

# 摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金

## 招募说明书（更新）

（2012年第1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

### 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。

投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为2012年3月26日，有关财务数据和净值表现截止日为2012年3月31日（财务数据未经审计）。

# 目 录

|                       |     |
|-----------------------|-----|
| 一、绪言                  | 1   |
| 二、释义                  | 1   |
| 三、基金管理人               | 5   |
| 四、基金托管人               | 15  |
| 五、相关服务机构              | 19  |
| 六、基金的募集               | 35  |
| 七、基金合同的生效             | 36  |
| 八、基金份额的申购、赎回与转换       | 36  |
| 九、基金份额的非交易过户、转托管与冻结解冻 | 43  |
| 十、基金的投资               | 43  |
| 十一、基金的业绩              | 57  |
| 十二、基金的财产              | 60  |
| 十三、基金资产的估值            | 62  |
| 十四、基金的收益分配            | 69  |
| 十五、基金的费用与税收           | 70  |
| 十六、基金的会计与审计           | 74  |
| 十七、基金的信息披露            | 74  |
| 十八、风险揭示               | 78  |
| 十九、基金的终止与清算           | 80  |
| 二十、基金合同的内容摘要          | 82  |
| 二十一、基金托管协议的内容摘要       | 95  |
| 二十二、对基金份额持有人的服务       | 102 |
| 二十三、其他应披露事项           | 104 |
| 二十四、招募说明书的存放及查阅方式     | 107 |
| 二十五、备查文件              | 107 |

## 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》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 2003 年 10 月 28 日第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过,自 2004 年 6 月 1 日起正式实施的《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>基金合同当事人</b> | 指受基金合同约束,根据基金合同享受权利并承担义务的基金管理人、基金托管人和基金份额持有人                                                 |
| <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                                                                                      |
| <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 |
|--|-----------------|

### 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：王文学

成立时间：2003 年 3 月 14 日

注册资本：1 亿元人民币

电话：( 0755 ) 88318883

联系人：赵婧

股东及股权结构：华鑫证券有限责任公司（36%）、摩根士丹利国际控股公司（34%）、汉唐证券有限责任公司<sup>1</sup>（15%）、深圳市招融投资控股有限公司（10%）、深圳市中技实业（集团）有限公司（5%）。

#### (二) 主要人员情况

##### 1、董事会成员

王文学先生，英国格林威治大学项目管理硕士。2011 年 6 月至今任摩根士丹利华鑫证券有限责任公司董事长，2011 年 11 月至今兼任华鑫证券有限责任公司副董事长。1993 年 7 月至 2011 年 11 月先后担任西安证券有限责任公司副总经理、总经理、董事长；人民银行西安分行体改、外汇管理、稽核副处长；华鑫证券有限责任公司董事长。现任本公司董事

<sup>1</sup> 深圳市中级人民法院 2007 年 12 月 29 日发布公告，汉唐证券有限责任公司于 2007 年 12 月 26 日进入破产清算程序。

长。

Carlos Alfonso Oyarbide Seco 先生，西班牙巴塞罗那大学经济学学士，美国宾夕法尼亚大学沃顿商学院商业管理硕士。2007 年 6 月至今任摩根士丹利董事总经理及中国首席营运官，曾任摩根士丹利并购部门董事总经理、摩根士丹利西班牙财富管理子公司首席执行官，瑞士信贷（香港）有限公司董事总经理及金融机构部主管。现任本公司副董事长。

Navtej Singh Nandra 先生，德里大学商学学士，印度管理学院工商管理硕士。2010 年 6 月至今任摩根士丹利董事总经理、摩根士丹利投资管理国际业务主管、摩根士丹利房地产和商业银行策略主管，曾为博思艾伦咨询公司全球金融服务业务合伙人，美林证券全球投资银行首席运营官、Nuveen 资产管理公司和 MLITS 印度董事、美林证券多样化金融服务业务主管、美林证券全球资产管理部首席运营官、Edelweiss 资本董事，Edelweiss Tokio 人寿保险有限公司董事，DTZ 控股公司资深顾问。现任本公司董事。

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。现任本公司董事、总经理。

洪家新先生，华东师范大学金融学院世界经济专业研究生，同济大学 EMBA 研究生。2000 年 10 月至今任华鑫证券有限责任公司副监事长、副总裁、总裁兼法定代表人。曾任飞乐音响证券投资公司总经理，西安证券有限责任公司总经理助理，华鑫证券有限责任公司筹委会组长。现任本公司董事。

赵恒先生，西安大学计划统计学专业，经济学学士。1985 年 9 月至今任人民银行西安

分行金融研究所研究室干部、西安证券有限责任公司总经理助理、副总经理、总经理、华鑫证券有限责任公司总监、副总裁。现任本公司董事。

洪小源先生，北京大学经济学硕士，澳大利亚国立大学科学硕士。2011年9月至今任招商局集团有限公司总裁助理。2007年5月至今任招商局金融集团有限公司总经理；任招商银行股份有限公司（上交所及香港联交所上市）、招商证券股份有限公司（上交所上市）、招商局中国基金有限公司（香港联交所上市）、中诚信托有限责任公司、长城证券有限责任公司董事；任招商局中国投资管理有限公司、招商昆仑股权投资管理有限公司、海达远东保险顾问有限公司、招商局保险有限公司和招商局(英国)控股有限公司董事长。现任本公司董事。

张嵩涛先生，英国兰开夏大学工商管理学学士，拉夫堡大学金融学硕士。2007年9月至今任深圳市中技实业（集团）有限公司金融事业部经理助理。现任本公司董事。

Andrew Gordon Williamson 先生，英国南安普顿大学社会科学理学士。曾任 Coopers & Lybrand 会计事务所（英国伦敦）审计师，Coopers & Lybrand 会计事务所（香港）审计经理，汇丰银行集团（香港）财务会计师、香港区会计经理、亚太区首席会计师、亚太区财务策划主管。现任本公司独立董事；兼任杭州工商信托股份有限公司独立董事。

