

摩根士丹利华鑫货币市场基金 招募说明书（更新）摘要 （2012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

摩根士丹利华鑫货币市场基金（以下简称“本基金”）经2006年6月15日中国证券监督管理委员会证监基金字【2006】120号文《关于同意巨田货币市场基金募集的批复》核准募集。本基金的基金合同于2006年8月17日正式生效。本基金为契约型开放式。

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。

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资产，投资者购买货币市场基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构，基金管理公司不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

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2012年8月17日，有关财务数据和净值表现截止日为2012年6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	6
四、基金的名称	22
五、基金的类型	22
六、基金的投资目标	22
七、基金的投资方向	23
八、基金的投资策略	23
九、基金的业绩比较基准	24
十、基金的风险收益特征	24
十一、基金的投资组合报告	24
十二、基金的业绩	28
十三、基金的费用与税收	29
十四、对招募说明书更新部分的说明	32

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十七层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十七层

法定代表人：王文学

成立时间：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

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务

注册资本：人民币22,750万元

组织形式：有限责任公司

存续期间：50年

全国统一客服电话：400-8888-668

电话：(0755) 88318883

传真：(0755) 82990384

联系人：赵婧

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%；汉唐证券有限责任公司¹，6.593%；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

王文学先生，英国格林威治大学项目管理硕士。2011年6月至今任摩根士丹利华鑫证券有限责任公司董事长，2011年11月至今兼任华鑫证券有限责任公司副董事长。1993年7月至2011年11月先后担任西安证券有限责任公司副总经理、总经理、董事长；人民银行西安分行体改、外汇管理、稽核副处长；华鑫证券有限责任公司董事长。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

¹ 深圳市中级人民法院2007年12月29日发布公告，汉唐证券有限责任公司于2007年12月26日进入破产清算程序。

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，德里大学商学学士，印度管理学院工商管理硕士。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，曾为博思艾伦咨询公司全球金融服务业务合伙人，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、美林证券多样化金融服务业务主管、美林证券全球资产管理部首席运营官、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。现任本公司董事。

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。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 月至今任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总监、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 月至今任招商局集团有限公司总裁助理。2007 年 5 月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）、中诚信托有限责任公司、摩根士丹利华鑫基金管理有限公司、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、招商局保险有限公司和招商局（英国）控股有限公司董事长。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。

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）、法学院法学博士。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。

何斐先生，北京大学法学学士，美国南方卫理会大学法学硕士、法律博士。1992 年 5 月至今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，南开大学经济学士，上海财经大学经济学硕士。2011 年 12 月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，澳大利亚特许注册会计师，目前担任摩根士丹利执行董事，曾任德意志银行（中国）有限公司上海分行董事、德意志银行亚太总部助理副总裁、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，1999 年至今担任招商局金融集团有限公司总经理助理、财务部经理、人力资源部经理，兼任招商局中国投资管理有限公司董事、招商证券股份有限公司监事，曾任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，英国兰卡斯特大学电子工程学士，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 月加入本公司，现任总经理助理兼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月加入本公司，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、公司高管人员

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，19年证券基金行业工作经历。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。2009年7月加入本公司，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14年基金行业工作经历。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。2009年4月加入本公司，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。

沈良先生，加拿大西安大略大学工商管理硕士，美国特许金融分析师（CFA），英国特许公认会计师（ACCA），具有10年金融行业工作经历。曾任香港普华永道会计师事务所审计员，加拿大宏利金融有限公司企业精算和融资经理，宏利人寿保险（国际）有限公司亚太区地区发展高级经理、投资分析师，中宏人寿保险有限公司投资总监，香港摩根士丹利亚洲有限公司亚太区首席行政官。2011年9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，具有15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，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、本基金基金经理简介

李轶女士，中央财经大学投资经济系国民经济学硕士学位，7年证券从业经验。2005年7月加入本公司，从事固定收益研究，历任债券研究员、本基金基金经理助理。2008年11月起任本公司本基金基金经理。

