摩根士丹利华鑫睿成中小盘弹性股票型证券投资基金招募说明书（更新）摘要

（2019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：交通银行股份有限公司

【重要提示】

摩根士丹利华鑫睿成中小盘弹性股票型证券投资基金（以下简称"本基金"）于2016年8月23日经中国证券监督管理委员会证监许可【2016】1916号文准予注册募集。本基金的基金合同于2017年1月16日正式生效。本基金为契约型开放式基金。

投资有风险，投资者认购（或申购）基金时应认真阅读招募说明书。

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）所载内容截止日为2019年7月16日，有关财务数据和净值表现截止日为2019年6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
住所：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：周熙
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：22,750万元人民币
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%）、深圳市招融投资控股有限公司（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%）。

期后事项：

2019年6月6日，中国证券监督管理委员会证监许可[2019]1028号文批复核准基金管理人原股东深圳市招融投资控股有限公司将其持有的公司10.989%的股权转让给摩根士丹利国际控股公司。本次股权变更的相关工商变更登记手续已经于2019年7月18日办理完成。上述工商变更登记手续完成后，基金管理人的注册资本保持不变，股东及股权比例为：摩根士丹利国际控股公司（48.352%），华鑫证券有限责任公司（39.560%），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

周熙先生，上海交通大学理学学士，美国密西根大学安娜堡分校电子工程硕士及工商管理硕士。曾任职于中国联合网络通信集团有限公司上海分公司、爱立信（中国）通信有限公司上海分公司、Ericsson Wireless Communications Inc.、高盛高华证券有限责任公司。2008年加入摩根士丹利亚洲有限公司北京代表处，历任副总裁、投资银行部执行董事、北京代表处首席代表等职务，2011年起至今任职于摩根士丹利（中国）股权投资管理有限公司，历任执行董事，目前担任董事总经理。现任本公司董事长。

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、东海证券有限责任公司常州地区中心营业部总经理兼延陵中路营业部总经理、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。目前担任华鑫证券有限责任公司董事长、法定代表人，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。曾先后担任兰州炼油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副总经理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。目前担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。现任本公司董事。

高杰文（Todd Coltman）先生，加利福尼亚州立大学通讯专业学士和硕士，乔治敦大学法学博士。曾在年利达律师事务所（Linklaters）伦敦、香港和东京办公室以及众达律师事务所（Jones Day）的东京办公室担任律师。2004年加入摩根士丹利，负责亚洲地区不动产投资（REI）的不动产收购融资。2007年至2009年担任日本REI业务运营总监，自2016年起至今担任摩根士丹利亚洲所有投资管理业务运营总监。目前担任摩根士丹利商务咨询（上海）有限公司董事、摩根士丹利资产服务咨询（中国）有限公司董事、Morgan Stanley Investment Management Private Limited（成立于印度）董事、Morgan Stanley Properties Advisory Corp. Limited（成立于开曼群岛）董事、MSP China Holdings Limited（成立于开曼群岛）董事。现任本公司董事。

侯杰明（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。目前担任摩根士丹利国际银行（中国）有限公司董事、摩根士丹利商贸（中国）有限公司董事、摩根士丹利管理服务（上海）有限公司董事，摩根士丹利（中国）股权投资管理有限公司监事、摩根士丹利华鑫证券有限责任公司监事，摩根士丹利亚洲有限公司北京代表处首席代表。现任本公司董事。

王鸿嫔女士，台湾国立清华大学法学学士。曾任钱杂志记者，康和证券投资顾问公司研究员，怡富证券投资顾问公司研究员、协理，怡富证券投资信托有限公司副总经理，怡富证券投资顾问公司总经理，上投摩根基金管理有限公司总经理，上海富汇财富投资管理股份有限公司董事长兼总经理等。现任本公司总经理及董事。

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。

期后事项：

自2019年8月1日起，彭磊女士不再担任本公司董事。上述事项已经本公司2019年第三次临时股东会会议审议通过。

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，目前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、江苏林洋能源股份有限公司和厦门特宝生物工程股份有限公司独立董事。现任本公司独立董事。

