摩根士丹利华鑫多因子精选策略股票型证券投资基金招募说明书

基金管理人:摩根士丹利华鑫基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司

【重要提示】

摩根士丹利华鑫多因子精选策略股票型证券投资基金(以下简称"本基金")于2011年3月10日经中国证券监督管理委员会证监许可[2011]356号文核准募集。

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价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险,投资人认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

本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,投资人在投资本基金前,应仔细阅读基金合同、本招募说明书,全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,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,本基金的特定风险,等等。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。

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。

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》")和其他有关法律法规的规定,以及《摩根士丹利华鑫多因子精选策略股票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多因子精选策略股票型证券投资基金的投资目标、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内容、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:指摩根士丹利华鑫多因子精选策略股票型证券投资基金
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:指中国建设银行股份有限公司
4.基金合同或本基金合同:指《摩根士丹利华鑫多因子精选策略股票型证券投资基金基金合同》及对本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《摩根士丹利华鑫多因子精选策略股票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:指《摩根士丹利华鑫多因子精选策略股票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《摩根士丹利华鑫多因子精选策略股票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2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过,自2004年6月1日起实施的《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》:指中国证监会2004年6月25日颁布、同年7月1日实施的《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》:指中国证监会2004年6月8日颁布、同年7月1日实施的《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》:指中国证监会2004年6月29日颁布、同年7月1日实施的《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.中国证监会:指中国证券监督管理委员会
14.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
15.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
16.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
17.机构投资者:指依据有关法律法规规定可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法注册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
18.合格境外机构投资者:指符合现实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
19.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
20.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
21.基金销售业务:指基金管理人或代销机构宣传推介基金,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
22.销售机构:指直销机构和代销机构
23.直销机构:指摩根士丹利华鑫基金管理有限公司
24.代销机构:指符合《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
25.基金销售网点:指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点
26.注册登记业务: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、基金份额注册登记、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等
27.注册登记机构:指办理注册登记业务的机构。基金的注册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注册登记业务的机构
28.基金账户:指注册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
29.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本基金的基金份额变动及结余情况的账户
30.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
31.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
32.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
33.存续期:指基金合同生效至终止之间的不定期期限
34.工作日:指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日
35.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工作日
36.T+n日:指自T日起第n个工作日(不包含T日)
37.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
38.交易时间:指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段
39.《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》,是规范摩根士丹利华鑫基金管理有限公司作为注册登记人办理基金管理人所管理的开放式证券投资基金注册登记方面的业务规则,由注册登记人和投资人共同遵守
40.认购:指在基金募集期内,投资人申请购买基金份额的行为
41.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
42.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
43.基金转换:指基金份额持有人按照本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、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金基金份额的行为
44.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
45.定期定额投资计划:指投资人通过有关销售机构提出申请,约定每期扣款日、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
46.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%
47.元:指人民币元
48.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
49.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
50.基金资产净值:指基金资产总值减去基金负债后的价值
51.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
52.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
53.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
54.不可抗力:指本合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

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:王文学
成立日期:2003年3月14日
批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监基金字[2003]33号
注册资本:人民币壹亿元
联系人:赵婧
联系电话:(0755)88318883
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(15%)、深圳市招融投资控股有限公司(10%)、深圳市中技实业(集团)有限公司(5%)。

(二)主要人员情况

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,曾任摩根士丹利并购部门董事总经理、摩根士丹利西班牙财富管理子公司首席执行官,瑞士信贷(香港)有限公司董事总经理及金融机构部主管。现任本公司副董事长。

Navtej Singh Nandra先生,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、摩根士丹利投资管理国际业务主管、摩根士丹利房地产和商业银行策略主管,曾担任Edelweiss资本董事,Edelweiss Tokio人寿保险有限公司董事,DTZ控股公司资深顾问, 美林证券多样化金融服务业务主管,美林证券全球投资银行首席运营官,Nuveen资产管理公司和MLITS印度董事,美林证券全球资产管理部首席运营官和Booz Allen & Hamilton的全球金融服务业务合伙人。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)。曾任深圳证券交易所综合研究所所长,加拿大鲍尔集团亚太分公司基金与保险业务副总裁,加拿大伦敦人寿保险公司北京代表处首席代表,大成基金管理有限公司董事、总经理,摩根士丹利亚洲有限公司董事总经理、中国投资管理业务主管。现任本公司董事、总经理;兼任中国证券业协会基金业委员会副主任委员,并代表中国证券业协会任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董事长、总经理。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、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、深圳龙蕃实业股份有限公司。现任本公司董事。

