

**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  
(2018 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，投资人投资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。

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

本招募说明书（更新）摘要所载内容截止日为 2018 年 11 月 15 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2018 年 9 月 30 日（财务数据未经审计）。

## 目 录

一、基金管理人.....	1
二、基金托管人.....	5
三、相关服务机构.....	8
四、基金的名称.....	34
五、基金的运作方式与类型.....	34
六、基金的投资目标.....	34
七、基金的投资方向.....	34
八、基金的投资策略.....	35
九、基金的业绩比较基准.....	38
十、基金的风险收益特征.....	38
十一、基金的投资组合报告.....	38
十二、基金的业绩.....	38
十三、基金的费用与税收.....	44
十四、对招募说明书更新部分的说明.....	49

## 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

股权结构应为：

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

### （二）主要人员情况

#### 1、董事会成员

于华先生，北京大学经济学学士，鲁汶大学工商管理硕士、金融博士，美国注册金融分析师（CFA）。曾任深圳证券交易所综合研究所所长，加拿大鲍尔集团亚太分公司基金与保险业务副总裁，加拿大伦敦人寿保险公司北京代表处首席代表，大成基金管理有限公司董事、总经理，摩根士丹利亚洲有限公司董事总经理、中国投资管理业务主管，摩根士丹利华鑫基金管理有限公司总经理。现任本公司董事长兼任代理总经理。

俞洋先生，澳门科技大学工商管理硕士，上海财经大学工商管理硕士。曾任常州市证券公司延陵东路营业部总经理、巨田证券有限责任公司无锡营业部总经理、华鑫证券有限责任公司总裁助理、华鑫证券有限责任公司副总裁、华鑫证券有限责任公司总裁、党委副书记、董事、华鑫证券投资有限公司董事长、华鑫期货有限公司董事。2017年5月至今任上海华鑫股份有限公司总经理，现任本公司副董事长。

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

监、总监、财务负责人。2017 年 5 月至今任上海华鑫股份有限公司总会计师。现任本公司董事。

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

Todd Coltman 先生，毕业于加利福尼亚州立大学通讯专业，并于乔治敦大学获得法学博士学位。曾任美国银行高级政策分析师、年利达律师事务所律师、众达律师事务所律师。2004 年加入摩根士丹利负责亚洲地区不动产投资（REI）业务的不动产收购融资工作，2016 年至今担任摩根士丹利亚洲有限公司投资管理业务亚洲地区运营总监。现任本公司董事。

Jeremy Alton Huff 先生，杜克大学文学学士，哈佛大学法学博士。曾任美国世达律师事务所律师、NBA 中国法律副总监、NBA 中国品牌娱乐的副总裁。2017 年 3 月至今任摩根士丹利董事总经理并担任中国首席运营官。现任本公司董事。

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

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

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

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

Paul M. Theil 先生，耶鲁大学东亚研究学士、硕士，哈佛大学商学院工商管理硕士（MBA）、法学院法律博士（JD）。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。

## 2、监事会成员

赵恒先生，西安大学计划统计学学士，上海财经大学工商管理硕士。曾任中国人民银行西安分行干部、西安证券有限责任公司总经理、华鑫证券有限责任公司总监、摩根士丹利华鑫基金管理有限公司董事。2008年至今任华鑫证券有限责任公司副总裁，兼任华鑫期货有限公司董事长，2017年6月起任上海华鑫股份有限公司副总经理。现任本公司监事长。

Mok Tuang Wei先生，加州大学伯克利分校学士、硕士。曾经在瓦乔维亚证券负责发行结构化和证券化产品，并在安永会计师事务所提供企业融资咨询服务。2010年9月加入摩根士丹利亚太区，2014年加入摩根士丹利风险投资管理团队，现任摩根士丹利投资风险管理执行董事。现任本公司监事。

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

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

周苑洁女士，华东政法大学国际经济法法学学士，复旦大学管理学院工商管理硕士。曾任大鹏资产管理有限责任公司客户关系管理经理。2004年加入本公司，历任客户服务中心负责人、上海理财中心负责人、营销策划经理、市场发展部总监助理、销售服务部副总监，现任本公司销售服务部总监、渠道业务二部总监、职工监事。

周源女士，湘潭大学计算机应用专业学士、湖南大学金融学院国际金融硕士。曾任招商基金管理有限公司基金会计（高级经理）。2010年起加入本公司，曾任基金运营部副总监、专户理财部副总监，现任本公司专户理财部总监、职工监事。

许菲菲女士，中南财经大学国际会计专业学士。曾任职于深圳市华新股份有限公司财务部、宝盈基金管理有限公司基金运营部。2005年加入本公司，历任基金运营部基金会计、监察稽核部高级监察稽核员、总监助理、副总监，现任本公司监察稽核部总监、职工监事。

徐达女士，弗吉尼亚大学商业与经济学士。2012年加入本公司，曾任公司研究管理部研究员，现任本公司权益投资部总监助理、基金经理、职工监事。

## 3、公司高级管理人员

于华先生，董事长、代理总经理，简历同上。

孙要国先生，英国格林威治大学项目管理专业硕士。21年证券基金行业工作经历。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。

