摩根士丹利华鑫深证300指数增强型证券投资基金招募说明书(更新)摘要

(2014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:中国建设银行股份有限公司

【重要提示】

摩根士丹利华鑫深证300指数增强型证券投资基金(以下简称"本基金")于2011年8月2日经中国证券监督管理委员会证监许可【2011】1218号文核准募集。本基金的基金合同于2011年11月15日正式生效。本基金为契约型开放式基金。

投资有风险,投资人认购(或申购)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》、《运作办法》、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2014年11月15日,有关财务数据和净值表现截止日为2014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: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:人民币22,750万元
联系人:赵婧
联系电话:(0755)88318883
股权结构如下:
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%)、汉唐证券有限责任公司(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,加拿大帕尔集团亚太分公司基金与保险业务副总裁,加拿大宏利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。现任本公司代董事长、总经理。

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

王文学先生,英国格林威治大学项目管理硕士。现任摩根士丹利华鑫证券有限责任公司董事长。1993年7月至2011年11月先后担任中国人民银行西安分行稽核处副处长,西安证券有限责任公司总经理、董事长,华鑫证券有限责任公司董事长,2008年5月至2014年3月任摩根士丹利华鑫基金管理有限公司董事长。现任本公司董事。

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月起至今先后担任摩根士丹利董事总经理及中国首席营运官,曾任摩根士丹利并购部门董事总经理、摩根士丹利西班牙财富管理子公司首席执行官,瑞士信贷(香港)有限公司董事总经理及金融机构部主管,2008年5月至2014年3月任摩根士丹利华鑫基金管理有限公司副董事长。现任本公司董事。

Edmond N. Moriarty先生,汉密尔顿学院学士,弗吉尼亚大学达顿商学院MBA。2011年3月起任摩根士丹利商业银行与房地产投资部主管。曾任摩根士丹利投资管理部首席运营官、美林证券公司联席首席风险管理官、环球信贷与债务部主管、GMI资产配置与债务部主管、证券投资银行部总经理。现任本公司董事。

赵恒先生,西安大学计划统计学专业,经济学学士。1985年9月起至今先后担任中国人民银行西安分行金融研究所研究室干部,西安证券有限责任公司总经理助理、副总经理、总经理,华鑫证券有限责任公司副总裁。现任本公司董事。

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

张嵩涛先生,英国兰开夏大学工商管理学学士,拉夫堡大学金融学硕士。2007年9月起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、亚太区财务规划主管。现任本公司独立董事,兼任杭州工商信托股份有限公司独立董事。

Paul M. Theil先生,耶鲁大学东亚研究学士、硕士,哈佛大学商学院工商管理硕士(MBA)、法学院法律博士(JD)。目前担任中安信业董事长,曾任摩根士丹利亚洲私募股权部门主管、美国驻华大使馆一秘。现任本公司独立董事。

苗复春先生,中国人民大学经济专业硕士。2007年5月起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产业组织与技术创新研究中心主任、教授、博士生导师。曾任教于上海新联纺织品进出口公司职工大学。现任本公司独立董事。

期后事项:

本公司第四届董事会第二十三次会议审议通过于华先生担任本公司董事长事宜。上述事项已经中国证券监督管理委员会证监许可[2014]1223号文核准批复,并报深圳证监局备案。本公司已按法律法规的规定于2014年11月25日公告上述调整事项。

深圳市招融投资控股有限公司于2014年10月29日致函本公司,说明洪小源先生将不再担任本公司董事,其将推荐洪磊女士作为本公司董事候选人。根据《摩根士丹利华鑫基金管理有限公司章程》规定,选举和更换董事须经公司股东会审批,相关审批程序正在进行中。

2、监事会成员

陈海东先生,南开大学经济学士,上海财经大学经济学硕士。2011年12月起至今任华鑫证券有限责任公司副总裁、合规总监,曾任天津住房公积金管理中心主管会计,厦门国际信托投资公司天津证券营业部门副经理,天同证券有限责任公司资产管理部投资经理,兴安证券有限责任公司资产管理部副总经理,华鑫证券有限责任公司财务部副总经理、客户资产存管中心总经理、合规稽核部总经理。现任本公司监事长。

蒋蓓怡女士,新加坡南洋理工大学会计学士。美国注册金融分析师(CFA)。2011年12月起至今担任摩根士丹利中国区首席风险官执行董事,曾任德意志银行(中国)有限公司上海分行风险管理部董事、德意志银行亚太总部风险管理部助理副总裁、德勤会计师事务所高级分析师,安达信会计师事务所高级分析师。现任本公司监事。

