摩根士丹利华鑫双利增强债券型证券投资基金 2015 年半年度报告

2015 年 6 月 30 日

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

送出日期：2015 年 8 月 25 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 6
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 7
3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 7
§4 管理人报告 9
4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 13
§5 托管人报告 13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 14
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 14
6.1 资产负债表 14
6.2 利润表 15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 16
6.4 报表附注 17
§7 投资组合报告 34
7.1 期末基金资产组合情况 34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合 35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 36
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 36
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 36
7.8 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 36
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 37
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 37
7.11 投资组合报告附注 37
§8 基金份额持有人信息 38

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 38
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 38
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 38
§9 开放式基金份额变动 39
§10 重大事件揭示 39
10.1 基金份额持有人大会决议 39
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 39
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 39
10.4 基金投资策略的改变 40
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 40
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 40
10.8 其他重大事件 42
§11 备查文件目录 43
11.1 备查文件目录 43
11.2 存放地点 43
11.3 查阅方式 43

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	摩根士丹利华鑫双利增强债券型证券投资基金	
基金简称	大摩双利增强债券	
基金主代码	000024	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 3 月 26 日	
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	
报告期末基金份额总额	227,143,333.44 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称：	大摩双利增强债券 A	大摩双利增强债券 C
下属分级基金的交易代码：	000024	000025
报告期末下属分级基金的份额总额	211,645,495.16 份	15,497,838.28 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金投资目标是在严格控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理，合理配置债券等固定收益类金融工具，力争使投资者获得长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金将坚持稳健配置策略，在严格控制风险的基础上，力争使投资者获得长期稳定的投资回报。 在大类资产配置的基础上，本基金采取以下策略，将固定收益类资产在信用债、可转债和其他资产间进行配置。 首先，本基金分别对影响信用债市场的信贷水平、信用利差水平、信用债市场供求关系等因素进行分析；然后，对影响可转债市场的转股溢价率、隐含波动率、对应正股的市场走势、可转债市场供求关系等因素进行分析研究；最后，本基金根据上述分析结论，预测和比较信用债、可转债两类资产未来的收益率与风险，并结合二者的相关关系，确定并调整信用债、可转债两类资产的配置比例，在收益与风险间寻求最佳平衡 。 本基金将以自上而下的在基准利率曲线分析和信用利差分析基础上相应实施的投资策略，以及自下而上的个券精选策略，作为本基金的信用债券投资策略。 基于行业分析、企业基本面分析和可转债估值模型分析，本基金在一、二级市场投资可转债，以达到控制风险，实现基金资产稳健增值的目的。 除信用债与可转债外，本基金还将在综合考虑组合收

	益、利率风险以及流动性的前提下，投资于国债、央行票据等利率品种。
业绩比较基准	中债企业债总全价指数收益率×40%+天相可转债指数收益率×40%+中债国债总全价指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		摩根士丹利华鑫基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李锦	田青
	联系电话	(0755) 88318883	(010) 67595096
	电子邮箱	xxpl@msfunds.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8888-668	(010) 67595096
传真		(0755) 82990384	(010) 66275853
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	北京市西城区金融大街 25 号
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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		518048	100033
法定代表人		YU HUA(于华)	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.msfunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	摩根士丹利华鑫基金管理有限公司	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第二座第 17 层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	大摩双利增强债券 A	大摩双利增强债券 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	4,128,317.46	1,215,126.12
本期利润	3,304,283.64	994,763.27
加权平均基金份额本期利润	0.0281	0.0547
本期加权平均净值利润率	2.39%	4.74%
本期基金份额净值增长率	4.49%	4.52%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	39,444,481.40	2,781,064.61
期末可供分配基金份额利润	0.1864	0.1794
期末基金资产净值	251,089,976.56	18,278,902.89
期末基金份额净值	1.186	1.179
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	18.60%	17.90%

注：1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2.期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，而非当期发生数)；