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。

苗复春先生，中国人民大学经济专业硕士。2007年5月至今任中国人寿养老保险公司顾问。曾任内蒙古商业局、计委科长，中国社科院技术经济研究所助理研究员，国务院技术经济研究中心研究员，国务院办公厅副局长，外经贸部办公厅主任，中央财经领导小组办公室局长，中国人寿养老保险公司副总经理，中国人寿保险股份有限公司执行董事、执行副总裁，

中国人寿保险集团公司副总裁。现任本公司独立董事。

陈宏民先生，加拿大英属哥伦比亚大学博士后。现任上海交通大学安泰产业组织与技术创新研究中心主任，教授，博士生导师。曾任教于上海新联纺织品进出口公司职工大学。现任本公司独立董事。

何斐先生，北京大学法学学士，美国南方卫理会大学法学硕士、法律博士。1992 年 5 月至今任北京市海问律师事务所合伙人。曾任教于北京大学法律系。现任本公司独立董事。

## 2、监事会成员

陈海东先生，南开大学经济学士，上海财经大学经济学硕士。2011 年 12 月至今任华鑫证券有限责任公司副总裁、合规总监，曾任天津住房公积金管理中心主管会计，厦门国际信托投资公司天津证券营业部部门副经理，天同证券有限责任公司资产管理部投资经理，兴安证券有限责任公司资产管理部副总经理，华鑫证券有限责任公司财务部副总经理、客户资产存管中心总经理、合规稽核部总经理。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，澳大利亚特许注册会计师，目前担任摩根士丹利执行董事，曾任德意志银行（中国）有限公司上海分行董事、德意志银行亚太总部助理副总裁、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。

吴慧峰先生，上海财经大学会计系学士，北京大学国家经济研究院硕士，1999 年至今担任招商局金融集团有限公司总经理助理、财务部经理、人力资源部经理，兼任招商局中国投资管理有限公司董事、招商证券股份有限公司监事，曾任上海诚南房地产开发有限公司财务部副经理，中国南山开发集团股份有限公司结算中心主任。现任本公司监事。

成立立女士，英国兰开夏电子工程学士，英国兰卡斯特大学金融专业硕士。2005 年至今任深圳市中技实业（集团）有限公司金融事业部经理。现任本公司监事。

张力女士，中国人民大学劳动经济专业硕士。2008 年 10 月加入摩根士丹利华鑫基金管理有限公司，现任综合管理和人力资源部总监。曾就职于深圳达能益力饮品有限公司、深圳益力康源饮品有限公司和联合饼干（中国）有限公司。现任本公司职工监事。

梅萍女士，武汉理工大学第三产业经济专业经济学硕士。2006 年 6 月加入摩根士丹利华鑫基金管理有限公司，现任市场发展部副总监兼客户服务中心主任。曾就职于长江证券有限责任公司和武汉新兰德证券投资顾问有限公司。现任本公司职工监事。

### 3、公司高管人员

于华先生，总经理，简历同上。

徐卫先生，北京大学经济管理系硕士、具有法律职业资格证书，19 年证券基金行业工作经历。先后在中国证监会深圳监管局政策法规处、市场处、机构监管处、基金监管处、机构监管二处等部门工作，历任副主任科员、主任科员、副处长、处长等职务。2009 年 7 月加入本公司，现任本公司副总经理。

秦红女士，北京大学国民经济管理学学士，具有 14 年证券基金行业工作经历。曾任职博时基金管理有限公司行政管理部经理、市场发展部经理、北京分公司总经理，易方达基金管理有限公司北京分公司总经理，工银瑞信基金管理有限公司渠道销售部总监。2009 年 4 月加入本公司，现任本公司副总经理；兼任中央财大理财规划师培训班基金讲师。

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，具有 15 年证券基金行业工作经历。曾就职于巨田证券有限责任公司，历任交易管理总部综合管理部经理助理，总经理办公室主任助理，资产管理部理财部副经理、经理，研究所研究员；2003 年 9 月加入本公司，历任基金运营部副总监、总监，总经理助理兼基金运营部总监。现任本公司督察长。

### 4、本基金基金经理

基金经理：盛军锋先生，暨南大学产业经济学博士。6 年证券从业经历。曾任中国人民

银行深圳中心支行货币信贷管理科员，宝盈基金管理有限公司研究员、基金经理，2009年7月至2011年4月间任“宝盈策略增长股票型证券投资基金”基金经理。2011年4月加入本公司，2012年1月起任本基金基金经理，2012年3月起任摩根士丹利华鑫主题优选股票型证券投资基金基金经理。

本基金前任基金经理管卫泽，于2004年3月至2005年3月管理本基金；前任基金经理陈守红，于2005年4月至2007年10月管理本基金；前任基金经理廖京胜，于2007年11月至2009年8月管理本基金；前任基金经理李君，于2009年8月至2012年1月管理本基金。

#### 5、投资决策委员会成员

主任委员：于华先生，本公司董事、总经理。

委员：何滨女士，总经理助理、投资总监兼基金投资部总监；钱辉先生，公司高级顾问；徐强先生，研究管理部总监；袁航女士，公司首席分析师；汝平先生，固定收益投资部总监。

#### 6、上述人员之间不存在近亲属关系。

### (三) 基金管理人的职责

1、依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回、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、编制中期和年度基金报告；

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、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、法规和中国证监会规定的其它职责。