吴慧峰先生,上海财经大学会计系学士,北京大学国家经济研究院硕士。2014年起担任招商证券股份有限公司总裁助理兼董事会办公室联席总经理,曾任招商局金融集团有限公司副总经理、总经理助理、财务部经理、人力资源部经理,上海诚南房地产开发有限公司财务部副经理,中国南山开发集团股份有限公司结算中心主任。现任本公司监事。

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

张力女士,中国人民大学劳动经济专业硕士。2008年10月加入摩根士丹利华鑫基金管理有限公司,现任助理总经理。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,现任渠道业务部副总监兼电商业务小组组长。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,21年证券基金行业从业经历。先后在中国证监会深圳监管局政策法规处、市场处、机构监管处、基金监管处、机构监管二处等部门工作,历任副主任科员、主任科员、副处长、处长等职务。2009年7月加入本公司,现任本公司副总经理。

孙要国先生,英国格林威治大学项目管理专业硕士。17年证券基金行业从业经历。曾任职于西安证券有限责任公司总经理办公室、华鑫证券有限责任公司总裁办公室,曾任华鑫证券有限责任公司深圳营业部总经理。2009年4月加入本公司,现任本公司副总经理兼任董事会秘书。

高见先生,清华大学五道口金融学院经济学博士,14年证券基金行业工作经历。曾任职华夏基金管理有限公司基金管理部高级经理、市场部执行副总,大成基金管理有限公司规划发展部产品总监、委托投资部总监,中国民生银行私人银行事业部首席投资顾问兼产品与资产管理中心总监,中国国际金融有限公司执行总经理。2014年2月加入本公司,现任本公司副总经理。

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,17年证券基金行业从业经历。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,总经理助理兼基金运营部总监。现任本公司督察长。

4、本基金基金经理

刘钊先生,中国科学技术大学管理学博士,6年证券从业经验。曾于2006年9月至2008年9月任职于深交所博士后工作站, 2008年11月至2010年1月任职于五矿证券有限责任公司,历任总裁助理兼研究所负责人、董事会秘书。2010年1月加入本公司,现任数量化投资部总监,2012年7月起任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经理,2013年4月起任本基金基金经理,2014年1月起任摩根士丹利华鑫量化配置股票型证券投资基金基金经理。

周志超先生,南开大学经济学硕士,8年证券基金行业从业经历。曾于2006年3月至2007年7月任职于诺安基金管理有限公司,担任研究所行业分析师,2007年7月至2009年10月任职于信达澳银基金管理有限公司,担任研究部高级分析师,2009年10月至2011年5月任职于广发基金管理有限公司,担任行业分析师,2011年5月加入本公司,2013年11月起任本基金基金经理,2014年3月起任摩根士丹利华鑫主题优选股票型证券投资基金基金经理,2014年6月起任摩根士丹利华鑫卓越成长股票型证券投资基金基金经理,2014年8月起任摩根士丹利华鑫品质生活股票型证券投资基金基金经理。

本基金历任基金经理:赵立松先生,自本基金合同生效起至2013年3月管理本基金;程志田先生,自本基金合同生效起至2013年4月管理本基金。

期后事项:周宁先生于2014年12月9日起担任本基金基金经理,周志超先生和刘钊先生自该日起不再担任本基金基金经理。本公司已按规定在中国证券投资基金业协会完成基金经理变更,并于12月9日公告上述调整事项。

周宁先生,首都经济贸易大学会计学硕士,6年证券从业经历。曾于2008年7月至2010年9月任职于东兴证券股份有限公司,担任研究部行业分析师。2010年9月加入本公司,2014年12月起任本基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

主任委员:徐卫先生,本公司副总经理。

委员:卞亚军先生,基金投资部总监、基金经理;陈强兵先生,研究管理部总监;张大伟先生,固定收益投资部总监;刘钊先生,数量化投资部总监、基金经理;胡明女士,交易管理部总监。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人情况

名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)
住所:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:王洪章
成立时间:2004年09月17日
组织形式:股份有限公司
注册资本:贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12号
联系人:田 青
联系电话:(010)6759 5096

中国建设银行拥有悠久的经营历史,其前身"中国人民建设银行"于1954年成立,1996年易名为"中国建设银行"。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立,承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码:939)于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市,是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日,中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为:250,010,977,486股(包括240,417,319,880股H股及9,593,657,606股A股)。