本基金历任基金经理：冀洪涛先生，自本基金合同生效日起至2007年1月管理本基金；孙健先生，于2007年1月至2008年11月管理本基金。

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：何滨女士，基金经理；盛军锋先生，基金经理；刘钊先生，数量化投资部副总监、基金经理；王笑先生，交易管理部副总监。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人基本情况

1、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：胡怀邦

住所：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

邮政编码：200120

注册时间：1987 年 3 月 30 日

注册资本：618.85 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：张咏东

电话：021-32169999

交通银行始建于 1908 年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国发钞行之一。交通银行先后于 2005 年 6 月和 2007 年 5 月在香港联交所、上交所挂牌上市，是中国 2010 年上海世博会唯一的商业银行全球合作伙伴。《财资》杂志（The Asset）“2010 年全球最佳交易银行评选”中，交通银行荣膺“最佳次托管银行”大奖。英国《银行家》杂志 2011 年公布的全球 1000 家银行排名，交通银行以 343.21 亿美元的一级资本连续第三年跻身全球商业银行 50 强。截至 2012 年 3 月 31 日，交通银行资产总额达到人民币 4.88 万亿元，实现净利润人民币 158.80 亿元。

交通银行总行设资产托管部。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。

2、主要人员情况

牛锡明先生，交通银行行长，哈尔滨工业大学经济学硕士，高级经济师。2009 年 12 月起担任交通银行副董事长、行长。

钱文挥先生，交通银行副行长，上海财经大学工商管理硕士。2004年10月起任交通银行副行长，2007年8月起任交通银行执行董事。

刘树军先生，交通银行资产托管部总经理。管理学硕士，高级经济师。曾任中国农业银行长春分行办公室主任、农行总行办公室正处级秘书，农行总行信贷部工业信贷处处长，农行总行托管部及养老金中心副总经理，交通银行内蒙古分行副行长。2011年10月起任交通银行资产托管部副总经理，2012年5月起任交通银行资产托管部总经理。

3、基金托管业务经营情况

截止2012年二季度末，交通银行共托管证券投资基金64只，包括博时现金收益货币、博时新兴成长股票、长城久富股票(LOF)、富国汉兴封闭、富国天益价值股票、光大保德信中小盘股票、国泰金鹰增长股票、海富通精选混合、华安安顺封闭、华安宝利配置混合、华安策略优选股票、华安创新股票、华夏蓝筹混合(LOF)、华夏债券、汇丰晋信2016周期混合、汇丰晋信龙腾股票、汇丰晋信动态策略混合、汇丰晋信平稳增利债券、汇丰晋信大盘股票、汇丰晋信低碳先锋股票、汇丰晋信消费红利股票、建信优势封闭、金鹰红利价值混合、金鹰中小盘精选混合、大摩货币、农银恒久增利债券、农银行业成长股票、农银平衡双利混合、鹏华普惠封闭、鹏华普天收益混合、鹏华普天债券、鹏华中国50混合、鹏华信用增利、融通行行业景气混合、泰达宏利成长股票、泰达宏利风险预算混合、泰达宏利稳定股票、泰达宏利周期股票、天治创新先锋股票、天治核心成长股票(LOF)、万家公用事业行业股票(LOF)、易方达科汇灵活配置混合、易方达科瑞封闭、易方达上证50指数、易方达科讯股票、银河银富货币、银华货币、中海优质成长混合、兴全磐稳增利债券、华富中证100指数、工银瑞信双利债券、长信量化先锋股票、华夏亚债中国指数、博时深证基本面200ETF、博时深证基本面200ETF联接、建信信用增强债券、富安达优势成长股票、工银主题策略股票、汇丰晋信货币、农银汇理中证500指数、建信深证100指数、富安达策略精选混合、金鹰中证500指数分级、工银瑞信纯债定期开放债券。此外，还托管了全国社会保障基金、保险资产、企业年金、QFII、QDII、信托计划、证券公司集合资产计划、ABS、产业基金、专户理财等12类产品，托管资产规模超过一万亿元。

