摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金招募说明书（更新）摘要

（2010年第2号）

基金管理人：摩根士丹利华鑫基金管理有限公司
基金托管人：中国光大银行

重要提示

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

本基金的基金合同已经根据《中华人民共和国证券投资基金法》、证券投资基金运作管理办法》、证券投资基金销售管理办法》、证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关规定进行修订。修订后的基金合同已于2004年10月20日开始生效，基金合同全文已登载于本基金管理人网站。

投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读本基金的招募说明书；基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、证作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本招募说明书（更新）摘要所载内容截止日为2010年9月26日，有关财务数据和净值表现截止日为2010年9月30日（财务数据未经审计）。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：摩根士丹利华鑫基金管理有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第二座第十七层01-04室

办公地址：广东省深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场一期二座17楼

法定代表人：王文学

成立时间：2003年3月14日

注册资本：1亿元人民币

电话：0755）88318883

联系人：赵婧

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

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

（二）主要人员情况

1、董事会成员

王文学先生，英国格林威治大学项目管理硕士。2000年12月至今任华鑫证券有限责任公司董事长。1993年7月至2000年12月任西安证券有限责任公司副总经理、总经理、董事长。曾于人民银行西安分行担任体改、外汇管理、稽核副处长。现任本公司董事长。

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

Navtej Singh Nandra先生，印度Indian Institute of Management，Ahmedahad工商管理硕士。2010年6月至今任摩根士丹利董事总经理及投资管理国际业务主管，曾为博思艾伦咨询公司合伙人、副总裁，美林证券高级副总裁、董事合伙人、投行业务的首席运营官、财富管理的首席运营官。现任本公司董事。

于华先生，北京大学经济学学士，比利时鲁汶大学工商管理硕士、金融博士，美国注册金融分析师（CFA）。曾任英国里丁大学经济系金融财务讲师，加拿大魁北克大学管理学院金融终身教授，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，摩根士丹利投资管理公司董事总经理、中国业务主管。现任本公司董事、总经理；兼任中国证券业协会基金业委员会副主任委员、国际资产管理协会董事。

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

宋斌先生，中央党校经济管理研究生。2001年至今任华鑫证券有限责任公司副总经理兼投资银行总部总经理等职。曾任首钢总公司、首钢机电公司、首钢设计院等部门负责人，国家经济贸易委员会办公厅信息调研处处长、委主任办公室副主任。现任本公司董事。

洪小源先生，北京大学经济学硕士，澳大利亚国立大学科学硕士。2007年5月至今任招商局金融集团有限公司董事总经理，兼任招商银行股份有限公司、招商证券股份有限公司、招商局中国基金有限公司、招商能源运输股份有限公司、中诚信托有限责任公司、长城证券有限公司董事，并任招商局中国投资管理有限公司、海达远东保险顾问有限公司、招商局保险有限公司、深圳市招融投资控股有限公司、深圳新江南投资有限公司和招商局（英国）控股有限公司董事长。曾就职于国家经济体制改革委员会综合规划司、深圳龙蕾实业股份有限公司。现任本公司董事。

张瀚涛先生，英国兰开夏大学文学学士，拉夫堡大学文学硕士。2007年9月至今任深圳市中技实业（集团）有限公司金融事业部经理助理。现任本公司董事。

宋文琪女士，台湾东吴大学外文系文学士，台湾政治大学商学院商学硕士。曾任怡富证券投资顾问公司行政经理、基金部经理、副总经理、总经理、董事长、台湾区负责人及大中华区基金营销总监，怡富证券投资信托公司执行副总经理、总经理，汇丰投资管理集团台湾区负责人暨亚太区共同基金资深顾问。现任本公司独立董事。

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

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

陈宏民先生，上海交通大学博士，加拿大英属哥伦比亚大学博士后。现任上海交通大学安泰经济与管理学院副院长、博士生导师。曾任上海新联纺织品进出口公司职工大学教师。现任本公司独立董事。

何斐先生，美国南方卫理会大学法学博士。现任北京市海问律师事务所合伙人。曾任教于北京大学法律系。现任本公司独立董事。

2、监事会成员

陈海东先生，南开大学经济学学士，上海财经大学经济学硕士。2009年6月至今任华鑫证券有限责任公司合规总监，曾任天津市住房公积金管理中心主管会计、厦门国际信托投资公司天津证券营业部部门副经理、天同证券有限责任公司资产管理部投资经理，兴安证券有限责任公司资产管理部副总经理，华鑫证券有限责任公司财务部副总经理、客户资产存管中心总经理。现任本公司监事长。