彭章健先生，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，退休后曾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）。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。目前担任中安信业董事长，深圳市中安信业创业投资有限公司董事长，Moshi Industrial Development (Shenzhen) Co., Ltd法定代表人，亚大健康集团董事长，深圳市中银富登村镇银行董事，润晖资产管理有限公司董事，兴业银行独立董事，亲亲食品集团董事，深圳市小额贷款行业协会会长，中国小额贷款公司协会副会长，深圳市创业投资同业公会副会长，深圳市商业联合会常务副会长。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监、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副总经理、华鑫证券有限责任公司副总裁。目前担任上海华鑫股份有限公司副总经理兼任华鑫期货有限公司董事长、华鑫思佰益融资租赁（上海）有限公司董事长。现任本公司监事长。

莫壮伟（Tuangwei Mok）先生，加州大学伯克利分校学士、加州大学伯克利分校哈斯商学院硕士。 曾经在瓦乔维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的市场风险团队。2014年加入摩根士丹利风险管理团队，目前担任摩根士丹利投资风险管理的执行董事。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月起担任招商局金融集团有限公司总经理助理。现任本公司监事。

期后事项：

自2019年8月1日起，王章为先生不再担任本公司监事。上述事项已经本公司2019年第三次临时股东会会议审议通过。

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，目前担任本公司助理总经理兼任综合管理部总监、产品规划部总监、上海分公司总经理。现任职工监事。

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，目前担任本公司市场发展部总监。现任职工监事。

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，目前担任本公司专户理财部总监。现任职工监事。

谢先斌先生，浙江大学计算科学与工程学专业学士，上海交通大学安泰经济与管理工商管理专业硕士。曾任中国移动（深圳）有限公司软件工程师，及招商基金管理有限公司信息技术部业务经理，基金事务部业务经理、高级经理，首席注册登记师。2011年5月加入本公司，曾任基金运营部副总监，目前担任基金运营部总监。现任职工监事。

3、高级管理人员

周熙先生，董事长，简历同上。

王鸿嫔女士，总经理，简历同上

李锦女士，哥伦比亚大学、伦敦商学院和香港大学联合授予工商管理学硕士、吉林大学经济管理学院国际金融专业硕士，22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、督察长。现任本公司副总经理。

许菲菲女士，中南财经大学经济学专业学士，17年证券基金行业工作经历。曾任深圳市华新股份有限公司会计，宝盈基金管理有限公司基金会计。2005年6月加入本公司，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、总监。现任本公司督察长。

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，13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月至2018年12月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月起担任摩根士丹利华鑫深证300指数增强型证券投资基金和本基金基金经理。

陈健夫先生，美国南加州大学应用数学博士，9年证券从业经历。曾任美国联合银行量化分析师，美国汇丰证券高级量化分析师，阳光资产管理有限公司高级量化研究员。2018年7月加入本公司，现任数量化投资部基金经理。2018年8月起担任摩根士丹利华鑫量化配置混合型证券投资基金和本基金基金经理。

本基金历任基金经理：吴国雄先生，自本基金合同生效日起至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、基金托管人基本情况

（一）基金托管人概况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）
公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO.,LTD
法定代表人：彭纯
住 所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
办公地址：中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码：200336
注册时间：1987年3月30日
注册资本：742.63亿元
基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25号
联系人：陆志俊
电 话：95559

交通银行始建于1908年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国的发钞行之一。1987年重新组建后的交通银行正式对外营业，成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行，总部设在上海。2005年6月交通银行在香港联合交易所挂牌上市，2007年5月在上海证券交易所挂牌上市。根据2018年英国《银行家》杂志发布的全球千家大银行报告，交通银行一级资本位列第11位，连续五年跻身全球银行20强；根据2018年美国《财富》杂志发布的世界500强公司排行榜，交通银行营业收入位列第168位，较上年提升3位。