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

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

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,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。曾任教于上海新联纺织品进出口公司职工大学。现任本公司独立董事。

何斐先生,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、肖特吉有限公司、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.公司高级管理人员

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。18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13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。14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

张靖先生,武汉大学经济学硕士,6年证券从业经验,曾于2005年11月至2009年12月间任职于平安证券有限责任公司,历任权证研究员、数量研究员和风险经理、股票研究员、金融工程研究员、高级业务总监。2009年12月加入本公司,现任金融工程和风险控制部金融工程师。

5.投资决策委员会成员

本基金投资采取集体决策制度,投资决策委员会成员包括:

主任委员:于华先生,本公司董事、总经理。

委员:陈晓先生,总经理助理兼投资总监和摩根士丹利华鑫领先优势股票型证券投资基金基金经理;钱辉先生,本公司高级顾问和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,研究管理部总监兼摩根士丹利华鑫消费领航混合型证券投资基金基金经理;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;汝平先生,固定收益投资部副总监。

6.上述人员之间不存在近亲属关系。

(三)基金管理人的职责
1.依法募集基金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回、转换和登记事宜;
2.办理基金备案手续;
3.对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账,进行证券投资;
4.按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.编制中期和年度基金报告;
7.计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回价格;
8.办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项;
9.召集基金份额持有人大会;
10.保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;
11.以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;
12.有关法律、法规和中国证监会规定的其他职责。

(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)向本基金管理人、基金托管人出资或者买卖其本基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;
(6)买卖与本基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与本基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券;
(7)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
(8)依照法律、行政法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他活动。
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)依照法律、行政法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他行为。
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)违反证券交易场所业务规则,利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格,扰乱市场秩序;
(9)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、行政法规以及中国证监会禁止的行为。
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)不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易;
(3)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;
(4)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。

(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,维护内控制度的有效执行。
(3)独立性原则。基金管理人各机构、部门和岗位职责保持相对独立,基金财产、基金管理人固有财产、其他财产的运作必须相互分离。
(4)相互制约原则。基金管理人内部部门和岗位的设置须权责分明、相互制衡。
(5)成本效益原则。基金管理人运用科学化的经营管理方法降低运作成本,提高经济效益,以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。
3.内部控制体系
基金管理人的内部控制体系结构是一个分工明确、相互制约的组织结构,具体包括:
(1)董事会负责决定基金管理人内部管理机构的设置、制定基金管理人基本管理制度,对确保基金管理人建立及维持适当而有效的内部控制负有最终责任。董事会下设的风险控制和审计委员会负责审核基金管理人内部控制制度、检查公司和基金运作的合法合规情况等事项,并向董事会汇报。
(2)经营管理层负责组织设计公司的内部控制制度,拟订公司的基本管理制度和制定公司的部门业务规章,并确保公司的日常经营运作活动合法合规。
(3)督察长负责监督检查基金管理人运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况,并依据相关规定可独立向董事会和中国证监会报告。
(4)经营管理层下设的风险管理委员会协助经营管理层实施对各类业务和风险的总体控制以及解决公司内部控制中出现的问题。
(5)金融工程和风险控制部负责为投资业务提供数量化分析服务,同时跟踪和报告投资管理中的市场风险,评价基金投资业绩,并根据风险收益情况及时提出改进意见,为投资业务的稳健发展提供支持。
(6)监察稽核部独立于基金管理人其他部门和业务活动,对基金管理人内部控制制度、风险管理政策和措施的执行情况实行严格检查和及时反馈,并向督察长、风险管理委员会和经营管理层定期或不定期报告。

(下转D15版)

摩根士丹利华鑫多因子精选策略股票型证券投资基金基金份额发售公告

【重要提示】

1、摩根士丹利华鑫多因子精选策略股票型证券投资基金(以下简称"本基金")的募集已获中国证监会证监许可[2011]356号文核准。中国证监会对本基金的核准并不代表中国证监会对本基金的风险和收益做出实质性判断、推荐或者保证。

2、本基金是契约型开放式股票型证券投资基金。

3、本基金的基金管理人和注册登记机构为摩根士丹利华鑫基金管理有限公司(以下简称"本公司"),基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称"中国建设银行")。