顾慧文女士，加拿大约克大学文学士。2007年4月至今任摩根士丹利投资管理执行董事及营运风险经理。曾任摩根士丹利亚洲有限公司私人财富管理销售助理、私人财富管理分行经理。现任本公司监事。

吕联贺先生，香港中文大学工商管理硕士。2005年至今任招商局中国投资管理有限公司投资经理、高级投资经理。曾就职于中国网络资本有限公司、肯特吉有限公司、可口可乐中国有限公司、墨克沙东药厂、Chemtron Technology Limited。现任本公司监事。

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

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

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

3、公司高管人员

于华先生，总经理，简历同上。

徐卫先生，北京大学经济管理系硕士、具有法律职业资格证书。17年证券基金行业监管工作经历。先后在中国证监会深圳监管局政策法规处、市场处、机构监管处、基金监管处、机构监管二处等部门工作，历任副主任科员、主任科员、副处长、处长等职务。现任本公司副总经理。

秦红女士，北京大学国民经济管理学学士，具有12年基金从业经历。曾任职博时基金管理有限公司行政管理部经理、市场发展部经理、北京分公司总经理，易方达基金管理有限公司北京分公司总经理，工银瑞信基金管理有限公司渠道销售部总监。现任本公司副总经理；兼任中央财大理财规划师培训班基金讲师。

李锦女士，吉林大学经济管理学院国际金融专业硕士研究生。13年证券基金从业经验。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年起就职于本公司，曾任基金运营部副总监、总监，总经理助理兼基金运营部总监。现任本公司督察长。

4、本基金基金经理

基金经理：李君先生，东北财经大学工商管理硕士，11年证券基金从业经验。曾任大连证券深圳投资研究中心研究部经理、巨田证券有限责任公司研究所研究员、行业部副经理。2007年1月加入本公司，历任首席策略师、投资管理部高级研究员。2009年8月起任本公司本基金基金经理。

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

5、投资决策委员会成员

主任委员：于华先生，本公司董事、总经理。

委员：陈晓先生，总经理助理兼投资管理部总监；钱辉先生，总经理助理兼金融工程和风险控制部总监、固定收益投资部总监、摩根士丹利华鑫强收益债券型证券投资基金基金经理；袁航女士，研究总监；何滨女士，基金投资部副总监兼摩根士丹利华鑫资源优选混合型证券投资基金（LOF）和摩根士丹利华鑫卓越成长股票型证券投资基金基金经理。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人基本情况

1、基本情况

名称：中国光大银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦

办公地址：北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦

法定代表人：唐双宁

成立时间：1992年8月18日

注册资本：282.1689亿元人民币

电话：0010）68560675

联系人：石立平

2、主要人员情况

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

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

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

3、基金托管业务经营情况

截止2010年9月30日，中国光大银行股份有限公司共托管国投瑞银融华债券型基金、摩根士丹利华鑫基础行业基金、国投瑞银景气行业基金、泰信先行策略基金、光大保德信量化核心基金、大成货币市场基金、摩根士丹利华鑫资源优选混合型基金（LOF）、招商安本增利债券型基金、国投瑞银创新动力基金、大成策略回报基金等共10只证券投资基金，托管基金资产规模351.82亿元。同时，开展了证券公司集合理财计划、信托公司资金信托计划、QDII、定向委托资产、企业年金基金等资产的托管业务。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构