2014年上半年,本集团实现利润总额1,695.16亿元,较上年同期增长9.23%;净利润1,309.70亿元,较上年同期增长9.17%。营业收入2,870.97亿元,较上年同期增长14.20%;其中,利息净收入增长12.59%,净利息收益率(NIM)2.80%;手续费及佣金净收入增长8.39%,在营业收入中的占比达20.96%。成本收入比24.17%,同比下降0.45个百分点。资本充足率与核心一级资本充足率分别为13.89%和11.21%,同业领先。

截至2014年6月末,本集团资产总额163,997.90亿元,较上年末增长6.75%,其中,客户贷款和垫款总额91,906.01亿元,增长6.99%;负债总额152,527.78亿元,较上年末增长6.75%,其中,客户存款总额129,569.56亿元,增长6.00%。

截至2014年6月末,中国建设银行公司机构客户326.89万户,较上年末增加20.35万户,增长6.64%;个人客户近3亿户,较上年末增加921万户,增长3.17%;网上银行客户1.67亿户,较上年末增长9.23%,手机银行客户数1.31亿户,增长12.56%。

截至2014年6月末,中国建设银行境内营业机构总量14,707个,服务覆盖面进一步扩大;自助设备72,128台,较上年末增加3,115台。电子银行和自助渠道账务性交易量占比达86.55%,较上年末提高1.15个百分点。

2014年上半年,本集团各方面良好表现,得到市场与业界广泛认可,先后荣获国内外知名机构授予的40余个重要奖项。在英国《银行家》杂志2014年"世界银行1000强排名"中,以一级资本总额位列全球第2,较上年上升3位;在美国《福布斯》杂志2014年全球上市公司2000强排名中位列第2;在美国《财富》杂志世界500强排名第38位,较上年上升12位。

中国建设银行总行设投资托管业务部,下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、监督稽核处等9个职能处室,在上海设有投资托管服务上海备份中心,共有员工240余人。自2007年起,托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计,并已经成为常规化的内控工作手段。

2、主要人员情况

赵观甫,投资托管业务部总经理,曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作,并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务,长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部,长期从事大客户的客户管理及服务工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室,长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行会计部,长期从事托管业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

3、基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国建设银行一直秉持"以客户为中心"的经营理念,不断加强风险管理和内部控制,严格履行托管人的各项职责,切实维护资产持有人的合法权益,为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展,中国建设银行托管资产规模不断扩大,托管业务品种不断增加,已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系,是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2014年9月末,中国建设银行已托管389只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平,赢得了业内的高度认同。中国建设银行自2009年至今连续五年被国际权威杂志《全球托管人》评为"中国最佳托管银行";获和讯网的中国"最佳资产托管银行"奖;境内权威经济媒体《每日经济观察》的"最佳基金托管银行"奖;中央国债登记结算有限责任公司的"优秀托管机构"奖。

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号嘉里建设广场第二座第17层
联系人:吴海灵
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
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:杨雪
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
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1000号恒生银行大厦45楼011-111单元
联系人:栾倩
电话:(021)63343311-2100
传真:(021)63343988

(4)摩根士丹利华鑫基金管理有限公司网上直销系统
交易系统网址:https://etrade.msfunds.com.cn/etrading
目前支持的网上直销银行卡:中国建设银行龙卡借记卡、招商银行"一卡通"借记卡、光大银行借记卡、中信银行借记卡、兴业银行借记卡、上海浦东发展银行借记卡、广发银行借记卡、南京银行借记卡、金华银行借记卡、温州银行借记卡、浙商银行借记卡、顺德农村商业银行借记卡和上海农村商业银行借记卡。
全国统一客服电话:400-8888-668
客户服务信箱:Services@msfunds.com.cn
深圳、北京或上海的投资人单笔申购金额超过100万元(含100万元)人民币的,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、销售机构

(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:王洪章
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:田国立
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
法定代表人:蒋超良
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:牛锡明
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:李建红
客户服务电话:95555
网址:http://www.cmbchina.com

(7)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:北京市西城区太平桥大街25号A座6层财富管理中心
法定代表人:唐双宁
客服电话:95595
网址:http://www.cebbank.com

(8)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:常振明
客户服务电话:95558
网址:http://bank.ecitic.com

(9)平安银行股份有限公司
注册地址:深圳市深南中路1099号平安银行大厦
办公地址:深圳市深南中路1099号平安银行大厦
法定代表人: 孙建一
联系人:芮蕊
联系电话:0755-25879756
客户服务电话:95511-3
网址:http://www.pingan.com/bank

(10)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
客户服务电话:95528
网址:http:// www.spdb.com.cn

(11)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: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: http:// www.yantaibank.net

