

摩根士丹利华鑫量化配置混合型  
证券投资基金  
招募说明书(更新)  
(2019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：中国农业银行股份有限公司

## 【重要提示】

摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2012 年 9 月 18 日经中国证券监督管理委员会证监许可【2012】1238 号文核准募集。本基金的基金合同于 2012 年 12 月 11 日正式生效。本基金为契约型开放式基金。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。

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

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

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

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

基金分为股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金等不同类型，投资人投资不同类型的基金将获得不同的收益预期，也将承担不同程度的风险。一般来说，基金的收益预期越高，投资人承担的风险也越大。本基金为混合型基金，理论上其长期平均风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》（证监会令第 104 号）及其配套规定的有关要求及本基金基金合同的有关规定，经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，自 2015 年 8 月 7 日起，本基金的基金名称变更为“摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资基金”，基金简称变更为“大摩量化配置混合”。上述更名不改变基金投资范围，对基金份额持有人利益无实质性不利影响，并已履行了规定的程序，符合相关法律法规及基金合同的规定。有关详细信息参见本公司于 2015 年 7 月 22 日发布的《摩根士丹利华鑫基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金更名的公告》。

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

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

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

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

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

本招募说明书（更新）所载内容截止日为 2019 年 6 月 11 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2019 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。

## 目 录

一、绪言.....	4
二、释义.....	5
三、基金管理人.....	8
四、基金托管人.....	17
五、相关服务机构.....	19
六、基金的募集.....	44
七、基金合同的生效.....	44
八、基金份额的申购、赎回与转换.....	44
九、基金的投资.....	53
十、基金的业绩.....	66
十一、基金的财产.....	67
十二、基金资产的估值.....	68
十三、基金的收益与分配.....	71
十四、基金的费用与税收.....	72
十五、基金的会计与审计.....	74
十六、基金的信息披露.....	74
十七、风险揭示.....	79
十八、基金的终止与清算.....	87
十九、基金合同的内容摘要.....	89
二十、基金托管协议内容摘要.....	101
二十一、对基金份额持有人的服务.....	115
二十二、其他应披露事项.....	117
二十三、招募说明书的存放及查阅方式.....	118
二十四、备查文件.....	118

## 一、绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性规定》”）和其他有关法律法规的规定，以及《摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

本招募说明书阐述了摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

本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。本招募说明书由摩根士丹利华鑫基金管理有限公司解释。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，或对本招募说明书做出任何解释或者说明。

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合同当事人之间权利、义务关系的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同当事人，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

本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资基金
- 2、基金管理人：指摩根士丹利华鑫基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指中国农业银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资基金基金合同》及对该基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书或本招募说明书：指《摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新
- 7、基金份额发售公告：指《摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资基金基金份额发售公告》
- 8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 9、《基金法》：指《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 10、《销售办法》：指《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《信息披露办法》：指《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《运作办法》：指《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 13、《流动性规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订
- 14、中国证监会：指中国证券监督管理委员会
- 15、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会
- 16、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

- 17、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人
- 18、机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织
- 19、合格境外机构投资者：指符合现行有效的相关法律法规规定可以投资于中国境内证券市场的中国境外的机构投资者
- 20、投资人：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称
- 21、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人
- 22、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务
- 23、销售机构：指摩根士丹利华鑫基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构
- 24、登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等
- 25、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构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登记业务的机构
- 26、基金账户：指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户
- 27、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构买卖基金的基金份额变动及结余情况的账户
- 28、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期
- 29、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期
- 30、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过 3 个月
- 31、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

32、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

33、T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

34、T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)

35、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

36、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

37、《业务规则》：指《摩根士丹利华鑫基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守

38、认购：指在基金募集期内，投资人申请购买基金份额的行为

39、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

40、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

41、基金转换：指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为

42、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作

43、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式

44、巨额赎回：指本基金单个开放日，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余额)超过上一开放日基金总份额的10%

45、元：指人民币元

46、基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

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



48、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

49、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

50、基金资产估值：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

51、指定媒体：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体

52、不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

53、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等

### 三、基金管理人

#### （一）基金管理人概况

名称：摩根士丹利华鑫基金管理有限公司

注册地址：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：22,750 万元人民币

联系人：赵婧

联系电话：（0755）88318883

股权结构应为：华鑫证券有限责任公司（39.560%）、摩根士丹利国际控股公司（37.363%）、深圳市招融投资控股有限公司（10.989%）、深圳市基石创业投资有限公司（6.593%）、深圳市中技实业（集团）有限公司（5.495%）。

#### （二）主要人员情况

##### 1、董事会成员

于华先生，北京大学经济学学士，鲁汶大学工商管理硕士、金融博士，美国注册金融分

析师（CFA）。曾任深圳证券交易所综合研究所所长，加拿大鲍尔集团亚太分公司基金与保险业务副总裁，加拿大伦敦人寿保险公司北京代表处首席代表，大成基金管理有限公司董事、总经理，摩根士丹利亚洲有限公司董事总经理、中国投资管理业务主管，摩根士丹利华鑫基金管理有限公司总经理。现任本公司董事长。

期后事项：

周熙先生自 2019 年 6 月 14 日起担任本公司董事长，于华先生自 2019 年 6 月 14 日起不再担任本公司董事长，上述事项已经本公司第六届董事会第十二次会议审议通过，并已按有关规定向深圳证监局备案。根据法律法规的规定，公司已于 2019 年 6 月 15 日公告上述事项。

周熙先生简历：

周熙先生，上海交通大学理学学士，美国密西根大学安娜堡分校电子工程硕士及工商管理硕士。曾任职于中国联合网络通信集团有限公司上海分公司、爱立信（中国）通信有限公司上海分公司、Ericsson Wireless Communications Inc.、高盛高华证券有限责任公司。2008 年加入摩根士丹利亚洲有限公司北京代表处，历任副总裁、投资银行部执行董事、北京代表处首席代表等职务，2011 年起至今任职于摩根士丹利（中国）股权投资管理有限公司，历任执行董事，目前担任董事总经理。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、东海证券有限责任公司常州地区中心营业部总经理兼延陵中路营业部总经理、华鑫证券有限责任公司总裁助理、华鑫证券有限责任公司副总裁、华鑫证券有限责任公司总裁、党委副书记、董事、华鑫证券投资有限公司董事长、华鑫期货有限公司董事。目前担任华鑫证券有限责任公司董事长、法定代表人，上海华鑫股份有限公司总经理。现任本公司副董事长。

田明先生，上海交通大学学士、香港中文大学专业会计学硕士。曾任上海广电（集团）有限公司财务经济部主管、上海广电电子股份有限公司财务会计部经理、上海广电信息产业股份有限公司总会计师、上海华鑫股份有限公司总会计师、华鑫证券有限责任公司财务副总监、总监、财务负责人。2017 年 5 月至今任上海华鑫股份有限公司总会计师。现任本公司董事。

孙辰健先生，西安交通大学工业自动化专业学士、西安交通大学经济金融学院产业经济学博士研究生。曾先后担任兰州炼油化工总厂自动化研究所职员、深圳证券交易所电脑工程部业务主任、深圳证券交易所交易运行部副经理、深圳证券交易所西北中心主任、深圳证券通信公司董事、总经理、深圳证券交易所信息管理部总监、中国证券登记结算有限责任公司北京数据技术分公司副总经理和中证信息技术服务有限责任公司党委委员、副总经理、华鑫证券有限责任公司副总经理，华鑫证券投资有限公司法定代表人、董事长。目前担任华鑫证券有限责任公司监事会主席，华鑫宽众投资有限公司法定代表人、董事长。现任本公司董事。

高杰文（Todd Coltman）先生，加利福尼亚州立大学通讯专业学士和硕士，乔治敦大学法学博士。曾在年利达律师事务所（Linklaters）伦敦、香港和东京办公室以及众达律师事务所（Jones Day）的东京办公室担任律师。2004年加入摩根士丹利，负责亚洲地区不动产投资（REI）业务的不动产收购融资。2007年至2009年担任日本REI业务运营总监，自2016年起至今担任摩根士丹利亚洲所有投资管理业务运营总监。目前担任摩根士丹利商务咨询（上海）有限公司董事、摩根士丹利资产服务咨询（中国）有限公司董事、Morgan Stanley Investment Management Private Limited（成立于印度）董事、Morgan Stanley Properties Advisory Corp. Limited（成立于开曼群岛）董事、MSP China Holdings Limited（成立于开曼群岛）董事。现任本公司董事。

侯杰明（Jeremy Alton Huff）先生，杜克大学文学学士，哈佛大学法学博士。曾任美国世达律师事务所律师、NBA中国法律副总监、NBA中国品牌娱乐的副总裁。2017年3月至今任摩根士丹利董事总经理并担任中国首席运营官。目前担任摩根士丹利国际银行（中国）有限公司董事、摩根士丹利商贸（中国）有限公司董事、摩根士丹利管理服务（上海）有限公司董事，摩根士丹利（中国）股权投资管理有限公司监事、摩根士丹利华鑫证券有限责任公司监事，摩根士丹利亚洲有限公司北京代表处普通代表。现任本公司董事。

王鸿嫔女士，台湾国立清华大学法学学士。曾任钱杂志记者，康和证券投资顾问公司研究员，怡富证券投资顾问公司研究员、协理，怡富证券投资信托有限公司副总经理，怡富证券投资顾问公司总经理，上投摩根基金管理有限公司总经理，上海富汇财富投资管理股份有限公司董事长兼总经理等。现任本公司董事、总经理。

彭磊女士，西南财经大学经济学学士，北京大学经济学硕士。曾任中国南山开发集团金融投资部主管，深圳经济特区证券公司资产管理部，友联资产管理公司执行董事，招商局金融集团有限公司综合管理部副总经理、审计稽核部总经理、中国业务部总经理、证券部总经理，招商局金融集团有限公司总经理助理。2016年4月至今任招商局金融集团有限公司副总经理。现任本公司董事。

贾丽娜女士，东北财经大学商业经济系学士、东北财经大学商业经济系硕士。曾于金陵科技学院任教，1994年8月至今2017年11月任天衡会计师事务所注册会计师、高级合伙人，2017年11月起至今任中天运会计师事务所（特殊普通合伙）担任合伙人，目前兼任俊知集团有限公司独立董事、倍加洁集团股份有限公司、江苏林洋能源股份有限公司和厦门特宝生物工程股份有限公司独立董事。现任本公司独立董事。

彭章键先生，中国人民大学法学硕士。曾任职于海南省高级人民法院、广东信达律师事务所。2008年至今担任北京市中银（深圳）律师事务所合伙人，兼任华南经济贸易仲裁委员会和深圳仲裁委员会仲裁员，广东省知识产权局入库专家。现任本公司独立董事。

苗复春先生，中国人民大学经济学硕士。2007年5月至今任中国人寿养老保险公司顾

问。曾任内蒙古商业局计委科长，中国社科院技术经济研究所助理研究员，国务院技术经济研究中心研究员，国务院办公厅副局长，外经贸部办公厅主任，中央财经领导小组办公室局长，中国人寿保险公司副总经理，中国人寿保险股份有限公司执行董事、执行副总裁，中国人寿保险集团公司党委副书记、副总裁，退休后曾任中国人寿养老保险公司顾问，兼任中国生产力学会副会长。现任本公司独立董事。

Paul M. Theil 先生，耶鲁大学东亚研究学士、硕士，哈佛大学商学院工商管理硕士（MBA）、法学院法律博士（JD）。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。目前担任中安信业董事长，深圳市中安信业创业投资有限公司董事长，Moshi Industrial Development (Shenzhen) Co., Ltd 法定代表人，亚太健康集团董事长，深圳市中银富登村镇银行董事，润晖资产管理有限公司董事，兴业银行独立董事，亲亲食品集团董事，深圳市小额贷款行业协会会长，中国小额贷款公司协会副会长，深圳市创业投资同业公会副会长、深圳市商业联合会常务副会长。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、华鑫证券有限责任公司副总裁。目前担任上海华鑫股份有限公司副总经理兼任华鑫期货有限公司董事长、华鑫思佰益融资租赁（上海）有限公司董事长。现任本公司监事长。

莫壮伟（Tuangwei Mok）先生，加州大学伯克利分校学士、加州大学伯克利分校哈斯商学院硕士。曾经在瓦乔维亚证券负责发行结构化和证券化产品，并在安永会计师事务所提供企业融资咨询服务。2010年9月加入摩根士丹利亚太区的市场风险团队。2014年加入摩根士丹利风险投资管理团队，目前担任摩根士丹利投资风险管理的执行董事。现任本公司监事。

王章为先生，东北财经大学学士，南澳大学工商管理硕士，中国注册会计师、国际注册内部审计师。曾任深圳三九集团会计、深圳中华会计师事务所项目经理、招商局蛇口控股股份有限公司审计部经理、招商局科技集团有限公司财务部经理、招商局集团有限公司审计部高级经理、招商局金融集团有限公司财务部总经理。2016年5月起担任招商局金融集团有限公司总经理助理。现任本公司监事。

赵婧女士，英国雷丁大学国际证券投资及银行学理学学士、英国诺丁汉大学风险管理硕士。曾任信诚人寿保险公司管理培训生、广州英国文化教育处财务官员。2007年加入本公司，目前担任本公司助理总经理兼任综合管理部总监、产品规划部总监、上海分公司总经理。现任职工监事。