4、本基金的募集期为2011年4月15日至2011年5月13日。在募集期内,本基金通过基金管理人的直销机构(包括柜台和网上交易平台)、中国建设银行等机构的代销网点公开发售。

5、本基金募集对象为个人投资者、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。

6、本基金募集规模上限为30亿份(不包括利息折算的基金份额)。募集期内,在当日本基金认购经确认后的累计发售规模达到或超过募集规模上限时,基金管理人将于次日在公司网站和指定媒体上公告自即日起结束本基金的发售及认购业务。若募集期内认购申请全部确认后认购份额不超过募集份额上限(不包括利息折算的份额),基金管理人将对所有的有效认购申请全部予以确认。若募集期内认购申请全部确认后认购份额超过募集份额上限(不包括利息折算的份额),基金管理人将对募集期内最后一个认购日之前的有效认购申请全部予以确认,对最后一个认购日有效认购申请采用"末日比例确认"的原则分别给予部分确认,未确认部分的认购款项将在募集结束后7个工作日内退还投资者。

7、投资人欲购买本基金,需开立本公司基金账户。基金募集期内销售机构(指基金管理人的直销机构和指定代销机构)同时为投资人办理开户及认购手续。投资人的开户和认购申请可同时办理,但若开户无效,认购申请也同时无效。

8、根据中国证监会的规定,一个投资人只能开设和使用一个基金账户;不得非法利用他人账户或资金进行认购,也不得违规融资或帮助他人违规进行认购。

9、在设立募集期内,投资人可至本基金的直销机构认购,也可至代销机构认购,首次认购最低限额为人民币1,000元,追加认购单笔最低限额为1,000元。投资人在募集期内可以重复认购,多次认购的,按单笔认购金额对应的费率档次分别计费。认购期内对单个基金份额持有人持有基金份额的比例或数量不设限制,法律另有规定的除外。认购申请一经基金销售机构受理,则不可撤销。

10、销售机构对申请的受理并不表示对该申请的成功确认,而仅代表销售机构确实接受了认购申请。申请的成功确认应以基金注册登记机构(本基金的注册登记机构由本公司担任)的确认登记为准。投资人可以在基金合同生效后到原认购网点打印认购成交确认凭证或通过本公司网上交易平台查询最终成交确认情况和认购的份额。

11、本公告仅对摩根士丹利华鑫多因子精选策略股票型证券投资基金份额发售的有关事项和规定予以说明。投资人欲了解摩根士丹利华鑫多因子精选策略股票型证券投资基金的详细情况,请详细阅读刊登在2011年4月11日《中国证券报》、2011年4月13日《上海证券报》、2011年4月15日《证券时报》上的《摩根士丹利华鑫多因子精选策略股票型证券投资基金招募说明书》。

12、本基金的招募说明书、基金合同、托管协议及本公告将同时在本公司网站(www.msfunds.com.cn)和中国建设银行网站(www.ccb.cn)上发布。投资人亦可通过本公司网站下载基金申请表格和了解基金发售相关事宜。

13、在募集期间,各代销机构可能增加部分基金销售网点,具体网点名单及开户认购事项详见各代销机构有关公告,或拨打各代销机构的客户服务电话进行咨询,具体规定以各代销机构的说明为准。本公司在募集期间内还可能增加新的代销机构,投资人可留意相关公告信息或拨打本公司客户服务电话进行咨询。

14、对未开设销售网点的地方的投资人,请拨打本公司的客户服务电话(400-8888-668免长途费)及直销专线电话(0755-88318898)咨询购买事宜。

15、基金管理人可综合各种情况对本次基金募集安排做适当调整。

16、风险提示

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,即当单个交易日基金的净赎回申请超过基金总份额的百分之十时,投资人将可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

基金分为股票基金、混合基金、债券基金、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,投资人根据所持有的基金份额享受基金收益,同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括: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基金产生的流动性风险,本基金的特定风险等。

本基金为股票型基金,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%。由于本基金股票资产投资比例最低为60%,无法完全规避股票市场的下跌风险。同时由于本基金持有一定比例的债券,故而也需承担债券价格变动导致的风险。投资人面临本基金特有的风险还表现为:本基金采用量化模型方法构建投资组合,其主要工作流程包括采集数据、分析数据、计算结果等几个部分,分别蕴含了数据风险、模型风险和编程风险。因此,本基金整体表现可能在特定时期内低于其他基金。