截至2019年3月31日，交通银行资产总额为人民币97,857.47亿元。2019年1-3月，交通银行实现净利润(归属于母公司股东)人民币210.71亿元。

交通银行总行设资产托管业务中心（下文简称"托管中心"）。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

（二）主要人员情况

彭纯先生，董事长、执行董事，高级会计师。

彭先生2018年2月起任本行董事长、执行董事。2013年11月至2018年2月任本行副董事长、执行董事，2013年10月至2018年1月任本行行长；2010年4月至2013年9月任中国投资有限责任公司副总经理兼中央汇金投资有限责任公司执行董事、总经理；2005年8月至2010年4月任本行执行董事、副行长；2004年9月至2005年8月任本行副行长；2004年6月至2004年9月任本行董事、行长助理；2001年9月至2004年6月任本行行长助理；1994年至2001年历任本行乌鲁木齐分行副行长、行长，南宁分行行长，广州分行行长。彭先生1986年于中国人民银行研究生部获经济学硕士学位。

任德奇先生，副董事长、执行董事、行长，高级经济师。

任先生2018年8月起任本行副董事长、执行董事、行长；2016年12月至2018年6月任中国银行执行董事、副行长，其中：2015年10月至2018年6月兼任中银香港（控股）有限公司非执行董事，2016年9月至2018年6月兼任中国银行上海人民币交易业务总部总裁；2014年7月至2016年11月任中国银行副行长，2003年8月至2014年5月历任中国建设银行信贷审批部副总经理、风险监控部总经理、授信管理部总经理、湖北省分行行长、风险管理部总经理；1988年7月至2003年8月先后在中国建设银行岳阳长岭支行、岳阳市中心支行、岳阳分行，中国建设银行信贷管理委员会办公室、信贷风险管理部工作。任先生1988年于清华大学获工学硕士学位。

袁庆伟女士，资产托管业务中心总裁，高级经济师。

袁女士2015年8月起任本行资产托管业务中心总裁；2007年12月至2015年8月，历任本行资产托管部总经理助理、副总经理，本行资产托管业务中心副总裁；1999年12月至2007年12月，历任本行乌鲁木齐分行财务会计部副科长、科长、处长助理、副处长，会计结算部高级经理。袁女士1992年毕业于中国石油大学计算机科学系，获得学士学位，2005年于新疆财经学院获硕士学位。

（三）基金托管业务经营情况

截至2019年3月31日，交通银行共托管证券投资基金418只。此外，交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、养老保障管理基金、企业年金基金、QFII证券投资资产、RQFII证券投资资产、QDII证券投资资产、RQDII证券投资资产和QDLP资金等产品。

三、相关服务机构

一、基金份额发售机构

（一）直销机构

1、摩根士丹利华鑫基金管理有限公司直销中心
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
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
注册地址：北京市西城区太平桥大街18号丰融国际大厦1005室
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
注册地址：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
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.msfunds.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、快付通等支付渠道以及基金汇款交易业务。支持银联通渠道、快付通渠道支付的银行卡详见本公司官方网站（http://www.msfunds.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

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

（二）其他销售机构

（1）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
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

（2）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

（3）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

（4）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

（5）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

（6）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

（7）华鑫证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01（b）单元
办公地址：上海市徐汇区宛平南路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

（8）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

（9）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：魏明
联系电话：（010）85130588
客户服务电话： 4008888108
网址：www.csc108.com

（10）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

（11）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

（12）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、朱雅崴
联系电话：（021）38676161
客户服务电话：95521
网址：www.gtja.com

（13）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

（14）光大证券股份有限公司
注册（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：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

（15）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

（16）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

（17）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

（18）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

（19）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

（20）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

（21）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

（22）东海证券股份有限公司
注册地址：江苏省常州延陵西路23号投资广场18层
办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦
法定代表人：赵俊
联系人：王一彦
联系电话：021-20333333
客户服务电话：95531；400-8888-588
网址：www.longone.com.cn

