摩根士丹利华鑫深证300指数增强型证券投资基金基金份额发售公告

（上接D9版）

办公地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人：吴万善
联系人：程高峰
联系电话：025-83290834
客户服务电话：95597
网址：http://www.htsc.com.cn

（25）齐鲁证券有限公司
注册地址：山东省济南市经十路128 号
办公地址：济南市经七路86号23层
法定代表人：李玮
联系人：王霖
联系电话：0531-68889157
客户服务电话：95538
网址：www.qlzq.com.cn

（26）中信万通证券有限责任公司
注册地址：青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层（1507-1510室）
办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层
法定代表人：张智河
联系人：吴忠超
联系电话：（0532）85022326
客户咨询电话：（0532）96577
公司网址：www.zxwt.com.cn

（27）中信金通证券有限责任公司
注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
法定代表人：沈强
联系人：丁思聪
联系电话：0571-87112510
客户服务电话：0571-96598
网址：www.bigsun.com.cn

（28）山西证券股份有限公司
注册地址：太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
办公地址：太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
法定代表人：侯巍
联系人：郭熠
联系电话：0351-8686659
客户服务电话：400-666-1618
网址：http://www.i618.com.cn

（29）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18-21层
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：http://www.dwzq.com.cn

（30）方正证券股份有限公司
注册地址：湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层
办公地址：湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层
法定代表人：雷杰
联系人：彭博
联系电话：0731-85832343
客户服务电话：95571
网址：http://www.foundersc.com

（31）安信证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层、28层A02单元
办公地址：深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层、28层A02单元
深圳市福田区深南大道2008号中国凤凰大厦1号楼9层
法定代表人：牛冠兴
联系人：余江
联系电话：0755-82558323
客户服务电话：4008-001-001
网址：http://www.essence.com.cn

（32）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6003号荣超商务中心A栋第18层至20层
法定代表人：杨明辉
联系人：刘毅
联系电话：0755- 82023442
客户服务电话：400-600-8008
网址：http://www.cjis.cn

（33）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30楼
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：http://www.newone.com.cn

（34）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1010号国际信托大厦9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：http://www.guosen.com.cn

（35）平安证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
法定代表人：杨宇翔
联系人：郑舒丽
联系电话：0755-22626391
客户服务电话：400-8816-168
网址：http://www.pingan.com

（36）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：400-8888-100（全国）、95563
网址：http://www.ghzq.com.cn

（37）华福证券有限责任公司
注册地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址：福州市五四路157号新天地大厦7至10层
法定代表人：黄金琳
联系人：张腾
联系电话：0591-87383623
客户服务电话：96326（福建省外请加拨0591）
网址： http://www. hfzq.com.cn

（38）天相投资顾问有限公司
注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
办公地址：北京市西城区金融街5号新盛大厦B座4层
法定代表人：林义相
联系人：林爽
联系电话：（010）66045608
客户服务电话：010-66045678
网址： www.txsec.com

如本次募集期间，新增销售机构，将另行公告。

（九）募集时间安排与基金合同生效

本基金的募集期为自基金份额开始发售之日起到基金份额发售结束之日止的时间段，最长不超过3个月。

本基金的募集期为自2011年10月17日至2011年11月11日。在本募集期内，本基金向中华人民共和国境内的个人投资者、机构投资者（法律、法规和有关规定禁止购买者除外）、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公开发售。

募集期满后，若本基金满足备案条件（即基金募集份额总额不少于2亿份，基金募集金额不少于2亿元人民币，且基金份额持有人的人数不少于200人），本基金管理人将按照规定办理验资和基金备案手续。自中国证监会书面确认之日起，基金合同生效。基金合同生效后，基金管理人将另行刊登基金合同生效公告。

基金合同生效前，投资人的认购款项只能存入商业银行专用账户，任何人不得动用。认购资金在募集期形成的利息在基金合同生效后折成投资人认购的基金份额，归投资人所有。利息折份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。

若募集期满，本基金未达到备案条件，则本基金合同不能生效，本基金管理人将承担因募集而产生的债务和费用，并将投资人缴纳的认购款项加计银行同期存款利息在募集期结束后30天内退还给基金认购人。

二、发售方式与相关规定

（一）认购方式

本基金认购采取金额认购的方式。

（二）认购费率

本基金的认购费用在认购时收取，认购费用以认购金额为基数采用比例费率计算。基金认购费用不列入基金资产，主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用。多次认购的，认购费用按单笔认购金额对应的费率档次分别计算。具体费率如下：

认购金额（M）	认购费率
M<100万	1.00%
100万≤M<500万	0.60%
M≥500万	每笔1000元

（三）认购份额的计算公式

本基金的认购金额包括认购费用和净认购金额。计算公式如下：

净认购金额=认购金额/（1+认购费率）

认购费用=认购金额-净认购金额

认购份额=（净认购金额+认购期间的利息）/基金份额初始面值

认购费用以人民币元为单位，计算结果保留到小数点后2位，第3位四舍五入；认购份额的计算保留到小数点后2位，第3位四舍五入。由上述计算误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