#### **(四) 基金管理人的承诺**

- 1、基金管理人承诺不从事违反《证券法》的行为，并承诺建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生；
- 2、基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为，并承诺建立健全的内部风险控制制度，采取有效措施，防止违反《基金法》行为的发生；
- 3、基金管理人承诺防止以下禁止行为的发生：
  - (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) 依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。
- 4、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下行为：
  - (1) 越权或违规经营；
  - (2) 违反《基金合同》或《托管协议》；
  - (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益；

- (4) 在向中国证监会报送的资料中故意弄虚作假；
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权；
- (7) 违反现行有效的有关法律、法规、规章、《基金合同》和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- (8) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- (9) 贬损同行，以抬高自己；
- (10) 以不正当手段谋求业务发展；
- (11) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (12) 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

## 5、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营成本，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) 金融工程和风险控制部负责为投资业务提供数量化分析服务，同时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) 基金托管人基本情况

##### 1、基本情况

名称:中国光大银行股份有限公司(简称“中国光大银行”)

住所地址:北京市西城区太平桥大街25号光大中心

办公地址:北京市西城区太平桥大街25号光大中心

成立日期:1992年8月18日

注册资本:人民币404.3479亿元

法定代表人:唐双宁

联系人:石立平

电话:010-63639180

传真:010-63639132

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

##### 2、主要人员情况

法定代表人唐双宁先生,历任中国人民建设银行辽宁省分行办公室副主任(主持工作),中国人民建设银行沈阳市分行常务副行长,中国人民银行沈阳市分行副行长、党组副书记,中国人民银行辽宁省分行党组成员兼沈阳市分行行长、党组书记,中国人民银行信贷管理司司长,中国人民银行货币金银局局长,中国人民银行银行监管一司司长,中国银行业监督管理委员会党委委员、副主席。现任中国光大集团董事长、党委书记,中国光大银行董事长、党委书记,光大证券股份有限公司董事,中国光大控股有限公司董事会主席,中国光大国际有限公司董事会主席。

行长郭友先生,历任国家外汇管理局外汇储备业务中心外汇交易部主任,中国投资公司(新加坡)总经理,中国人民银行外资金融机构管理司副司长,中国光大银行副行长,中国光大(集团)总公司执行董事、副总经理兼中国光大控股有限公司行政总裁,现任中国光大(集团)总公司副董事长、中国光大银行股份有限公司副董事长、行长。

陈昌宏先生,北京大学法学学士、硕士。曾任中共中央联络部干部,四川光大资产管理公司董事、常务副总经理,中国光大银行昆明分行副行长。现任中国光大银行股份有限公司投资与托管业务部总经理。

### 3、基金托管业务经营情况

截止 2012 年 3 月 31 日,中国光大银行股份有限公司共托管国投瑞银融华债券型基金、摩根士丹利华鑫基础行业基金、国投瑞银景气行业基金、泰信先行策略基金、光大保德信量化核心基金、大成货币市场基金、摩根士丹利华鑫资源优选混合型基金(LOF)、招商安本增利债券型基金、国投瑞银创新动力基金、大成策略回报股票型基金、博时转债增强型债券型基金、中欧新动力股票型基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、工银瑞信保本混合型证券投资基金,共 14 只证券投资基金,托管基金资产规模 333.68 亿元。同时,开展了证券

公司集合理财计划、专户理财、企业年金基金、QDII 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。

## **(二) 基金托管人的内部控制制度**

### **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。中国光大银行股份有限公司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，安装了录象监视系统和录音监听系统，以保障基金信息的安全。

#### **（三）基金托管人对基金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。基金管理人对于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：王一平

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：罗晔

电话：(010) 66155568

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：栾倩

电话：(021) 63343311

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>

目前支持的网上直销银行卡：中国建设银行龙卡借记卡、招商银行“一卡通”借记卡、

光大银行借记卡、中信银行借记卡、兴业银行借记卡和上海浦东发展银行借记卡。

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、代销机构

### （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 号光大中心

办公地址：北京市西城区太平桥大街 25 号光大中心

法定代表人：唐双宁

联系电话：（010）63639180

客服电话：95595

网址：www.cebbs.com

### （2）中国建设银行股份有限公司

注册地址：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

客户服务电话：95533

网址：www.ccb.com

### （3）中国工商银行股份有限公司

注册地址：中国北京复兴门内大街55号

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

网址：<http://www.icbc.com.cn>

( 4 ) 中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：肖钢

客户服务电话：95566

网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

( 5 ) 招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人：傅育宁

客户服务电话：95555

网址：[www.cmbchina.com](http://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8号富华大厦C座

法定代表人：田国立

客户服务电话：95558

网址：[bank.ecitic.com](http://bank.ecitic.com)

( 7 ) 平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南中路1099号平安银行大厦

办公地址：深圳市深南中路1099号平安银行大厦

法定代表人：孙建一

联系人：芮蕊

联系电话：( 0755 ) 25879756

客户服务电话：95511-3

网址：bank.pingan.com

( 8 ) 烟台银行股份有限公司

注册地址：山东省烟台市芝罘区海港路25号

办公地址：山东省烟台市芝罘区海港路25号

法定代表人：庄永辉

客户服务电话：4008-311-777

网址：http://www.yantaibank.net

( 9 ) 河北银行股份有限公司

注册地址：石家庄市平安北大街28号

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：http://www.hebbank.com

( 10 ) 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：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01 ( b ) 单元

法定代表人：王文学

联系人：杨小江

联系电话 : ( 0755 ) 82083788

客户服务电话 : ( 021 ) 32109999 , ( 029 ) 68918888

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

( 11 ) 中信证券股份有限公司

注册地址 : 深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层

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 : 陈忠

联系电话 : ( 010 ) 60833722

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

( 12 ) 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 : 北京市东城区朝内大街 188 号

法定代表人 : 王常青

联系人 : 权唐

联系电话 : ( 010 ) 85130577

客户服务电话 : 400-8888-108 ( 免长途费 )