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，目前担任本公司市场发展部总监。现任职工监事。

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，目前担任本公司专户理财部总监。现任职工监事。

谢先斌先生，浙江大学计算科学与工程学专业学士，上海交通大学安泰经济与管理工商管理专业硕士。曾任中国移动（深圳）有限公司软件工程师，及招商基金管理有限公司信息技术部业务经理，基金事务部业务经理、高级经理、首席注册登记师。2011年5月加入本公司，曾任基金运营部副总监，目前担任基金运营部总监。现任职工监事。

### 3、公司高级管理人员

于华先生，董事长，简历同上。

期后事项：

周熙先生自2019年6月14日起担任本公司董事长，于华先生自2019年6月14日起不再担任本公司董事长，上述事项已经本公司第六届董事会第十二次会议审议通过，并已按有关规定向深圳证监局备案。根据法律法规的规定，公司已于2019年6月15日公告上述事项。

周熙先生，董事长，简历同上。

王鸿嫔女士，总经理，简历同上。

李锦女士，哥伦比亚大学、伦敦商学院和香港大学联合授予工商管理学硕士、吉林大学经济管理学院国际金融专业硕士，22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，曾任基金运营部副总监、总监，总经理助理，督察长。现任本公司副总经理。

许菲菲女士，中南财经大学国际会计专业学士，17年证券基金行业工作经历。曾任深圳市华新股份有限公司会计，宝盈基金管理有限公司基金会计。2005年6月加入本公司，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、总监。现任本公司督察长。

### 4、本基金基金经理

夏青先生，美国马里兰大学金融数学博士，13年证券从业经历。曾任美国摩根士丹利机构证券部副总裁，美国芝加哥交易对冲基金投资经理，美国斯考特交易对冲基金投资经理，万向资源有限公司量化投资部总经理，东吴证券股份有限公司投资总部董事总经理。2016年7月加入本公司，现任数量化投资部总监、组合投资部总监、基金经理。2017年6月起

担任摩根士丹利华鑫多因子精选策略混合型证券投资基金、摩根士丹利华鑫量化多策略股票型证券投资基金和本基金基金经理，2017年12月至2018年12月担任摩根士丹利华鑫新趋势灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018年5月起担任摩根士丹利华鑫深证300指数增强型证券投资基金、摩根士丹利华鑫睿成中小盘弹性股票型证券投资基金基金经理。

陈健夫先生，美国南加州大学应用数学博士，9年证券从业经历。曾任美国联合银行量化分析师，美国汇丰证券高级量化分析师，阳光资产管理有限公司高级量化研究员。2018年7月加入本公司，现任数量化投资部基金经理。2018年8月起担任本基金和摩根士丹利华鑫睿成中小盘弹性股票型证券投资基金基金经理。

本基金历任基金经理：张靖先生，自本基金合同生效日起至2014年1月管理本基金。刘钊先生，自2014年1月至2015年8月管理本基金。杨雨龙先生，自2015年7月至2017年6月管理本基金。吴国雄先生，自2016年6月至2018年6月管理本基金。

#### 5、投资决策委员会成员

主任委员：何晓春，助理总监经理、权益投资部总监、基金经理。

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

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

秘书：王大鹏，研究管理部总监、基金经理。

#### 6、上述人员之间不存在近亲属关系。

#### （三）基金管理人的职责

- 1、依法募集基金，办理基金份额的发售、申购、赎回、转换和登记事宜；
- 2、办理基金备案手续；
- 3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；
- 4、按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基金收益；
- 5、进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；
- 6、编制季度、半年度和年度基金报告；
- 7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- 8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、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实施其他法律行为；
- 12、有关法律法规、中国证监会规定的和基金合同约定的其他职责。

#### （四）基金管理人的承诺

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

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

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

- （1）承销证券；
- （2）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）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；
- （6）法律法规、中国证监会及基金合同禁止的其他活动。

上述禁止行为为引用当时有效的相关法律法规或监管部门的有关禁止性规定，如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

4、基金管理人承诺严格遵守法律法规，禁止发生下列行为：

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

5、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下行为：

- （1）越权或违规经营；

- (2) 违反基金合同或托管协议；
- (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益；
- (4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- (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) 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) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (10) 其他法律法规、中国证监会及基金合同禁止的行为。

## 6、基金经理承诺

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

### 1、内部控制目标

- (1) 保证基金管理人的经营运作严格遵守法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念；
- (2) 防范和化解经营风险，提高经营管理效益，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，实现基金管理人的持续、稳定、健康发展；
- (3) 确保基金、基金管理人应披露的信息真实、准确、完整、及时；
- (4) 确保基金管理人成为一个决策科学、经营规范、管理高效、运作安全的持续、稳定、健康发展的基金管理公司。



## 2、内部控制原则

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

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

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

(4) 相互制约原则。基金管理人内部部门和岗位的设置须权责分明、相互制衡。

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

## 3、内部控制体系

基金管理人的内部控制体系结构是一个分工明确、相互制约的组织结构，具体包括：

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

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

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

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

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

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

(7) 各业务部门及员工对风险管理负有直接责任。各业务部门负责人在权限范围内，执行公司的各项风险管理程序，负责本部门业务风险的识别、监控，对本部门的风险管理负全部责任。每一位员工均负有一线风险控制职责，负责把公司的风险管理理念和控制措施落

实到每一个业务环节当中，并在发现风险隐患和问题时负有报告、反馈和改进的义务。

#### 4、内部控制措施

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

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

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

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

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

#### 5、基金管理人关于内部控制制度的声明

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

(2) 本基金管理人承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；

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

## 四、基金托管人

### (一) 基金托管人情况

#### 1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：周慕冰

成立日期：2009年1月15日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23号

注册资本：32,479,411.7万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：贺倩

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京。经国务院批准,中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月15日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡,成为国内网点最多、业务辐射范围最广,服务领域最广,服务对象最多,业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外,中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉,每年位居《财富》世界500强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行,中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念,坚持审慎稳健经营、可持续发展,立足县域和城市两大市场,实施差异化竞争策略,着力打造“伴你成长”服务品牌,依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品,致力为广大客户提供优质的金融服务,与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行,经验丰富,服务优质,业绩突出,2004年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007年中国农业银行通过了美国SAS70内部控制审计,并获得无保留意见的SAS70审计报告。自2010年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准(ISA3402)认证,表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设,品牌声誉进一步提升,在2010年首届“‘金牌理财’TOP10颁奖盛典”中成绩突出,获“最佳托管银行”奖。2010年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。2012年荣获第十届中国财经风云榜“最佳资产托管银行”称号;2013年至2017年连续荣获上海清算所授予的“托管银行优秀奖”和中央国债登记结算有限责任公司授予的“优秀托管机构奖”称号;2015年、2016年荣获中国银行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号;2018年荣获中国基金报授予的公募基金20年“最佳基金托管银行”奖。

中国农业银行证券投资基金托管部于1998年5月经中国证监会和中国人民银行批准成立,2014年更名为托管业务部/养老金管理中心,内设综合管理部、业务管理部、客户一部、客户二部、客户三部、客户四部、风险合规部、产品研发与信息技术部、营运一部、营运二部、市场营销部、内控监管部、账户管理部,拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

## 2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工近240名,其中具有高级职称的专家30余名,服务

团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

### 3、基金托管业务经营情况

截止到 2019 年 3 月 31 日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共 440 只。

## （二）基金托管人的内部控制制度

### 1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

### 2、内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作，对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，独立行使监督稽核职权。

### 3、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理实行严格的复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

## （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

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统，每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作，并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时，基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理：

1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题，电话提示基金管理人；

2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题，以书面方式对基金管理人进行提示；

3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为，书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

## 五、相关服务机构

### （一）基金份额销售机构

#### 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

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

联系人：时亚蒙

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

注册地址：北京市西城区太平桥大街18号丰融国际大厦1005室

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

注册地址：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

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1000号恒生银行大厦45楼011-111单元

联系人：朱冰楚

电话：(021) 63343311-2100

传真：(021) 50429808

## (4) 摩根士丹利华鑫基金管理有限公司网上直销系统

交易系统网址：<https://etrade.msfnfunds.com.cn/etrading>

目前已开通工商银行、建设银行、农业银行、招商银行、银联通、快付通等支付渠道以及基金汇款交易业务。支持银联通渠道、快付通渠道支付的银行卡详见本公司官方网站 (<http://www.msfnfunds.com.cn>)。以上支付渠道支持的银行卡均指银行借记卡，信用卡等贷记卡不支持购买基金。

全国统一客服电话：400-8888-668

客户服务信箱：[Services@msfnfunds.com.cn](mailto:Services@msfnfunds.com.cn)

深圳、北京或上海的投资人单笔申购金额超过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、其他销售机构

## (1) 中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街69号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：周慕冰

客户服务电话：95599

网址：www.abchina.com

(2) 中国建设银行股份有限公司

注册（办公）地址：北京市西城区金融大街 25 号

法定代表人：田国立

客户服务电话：95533

网址：www.ccb.com

(3) 中国工商银行股份有限公司

注册（办公）地址：中国北京复兴门内大街 55 号

法定代表人：易会满

客户服务电话：95588（全国）

网址：www.icbc.com.cn

(4) 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：彭纯

联系人：王菁

联系电话：021-58781234

传真：021-58408483

客户服务电话：95559

网址：www.bankcomm.com

(5) 招商银行股份有限公司

注册（办公）地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：李建红

客户服务电话：95555

网址：www.cmbchina.com

(6) 中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 9 号文化大厦

法定代表人：李庆萍

客户服务电话：95558

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

(7) 中国民生银行股份有限公司

注册（办公）地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：洪崎

联系人：穆婷

联系电话：010-58560666

客户服务热线：95568

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

(8) 平安银行股份有限公司

注册（办公）地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

法定代表人：谢永林

联系人：施艺帆

联系电话：021-50979384

客户服务电话：95511-3

网址：[www.bank.pingan.com](http://www.bank.pingan.com)

(9) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

客户服务热线：95528

公司网站：[www.spdb.com.cn](http://www.spdb.com.cn)

(10) 兴业银行股份有限公司

注册（办公）地址：福建省福州市湖东路 154 号中山大厦

法定代表人：高建平

联系人：张磊

联系电话：021-52629999-218931

客户服务电话：95561

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

(11) 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

(12) 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

(13) 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

(14) 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

(15) 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



## (16) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：魏明

联系电话：（010）85130588

客户服务电话：4008888108

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

## (17) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

法定代表人：陈共炎

联系人：邓颜

联系电话：010-66568292

客户服务电话：4008-888-888 或 95551

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

## (18) 信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

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

联系人：尹旭航

联系电话：（010）63081000

客户服务电话：95321

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

## (19) 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>

## (20) 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

(21) 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

(22) 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

(23) 光大证券股份有限公司

注册（办公）地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

联系人：刘晨、李芳芳

联系电话：（021）22169999

客户服务电话：400-8888-788、10108998

网址：www.ebscn.com

(24) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

办公地址：上海市浦东新区长柳路 36 号

法定代表人：杨华辉

联系人：乔琳雪

联系电话：021-38565547

客户服务电话：95562

网址：www.xyzq.com.cn

(25) 长江证券股份有限公司

注册（办公）地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：尤习贵

联系人：奚博宇

联系电话：（027）65799999

客户服务电话：95579 或 4008-888-999

网址：www.95579.com

(26) 东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层、23 层、25 层-29 层

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

法定代表人：潘鑫军

联系人：孔亚楠

联系电话：021-63325888

客户服务电话：95503

网址：www.dfzq.com.cn

(27) 华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场

法定代表人：周易

联系人：庞晓芸

联系电话：（0755）82492193

客户服务电话：95597

网址：www.htsc.com.cn

(28) 中泰证券股份有限公司

注册（办公）地址：济南市经七路 86 号

法定代表人：李玮

联系人：王霖

联系电话：（0531）68889157

客户服务电话：95538

网址：www.zts.com.cn

（29） 中信证券（山东）有限责任公司

注册（办公）地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

法定代表人：杨宝林

联系人：孙秋月

联系电话：（0532）85022026

客户服务电话：95548

公司网址：www.citicssd.com

（30） 山西证券股份有限公司

注册（办公）地址：太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

联系人：郭熠

联系电话：（0351）8686659

客户服务电话：400-666-1618

网址：www.i618.com.cn

（31） 华龙证券股份有限公司

注册（办公）地址：甘肃省兰州市东岗西路 638 号财富大厦

法定代表人：李晓安

联系人：李昕田

联系电话：0931-8784656

客户服务电话：400-689-8888

网址：www.hlzqgs.com

（32） 东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：赵俊

联系人：王一彦

联系电话：021-20333333

客户服务电话：95531；400-8888-588

网址：www.longone.com.cn

（33） 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：95330

网址：www.dwzq.com.cn

（34） 方正证券股份有限公司

注册（办公）地址：湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层

法定代表人：何其聪

联系人：高利

联系电话：0731-85832507

客户服务电话：95571

网址：www.foundersc.com

（35） 宏信证券有限责任公司

注册（办公）地址：四川省成都市人民南路二段18号川信大厦10楼

法定代表人：吴玉明

联系人：刘进海

联系电话：028-86199278

客户服务电话：4008-366-366

网址：www.hxzq.cn

（36） 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

(37) 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

(38) 招商证券股份有限公司

注册（办公）地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人：霍达

联系人：黄婵君

联系电话：0755-82943666

客户服务热线：95565、400-8888-111

网址：www.newone.com.cn

(39) 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

(40) 平安证券股份有限公司

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：詹露阳

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](http://stock.pingan.com)

(41) 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](http://www.ghzq.com.cn)

