摩根士丹利华鑫多因子精选策略股票型证券投资基金招募说明书（更新）摘要

（2011年第1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】

摩根士丹利华鑫多因子精选策略股票型证券投资基金（以下简称"本基金"）于2011年3月10日经中国证券监督管理委员会证监许可【2011】356号文核准募集。本基金的基金合同于2011年5月17日正式生效。本基金为契约型开放式基金。

投资有风险，投资者投资于本基金前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2011年11月17日，有关财务数据和净值表现截止日为2011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：王文学
成立日期：2003年3月14日
批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字【2003】33号
注册资本：人民币壹亿元
联系人：赵婧
联系电话：（0755）88318883

股权结构：华鑫证券有限责任公司（36%）、摩根士丹利国际控股公司（34%）、汉唐证券有限责任公司（15%）、深圳市招融投资控股有限公司（10%）、深圳市中技实业（集团）有限公司（5%）。

（二）主要人员情况

王文学先生，英国格林威治大学项目管理硕士。2000年12月至今任华鑫证券有限责任公司董事长。1993年7月至2000年12月任西安证券有限责任公司副总经理、总经理、董事长。曾于人民银行西安分行担任体改、外汇管理、稽核副处长。现任本公司董事长。

Carlos Alfonso Oyarbide Seco先生，西班牙巴塞罗那大学经济学学士，美国宾夕法尼亚大学沃顿商学院商业管理硕士。2007年6月至今任摩根士丹利亚洲有限公司董事总经理及中国首席营运官，曾任摩根士丹利并购部门董事总经理、摩根士丹利西班牙财富管理子公司首席执行官、瑞士信贷（香港）有限公司董事总经理及金融机构部主管。现任本公司副董事长。

Navtej Singh Nandra先生，印度Indian Institute of Management，Ahmedabad工商管理硕士。2010年6月至今任摩根士丹利董事总经理、摩根士丹利投资管理国际业务主管、摩根士丹利房地产和商业银行策略主管，曾担任Edelweiss资本董事，Edelweiss Tokio人寿保险有限公司董事，DTZ控股公司资深顾问，美林证券多样化金融服务业务主管，美林证券全球投资银行首席运营官，Nuveen资产管理公司和MLITS印度董事，美林证券全球资产管理部首席运营官和Booz Allen & Hamilton的全球金融服务业务合伙人。现任本公司董事。

于华先生、北京大学经济学学士，比利时鲁汶大学工商管理硕士、金融博士，美国注册金融分析师（CFA）。曾任深圳证券交易所综合研究所所长，加拿大鲍尔集团亚太分公司基金与保险业务副总裁，加拿大伦敦人寿保险公司北京代表处首席代表，大成基金管理有限公司董事、总经理，摩根士丹利亚洲有限公司董事总经理、中国投资管理业务主管。现任本公司董事、总经理；兼任中国证券业协会基金业委员会副主任委员，并代表中国证券业协会任国际资产管理协会董事。

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

宋斌先生，中央党校经济管理研究生。2001年至今任华鑫证券有限责任公司副总经理兼投资银行总部总经理等职。曾任首钢总公司、首钢机电公司、首钢设计院等部门负责人，国家经济贸易委员会办公厅信息调研处处长、委主任办公室副主任。现任本公司董事。

洪小源先生，北京大学经济学硕士，澳大利亚国立大学科学硕士。2007年5月至今任招商局金融集团有限公司董事总经理，兼任招商银行股份有限公司、招商证券股份有限公司、招商局中国基金有限公司、中诚信托有限责任公司、长城证券有限公司董事，并任招商局中国投资管理有限公司、海达远东保险顾问有限公司、招商局保险有限公司、深圳市招融投资控股有限公司、深圳新江南投资有限公司和招商局（英国）控股有限公司董事长。曾就职于国家经济体制改革委员会综合规划司、深圳龙蕾实业股份有限公司。现任本公司董事。