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，21年证券基金行业工作经历。曾就职于巨田证券有限责任公司，历任交易管理总部综合管理部经理助理，总经理办公室主任助理，资产管理部理财部副经理、经理，研究所研究员。2003年9月加入本公司，历任基金运营部副总监、总监，总经理助理兼基金运营部总监，督察长。现任本公司副总经理兼风险管理部总监。

陈竽女士，英国约克大学项目分析、金融与投资硕士，14年证券基金行业工作经历。曾任泰达宏利基金管理有限公司高级风险管理经理，农银汇理基金管理有限公司监察稽核部副总经理（主持工作），中信保诚基金管理有限公司监察稽核总监。2018年3月加入本公司，现任本公司督察长。

#### 期后事项：

陈竽女士由于个人原因离职，自 2018 年 12 月 8 日起不再担任本公司督察长，上述事项已由本公司第六届董事会第七次会议审议通过，并按有关规定履行备案手续。公司于 2018 年 12 月 8 日公告该事项。

#### 4、本基金基金经理

夏青先生，美国马里兰大学金融数学博士，12年证券从业经历。曾任美国摩根士丹利机构证券部副总裁，美国芝加哥交易对冲基金投资经理，美国斯考特交易对冲基金投资经理，万向资源有限公司量化投资部总经理，东吴证券股份有限公司投资总部董事总经理。2016年7月加入本公司，现任数量化投资部总监、组合投资部总监、基金经理。2017年6月起担任摩根士丹利华鑫多因子精选策略混合型证券投资基金、摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资基金、摩根士丹利华鑫量化多策略股票型证券投资基金基金经理，2017年12月起担任摩根士丹利华鑫新趋势灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018年5月起担任本基金、摩根士丹利华鑫睿成中小盘弹性股票型证券投资基金基金经理。

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。周志超先生，2013年11月至2014年12月管理本基金。刘钊先生，2013年4月至2014年12月管理本基金。周宁先生，2014年12月至2016年7月管理本基金。吴国雄先生，2016年7月至2018年6月管理本基金。

#### 5、投资决策委员会成员

主任委员：何晓春，助理总经理、权益投资部总监、基金经理。

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

委员：王大鹏，研究管理部总监、基金经理；夏青，数量化投资部总监、组合投资部总

监、基金经理；李功舜，交易管理部总监；张雪，固定收益投资部副总监、基金经理。

秘书：王大鹏，研究管理部总监、基金经理。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### （一）基本情况

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：田国立

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

中国建设银行成立于 1954 年 10 月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于 2005 年 10 月在香港联合交易所挂牌上市（股票代码 939），于 2007 年 9 月在上海证券交易所挂牌上市（股票代码 601939）。

2018 年 6 月末，本集团资产总额 228,051.82 亿元，较上年末增加 6,807.99 亿元，增幅 3.08%。上半年，本集团盈利平稳增长，利润总额较上年同期增加 93.27 亿元至 1,814.20 亿元，增幅 5.42%；净利润较上年同期增加 84.56 亿元至 1,474.65 亿元，增幅 6.08%。

2017 年，本集团先后荣获香港《亚洲货币》“2017 年中国最佳银行”，美国《环球金融》“2017 最佳转型银行”、新加坡《亚洲银行家》“2017 年中国最佳数字银行”、“2017 年中国最佳大型零售银行奖”、《银行家》“2017 最佳金融创新奖”及中国银行业协会“年度最具社会责任金融机构”等多项重要奖项。本集团在英国《银行家》“2017 全球银行 1000 强”中列第 2 位；在美国《财富》“2017 年世界 500 强排行榜”中列第 28 名。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合与合规管理处、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、跨境托管运营处、监督稽核处等10个职能处室，在安徽合肥设有托管运营中心，在上海设有托管运营中心上海分中心，共有员工315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。

## （二）主要人员情况

纪伟，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行南通分行、总行计划财务部、信贷经营部任职，并在总行公司业务部、投资托管业务部、授信审批部担任领导职务。其拥有八年托管从业经历，熟悉各项托管业务，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），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。

郑绍平，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原玗，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

## （三）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、(R)QFII、(R)QDII、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2018年二季度末，中国建设银行已托管857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。中国建设银行先后9次获得《全球托管人》“中国最佳托管银行”、4次获得《财资》“中国最佳次托管银行”、连续5年获得中债登“优秀资产托管机构”等奖项，

并在 2016 年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”、在 2017 年荣获《亚洲银行家》“最佳托管系统实施奖”。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### （一）内部控制目标

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

### （二）内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作，具有独立行使内控合规工作职权和能力。

### （三）内部控制制度及措施

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

## 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

### （一）监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“新一代托管应用监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

### （二）监督流程

1. 每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统，对各基金投资运作比例控制等情况进行监控，如发现投资异常情况，向基金管理人进行风险提示，与基金管理人进行情况核实，