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：周秀芬

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) 66155568-6100

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：建设银行储蓄卡、招商银行“一卡通”借记卡、兴业银行银联卡、光大银行卡、中信银行卡和浦发银行卡。

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) 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>

(2) 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>

(3) 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>

(4) 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>

(5) 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>

(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

客户服务电话: 95595

网址: <http://www.cebbank.com>

(8) 中国民生银行股份有限公司

注册地址: 北京市西城区复兴门内大街 2 号

注册地址: 北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人: 董文标

联系人: 吴海鹏

联系电话: (010) 57092616

客户服务电话: 95568

网址: <http://www.cmbc.com.cn>

(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://bank.pingan.com>

(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](http://www.spdb.com.cn)

(11) 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：(021)64339000

客户服务电话：(021) 32109999, (029) 68918888

网址： <http://www.cfsc.com.cn>

(12) 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

网址： <http://www.cs.ecitic.com>

(13) 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：权唐

联系电话：(010) 85130577

客户服务电话：400-8888-108

网址： <http://www.csc108.com>

(14) 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

客户服务电话：400-888-8888

网址: <http://www.chinastock.com.cn>

(15) 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.cindasc.com>

(16) 民生证券有限责任公司

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.msza.com>

(17) 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>

(18) 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

客服热线：400-8888-001、95553

网址：<http://www.htsec.com>

(19) 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：上海市浦东新区银城中路 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>

(20) 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、4008895523

网址：<http://www.sywg.com>

(21) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：徐浩明

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：<http://www.ebscn.com>

(22) 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>

(23) 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、4008-888-999

网址：<http://www.95579.com>

(24) 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：<http://www.bocichina.com>

(25) 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：<http://www.dfzq.com.cn>

(26) 湘财证券有限责任公司

注册地址：湖南省长沙市黄兴中路 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：王霖

联系电话：(0531) 68889157

客户服务电话：95538

网址：<http://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：吴忠超

联系电话：(0532) 85022326

客户服务电话：(0532) 96577

网址: <http://www.zxwt.com.cn>

(30) 中信证券(浙江)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: <http://www.bigsun.com.cn>

(31) 山西证券股份有限公司

注册地址: 山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

办公地址: 山西省太原市府西街 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) 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>