举例：某投资人投资100，000元认购本基金，对应费率为1.00%，假设认购利息为19.80元，则其可得到的基金份额计算如下：

净认购金额=100，000/（1+1.00%）=99，009.90元

认购费用=100，000-99，009.90=990.10元

认购份额=（99，009.90+19.80）/1.00=99，029.70份

即投资人投资100，000元认购本基金，可得到99，029.70份基金份额。

（四）认购最低限额

在基金募集期内，投资人通过直销机构、代销机构或本公司网上交易平台（目前仅对个人投资者开通）首次认购的单笔最低限额为人民币1000元，追加认购单笔最低金额为人民币1000元。各销售机构对最低认购限额及交易级差有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。（以上金额含认购费）。

（五）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。认购申请一经基金份额发售机构受理，则不可撤销。

（六）基金募集期间不设置投资人单个账户最高认购金额限制。基金管理人可根据市场情况，调整认购金额的数量限制，基金管理人必须在调整前依照《信息披露管理办法》在指定媒体刊登公告并报中国证监会备案。

三、个人投资者的开户与认购程序

（一）直销办理程序

1、直销机构

（1）注意事项：

1）通过直销机构办理认购申请的起点金额为人民币1000元。

2）投资人可以使用存折转账、信汇或电汇等主动付款方式进行认购交款，但不接受现金方式认购。

3）在直销机构开立基金及交易账户的基金投资人应指定一个银行账户作为其资金交收账户，以便进行赎回、分红及无效认（申）购的资金退款等资金结算。银行账户名称必须同投资人基金账户的户名一致。

4）业务办理时间：基金份额发售日9:00~17:00（周六、周日及节假日不受理）。

5）请有意认购本基金的个人投资者尽早向直销机构索取账户和交易业务申请表。个人投资者也可从摩根士丹利华鑫基金管理有限公司的网站（http://www.msfunds.com.cn）上下载有关直销业务表格，但必须在办理业务时保证提交的材料与下载文件中所要求的格式一致。