督促其纠正，如有重大异常事项及时报告中国证监会。

2. 收到基金管理人的划款指令后，对指令要素等内容进行核查。

3. 通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，如有必要将及时报告中国证监会。

### 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：时亚蒙

电话：（0755）88318898

传真：（0755）82990631

###### （2）摩根士丹利华鑫基金管理有限公司北京分公司

办公地址：北京市西城区太平桥大街18号丰融国际大厦1005室

联系人：张宏伟

电话：（010）66155568-6100

传真：（010）66158135

###### （3）摩根士丹利华鑫基金管理有限公司上海分公司

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

联系人：朱冰楚

电话：（021）63343311-2100

传真：（021）50429808

###### （4）摩根士丹利华鑫基金管理有限公司网上直销系统

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

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

全国统一客服电话：400-8888-668

客户服务信箱: [Services@msfunds.com.cn](mailto: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（办公）地址：北京市西城区金融大街25号

法定代表人：田国立

客户服务电话：95533

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

### （2）中国工商银行股份有限公司

注册（办公）地址：中国北京复兴门内大街55号

法定代表人：易会满

客户服务电话：95588（全国）

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

### （3）中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街69号

办公地址：北京市东城区建国门内大街69号

法定代表人：周慕冰

客户服务电话：95599

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

### （4）中国银行股份有限公司

注册（办公）地址：北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人：陈四清

客户服务电话：95566（全国）

网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

### （5）交通银行股份有限公司

注册（办公）地址：上海市浦东新区银城中路188号

法定代表人：彭纯

联系人：王菁

联系电话：021-58781234

传真：021-58408483

客户服务电话：95559

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

(6) 招商银行股份有限公司

注册（办公）地址：深圳市福田区深南大道7088号

法定代表人：李建红

客户服务电话：95555

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

(7) 中国光大银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心

办公地址：北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心

法定代表人：李晓鹏

客户服务电话：95595（全国）

网址：[www.cebbank.com](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9号文化大厦

法定代表人：李庆萍

客户服务电话：95558

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

(9) 中国民生银行股份有限公司

注册（办公）地址：北京市西城区复兴门内大街2号

法定代表人：洪崎

联系人：穆婷

联系电话：010-58560666

客户服务热线：95568

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

(10) 平安银行股份有限公司

注册（办公）地址：深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦

法定代表人：谢永林

联系人：施艺帆

联系电话：021-50979384

客户服务电话：95511-3

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

(11) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路500号

办公地址：上海市中山东一路12号

法定代表人：吉晓辉

客户服务热线：95528

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

(12) 烟台银行股份有限公司

注册（办公）地址：山东省烟台市芝罘区海港路25号

法定代表人：叶文君

联系人：王淑华

联系电话：0535-6699660

客户服务电话：4008-311-777

网址：[www.yantaibank.net](http://www.yantaibank.net)

(13) 河北银行股份有限公司

注册（办公）地址：石家庄市平安北大街28号

法定代表人：乔志强

客户服务电话：400-612-9999

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

(14) 哈尔滨银行股份有限公司

注册（办公）地址：哈尔滨市道里区尚志大街160号

法定代表人：郭志文

客户服务电话：95537、400-60-95537

网址：www.hrbb.com.cn

（15）华鑫证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01（b）单元

办公地址：上海市徐汇区宛平南路8号

法定代表人：俞洋

联系人：杨莉娟

联系电话：021-54967202

客户服务电话：021-32109999；029-68918888；4001099918

网址：www.cfsc.com.cn

（16）中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人：王东明

联系人：侯艳红

联系电话：010-60838995

客户服务电话：400-889-5548

网址：www.cs.ecitic.com

（17）中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街188号

法定代表人：王常青

联系人：魏明

联系电话：（010）85130588

客户服务电话：4008888108

网址：www.csc108.com

（18）中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

办公地址：北京市西城区金融大街35号2-6层

法定代表人：陈共炎

联系人：邓颜

联系电话：010-66568292

客户服务电话：4008-888-888或95551

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

(19) 信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

办公地址：北京市西城区宣武门西大街甲127号大成大厦6层法定代表人：张志刚

联系人：尹旭航

联系电话：（010）63081000

客户服务电话：95321

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

(20) 民生证券股份有限公司

注册（办公）地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-18层

法定代表人：余政

联系人：赵明

联系电话：（010）85127622

客户服务电话：4006-19-8888

网址：<http://www.msza.com>

(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：李笑鸣

联系电话：021-23219000

客户服务电话：95553



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

(22) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路618号

办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼

法定代表人：杨德红

联系人：芮敏祺、朱雅崑

联系电话：（021）38676161

客户服务电话：95521

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

(23) 申万宏源证券有限公司

注册（办公）地址：上海市徐汇区长乐路989号45层

法定代表人：李梅

联系人：曹晔

联系电话：（021）33389888

客户服务电话：95523或4008895523

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

(24) 光大证券股份有限公司

注册（办公）地址：上海市静安区新闻路1508号

法定代表人：薛峰

联系人：刘晨、李芳芳

联系电话：（021）22169999

客户服务电话：400-8888-788、10108998

网址：[www.ebscn.com](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：上海市浦东新区长柳路36号