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

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

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

陈宏民先生，加拿大英属哥伦比亚大学博士后。现任上海交通大学安泰经济与管理学院副院长、博士生导师。曾任教于上海新联纺织品进出口公司职工大学。现任本公司独立董事。

何斐先生，英国南方卫理会大学法学博士。现任北京市海问律师事务所合伙人。曾任教于北京大学法律系。现任本公司独立董事。

2、监事会成员

陈海东先生，南开大学经济学学士，上海财经大学经济学硕士。2009年6月至今任华鑫证券有限责任公司合规总监，曾任天津市住房公积金管理中心主管会计，厦门国际信托投资公司天津证券营业部部门副经理，天同证券有限责任公司资产管理部投资经理，兴安证券有限责任公司资产管理部副总经理，华鑫证券有限责任公司财务部副总经理，客户资产存管中心总经理。现任本公司监事长。

顾慧文女士，加拿大约克大学文学士。2007年4月至今任摩根士丹利投资管理执行董事及营运风险经理。曾任摩根士丹利亚洲有限公司私人财富管理销售助理、私人财富管理分行经理。现任本公司监事。

吕联贺先生，香港中文大学工商管理硕士。2005年至今任招商局中国投资管理有限公司投资经理、高级投资经理。曾就职于中国网络资本有限公司、肖特吉有限公司、可口可乐中国有限公司、墨克沙东药厂、Chemtron Technology Limited。现任本公司监事。

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

张力女士，中国人民大学劳动经济专业硕士。2008年10月加入摩根士丹利华鑫基金管理有限公司，现任综合管理和人力资源部总监。曾就职于深圳达能益力饮品有限公司、深圳益力康源饮品有限公司和联合饼干（中国）有限公司。现任本公司职工监事。

梅萍女士，武汉理工大学第三产业经济专业经济学硕士。2006年6月加入摩根士丹利华鑫基金管理有限公司，现任市场发展部副总监兼客户服务中心主任。曾就职于长江证券有限责任公司和武汉新兰德证券投资顾问有限公司。现任本公司职工监事。

3、公司高级管理人员

于华先生、总经理，简历同上。

徐卫先生，北京大学经济管理系硕士，具有法律职业资格证书。18年证券基金行业监管工作经历。先后在中国证监会深圳监管局政策法规处、市场处、机构监管处、基金监管处、机构监管二处等部门工作，历任副主任科员、主任科员、副处长、处长等职务。现任本公司副总经理。

秦红女士，北京大学国民经济管理学学士，具有13年基金从业经历。曾任职博时基金管理有限公司行政管理部经理、市场发展部经理、北京分公司总经理，易方达基金管理有限公司北京分公司总经理，工银瑞信基金管理有限公司渠道销售部总监。现任本公司副总经理；兼任中央财大理财规划师培训班基金讲师。

李锦女士，吉林大学经济管理学院国际金融专业硕士研究生。14年证券基金从业经验。曾就职于巨田证券有限责任公司，历任交易管理总部综合管理部经理助理，总经理办公室主任助理，资产管理部理财部副经理、经理，研究所研究员；2003年起就职于本公司，曾任基金运营部副总监、总监，总经理助理兼基金运营部总监。现任本公司督察长。

4、本基金基金经理

张靖先生，武汉大学经济学硕士，6年证券从业经验。曾于2005年11月至2009年12月间任职于平安证券有限责任公司，历任权证研究员、数量研究员和风险经理、股票研究员、金融工程研究员、高级业务总监。2009年12月加入本公司，2011年5月起任本基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

本基金投资采取集体决策制度，投资决策委员会成员包括：

主任委员：于华先生，本公司董事、总经理。

委员：何诗女士，总经理助理兼投资总监；钱辉先生，本公司高级顾问；袁航女士，本公司首席分析师；徐强先生，研究管理部总监；汝平先生，固定收益投资部总监。

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

1、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：张建国（代行）
成立时间：2004年09月17日
组织形式：股份有限公司
注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元
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：尹　东
联系电话：（010）6759 5003