（23）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：95330
网址：www.dwzq.com.cn

（24）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

（25）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

（26）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

（27）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

（28）平安证券股份有限公司
注册（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：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

（29）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

（30）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

（31）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

（32）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

（33）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

（34）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

（35）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：杜晶、贾鹏
联系电话：028-86690057、028-86690058
客户服务热线：95310
网址：www.gjzq.com.cn

（36）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

（37）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

（38）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

（39）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

（40）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

（41）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

（42）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
基金买卖网 www.jjmmw.com

（43）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

（44）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

（45）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

（46）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

（47）上海长量基金销售有限公司
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

（48）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

（49）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

（50）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

（51）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

（52）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

（53）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

（54）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

（55）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

（56）上海联泰基金销售有限公司
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

（57）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

（58）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岗厦社区金田路3088号中洲大厦3203A单元
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

（59）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

（60）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

（61）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

（62）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

（63）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

（64）大泰金石基金销售有限公司
注册地址：南京市建邺区江东中路102号708室
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：姚杨
联系人：孟召社
联系电话：021-20324176
客户服务热线：400-928-2266
网址：www.dtfunds.com
注：仅开放赎回

（65）深圳市金斧子基金销售有限公司
注册（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11层1108
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

（66）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

（67）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

（68）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

（69）北京晟视天下基金销售有限公司
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

（70）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

（71）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

（72）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

（73）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

（74）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

（75）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

（76）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

（77）北京蛋卷基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
办公地址：北京市朝阳区创远路 34 号院融新科技中心 C 座 17 层
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

（78）上海华夏财富投资管理有限公司
注册地址：上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室
法定代表人：毛淮平
联系人：张静怡
联系电话：010-88066184
客户服务热线：400-817-5666
网址： www.amcfortune.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。

（三）登记机构
名称：摩根士丹利华鑫基金管理有限公司
住所：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：周熙
联系人：赵恒
电话：（0755）88318709

（四）出具法律意见书的律师事务所
名称：上海市通力律师事务所
注册地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人：俞卫锋
联系人：安冬
电话：021-31358666
经办律师：安冬、陆奇

（五）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：摩根士丹利华鑫睿成中小盘弹性股票型证券投资基金

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

本基金采取中证500指数成分股量化加权投资策略，在控制风险的基础上，力争获取超额收益与长期资本增值。

七、基金的投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、次级债、短期融资券、超短期融资券、中期票据及其他中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、权证、股指期货、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

基金的投资组合比例：股票资产占基金资产的比例范围为80%-95%，其中投资于中证500指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金非现金资产的80%；权证投资比例不高于基金资产净值的3%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后，本基金持有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。权证、股指期货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。

八、基金的投资策略

（一）投资策略

1、股票投资策略

国内外学术研究及多年的投资实践表明，A股市场存在着显著的异象效应。本基金以中证500指数的成份股为基础，根据"异象效应及其风险溢价"的理论，使用指数成分股量化加权的理念进行主动投资组合的构建，并定期进行组合的再平衡。

指数成分股量化加权

指数成分股量化加权是通过使用股票基本面或交易面因子来决定投资组合中各只成分股的权重，成份股来源于基金对应的基准指数。

因子选取

通过深入研究传统投资理论、总结分析投资团队多年积累的投资经验，基金管理人投资团队提炼出适应中国市场的逻辑，再经过全面而细致的实证检验，挑选出相对稳定的逻辑，并具体体现为有效因子。这些有效因子主要来自三方面信息：一是公司基本面信息；二是分析师预期；三是公司的二级市场价格数据。每一个因子的提炼都经过投资团队的反复验证，具备获取超额收益的能力。

投资组合构建

本基金将在中证500成份股的基础上进行投资组合构建。在中证500的成份股上进行投资组合构建，首先能够保证基金的大小盘风格稳定，并且能在一定程度上降低个股选择风险。