①摩根士丹利华鑫基金管理有限公司直销中心

办公地址：深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场一期二座17楼

联系人：翟妍莉

电话：0755）88318898

传真：0755）82990631

全国统一客服电话：400-8888-668

②摩根士丹利华鑫基金管理有限公司北京分公司

办公地址：北京市西城区太平桥大街18号丰融国际大厦1005室

联系人：朱勇

电话：0010）66155568

传真：0010）66158135

③摩根士丹利华鑫基金管理有限公司上海办事处

办公地址：上海市卢湾区桃源路85号永银大厦1202室

联系人：柴阳

电话：021）63343311

传真：021）63343988

④摩根士丹利华鑫基金管理有限公司网上直销系统

交易系统网址：https://etrade.msfunds.com.cn/etrading

目前支持的网上直销银行卡：建设银行储蓄卡、招商银行“一卡通”借记卡、兴业银行银联卡、浦发银行卡、中信银行卡和光大银行卡。

客户服务信箱：Services@msfunds.com.cn

深圳、北京或上海的投资人单笔认（申）购金额超过100万元（含100万元）人民币以上的，可拨打直销中心的上述电话进行预约，本公司将提供上门服务。

2、代销机构

①中国光大银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦

办公地址：北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦

法定代表人：唐双宁

电话：0010）68098778

联系人：薛军丽

联系电话：0010）68098777

客服电话：95595

网址：www.cebbank.com

②中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：郭树清

客户服务电话：95533

网址：www.ccb.com

③中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人：肖钢

联系人：王圣明

电话：0010）66594911

客户服务电话：95566

网址：www.boc.cn

④招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人：秦晓

客户服务电话：95555

网址：www.cmbchina.com

⑤中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人：孔丹

客户服务电话：95558

网址：bank.ecitic.com

⑥平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南中路1099号平安银行大厦

办公地址：深圳市深南中路1099号平安银行大厦

法定代表人：孙建一

联系人：蔡宇洲

联系电话：0755）25859591

客户服务电话：400-6699-999

网址：bank.pingan.com

⑦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：上海市肇嘉浜路750号

法定代表人：王文学

联系人：杨小江

联系电话：021）64339000

客户服务电话：021）32109999，029）68918888

网址：www.cfsc.com.cn

⑧中信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层

办公地址：北京市朝阳区新源南路6号京城大厦3层

法定代表人：王东明

联系人：陈忠

联系电话：010）84683893

网址：www.cs.ecitic.com

⑨中信建投证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市东城区朝内大街188号

法定代表人：张佑君

联系人：权唐

联系电话：010）85130577

客户服务电话：400-8888-108（免长途费）

网址：www.csc108.com

⑩申国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人：胡关金

联系人：李洋

电话：010）66568047

客户服务电话：400-888-8888

网址：www.chinastock.com.cn

⑪信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层

办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：张志刚

联系人：唐静

联系电话：010）63080985

客户服务电话：400-800-8899

网址：www.cindasc.com

⑫宏源证券股份有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市建设路2号

办公地址：北京市西城区太平桥大街19号宏源证券

法定代表人：冯戎

联系人：李巍

联系电话：010）88085858

客户服务电话：4008-000-562

网址：http://www.hysec.com

⑬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：李英鸣

联系电话：021）23219000

客户服务电话：400-8888-001、95553

网址：www.htsec.com

⑭国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路618号

办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼

法定代表人：祝幼一

联系人：芮敏祺

联系电话：021）38676161

客户服务电话：400-8888-666

网址：www.gtja.com

⑮申银万国证券股份有限公司

注册地址：上海市常熟路171号

办公地址：上海市常熟路239号

法定代表人：丁国荣

联系人：曹晔

联系电话：021）54047892

客户服务电话：021）962505

网址：www.sywg.com

⑯光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闸路1508号

办公地址：上海市静安区新闸路1508号

法定代表人：徐浩明

联系人：刘晨、李芳芳

联系电话：021）22169999

客户服务电话：400-8888-788、10108998

网址：www.ebscn.com

⑰兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路99号标力大厦

办公地址：浦东新区民生路1199弄证大·五道口广场1号楼21层

法定代表人：兰荣

联系人：谢高得

联系电话：021）38565785

客户服务电话：400-8888-123

网址：www.xyzq.com.cn

⑱长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

办公地址：上海市世纪大道1589号长泰国际金融中心21F

法定代表人：胡运钊

联系人：李良

联系电话：021）68751929

客户服务电话：4008-888-999、027）85808318

网址：www.95579.com

⑲中银国际证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39楼

办公地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39-40楼

法定代表人：唐新宇

联系人：张静

联系电话：021）68604866

客户服务电话：400-620-8888

网址：www.bocichina.com

⑳湘财证券有限责任公司

注册地址：长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼

办公地址：长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼

法定代表人：林俊波

联系人：钟康莺

联系电话：021）68634518

客户服务电话：400-888-1551

网址：www.xcsc.com

㉑华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

办公地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

联系人：李杰