(12)河北银行股份有限公司
注册地址:石家庄市平安北大街28号
办公地址:石家庄市平安北大街28号
法定代表人: 乔志强
客户服务电话:400-612-9999
网址: http://www.hebbank.com

(13)哈尔滨银行股份有限公司
注册地址:哈尔滨市道里区尚志大街160号
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: http://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:上海市肇嘉浜路750号
法定代表人:俞洋
联系人:陈敏
联系电话:021-64339000-807
客户服务电话:021-32109999,029-68918888
网址:http://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:顾凌
联系电话:010-608388696
客户服务电话:95558
网址:http:// 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:北京市朝阳门内大街188号
法定代表人:王常青
联系人:权唐
联系电话:010-85130577
客户服务电话:400-8888-108
网址: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号国际企业大厦C座
法定代表人:陈有安
联系人:田薇
联系电话:010-66568536
网址: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:010-63081000
客户服务电话:400-800-8899
网址:http://www.cindasc.com

(19) 民生证券股份有限公司
注册地址:北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-18层
办公地址:北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-18层
法定代表人:余政
联系人:赵明
联系电话:010-85127622
客户服务电话:4006-19-8888
网址:http://www.mszq.com

(20)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

(21)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:金芸、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

(22)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

(23)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:储晓明
联系人:李清怡
联系电话:021-54033888
客户服务电话:95523或4008895523
网址:http://www.sywg.com

(24)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:薛峰
联系人:李芳芳
联系电话:021-22169999
客户服务电话:400-8888-788、10108998
网址:http://www.ebscn.com

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

(26)长江证券股份有限公司
注册地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦
办公地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人:杨泽柱
联系人:李良
联系电话:027-65799999
客户服务电话:95579或4008-888-999
网址:http://www.95579.com

(27)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层
办公地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层
法定代表人:许刚
联系人:李丹
联系电话:021-20328216
客户服务电话:400-620-8888
网址:www.bocichina.com

(28)东方证券股份有限公司
注册地址:上海市中山南路318号2号楼21层-29层
办公地址:上海市中山南路318号2号楼21层-29层
法定代表人:潘鑫军
联系人:吴宇
联系电话:(021)63325888
客户服务电话:95503
网址:www. dfzq.com.cn

(29)湘财证券股份有限公司
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:湖南省长沙市天心区湘府中路198号标志商务中心11楼
法定代表人:林俊波
联系人:钟康莺
联系电话:021-68634518
客户服务电话:400-888-1551
网址:http://www.xcsc.com

(30)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
深圳市福田区深南大道4011号港中旅大厦24楼
法定代表人:吴万善
联系人:庞晓芸
联系电话:0755-82492193
客户服务电话:95597
网址:http://www.htsc.com.cn

(31)齐鲁证券有限公司
注册地址:山东省济南市经七路86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:http://www.qlzq.com.cn

(32)中信证券(山东)有限责任公司
注册地址: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
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:吴忠超
联系电话:(0532)85022326
客户咨询电话:95548
公司网址:www.citicssd.com

(33)中信证券(浙江)有限责任公司
注册地址:浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22楼
办公地址:浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22楼
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:0571-95548
网址:http://www.bigsun.com.cn

(34)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

(35)华龙证券有限责任公司
注册地址:甘肃省兰州市东岗西路638号财富大厦
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: http://www.hlzqgs.com

(36)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:4008-601555
客户服务电话:0512-33396288
网址:http://www.dwzq.com.cn

(37)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

(38)宏信证券有限责任公司
注册地址:四川省成都市人民南路二段18号川信大厦10楼
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:http://www.hxzq.cn

(39)安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
法定代表人:牛冠兴
联系人:陈剑虹
联系电话:0755-82558305
客户服务电话:4008-001-001
网址:http://www.essence.com.cn

(40)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18-21层及第04层01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23单元
办公地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层
法定代表人:龙增来
联系人:刘毅
联系电话:0755- 82023442
客户服务电话:400-600-8008、95532
网址:http://www.china-invs.cn

(41)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:95565、400-8888-111
网址:http://www.newone.com.cn

(42)国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人:何如
联系人:周杨
联系电话:0755-82130833
客户服务电话:95536
网址:http://www.guosen.com.cn

(43)平安证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
办公地址:深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
法定代表人:谢永林
联系人:郑舒丽
联系电话:0755-22626391
客户服务电话:400-8816-168
网址:http://stock.pingan.com

(44)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

(45)长城证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
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:http://www.cgws.com