通过我们提炼出来的因子，使用一定的赋权机制对成份股进行赋权，以最大限度的体现出该因子所具备的获取超额收益的能力。

组合再平衡与优化

每隔一段时期，基金管理人将重新计算因子的数值，并以新的因子数值为依据对股票投资组合进行调整，始终保持投资组合能够最大限度的体现出该因子获取超额收益的能力。

2、衍生品投资策略

本基金的衍生品投资将严格遵守相关法律法规的规定，合理利用股指期货、权证等衍生工具，充分考虑衍生品的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，追求稳定的当期收益或降低投资组合的整体风险。

（1）权证投资策略

本基金在进行权证投资时，将通过对权证标的证券基本面的研究，结合权证定价模型寻求其合理估值水平，利用正股和权证之间的不同组合来套取无风险收益。

（2）股指期货投资策略

本基金将以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

3、资产支持证券投资策略

本基金通过对资产支持证券的发行条款、基础资产的构成及质量等基本面研究，结合相关定价模型评估其内在价值，谨慎参与资产支持证券投资。

4、债券投资策略

本投资组合对于债券的投资主要为久期管理策略、收益率曲线策略、个券选择策略、跨市场套利策略等，并择机把握市场有效性不足情况下的交易机会。

（二）投资决策程序

1、投资决策依据

（1）决策依据的主要内容
1）国家有关法律、法规和基金合同的有关规定；
2）国内外宏观经济发展状况、上市公司的经济运行状况；
3）国家财政政策、货币政策、产业政策；
4）证券市场政策环境、市场资金供求状况、投资者状况；
5）投资品种的预期收益率和风险水平；
6）影响证券市场未来走势的其他因素。

（2）决策依据的主要来源

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

2、投资决策机制

（1）决策架构

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

（2）决策支持

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

3、投资管理流程

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

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

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

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

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

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

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

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：

中证500指数收益率*95% + 一年期活期存款利率*5%

中证500指数是由中证指数有限公司编制，该指数样本选自沪深两个证券市场，其成份股包含了500只沪深300指数成份股之外的A股市场中流动性好、代表性强的中小盘股票，综合反映了沪深证券市场内中小市值公司的整体情况，此外本基金有不低于5%的基金资产用作日常流动性管理。因此选用上述业绩比较基准能够真实、客观地反映本基金的风险收益特征。

如果今后法律法规发生变化，又或者市场推出更具权威、且更能够表征本基金风险收益特征的业绩比较基准，本基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略，经与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后调整本基金的业绩比较基准，而无需召开基金份额持有人大会审议，并应及时公告并报中国证监会备案，同时在更新的招募说明书中列示。

十、基金的风险收益特征

本基金为股票型基金，理论上其长期平均预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金。

十一、基金投资组合报告

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年7月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。本投资组合报告所载数据截至2019年6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	56,242,009.70	92.86
	其中：股票	56,242,009.70	92.86
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	–	–
	其中：债券	–	–
	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	4,311,795.08	7.12
8	其他资产	13,982.64	0.02
9	合计	60,567,787.42	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	707,483.00	1.18
B	采矿业	2,751,030.00	4.57
C	制造业	29,394,218.40	48.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,805,403.00	4.66
E	建筑业	1,073,939.00	1.78
F	批发和零售业	3,613,891.00	6.01
G	交通运输、仓储和邮政业	2,083,705.00	3.46
H	住宿和餐饮业	270,904.00	0.45
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,377,545.30	8.94
J	金融业	2,277,508.00	3.79
K	房地产业	2,919,071.00	4.85
L	租赁和商务服务业	1,032,003.00	1.72
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	260,870.00	0.43
Q	卫生和社会工作	372,078.00	0.62
R	文化、体育和娱乐业	852,267.00	1.42
S	综合	450,094.00	0.75
	合计	56,242,009.70	93.48