法定代表人：杨华辉

联系人：乔琳雪

联系电话：021-38565547

客户服务电话：95562

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

(26) 长江证券股份有限公司

注册（办公）地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：尤习贵

联系人：奚博宇

联系电话：（027）65799999

客户服务电话：95579或4008-888-999

网址：[www.95579.com](http://www.95579.com)

(27) 中银国际证券股份有限公司

注册（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](http://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22层、23层、25层-29层

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

法定代表人：潘鑫军

联系人：孔亚楠

联系电话：021-63325888

客户服务电话：95503

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

(29) 湘财证券股份有限公司

注册（办公）地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼

法定代表人：孙永祥

联系人：李欣

联系电话：021-38784580-8918

客户服务电话：95351

网址：www.xcsc.com

(30) 华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路228号

办公地址：南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场

法定代表人：周易

联系人：庞晓芸

联系电话：(0755) 82492193

客户服务电话：95597

网址：www.htsc.com.cn

(31) 中泰证券股份有限公司

注册（办公）地址：济南市经七路86号

法定代表人：李玮

联系人：王霖

联系电话：(0531) 68889157

客户服务电话：95538

网址：www.zts.com.cn

(32) 中信证券（山东）有限责任公司

注册（办公）地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层

法定代表人：杨宝林

联系人：孙秋月

联系电话：(0532) 85022026

客户服务电话：95548

公司网址：www.citicssd.com

(33) 山西证券股份有限公司

注册（办公）地址：太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

联系人：郭熠

联系电话：（0351）8686659

客户服务电话：400-666-1618

网址：www.i618.com.cn

（34）华龙证券股份有限公司

注册（办公）地址：甘肃省兰州市东岗西路638号财富大厦

法定代表人：李晓安

联系人：李昕田

联系电话：0931-8784656

客户服务电话：400-689-8888

网址：www.hlzqgs.com

（35）东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州工业园区翠园路181号商旅大厦

办公地址：苏州工业园区星阳街5号

法定代表人：范力

联系人：方晓丹

联系电话：0512-65581136

客户服务电话：4008-601555

网址：www.dwzq.com.cn

（36）方正证券股份有限公司

注册（办公）地址：湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层

法定代表人：何其聪

联系人：高利

联系电话：0731-85832507

客户服务电话：95571

网址：www.foundersc.com

## (37) 宏信证券有限责任公司

注册（办公）地址：四川省成都市人民南路二段18号川信大厦10楼

法定代表人：吴玉明

联系人：刘进海

联系电话：028-86199278

客户服务电话：4008-366-366

网址：www.hxzq.cn

## (38) 安信证券股份有限公司

注册（办公）地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

法人代表人：牛冠兴

联系人：郑向溢

联系电话：（0755）82558038

客户服务电话：4008-001-001

网址：www.essence.com.cn

## (39) 中国中投证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23单元

办公地址：深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层

法定代表人：高涛

联系人：刘毅

联系电话：（0755）82023442

客户服务电话：400-600-8008、95532

网址：www.china-invs.cn

## (40) 招商证券股份有限公司

注册（办公）地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层

法定代表人：霍达

联系人：黄婵君

联系电话：0755-82943666

客户服务热线：95565、400-8888-111

网址：www.newone.com.cn

(41) 国信证券股份有限公司

注册（办公）地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

联系人：周杨

联系电话：（0755）82130833

客户服务电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

(42) 平安证券股份有限公司

注册（办公）地址：深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层

法定代表人：詹露阳

联系人：周一涵

联系电话：（0755）38637436

客户服务电话：95511-8

网址：stock.pingan.com

(43) 国海证券股份有限公司

注册地址：广西南宁市滨湖路46号

办公地址：深圳市福田区竹子林四路紫竹七道18号光大银行大厦30楼

法定代表人：张雅锋

联系人：牛孟宇

联系电话：（0755）83709350

客户服务电话：95563

网址：www.ghzq.com.cn

(44) 华西证券股份有限公司

注册（办公）地址：四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦

法定代表人：杨炯洋

联系人：谢国梅

联系电话：010-52723273

客户服务热线：95584

网址：www.hx168.com.cn

(45) 长城证券股份有限公司

注册（办公）地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

法定代表人：黄耀华

联系人：刘阳

联系电话：0755-83516289

客户服务电话：400-6666-888

网址：www.cgws.com

(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楼西

法定代表人：朱治理

联系人：周小钰

联系电话：0755-88694888-857

客户服务电话：4008-882-882

网址：www.wanhesec.com

(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）

网站：www.hfzq.com.cn

(48) 东莞证券股份有限公司

注册（办公）地址：广东省东莞市可园南路1号金源中心30楼

法定代表人：张运勇

联系人：苏卓仁

联系电话：（0769）22112062

客服电话：961130

网址：www.dgzq.com.cn

（49）申万宏源西部证券有限公司

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

法定代表人：李季

联系人：王怀春

联系电话：0991-2307105

客户服务热线：4008-000-562

网址：www.hysec.com

（50）国金证券股份有限公司

注册（办公）地址：成都市青羊区东城根上街95号

法定代表人：冉云

联系人：刘婧漪、贾鹏

联系电话：028-86690057、028-86690058

客户服务热线：95310

网址：www.gjq.com.cn

（51）中国民族证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼

办公地址：北京市朝阳区北四环中路盘古大观40层-43层

法定代表人：何亚刚

联系人：齐冬妮

联系电话：010-59355807

客户服务电话：40088-95618

网址：www.e5618.com



(52) 中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座6层

法定代表人：丁学东

联系人：任敏、陈曦

联系电话：010-65051166

客户服务热线：010-65051166

网址：www.cicc.com

(53) 上海证券有限责任公司