(42) 华西证券股份有限公司

注册(办公)地址: 四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

法定代表人: 杨炯洋

联系人: 谢国梅

联系电话: 010-52723273

客户服务热线: 95584

网址: [www.hx168.com.cn](http://www.hx168.com.cn)

(43) 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](http://www.cgws.com)

(44) 万和证券有限责任公司

注册地址: 海南省海口市南沙路 49 号通讯广场二楼

办公地址: 深圳市福田区深南大道 7028 号时代科技大厦 20 楼西

法定代表人: 朱治理

联系人: 周小钰

联系电话: 0755-88694888-857

客户服务电话: 4008-882-882

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

## (45) 广发证券股份有限公司

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

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

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

联系电话：（020）87555888

客户服务电话：95575

网址：www.gf.com.cn

## (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) 申万宏源西部证券有限公司

注册（办公）地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

法定代表人：李季

联系人：王怀春

联系电话：0991-2307105

客户服务热线：4008-000-562



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

(49) 国金证券股份有限公司

注册（办公）地址：成都市青羊区东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

联系人：杜晶、贾鹏

联系电话：028-86690057、028-86690058

客户服务热线：95310

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

(50) 中国民族证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼

办公地址：北京市朝阳区北四环中路盘古大观 40 层-43 层

法定代表人：何亚刚

联系人：齐冬妮

联系电话：010-59355807

客户服务电话：40088-95618

网址：[www.e5618.com](http://www.e5618.com)

(51) 中国国际金融股份有限公司

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

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 6 层

法定代表人：丁学东

联系人：任敏、陈曦

联系电话：010-65051166

客户服务热线：010-65051166

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

(52) 上海证券有限责任公司

注册（办公）地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

法定代表人：李俊杰

联系电话：021-53686888

客户服务电话：021-962518

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

(53) 中信期货有限公司

注册(办公)地址:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层

法定代表人:张皓

联系人:刘宏莹

联系电话:010-60833754

客户服务电话:400-990-8826

网址:www.citicsf.com

(54) 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

(55) 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:licaikexun.com

(56) 深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元

办公地址:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼

法定代表人:薛峰

联系人:童彩平

联系电话:(0755)33227950

客户服务电话:4006-788-887

网址:众禄基金网 www.zlfund.cn

基金买卖网 www.jjmmw.com

## (57) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室

办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F

法定代表人：陈柏青

联系人：韩爱彬

联系电话：0571-26888888-37494

客户服务电话：4000-766-123

网址：www.fund123.cn

## (58) 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>

## (59) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

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

法定代表人：杨文斌

联系人：张茹

联系电话：021-20613999

客户服务电话：400-700-9665

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

## (60) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

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

法定代表人：其实

联系人：黄妮娟

联系电话：021-54509998

客户服务电话：400-1818-188

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

(61) 上海长量基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层

法定代表人：张跃伟

联系人：沈雯斌

联系电话：021-58788678-8201

客户服务电话：400-820-2899

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

(62) 诺亚正行基金销售有限公司

注册地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室

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

法定代表人：汪静波

联系人：方成

联系电话：021-38602377

客户服务电话：400-821-5399

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

(63) 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>

(64) 宜信普泽（北京）基金销售有限公司

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

法定代表人：戎兵

联系人：王巨明

联系电话：010-52855650

客户服务电话：400-6099-200

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

(65) 中期资产管理有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路16号1幢11层

办公地址：北京市朝阳区建国门外光华路16号1幢2层

法定代表人：路瑶

联系人：侯英建

联系电话：010-65807865

客户服务电话：010-65807609

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

(66) 北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号

办公地址：北京市朝阳区华严北里2号民建大厦6层

法定代表人：闫振杰

联系人：马林

联系电话：010-62020088-7024

客户服务电话：4008188000

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

(67) 中国国际期货股份有限公司

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](http://www.cifco.net)

(68) 北京创金启富基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A

办公地址：北京市西城区白纸坊东街2号经济日报社A座综合楼712号

法定代表人：梁蓉

联系人：张旭

联系电话：010-66154828

客户服务电话：400-6262-818

网址：www.5irich.com

(69) 上海汇付基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区中山南路 100 号 19 层

办公地址：上海市宜山路 700 号普天信息产业园 2 期 C5 栋汇付天下总部大楼 2 楼

法定代表人：冯修敏

联系人：陈云卉

联系电话：021-33323999-5611

客户服务电话：400-820-2819

网址：fund.bundtrade.com

(70) 上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：胡学勤

联系人：宁博宇

联系电话：021-20665952

客户服务电话：4008219031

网址：www.lufunds.com

(71) 上海联泰基金销售有限公司

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

(72) 上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼

法定代表人：陈继武

联系人：李晓明

联系电话：021-63333319

客户服务热线：4000 178 000

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

(73) 深圳富济基金销售有限公司

注册（办公）地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路 3088 号中洲大厦 3203A 单元

法定代表人：刘鹏宇

联系人：刘勇

联系电话：0755-83999907-8814

客户服务热线：0755-83999907

网址：[www.fujifund.cn](http://www.fujifund.cn)

(74) 北京钱景基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

办公地址：北京市海淀区丹棱街 6 号丹棱 SOHO 大厦 1008

法定代表人：赵荣春

联系人：陈剑炜

联系电话：010-57418813

客户服务热线：400-893-6885

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

(75) 上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海市虹口区东大名路 1098 号浦江金融世纪广场 18 层

法定代表人：李兴春

联系人：陈洁

联系电话：021-60195121

客户服务热线：400-921-7755

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

(76) 珠海盈米基金销售有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

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

法定代表人：肖雯

联系人：黄敏嫦

联系电话：020-89629099

客户服务电话：020-89629066

公司网址：www.yingmi.cn

(77) 中证金牛（北京）投资咨询有限公司

注册地址：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室

办公地址：北京市宣武门外大街甲一号新华社第三工作区A座5层

法定代表人：钱昊旻

联系人：孙雯

联系电话：010-59336519

客户服务热线：4008-909-998

公司网址：www.jnlc.com

(78) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街11号E世界财富中心A座11层1108号

办公地址：北京市海淀区中关村大街11号E世界财富中心A座11层

法定代表人：王伟刚

联系人：丁向坤

联系电话：010-56282140

客户服务热线：400-619-9059

网址：www.hcjijin.com

(79) 大泰金石基金销售有限公司

注册地址：南京市建邺区江东中路102号708室

办公地址：上海市浦东新区峨山路505号东方纯一大厦15楼

法定代表人：姚杨

联系人：孟召社

联系电话：021-20324176

客户服务热线：400-928-2266

网址：www.dtfunds.com

注：仅开放赎回

(80) 深圳市金斧子基金销售有限公司

注册（办公）地址：深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3



单元 11 层 1108

法定代表人：赖任军

联系人：刘昕霞

联系电话：0755-29330513

客户服务热线：400-930-0660

网址：www.jfzinv.com

(81) 上海万得基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址：上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼

法定代表人：王廷富

联系人：徐亚丹

联系电话：021-51327185

客户服务热线：400-821-0203

网址：www.520fund.com.cn

(82) 北京新浪仓石基金销售有限公司

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

法定代表人：李昭琛

联系人：付文红

联系电话：010-62676405

客户服务热线：010-62675369

网址：www.xincai.com

(83) 北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路甲 19 号 SOHO 嘉盛中心 30 层

法定代表人：周斌

联系人：张晔

联系电话：010-59313591

客户服务热线：4008-980-618

网址：www.chtfund.com

(84) 北京肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15

办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院A座17层

法定代表人：江卉

联系人：徐伯宇

联系电话：010-89189285

客户服务热线：95118/400-088-8816

网址：<http://fund.jd.com>

(85) 南京苏宁基金销售有限公司

注册（办公）地址：南京玄武区苏宁大道1-5号

法定代表人：钱燕飞

联系人：赵耶

联系电话：18551602256

客户服务热线：95177

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

(86) 济安财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环中路7号4号楼40层4601室

法定代表人：杨健

联系人：李海燕

联系电话：010-65309516

客户服务热线：400-673-7010

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

(87) 上海云湾基金销售有限公司

注册（办公）地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层

法定代表人：戴新装

联系人：朱学勇

联系电话：021-20530012

客户服务热线：400-820-1515

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

(88) 通华财富（上海）基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区同丰路667弄107号201室

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场杨高南路799号3号楼9楼

法定代表人：兰奇

联系电话：021-60818588

客户服务热线：400-66-95156

网址：www.tonghuafund.com

(89) 上海挖财基金销售有限公司

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

法定代表人：冷飞

联系人：孙琦

联系电话：021-50810687

客户服务热线：021-50810673

网址：www.wacaijijin.com

(90) 上海基煜基金销售有限公司

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

办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

法定代表人：王翔

联系人：李关洲

联系电话：021-65370077

客户服务热线：400-820-5369

网址：www.jiyufund.com.cn

(91) 北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

办公地址：北京市朝阳区创远路 34 号院融新科技中心 C 座 17 层

法定代表人：钟斐斐

联系人：袁永姣

联系电话：010-61840688

客户服务热线：4000-618-518

网址：www.danjuanapp.com

(92) 腾安基金销售（深圳）有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海天二路 33 号腾讯滨海大厦 15 楼

法定代表人：刘明军

联系人：谭广锋

联系电话：0755-86013388-80618

客户服务热线：95017(拨通后转 1 再转 8)

网址：[www.tenganxinxi.com](http://www.tenganxinxi.com) 或 [www.txfund.com](http://www.txfund.com)

(93) 上海华夏财富投资管理有限公司

注册地址：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室

法定代表人：毛淮平

联系人：张静怡

联系电话：010-88066184

客户服务热线：400-817-5666

网址：[www.amcfortune.com](http://www.amcfortune.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) 88318809

## (三) 出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

联系人：安冬

电话：021-31358666

经办律师：吕红、安冬

## (四) 审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

电话：021-23238189

联系人：俞伟敏

经办注册会计师：许康玮、俞伟敏

## 六、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集，经中国证监会 2012 年 9 月 18 日证监许可【2012】1238 号文件核准募集。

本基金募集期为 2012 年 11 月 12 日至 2012 年 12 月 7 日。经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第 508 号验资报告予以验证，按照每份基金份额面值人民币 1.00 元计算，本基金募集期共募集 1,095,372,033.67 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,260,380.78 份基金份额。有效认购户数为 4,668 户。

## 七、基金合同的生效

根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、基金合同及其它相关规定，本基金募集符合有关规定和条件，已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于 2012 年 12 月 11 日获书面确认，基金合同自该日起正式生效。

## 八、基金份额的申购、赎回与转换

### （一）申购和赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

### （二）申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，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、赎回时除外。

基金合同生效后,若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况,基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整,但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

## 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金自 2013 年 1 月 14 日起开放办理日常申购、赎回业务。基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的,其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

### (三) 申购与赎回的原则

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

2、“金额申购、份额赎回”原则,即申购以金额申请,赎回以份额申请;

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销;

4、赎回遵循“先进先出”原则,即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回。

基金管理人可在法律法规允许的情况下,对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

### (四) 申购与赎回的程序

#### 1、申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序,在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资人在提交申购申请时须按销售机构规定的方式全额缴付申购款项,投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额,否则所提交的申购、赎回申请无效。

#### 2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时,必须全额交付申购款项,投资人交付款项,申购申请即为有效。

投资人赎回申请成功后,基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回时,款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

#### 3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日),在正常情况下,本基金登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请,投资人可在T+2日后(包括该日)到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功,则申购款项退还给投资人。

#### (五) 申购与赎回的数量限制

1、每个账户每次申购的最低金额为人民币10元。其中个人投资者通过本公司直销中心首次申购公司旗下基金的单笔最低限额为100万元(含),已有认购本基金记录的个人投资人不受首次申购最低金额100万元(含)的限制,但受追加申购最低金额的限制。

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

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

4、基金管理人可根据市场情况,在法律法规允许的情况下,调整申购金额和赎回份额的数量限制,或者新增基金规模控制措施。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定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、申购费用

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。本基金的申购费用最高不超过申购金额的5%。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、销售等各项费用。

本基金自2013年11月1日起,对于通过本公司直销中心申购本基金的养老金客户实施特定申购费率。养老金客户指基本养老保险与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金等,包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方和行业社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型,基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围,并按规定向中国证监会备案。

通过基金管理人的直销中心申购本基金基金份额的养老金客户申购费率见下表:

申购金额(M)	申购费率
M<100万元	0.6%
100万元≤M<500万元	0.4%

M≥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	1.50%
100 万元≤M<500 万元	1.00%
M≥500 万元	每笔 1000 元

## 2、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。赎回费用最高不超过赎回金额的 5%。不低于赎回费总额的 25%归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。其中，对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。具体赎回费率结构如下：

持有年限（Y）	赎回费率
Y<7 天	1.50%
7 天≤Y<1 年	0.50%
1 年≤Y<2 年	0.25%
Y≥2 年	0%

注：1 年指 365 天。

## 3、申购份额的计算

申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除申购费用后，以申请当日基金份额净值为基准计算，有效份额单位为份，各计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

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：

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

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

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



举例：某非养老金客户在基金存续期间分别投资 5 万元、150 万元申购本基金，该日基金份额净值为 1.080 元，该客户的申购费用及可获得的申购份额分别计算如下：

	申购一	申购二
申购金额	50,000.00	1,500,000.00
适用费率	1.50%	1.00%
净申购金额	49,261.08	1,485,148.51
申购费用	738.92	14,851.49
申购份额	45,612.11	1,375,137.51