3、报告期末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	600183	生益科技	51,500	775,075.00	1.29
2	000513	丽珠集团	22,100	734,383.00	1.22
3	002223	鱼跃医疗	29,300	721,366.00	1.20
4	000027	深圳能源	115,300	714,860.00	1.19
5	300207	欣旺达	61,500	708,480.00	1.18
6	600642	申能股份	117,300	704,973.00	1.17
7	600169	太原重工	246,700	658,689.00	1.09
8	002152	广电运通	93,600	641,160.00	1.07
9	002195	二三四五	161,530	628,351.70	1.04
10	000997	新 大 陆	37,100	626,619.00	1.04

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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名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的规定，本基金将以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

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未超出基金合同规定的备选股票库。

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其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	9,651.27
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	950.59
5	应收申购款	3,380.78
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	13,982.64

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债。

11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

十二、基金的业绩

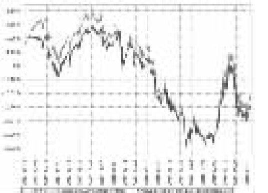
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1、自基金合同生效以来至2019年6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
自基金合同生效日起至2017年12月31日	–1.27%	0.81%	0.93%	0.88%	–2.20%	–0.07%
2018年1月1日至2018年12月31日	–30.72%	1.33%	–31.85%	1.43%	1.13%	–0.10%
2019年1月1日至2019年6月30日	15.13%	1.65%	17.87%	1.70%	–2.74%	–0.05%
自基金合同生效日起至2019年6月30日	–21.25%	1.24%	–18.92%	1.31%	–2.33%	–0.07%

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

摩根士丹利华鑫睿成中小盘弹性股票型证券投资基金
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：
（2017年1月16日至2019年6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》生效后与基金相关的信息披露费用；
（4）《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
（5）基金份额持有人大会费用；
（6）基金的证券/期货交易费用；
（7）基金的银行汇划费用；
（8）基金的开户费用、账户维护费用；
（9）按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

2、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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×1.50%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前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、公休假等，支付日期顺延。

（2）基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.25%÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述"1、基金费用的种类中第3－9项费用"，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（二）与基金销售有关的费用

1、申购费用

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、销售等各项费用。

本基金对通过直销中心申购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。

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，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。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资者。

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	0.60%
100万元≤M＜500万元	0.40%
M≥500万元	每笔1000元

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	1.50%
100万≤M＜500万	1.00%
M≥500万	每笔1000元

2、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。

具体赎回费率结构如下：

持有时间（Y）	赎回费率	记入基金资产
Y＜7日	1.5%	100%
7日≤Y＜30日	0.75%	100%
30日≤Y＜90日	0.5%	75%
90日≤Y＜180日	0.5%	50%
180日≤Y＜365日	0.1%	25%
365日≤Y＜730日	0.05%	25%
Y≥730日	0%	0

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，申购补差费率 ＝ 转入总金额对应的转入基金申购费率 － 转入总金额对应的转出基金申购费率，若转入总金额对应的转出基金申购费率≥转入总金额对应的转入基金申购费率，则申购补差费为0。

（2）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。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、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；
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
3、《基金合同》生效前的相关费用；
4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

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2019年2月28日刊登的《摩根士丹利华鑫睿成中小盘弹性股票型证券投资基金招募说明书（更新）（2019年第1号）》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重要提示内容，以及所载内容截止日期、有关财务数据和净值表现截止日
2	第三部分 基金管理人	更新了"主要人员情况"的信息
3	第五部分 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
4	第九部分 基金的投资	更新了最近一期投资组合报告的内容，即截至2019年6月30日的基金投资组合报告；根据基金合同修订内容进行了更新
5	第十部分 基金的业绩	更新了基金的投资业绩，即截至2019年6月30日的基金投资业绩
6	第二十部分 基金托管协议内容摘要	根据托管人提供的信息更新了"基金托管人"部分
7	第二十一部分 对基金份额持有人的服务	更新了对基金份额持有人服务的部分内容
8	第二十二部分 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
二〇一九年八月二十八日