(46)万和证券有限责任公司
注册地址:海南省海口市南沙路49号通讯广场二楼
办公地址:深圳市福田区深南大道7028号时代科技大厦20层西厅
法定代表人:朱治理
联系人:张琛
联系电话:0755-82830333-876
客户服务电话:0755-25170332
网址:http://www. vanho.cn

(47)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

(48)东莞证券有限责任公司
注册地址:广东省东莞市可园南路1号金源中心30楼
办公地址:广东省东莞市可园南路1号金源中心30楼
法定代表人:张运勇
联系人:苏卓仁
联系电话:(0769)22112062
客服电话:961130
网址:http://www.dgzq.com.cn

(49)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: http://www.txsec.com

(50)和讯信息科技有限公司
注册地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
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: http://licaike.hexun.com

(51)深圳众禄基金销售有限公司
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:汤素娅
联系电话:(0755)33227950
客户服务电话:4006-788-887
网址:众禄基金网 http://www.zlfund.cn
基金买卖网 http://www.jjmmw.com

(52)杭州数米基金销售有限公司
注册地址:杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人:陈柏青
联系人:周嬿旻
联系电话:(0571)28829790;(021)60897869
客户服务电话:4000-766-123
网址: http://www.fund123.cn

(53)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:浙江省杭州市文二西路1号元茂大厦903
法定代表人:李晓涛
联系人:杨翼
联系电话:0571-88920897 0571-88911818-8565
客户服务电话:4008-773-772 0571-88920897
网址: http:// www.5ifund.com

(54)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: http://www.ehowbuy.com

(55)上海天天基金销售有限公司
注册地址:浦东新区峨山路613号6幢551室
办公地址:上海市徐汇区龙田路195号3C座9楼
法定代表人:其实
联系人:潘世友
联系电话:021-54509998-7019
客户服务电话:400-1818-188
网址: http://www.1234567.com.cn

(56)上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16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:400-089-1289
网址: http://www.erichfund.com

(57)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
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: http://www.noah-fund.com

(58)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:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
法定代表人:陈操
联系人:刘宝文
联系电话: 010-58325395
客户服务电话:400-850-7771
网址: https://t.jrj.com

(59)宜信普泽投资顾问(北京)有限公司
注册地址:北京市朝阳区建国路88号9号楼15 层1809
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:沈伟桦
联系联系人:王巨明
电话:010-52855650
客户服务电话:400-6099-200
网址:http://www.yixinfund.com

(60)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:http://www.cifcofund.com

(61)北京展恒基金销售有限公司
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:韩晓彤
联系电话:010-62020088-7071
客户服务电话:400-888-6661
网址:http://www.myfund.com

(62)中国国际期货有限公司
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:http://www.cifco.net

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)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:YU HUA(于华)
联系人:刘芳冰
电话:(0755)88318721

(三)出具法律意见书的律师事务所
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

(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)
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦1604-1608室
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
法人代表:杨绍信
联系人: 俞伟敏
联系电话:(021)23238819
经办注册会计师:单峰、俞伟敏

四、基金的名称

本基金名称:摩根士丹利华鑫深证300指数增强型证券投资基金

五、基金的运作方式与类型

(一)本基金的运作方式:契约型开放式
(二)本基金的类型:股票型证券投资基金

六、基金的投资目标

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%。

七、基金的投资方向

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或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)。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。

八、基金的投资策略

(一)投资策略

本基金以深证300 指数为目标指数,采用指数化投资为主要投资策略,适度增强型投资策略为辅助投资策略。在严格控制跟踪误差的前提下,力争获得适度超越业绩比较基准的投资收益。为控制基金业绩偏离比较基准的风险,本基金力求控制基金份额净值增长率与业绩比较基准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%。

1、资产配置策略

本基金为指数基金,保持对目标指数的紧密跟踪,股票资产占基金资产的比例不低于90%,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%。本基金将根据申购、赎回情况、股票市场状况、宏观经济政策等因素的变化,在本基金的投资范围内进行适度调整股票、债券等资产的配置比例。在控制与目标指数的跟踪误差的前提下,适度获取超越业绩比较基准的投资收益。

2、股票投资策略

本基金股票投资策略由指数化投资策略和增强型投资策略组成。本基金以深证300指数为目标指数,通过复制目标指数的方法,即按照目标指数的成份股及其权重构建指数化投资组合,并根据目标指数成份股及其权重的变动进行定期和不定期调整,对于受法律法规限制不能投资的股票将选择其他品种进行替代。另外,本基金将对目标指数成份股及非成份股分别采取相应的适度增强的投资策略,力求提高本基金的投资收益。