注册（办公）地址：上海市黄浦区四川中路213号7楼

法定代表人：李俊杰

联系电话：021-53686888

客户服务电话：021-962518

网址：www.962518.com

(54) 中信期货有限公司

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

法定代表人：张皓

联系人：刘宏莹

联系电话：010-60833754

客户服务电话：400-990-8826

网址：www.citicsf.com

(55) 天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701

办公地址：北京市西城区新街口外大街28号C座5层

法定代表人：林义相

联系人：尹伶

联系电话：（010）66045529

客户服务电话：010-66045678

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

(56) 和讯信息科技有限公司

注册（办公）地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层

法定代表人：王莉

联系人：梁檐

联系电话：021-20835789

客户服务电话：400-920-0022

网址：[licaike.hexun.com](http://licaike.hexun.com)

(57) 深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

联系电话：（0755）33227950

客户服务电话：4006-788-887

网址：众禄基金网 [www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn)

基金买卖网 [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

(58) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1栋202室

办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F

法定代表人：陈柏青

联系人：韩爱彬

联系电话：0571-26888888-37494

客户服务电话：4000-766-123

网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

(59) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路1号元茂大厦903

办公地址：浙江省杭州市余杭区五常街道同顺街18号 同花顺大楼4层

法定代表人：凌顺平

联系人：吴强

联系电话：0571-88911818

客户服务电话：4008-773-772

网址：<http://www.5ifund.com>

(60) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室

办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室

法定代表人：杨文斌

联系人：张茹

联系电话：021-20613999

客户服务电话：400-700-9665

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

(61) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层

办公地址：上海市徐汇区龙田路195号3C座7楼宛平南路88号东方财富大厦

法定代表人：其实

联系人：黄妮娟

联系电话：021-54509998

客户服务电话：400-1818-188

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

(62) 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：上海市浦东新区东方路1267号11层

法定代表人：张跃伟

联系人：沈雯斌

联系电话：021-58788678-8201

客户服务电话：400-820-2899

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

(63) 诺亚正行基金销售有限公司

注册地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路7650号205室

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴银城中路68号时代金融中心8楼801

法定代表人：汪静波

联系人：方成

联系电话：021-38602377

客户服务电话：400-821-5399

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

(64) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#

办公地址：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦16层

法定代表人：杨懿

联系人：张燕

联系电话：400-166-1188

客户服务电话：400-166-1188

网址：<http://8.jrj.com.cn>

(65) 宜信普泽（北京）基金销售有限公司

注册（办公）地址：北京市朝阳区建国路88号9号楼15 层1809

法定代表人：戎兵

联系人：王巨明

联系电话：010-52855650

客户服务电话：400-6099-200

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

(66) 中期资产管理有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路16号1幢11层

办公地址：北京市朝阳区建国门外光华路16号1幢2层

法定代表人：路瑶

联系人：侯英建

联系电话：010-65807865

客户服务电话：010-65807609

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

(67) 北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号

办公地址：北京市朝阳区华严北里2号民建大厦6层

法定代表人：闫振杰

联系人：马林

联系电话：010-62020088- 7024

客户服务电话：4008188000

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

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

(69) 北京创金启富基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A

办公地址：北京市西城区白纸坊东街2号经济日报社A座综合楼712号

法定代表人：梁蓉

联系人：张旭

联系电话：010-66154828

客户服务电话：400-6262-818

网址：[www.5irich.com](http://www.5irich.com)

(70) 上海汇付基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区中山南路100号19层

办公地址：上海市宜山路700号普天信息产业园2期C5栋汇付天下总部大楼2楼

法定代表人：冯修敏

联系人：陈云卉

联系电话：021-33323999-5611

客户服务电话：400-820-2819

网址：[fund.bundtrade.com](http://fund.bundtrade.com)

(71) 上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333 号14 楼09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333 号14 楼

法定代表人：胡学勤

联系人：宁博宇

联系电话：021-20665952

客户服务电话：4008219031

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

(72) 上海联泰资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室

办公地址：上海市长宁区福泉北路518号8座3层

法定代表人：燕斌

联系人：陈东

联系电话：021-52822063

客户服务热线：4000-466-788

网址：[www.66zichan.com](http://www.66zichan.com)

(73) 上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏南路765号602-115室

办公地址：上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼

法定代表人：陈继武

联系人：李晓明

联系电话：021-63333319

客户服务热线：4000 178 000

网址：www.vstonewealth.com

（74）深圳富济基金销售有限公司

注册（办公）地址：深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦35层01B、02、03、04单位