6）直销机构与代理销售网点的业务申请表不同，个人投资者请勿混用。

7）投资人在办理基金账户开户的同时可以办理基金的认购申请手续。

（2）开户及认购程序

1）开立基金账户

A. 投资人开户资料的填写必须真实、准确，否则由此引起的错误和损失，由投资人自己承担。

B. 个人投资者申请开立基金账户时应提交下列材料：

①本人有效身份证件（身份证、军官证、警官证、士兵证、文职证等）原件及复印件；

②若是由代理人办理，需要提供经公证的授权委托书及代理人有效身份证件原件以及复印件；

③指定银行账户的银行存折或银行卡原件及复印件；

④填妥的《个人账户业务申请表》；

⑤经本人签字确认的投资人权益须知；

⑥填妥的风险承受能力调查问卷。

2）提出认购申请

A. 个人投资者办理认购申请需准备以下资料：

①填写完整的《交易业务申请表》；

②加盖银行受理章的银行付款凭证回单联原件及复印件；

③出示本人身份证件原件，提供复印件；

④若是由代理人办理，需提供经公证的授权委托书及代理人有效身份证件原件以及复印件。

B. 尚未开户者可同时办理开户和认购手续。

3）交款方式

A. 通过直销机构认购的个人投资者，应在提出认购申请当日16:30之前，通过汇款等方式将足额认购资金汇入本公司如下直销专户：

①直销专户1：
账户名称：摩根士丹利华鑫基金管理有限公司
开户行：中国建设银行深圳分行营业部
账号：44201501100052515800

②直销专户2：
账户名称：摩根士丹利华鑫基金管理有限公司
开户行：中国银行深圳分行福田支行
账号：820106285828027001

③直销专户3：
账户名称：摩根士丹利华鑫基金管理有限公司
开户行：中国工商银行深圳福田支行
账号：4000023329200180361

④直销专户4：
账户名称：摩根士丹利华鑫基金管理有限公司直销专户
开户行：交通银行深圳彩田支行
账号：443066175018010020733

⑤直销专户5：
账户名称：摩根士丹利华鑫基金管理有限公司直销专户
开户行：中国光大银行深圳分行营业部
账号：38910188000018773

B. 投资人在办理汇款时须注意以下事项：

①投资人在“汇款人”栏中填写的汇款人名称必须与认购申请人名称一致；

②投资人在银行填写划款凭证时，请写明用途；

③投资人若未按上述办法划付认购款项，造成认购无效的，本公司及直销专户的开户银行不承担任何责任；

④如果投资人认购资金在当日规定时间内未划入本公司指定直销专户的，则当日提交的申请无效（投资人在认购申请表上注明以资金到账日为受理申请日除外）。

C. 至募集期结束，以下情况将被视为无效认购，款项将退往投资人指定的银行账户：

①投资人划入认购资金，但未办理开户手续或开户不成功的；

②投资人划入认购资金，但逾期未办理认购手续的；

③投资人划入的认购资金金额小于其申请的认购金额的；

④在募集期截止日16:30之前认购资金未划入本公司指定直销资金账户的；

⑤本公司确认的其它无效或认购失败情形。

2、网上交易平台

（1）注意事项

1）个人投资者可以通过本公司网上交易平台办理本基金的开户和认购业务，但认购金额会受相关银行卡单笔认购金额和日交易金额限制。

2）目前本公司基金网上直销业务已开通的银行卡如下：

①中国建设银行龙卡借记卡

②招商银行“一卡通”借记卡

③光大银行借记卡

④中信银行借记卡

⑤兴业银行借记卡

⑥上海浦东发展银行借记卡

3）业务办理时间：基金份额发售日7＊24小时受理（17:00以后的认购申请于下一工作日提交；周六、周日及法定节假日正常受理客户申请，期间的认购申请于下一工作日提交）。

（2）开户及认购程序

持有上述借记卡的个人投资者可以直接通过本公司网站办理开户手续，并通过摩根士丹利华鑫网上交易平台进行本基金的认购。具体交易细则请参阅本公司网站公告。

本公司网上交易平台网址：https://etrade.msfunds.com.cn/etrading

本公司网上交易咨询电话：400-8888-668（免长途费）。

（二）中国建设银行股份有限公司

1、业务办理时间

基金份额发售日的9:30-17:00（周六、周日及法定节假日正常受理客户申请，该认购申请计入下一发售日；发售日每天17:00以后客户发起的认购申请计入下一发售日）。

2、开户程序及所需材料

（1）请事先办妥或持有中国建设银行理财卡或龙卡通并存入足额开户和认购资金。

（2）请投资人到网点提交以下材料，办理开户手续，开立本公司的基金账户：

1）本人有效身份证件原件（包括：居民身份证、军官证、士兵证等）

2）本人的中国建设银行理财卡或龙卡通

3）填妥的“个人开通/取消证券交易申请表”

（3）开户同时可办理认购手续，需填妥并提交“证券买入（基金认购/申购）委托单”。

3、认购程序及所需材料

（1）本人有效身份证件原件

（2）填妥的“证券买入（基金认购/申购）委托单”

4、注意事项

（1）请个人投资者本人到中国建设银行指定的代销网点办理开户和认购手续；

（2）有关详细的办理手续，请查阅代销网点摆放的《中国建设银行证券业务系统个人客户操作指南》。

（三）中国银行股份有限公司

1、业务办理时间

基金份额发售日的9:00~16:00。周六、周日部分网点只受理个人投资者业务申请。

2、开户程序及所需材料

个人投资者申请开立中国银行的交易账户时应提交下列材料：

（1）有效身份证件原件（身份证、军官证、士兵证、警官证等）；

（2）中国银行长城借记卡；

（3）填妥的《中国银行开放式基金业务申请表（个人）》；

（4）与中国银行签订的《中国银行开放式基金交易协议书》（一式两份）。

3、认购程序及所需材料

个人投资者在开立中国银行交易账户后，可提出基金认购申请。提出认购申请时应提供以下材料：

（1）中国银行长城借记卡；

（2）填妥的《认购申请表》；

（3）中国银行基金交易卡。

中国银行在接收到投资者的认购申请后，将自动向本公司提交投资者开立基金账户的申请和认购申请，经本公司确认后，投资者可在T+2日（工作日）在中国银行销售网点打印基金开户确认书和认购业务确认书。但此次确认是对认购申请的确认，认购的最终结果要待本基金发行成功后才能确认。

（四）交通银行股份有限公司

1、业务办理时间

基金工作日9:30-15:00，15:00以后交易作为下一基金工作日交易。

2、开户及认、申购程序（下述三项业务可同时办理）

（1）开立交通银行基金交易账户（已在交通银行开立过基金交易账户的客户不必再开立该账户，直接开通本公司基金账户即可）；

（2）开通本公司基金账户（已在交行开立过本公司基金账户的投资者无需再次办理，已在其他机构开立过本公司基金账户的投资者仅需在交行开通已有基金账户）；

（3）认、申购基金。

3、个人客户办理开立交通银行基金交易账户时，需本人亲自到网点并提交以下材料：

（1）事先办妥的交通银行太平洋借记卡；

（2）本人法定身份证件原件；

（3）填妥的开通基金交易账户申请表。

4、个人客户在营业网点办理认、申购申请时，需先存入足够资金，并提交以下材料：

（1）本人交通银行太平洋借记卡（存有足够资金）；

（2）填妥的认购申请表。

个人投资者本人仅需持有已开通基金交易账户交通银行借记卡，可到交通银行任一网点柜台办理开通网上基金交易功能。

（五）中信银行股份有限公司

1、开户及认购业务办理时间：

基金份额发售日的9:30-15:00（15:00以后的申请于下一工作日提交。）

2、开立中信银行的交易账户

个人投资者申请开立中信银行的交易账户时应提交下列材料：

（1）事先办妥的中信银行理财宝卡；

（2）本人法定身份证件原件；

（3）填妥的中信银行基金账户业务申请表。

3、提出认购申请

个人投资者办理认购申请时需提交以下材料：

（1）本人中信银行理财宝卡（存有足够资金）；

（2）填妥的中信银行基金交易业务申请表。

（六）通过其他代销银行办理开户和认购的程序

以下程序原则上适用于代销本基金的其他商业银行，包括：中国工商银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、烟台银行股份有限公司。此程序仅供投资人参考，具体程序以各代销银行的规定和说明为准。