(1)指数化投资策略

指数化投资策略是本基金主要股票投资策略,通过采用复制的方法,根据目标指数即深证300指数的成份股及其权重构建指数投资组合。在构建指数投资组合的过程中,尤其是在初始建仓过程中,本基金可采取适当的交易策略,以降低交易成本。

1)定期调整

本基金将根据深证300 指数的编制规则和定期调整公告,参照成份股及其权重的调整方案,在尽量减小跟踪误差的基础上,优化调整方案,对股票指数化投资组合进行相应调整。

2)不定期调整

a. 本基金将密切跟踪目标指数成份股临时调整公告,并及时制定相应的指数化投资组合调整策略;

b. 本基金将密切跟踪目标指数成份股及其备选成份股可能导致股本发生变化的信息,包括但不限于增发、配股、分红等,本基金将根据目标指数编制规则,在考虑跟踪误差风险的基础上,对指数化投资组合进行相应调整;

c. 本基金还将根据申购、赎回情况,结合现金头寸管理,制定相应的调整策略。

3)特殊调整

当发生法律法规限制、基金规模、流动性等特殊情况下,如基金管理人无法按照其所占目标指数权重构建投资组合时,基金管理人将综合考虑跟踪误差最小化和投资人利益,决定部分持有现金或买入相关的替代性组合。

(2)增强型主动投资策略

增强型主动投资策略是本基金辅助股票投资策略,包括:成份股增强策略和非成份股增强策略。

1)成份股增强策略

本基金在复制目标指数构建投资组合的基础上,基金管理人将以对当前及未来国内外宏观经济形势的判断和经济景气周期预测作为基础,结合经济周期的各发展阶段,从行业发展政策因素、产业结构变化趋势因素以及行业自身景气周期因素等多个指标把握不同行业的景气度情况和上市公司业绩增长的趋势,通过对目标指数成份股的深入研究,选择景气度处于上升行业中价值被市场低估的个股对指数投资组合进行优化增强。

2)非成份股增强策略

本基金将在充分利用公司研究团队研究成果的基础上,以"自上而下"与"自下而上"相结合的方法,精选出少量具备估值优势、持续成长能力的成份股之外的股票建立增强股票库。基金经理参考研究团队提供的策略、行业及个股研究支持,根据自身的综合判断,选择增强股票库中的股票进行适度投资,优化股票投资组合,力争获取超过目标指数的投资收益,增强投资组合整体收益水平。

3、债券投资策略

本基金债券投资的目的是基金资产流动性管理,有效利用基金资产,提高基金资产的投资收益。本基金将根据国内外宏观经济形势、货币政策、债券市场供求状况以及市场利率走势等因素,合理预期债券市场利率变动趋势,制定以久期控制下的债券资产配置策略,主要投资于到期日在一年以内的政府债券、金融债等。

4、股指期货投资策略

本基金可运用股指期货,以提高投资效率,有效控制指数的跟踪误差,更好地实现投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,本着审慎原则,适度参与股指期货投资,改善投资组合风险收益特征。另外,本基金将利用股指期货流动性好、杠杆交易的特点,进行现金管理,以应对大额赎回、大额现金分红等,管理流动性风险,优化投资组合对目标指数的跟踪效果,提高投资组合的运作效率等。

5、跟踪误差的控制

本基金为控制基金业绩偏离比较基准的风险,设定跟踪目标为:力求控制基金份额净值增长率与业绩比较基准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%。

本基金每日对基金净值增长率与业绩比较基准收益率偏离度进行跟踪,每月末定期分析基金跟踪误差变化情况及原因。如日均跟踪偏离度的绝对值接近或大于0.5%,基金管理人须进行归因分析,辨认造成跟踪误差引致因素,提出组合调整建议,基金经理须及时对投资组合进行相应调整,使跟踪误差回到限制值内。

(二) 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、国家财政政策、货币政策、产业政策、证券市场政策环境、市场资金供求状况、上市公司的经济运行状况;
(3)深证300指数的编制方法及调整公告等;
(4)深证300指数备选成份股的预测与分析。

2、投资程序

(1)投资决策委员会定期依据研究团队及基金经理提交的各类研究报告、指数投资组合调整方案,以及投资风险管理团队提供的风险监测指标等,制定投资原则、风险控制原则以及资产配置的指导意见。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。

(2)基金经理在投资决策委员会的授权范围内,在遵守基金合同、投资内部风控制度的前提下,依照目标指数编制规则、成份股调整公告、成份股权重以及指数增强策略等提出指数基金组合调整方案,组织实施获得批准的投资方案。基金经理的投资方案超过了授予权限的,经履行批准程序后实施。基金经理可配备基金经理助理协助其开展工作。