网址 : [www.csc108.com](http://www.csc108.com)

( 13 ) 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 号国际企业大厦 C 座

法定代表人 : 顾伟国

联系人：田薇

电话：( 010 ) 66568536

客户服务电话：400-888-8888

网址：www.chinastock.com.cn

( 14 ) 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：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：高冠江

联系人：唐静

联系电话：( 010 ) 63081000

客户服务电话：400-800-8899

网址：www.cindasc.com

( 15 ) 民生证券有限责任公司

注册地址：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

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：www.msza.com

( 16 ) 宏源证券股份有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市建设路2号

办公地址：北京市西城区太平桥大街19号宏源证券

法定代表人：冯戎

联系人：李巍

联系电话：( 010 ) 88085858

客户服务电话：4008-000-562

网址：<http://www.hysec.com>

( 17 ) 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：400-8888-001、95553

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

( 18 ) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路 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：万建华

联系人：芮敏祺

联系电话：( 021 ) 38676161

客户服务电话：400-8888-666

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

( 19 ) 申银万国证券股份有限公司

注册地址：上海市常熟路 171 号

办公地址：上海市常熟路171号

法定代表人：丁国荣

联系电话：( 021 ) 54033888

客户服务电话：95523 或 4008895523

网址：www.sywg.com

( 20 ) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路1508号

办公地址：上海市静安区新闻路1508号

法定代表人：徐浩明

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

( 21 ) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 99 号标力大厦

办公地址：浦东新区民生路 1199 弄证大·五道口广场 1 号楼 21 层

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

( 22 ) 长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

联系人：李良

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)

( 23 ) 中银国际证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39楼

办公地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39楼

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)

( 24 ) 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 21 层-29 层

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：吴宇

联系电话：( 021 ) 63325888

客户服务电话：95503

网址：www.dfzq.com.cn

( 25 ) 湘财证券有限责任公司

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

( 26 ) 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

法定代表人：吴万善

联系人：程高峰

联系电话：( 025 ) 83290834

客户服务电话：95597

网址：www.htsc.com.cn

( 27 ) 齐鲁证券有限公司

注册地址：山东省济南市经十路 128 号

办公地址：济南市经七路 86 号 23 层

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

( 28 ) 中信万通证券有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层 ( 1507-1510 室 )

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：张智河

联系人：吴忠超

联系电话：( 0532 ) 85022326

客户咨询电话：( 0532 ) 96577

公司网址：www.zxwt.com.cn

( 29 ) 中信证券 ( 浙江 ) 有限责任公司

注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19、20 层

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19、20 层

法定代表人：沈强

联系人：丁思聪

联系电话：0571-87112510

客户服务电话：0571-96598

网址：www.bigsun.com.cn

( 30 ) 山西证券股份有限公司

注册地址：太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

办公地址：太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

联系人：郭熠

联系电话：( 0351 ) 8686659

客户服务电话：400-666-1618

网址：www.i618.com.cn

( 31 ) 东海证券有限责任公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18、19 楼

办公地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18、19 楼

法定代表人：朱科敏

联系人：李涛

联系电话：( 0519 ) 88157761

客户服务电话：400-888-8588

网址：www.longone.com.cn

( 32 ) 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：苏州工业园区翠园路 181 号商旅大厦

法定代表人：吴永敏

联系人：方晓丹

联系电话：( 0512 ) 65581136

客户服务电话 : ( 0512 ) 33396288

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

( 33 ) 方正证券股份有限公司

注册地址 : 湖南长沙芙蓉中路 2 段华侨国际大厦 22-24 层

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 : 雷杰

联系人 : 彭博

联系电话 : ( 0731 ) 85832343

客户服务电话 : 95571

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

( 34 ) 安信证券股份有限公司

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

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

深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 9 层

法人代表人 : 牛冠兴

联系人 : 陈剑虹

联系电话 : ( 0755 ) 82558305

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

( 35 ) 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：龙增来

联系人：刘毅

联系电话：( 0755 ) 82023442

客户服务电话：400-600-8008

网址：www.cjis.cn

( 36 ) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

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：林生迎

联系电话：( 0755 ) 82960223

客户服务电话：400-8888-111、( 0755 ) 26951111

网址：www.newone.com.cn

( 37 ) 国信证券股份有限公司

注册地址：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

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：齐晓燕

联系电话：( 0755 ) 82130833

客户服务电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

( 38 ) 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层西厅

法定代表人：朱治理

联系人：张琛

联系电话：0755-82830333-876

客户服务电话：0755-25170332

网址：www.vanho.cn

( 39 ) 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、41 和 42 楼

法定代表人：林治海

联系人：黄岚

联系电话：( 020 ) 87555888

客户服务电话：95575

网址：www.gf.com.cn

( 40 ) 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 )

网址：www.hfzq.com.cn

( 41 ) 东莞证券有限责任公司

注册地址：广东省东莞市可园南路 1 号金源中心 30 楼

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

( 42 ) 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：北京市西城区金融街 5 号新盛大厦 B 座 4 层

法定代表人：林义相

联系人：林爽

联系电话：( 010 ) 66045608

客户服务电话：010-66045678

网址：www.txsec.com

3、其他代销机构

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代理销售本基金，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：王文学

联系人：邢思宁

电话：( 0755 ) 88318720

### **( 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有限公司

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：张鸿

联系电话：(021) 23233283

经办注册会计师：薛竞、张鸿

## **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、代销机构

经本公司委托 ,具有代销本基金资格的商业银行或其他机构的营业网点 (见“五、相关服务机构”部分相关内容) ;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代销机构 ,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、代销网点每个账户每次申购的最低金额为 100 元；
- 2、直销中心每个账户首次申购的最低金额为 100 元，已在直销中心有认购本基金记录的投资者不受首次申购最低金额的限制，追加申购的最低金额为 100 元；
- 3、赎回的最低份额为 0 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；
- 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，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：