投资人在进行投资决策前,请认真阅读本基金的招募说明书及基金合同,并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资人的风险承受能力相适应。

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。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,在投资人作出投资决策后,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。

17、基金管理人拥有对本基金份额发售公告的最终解释权。

一、本次发售基本情况

(一)基金名称:摩根士丹利华鑫多因子精选策略股票型证券投资基金(基金代码:233009,基金简称:大摩多因子策略股票)
(二)基金类别:股票型
(三)基金运作方式:契约型开放式
(四)基金份额面值:基金份额的初始面值为人民币1.00元
(五)基金存续期限:不定期
(六)募集规模上限及规模控制措施

1、本基金募集规模上限为30亿份(不包括利息折算的基金份额)。募集期内,在当日本基金认购经确认后的累计发售规模达到或超过募集规模上限时,基金管理人将于次日在公司网站和指定媒体上公告自即日起结束本基金的发售及认购业务。

若募集期内认购申请全部确认后认购份额不超过募集份额上限(不包括利息折算的份额),基金管理人将对所有的有效认购申请全部予以确认。若募集期内认购申请全部确认后认购份额超过募集份额上限(不包括利息折算的份额),基金管理人将对募集期内最后一个认购日之前的有效认购申请全部予以确认,对最后一个认购日有效认购申请采用"末日比例确认"的原则分别给予部分确认,未确认部分的认购款项将在募集结束后7个工作日内退还投资者。

基金合同生效后,基金规模不受上述募集规模上限的限制。

2、投资人对本基金的认购申请可能全部确认或部分确认,认购申请成功与否及其确认情况应以本基金注册登记机构的确认为准。

3、末日认购申请确认比例计算方法

认购申请确认比例=(30亿-末日之前累计有效净认购金额)/末日有效净认购金额 (公式中的金额均不包括利息)

按照上式计算的确认比例,投资者在末日提交的有效认购申请将部分予以确认。

当需要采取比例确认方式对有效认购进行部分确认时,投资者认购费用按照认购申请确认金额所对应的认购费率计算,且认购申请确认金额不受认购最低限额的限制。

(七)募集对象: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。

(八)基金份额销售机构

1、直销方式
(1)直销机构
1)摩根士丹利华鑫基金管理有限公司直销中心
办公地址:深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第二座第17层
联系人:王一平
电话:(0755)88318898
传真:(0755)82990631
全国统一客服电话:400-8888-668
2)摩根士丹利华鑫基金管理有限公司北京分公司
办公地址:北京市西城区太平桥大街18号丰融国际大厦1005室
联系人:罗晔
电话:(010)66155568
传真:(010)66158135
3)摩根士丹利华鑫基金管理有限公司上海分公司
办公地址:上海市卢湾区西藏南路218号永银大厦1202室
联系人:柴阳
电话:(021)63343311
传真:(021)63343988
(2)网上交易平台

本基金管理人网上交易平台网址:https://etrade.msfunds.com.cn/etrading,目前已开通中国建设银行龙卡借记卡、招商银行"一卡通"借记卡、光大银行借记卡、中信银行借记卡、兴业银行借记卡、上海浦东发展银行借记卡的基金网上直销业务,持有上述借记卡的个人投资者可以通过本基金管理人网上交易平台办理开户手续,并办理本基金的认购手续。