#### 4、净赎回金额的计算

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以申请当日基金份额净值的金额，净赎回金额为赎回金额扣除赎回费用的金额，赎回金额单位为元。各计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

净赎回金额为赎回金额减去赎回费用。计算公式如下：

赎回金额 = 赎回份数 × 赎回价格

赎回费用 = 赎回金额 × 赎回费率

赎回价格 = 申请日基金份额净值

净赎回金额 = 赎回金额 - 赎回费用

举例：假定某投资人在 T 日赎回 10,000 份基金份额，持有时间为 15 个月，对应的赎回费率为 0.25%，该日基金份额净值为 1.280 元，则其获得的净赎回金额计算如下：

赎回金额 =  $10,000 \times 1.280 = 12,800.00$  元

赎回费用 =  $12,800.00 \times 0.25\% = 32.00$  元

净赎回金额 =  $12,800.00 - 32.00 = 12,768.00$  元

#### 5、基金份额净值的计算

本基金份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

基金份额净值的计算公式为：

$T$ 日基金份额净值= $T$ 日基金资产净值总额/ $T$ 日基金份额总份数。

6、基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整申购费率、调低赎回费率或变更收费方式，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。

基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

#### (七) 申购和赎回的登记业务

1、基金投资人当日的申购和赎回申请，在基金管理人规定的时间以内可以撤销。

2、投资人 $T$ 日申购基金成功后，登记机构在 $T+1$ 日为投资人增加权益并办理登记手续，投资人自 $T+2$ 日起有权赎回该部分基金份额。

3、投资人 $T$ 日赎回基金成功后，登记机构在 $T+1$ 日为投资人扣除权益并办理相应的登记手续。

4、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述登记办理时间进行调整，并于开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

#### (八) 巨额赎回的情形及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(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余额)超过前一开放日的基金总份额的10%，即认为是发生了巨额赎回。

##### 2、巨额赎回的处理方式

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

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

(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额10%的前提下，可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；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

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

(4) 暂停赎回：连续 2 日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒体上进行公告。

### 3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当在 2 日内在指定媒体上刊登公告。同时在法律法规规定的时间内通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式通知基金份额持有人，说明有关处理方法。

#### (九) 拒绝或暂停申购、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形及处理

##### 1、发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

(1) 因不可抗力导致基金无法正常运作。

(2) 发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接收投资人的申购申请。当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。

(3) 证券交易所在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。

(4) 基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

(5) 基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。

(6) 基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形时。

(7) 当一笔新的申购申请被确认成功，使本基金总规模超过基金管理人规定的本基金

总规模上限时；或使本基金单日申购金额或净申购比例超过基金管理人规定的单日申购金额或净申购比例上限时；或该投资人累计持有的份额超过单个投资人累计持有的份额上限时；或该投资人单日或单笔申购金额超过单个投资人单日或单笔申购金额上限时。

(8) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述除第(4)、(6)、(7)项外暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。当发生上述第(6)项情形时，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的申购申请进行限制，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

2、发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

(1) 因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

(2) 发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接收投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金赎回申请或延缓支付赎回款项。

(3) 证券交易所在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；

(4) 连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回；

(5) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。若出现上述第(4)项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。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并公告。

(十) 暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并在规定期限内指定媒体上刊登暂停公告。

2、基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放日在指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

### （十一）基金转换

1、本基金于2013年1月14日起开放了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2013年1月10日刊登的《摩根士丹利华鑫量化配置股票型证券投资基金开放日常申购（赎回、转换、定期定额投资）业务公告》。

#### 2、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，申购补差费率 = 转入总金额对应的转入基金申购费率 - 转入总金额对应的转出基金申购费率，若转入总金额对应的转出基金申购费率 ≥ 转入总金额对应的转入基金申购费率，则申购补差费为0。

(2) 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。

### （十二）基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

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他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理，并按基金登记机构规定的标准收费。

### （十三）基金的转托管

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，基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

#### （十四）定期定额投资计划

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

#### （十五）基金份额的冻结和解冻

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

### 九、基金的投资

#### （一）投资目标

本基金通过数量化模型，优化资产配置权重，力争在降低组合风险的同时，获得超越比较基准的超额收益。

#### （二）投资范围

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（包括交易所和银行间两个市场的国债、金融债、企业债与可转换债、中期票据、短期融资券等）、银行存款、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规和中国证监会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）。

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

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的60%-95%；除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为5%-40%，其中权证资产占基金资产净值的比例范围为0-3%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

#### （三）投资策略

##### 1、资产配置策略

本基金实行在公司投资决策委员会统一指导下的资产配置机制。投资决策委员会定期或针对特定事件临时召开，讨论、确定具体的基金资产未来一段时期内在权益类资产及固定收益类资产之间的配置比例范围，形成资产配置相关决议。基金经理根据投资决策委员会关于资产配置的决议具体执行并实施资产配置方案。

为了有效实施数量化投资策略，本基金将在投资决策委员会关于资产配置决议的允许范围内，采取相对稳定的股票持仓比例控制措施，降低由于股票持仓比例波动过于频繁影响到

数量化投资策略的效果。

资产配置采取“自上而下”的多因素分析决策支持，结合定性分析和定量分析，对股票资产和固定收益类资产的风险收益特征进行分析预测，确定中长期的资产配置方案。

在实施资产配置时，主要考察三方面的因素：宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素。

宏观经济因素是资产配置的重点考量对象。本基金重点考察全球经济发展状况、国际间贸易和资本流动、国际间贸易壁垒和文化差异等定性因素和中国劳动力分布、GDP、CPI、PPI、投资、消费、进出口、货币流动性状况、利率、汇率等定量因素，评估宏观经济变量变化趋势及对固定收益投资品和权益类投资品的影响，并做出适当的资产配置策略。

政策及法规因素方面主要关注政府货币政策、财政政策和产业政策的变动趋势，评估其对各行业领域及资本市场的影响；关注资本市场制度和政策的变动趋势，评估其对资本市场体系建设的影响。

资本市场因素方面主要关注市场估值的比较、市场预期变化趋势、资金供求变化趋势等。在此基础上，对市场估值进行整体评估，依据评估结果决定资产配置方案。

当资本市场、国家财经政策等发生重大变化，或发生其他重大事件（包括但不限于重大自然灾害、战争等不可预测事件等），可能导致各类别资产的风险收益特征发生显著变化时，投资决策委员会将临时组织集体讨论并确定特定时期的资产配置方案。

## 2、行业配置策略

本基金采用结合行业多因子阿尔法模型 (Multi-Factor Industry Alpha Model) 和 Black-Litterman 资产配置模型 (B-L Model) 的量化模型以及其他量化模型进行行业配置。

本基金所指行业多因子阿尔法模型（以下称多因子模型）是建立在已被国际市场广泛应用的多因子模型的基础上，根据中国资本市场的实际情况，由本基金管理的金融工程团队开发的更具有针对性和适用性的量化行业选择模型。本基金所指 Black-Litterman 资产配置模型（以下称 BL 模型）已成为国际上主流的量化配置模型，该模型能较好地结合各项资产的预期收益率和历史收益率，形成新的市场收益预期，从而使得各项资产配置权重的优化结果更加有效。

首先，本基金通过量化方法分析各个行业的股价表现与宏观经济、本行业内、上下游产业链指标之间的关系，并结合各行业的估值水平、一致预期、盈利水平、动量反转等指标，从中筛选出最有效的指标和因子建立多因子模型，获得各行业的预期收益率；其次，运用 BL 模型结合多因子模型的预测结果，对行业配置权重进行优化。

### （1）多因子模型

#### A. 备选因子库

不同行业的市场表现对于货币信贷政策、财政政策、物价体系、投资、进出口等宏观经济环境的变化有不同反应；行业产销量、产品价格、库存等因素将揭示本行业的景气状况，从而影响行业股价的市场表现；上下游产业的运行状况将改变本行业的供求状况，从而引起

行业股价的变化；行业的估值水平、一致预期等市场特性将对行业未来收益率产生一定的影响。本基金通过深入研究传统投资理论、总结分析投资团队多年积累的投资经验，构建备选因子库。

本基金定期或不定期对备选因子库进行更新，首先是对现有因子数据的更新；其次，添加值得研究、跟踪和检验的新因子；再次，添加复合因子，即利用若干因子之间的内生关系，通过汇总、剥离、调整等方法获得的综合因子。

#### B. 模型的入选因子

本基金结合中国市场的行业投资逻辑，经过全面而细致的实证检验，从备选因子库中对行业收益最有解释力的若干因子，构建多因子模型。

由于因子的有效性会随着宏观经济周期的变化、行业发展阶段的演进等因素发生变化，本基金定期和不定期重复从备选因子库中挑选有效因子的过程，建立入选因子的更新机制，力求提高多因子模型的适应力和生命力。

#### C. 模型入选因子的权重

入选模型的若干因子对行业收益的重要性是不同的，例如，有些行业注重宏观经济周期的变化，有些行业注重规模的扩张，有些行业注重盈利能力的提升，有些行业注重估值的变化等等。多因子模型将采用OLS等方法评价因子的重要程度给不同入选因子配以不同的权重，以反映市场的侧重点。

在因子发挥效用的同时，其重要性也会随之发生变化。因此本基金对因子权重也设置了更新机制，定期重复权重分配过程。

#### (2) 权重优化模型

本基金采用BL模型最终确定各行业的投资权重。BL模型能将基金管理人对各行业的预期收益观点与市场均衡状态下个行业隐含的超额收益率及市场权重相结合，以风险调整收益最大化的目标下，实现各行业的合理和优化的配置。

具体到本基金来讲，由于各行业隐含的超额收益率及市场权重可由历史收益率以及市场权重计算得出；多因子模型通过各项有效因子对各行业的预期收益进行评估，提供预期收益观点。BL模型采用贝叶斯方法把隐含的超额收益率和预期收益观点结合起来，对均衡的市场权重进行调节，使得组合达到最优的风险调整收益。

### 3、股票配置策略

股票配置是本基金量化资产配置的实施阶段，股票配置策略将直接影响到实施效果，本基金的股票配置策略以拟合和超越行业平均收益为目的。

本基金从以下几个维度构建各行业的股票配置策略：首先，需考虑行业内股票的权重分布。每个行业内股票权重集中度都不尽相同，对于个股权重较为集中的行业，若干权重股的收益能够较好地拟合行业平均收益，而个股权重分散的行业则不然。其次，行业内股票的收益分布。每个行业内个股的市场表现一致程度也不尽相同，对于一致性较强的行业，拟合行业平均收益的难度较低，而一致性较弱的行业的难度较大。再次，行业内股票的流动性分布。



对于个股流动性较好的行业，满足基金交易需求的股票品种较多，而在流动性差行业中的股票配置数量将受到限制。最后，行业目标配置权重。对于目标权重较高的行业，更多数量的股票能缓和流动性问题，同时对行业平均收益率的拟合程度也较高。除了以上情况以外，还需考虑基金的股票品种的投资禁止行为、比例限制等各方面的因素。

在行业内选股策略上，本基金采用量化模型的方法进行选股。量化选股模型包括但不限于以下两种：一种是持有行业内若干权重股，并优化其在基金中的权重以拟合行业平均收益；另一种是通过量化多因子选股模型挑选优势个股，从而超越行业平均收益，其中因子主要包括价值因子、成长因子、基本面因子、一致预期和市场因子等。本基金综合考虑以上因素，根据市场状况的变化，定期或不定期修订行业的股票配置策略。

#### 4、其他金融工具投资策略

##### （1）固定收益投资策略

本基金遵循中长期资产配置策略，进行国债、金融债、公司债等固定收益类证券以及可转换债券的投资。由公司固定收益投资团队独立提出具体的投资策略及投资建议，通过评估货币政策、财政政策和国际环境等因素，分析市场价格中隐含的对经济增长、通货膨胀、违约概率、提前偿付速度等因素的预测，根据固定收益市场中存在的各种投资机会的相对投资价值和相关风险决定总体的投资策略及类属（政府、企业/公司、可转换债券、资产支持证券等）和期限（短期、中期和长期）等部分的投资比例，并基于价值分析精选投资品种构建固定收益投资组合。

本基金采用的主要固定收益投资策略包括：利率预期策略、收益率曲线策略、信用利差策略、公司/企业债券策略、可转换债券策略等。

##### （2）股指期货投资策略

本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。

本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素，结合定性和定量方法，确定投资时机。基金管理人另根据CAPM模型计算得到的组合Beta值，结合股票投资的总体规模，以及中国证监会的相关限定和要求，确定参与股指期货交易的投资比例。

若相关法律法规发生变化时，基金管理人期货投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。

##### （3）权证投资策略

本基金对权证的投资建立在对标的证券和组合收益风险分析的基础上，以Black-Scholes模型和二叉树期权定价模型为基础对权证进行分析定价，并根据市场情况对定价模型和参数进行适当修正。

若法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围并及时制定相应的投资策略。

#### （四）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、微观经济运行环境和证券市场发展趋势；
- 3) 投资品种的预期收益率和风险水平。

##### 2、投资决策程序

###### （1）投资研究

本基金管理人研究团队充分利用外部和内部的研究资源提供研究成果，挖掘投资机会，为投资决策委员会和基金经理提供决策支持。

###### （2）投资决策

投资决策委员会是基金投资的最高决策机构，负责制定基金的投资原则、投资目标及整体资产配置策略和风险控制策略，并对基金经理进行授权，对基金的投资进行总体监控。如遇重大事项，投资决策委员会及时召开临时会议做出决议。