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

$$\text{赎回费用} = 12500 \times 0.5\% = 62.50 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 12500 - 62.50 = 12437.50 \text{ 元}$$

## 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运转；

(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) 法律、法规规定或经中国证监会批准的其他情形。

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运转；

(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) 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事项，但基金管理人认为有正当理由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基准计算赎回金额，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) 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

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

## 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

### 1、投资决策依据

#### （1）决策依据的主要内容

- 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、上市公司的经济运行状况；
- 3) 国家财政政策、货币政策、产业政策；
- 4) 证券市场政策环境、市场资金供求状况、投资者状况；
- 5) 投资品种的预期收益率和风险水平；
- 6) 影响证券市场未来走势的其他因素。

#### （2）决策依据的主要来源

决策依据主要来源于研究团队定期或不定期的宏观经济分析报告、证券市场分析报告、行业分析报告、上市公司研究报告以及个券研究报告等。上述报告综合了内外部研究成果。

#### （3）决策依据的主要用途

投资决策依据主要用于资产配置策略、权益类投资策略、固定收益类投资策略等投资策略，最终决定证券具体的交易行为。

### 2、投资决策机制

#### （1）决策架构

本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会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。基金经理在投资决策委员会的授权范围内行使投资管理权限。

## （2）决策支持

“研究决定投资”是本基金的投资原则。公司所有的投资决策建立在科学、客观、充分和独立的研究的基础上。研究为投资决策提供依据，为投资组合构建提出建议，为重大突发事件提供评估意见和决策建议。

## 3、投资管理流程

（1）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，为投资决策委员会及基金投资组合管理提供研究依据。

（2）投资决策委员会定期或不定期召开会议，依据研究团队及基金经理提交的各类研究报告、投资策略或组合方案，以及金融工程团队提供的风险监测指标等，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。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）基金经理在投资决策委员会的授权范围内，根据投资决策委员会的决定，参考金融工程团队的建议和市场销售团队适时提供的申购赎回预测，构建具体的投资方案并组织实施。超过基金经理权限的，经履行批准程序后实施。每位基金经理可配备若干名基金经理助理协助其开展工作。

（4）本基金实行集中交易制度。基金经理将指令下达给交易团队，由交易团队交易主管分配给交易员完成交易指令的执行。交易团队同时承担一线风险监控职责。

（5）投资风险管理团队由金融工程团队和监察稽核团队组成，金融工程团队定期或不定期地对基金投资风险进行评估；监察稽核团队对基金投资的合规性进行日常监控；风险管

理委员会根据投资风险管理团队提供的报告及市场变化对基金投资组合进行风险评估,并提出风险防范措施。

(6) 基金经理根据证券市场变化、基金申购、赎回现金流情况以及各种风险的监控和评估结果对组合进行动态调整。

(7) 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流程。

#### 4、投资组合管理的方法和标准

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%。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 ) 业绩比较基准

沪深 300 指数×55% + 中证综合债券指数×45%

#### ( 五 ) 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。

#### ( 六 ) 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。

#### (七) 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。

#### (八) 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 2012 年 4 月 19 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。

##### 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<br>（%） |
|----|--------|---------------|------------------|
| 1  | 权益投资   | 44,448,867.62 | 63.77            |
|    | 其中：股票  | 44,448,867.62 | 63.77            |
| 2  | 固定收益投资 | 16,195,560.20 | 23.24            |

|   |                       |               |        |
|---|-----------------------|---------------|--------|
|   | 其中：债券                 | 16,195,560.20 | 23.24  |
|   | 资产支持证券                | -             | -      |
| 3 | 金融衍生品投资               | -             | -      |
| 4 | 买入返售金融资产              | -             | -      |
|   | 其中：买断式回购的买入返售<br>金融资产 | -             | -      |
| 5 | 银行存款和结算备付金合计          | 7,835,041.87  | 11.24  |
| 6 | 其他各项资产                | 1,221,972.11  | 1.75   |
| 7 | 合计                    | 69,701,441.80 | 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<br>比例（%） |
|----|-------------|---------------|------------------|
| A  | 农、林、牧、渔业    | 1,278,585.00  | 1.90             |
| B  | 采掘业         | 1,060,000.00  | 1.58             |
| C  | 制造业         | 27,243,739.30 | 40.50            |
| C0 | 食品、饮料       | 5,381,860.00  | 8.00             |
| C1 | 纺织、服装、皮毛    | -             | -                |
| C2 | 木材、家具       | -             | -                |
| C3 | 造纸、印刷       | -             | -                |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 2,602,138.00  | 3.87             |

|     |                |               |       |
|-----|----------------|---------------|-------|
| C5  | 电子             | 2,556,820.00  | 3.80  |
| C6  | 金属、非金属         | 1,397,840.00  | 2.08  |
| C7  | 机械、设备、仪表       | 8,007,714.30  | 11.91 |
| C8  | 医药、生物制品        | 4,527,080.00  | 6.73  |
| C99 | 其他制造业          | 2,770,287.00  | 4.12  |
| D   | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 716,559.48    | 1.07  |
| E   | 建筑业            | -             | -     |
| F   | 交通运输、仓储业       | -             | -     |
| G   | 信息技术业          | -             | -     |
| H   | 批发和零售贸易        | 5,523,370.40  | 8.21  |
| I   | 金融、保险业         | 1,682,448.75  | 2.50  |
| J   | 房地产业           | 4,658,470.00  | 6.93  |
| K   | 社会服务业          | 2,284,650.00  | 3.40  |
| L   | 传播与文化产业        | 1,044.69      | 0.00  |
| M   | 综合类            | -             | -     |
|     | 合计             | 44,448,867.62 | 66.08 |