(33) 东海证券有限责任公司

注册地址: 江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18、19 楼

办公地址: 江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18、19 楼

法定代表人: 朱科敏

联系人：李涛

联系电话：(0519) 88157761

客户服务电话：400-888-8588

网址：<http://www.longone.com.cn>

(34) 国元证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市寿春路 179 号

办公地址：安徽省合肥市寿春路 179 号

法定代表人：凤良志

联系人：程维

联系电话：(0551) 2207936

客户服务电话：(0551) 96888

网址：<http://www.gyzq.com.cn>

(35) 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>

(36) 中航证券有限公司

注册地址：南昌市抚河北路 291 号

办公地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼中航证券有限公司

法定代表人：姚江涛

联系人：余雅娜

联系电话：(0791) 6768763

客户服务电话：400-8866-567

网址：<http://www.avicsec.com>

(37) 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

法人代表人：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>

(38) 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：龙增来

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>

(39) 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：官少林

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>

(40) 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：齐晓燕

联系电话：(0755) 82130833

客户服务电话：95536

网址：<http://www.guosen.com.cn>

(41) 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://stock.pingan.com>

(42) 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>

(43) 世纪证券有限责任公司

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 41-42 层

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 41-42 层

法定代表人：卢长才

联系人：张婷

联系电话：(0755) 83199599

网址：<http://www.csc.com.cn>

(44) 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>

(45) 金元证券有限责任公司

注册地址：海南省海口市南宝路 36 号证券大厦 4 层

办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 17 层

法定代表人：郑辉

联系人：金春

联系电话：(0755) 83025695

网址：<http://www.jyzq.com.cn>

(46) 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、39、41、42、43、44

法定代表人：孙树明

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>

(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

客户服务电话：961130

网址：<http://www.dgzq.com.cn>

(49) 中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界中心 29 层

办公地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界中心 29 层

法定代表人：吴泳良

联系人：李珍

联系电话：(0755) 82570586

客户服务电话：4001022011

网址：<http://www.zszq.com.cn>

(50) 万联证券有限责任公司

注册地址：广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 层

办公地址：广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 层

法定代表人：张建军

联系人：罗创斌

联系电话：(020) 37865070

客户服务电话：400—8888—133

网址：<http://www.wlzq.com.cn>

(51) 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：<http://www.txsec.com>

(52) 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：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

法定代表人：薛峰

联系人：张玉静

联系电话：（0755）33227953

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>

（53）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：周燕旻

联系电话：（0571）28829790；（021）60897869

客户服务电话：4000-766-123

网址：<http://www.fund23.cn>

（54）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：王丽

联系电话：021-58788678-8701

客户服务电话：400-089-1289

网址：<http://www.erichfund.com>

（二）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

注册地址：北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

办公地址：北京西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：金颖

电话：(010) 59378835

传真：(010) 59378907

联系人：任瑞新

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：北京市金杜律师事务所

注册地址：北京市朝阳区东三环中路 39 号建外 SOHU A 座 31 层

办公地址：北京市朝阳区东三环中路 39 号建外 SOHU A 座 31 层

负责人：王玲

电话：(010) 58785588、(0755) 22163333

联系人：冯艾

经办律师：宋萍萍、彭晋

（四）会计师事务所和经办注册会计师

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：谢翰文

联系电话：(021) 23233357

经办注册会计师：薛竞、王灵

四、基金的名称

本基金名称：摩根士丹利华鑫货币市场基金

五、基金的类型

本基金类型：契约型开放式货币市场基金

六、基金的投资目标

在力争本金安全和保证资产高流动性的前提下，追求高于业绩比较基准的收益率。

七、基金的投资方向

- 1、现金；
- 2、一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单；
- 3、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券；
- 4、期限在一年以内（含一年）的央行票据；
- 5、期限在一年以内（含一年）的债券回购；
- 6、中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

八、基金的投资策略

（一）投资策略

本基金主要为投资人提供短期现金管理工具，最主要的投资策略是，通过优化以久期为核心的资产配置和品种选择，在保证安全性和流动性的前提下，最大限度地提升基金资产的收益。投资策略分为两个层次：战略资产配置和战术资产配置。

战略资产配置：根据对宏观经济指标、国家财政与货币政策、资金供需、利率期限结构等因素的研究和分析，预测短期市场利率水平，从而确定投资组合的久期和品种配置。

战术资产配置：主要包括对交易市场、投资品种、投资时机、套利的选择与操作，并根据市场环境变化，寻找价值被低估的投资品种和无风险套利机会，努力实现超额收益。

（二）决策依据

- 1、国家有关法律、法规和本基金合同的有关规定；
- 2、国内外宏观经济形势、微观经济环境和证券市场走势；
- 3、财政和货币政策变化、利率走势、通货膨胀预期；
- 4、投资品种的预期收益率和风险水平；
- 5、影响证券市场未来走势的其他因素。

（三）决策程序

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完成交易指令的执行。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。

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：一年期银行定期储蓄存款的税后利率，即 $(1 - \text{利息税率}) \times \text{一年期银行定期储蓄存款利率}$ 。

本基金管理人在合理的市场化利率基准推出的情况下，可根据投资目标、投资方向和投资策略，确定变更业绩比较基准，并提前公告。

十、基金的风险收益特征

本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种，预期风险和预期收益都低于债券基金、混合基金和股票基金。

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。

基金托管人交通银行根据本基金合同规定，于2012年7月16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取自摩根士丹利华鑫货币市场基金 2012 年第 2 季度报告，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	固定收益投资	391,161,889.85	37.18
	其中：债券	391,161,889.85	37.18
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	230,000,865.00	21.86
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	370,863,063.18	35.26
4	其他资产	59,917,715.76	5.70
5	合计	1,051,943,533.79	100.00