法定代表人：刘鹏宇

联系人：刘勇

联系电话：0755-83999907-8814

客户服务热线：0755-83999907

网址：www.fujifund.cn

（75）北京钱景基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012

办公地址：北京市海淀区丹棱街6号丹棱SOHO大厦1008

法定代表人：赵荣春

联系人：陈剑炜

联系电话：010-57418813

客户服务热线：400-893-6885

网址：www.qianjing.com

（76）上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室

办公地址：上海市虹口区东大名路1098号浦江金融世纪广场18层

法定代表人：李兴春

联系人：陈洁

联系电话：021-60195121

客户服务热线：400-921-7755

网址：www.leadfund.com.cn

（77）珠海盈米基金销售有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

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

法定代表人：肖雯

联系人：黄敏嫦

联系电话：020-89629099

客户服务电话：020-89629066

公司网址：www.yingmi.cn

(78) 中证金牛（北京）投资咨询有限公司

注册地址：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室

办公地址：北京市宣武门外大街甲一号新华社第三工作区A座5层

法定代表人：钱昊旻

联系人：孙雯

联系电话：010-59336519

客户服务热线：4008-909-998

公司网址：www.jnlc.com

(79) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街11号E世界财富中心A座11层1108号

办公地址：北京市海淀区中关村大街11号E世界财富中心A座11层

法定代表人：王伟刚

联系人：丁向坤

联系电话：010-56282140

客户服务热线：400-619-9059

网址：www.hcjijin.com

(80) 大泰金石基金销售有限公司

注册（办公）地址：上海市浦东新区峨山路505号东方纯一大厦15楼

法定代表人：袁顾明

联系人：何庭宇

联系电话：13917225742



客户服务热线：400-928-2266

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

(81) 深圳市金斧子基金销售有限公司

注册地址：深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元11层

办公地址：深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元7层

法定代表人：赖任军

联系人：刘昕霞

联系电话：0755-29330513

客户服务热线：400-930-0660

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

(82) 上海万得基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座

办公地址：上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼

法定代表人：王廷富

联系人：徐亚丹

联系电话：021-51327185

客户服务热线：400-821-0203

网址：[www.520fund.com.cn](http://www.520fund.com.cn)

(83) 北京新浪仓石基金销售有限公司

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

法定代表人：李昭琛

联系人：付文红

联系电话：010-62676405

客户服务热线：010-62675369

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

(84) 北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路甲19号SOHO嘉盛中心30层

法定代表人：周斌

联系人：张晔

联系电话：010-59313591

客户服务热线：4008-980-618

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

(85) 北京晟视天下投资管理有限公司

注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街甲六号万通中心D座28层

法定代表人：蒋煜

联系人：杨雪

联系电话：010-58170963

客户服务热线：400-818-8866

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

(86) 北京肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15

办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院A座17层

法定代表人：江卉

联系人：徐伯宇

联系电话：010-89189285

客户服务热线：95118/400-088-8816

网址：<http://fund.jd.com>

(87) 南京苏宁基金销售有限公司

注册（办公）地址：南京玄武区苏宁大道1-5号

法定代表人：钱燕飞

联系人：赵耶

联系电话：18551602256

客户服务热线：95177

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

(88) 济安财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环中路7号4号楼40层4601室

法定代表人：杨健

联系人：李海燕

联系电话：010-65309516

客户服务热线：400-673-7010

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

(89) 上海云湾基金销售有限公司

注册（办公）地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层

法定代表人：戴新装

联系人：朱学勇

联系电话：021-20530012

客户服务热线：400-820-1515

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

(90) 通华财富（上海）基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区同丰路667弄107号201室

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场杨高南路799号3号楼9楼

法定代表人：兰奇

联系电话：021-60818588

客户服务热线：400-66-95156

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

(91) 上海挖财基金销售有限公司

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

法定代表人：冷飞

联系人：孙琦

联系电话：021-50810687

客户服务热线：021-50810673

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

(92) 上海基煜基金销售有限公司

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

办公地址：上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室

法定代表人：王翔

联系人：李关洲

联系电话：021-65370077

客户服务热线：400-820-5369

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

(93) 北京蛋卷基金销售有限公司

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

法定代表人：钟斐斐

联系人：袁永姣

联系电话：010-61840688

客户服务热线：4000-618-518

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

基金管理人可以根据情况变化增加或者减少销售机构，并另行公告。销售机构可以根据情况变化增加或者减少其销售城市、网点，并另行公告。

## (二) 登记机构

名称：摩根士丹利华鑫基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第二座第17层01-04室

办公地址：深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第二座第17层

法定代表人：YU HUA(于华)

联系人：赵恒

电话：(0755) 88318709

## (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）

住所：中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址：上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼

执行事务合伙人：李丹

电话：021-23238189

联系人：俞伟敏

经办注册会计师：许康玮、俞伟敏

#### 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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，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，通过采用复制指数的方法，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变化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。