(3)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执行交易指令。基金经理与交易团队保持沟通,对交易结果进行分析。交易团队同时承担风险监控职责。

(4)投资风险管理团队由风险管理团队和监察稽核团队组成,风险管理团队定期对跟踪误差进行计算、归因分析,提出投资组合改进建议;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。

(5)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。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:深证300价格指数收益率×95% + 银行活期存款利率(税后)×5%

由于本基金为指数基金,并以深证300指数为目标指数进行跟踪复制,因此上述业绩比较基准适用于本基金。

深证300指数是深圳证券信息有限公司受深圳证券交易所委托,于2009年推出的作为可供跟踪交易的深圳市场指数。深证300指数选取在深圳证券交易所上市的300只A股组成,深证300指数的覆盖率较深证100指数大幅提高,对中小板和创业板公司的吸纳能力显著加强,使指数能更好地反映深市多层次资本市场的特点。

如果深证300指数被停止编制及发布,或深证300指数由其他指数替代(单纯更名除外),或由于指数编制方法等重大变更导致深证300指数不宜继续作为本基金的目标指数,本基金管理人可在履行适当程序后变更基金的目标指数和业绩比较基准。经与基金托管人协商一致,本基金变更业绩比较基准应报中国证监会备案,并在中国证监会指定的媒体上及时公告。

十、基金的风险收益特征

本基金为股票指数型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的基金产品,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

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。

基金托管人中国建设银行根据本基金合同规定,于2014年10月22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	61,571,173.48	91.44
	其中:股票	61,571,173.48	91.44
2	固定收益投资	2,517,380.00	3.74
	其中:债券	2,517,380.00	3.74
	资产支持证券	–	–
3	贵金属投资	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
5	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	银行存款和结算备付金合计	2,935,935.81	4.36
7	其他各项资产	311,965.94	0.46
8	合计	67,336,455.23	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 积极投资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	998,387.06	1.50
B	采掘业	1,538,400.78	2.32
C	制造业	32,006,900.06	48.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	906,448.21	1.37
E	建筑业	947,465.97	1.43
F	批发和零售业	2,318,343.91	3.49
G	交通运输、仓储和邮政业	268,006.71	0.40
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,553,781.52	6.86
J	金融业	3,766,042.01	5.68
K	房地产业	3,328,330.51	5.02
L	租赁和商务服务业	1,285,759.24	1.94
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	1,058,864.53	1.60
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	110,918.40	0.17
R	文化、体育和娱乐业	1,110,918.79	1.67
S	综合	411,277.24	0.62
	合计	54,609,844.94	82.31

2.2 指数投资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	23.34	0.00
B	采矿业	1,910.98	0.00
C	制造业	6,953,991.07	10.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	502.52	0.00
E	建筑业	573.92	0.00
F	批发和零售业	1,228.74	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	930.70	0.00
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,900.85	0.00
J	金融业	–	–
K	房地产业	266.42	0.00
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	–	–
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	–	–
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	6,961,328.54	10.49

3、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

3.1 期末指数投资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	000002	万 科A	176,262	1,618,085.16	2.44
2	000651	格力电器	46,890	1,300,259.70	1.96
3	000001	平安银行	102,926	1,043,669.64	1.57
4	000333	美的集团	37,682	749,494.98	1.13
5	002024	苏宁云商	84,095	719,853.20	1.09
6	000858	五 粮 液	36,590	675,817.30	1.02
7	000776	广发证券	60,129	658,412.55	0.99
8	000063	中兴通讯	38,266	580,112.56	0.87
9	000625	长安汽车	41,627	570,289.90	0.86
10	000783	长江证券	70,974	484,752.42	0.73

3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	002539	新都化工	209,774	3,608,112.80	5.44
2	002519	银河电子	125,053	3,323,908.74	5.01
3	000852	江钻股份	93	2,429.16	0.00
4	002424	贵州百灵	57	2,280.00	0.00
5	300020	银江股份	53	1,624.45	0.00

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	2,517,380.00	3.79
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	–	–
8	其他	–	–
9	合计	2,517,380.00	3.79

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	019322	13国债22	25,000	2,507,250.00	3.78
2	010501	05国债(1)	100	10,130.00	0.02

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规定,本基金可运用股指期货,以提高投资效率,有效控制指数的跟踪误差,更好地实现投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,本着审慎原则,适度参与股指期货投资,改善投资组合风险收益特征。另外,本基金将利用股指期货流动性好、杠杆交易的特点,进行现金管理,以应对大额申购赎回、大额现金分红等,管理流动性风险,优化投资组合对目标指数的跟踪效果,提高投资组合的运作效率等。