###### （3）组合构建

基金经理根据投资委员会确定的总体投资策略和原则以及研究团队提供的分析和建议等信息，在遵守基金合同的前提下，在投资决策委员会的授权范围内构建具体的投资组合，进行组合的日常管理。

###### （4）交易执行

本基金实行集中交易制度。交易团队负责执行基金经理投资指令，同时承担一线风险监控职责。

###### （5）风险与绩效评估

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

###### （6）组合调整

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

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

#### （五）业绩比较基准

依据本基金基金合同的约定，经与相关基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，自2015年9月29日起，本基金的业绩比较基准变更为：

$80\% \times \text{沪深300指数收益率} + 20\% \times \text{标普中国债券指数收益率}$

本基金股票投资部分的业绩比较基准是沪深300指数，债券投资部分的业绩比较基准是

标普中国债券指数。

沪深300指数是沪深证券交易所第一次联合发布的反映A股市场整体走势的指数,由中证指数公司编制和维护,是在上海和深圳证券交易所中选取300只A股作为样本编制而成。该指数样本对沪深市场的覆盖度高,具有良好的市场代表性,投资人可以方便地从报纸、互联网等财经媒体中获取。同时,该指数编制方法清晰透明,具有独立性和良好的市场流动性;与市场整体表现具有较高的相关度,且指数历史表现强于市场平均收益水平,适合作为本基金的权益投资部分业绩基准。

标普中国债券指数是中信标普指数信息服务有限公司所开发的债券系列指数之一,该系列指数包括6只固定收益指数,分别跟踪中国政府债、企业债、金融债、服务债、工业债和公用事业债的业绩表现以及具有综合意义的全债指数。标普中国债券指数旨在追踪中国的政府债、企业债、金融债、服务债、公用事业债和工业债券市场,它涵盖了在上海证券交易所和深圳证券交易所上市的债券。纳入标普中国债券指数的债券的信用评级都在投资级以上。适合作为本基金的固定收益投资部分业绩基准。

如果上述基准指数停止计算编制或更改名称,或者今后法律法规发生变化,又或者市场推出更具权威、且更能够表征本基金风险收益特征的指数,则基金管理人将视情况经与基金托管人协商同意并按照监管部门要求履行适当程序后调整本基金的业绩比较基准,而无需召开基金份额持有人大会审议,并及时公告并报证监会备案,同时在更新的招募说明书中列示。

上述事项已于2015年9月29日在指定媒体上公告。

#### (六) 风险收益特征

本基金为混合型基金,其预期收益和风险高于货币型基金、债券型基金,而低于股票型基金,属于证券投资基金中的中高风险、中高收益品种。

#### (七) 投资限制

##### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

(1) 股票资产占基金资产的比例范围为60%-95%;除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为5%-40%;

(2) 本基金持有一家上市公司的股票,其市值不超过基金资产净值的10%;

(3) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券,不超过该证券的10%;

(4) 本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;

(5) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的10%;

(6) 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0.5%;

(7) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；

(8) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；

(9) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；

(10) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；

(11) 本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

(12) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(13) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%；

(14) 本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在本基金托管协议或其补充协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险；

(15) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；

(16) 本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%；

其中，有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等；

(17) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；

基金管理人应当按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等；

(18) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计(轧差计算)占基金资产的比例范围为60%-95%；

(19) 本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；

(20) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存

出保证金、应收申购款等；

(21) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

(22) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%。

因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(23) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

(24) 法律法规、基金合同规定的其他比例限制。

本基金在开始进行股指期货投资之前，应与基金托管人就股指期货清算、估值、交割等事宜另行具体协商。

除上述（11）、（20）、（22）、（23）以外，因证券或期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，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) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

## (八) 基金管理人代表基金行使股东及债权人权利的处理原则及方法

1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东及债权人权利，保护基金份额持有人的利益；

2、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；

3、有利于基金财产的安全与增值；

4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

## (九) 基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关法律法规规定进行融资、融券。

## (十) 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019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2019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	600,280,903.51	93.64
	其中：股票	600,280,903.51	93.64
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,364,366.00	0.21
	其中：债券	1,364,366.00	0.21
	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	39,147,329.72	6.11
8	其他各项资产	277,252.74	0.04
9	合计	641,069,851.97	100.00

## 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值
----	------	---------	---------

			比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	763,036.74	0.12
B	采矿业	18,881,233.00	2.96
C	制造业	243,246,941.91	38.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,827,200.00	2.64
E	建筑业	20,290,816.00	3.18
F	批发和零售业	9,496,109.00	1.49
G	交通运输、仓储和邮政业	16,748,214.40	2.63
H	住宿和餐饮业	585,184.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,550,791.94	3.38
J	金融业	207,798,533.88	32.61
K	房地产业	28,581,840.00	4.49
L	租赁和商务服务业	5,694,177.00	0.89
M	科学研究和技术服务业	1,700,488.64	0.27
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	2,937,090.00	0.46
R	文化、体育和娱乐业	5,179,247.00	0.81
S	综合	-	-
	合计	600,280,903.51	94.21

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	601318	中国平安	450,500	34,733,550.00	5.45
2	600519	贵州茅台	25,500	21,776,745.00	3.42
3	600036	招商银行	607,500	20,606,400.00	3.23
4	600030	中信证券	774,100	19,182,198.00	3.01
5	601166	兴业银行	940,900	17,096,153.00	2.68
6	000858	五粮液	162,300	15,418,500.00	2.42
7	000001	平安银行	909,000	11,653,380.00	1.83
8	000333	美的集团	234,800	11,441,804.00	1.80
9	000651	格力电器	237,100	11,193,491.00	1.76
10	002142	宁波银行	439,212	9,328,862.88	1.46

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,364,366.00	0.21
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,364,366.00	0.21

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

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	113021	中信转债	6,080	654,998.40	0.10
2	110051	中天转债	4,040	445,167.60	0.07
3	123022	长信转债	1,892	189,200.00	0.03
4	110056	亨通转债	750	75,000.00	0.01

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的规定，本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。

本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素，结合定性和定量方法，确定投资时机。基金管理人另根据 CAPM 模型计算得到的组合 Beta 值，结合股票投资的总体规模，以及中国证监会的相关限定和要求，确定参与股指期货交易的投资比例。

若相关法律法规发生变化时，基金管理人期货投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。

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招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）、兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）、平安银行股份有限公司（以下简称“平安银行”）和宁波银行股份有限公司（以下简称“宁波银行”）外，其余的没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

2018 年 5 月，中国银行保险监督管理委员会发布《中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表》（银监罚决字〔2018〕1 号）（招商银行股份有限公司），对招商银行的内控管理严重违反审慎经营规则、销售同业非保本理财产品时违规承诺保本、未严格审查贸易背景真实性办理银行承兑业务等违法违规行为，处以罚款和没收违法所得。

2018 年 5 月，中国银行保险监督管理委员会发布《中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表》（银保监银罚决字〔2018〕1 号）（兴业银行股份有限公司），对兴业银行的重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告、非真实转让信贷资产、内控管理严重违反审慎经营规则等违法违规行为，处以罚款。

2018年6月，中国银行业监督管理委员会宁波监管局发布《宁波银监局行政处罚信息公开表》（甬银监罚决字〔2018〕6号），对宁波银行以不正当手段违规吸收存款的行为处以罚款人民币60万元的行政处罚。

2018年7月，中国人民银行发布《行政处罚决定书》（银反洗罚决字【2018】2号），对平安银行未按照规定履行客户身份识别义务、未按照规定保存客户身份资料和交易记录、未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告的行为处以罚款。

2019年1月，中国银行业监督管理委员会宁波监管局发布《宁波银监局行政处罚信息公开表》（甬银监罚决字〔2018〕45号），对宁波银行将个人贷款资金违规流入房市、购买理财的行为处以罚款人民币20万元的行政处罚。

2019年3月，中国银行业监督管理委员会宁波监管局发布《宁波银监局行政处罚信息公开表》（甬银监罚决字〔2019〕14号），对宁波银行违规将同业存款变为一般性存款的行为处以罚款人民币20万元的行政处罚。

本基金投资招商银行（600036）、兴业银行（601166）、平安银行（000001）和宁波银行（002142）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，认为上述事件对招商银行、兴业银行、平安银行和宁波银行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 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	92,350.59
2	应收证券清算款	55,964.00
3	应收股利	-
4	应收利息	9,943.89
5	应收申购款	118,994.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	277,252.74

### 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债。

### 11.5 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、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2019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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2012年12月11日至 2012年12月31日	0.20%	0.04%	8.87%	1.25%	-8.67%	-1.21%
2013年1月1日至 2013年12月31日	4.29%	1.06%	-5.49%	1.12%	9.78%	-0.06%
2014年1月1日至 2014年12月31日	55.31%	0.93%	42.46%	0.98%	12.85%	-0.05%
2015年1月1日至 2015年12月31日	33.46%	2.40%	7.05%	1.99%	26.41%	0.41%
2016年1月1日至 2016年12月31日	-6.88%	1.36%	-8.40%	1.12%	1.52%	0.24%
2017年1月1日至 2017年12月31日	6.16%	0.54%	17.10%	0.51%	-10.94%	0.03%
2018年1月1日至 2018年12月31日	-24.62%	1.16%	-19.37%	1.07%	-5.25%	0.09%
自基金合同生效日起 至2019年3月31日	96.93%	1.37%	66.53%	1.22%	30.39%	0.15%

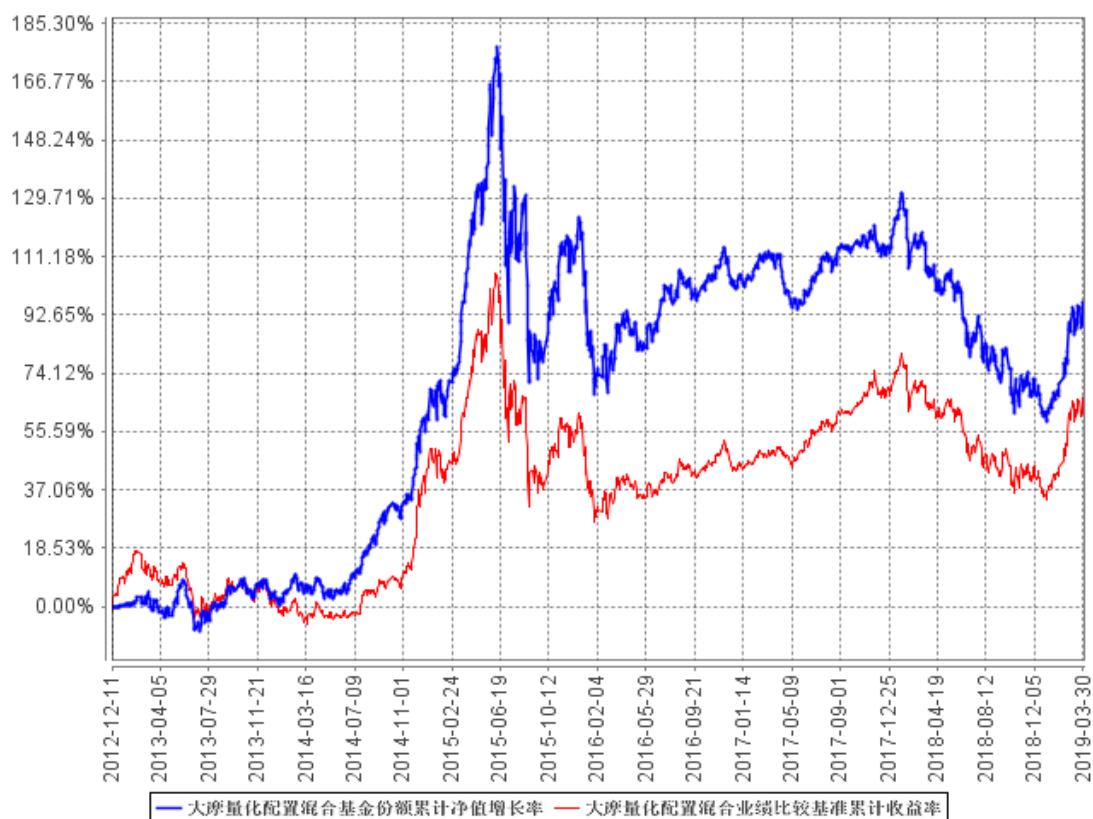
2、自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资基金

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：

（2012年12月11日至2019年3月31日）

大摩量化配置混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## 十一、基金的财产

### (一) 基金资产总值

基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

### (二) 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### (三) 基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### (四) 基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、基金登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和基

金合同的规定处分外，基金财产不得被处分。

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。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。

## 十二、基金资产的估值

### （一）估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

### （二）估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券、股指期货合约和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及所有负债。

### （三）估值方法

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（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，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（2）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（3）交易所上市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；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券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。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（4）交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，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，按成本估值。

#### 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

（1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，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) 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，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、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。

4、因持有股票而享有的配股权，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。

5、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。

6、股指期货合约一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

7、如有确凿证据表明按上述方法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与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

8、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。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，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

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

#### (四) 估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到0.001元，小数点后第4位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同

的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

#### (五) 估值错误的处理

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。当基金份额净值小数点后3位以内(含第3位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误、有关会计制度变化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，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### 1、估值错误类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人(“受损方”)的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述估值错误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。

##### 2、估值错误处理原则

(1) 估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误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。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。

(2) 估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

(3) 因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。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”)，则估值错误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估值错误责任方。