### 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  | 002594 | 比亚迪   | 97,890  | 2,770,287.00 | 4.12 |
| 2  | 600779 | 水井坊   | 105,000 | 2,381,400.00 | 3.54 |
| 3  | 600739 | 辽宁成大  | 128,000 | 2,044,160.00 | 3.04 |
| 4  | 000538 | 云南白药  | 38,000  | 1,870,360.00 | 2.78 |
| 5  | 000527 | 美的电器  | 140,000 | 1,836,800.00 | 2.73 |
| 6  | 600239 | 云南城投  | 255,000 | 1,797,750.00 | 2.67 |
| 7  | 000417 | 合肥百货  | 119,984 | 1,721,770.40 | 2.56 |
| 8  | 000858 | 五 粮 液 | 49,000  | 1,609,160.00 | 2.39 |
| 9  | 600761 | 安徽合力  | 130,000 | 1,544,400.00 | 2.30 |
| 10 | 002277 | 友阿股份  | 98,000  | 1,497,440.00 | 2.23 |

## 4、报告期末按券种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值 ( 元 )   | 占基金资产净值<br>比例 ( % ) |
|----|-----------|--------------|---------------------|
| 1  | 国家债券      | -            | -                   |
| 2  | 央行票据      | -            | -                   |
| 3  | 金融债券      | 5,000,000.00 | 7.43                |
|    | 其中：政策性金融债 | 5,000,000.00 | 7.43                |
| 4  | 企业债券      | 9,787,000.00 | 14.55               |
| 5  | 企业短期融资券   | -            | -                   |

|   |      |               |       |
|---|------|---------------|-------|
| 6 | 中期票据 | -             | -     |
| 7 | 可转债  | 1,408,560.20  | 2.09  |
| 8 | 其他   | -             | -     |
| 9 | 合计   | 16,195,560.20 | 24.08 |

#### 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

| 序号 | 债券代码    | 债券名称   | 数量(张)  | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|---------|--------|--------|--------------|--------------|
| 1  | 110308  | 11进出08 | 50,000 | 5,000,000.00 | 7.43         |
| 2  | 1080025 | 10黄山债  | 50,000 | 4,774,000.00 | 7.10         |
| 3  | 122927  | 09海航债  | 45,000 | 4,458,600.00 | 6.63         |
| 4  | 113002  | 工行转债   | 11,260 | 1,219,120.20 | 1.81         |
| 5  | 122918  | 10阜阳债  | 5,500  | 554,400.00   | 0.82         |

#### 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投资。

#### 7、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投资。

#### 8、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宜宾五粮液股份有限公司外，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。

宜宾五粮液股份有限公司于 2011 年 5 月 28 日公告了《关于收到中国证监会〈行政处罚决定书〉的公告》。宜宾五粮液股份有限公司于 2011 年 5 月 27 日收到中国证券监督管理委员会《行政处罚决定书》([2011]17 号)。该公告中,公司陈述了《行政处罚决定书》中提及的主要内容及公司针对处罚事项的说明。

本基金投资五粮液(000858)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及时分析和研究,认为上述事件对五粮液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证券的股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

(3) 其他资产的构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 500,000.00   |
| 2  | 应收证券清算款 | 443,720.90   |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 266,590.49   |
| 5  | 应收申购款   | 11,660.72    |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 1,221,972.11 |

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净 |
|----|------|------|---------|--------|
|----|------|------|---------|--------|

|   |        |      |              | 值比例(%) |
|---|--------|------|--------------|--------|
| 1 | 113002 | 工行转债 | 1,219,120.20 | 1.81   |
| 2 | 113001 | 中行转债 | 189,440.00   | 0.28   |

(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 2012 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的比较表：

| 阶段                                   | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基准<br>收益率③ | 业绩比较基准收<br>益率标准差④ | ① - ③   | ② - ④  |
|--------------------------------------|------------|---------------|----------------|-------------------|---------|--------|
| 2004 年 3 月 26 日至<br>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<br>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<br>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                      | 128.02%    | 2.05%         | 80.15%         | 1.65%             | 47.87%  | 0.40%  |

|                                                |         |       |         |       |         |       |
|------------------------------------------------|---------|-------|---------|-------|---------|-------|
| 2007 年 12 月 31 日                               |         |       |         |       |         |       |
| 2008 年 1 月 1 日至<br>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<br>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<br>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<br>2011 年 12 月 31 日            | -30.03% | 0.93% | -18.28% | 0.91% | -11.75% | 0.02% |
| 自基金合同生效起<br>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：<br>2012 年 3 月 5 日至<br>2012 年 3 月 31 日 | -5.63%  | 1.14% | -4.54%  | 0.66% | -1.09%  | 0.48% |