联系电话：025）83290838

客户服务电话：95597

网址：www.htsc.com.cn

㉒齐鲁证券有限公司

注册地址：山东省济南市经十路128号

办公地址：济南市经十路17703号华特广场B516室

法定代表人：李玮

联系人：王霖

联系电话：0531）81283906

客户服务电话：95538

网址：www.qlzq.com.cn

㉓山西证券股份有限公司

注册地址：山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼

办公地址：山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼

法定代表人：侯巍

联系人：张治国

联系电话：0351）8686703

客户服务电话：400-666-1618

网址：www.i618.com.cn

㉔东海证券有限责任公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18、19楼

办公地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18、19楼

法定代表人：朱科敏

联系人：李（涛）

联系电话：0519）88157761

客户服务电话：400-888-8588

网址：www.longone.com.cn

㉕东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州工业园区翠园路181号商旅大厦

办公地址：苏州工业园区翠园路181号商旅大厦

法定代表人：吴永敏

联系人：方晓丹

联系电话：0512）65581136

客户服务电话：0512）33396288

网址：www.dwzq.com.cn

㉖方正证券有限责任公司

注册地址：湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层

办公地址：湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层

法定代表人：雷杰

联系人：彭博

联系电话：0731）85832343

客户服务电话：95571

网址：www.founder.sc.com

㉗万国证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

办公地址：深圳市福田区深南大道凤凰大厦1栋9层

法人代表人：牛冠兴

联系人：陈剑虹

联系电话：0755）82558305

网址：www.essence.com.cn

㉘中国建银投资证券有限责任公司

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层至20层

办公地址：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层至20层

法定代表人：杨明辉

联系人：杨瑞芳

联系电话：0755）82026511

客户服务电话：400-600-8008

网址：www.cjis.cn

㉙招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层

法定代表人：宫少林

联系人：林生迎

联系电话：0755）82960223

客户服务电话：400-8888-111、0755）26951111

网址：www.newone.com.cn

㉚）国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦九楼

法定代表人：何如

联系人：齐晓燕

联系电话：0755）82130833

客户服务电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

㉛华泰联合证券有限责任公司

注册地址：深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦10、24、25层

办公地址：深圳市福田区深南大道4011号香港中旅大厦24楼

法定代表人：马昭明

联系人：盛宗凌

联系电话：0755）82492000

客户服务电话：400-8888-555、0755）25125666

网址：www.lhzq.com

㉜广发证券股份有限公司

注册地址：广州市天河北路183号大都会广场43楼

办公地址：广州天河北路大都会广场36、38、41和42层

法定代表人：王志伟

联系人：黄岚

联系电话：020）87555888-333

客户服务电话：95575

网址：www.gf.com.cn

㉝广发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、8、10层

法定代表人：黄金琳

联系人：张腾

联系电话：0591）87841160

客户服务电话：96326（福建省外请加拨0591）

网址：www.gfhfzq.com.cn

3、其他代销机构

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

（二）注册登记机构

名称：摩根士丹利华鑫基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第二座第十七层01-04室

办公地址：深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场一期二座17楼

法定代表人：王文学

联系人：邢思宁

电话：0755）88318720

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：北京市金杜律师事务所

注册地址：北京市朝阳区东三环中路39号建外SOHU A座31层

办公地址：北京市朝阳区东三环中路39号建外SOHU A座31层

负责人：王玲

联系人：冯艾

电话：010）58785588、0755）22163333

经办律师：宋萍萍、靳庆军

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦1604-1608室

办公地址：上海湖滨路202号普华永道中心11楼

法人代表：杨绍信

联系人：陈（宇）

联系电话：021）23233834

经办注册会计师：汪（棣、陈（宇）

四、基金的名称

本基金名称：摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型：混合型证券投资基金

六、基金的投资目标

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

七、基金的投资方向

本基金的投资对象为国内证券市场依法发行上市的A股、债券及经中国证监会批准的允许本基金投资的其他金融工具，其中投资于基础行业类股票的比例不低于股票资产的80%。

八、基金的投资策略

1、投资决策依据

①决策依据的主要内容

1）国家有关法律、法规和基金合同的有关规定；

2）国内外宏观经济发展状况、上市公司的经济运行状况；

3）国家财政政策、货币政策、产业政策；

4）证券市场政策环境、市场资金供求状况、投资者状况；

5）股资品种的预期收益率和风险水平；

6）影响证券市场未来走势的其他因素。

②决策依据的主要来源

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

③决策依据的主要用途

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

2、投资决策机制

①决策架构

本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会负责制定基金的投资原则、投资目标及整体资产配置策略和风险控制策略，并对基金经理进行授权。基金经理在投资决策委员会的授权范围内行使投资管理权限。

②决策支持

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

3、投资管理流程

①研究团队充分利用外部和内部的研究资源提供研究成果，挖掘投资机会，为投资决策委员会及基金投资组合管理提供研究依据。

②投资决策委员会定期或不定期召开会议，依据研究团队及基金经理提交的各类研究报告、投资策略或组合方案，以及金融工程团队提供的风险监测指标等，制定基金的投资原则、投资目标及整体资产配置策略和风险控制策略。如遇重大事项，投资决策委员会及时召开临时会议做出决议。

③基金经理在投资决策委员会的授权范围内，根据投资决策委员会的决定，参考金融工程团队的建议和市场销售团队适时提供的申购赎回预测，构建具体的投资方案并组织实施。超过基金经理权限的，经履行批准程序后实施。每位基金经理可配备若干名基金经理助理协助其开展工作。