## 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) 投资研究

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

##### (2) 投资决策

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

##### (3) 组合构建

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

##### (4) 交易执行

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

##### (5) 风险与绩效评估



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

#### (6) 组合调整

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

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

### 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征。

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2018年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。本投资组合报告所载数据截至2018年9月30日，本报告中所列财务数据未经审计。

#### 1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	35,772,105.66	89.70
	其中：股票	35,772,105.66	89.70
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	52,531.21	0.13
	其中：债券	52,531.21	0.13
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,038,330.94	10.13
8	其他资产	17,943.79	0.04
9	合计	39,880,911.60	100.00

## 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

### 2.1 报告期末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	777,734.60	1.98
B	采掘业	198,104.75	0.50
C	制造业	19,294,457.17	49.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	615,855.00	1.57
E	建筑业	231,940.16	0.59
F	批发和零售业	1,064,902.50	2.71
G	交通运输、仓储和邮政业	184,888.88	0.47
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,158,610.99	5.50

J	金融业	2,736,606.61	6.97
K	房地产业	2,339,728.43	5.96
L	租赁和商务服务业	640,606.35	1.63
M	科学研究和技术服务业	12,960.00	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	200,693.50	0.51
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	570,956.32	1.45
R	文化、体育和娱乐业	829,894.50	2.11
S	综合	44,080.00	0.11
	合计	31,902,019.76	81.25

## 2.2 报告期末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	-	-
B	采掘业	243,675.00	0.62
C	制造业	798,315.80	2.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	477,652.00	1.22
E	建筑业	151,248.70	0.39
F	批发和零售业	230,304.00	0.59
G	交通运输、仓储和邮政业	289,365.00	0.74
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	48,484.80	0.12
J	金融业	1,329,637.60	3.39
K	房地产业	164,567.00	0.42
L	租赁和商务服务业	35,816.00	0.09
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	61,020.00	0.16
S	综合	40,000.00	0.10
	合计	3,870,085.90	9.86

### 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	000651	格力电器	22,580	907,716.00	2.31
2	000333	美的集团	21,400	862,420.00	2.20
3	000001	平安银行	55,153	609,440.65	1.55
4	000858	五粮液	8,640	587,088.00	1.50
5	300498	温氏股份	22,680	526,629.60	1.34
6	000002	万科A	21,002	510,348.60	1.30
7	002415	海康威视	16,650	478,521.00	1.22
8	000725	京东方A	139,100	438,165.00	1.12
9	300124	汇川技术	14,100	390,570.00	0.99
10	300015	爱尔眼科	11,856	382,356.00	0.97

#### 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	601288	农业银行	22,500	87,525.00	0.22
2	600023	浙能电力	16,400	83,312.00	0.21
3	600900	长江电力	4,900	80,262.00	0.20
4	601857	中国石油	8,700	79,779.00	0.20
5	601988	中国银行	20,300	75,516.00	0.19

### 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-

	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	52,531.21	0.13
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	52,531.21	0.13

#### 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	128024	宁行转债	378	42,929.46	0.11
2	128020	水晶转债	39	3,587.61	0.01
3	123003	蓝思转债	37	3,458.02	0.01
4	123004	铁汉转债	28	2,556.12	0.01

#### 6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

根据本基金基金合同规定，本基金不参与贵金属投资。

#### 8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

报告期内，本基金未参与股指期货交易；截至报告期末，本基金未持有股指期货合约。

##### 9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同规定，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 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体除宁波银行股份有限公司（以下简称“宁波银行”）外，其余的没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

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

本基金投资宁行转债(128024)的决策流程符合本基金管理人投资管理制度的相关规定。针对上述情况，本基金管理人进行了分析和研究，认为上述事件对宁行转债的投资价值未造成实质性影响。本基金管理人将继续对上述公司进行跟踪研究。

11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	7,462.26
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	860.14
5	应收申购款	9,621.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,943.79

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128024	宁行转债	42,929.46	0.11
2	128020	水晶转债	3,587.61	0.01
3	123003	蓝思转债	3,458.02	0.01
4	123004	铁汉转债	2,556.12	0.01

#### 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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000333	美的集团	862,420.00	2.20	重大资产重组

##### 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2018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12月31日	30.49%	1.13%	29.05%	1.12%	1.44%	0.01%
2015年1月1日至	36.43%	2.88%	31.33%	2.51%	5.10%	0.37%