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

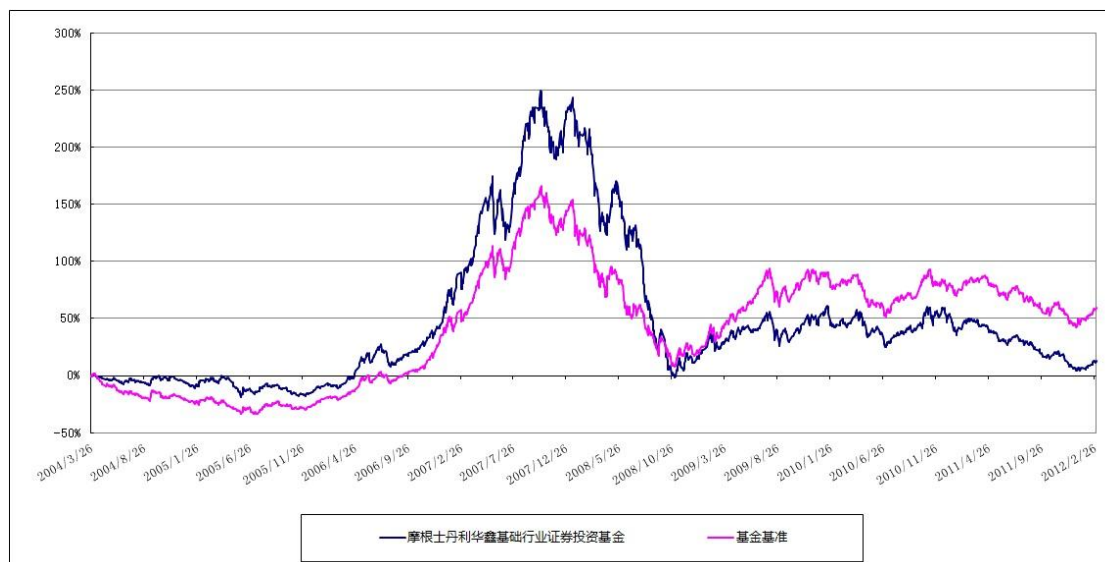
自基金合同生效以来至基金合同修改前基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较

#### 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 2012 年 3 月 31 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）上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

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

##### （2）未上市股票的估值：

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

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

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

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

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

(4) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

## 2、债券估值方法

(1) 在证券交易所市场挂牌交易的实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

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

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

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

术确定公允价值。

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

(6) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

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

(8) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

### 3、权证估值方法

(1) 基金持有的权证，从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日其所在证券交易所挂牌的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

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

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

(4) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1) - (3)小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第(1)

- (3) 小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的, 基金管理人可根据具体情况, 并与基金托管人商定后, 按最能反映公允价值的价格估值。

(5) 国家有最新规定的, 按其规定进行估值。

4、其他有价证券等资产按国家有关规定进行估值。

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

#### (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、如出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的；
- 5、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

#### （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事务所和律师费、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

本基金的申购费按申购金额采用比例费率，投资人在 1 天之内如果有多笔申购，适用按单笔分别计算，费率表如下：

| 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

申购费用由基金申购人承担，用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

## 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。费率表如下：

| 持有基金份额期限    | 赎回费率  |
|-------------|-------|
| 365天以内      | 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:

$$\text{转出金额} = \text{转出份额} \times \text{转出基金当日基金份额净值}$$
$$\text{转出基金赎回费} = \text{转出金额} \times \text{转出基金赎回费率}$$
$$\text{申购补差费} = (\text{转出金额} - \text{转出基金赎回费}) \times \text{申购补差费率} / (1 + \text{申购补差费率})$$
$$\text{转换费用} = \text{转出基金赎回费} + \text{申购补差费}$$

(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两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。更换会计师事务所应在两日内公告。

## 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。

### 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) 终止基金合同;
- (3) 转换基金运作方式;
- (4) 更换基金管理人、基金托管人;
- (5) 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更;
- (6) 基金管理人股东及其出资比例发生变更;
- (7) 基金管理人的董事长、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;
- (8) 基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十;
- (9) 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;
- (10) 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼;
- (11) 基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查;
- (12) 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;
- (13) 重大关联交易事项;
- (14) 基金收益分配事项;

- ( 15 ) 管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- ( 16 ) 基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；
- ( 17 ) 基金改聘会计师事务所；
- ( 18 ) 变更基金份额发售机构；
- ( 19 ) 基金更换注册登记机构；
- ( 20 ) 基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- ( 21 ) 基金发生巨额赎回并延期支付；
- ( 22 ) 基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- ( 23 ) 基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- ( 24 ) 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)市场风险

本基金主要投资于证券市场，而证券市场价格受政治、经济、投资心理和交易制度等各种因素的影响会产生波动，从而对本基金资产构成潜在风险，导致基金收益水平发生波动。

市场风险主要包括：

#### 1、政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家宏观经济政策的变化对证券市场产生一定影响，从而导致市场价格波动，影响基金收益而产生的风险。

#### 2、经济周期风险

证券市场是国民经济的晴雨表，而经济运行则具有周期性的特点。随宏观经济运行的周期性变化，基金所投资于国债与上市公司股票的收益水平也会随之变化，从而产生风险。

#### 3、利率风险

金融市场利率的变化直接影响着债券的价格和收益率，同时也影响到证券市场资金供求关系，并在一定程度上影响上市公司的盈利水平，上述变化将直接影响本基金的收益。

#### 4、上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等都会导致公司盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格

可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，从而使基金投资收益下降。虽然基金可以通过投资多样化分散这种非系统性风险，但不能完全规避。

#### 5、购买力风险

基金收益的一部分将通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而使购买力下降，从而使基金的实际投资收益下降。

### (二)管理风险

1、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以及对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平；

2、本基金管理人和基金托管人的管理手段和管理技术等因素的变化也会影响基金收益水平。

3、因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；

4、对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；

### (三)流动性风险

1、本基金类型为契约型开放式，基金规模将随着基金投资者对基金份额的申购和赎回而不断波动，若由于基金投资者的连续大量赎回，导致基金管理人的现金支付出现困难，或被迫在不适当的价格大量抛售股票债券，使基金资产净值受到不利影响。

2、基金投资组合的证券可能会因为各种原因使交易的执行难度提高，买入成本或变现成本增加。

### (四)特定风险

由于本基金为基础行业基金，根据基金合同规定 80%以上的股票资产要投资于特定的行业(基础行业)。可能会导致持仓组合中行业相对集中，如果基础行业出现较大波动，对基金的收益会有一定的影响。

### (五)其他风险

1、因技术因素而产生的风险，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投资者的利益受到影响。这种技术可能来自基金管理公司、注册登记机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等；