中国建设银行股份有限公司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）。

截至2011年3月31日，中国建设银行资产总额113,125.16亿元，较上年末增加5,021.99亿元，增长4.65%。2011年一季度，中国建设银行实现净利润472.33亿元，较上年同期增长34.23%；年化平均资产回报率1.71%，年化加权平均净资产收益率26.19%；利息净收入716.30亿元，较上年同期增长25.27%；净利差为2.58%，净利息收益率为2.69%，分别较上年同期提高0.28和0.30个百分点；手续费及佣金净收入231.54亿元，较上年同期增长37.29%。其中，结算、理财、电子银行、贷记卡及保理等重点产品快速增长，收入结构日趋合理。

中国建设银行在中国内地设有1.3万余个分支机构，并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约、胡志明市及悉尼设有分行，在莫斯科设有代表处，设立了湖北枣江建信村镇银行、浙江苍南建信村镇银行、安徽繁昌建信村镇银行、浙江青田建信华侨村镇银行、浙江武义建信村镇银行、陕西安塞建信村镇银行、河北丰宁建信村镇银行、上海浦东建信村镇银行、苏州常熟建信村镇银行9家村镇银行，拥有建行亚洲，建银国际，建行伦敦、建信基金、建信金融租赁、建信信托、中德住房储蓄银行等多家子公司。全行已安装运行自动柜员机（ATM）39,874台，拥有员工313,867人，为客户提供全面的金融服务。

中国建设银行得到市场和业界的支持和广泛认可，2010年共获得100多个国内外奖项。本集团在英国《银行家》杂志公布的"全球商业银行品牌十强"列第二位，在"全球银行品牌500强"列第13位，并被评为2010年中国最佳银行；在美国《福布斯》杂志公布的"Interbrand2010年度最佳中国品牌价值排行榜"列第三位，银行业第一位；被《亚洲金融》杂志评为2010年度"中国最佳银行"；连续三年被香港《资本》杂志评为"中国杰出零售银行"；被中国红十字会总会授予"中国红十字杰出奉献奖章"。

中国建设银行总行设投资托管服务部，下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队，涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海备份中心等12个职能处室、团队，现有员工130余人。自2008年以来中国建设银行托管业务持续通过SAS70审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

2、主要人员情况

杨新丰，投资托管服务部副总经理（主持工作），曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部，长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管服务部副总经理，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。

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2011年6月30日，中国建设银行已托管195只证券投资基金。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。2010年初，中国建设银行被总部设于英国伦敦的《全球托管人》杂志评为2009年度"国内最佳托管银行"（Domestic Top Rated），并连续第三年被香港《财资》杂志评为"中国最佳次托管银行"。

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：王一平
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：罗晔
电话：（010）66155568
传真：（010）66158135

③摩根士丹利华鑫基金管理有限公司上海分公司
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1000号恒生银行大厦45楼01-111单元
联系人：荣倩
电话：（021）63343311
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：建设银行储蓄卡、招商银行"一卡通"借记卡、光大银行卡、中信银行卡、兴业银行银联卡和浦发银行卡。
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）人民币以上的，可拨打直销中心的上述电话进行预约，本公司将提供上门服务。

2、代销机构

①中国建设银行股份有限公司
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：张建国（代行）
网址：www.ccb.com

②中国工商银行股份有限公司
注册地址：中国北京复兴门内大街55号
办公地址：中国北京复兴门内大街55号
法定代表人：姜建清
客户服务电话：95588
网址：http://www.icbc.com.cn

③中国银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人：肖钢
客户服务电话：95566
网址：http://www.boc.cn

④中国农业银行股份有限公司
注册地址：北京市东城区建国门内大街69号
办公地址：北京市东城区建国门内大街69号
法定代表人：项俊波
客户服务电话：95599
网址：www.abchina.com

⑤交通银行股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区银城中路188号
办公地址：上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人：胡怀邦
客户服务电话：95559
网址：http://www.bankcomm.com

⑥招商银行股份有限公司
注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人：傅育宁
客户服务电话：95555
网址：http://www.cmbchina.com