1、业务办理时间

各代销银行营业日的受理时间，以代销银行的具体规定为准。

2、开户与认购的程序

（1）开立银行基金交易账户

个人投资者申请开立银行基金交易账户时应提交下列资料：

1）本人有效身份证明原件（居民身份证、军官证、士兵证、警官证、文职证等）；

2）代销银行借记卡；

3）填妥的开户申请表；

4）代销银行要求的其他资料。

（2）提出认购申请：

个人投资者在开立银行基金交易账户后，可提出基金认购申请，应提供以下资料：

1）代销银行借记卡；

2）填妥的认购申请表；

3）基金交易卡；

4）代销银行要求的其他资料。

3、注意事项：

（1）没有银行借记卡的投资人可当场办理，但建议有意认购的投资人提前办理；

（2）对于认购申请，部分代销银行只需提供代销银行借记卡或基金交易卡其中一种资料；

（3）个人投资者在代销银行开户和认购的详细程序如与上述原则程序有所不同，或若代销银行有其他方面的要求，以各代销银行的规定和说明为准。

（七）通过代销证券公司办理开户和认购的程序

以下开户和认购程序原则上适用于代销本基金的证券公司，包括：华鑫证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、民生证券有限责任公司、宏源证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、中银国际证券有限责任公司、湘财证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、中信万通证券有限责任公司、中信金通证券有限责任公司、山西证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、中国建银投资证券有限责任公司、招商证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、国海证券股份有限公司、华福证券有限责任公司、天相投资顾问有限公司。此程序仅供投资人参考，具体程序以各代销证券公司的规定和说明为准。

1、业务办理时间

基金份额发售日的9:30~11:30和13:00~15:00。

2、开户与认购的程序

（1）事先在证券公司营业部开立资金账户，并存入足额认购资金。

（2）如果没有开立资金账户，需携带如下材料到证券公司营业部办理资金账户开户，同时办理基金账户开户：

1）填妥的《资金账户开户申请表》；

2）本人有效身份证明原件及复印件；

3）营业部指定银行的存折（储蓄卡）。

（3）如果已有资金账户，到营业网点提交以下材料办理基金账户开户手续：

1）本人有效身份证原件及复印件；

2）本人资金账户卡；

3）填妥的《开放式基金基金账户开户申请表》。

（4）开户同时可办理认购手续，需填妥并提交基金认购申请表。

3、注意事项

（1）个人投资者需本人到代销证券公司营业部办理开户和认购手续。部分代销证券公司可直接通过网上交易等自助委托方式开立基金账户和进行认购委托 。

（2）若有其他方面的要求，以各代销证券公司的规定和说明为准。

四、机构投资者的开户与认购程序

机构投资者认购本基金可以在摩根士丹利华鑫基金管理有限公司直销机构、中国建设银行及其他代销机构指定的基金销售网点认购。

（一）直销机构

1、注意事项：

（1）通过直销机构办理认购申请的起点金额为人民币1000元。

（2）投资人可以使用信汇或电汇等主动付款方式进行认购交款，但不接受现金方式认购。

（3）在直销机构开立基金及交易账户的基金投资人应指定一个银行账户作为其资金交收账户，以便进行赎回、分红及无效认（申）购的资金退款等资金结算。银行账户名称必须同投资人基金账户的户名一致。

（4）业务办理时间：基金份额发售日9:00~17:00（周六、周日及节假日不受理）。

（5）请有意认购本基金的机构投资者尽早向直销机构索取账户和交易业务申请表。机构投资者也可从本公司的网站（http://www.msfunds.com.cn）上下载有关直销业务表格，但必须在办理业务时保证提交的材料与下载文件中所要求的格式一致。