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

⑤投资风险管理团队由金融工程团队和监察稽核团队组成，金融工程团队定期或不定期地对基金投资风险进行评估；监察稽核团队对基金投资的合规性进行日常监控；风险管理委员会根据投资风险管理团队提供的报告及市场变化对基金投资组合进行风险评估，并提出风险防范措施。

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

⑦本基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据市场环境变化和实际需要调整上述投资流程。

4、投资组合管理的方法和标准

本基金采用“自上而下”为主、结合“自下而上”的投资方法，将资产管理策略体现在资产配置、行业配置、股票选择和债券选择的过程中。

①一级资产配置

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

a、国家有关法律、法规和基金契约的有关规定；

b、国内外宏观经济环境及相关指标，包括GDP增长率、消费需求变化趋势、进出口增长变化趋势、总投资变化趋势；

c、国家财政政策包括国债发行趋势、政府财政收支状况、税收政策及政府转移支付政策等；

d、国家货币政策、利率走势及通货膨胀预期、物价变化趋势；

e、国家产业政策、产业投资增长变化、投入产出状况；

f、各地区、各行业发展状况；

g、证券市场政策环境、市场资金供求状况、投资者状况及市场发展趋势。

在正常市场情况下，股票投资比例浮动范围：基金净值的50%—75%；债券投资比例浮动范围：基金净值的20%—45%；现金资产比例浮动范围：基金净值的5%—20%。当市场出现极端情况，系统性风险超出正常水平时，投资比例可作一定调整，但在十个交易日内，投资比例将恢复到正常市场情况下的水平。

2）根据本基金管理人关于旗下基金权证投资方案：

a、本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的千分之五；

b、本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的百分之三；

c、公司管理的全部基金持有的同一权证不得超过该权证的百分之十。

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

②二级资产配置

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

二级资产配置主要依据的内容按重要性排列如下：

1）各行业增长与GDP增长的相关性分析；

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

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

4）行业内上市公司规模和可投资容量分析，这里须结合行业内股票选择结果进行。

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

③股票投资策略：

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

精选个股主要采用自下而上的方法：根据基础行业股票综合评级系统对备选库股票进行评级排序。选股的标准主要是针对基础行业特点，对上市公司进行财务状况分析、内在价值分析和相对价值分析，研究内容包括上市公司核心竞争力、持续经营能力、公司治理结构、未来经营状况和现金流、财务状况和相对价值等方面。以持续盈利和稳定增长为核心标准，对上市公司进行分行业综合评级。

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

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

④债券投资策略

我们以“类别资产配置、久期管理”为核心，通过“自上而下”的投资策略，以长期利率趋势分析为基础，兼顾中短期经济周期、政策方向等因素在类别资产配置、不同市场间的资产配置券种选择三个层面进行投资管理；并结合使用“自下而上”的投资策略，即收益率曲线分析、久期管理、新债分析、信用分析、流动性分析等方法，实施动态投资管理，动态调整组合的投资品种，以达到预期投资目标。

1）自上而下的投资策略

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

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

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

2）自下而上的投资策略

a. 久期管理

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

b. 收益率曲线结构配置

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

⑤权证投资策略

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

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

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

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：

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

复合指数=（上证A股流通市值/A股总流通市值）×上证综指+（深证A股流通市值/A股总流通市值）×深证综指

十、基金的风险收益特征

追求基金资产长期稳定增值，风险属于中低水平。

十一、基金的投资组合报告

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

基金托管人中国光大银行根据本基金合同规定，于2010年10月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	72,357,754.09	72.60
	其中：股票	72,357,754.09	72.60
2	固定收益投资	23,171,065.20	23.25
	其中：债券	23,171,065.20	23.25
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	2,431,505.28	2.44
6	其他各项资产	1,699,627.13	1.71
7	合计	99,659,951.70	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	9,063,100.00	9.32
C	制造业	51,964,758.89	53.42
C0	食品、饮料	7,327,491.48	7.53
C1	纺织、服装、皮毛	1,833,117.41	1.88
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	1,529,200.00	1.57
C5	电子	5,818,500.00	5.98
C6	金属、非金属	7,987,300.00	8.21
C7	机械、设备、仪表	23,550,860.00	24.21
C8	医药、生物制品	1,143,090.00	1.18
C99	其他制造业	2,775,200.00	2.85
D	电力、煤气及水的生产和供应业	646,800.00	0.66
E	建筑业	348,000.00	0.36
F	交通运输、仓储业	1,050,000.00	1.08
G	信息技术业	2,907,000.00	2.99
H	批发和零售贸易	2,010,202.60	2.07
I	金融、保险业	106,500.00	0.11
J	房地产业	-	-
K