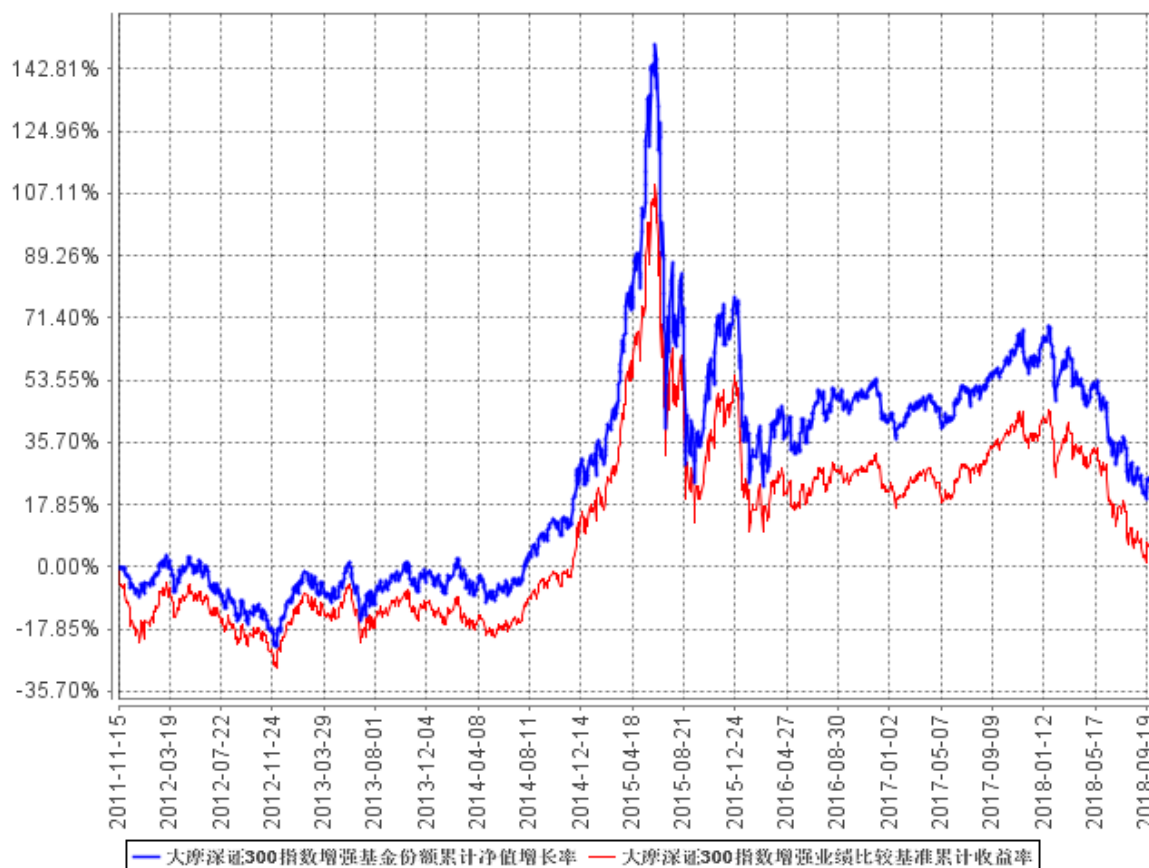
2015 年 12 月 31 日						
2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	-18.28%	1.76%	-18.35%	1.66%	0.07%	0.10%
2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	12.42%	0.74%	13.14%	0.82%	-0.72%	-0.08%
2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	-14.94%	1.19%	-14.18%	1.30%	-0.76%	-0.11%
自基金合同生效起至 2018 年 9 月 30 日	25.50%	1.59%	6.74%	1.53%	18.76%	0.06%

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2018年9月30日)

大摩深证300指数增强基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史  
 走势对比图





### 十三、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) 基金财产划拨支付的银行费用；
- (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：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

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：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

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:

$$H = E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$

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保险与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金等,包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方和行业社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型,基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围,并按规定向中国证监会备案。

通过基金管理人的直销中心申购本基金基金份额的养老金客户申购费率见下表:

申购金额 (M)	申购费率
M<100万元	0.48%

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:

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

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

## 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。其中,对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费,并将上述赎回费全额计入基金财产。具体赎回费率结构如下:

持有天数 (Y)	赎回费率
Y<7	1.50%
7≤Y<365	0.50%
365≤Y<730	0.25%
Y≥730	0%

计算公式:

$$\text{赎回费用} = \text{赎回金额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{赎回金额} = \text{赎回份数} \times \text{赎回价格}$$

$$\text{赎回价格} = \text{申请日基金份额净值}$$

## 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:

$$\text{转出金额} = \text{转出份额} \times \text{转出基金当日基金份额净值}$$

$$\text{转出基金赎回费} = \text{转出金额} \times \text{转出基金赎回费率}$$

$$\text{转入总金额} = \text{转出金额} - \text{转出基金赎回费}$$

$$\text{申购补差费} = \text{转入总金额} \times \text{申购补差费率} / (1 + \text{申购补差费率})$$

$$\text{转换费用} = \text{转出基金赎回费} + \text{申购补差费}$$

(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2018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、有关财务数据和净值表现截止日;
2	三、基金管理人	更新了“主要人员情况”、个别文字表述
3	四、基金托管人	根据托管行提供的信息进行更新

4	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
5	九、基金的投资	更新了最近一期投资组合报告的内容，即截至 2018 年 9 月 30 日的基金投资组合报告
6	十、基金的业绩	更新了基金的投资业绩，即截至 2018 年 9 月 30 日的基金投资业绩
7	二十. 基金托管协议内容摘要	更新了基金托管人信息
8	二十一、对基金份额持有人的服务	根据公告内容进行了更新
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  
二〇一八年十二月二十八日