深圳、北京或上海的投资人单笔认购金额超过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:http://www.ccb.com
(2)中国工商银行股份有限公司
注册地址:中国北京复兴门内大街55号
办公地址:中国北京复兴门内大街55号
法定代表人:姜建清
客户服务电话:95588
网址:http://www.icbc.com.cn
(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
客户服务电话:95566
网址:http://www.boc.cn
(4)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:项俊波
客户服务电话:95599
网址:http://www.abchina.com
(5)交通银行股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区银城中路188号
办公地址:上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人:胡怀邦
客户服务电话:95559
网址:http://www.bankcomm.com
(6)招商银行股份有限公司
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人:傅育宁
客户服务电话:95555
网址:http://www.cmbchina.com
(7)中国光大银行
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
客户服务电话:95595
网址:http://www.cebbank.com
(8)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:http://www.pingan.com/bank
(9)烟台银行股份有限公司
注册地址:山东省烟台市芝罘区海港路25号
办公地址:山东省烟台市芝罘区海港路25号
法定代表人: 庄永辉
客户服务电话:4008-311-777
网址: http://www.ytcb.com
(10)华鑫证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28A01、B01(b)单元
办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28A01、B01(b)单元
法定代表人:王文学
联系人:杨小江
联系电话: 0755-82083788
客户服务电话:021-32109999,029-68918888
网址:http://www.cfsc.com.cn
(11)中信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层
办公地址:北京朝阳区新源南路6号京城大厦
法定代表人:王东明
联系人:陈忠
联系电话:010-84683893
网址:http://www.cs.ecitic.com
(12)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:北京市朝阳门内大街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
网址:http://www.csc108.com
(13)中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人:胡关金
联系人:李洋
联系电话:010-66568047
网址:http://www.chinastock.com.cn
(14)信达证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区三里河东路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号楼信达金融中心7层
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:http://www.cindasc.com
(15)民生证券有限责任公司
注册地址:北京市朝阳门外大街16号中国人寿大厦1901室
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:岳献春
联系人:赵明
联系电话:010-85127622
网址:http://www.mszq.com
(16)宏源证券股份有限公司
注册地址:新疆乌鲁木齐市建设路2号
办公地址:北京市西城区太平桥大街19号宏源证券
法人:冯戎
联系人:李巍
联系电话:010-88085858
网址:www.hysec.com
(17)海通证券股份有限公司
注册地址:上海市淮海中路98号
办公地址:上海市广东路689号海通证券大厦10楼
法定代表人:王开国
联系人:李笑鸣
联系电话:021-23219000
客户服务电话:400-8888-001、95553
网址:http://www.htsec.com
(18)国泰君安证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区商城路618号
办公地址:上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼
法定代表人:万建华
联系人:芮敏祺
联系电话:021-38676161
客户服务电话:400-8888-666
网址:http://www.gtja.com
(19)申银万国证券股份有限公司
注册地址:上海市常熟路171号
办公地址:上海市常熟路171号
法定代表人:丁国荣
联系电话:021-54033888

(下转D14版)

摩根士丹利华鑫多因子精选策略股票型证券投资基金基金合同摘要

基金管理人:摩根士丹利华鑫基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司

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
根据《基金法》及其他有关法律法规,基金管理人的权利为:
1.自本基金合同生效之日起,依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产;
2.依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入;
3.发售基金份额;
4.依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利;
5.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、定期定额投资、非交易过户、转托管等业务的规则, 在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式;
6.根据本基金合同及有关规定监督基金托管人,对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为,对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形,应及时呈报中国证监会,并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益;
7.在基金合同约定的范围内,拒绝或暂停受理申购和赎回申请;
8.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、融券;
9.自行担任或选择、更换注册登记机构,获取基金份额持有人名册,并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查;
10.选择、更换代销机构,并依据基金销售服务代理协议和有关法律法规,对其行为进行必要的监督和检查;
11.选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;
12.在基金托管人更换时,提名新的基金托管人;
13.依法召集基金份额持有人大会;
14.法律法规和基金合同规定的其他权利。
根据《基金法》及其他有关法律法规,基金管理人的义务为:
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、勤勉尽责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.计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回价格;
9.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;
10.按规定受理申购和赎回申请,及时、足额支付赎回款项;
11.进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;
12.编制中期和年度基金报告;
13.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;
14.保守基金商业秘密,不得泄露基金投资计划、投资意向等,除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不得向他人泄露;
15.按照基金合同的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配收益;
16.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;
17.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;
18.以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;
19.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;
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,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;
21.基金托管人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托管人追偿;
22.按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料;
23.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;
24.执行生效的基金份额持有人大会决议;
25.不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动;
26.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,不谋求对上市公司的控股和直接管理;
27.法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

(二)基金托管人的权利与义务
根据《基金法》及其他有关法律法规,基金托管人的权利为:
1.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收入;
2.监督基金管理人对本基金的投资运作;
3.自本基金合同生效之日起,依法保管基金资产;
4.在基金管理人更换时,提名新任基金管理人;
5.根据本基金合同及有关规定监督基金管理人,对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为,对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形,应及时呈报中国证监会,并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益;
6.依法召集基金份额持有人大会;
7.按规定取得基金份额持有人名册资料;
8.法律法规和基金合同规定的其他权利。
根据《基金法》及其他有关法律法规,基金托管人的义务为:
1.安全保管基金财产;
2.设立专门的基金托管部,具有符合要求的营业场所,配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员,负责基金财产托管事宜;
3.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;
4.除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外,不得为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人托管基金财产;
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;
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应予保密,不得向他人泄露;
8.对基金财务会计报告、中期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;如果基金管理人有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;
9.保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;
10.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;
11.办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;
12.复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格;
13.按照规定监督基金管理人的投资运作;
14.按规定制作相关账册并与基金管理人核对;
15.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;
16.按照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自行召集基金份额持有人大会;
17.因违反基金合同导致基金财产损失,应承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;
18.基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时,应为基金向基金管理人追偿;
19.参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;
20.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业监督管理机构,并通知基金管理人;
21.执行生效的基金份额持有人大会决议;
22.不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动;
23.建立并保存基金份额持有人名册;
24.法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