2、报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	0.81	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	77,999,683.00	8.13
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

报告期内不存在债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的情况。

3、基金投资组合平均剩余期限情况

（1）投资组合平均剩余期限基本情况

项 目	天 数
报告期末投资组合平均剩余期限	144
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	149
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	29

报告期内不存在投资组合平均剩余期限违规超过 180 天的情况。

(2) 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值比例 (%)	各期限负债占基金资产净值比例 (%)
1	30 天以内	26.15	8.13
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
2	30 天(含)—60 天	10.43	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
3	60 天(含)—90 天	18.77	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
4	90 天(含)—180 天	17.71	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
5	180 天(含)—397 天(含)	30.36	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
	合计	103.42	8.13

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	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	—	—
2	央行票据	49,420,901.20	5.15
3	金融债券	30,044,830.17	3.13
	其中：政策性金融债	30,044,830.17	3.13
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	311,696,158.48	32.50
6	中期票据	—	—
7	其他	—	—
8	合计	391,161,889.85	40.78
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	—	—

5、报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量 (张)	摊余成本 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	041258037	12 天津港 CP001	600,000	60,005,636.34	6.26
2	041261023	12 渝外贸 CP002	500,000	50,004,956.14	5.21

3	1101094	11 央票 94	500,000	49,420,901.20	5.15
4	041256007	12 统众 CP001	300,000	30,422,237.27	3.17
5	041260022	12 长电科技 CP001	300,000	30,141,914.46	3.14
6	110249	11 国开 49	300,000	30,044,830.17	3.13
7	041264011	12 兵团建工 CP001	300,000	29,950,505.82	3.12
8	041159011	11 国新能源 CP001	200,000	20,437,343.67	2.13
9	041260018	12 厦门轻工 CP001	200,000	20,329,059.01	2.12
10	041261016	12 浙商集 CP001	200,000	20,288,455.57	2.12

6、“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项 目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值	
在 0.25%（含）-0.5%间的次数	21 次
报告期内偏离度的最高值	0.46%
报告期内偏离度的最低值	0.05%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.21%

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。

8、投资组合报告附注

（1）基金计价方法说明：本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内平均摊销，每日计提损益。在有关法律法规允许交易所短期债券可以采用摊余成本法估值前，本基金暂不投资于交易所短期债券。

（2）本报告期内不存在剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的 20%的情况。

（3）本报告期内需说明的证券投资决策程序

本报告期内，本基金严格按照基金合同和招募说明书的规定进行投资决策，所投资品种无超出基金合同规定范围的情形，没有需要特别说明和补充的内容。本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的，在报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

(4) 其他资产的构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	4,761,233.51
4	应收申购款	55,156,482.25
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	59,917,715.76