（6）直销机构与代理销售网点的业务申请表不同，机构投资者请勿混用。

（7）投资人在办理基金账户开户的同时可以办理基金的认购申请手续。

2、开户及认购程序

（1）开立基金账户

A. 投资人开户资料的填写必须真实、准确，否则由此引起的错误和损失，由投资人自己承担。

B. 机构投资者申请开立基金账户时应提交下列材料：

①填写完整并加盖单位公章和法定代表人（或负责人）签章的《机构账户业务申请表》；

②营业执照或民政部门等颁发的注册登记书原件及复印件；

③税务登记证原件及复印件；

④组织机构代码证原件及复印件；

⑤指定银行出具的开户证明原件及复印件；

⑥基金业务授权委托书；

⑦预留印鉴卡；

⑧经办人的身份证件原件及复印件；

⑨法定代表人证明书及法定代表人身份证复印件；

⑩开放式基金传真交易协议书；

⑪签字确认的《投资人权益须知》；

⑫填妥的风险承受能力调查问卷；

⑬本公司要求提供的其他资料。

注：以上复印件均应加盖单位公章。

（2）提出认购申请

A. 机构投资者在直销机构认购应提交以下资料：

①加盖预留印鉴的《交易业务申请表》；

②出示经办人身份证件、授权委托书（如需要）原件，提供复印件；

③加盖银行受理章的银行付款凭证回单联原件及复印件。

B. 尚未办理开户手续的投资人可提供规定的资料将开户与认购一起办理。

（3）认购资金的划拨

A. 通过直销机构认购的机构投资者，应在提出认购申请当日16:30之前将足额认购资金汇入本公司直销专户，具体账户信息请参见本公告第三部分“个人投资者的开户与认购程序”第（一）条中列示的直销专户。

B. 投资人在办理汇款时须注意以下事项：

①机构投资者在填写银行划款凭证时，请写明用途；

②投资人若未按上述办法划付认购款项，造成认购无效的，本公司及直销专户的开户银行不承担任何责任；

③如果投资人认购资金在当日规定时间内未到本公司指定直销专户的，则当日提交的申请无效（投资人在认购申请表上注明以资金到账日为受理申请日除外）。

C. 至募集期结束，以下情况将被视为无效认购，款项将退往投资人的指定银行账户：

①投资人划入认购资金，但未办理开户手续或开户不成功的；

②投资人划入认购资金，但逾期未办理认购手续的；

③投资人划入的认购资金金额小于其申请的认购金额的；

④本公司确认的其它无效或认购失败情形。

（二）中国建设银行股份有限公司

1、业务办理时间

基金份额发售日的9:30—17:00。周六、日及法定节假日不办理业务。

2、开户程序及所需材料

（1）事先办妥或已有中国建设银行的机构活期存款账户并存入足额开户和认购资金。

（2）由被授权人到开户会计柜台提交以下材料，办理开户手续，开立本公司的基金账户：

1）机构活期存款账户的印鉴卡及印鉴、营业执照或事业社团法人证书及复印件、军队或武警开户许可证及复印件、组织机构代码证及复印件。开户单位为分支机构的，还应提交法人授权其开户的书面证明；

2）证券业务授权书；

3）被授权人有效身份证明及复印件、印鉴；

4）填妥的“机构开通/取消证券交易申请表”，并加盖公章和法定代表人章。

（3）开户同时可办理认购手续，请填妥并提交“证券买入（基金认购/申购）委托单”。

3、认购程序及所需材料

（1）被授权人有效身份证明原件；

（2）填妥的“证券买入（基金认购/申购）委托单”。

4、注意事项

（1）机构投资者请到原机构活期存款账户开户会计柜台办理开户和认购手续；

（2）若有其他方面的要求，请以中国建设银行《中国建设银行证券业务系统机构客户操作指南》为准。

（三）中国银行股份有限公司

1、业务办理时间：

基金份额发售日的9:00~16:00。周六、周日不受理。

2、开户程序及所需材料

同一机构投资者只能在中国银行开立一个基金交易账户，并只能指定一个人民币活期结算账户作为与之关联的资金账户。机构投资者申请开立中国银行的交易账户时，应提交下列材料：

（1）组织机构代码证、营业执照或注册登记证书原件正本及上述文件加盖公章的复印件；

（2）投资者填写，并加盖机构公章、法定代表人签章和与资金账户一致的预留印鉴的开户申请表；

（3）授权委托书（加盖法定代表人签章和机构公章）；

（4）经办人有效身份证件原件及其复印件；

（5）预留印鉴（与资金账户预留印鉴一致）；

（6）加盖法定代表人签章和单位公章的“中国银行开放式基金交易协议书”（一式两份），加盖机构公章、法定代表人签章和与资金账户一致的预留印鉴的“中国银行开放式基金开/销户申请书（单位）”。T+2日，机构投资者在中国银行柜台查询开户是否成功，中国银行为机构投资者打印“开放式基金代销业务确认书（单位）”。

3、认购程序及所需材料

（1）机构投资者在开立中国银行交易账户后，可提出基金认购申请。机构投资者应先从中国银行基金代销网点取得《开放式基金认、申购申请书（单位）》，填妥后加盖银行预留印鉴。

（2）中国银行代销网点柜员对机构投资者提供的资料审核无误后，为其办理认购并打印“开放式基金认购、申购业务回单”。

中国银行在接收到投资者的认购申请后，将自动向本公司提交机构投资者开立基金账户的申请和认购申请，经本公司确认后，投资者可在T+2日（工作日）在中国银行代销网点打印基金开户确认书和认购业务确认书。但此次确认是对认购申请的确认，认购的最终结果要待本基金发行成功后才能够确认。