(三)基金份额持有人的权利与义务
根据《基金法》及其他有关法律法规,基金份额持有人的权利为:
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、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼;
9.法律法规和基金合同规定的其他权利。
每份基金份额具有同等的合法权益。
根据《基金法》及其他有关法律法规,基金份额持有人的义务为:
1.遵守法律法规、基金合同及其他有关规定;
2.交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用;
3.在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;
4.不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动;
5.执行生效的基金份额持有人大会决议;
6.返还在基金交易过程中因任何原因,自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、代销机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利;
7.法律法规和基金合同规定的其他义务。
(四)本基金合同当事各方的权利义务以本基金合同为依据,不因基金财产账户名称而有所改变。

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。基金份额持有人持有的每一基金份额具有同等的投票权,其授权代表有权根据基金份额持有人的授权行使表决权。
(二)召开事由
1.当出现或需要决定下列事由之一的,经基金管理人、基金托管人或持有基金份额10%以上(含10%,下同)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)提议时,应当召开基金份额持有人大会:
(1)终止基金合同;
(2)转换基金运作方式;
(3)变更基金类别;
(4)变更基金投资目标、投资范围或投资策略;
(5)变更基金份额持有人大会程序;
(6)更换基金管理人、基金托管人;
(7)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准,但法律法规要求提高该等报酬标准的除外;
(8)本基金与其他基金的合并;
(9)对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项;
(10)法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。
2.出现以下情形之一的,可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同,不需召开基金份额持有人大会:
(1)调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用;
(2)在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、收费方式或调低赎回费率;
(3)因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改;
(4)对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生重大变化;
(5)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;
(6)按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。
(三)召集人和召集方式
1.除法律法规或本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。基金管理人未按规定召集或者不能召集时,由基金托管人召集。
2.基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起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,应当自行召集。
3.代表基金份额10%以上的基金份额持有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。
4.代表基金份额10%以上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,代表基金份额10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会,但应当至少提前30日向中国证监会备案。
5.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。
(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.基金份额持有人大会的召集人(以下简称"召集人")负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会,召集人必须于会议召开日前30日在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容:
(1)会议召开的时间、地点和出席方式;
(2)会议拟审议的主要事项;
(3)会议形式;
(4)议事程序;
(5)有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人权益登记日;
(6)代理投票的授权委托书的内容要求(包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等)、送达时间和地点;
(7)表决方式;
(8)会务常设联系人姓名、电话;
(9)出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续;
(10)召集人需要通知的其他事项。
2.采用通讯方式开会并进行表决的情况下,由召集人决定通讯方式和书面表决方式,并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见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书面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书面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书面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,不影响计票和表决结果。
(五)基金份额持有人出席会议的方式
1.会议方式
(1)基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会、通讯方式开会及法律法规、中国证监会允许的其他方式。
(2)现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席,现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席,如基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的,不影响表决效力。
(3)通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。
(4)在法律法规或监管机构允许的情况下,经会议通知载明,基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决,或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决。
(5)会议的召开方式由召集人确定。
2.召开基金份额持有人大会的条件
(1)现场开会方式
在同时符合以下条件时,现场会议方可举行:
1)对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示,全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的50%以上(含50%,下同);
2)到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备,到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定,并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的注册登记资料相符。
(2)通讯开会方式
在同时符合以下条件时,通讯会议方可举行:
1)召集人按本基金合同规定公布会议通知后,在2个工作日内连续公布相关提示性公告;
2)召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人(分别或共同称为"监督人")到指定地点对书面表决意见的计票进行监督;
3)召集人在监督人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见,如基金管理人或基金托管人经通知拒不到场监督的,不影响表决效力;

(下转D14版)