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 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本报告期内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、处罚的情形。

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 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	15,999.20
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	92,337.17
5	应收申购款	183,465.71
6	其他应收款	–
7	待摊费用	20,163.86
8	其他	–
9	合计	311,965.94

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换债券。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

十二、基金的业绩

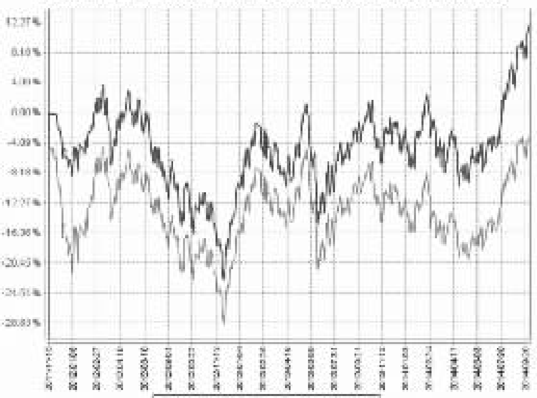
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1、自基金合同生效以来至2014年9月30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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
2011年11月15日至2011年12月31日	-6.50%	0.51%	-17.95%	1.37%	11.45%	-0.86%
2012年1月1日至2012年12月31日	-3.32%	1.22%	2.37%	1.37%	-5.69%	-0.15%
2013年1月1日至2013年12月31日	7.74%	1.31%	4.59%	1.32%	3.15%	-0.01%
2014年1月1日至2014年6月30日	-1.95%	1.15%	-3.83%	1.11%	1.88%	0.04%
自基金合同生效起至2014年9月30日	12.00%	1.19%	-2.89%	1.28%	14.89%	-0.09%

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

摩根士丹利华鑫深证300指数增强型证券投资基金
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:
(2011年11月15日至2014年9月30日)



十三、基金的费用与税收

(一)与基金运作有关的费用

1、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。

2、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。

3、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。

(二)与基金销售有关的费用

1、基金申购费用

本基金以申购金额为基数采用比例费率计算申购费。投资人在一天之内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。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、注册登记等各项费用。

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基金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	0.48%
100万元≤M<500万元	0.32%
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	1.20%
100万元≤M<500万元	0.80%
M≥500万元	每笔1000元

计算公式:
申购费用=申购金额-净申购金额
净申购金额=申购金额/(1+申购费率)

2、基金赎回费用

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。赎回费中不低于赎回费总额的25%归基金财产,其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。具体赎回费率结构如下:

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

注:1年指365天。

计算公式:
赎回费用=赎回金额×赎回费率
赎回金额=赎回份数×赎回价格
赎回价格=申请日基金份额净值

3、转换费用

本基金转换费用由转出基金的赎回费和转出与转入基金的申购费补差两部分构成,具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率差异情况和赎回费率而定。基金转换费用由基金份额持有人承担,计算方法如下:

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,以转入总金额对应的转出基金申购费率、转入基金申购费率计算申购补差费用。

(2)转出基金赎回费不低于25%的部分归入转出基金资产。

(3)计算基金转换费用所涉及的申购费率和赎回费率均按基金合同、招募说明书及相关公告的规定费率执行,对于通过本公司网上交易、费率优惠活动期间发生的基金转换业务,按照本公司最新公告的相关费率计算基金转换费用。

基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式,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。

(三)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。

(四)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。

(五)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。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》及其它有关法律法规的要求,对2014年6月27日刊登的《摩根士丹利华鑫深证300指数增强型证券投资基金招募说明书(更新)》进行了更新,主要更新的内容如下:

序号	修改部分	说明
1	重要提示	更新了本招募说明书所载内容截止日期
2	二、释义	更新了部分释义的文字描述
3	三、基金管理人	更新了"主要人员情况"的有关信息
4	四、基金托管人	根据基金托管人提供的信息,更新了"基金托管人"有关信息
5	五、相关服务机构	根据服务机构的实际情况更新了相关机构的信息
6	九、基金的投资	更新最近一期投资组合报告的内容,即截至2014年9月30日的基金投资组合报告
7	十、基金的业绩	更新了基金的投资业绩,即截至2014年9月30日的基金投资业绩
8	二十一、对基金份额持有人的服务	修改了对基金份额持有人服务的个别文字表述
9	二十二、其他应披露事项	根据最新情况对相关应披露事项进行了更新

摩根士丹利华鑫基金管理有限公司
二〇一四年十二月二十九日