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。

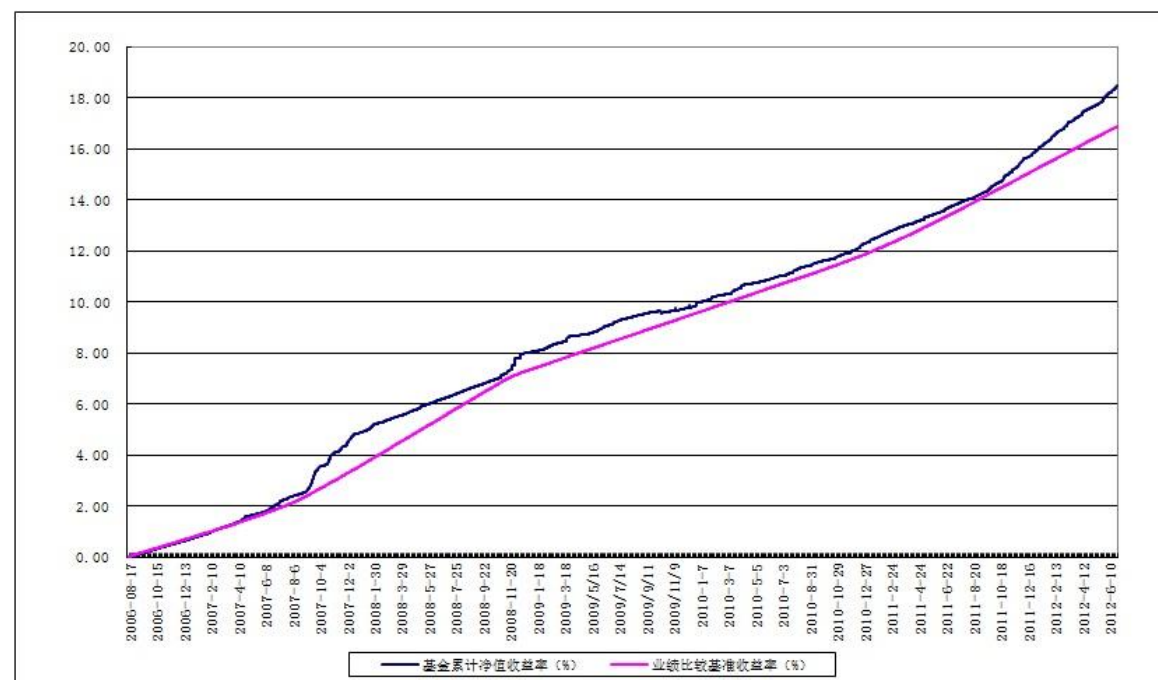
1、自基金合同生效以来至 2012 年 6 月 30 日，本基金份额净值收益率与同期业绩比较基准收益率的比较表：

阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率 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
2006 年 8 月 17 日至 2006 年 12 月 31 日	0.7086%	0.0011%	0.7555%	0.0001%	-0.0469%	0.0010%
2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日	4.1213%	0.0112%	2.7850%	0.0019%	1.3363%	0.0093%
2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	3.0089%	0.0164%	3.7725%	0.0012%	-0.7636%	0.0152%
2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日	1.8123%	0.0086%	2.2500%	0.0000%	-0.4377%	0.0086%
2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	2.1076%	0.0092%	2.3041%	0.0003%	-0.1965%	0.0089%
2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	3.1563%	0.0082%	3.2801%	0.0000%	-0.1238%	0.0082%
2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	2.2733%	0.0113%	1.7295%	0.0002%	0.5438%	0.0111%
自基金合同生效起 至 2012 年 6 月 30 日	18.4659%	0.0111%	16.8767%	0.0019%	1.5892%	0.0092%

重要说明：本基金采取的收益分配方式是采用 1.00 元固定单位净值交易方式，自基金合

同生效之日起每日将实现的基金净收益分配给基金份额持有人,并以份额形式按月结转到基金份额持有人的基金账户,使基金账面单位净值始终保持 1.00 元。

2、自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较:



注: 1、业绩比较基准: 一年期银行定期储蓄存款的税后利率= (1-利息税率) × 一年期银行定期储蓄存款利率;

2、本基金基金合同生效日为 2006 年 8 月 17 日。本基金在 3 个月的初始建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定;

3、本基金业绩截止日为 2012 年 6 月 30 日 (未经审计)。

十三、 基金的费用与税收

(一) 与基金运作有关的费用

1、与基金运作有关的基金费用的种类

- (1) 基金管理人的管理费;
- (2) 基金托管人的托管费;
- (3) 基金合同生效后的信息披露费用;
- (4) 基金份额持有人大会费用;

(5) 基金合同生效后的与基金相关的会计师费和律师费；

(6) 证券交易费用；

(7) 按照国家有关规定和本基金合同规定可以列入的其他费用。

法律法规另有规定时从其规定。

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

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的0.33%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.33%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E\times 0.33\%\div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据基金管理人的划款指令，于次月的前2个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

(2) 基金托管人的托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.1%年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.1%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E\times 0.1\%\div \text{当年天数}$$