（四）交通银行股份有限公司

1、业务办理时间

基金工作日9:30-15:00，15:00以后交易作为下一基金工作日交易。

2、开户及认、申购程序（下述三项业务可同时办理）

（1）开立交通银行基金交易账户（已在交通银行开立过基金交易账户的客户不必再开立该账户，直接开通本公司基金账户即可）；

（2）开通本公司基金账户（已在交行开立过本公司基金账户的投资者无需再次办理，已在其他机构开立过本公司基金账户的投资者仅需在交行开通已有基金账户）；

（3）认、申购基金。

3、机构客户办理开立交通银行基金交易账户时，需指定经办人亲自到网点并提交以下材料：

（1）工商行政管理机关颁发的法人营业执照副本或民政部门、其他主管部门颁发的注册登记证书原件及复印件（加盖机构公章）；

（2）机构对基金业务经办人员的授权书（加盖机构公章、法定代表人私章）；

（3）机构代码证；

（4）经办人身份证件及复印件；

（5）填妥的开立基金交易账户申请表，加盖机构公章和法人代表章；

（6）指定一个该基金代销网点的资金结算账户为基金结算账户，用以对所有基金交易业务的资金清算。

4、机构客户办理开通本公司基金账户时，需到网点并提交以下材料：

（1）《交通银行代销基金交易卡》；

（2）填写的开通基金账户申请表（加盖机构公章和法人代表章）；

（3）经办人身份证件。

5、机构客户办理认、申购申请时，需在银行账户中存入足够的资金，并提交以下材料：

（1）《交通银行代销基金交易卡》；

（2）填写的代销基金认购申请表（加盖机构公章和法人代表章）；

（3）认购款项的有效结算凭证；

（4）经办人身份证件。

（五）中信银行股份有限公司

1、开户及认购业务办理时间：

基金份额发售日的9:30-15:00。15:00以后的申请于下一工作日提交。

2、开立中信银行的交易账户

机构投资者申请开立中信银行的交易账户时应提交下列材料：

（1）事先办妥的中信银行转帐支票；

（2）机构证件（包括企业营业执照副本、社会团体证件、事业法人证件、技术监督局代码、行政机关、军队、武警、下属机构（具有主管单位批文号）、基金会、其它机构证明）复印件、预留印鉴、法人授权书、经办人的身份证明文件。同一投资者只能利用一种有效身份证明文件作为身份证明依据；

（3）填妥的中信银行基金账户业务申请表。

3、提出认购申请

机构投资者办理认购申请时需提交以下材料：

（1）事先办妥的中信银行转帐支票；

（2）填妥的中信银行基金交易业务申请书。

若有其他方面的要求，以中信银行的说明为准。

（六）通过其他代销银行办理开户和认购的程序

以下程序原则上适用于代销本基金的其他商业银行，包括：中国工商银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、烟台银行股份有限公司。此程序仅供投资人参考，具体程序以各代销银行的规定和说明为准。

1、业务办理时间

各代销银行营业日的受理时间，以代销银行的具体规定为准。

2、开户与认购的程序

（1）开立银行交易账户

机构投资者必须由指定的经办人亲自到网点办理银行基金交易账户的开户手续，并提交以下资料：

1）加盖单位公章的企业法人营业执照复印件及副本原件；事业法人、社会团体或其他组织提供民政部门或主管部门颁发的注册登记证书原件及加盖单位公章的复印件；

2）基金业务授权委托书；

3）经办人有效身份证件原件；

4）机构活期存款账户的印鉴卡；

5）填妥的开户申请表并加盖单位公章和法定代表人名章。

（2）提出认购申请：

机构投资者在开立银行基金交易账户后，可提出基金认购申请，应提供以下资料：

1）业务经办人有效身份证原件；

2）加盖预留印鉴的认购申请表。

3、注意事项

（1）同一机构投资者只能在代销银行开立一个基金交易账户，并只能指定一个人民币活期结算账户作为与之关联的资金账户；

（2）机构投资者在代销银行开户和认购的详细程序如与上述原则程序有所不同，或若代销银行有其他方面的要求，以各代销银行的规定和说明为准。

（七）通过代销证券公司办理开户和认购的程序

以下开户和认购程序原则上适用于代销本基金的证券公司，包括：华鑫证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、民生证券有限责任公司、宏源证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、中银国际证券有限责任公司、湘财证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、中信万通证券有限责任公司、中信金通证券有限责任公司、山西证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、中国建银投资证券有限责任公司、招商证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、国海证券股份有限公司、华福证券有限责任公司、天相投资顾问有限公司。此程序仅供机构投资者参考，具体程序以各代销证券公司的规定和说明为准。