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

##### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明估值错误发生的原因，列明所有的当事人，并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方；

(2) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估；

(3) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据估值错误处理的方法，需要修改基金登记机构交易数据的，由基金登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

(六) 暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

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时；

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

4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

(七) 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和基金份额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。

### 十三、基金的收益与分配

(一) 基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

(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、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为4次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的25%，若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### (四) 收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

### (五) 收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在2日内在指定媒体公告并报中国证监会备案。

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过15个工作日。

### (六) 基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

## 十四、基金的费用与税收

### (一) 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、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；

4、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；

- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金的开户费用；
- 9、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

## (二) 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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5 %年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.5 \% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前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、公休假等，支付日期顺延。

### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.25 \% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类中第3—8项费用”，根据有关法规及相应协议规定，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。

## (三) 不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、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；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、基金合同生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

#### (四) 基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

### 十五、基金的会计与审计

#### (一) 基金的会计政策

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；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果基金合同生效少于2个月，可以并入下一个会计年度；

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、会计制度执行国家有关会计制度；

5、本基金独立建账、独立核算；

6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、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；

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

#### (二) 基金的年度审计

1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。

2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。

3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需在2日内在指定媒体公告并报中国证监会备案。

### 十六、基金的信息披露

(一) 本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。

#### (二) 信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。

本基金信息披露义务人按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露

信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的报刊（“指定报刊”）、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，并保证基金投资者能够按照基金合同约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

（三）本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；
- 5、登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

（四）本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

（五）公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

1、基金招募说明书、基金合同、基金托管协议

（1）基金合同是界定基金合同当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

（2）基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。基金合同生效后，基金管理人在每6个月结束之日起45日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定报刊上；基金管理人在公告的15日前向主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

（3）基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

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3日前，将基金招募说明书、基金合同摘要登载在指定报刊上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同、基金托管协议登载在网站上。

## 2、基金份额发售公告

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媒体上。

## 3、基金合同生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定媒体上登载基金合同生效公告。

## 4、基金资产净值、基金份额净值

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

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当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。

基金管理人应当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。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒体上。

## 5、基金份额申购、赎回价格

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

## 6、基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起90日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

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

基金管理人应当在每个季度结束之日起15个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定报刊上。

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

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

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

基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。

## 7、临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：

- (1) 基金份额持有人大会的召开；
- (2) 终止基金合同；
- (3) 转换基金运作方式；
- (4) 更换基金管理人、基金托管人；
- (5) 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- (6) 基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- (7) 基金募集期延长；
- (8) 基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
- (9) 基金管理人的董事在一年内变更超过 50%；
- (10) 基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过 30%；
- (11) 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；

- (12) 基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- (13) 基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；
- (14) 重大关联交易事项；
- (15) 基金收益分配事项；
- (16) 管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- (17) 基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；
- (18) 基金改聘会计师事务所；
- (19) 变更基金销售机构；
- (20) 更换基金登记机构；
- (21) 本基金开始办理申购、赎回；
- (22) 本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- (23) 本基金发生巨额赎回并延期支付；
- (24) 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- (25) 本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- (26) 本基金发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项；
- (27) 中国证监会或基金合同规定的其他事项。

## 8、澄清公告

在基金合同存续期限内，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。

## 9、基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报国务院证券监督管理机构核准或者备案，并予以公告。

## 10、中国证监会规定的其他信息。

### (六) 信息披露事务管理

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

事务。

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

基金托管人应当按照相关法律法规、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。

基金管理人、基金托管人应当在指定媒体中选择披露信息的报刊。

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

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到基金合同终止后 10 年。

#### （七）信息披露文件的存放与查阅

招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所，供公众查阅、复制。

基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，以供公众查阅、复制。

基金管理人和基金托管人应保证上述文本的内容与公告的内容完全一致。

## 十七、风险揭示

### （一）投资于本基金面临的主要风险

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

#### 1、市场风险

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

##### （1）经济周期风险



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

#### （2）政策风险

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

#### （3）上市公司经营风险

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

#### （4）利率风险

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

#### （5）信用风险

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

#### （6）购买力风险

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

#### （7）再投资风险

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

#### （8）市场供需风险

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

#### （9）债券收益率曲线变动风险

债券收益率曲线变动风险是指与收益率曲线非平行移动有关的风险。

#### （10）利差风险

债券市场不同期限、不同类属债券之间的利差变动导致相应期限和类属债券价格变化

的风险。

#### (11) 债券回购风险

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

#### 2、管理风险

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

#### 3、流动性风险

流动性风险是指本基金无法及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险；或是为应对投资者赎回，变现冲击成本较高，给基金资产造成损失的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资人的集中巨额赎回，另一方面来自于其投资组合或其中的部分资产变现能力变弱所产生的风险。主要包括：

(1) 巨额赎回风险：本基金属于开放式基金，在本基金存续期间，可能会发生巨额赎回的情形。当本基金发生单一投资者持有基金份额占比较大的情形时，若上述投资者集中大额赎回本基金，亦可能引发巨额赎回的情形。投资者可能面临以下风险：

A. 由于我国证券市场的波动性较大，在市场价格下跌时会出现交易量急剧减少的情形，此时出现巨额赎回可能会导致基金资产变现困难，从而产生流动性风险，甚至影响基金份额净值。此外，当出现巨额赎回时，因基金运作特点导致的费用计提、计入基金资产的赎回费以及基金持仓证券价格波动等因素，也可能影响基金份额净值，极端情况下可能会造成基金份额净值的大幅波动。

B. 当发生巨额赎回时，根据《基金合同》的约定，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定部分延期办理赎回或暂停接受基金的赎回申请或延缓支付赎回款，投资者将面临无法及时赎回所持有基金份额的风险。若本基金发生巨额赎回且发生单一投资者的赎回申请超过上一开放日基金总份额 20%以上的，基金管理人有权采取具体措施对其进行延期办理赎回申请，该投资者可能面临当日的部分赎回申请被延期办理的风险。

(2) 变现风险：投资组合的变现能力较弱所导致基金收益变动的风险。当本基金持有的部分证券品种的交投不活跃、成交量不足时，资产变现的难度可能会加大，若存在证券停牌的情形，资产可能难以在短时间内迅速变现。或者，由于基金持有的某种资产集中度过高，导致难以在短时间内迅速变现，有可能导致基金的净值出现损失。本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，其中股票投资占基金资产的比例为 60%-95%，主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%。股票流动性较好，存在部分股票品种停牌或交投不活跃的情况；大部分债券品种流动性较好，存在部分债券品种停牌或是企业债、资

产证券化、回购等品种流动性相对较差的情况。综上所述，本基金拟投资市场、行业及资产的流动性良好，流动性风险相对可控。但如果市场短时间内发生较大变化或基金赎回量较大，可能会影响到基金的流动性和投资收益。

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

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

1) 延期办理巨额赎回申请

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

2) 暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项

具体措施，详见招募说明书“八、基金份额的申购、赎回与转换”中“（九）拒绝或暂停申购、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形及处理”的相关内容。

3) 收取短期赎回费

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

4) 暂停基金估值

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

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

4、操作风险

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

在开放式基金的各种交易行为或者后台运作中,可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致基金份额持有人的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、登记机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等等。

#### 5、合规性风险

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

#### 6、政策变更风险

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

#### 7、本基金特有的风险

(1) 本基金为混合型基金,存在大类资产配置风险,有可能受到经济周期、市场环境或管理人对市场所处的经济周期和产业周期的判断不足等因素的影响,导致基金的大类资产配置比例偏离最优化水平,给基金投资组合的绩效带来风险。因此,本基金整体表现可能在特定时期内低于其他基金。本基金坚持价值和长期投资理念,重视股票投资风险的防范,但是基于投资范围的规定,本基金无法完全规避股票市场和债券市场的下跌风险。

(2) 本基金采用量化模型构建投资组合,其主要工作流程包括采集数据、分析数据、计算目标持仓等几个部分,分别蕴含了数据风险和模型风险。

本基金建立量化模型的数据来源包括宏观数据、行业信息、上市公司基本财务数据、证券及期货市场交易行情数据、卖方分析师预期及评级数据等多种数据,广泛涵盖各类信息源,相关数据来源于不同数据提供商,且按不同的需求和规范进行预处理。在数据采集、预处理等过程中可能发生数据错误风险,从而对量化模型输出结果造成影响。

本基金基于量化模型进行投资决策,量化投资方法的缺陷在一定程度上会影响本基金的表现。一方面,面对不断变换的市场环境,量化投资策略所遵循的模型理论均处于不断发展和完善的过程中;另一方面,在量化模型的实际运用中,核心参数假定的变动均可能影响整体效果的稳定性;最后,定量模型存在对历史数据的依赖。因此,在实际运用过程中,市场环境的变化可能导致遵循量化模型构建的投资组合在一定程度上无法达到预期的投资效果。

(3) 本基金投资股指期货的风险。

本基金可投资于股指期货,股指期货作为一种金融衍生品,主要存在以下风险:

A、基差风险:股指期货的标的指数价格与期货价格之间的价差被称为基差。基差风险是期货市场的特有风险之一,是由于期货与现货间价差的波动,可能影响套期保值或套利效果,使之发生意外损益的风险。

B、保证金管理风险:期货交易采用保证金制度,保证金账户实行当日无负债结算制度,对资金管理要求较高。保证金预留过多会导致资金运用效率过低,减少预期收益。保证金不

足将存在被强行平仓的风险，从而导致超出预期的损失，并使得原有的投资策略不能得以实现。

C、杠杆风险：由于期货采用保证金交易而存在杠杆效应，因此放大了基金财产波动幅度。

D、合约品种差异造成的风险：类似的合约品种在相同因素的影响下，价格变动不同。表现为两种情况：1) 价格变动的方向相反；2) 价格变动的幅度不同。类似合约品种的价格，在相同因素作用下变动幅度上的差异，也构成了合约品种差异的风险。

E、流通量风险：是指因市场缺乏广度或深度，可能导致期货合约无法及时以所希望的价格建立或了结头寸的风险。

#### (4) 本基金投资资产支持证券的风险

本基金投资范围包括资产支持证券，尽管基金管理人本着谨慎和控制风险的原则进行投资，但仍面临以下风险：

A、信用风险：若本基金所投资的资产支持证券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降，可能造成基金财产损失。

B、利率风险：市场利率波动会导致资产支持证券的收益率和价格的变动，一般而言，如果市场利率上升，本基金持有资产支持证券将面临价格下降、本金损失的风险，而如果市场利率下降，资产支持证券利息的再投资收益将面临下降的风险。

C、流动性风险：受资产支持证券市场规模及交易活跃程度的影响，资产支持证券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，存在一定的流动性风险。

D、提前偿付风险：债务人可能会由于利率变化等原因进行提前偿付，从而使基金资产面临再投资风险。

E、法律风险：由于法律法规方面的原因，某些市场行为受到限制或合同不能正常执行，导致基金财产损失。

#### (5) 本基金投资科创板的风险

本基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于科创板或选择不将基金资产投资于科创板，基金资产并非必然投资于科创板。

科创板股票在发行、上市、交易、退市制度等方面的规则与其他板块不同，除与其他投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临以下风险：

##### A、流动性风险：

1) 科创板投资者门槛较高，流动性可能弱于其他市场板块，若机构投资者在特定阶段对科创板个股形成一致性预期，存在本基金持有股票无法成交的风险。

2) 科创板可能采用摇号抽签方式对于参与网下申购中签的账户进行获配股份的一定

间内的锁定机制，本基金若参与科创板新股的网下申购，可能存在获配股份锁定期内无法交易的风险。

B、退市风险：科创板退市的标准、程序和执行更为严格，主要包括：退市情形更多，新增市值低于规定标准、信息披露或者规范运作存在重大缺陷导致退市的情形；退市时间更短，科创板取消了暂停上市和恢复上市制度；执行标准更严，明显丧失持续经营能力且仅依赖与主业无关的贸易或者不具备商业实质的关联交易维持收入的上市公司可能会被退市。上述因素使科创板上市企业退市风险更大，从而可能给本基金净值带来不利影响或损失。

C、发行定价风险：科创板新股发行价格、规模、节奏等坚持市场化导向，询价、定价、配售等环节由机构投资者主导。科创板新股发行采用向证券公司、基金公司等七类专业机构投资者询价定价方式，个人投资者无法直接参与发行定价。同时，因科创板上市公司普遍具有技术新、前景不确定、业绩波动大、风险高等特征，市场可比公司较少，传统估值方法可能不适用。上述因素可能造成科创板股票发行定价难度较大，股票上市后可能存在股价波动的风险，从而引发本基金净值波动的风险。

D、交易价格波动风险：科创板股票竞价交易设置较宽的涨跌幅限制，首次公开发行上市的股票，上市后的前5个交易日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为20%，较宽的涨跌幅限制可能使得股票价格产生较大波动，从而导致本基金净值出现较大波动的风险。

E、异常交易停牌风险：科创板股票交易盘中临时停牌情形和严重异常波动股票核查制度与上交所主板市场规定不同，本基金可能承担由此造成的无法交易相关股票的风险。

F、系统性风险：科创板企业均为市场认可度较高的科技创新企业，在企业经营及盈利模式上存在趋同，所以科创板个股相关性较高，市场表现不佳时，系统性风险将更为显著。

#### G、上市公司经营风险

1) 科创板上市公司所处行业和业务往往具有研发投入规模大、盈利周期长、技术更迭快、风险高以及严重依赖核心项目、核心技术人员、少数供应商等特点，公司上市后的持续创新能力、主营业务发展的可持续性、公司收入及盈利水平等仍具有较大不确定性。