⑦中国光大银行股份有限公司
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：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：田国立
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：蔡宇洲
联系电话：0755-25859591
客户服务电话：400-6699-999
网址：http://www.pingan.com/bank

⑩烟台银行股份有限公司
注册地址：山东省烟台市芝罘区海港路25号
办公地址：山东省烟台市芝罘区海港路25号
法定代表人：庄永辉
客户服务电话：4008-311-777
网址：http://www.ytcb.com

⑪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

⑫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：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01、b）单元
法定代表人：王文学
联系人：杨小江
联系电话：0755-82083788
客户服务电话：021-32109999，029-68918888
网址：http://www.cfsc.com.cn

⑬中信证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层
办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人：王东明
联系人：陈忠
联系电话：010-60833722
客户服务电话：95558
网址：http://www.cs.ecitic.com

⑭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

⑮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：顾伟国
联系人：田薇
联系电话：010-66568536
网址：http://www.chinastock.com.cn

⑯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：高冠江
联系人：唐静
联系电话：010-63081000
客户服务电话：400-800-8899
网址：http://www.cindase.com

⑰）民生证券有限责任公司
注册地址：北京市朝阳门外大街16号中国人寿大厦1901室
办公地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-18层
法定代表人：岳献春
联系人：赵明
联系电话：010-85127622
网址：http://www.mszq.com

⑱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
网址：www.hysec.com

⑲海通证券股份有限公司
注册地址：上海市淮海中路98号
办公地址：上海市广东路689号海通证券大厦10楼
法定代表人：王开国
联系人：李笑鸣
联系电话：021-23219000
客户服务电话：400-8888-001、95553
网址：http://www.htsec.com

⑳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

㉑申银万国证券股份有限公司
注册地址：上海市常熟路171号
办公地址：上海市常熟路171号
法定代表人：丁国荣
联系电话：021-54033888
客户服务电话：95523或4008895523
网址：http://www.sywg.com

㉒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：徐浩明
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

㉓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

㉔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：胡运钊
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

㉕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.boci.com.cn

㉖湘财证券有限责任公司
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

㉗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
法定代表人：吴万善
联系人：程高峰
联系电话：025-83290834
客户服务电话：95597
网址：http://www.htsc.com.cn

㉘齐鲁证券有限公司
注册地址：山东省济南市经十路128号
办公地址：济南市经七路86号23层
法定代表人：李玮
联系人：王霆
联系电话：0531-68889157
客户服务电话：95538
网址：www.qlzq.com.cn

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

㉚）中信金通证券有限责任公司
注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
法定代表人：沈强
联系人：丁思聪
联系电话：0571-87112510
客户服务电话：0571-96598
网址：www.bigsun.com.cn

㉛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

㉜东吴证券股份有限公司
注册地址：苏州工业园区翠园路181号商旅大厦18-21层
办公地址：苏州工业园区翠园路181号商旅大厦
法定代表人：吴永敏
联系人：方晓丹
联系电话：0512-65581136
客户服务电话：0512-33396288
网址：http://www.dwzq.com.cn

㉝）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

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

㉟）中国建银投资证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层至20层
办公地址：深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第18层至20层
法定代表人：杨明辉
联系人：刘毅
联系电话：0755-82023442
客户服务电话：400-600-8008
网址：http://www.cjis.cn

㊱）招商证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层
办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座30楼
法定代表人：宫少林
联系人：林生迎
联系电话：0755-82960223
客户服务电话：400-8888-111、0755-26951111
网址：http://www.newone.com.cn

㊲）国信证券股份有限公司
注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1010号国际信托大厦9楼
法定代表人：何如
联系人：齐晓燕
联系电话：0755-82130833
客户服务电话：95536
网址：http://www.guosen.com.cn

㊳）华泰联合证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层（01A、02、03、04）、17A、18A、24A、25A、26A
办公地址：深圳市福田中心区中心广场香港中旅大厦第5层、17层、18层、24层、25层、26层
法定代表人：马昭明
联系人：盛宗凌、庞晓芸
联系电话：（0755）82492000
客户服务电话：95513
网址：www.lhzq.com