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、因业务竞争压力可能产生的风险；

4、战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金财产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险；

5、其他意外导致的风险。

## 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，否则基金管理人对于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. 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金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值低于 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，保存基金的会计账册、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主持人共同担任监票人;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：王文学

成立时间：2003年3月14日

注册资本：人民币1亿元

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

住所：北京市西城区太平桥大街25号光大中心

法定代表人：唐双宁

注册资本：282.1689亿元人民币

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。基金管理人对于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，则托管人应相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代销机构的代销网点办理申购、赎回、信息查询等业务外，还可通过基金管理人网站（[www.msfunds.com.cn](http://www.msfunds.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代销机构的代销网点查询基金持有情况之外,还可通过基金账号或者身份证号码和查询密码登陆基金管理人网站(www.msfnunds.com.cn)“客户查询”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）资料的寄送服务

- 1、每次交易结束后,投资人可在 T+2 日后通过销售机构的网点查询和打印确认单;
- 2、基金管理人在获取准确的邮政地址和邮政编码的前提下,每季度结束后 15 个工作日内,向本季度内有交易的投资人寄送纸质对账单;
- 3、每年度结束后 20 个工作日内,基金管理人向所有持有本基金份额的投资人寄送纸质年度对账单;
- 4、基金投资人可根据个人需要,通过基金管理人客服电话、网站、电子邮件等方式取消或恢复对账单寄送服务。

## （四）免费信息定制服务

投资人可通过拨打电话、发送邮件等方式免费定制信息,基金管理人可通过邮件等方式向投资人发送所定制的信息。可定制的信息包括:基金份额净值、基金交易确认、电子账单、基金视窗、基金理财刊物、基金公告等信息。

## （五）在线客服服务

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

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

## （六）客户服务中心电话服务

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

服务等信息查询。

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

**(七) 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。

**(八) 服务联系方式**

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

客服电子信箱：[services@msfunds.com.cn](mailto:services@msfunds.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 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|---|------|--------|--------|
|---|------|--------|--------|

| 号  |                                           |                                       |            |
|----|-------------------------------------------|---------------------------------------|------------|
| 1  | 本基金 2011 年 3 季度报告                         | 《证券时报》                                | 2011-10-24 |
| 2  | 本公司关于旗下基金增加河北银行为<br>代销机构的公告               | 《中国证券报》、《上海<br>证券报》、《证券时报》            | 2011-10-25 |
| 3  | 本公司关于旗下基金增加东莞证券为<br>代销机构的公告               | 《中国证券报》、《上海<br>证券报》、《证券时报》            | 2011-10-27 |
| 4  | 关于平安银行暂停办理本公司旗下基<br>金交易业务的公告              | 《中国证券报》、《上海<br>证券报》、《证券时报》            | 2011-11-03 |
| 5  | 本基金招募说明书（更新）（2011 年<br>第 2 号）             | 《证券时报》                                | 2011-11-09 |
| 6  | 本公司关于旗下基金在中信万通证券<br>开通定期定额投资业务的公告         | 《中国证券报》、《上海<br>证券报》、《证券时报》            | 2011-12-05 |
| 7  | 关于华泰联合证券有限责任公司停止<br>代理本公司旗下基金销售业务的公告      | 《中国证券报》、《上海<br>证券报》、《证券时报》            | 2011-12-26 |
| 8  | 本公司关于上海分公司注册地址变更<br>的公告                   | 《中国证券报》、《上海<br>证券报》、《证券时报》            | 2011-12-28 |
| 9  | 本公司关于旗下部分基金在天相投资<br>顾问有限公司开通基金转换业务的公<br>告 | 《中国证券报》、《上海<br>证券报》、《证券时报》            | 2011-12-29 |
| 10 | 本公司关于旗下基金增加万和证券为<br>代销机构的公告               | 《中国证券报》、《上海<br>证券报》、《证券时报》、<br>《证券日报》 | 2012-01-04 |

|    |                                    |                                   |            |
|----|------------------------------------|-----------------------------------|------------|
| 11 | 本基金基金经理变更公告                        | 《证券时报》                            | 2012-01-09 |
| 12 | 本公司以通讯方式召开本基金基金份额持有人大会的公告          | 《证券时报》                            | 2012-01-09 |
| 13 | 关于以通讯方式召开本基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告     | 《证券时报》                            | 2012-01-10 |
| 14 | 关于以通讯方式召开本基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告     | 《证券时报》                            | 2012-01-11 |
| 15 | 本公司关于旗下部分基金增加中信证券(浙江)为代销机构的公告      | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、<br>《证券日报》 | 2012-01-11 |
| 16 | 本公司关于相关媒体报道的澄清公告                   | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》            | 2012-01-17 |
| 17 | 本基金 2011 年 4 季度报告                  | 《证券时报》                            | 2012-01-20 |
| 18 | 本公司关于旗下基金增加东方证券为代销机构并参与申购费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》            | 2012-02-07 |
| 19 | 关于本基金基金份额持有人大会表决结果的公告              | 《证券时报》                            | 2012-02-15 |
| 20 | 本公司关于中国银行直销账户银行账户信息变更的公告           | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》            | 2012-02-23 |
| 21 | 关于本公司对旗下部分基金持有的 09                 | 《中国证券报》、《上海                       | 2012-02-28 |

|    |                    |             |            |
|----|--------------------|-------------|------------|
|    | 广汇债进行估值调整的公告       | 证券报》、《证券时报》 |            |
| 22 | 本基金基金份额持有人大会决议生效公告 | 《证券时报》      | 2012-03-09 |
| 23 | 本基金 2011 年年度报告     | 《证券时报》      | 2012-03-26 |

#### 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

二〇一二年五月九日