2) 科创板上市公司可能存在首次公开发行前最近3个会计年度未能连续盈利、公开发行并上市时尚未盈利、有累计未弥补亏损等情形，可能存在上市后仍无法盈利、持续亏损、无法进行利润分配等情形。

本基金在追求科创板上市公司带来收益的同时，需承受相关公司带来的风险，本基金投资于科创板上市公司面临无法盈利甚至可能导致较大亏损的风险。

H、表决权差异风险：科创板制度允许上市公司设置表决权差异安排。上市公司可能根

据此项安排，存在控制权相对集中，以及因每一特别表决权股份拥有的表决权数量大于每一普通股份拥有的表决权数量等情形，而使本基金作为普通投资者的表决权受到限制。

I、股权激励风险：科创板上市公司的股权激励制度相对于主板上市公司更为灵活，包括股权激励计划所涉及的股票比例上限和对象有所扩大、价格条款更为灵活、实施方式更为便利。实施该等股权激励制度安排可能导致公司实际上市交易的股票数量超过首次公开发行时的数量，从而使本基金面临相关风险。

J、境外企业风险：符合相关规定的红筹企业发行的股票可以在科创板上市。红筹企业在境外注册，可能采用协议控制架构，在信息披露、分红派息等方面可能与境内上市公司存在差异。红筹公司注册地、境外上市地等地法律法规对当地投资者提供的保护，可能与境内法律为境内投资者提供的保护存在差异。本基金若投资于科创板上市的红筹企业，可能面临相关风险。

K、存托凭证风险：符合相关规定的红筹企业发行的存托凭证可以在科创板上市。存托凭证由存托人签发、以境外证券为基础在中国境内发行，代表境外基础证券权益。红筹公司存托凭证持有人实际享有的权益与境外基础证券持有人的权益虽然基本相当，但并不能等同于直接持有境外基础证券。本基金若投资于科创板上市的存托凭证，可能面临相关风险。

L、政策风险：国家对高新技术产业扶持力度及重视程度的变化会对科创板企业带来较大影响，国际经济形势变化对战略新兴产业及科创板个股也会带来政策影响。

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

## 8、法律风险

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

## 9、其他风险

- (1) 因技术因素而产生的风险，如电脑系统不可靠产生的风险；
- (2) 因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；
- (3) 因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈等行为产生的风险；
- (4) 对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；

(5) 因业务竞争压力可能产生的风险；

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

(7) 其他风险。

## (二) 声明

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

2、除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过中国农业银行股份有限公司等基金销售机构代理销售，基金管理人与基金销售机构都不能保证其收益或本金安全。

3、本基金法律文件投资章节有关风险收益特征的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述，代表了一般市场情况下本基金的长期风险收益特征。销售机构(包括基金管理人直销机构和其他销售机构)根据相关法律法规对本基金进行风险评价，不同的销售机构采用的评价方法也不同，因此销售机构的风险等级评价与基金法律文件中风险收益特征的表述可能存在不同，投资人在购买本基金时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。

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

## 十八、基金的终止与清算

### (一) 基金合同的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行，自决议生效之日起在指定媒体公告。

### (二) 基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

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6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；



4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### （三）基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现基金合同终止事由之日起30个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

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

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

#### 4、基金财产清算程序：

- （1）基金合同终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- （3）对基金财产进行估值和变现；
- （4）制作清算报告；
- （5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- （6）将清算报告报中国证监会备案并公告；
- （7）对基金财产进行分配。

#### 5、基金财产清算的期限为6个月。

### （四）清算费用

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

### （五）基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

### （六）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

### （七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

## 十九、基金合同的内容摘要

以下内容摘自《摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资基金基金合同》

### 【一】基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务

#### (一)基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

- (1) 依法募集基金；
- (2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 销售基金份额；
- (5) 召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据《基金合同》及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- (9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- (10) 依据《基金合同》及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；
- (11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- (12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- (13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；
- (14) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- (15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- (16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则；

- (17) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。
- 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：
- (1) 依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- (2) 办理基金备案手续；
- (3) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；
- (4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- (5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
- (6) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
- (7) 依法接受基金托管人的监督；
- (8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；
- (9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- (10) 编制季度、半年度和年度基金报告；
- (11) 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；
- (12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；
- (13) 按《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基金收益；
- (14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- (15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- (16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上；
- (17) 确保需要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《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合

理成本的前提下得到有关资料的复印件；

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

(19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

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

(21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

(23) 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实施其他法律行为；

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## (二) 基金托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

(1) 自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

(2) 依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(4) 根据相关市场规则，为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算；

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

- (1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；
- (2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
- (3) 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，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
- (4) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
- (5) 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；
- (6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- (7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；
- (8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；
- (9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (10) 对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- (11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料15年以上；
- (12) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (14) 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；
- (15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- (16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；
- (17) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；
- (19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管

理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### (三) 基金份额持有人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

(1) 分享基金财产收益；

(2) 参与分配清算后的剩余基金财产；

(3) 依法申请赎回其持有的基金份额；

(4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；

(5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；

(6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

(7) 监督基金管理人的投资运作；

(8) 对基金管理人、基金托管人、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；

(9) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

(1) 认真阅读并遵守《基金合同》；

(2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自行承担投资风险；

(3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；

(4) 缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

(5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；

(6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；

(7) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

(9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### 【二】基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

(一) 基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

(二) 召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止《基金合同》；
- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 转换基金运作方式；
- (5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- (6) 变更基金类别；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序；
- (10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

(11) 单独或合计持有本基金总份额10%以上（含10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

(12) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

(13) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- (1) 调低基金管理费、基金托管费；
- (2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率；
- (4) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- (5) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；
- (6) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

### (三) 召集人和召集方式

1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10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60日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集。

4、代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10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60日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额10%以上（含10%）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10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60日内召开。

5、代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前30日报中国证监会备案。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。

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

### (四) 召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前30日，在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- (1) 会议召开的时间、地点和会议形式；
- (2) 会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- (3) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- (4) 授权委托证明的内容要求（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；
- (5) 会务常设联系人姓名及联系电话；
- (6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- (7) 召集人需要通知的其他事项。



2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定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、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

#### (五) 基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，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，基金管理人或托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

(1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

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

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

(1) 会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后，在2个工作日内连续公布相关提示性公告；

(2) 召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议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；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

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

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

知的规定，并与基金登记注册机构记录相符；

(5) 会议通知公布前报中国证监会备案。

#### (六) 议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

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

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

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下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的50%以上（含50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议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）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

###### (2) 通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前30日公布提案，在所通知的表决截止日期后2个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

#### (六) 表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的50%以上（含50%）通过方为有效；除下列第2项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托

管人、终止《基金合同》以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

#### （七）计票

##### 1、现场开会

（1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

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

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

（4）计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

##### 2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

#### （八）生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会核准或者备案。

基金份额持有人大会的决议自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起2日内在指定媒体上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等

一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

### 【三】基金合同解除和终止的事由、程序

#### （一）《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行，自决议生效之日起在指定媒体公告。

#### （二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- 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6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；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

#### （三）基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

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

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

#### 4、基金财产清算程序：

- （1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- （3）对基金财产进行估值和变现；
- （4）制作清算报告；

(5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计, 聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书;

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告;

(7) 对基金财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为6个月。

(四) 清算费用

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

(五) 基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案, 将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后, 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

(六) 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告; 基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

(七) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

#### 【四】争议解决方式

各方当事人同意, 因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议, 如经友好协商未能解决的, 应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁, 仲裁地点为北京, 仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力, 仲裁费由败诉方承担。

《基金合同》受中国法律管辖。

#### 【五】基金合同存放地和投资者取得合同的方式

《基金合同》是约定基金当事人之间、基金与基金当事人之间权利义务关系的法律文件。

1、《基金合同》正本一式六份, 除上报有关监管机构一式二份外, 基金管理人、基金托管人各持有二份, 每份具有同等的法律效力。

2、《基金合同》可印制成册, 供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。

3、投资人还可以直接登录基金管理人的网站查阅和下载基金合同。

## 二十、基金托管协议内容摘要

### 一、基金托管协议当事人

#### (一) 基金管理人

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01-04室

法定代表人：YU HUA（于华）

成立时间：2003年3月14日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2003]33号

注册资本：22,750万元人民币

组织形式：有限责任公司

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务

存续期间：50年

电话：0755-88318883

传真：0755-82990384

联系人：赵婧

#### (二) 基金托管人

名称：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：北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座九层

邮政编码：100031

法定代表人：周慕冰

成立时间：2009年1月15日

基金托管资格批准文号：中国证监会证监基字[1998]23号

注册资本：32,479,411.7万元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债

券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；结汇、售汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；代理资金清算；各类汇兑业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；贷款承诺；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇借款；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；外汇票据承兑和贴现；自营、代客外汇买卖；外币兑换；外汇担保；资信调查、咨询、见证业务；企业、个人财务顾问服务；证券公司客户交易结算资金存管业务；证券投资基金托管业务；企业年金托管业务；产业投资基金托管业务；合格境外机构投资者境内证券投资托管业务；代理开放式基金业务；电话银行、手机银行、网上银行业务；金融衍生产品交易业务；经国务院银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督、核查

(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池和交易对手库，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

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（包括交易所和银行间两个市场的国债、金融债、企业债与可转换债、中期票据、短期融资券等）、银行存款、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规和中国证监会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）。

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

本基金不得投资于相关法律法规及《基金合同》禁止投资的投资工具。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的60%—95%；除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为5%—40%，其中权证资产占基金资产净值的比例范围为0—3%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

(二) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资、融券比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

- 1、本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的10%；
- 2、本基金与本基金管理人管理的、且由本基金托管人托管的其他基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过该证券的10%；
- 3、进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%；
- 4、本基金参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

5、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5%；本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；本基金与本基金管理人管理的其他基金持有的同一权证，不得超过该权证的10%；

6、本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过该基金资产净值的10%；本基金管理人管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过该基金资产净值的20%；

7、保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

8、本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

9、本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；

10、本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%；

其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

11、本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；

基金管理人应当按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等；

12、本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例范围为60%-95%；

13、本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；

14本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

15、本基金管理人管理的、且由本基金托管人托管的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的15%；本基金管理人管理的、且由本基金托管人托管的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%。

16、本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的15%。



因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。

17、本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致。

18、本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定；

19、法律法规、基金合同规定的其他比例限制；

20、法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

本基金在开始进行股指期货投资之前，应与基金托管人就股指期货清算、估值、交割等事宜另行具体协商。

除上述7、8、14、16、17以外，由于证券或期货市场波动、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比例不符合上述1-3项以及5-14项规定的投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

上述投资组合限制条款中，若属法律法规的强制性规定，则当法律法规或监管部门取消上述限制，在履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

基金托管人对基金投资的监督和检查自基金合同生效之日起开始。

（三）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对本协议第十五条第九项基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金禁止从事关联交易的规定，基金管理人和基金托管人相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公司名单及有关关联方证券名单。基金管理人和基金托管人有责任确保各名单的真实性、准确性、完整性，并负责及时将更新后的名单发送给对方。

若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时，基金托管人应及时提醒并协助基金管理人采取必要措施阻止该关联交易的发生，如基金托管人采取必要措施后仍无法阻止关联交易发生时，基金托管人有权向中国证监会报告。对于基金管理人已成交的关联交易，如基金托管人事前已严格遵循了监督流程仍无法阻止该关联交易的发生，而只能按相关法律法规和交易所规则进行事后结算，则基金托管人不承担由此造成的损失，并应向中国证监会报告。

（四）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单进行更新，如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单，应向基金托管人说明理由，在与交易对手发生交易

前3个工作日内与基金托管人协商解决。基金管理人收到基金托管人书面确认后，被确认调整的名单开始生效，新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督，但不承担交易对手不履行合同造成的损失。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

(五) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人选择存款银行进行监督。

基金投资银行定期存款的，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人应据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合有关规定进行监督。

本基金投资银行存款应符合如下规定：

1、基金管理人、基金托管人应当与存款银行建立定期对账机制，确保基金银行存款业务账目及核算的真实、准确。

2、基金托管人应加强对基金银行存款业务的监督与核查，严格审查、复核相关协议、账户资料、投资指令、存款证实书等有关文件，切实履行托管职责。

3、基金管理人与基金托管人在开展基金存款业务时，应严格遵守《基金法》、《运作办法》等有关法律法规，以及国家有关账户管理、利率管理、支付结算等的各项规定。

基金托管人发现基金管理人在选择存款银行时有违反有关法律法规的规定及基金合同的约定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人在10个工作日内纠正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在10个工作日内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人在10个工作日内纠正或拒绝结算。

(六) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

如果基金管理人未经基金托管人的审核擅自将不实的业绩表现数据印制在宣传推介材料上，则基金托管人对此不承担任何责任，并将在发现后立即报告中国证监会。

(七) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资流通受限证券进行监督。

1、基金投资流通受限证券，应遵守《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

2、流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公

开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

3、在首次投资流通受限证券之前,基金管理人应当制定相关投资决策流程、风险控制制度、流动性风险控制预案等规章制度。基金管理人应当根据基金流动性的需要合理安排流通受限证券的投资比例,并在风险控制制度中明确具体比例,避免基金出现流动性风险。上述规章制度须经基金管理人董事会批准。上述规章制度经董事会通过之后,基金管理人应当将上述规章制度以及董事会批准上述规章制度的决议提交给基金托管人。