1、业务办理时间

基金份额发售日的9:30~11:30和13:00~15:00。

2、开户与认购的程序

（1）事先在证券公司营业部开立资金账户，并存入足额认购资金。

（2）如果没有开立资金账户，需携带如下材料到证券公司营业部办理资金账户开户，同时办理基金账户开户：

1）加盖单位公章的企业法人营业执照复印件及副本原件；事业法人、社会团体或其他组织提供民政部门或主管部门颁发的注册登记证书原件及加盖单位公章的复印件；

2）经办人身份证件原件和复印件；

3）填妥的《开放式基金基金账户开户申请表》；

4）法定代表人身份证证件及复印件，法定代表人签发的授权委托书（法定代表人签字并加盖公章）；

5）法定代表人身份证明书（加盖机构公章）。

（3）如果已有资金账户，到营业网点提交以下材料办理基金账户开户手续：

1）填妥的开户申请表；

2）有效法人营业执照（副本）或其他主管部门颁发的注册登记证书，上述文件需同时提供复印件（加盖机构公章）；

3）经办人身份证件及复印件；

4）开户授权委托书（加盖机构公章和法定代表人章）；

5）法定代表人身份证明文件（加盖机构公章）；

6）证券公司资金账户卡。

（4）开户同时可办理认购手续，需填妥并提交基金认购申请表。

3、注意事项

（1）机构投资者需由授权的业务经办人本人到代销证券公司营业部办理开户和认购手续。部分代销证券公司可以通过网上交易渠道进行认购委托。

（2）若有其他方面的要求，以各代销证券公司的规定和说明为准。

五、清算与交割

本基金合同生效前，全部募集资金将被冻结在基金募集专户中，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。投资人有效认购款项在募集期内产生的银行同期存款利息归投资人所有，在本基金基金合同生效后，折算为基金份额计入投资人的账户，具体份额以注册登记机构的记录为准。

本基金权益登记由基金注册登记机构（摩根士丹利华鑫基金管理有限公司）在募集结束后完成过户登记。

六、退款事项

（一）基金发行结束后，以下情况将被视为无效认购：

1、投资人划入认购资金，但逾期未办理开户手续或开户不成功；

2、已开户投资人划入认购资金，但逾期未办理认购手续；

3、投资人划入的认购资金小于其认购申请金额；

4、投资人认购资金的到账时间晚于规定的资金最迟到账时间；

5、基金注册登记机构确认的其他无效资金。

（二）投资人的无效认购资金，将由各直销机构、代销机构于本基金募集结束之日起3 个工作日内划往投资人指定的银行账户。

（三）募集失败：在募集期结束后，如果本基金募集份额总份额小于2 亿份或募集资金金额少于2 亿元人民币或基金份额持有人的人数少于200 人，则本基金基金合同不能生效。届时本基金管理人承担因募集行为产生的债务和费用，并将投资人缴纳的认购款项并加计中国人民银行规定的商业银行同期活期存款利息在募集期结束后30 天内退还投资人。

七、基金的验资与基金合同生效

1、募集期截止后，基金管理人根据注册登记机构确认的数据，将募集的属于本基金财产的全部资金划入基金托管人为基金开立的资产托管专户中，并委托具有资格的会计师事务所对基金资产进行验资并出具报告，注册登记机构出具认购人数、认购份额、利息等证明。

2、若本基金合同达到生效条件，基金管理人向中国证监会提交验资报告，办理基金备案手续。自中国证监会书面确认之日起，基金合同生效。基金管理人在收到中国证监会书面确认的次日刊登基金合同生效公告。

八、本次发售当事人及中介机构

（一）基金管理人
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
成立时间：2003年3月14日
客户服务中心电话：400-8888-668
电话：0755-88318883
联系人：赵婧

（二）基金托管人
名称：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
电话：010-67595003
联系人：尹东

（三）直销机构
名称：摩根士丹利华鑫基金管理有限公司
办公地址：深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第二座第17层01-04室
电话：0755-88318898
传真：0755-82990631
网站：http://www.msfunds.com.cn
联系人：王一平

（四）代销机构

本基金的代销机构相关情况详见本公告第一部分“本次发售基本情况”的第（八）条 “代销机构”部分。

（五）注册登记机构
名称：摩根士丹利华鑫基金管理有限公司
注册地址：深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第二座第17层01-04室
办公地址：深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第二座第17层
法定代表人：王文学
成立时间：2003年3月14日
客户服务中心电话：400-8888-668
电话：0755-88318720
联系人：邢思宁

（六）律师事务所
名称：北京市竞天公诚律师事务所
注册地址：北京市朝阳区建国路77号华贸中心3号写字楼34层
办公地址：北京市朝阳区建国路77号华贸中心3号写字楼34层
负责人：赵洋
联系人：黄亮
电话：010-58091000、0755-23982200
经办律师：黄亮、孔雨泉

（七）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： 张鸿
联系电话：（021）23233283
经办注册会计师：薛竞、张鸿

摩根士丹利华鑫基金管理有限公司
二〇一一年十月十七日

摩根士丹利华鑫深证300指数增强型证券投资基金基金合同摘要

（上接D9版）

（2）特别决议

特别决议须经出席会议的基金份额持有人（或其代理人）所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效；涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同必须以特别决议通过方为有效。