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，由基金托管人根据基金管理人的划款指令，于次月的前2个工作日内从基金资产中一次性支取。

(3) 上述与基金运作有关的基金费用的种类中(3)至(7)项费用根据有关法规、基金合同及相应协议的规定，按费用实际支出金额，列入当期基金费用。

3、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资产的损失，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。

基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用不得从基金财产列支。国家另有规定的除外。

4、基金管理费和托管费的调整

基金管理人和基金托管人可磋商酌情调低基金管理费和托管费，经中国证监会核准后公

告。此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。

（二）与基金销售有关的费用

1、基金的销售服务费

基金销售服务费用于支付销售机构佣金以及本基金的市场推广、销售、服务等活动。

本基金的销售服务费率按前一日基金资产净值0.25%的年费率计算。

计算公式如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的销售服务费

E为前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每个月月末，按月支付，由基金托管人根据基金管理人的划款指令，于次月的前5个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，再由基金管理人支付给销售机构。

2、基金认购费

本基金免收认购费

3、基金申购费

本基金免收申购费

4、基金赎回费

本基金免收赎回费

5、基金转换费

基金转换费用由基金份额持有人承担。

基金管理人于2011年6月17日发布《摩根士丹利华鑫基金管理有限公司关于调整旗下部分基金之间转换业务费用计算方法的公告》，自2011年6月22日起，对本基金与摩根士丹利华鑫资源优选混合型证券投资基金(LOF)（下文简称“大摩资源优选混合(LOF)”）之间的转换业务费用计算方法进行调整。调整后的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，具体计算公式为：

（1）大摩资源优选混合（LOF）转出至本基金

$$\text{转出金额} = \text{转出份额} \times \text{转换申请日转出基金份额净值}$$

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

$$\text{申购补差费} = (\text{转出金额} - \text{转出基金赎回费}) \times \text{申购补差费率} / (1 + \text{申购补差费率})$$

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

转入金额=转出金额-转换费用

转入份额=转入金额/转换申请日转入基金份额净值

注：大摩资源优选混合（LOF）转换至本基金的申购补差费率为0。

（2）本基金转出至大摩资源优选混合（LOF）

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

申购补差费=（转出金额-转出基金赎回费）×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

转入金额=转出金额-转换费用+转出份额的待支付收益

转入份额=转入金额/转换申请日转入基金份额净值

注：本基金转换至大摩资源优选混合（LOF）的申购补差费率为转入金额对应的大摩资源优选混合（LOF）申购费率。

（3）转入份额以四舍五入的方法保留至小数点后两位。

基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）或在特定时间段等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以对促销活动范围内的投资者调低基金转换费率。

6、与基金销售有关的费率调整

基金管理人可以在基金合同规定的范围内调整与基金销售有关的费率，调整后的费率在最新的招募说明书中列示。上述费率如发生变更，基金管理人最迟应于新的费率实施前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

（三）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，应按国家税收法律、法规履行其纳税义务。

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》、《运作管理办法》、《销售管理办法》、《信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，对 2012 年 3 月 30 日刊登的《摩根士丹利华鑫货币市场基金招募说明书（更新）（2012 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	三、基金管理人	更新了“基金管理人概况”中的注册资本和股权结构信息；更新了“主要人员情况”的有关信息；更新了“基金管理人的内部控制制度”中的个别表述
2	四、基金托管人	根据基金托管人提供的内容，更新了基金托管人的有关资料
3	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
4	十一、基金的投资	更新了“决策程序”中的有关部门职能；更新了基金投资组合报告的内容，即截至 2012 年 6 月 30 日的基金投资组合报告
5	十二、基金的业绩	更新了基金的投资业绩，即截至 2012 年 6 月 30 日的基金投资业绩
6	二十二、基金托管协议的内容摘要	更新了基金管理人的注册资本信息和基金托管人的办公地址、注册资本信息
7	二十三、对基金份额持有人的服务	根据实际情况更新了对基金份额持有人服务的有关内容
8	二十四、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

二零一二年九月二十八日