4、在投资流通受限证券之前,基金管理人应至少提前一个交易日向基金托管人提供有关流通受限证券的相关信息,具体应当包括但不限于如下文件(如有):

拟发行数量、定价依据、监管机构的批准证明文件复印件、基金管理人与承销商签订的销售协议复印件、缴款通知书、基金拟认购的数量、价格、总成本、划款账号、划款金额、划款时间文件等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整。

5、基金托管人在监督基金管理人投资流通受限证券的过程中,如认为因市场出现剧烈变化导致基金管理人的具体投资行为可能对基金财产造成较大风险,基金托管人有权要求基金管理人对该风险的消除或防范措施进行补充和整改,并做出书面说明。否则,基金托管人经事先书面告知基金管理人,有权拒绝执行其有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的,基金托管人不承担任何责任,并有权报告中国证监会。

6、基金管理人应保证基金投资的受限证券登记存管在本基金名下,并确保基金托管人能够正常查询。因基金管理人原因产生的受限证券登记存管问题,造成基金财产的损失或基金托管人无法安全保管基金财产的责任与损失,由基金管理人承担。

7、如果基金管理人未按照本协议的约定向基金托管人报送相关数据或者报送了虚假的数据,导致基金托管人不能履行托管人职责的,基金管理人应依法承担相应法律后果。除基金托管人未能依据基金合同及本协议履行职责外,因投资流通受限证券产生的损失,基金托管人按照本协议履行监督职责后不承担上述损失。

(八)基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作中违反法律法规和基金合同的规定,应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函,就基金托管人的疑义进行解释或举证,说明违规原因及纠正期限,并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内,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。基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当立即通知基金管理人,并报告中国证监会。

(九)基金管理人应配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示,基金管理人应在规定时间内答复并改正,或就基金托管人的疑义进行解释或举证;对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报

送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

(十)除上述第(七)项外，基金托管人发现基金管理人有其他重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由，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，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

### 三、基金管理人对基金托管人的业务核查

(一)基金管理人对基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户、证券账户和期货账户。复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

(二)基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定时，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在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，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。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

(三)基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。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，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

### 四、基金财产的保管

#### (一)基金财产保管的原则

- 1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- 2、基金托管人应安全保管基金财产。未经基金管理人依据合法程序作出的合法合规指令，基金托管人不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。
- 3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户、证券账户和期货账户。
- 4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。
- 5、基金托管人根据基金管理人的指令，按照基金合同和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。
- 6、对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金托管人对此不承担任何责任。

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

## （二）基金募集期间及募集资金的验资

1、基金募集期间的资金应存于基金管理人在具有托管资格的商业银行开设的基金认购专户。该账户由基金管理人开立并管理。

2、基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金托管资金账户，同时在规定时间内，聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的2名或2名以上中国注册会计师签字方为有效。

3、若基金募集期限届满，未能达到基金合同生效的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜，基金托管人应提供充分协助。

## （三）基金资金账户的开立和管理

1、基金托管人应负责本基金的资金账户的开设和管理。

2、基金托管人可以本基金的名义在其营业机构开设本基金的资金账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。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、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的资金账户进行。

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

4、基金托管资金账户的开立和管理应符合相关法律法规的有关规定。

5、在符合法律法规规定的条件下，基金托管人可以通过基金托管人专用账户办理基金资产的支付。

## （四）基金证券账户的开立和管理

1、基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户。

2、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或未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户，亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3、基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

4、基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

5、在本托管协议生效日之后，本基金被允许从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开设、使用的，按有关规定开设、使用并管理；若无相关规定，则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

#### （五）债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司的有关规定，以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司开立债券托管与结算账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。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。

#### （六）其他账户的开立和管理

1、因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和基金合同的规定，在基金管理人和基金托管人商议后由基金托管人负责开立。新账户按有关规则使用并管理。

2、法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### （七）基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人负责妥善保管，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。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。托管人对托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

#### （八）与基金财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管理人、基金托管人保管。除协议另有规定外，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。重大合同的保管期限为基金合同终止后15年。

### 五、基金资产净值计算与复核

#### （一）基金资产净值的计算及复核程序

##### 1、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的净资产值。

基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数后得到的基金份额的资产净值。基金份额净值的计算，精确到0.001元，小数点后第四位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。国家另有规定的，从其规定。

每工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

##### 2、复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，将基金份额净值计算结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人依据基金合同和相关法律法规的规定对外公布。

## （二）基金资产估值方法和特殊情形的处理

### 1、估值对象

基金依法拥有的股票、债券、权证及其他基金资产和负债。

### 2、估值方法

#### （1）证券交易所上市的有价证券的估值

1) 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（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，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

2) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

3) 交易所上市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；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券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。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

4) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，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，按成本估值。

#### （2）处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，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) 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，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

（3）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。

（4）因持有股票而享有的配股权，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。

(5) 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。

(6) 股指期货合约一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

(7) 如有确凿证据表明按上述方法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与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(8) 相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。以约定的方法、程序和相关法律法规的规定进行估值，以维护基金份额持有人的利益。

### 3、特殊情形的处理

基金管理人、基金托管人按估值方法的第(7)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。

#### (三) 基金份额净值错误的处理方式

(1) 当基金份额净值小数点后3位以内(含第3位)发生差错时，视为基金份额净值错误；基金份额净值出现错误时，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；错误偏差达到或超过基金资产净值的0.25%时，基金管理公司应当及时通知基金托管人并报中国证监会；错误偏差达到基金份额净值的0.50%时，基金管理人应当公告、通报基金托管人并报中国证监会备案；当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，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。

(2) 当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

①本基金的基金会计责任方由基金管理人担任。与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金会计责任方的建议执行，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付。

②若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明，基金份额净值出错且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对基金份额持有人或基金支付赔偿金，就实际向基金份额持有人或基金支付的赔偿金额，其中基金管理人承担50%，基金托管人承担50%。

③如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对



外公布，如基金托管人在核对中已提出正确意见而基金管理人未采纳的，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付。

④由于基金管理人提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金额等），基金托管人在履行正常复核程序后仍不能发现该错误，进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金财产的损失，由基金管理人负责赔付。

（3）由于证券交易所、登记结算公司发送的数据错误，有关会计制度变化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，但是未能发现该错误而造成的基金份额净值计算错误，基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

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

（5）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。如果行业有通行做法，双方当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

#### （四）基金账册的建立

基金管理人进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。基金管理人独立地设置、记录和保管本基金的全套账册。若基金管理人和基金托管人对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

#### （五）基金财务报表与报告的编制和复核

##### 1、财务报表的编制

基金管理人应当及时编制并对外提供真实、完整的基金财务会计报告。月度报表的编制，基金管理人应于每月终了后 5 个工作日内完成；招募说明书在基金合同生效后每 6 个月更新并公告一次，于该等期间届满后 45 日内公告。季度报告应在每个季度结束之日起 15 个工作日内编制完毕并予以公告；半年度报告在会计年度半年终了后 60 日内编制完毕并予以公告；年度报告在会计年度结束后 90 日内编制完毕并予以公告。基金合同生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

##### 2、报表复核

基金管理人在月度报表完成当日，将报表盖章后提供给基金托管人复核；基金托管人在收到后应在 3 日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 7 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在半年度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 30 日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人应在收

到后45日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以加密传真的方式或双方商定的其他方式进行。

基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准；若双方无法达成一致，以基金管理人的账务处理为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖托管业务部门公章或者出具加盖托管业务专用章的复核意见书，双方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报中国证监会备案。

## 六、基金份额持有人名册的登记与保管

本基金的基金管理人和基金托管人须分别妥善保管的基金份额持有人名册，包括基金合同生效日、基金合同终止日、基金份额持有人大会权益登记日、每年6月30日、12月31日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容至少应包括持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由登记机构编制，由基金管理人审核并提交基金托管人保管。基金托管人有权要求基金管理人提供任意一个交易日或全部交易日的基金份额持有人名册，基金管理人应及时提供，不得拖延或拒绝提供。

基金管理人应及时向基金托管人提交基金份额持有人名册。每年6月30日和12月31日的基金份额持有人名册应于下月前十个工作日内提交；基金合同生效日、基金合同终止日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册应于发生后十个工作日内提交。

基金管理人和基金托管人应妥善保管基金份额持有人名册，保存期限为15年。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

## 七、争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，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。

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本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

## 八、托管协议的修改与终止

### （一）托管协议的变更程序

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。基金托管协议的变更报中国证监会核准后生效。

## （二）基金托管协议终止的情形

- 1、基金合同终止；
- 2、基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；
- 3、基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权；
- 4、发生法律法规或基金合同规定的终止事项。

## （三）基金财产的清算

### 1、基金财产清算小组

(1)基金合同终止后，成立基金清算小组，基金清算小组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、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用必要的工作人员。

(3)在基金财产清算过程中，基金管理人和基金托管人应各自履行职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

(4)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、基金财产清算程序

- (1)基金合同终止时，由基金清算小组统一接管基金财产；
- (2)对基金财产进行清理和确认；
- (3)对基金财产进行估价和变现；
- (4)编制清算报告；
- (5)聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- (6)聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (7)将基金清算结果报告中国证监会；
- (8)公布基金清算报告；
- (9)对基金剩余财产进行分配。

### 3、清算费用

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

### 4、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。

基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

5、基金财产清算的期限为6个月。

6、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算小组报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后5个工作日内由基金清算小组公告。

7、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

## 二十一、对基金份额持有人的服务

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

### (一) 网上交易服务

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

### (二) 网上查询服务

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

### (三) 服务产品的定制及发送

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

1、对账单服务：基金管理人将按照投资人需求，提供电子邮件账单及短信账单。对于未选择账单寄送方式的投资人，基金管理人将默认提供电子邮件账单。投资人可通过拨打基金管理人客服电话、登录基金管理人网站、发送电子邮件或短信等方式向基金管理人主动定制短信账单。

若投资人因特殊原因需要获取指定期间的纸质对账单，可拨打本公司客服热线400-8888-668（免长途话费）按“9”转人工服务，提供姓名、开户证件号码或基金账号、持

有基金名称、购买销售机构、邮寄地址、联系电话，客服人员核对信息无误后，将通过平信方式为投资人免费邮寄纸质对账单。

对账单服务发送规则：如投资人成功定制电子邮件账单或短信账单，基金管理人将在每月初5个工作日内发送。

2、免费定制信息：投资人可定制的信息包括：基金份额净值、基金视窗等信息。基金管理人可通过邮件或短信方式向投资人发送所定制的信息。

#### （四）在线客服服务

投资人可登录基金管理人网站（<http://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（节假日除外）。

#### （五）客户服务中心电话服务

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

客户服务中心人工座席提供周一至周五（节假日除外），每天不少于8小时的座席服务，投资人可通过该电话查询认购、申购和赎回等交易情况、基金账户余额、信息定制、资料修改、服务投诉及获得其他业务咨询等专项服务。

#### （六）客户投诉处理

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

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

#### （七）服务联系方式

基金管理人网址：<http://www.msfnunds.com.cn>

客服电子信箱：[services@msfnunds.com.cn](mailto:services@msfnunds.com.cn)

全国统一客服电话：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层摩根士丹利华鑫基金客户服务中心

邮编：518048

## 二十二、其他应披露事项

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	本公司关于直销网上交易停止受理汇付天下天天盈渠道认申购、定投业务的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券日报》	2018年12月25日
2	本公司关于旗下部分基金参与中投证券费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券日报》	2018年12月27日
3	本公司关于旗下部分基金参与中国农业银行股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券日报》	2018年12月28日
4	本公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券日报》	2018年12月29日
5	本公司关于旗下部分基金参与国信证券费率优惠活动的公告	《证券时报》	2019年1月15日
6	本基金2018年4季度报告	《证券时报》	2019年1月21日
7	本证券投资基金招募说明书（更新）（2018年第2号）	《证券时报》	2019年1月23日
8	本公司关于暂停大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关业务的公告	《证券时报》	2019年1月30日
9	本公司关于旗下基金停牌股票估值调整情况的公告	《证券时报》	2019年2月1日
10	本公司关于网上交易停止受理银联通建行渠道认申购、定投业务的公告	《证券时报》	2019年2月2日
11	本公司关于旗下部分基金增加腾安基金销售（深圳）有限公司为销售机构并参与费率优惠活动的公告	《证券时报》	2019年2月14日
12	本公司关于旗下基金停牌股票估值调整情况的公告	《证券时报》	2019年2月22日
13	本公司关于旗下基金停牌股票估值调整情况的公告	《证券时报》	2019年3月6日
14	本基金2018年年度报告	《证券时报》	2019年3月27日
15	本公司高级管理人员变更公告	《证券时报》	2019年3月30日

16	本公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司手机银行申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	《证券时报》	2019年4月1日
17	本公司关于旗下部分基金继续参与工商银行电子银行申购费率优惠活动的公告	《证券时报》	2019年4月1日
18	本基金 2019 年 1 季度报告	《证券时报》	2019年4月20日
19	本公司高级管理人员变更公告	《证券时报》	2019年4月27日
20	本公司关于旗下部分基金参与民生银行直销银行费率优惠活动的公告	《证券时报》	2019年5月16日
21	本公司关于旗下基金增加上海华夏财富投资管理有限公司为销售机构并参与费率优惠活动的公告	《证券时报》	2019年5月21日
22	本公司高级管理人员变更公告	《证券时报》	2019年5月24日

### 二十三、招募说明书的存放及查阅方式

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

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

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

### 二十四、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

二〇一九年七月二十四日