㊴）平安证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
法定代表人：杨宇翔
联系人：郑舒丽
联系电话：0755-22626391
客户服务电话：400-8816-168
网址：http://www.pingan.com

㊵）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

㊶）广发证券股份有限公司
注册地址：广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼（4301-4316房）
办公地址：广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、41和42楼
法定代表人：林治海
联系人：黄岚
联系电话：（020）87555888
客户服务电话：95575
网址：http://www.gf.com.cn

㊷）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

㊸）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：www.dgzq.com.cn

㊹）天相投资顾问有限公司
注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
办公地址：北京市西城区金融街5号新盛大厦B座4层
法定代表人：林义相
联系人：林爽
联系电话：（010）66045608
客户服务电话：010-66045678
网址：www.txsec.com

（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：王文学
联系人：邢思宁
电话：（0755）88318720

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：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：韩炯
联系人：黎明
电话：021-31358666
经办律师：吕红、黎明

（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有限公司
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦1604-1608室
办公地址：上海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：张鸿
联系电话：（021）23233283
经办注册会计师：薛竞、张鸿

四、基金的名称

本基金名称：摩根士丹利华鑫多因子精选策略股票型证券投资基金

五、基金的运作方式与类型

（一）本基金运作方式：契约型开放式

（二）本基金类型：股票型证券投资基金

六、基金的投资目标

本基金通过多因子量化模型方法，精选股票进行投资，在充分控制风险的前提下，力争获取超越比较基准的投资回报。

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）。

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。

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60%-95%；除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为5%-40%，其中权证资产占基金资产净值的比例范围为0-3%，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%。

八、基金的投资策略

（一）投资策略

本基金采用数量化模型驱动的选股策略为主导投资策略，结合适当的资产配置策略。本基金所指数量化模型是建立在已为国际市场上广泛应用的多因子阿尔法模型（Multiple Factors Alpha Model）的基础上，根据中国资本市场的实际情况，由本基金管理人的金融工程团队开发的更具针对性和实用性的修正的多因子阿尔法选股模型（以下简称"大摩多因子阿尔法模型"）。本基金在股票投资过程中将保持模型选股并构建股票投资组合的投资策略，强调投资纪律，降低随意性投资带来的风险，力争基金资产长期稳定增值。为降低资本市场系统性风险对基金的影响，基金管理人在综合分析国内外宏观经济形势以及资本市场环境等因素的基础上，在对证券市场中长期走势判断的基础上，采取适度的资产配置策略。

1.股票投资策略

本基金以"量化投资"为主要投资策略，通过基金管理人开发的"大摩多因子阿尔法模型"进行股票选择并据此构建股票投资组合。"大摩多因子阿尔法模型"在实际运行过程中将定期或不定期地进行修正，优化股票投资组合。

①大摩多因子阿尔法模型

大摩多因子阿尔法模型是建立在已为国际市场上广泛应用的多因子阿尔法模型（Multiple Factors Alpha Model）的基础上，根据中国资本市场的实际情况，由本基金管理人的金融工程团队开发的更具针对性和实用性的数量化选股模型。该模型包括以下几个步骤：

1）筛选有效因子

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，本公司金融工程团队提炼出适应中国市场的选股逻辑，再经过全面而细致的实证检验，挑选出相对稳定的逻辑，并具体体现为通过量化因子选股。这些量化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金融工程团队的反复验证，具备一定的选股能力。

2）因子的权重

每一个因子都代表了一种选股逻辑。在不同的市场环境下，选股逻辑会有不同的侧重点。例如，当市场关注价值投资时，反映公司价值的因子重要性要大一些；当市场更关注企业成长时，反映公司成长速度的因子重要性要大一些。我们会给不同因子配以不同的权重，以反映当时市场的侧重点。

3）因子的更替及权重的调整

金融工程团队将定期回顾所有因子的表现情况，适时剔除失效因子，酌情纳入重新发挥作用的有效因子或者由市场上新出现的投资逻辑归纳而来的有效因子。此外，我们还将采用OLS、信息比率等方法，评价因子的重要程度，定期调整因子权重。