3.基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准或者备案，并予以公告。

4.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，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，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。

5.基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

6.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。

（八）计票

1.现场开会

（1）如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则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推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，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推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人；但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

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

（3）如大会主持人对于提交的表决结果有异议，可以对投票数进行重新清点；如大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

2.通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监票人在监督人派出的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；如监督人经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权3名监票人进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

（九）基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

1.基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，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决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

2.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。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决议。

3.基金份额持有人大会决议应自生效之日起2日内在指定媒体公告。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。

（十）法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

三、基金收益分配原则、执行方式

（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

本基金收益分配应遵循下列原则：

1.本基金的每份基金份额享有同等分配权；

2.收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账等手续费用或低于基金管理人规定的限额时，本基金注册登记机构可将投资人的现金红利按除权后的基金份额净值自动转为基金份额；

3.本基金收益每年最多分配4次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的25%；

4.若基金合同生效不满3个月则可不进行收益分配；

5.本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

6. 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；

7. 基金收益分配后每一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；

8.法律法规或监管机构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收益分配基准日以及该日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

（五）收益分配的时间和程序

1.基金收益分配方案由基金管理人拟订，由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案；

2.在收益分配方案公布后，基金管理人依据具体方案的规定就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

四、与基金财产管理、运作有关费用的提取、支付方式与比例

（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.基金合同生效后的指数使用许可费；

4.基金财产拨划支付的银行费用；

5.基金合同生效后的基金信息披露费用；

6.基金份额持有人大会费用；

7.基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；

8.基金的开户费用、账户维护费用；

9.基金的证券交易费用；

10.依法可以在基金财产中列支的其他费用。

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

（三）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1.基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的1%年费率计提。计算方法如下：

H=E×年管理费率÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

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

2.基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提。计算方法如下：

H=E×年托管费率÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

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

3.基金合同生效后的指数使用许可费

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

H ＝ E×0.02%÷当年天数

H 为每日应计提的指数使用许可费

E 为前一日的基金资产净值

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

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

4.除管理费、托管费和指数使用许可费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

（四）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

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

（六）基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

五、基金财产的投资方向和投资限制

（一）投资目标

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

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

（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、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例范围为90%-95%，其中投资于深证300 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产的80%；除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为5%-10%，保持现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，股指期货、权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

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

（三）投资限制

1.组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：

（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）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；

（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%；

（5）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%；

（6）股票资产占基金资产的比例范围为90%-95%，其中投资于深证300 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产的80%；除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为5%-10%；

（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%；

（14）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；

（15）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；

（16）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%；

（17）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；

（18）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%。

本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；

（19）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90%-95%；

（20）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%；

（21）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；

（22）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开户、清算、估值、交收、费用等事宜另行具体协商。

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

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本基金合同生效之日起开始。

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；

（9）法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

（四）基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

六、基金资产净值的计算方法和公告方式

（一）基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项以及其他资产的价值总和。

（二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

（三）基金资产净值公告、基金份额净值公告、基金份额累计净值公告

1.本基金的基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人将至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值；

2.在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人将在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值；

3.基金管理人将公告半年度和年度最后一个市场交易日（或自然日）基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在上述市场交易日（或自然日）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报刊和网站上。

七、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

（一）基金合同的变更

1.基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。

（1）转换基金运作方式；

（2）变更基金类别；

（3）变更基金投资目标、投资范围或投资策略；

（4）变更基金份额持有人大会程序；

（5）更换基金管理人、基金托管人；

（6）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据适用的相关规定提高该等报酬标准的除外；

（7）本基金与其他基金的合并；

（8）对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；

（9）法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布，并报中国证监会备案：

（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。

2.关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行，并自生效之日起2日内在至少一种指定媒体公告。

（二）本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

1.基金份额持有人大会决定终止的；

2.基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在6个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；

3.基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在6个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；

4.中国证监会规定的其他情况。

（三）基金财产的清算

1.基金财产清算组

（1）基金合同终止时，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

（2）基金财产清算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。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

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

2.基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

（1）基金合同终止后，发布基金财产清算公告；

（2）基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；

（3）对基金财产进行清理和确认；

（4）对基金财产进行估价和变现；

（5）聘请会计师事务所对清算报告进行审计；

（6）聘请律师事务所出具法律意见书；

（7）将基金财产清算结果报告中国证监会；

（8）参加与基金财产有关的民事诉讼；

（9）公布基金财产清算结果；

（10）对基金剩余财产进行分配。

3.清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产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个工作日内由基金财产清算组公告；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，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

6.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。

八、争议解决方式

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，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，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。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本基金合同受中国法律管辖。

九、基金合同存放地和投资者取得合同的方式

本基金合同正本一式八份，除中国证监会和银行业监督管理机构各持两份外，基金管理人和基金托管人各持有两份。每份均具有同等的法律效力。

本基金合同可印制成册，供投资人在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构办公场所查阅，但其效力应以基金合同正本为准。