 流通受限情况说明

1 000651 格力电器 1,045,599.20 2.21 重大事项

11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号 股票代码 股票名称 流通受限部分的公允价值(元) 占基金资产净值比例(%) 流通受限情况说明

1 300025 华星创业 1,090,000.00 2.30 重大资产重组

2 000982 中银绒业 191,583.54 0.40 重大事项

十二、基金的业绩基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1、自基金合同生效以来至 2016 年 3 月 31 日，本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表：

阶段 份额净值增长率① 份额净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准

收益率标准差④ ①-③ ②-④

2011 年 11 月 15 日至 2011 年 12 月 31 日 -6.50% 0.51% -17.95% 1.37% 11.45% -0.86%

2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日 -3.32% 1.22% 2.37% 1.37% -5.69% -0.15%

2013 年 1 月 1 日至

2013 年 12 月 31 日 7.74% 1.31% 4.59% 1.32% 3.15% -0.01%

2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日 30.49% 1.13% 29.05% 1.12% 1.44% 0.01%

2015 年 1 月 1 日至

2015 年 12 月 31 日 36.43% 2.88% 31.33% 2.51% 5.10% 0.37%

自基金合同生效起至 2016 年 3 月 31 日 41.80% 1.85% 24.79% 1.75% 17.01% 0.10%

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

摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图：

(2011 年 11 月 15 日至 2016 年 3 月 31 日)

十三、基金的费用与税收 (一) 与基金运作有关的费用

1、基金费用的种类

- (1) 基金管理人的管理费；
- (2) 基金托管人的托管费；
- (3) 基金合同生效后的指数使用许可费；
- (4) 基金财产划拨支付的银行费用；
- (5) 基金合同生效后的基金信息披露费用；
- (6) 基金份额持有人大会费用；
- (7) 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- (8) 基金的开户费用、账户维护费用；
- (9) 基金的证券交易费用；
- (10) 依法可以在基金财产中列支的其他费用。

2、上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

3、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，基金管理费按前一日基金资产净值的 1% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

(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 0.15% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

(3) 基金合同生效后的指数使用许可费

本基金作为指数基金，需根据与深圳证券信息有限公司签署的指数使用许可协议的约定向深圳证券信息有限公司支付指数使用许可费。通常情况下，指数使用许可费按前一日基金资产净值的 0.02%（2 个基点）的年费率计提，且收取下限为每季度人民币 5 万元。计算方法如下：

$$H = E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的指数使用许可费

E 为前一日的基金资产净值

指数使用许可费从基金合同生效日开始每日计算，逐日累计，按季支付；基金合同生效之日所在季度的指数使用许可费，按实际计提金额收取，不设下限。自基金合同生效之日所在季度的下一季度起，指数使用许可费收取下限为每季度 5 万元，即不足 5 万元时按照 5 万元收取。

指数使用费的支付由基金管理人向基金托管人发送划付指令，经基金托管人复核后于次季初 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给深圳证券信息有限公司。

(4) 除管理费、托管费和指数使用许可费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法

规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

（二）与基金销售有关的费用

1、基金申购费用

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。如将来出现经养老金监管部门认可的新的养老金类型，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 0.48%

100 万元 $\leq M < 500$ 万元 0.32%

$M \geq 500$ 万元 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（M） 申购费率

$M < 100$ 万元 1.20%

100 万元 $\leq M < 500$ 万元 0.80%

$M \geq 500$ 万元 每笔 1000 元

计算公式：

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

2、基金赎回费用

本基金的赎回费用按基金份额持有人持有时间的增加而递减。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费中不低于赎回费总额的 25% 归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。具体赎回费率结构如下：

持有年限（Y） 赎回费率

$Y < 1$ 年 0.50%

1 年 $\leq Y < 2$ 年 0.25%

$Y \geq 2$ 年 0%

注：1 年指 365 天。

计算公式：

赎回费用 = 赎回金额 \times 赎回费率

赎回金额 = 赎回份数 \times 赎回价格

赎回价格 = 申请日基金份额净值

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

转入总金额 = 转出金额－转出基金赎回费

申购补差费=转入总金额×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。

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。

(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列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

(四) 基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒体上刊登公告。

(五) 基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

十四、对招募说明书更新部分的说明本招募说明书依据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》及其它有关法律法规的要求，对 2015 年 12 月 29 日刊登的《摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）》进行了更新，主要更新的内容如下：

序号 修改部分 说明

1 重要提示 更新了本招募说明书重要提示内容，以及所载内容截止日期、有关财务数据和净值表现截止日

2 三、基金管理人 更新了“主要人员情况”的信息

3 四、基金托管人 根据托管人提供的信息，更新了“基金托管人”部分

4 五、相关服务机构 根据服务机构的实际情况更新了相关机构的信息

5 九、基金的投资 更新了最近一期投资组合报告的内容，即截至 2016 年 3 月 31 日的基金投资组合报告

6 十、基金的业绩 更新了基金的投资业绩，即截至 2016 年 3 月 31 日的基金投资业绩

7 十七、风险揭示 更新了风险揭示的内容

8 二十二、其他应披露事项 根据最新情况对相关应披露事项进行了更新

摩根士丹利华鑫基金管理有限公司

二〇一六年六月二十七日