②股票投资组合的构建

本基金将在本公司股票备选库的基础上选股。只有符合公司的基本投资要求、得到公司研究团队认可的个股才能进入公司股票备选库。在备选股票库中选股，能在一定程度上降低个股选择风险。

本基金利用"大摩多因子阿尔法模型"计算每只股票的因子加权得分，并挑选总得分最高的若干只个股构建投资组合。每隔一段时期，我们将重新计算个股加权因子得分，并以新得分值为依据对股票投资组合进行调整，始终保证组合中个股具有相对较高的分值。

2.资产配置策略

本基金实行在公司投资决策委员会统一指导下的资产配置机制。投资决策委员会定期或针对特定事件临时召开，讨论、确定具体的基金资产未来一段时期内在权益类资产及固定收益类资产之间的配置比例范围，形成资产配置相关决议。基金经理根据投资决策委员会关于资产配置的决议具体执行并实施资产配置方案。

数量化投资策略是本基金的主要投资策略，为了有效实施数量化投资策略，本基金将在投资决策委员会关于资产配置决议的允许范围内，采取相对稳定的股票持仓比例控制措施，降低由于股票持仓比例波动过于频繁影响到数量化投资策略的效果。

资产配置采取"自上而下"的多因素分析决策支持，结合定性分析和定量分析，对股票资产和固定收益类资产的风险收益特征进行分析预测，确定中长期的资产配置方案。

在实施资产配置时，主要考察三方面的因素：宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素。

宏观经济因素是资产配置的重点考量对象。本基金重点考察全球经济发展状况、国际间贸易和资本流动、国际间贸易壁垒和文化差异等定性因素和中国劳动力分布、GDP、CPI、PPI、投资、消费、进出口、货币流动性状况、利率、汇率等定量因素，评估宏观经济变量变化趋势及对固定收益投资品和权益类投资品的影响，并做出适当的资产配置策略。

政策及法规因素方面主要关注政府货币政策、财政政策和产业政策的变动趋势，评估其对各行业领域及资本市场的影响；关注资本市场制度和政策的变动趋势，评估其对资本市场体系建设的影响。

资本市场因素方面主要关注市场估值的比较、市场预期变化趋势、资金供求变化趋势等。在此基础上，对市场估值进行整体评估，依据评估结果决定资产配置方案。

当资本市场、国家财经政策等发生重大变化，或发生其他重大事件（包括但不限于重大自然灾害、战争等不可预测事件等），可能导致各类别资产的风险收益特征发生显著变化时，投资决策委员会将临时组织集体讨论并确定特定时期的资产配置方案。

3.其他金融工具投资策略

①固定收益投资策略

本基金避循中长期资产配置策略，进行国债、金融债、公司债等固定收益类证券以及可转换债券的投资。由公司固定收益投资团队独立提出具体的投资策略及投资建议，通过评估货币政策、财政政策和国际环境等因素，分析市场价格中隐含的对经济增长、通货膨胀、违约概率、提前偿付速度等因素的预测，根据固定收益市场中存在的各种投资机会的相对投资价值和相关风险决定总体的投资策略及类属（政府、企业公司、可转换债券、资产支持证券等）和期限（短期、中期和长期）等部分的投资比例，并基于价值分析精选投资品种构建固定收益投资组合。

本基金采用的主要固定收益投资策略包括：利率预期策略、收益率曲线策略、信用利差策略、公司企业债券策略、可转换债券策略等。

②短期货币投资策略

本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。

本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素，结合定性和定量方法，确定投资时机。基金管理人另根据CAPM模型计算得到的组合Beta值，结合股票投资的总体规模，以及中国证监会的相关限定和要求，确定参与股指期货交易的投资比例。

基金管理人将建立股指期货投资决策部门或小组，负责股指期货的投资管理的相关事项，同时针对股指期货投资管理制定投资决策流程和风险控制等制度，并经基金管理人董事会批准后执行。

若相