3.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

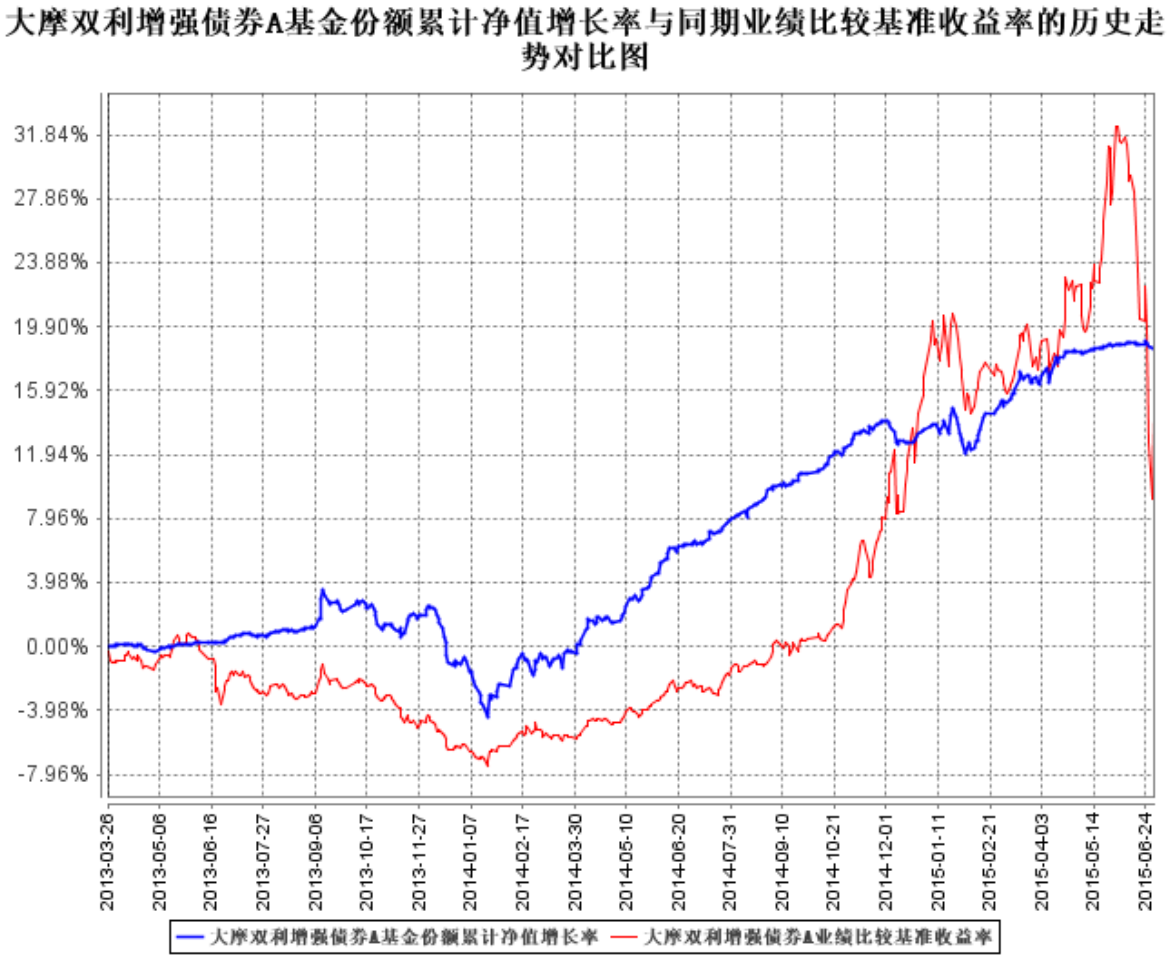
大摩双利增强债券 A

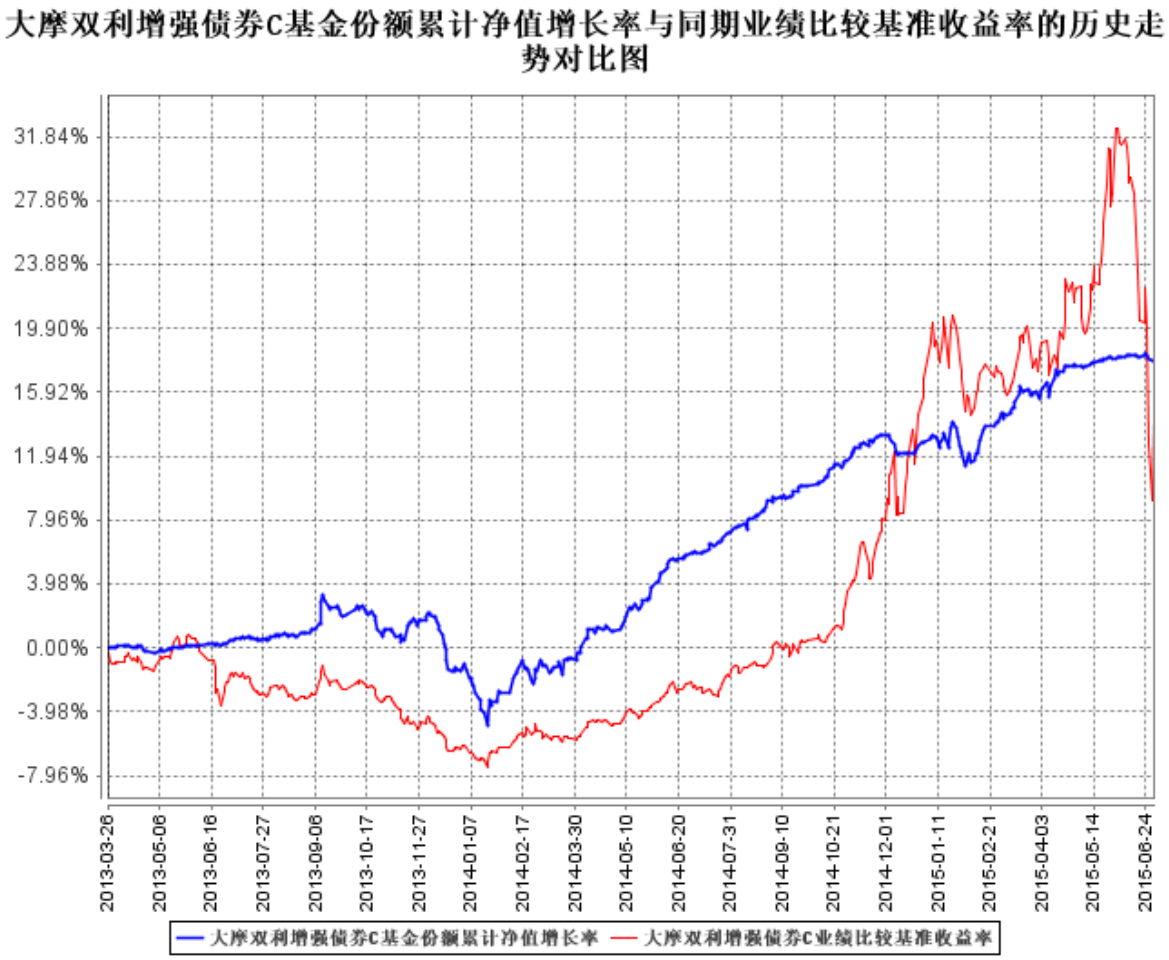
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	-0.08%	0.07%	-10.90%	2.18%	10.82%	-2.11%
过去三个月	1.89%	0.16%	-2.50%	1.51%	4.39%	-1.35%
过去六个月	4.49%	0.25%	-2.18%	1.21%	6.67%	-0.96%
过去一年	11.47%	0.20%	16.76%	0.94%	-5.29%	-0.74%
自基金合同生效起至今	18.60%	0.23%	14.26%	0.65%	4.34%	-0.42%

大摩双利增强债券 C

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
过去一个月	-0.08%	0.06%	-10.90%	2.18%	10.82%	-2.12%
过去三个月	1.90%	0.16%	-2.50%	1.51%	4.40%	-1.35%
过去六个月	4.52%	0.24%	-2.18%	1.21%	6.70%	-0.97%
过去一年	11.33%	0.20%	16.76%	0.94%	-5.43%	-0.74%
自基金合同生效起至今	17.90%	0.23%	14.26%	0.65%	3.64%	-0.42%

3.2.2 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





§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

摩根士丹利华鑫基金管理有限公司（以下简称“公司”）是一家中外合资基金管理公司，前身为经中国证监会证监基金字[2003]33 号文批准设立并于 2003 年 3 月 14 日成立的巨田基金管理有限公司。公司的主要股东包括华鑫证券有限责任公司、摩根士丹利国际控股公司、深圳市招融投资控股有限公司等国内外机构。

截止 2015 年 6 月 30 日，公司旗下共管理十九只开放式基金，包括摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金、摩根士丹利华鑫资源优选混合型证券投资基金（LOF）、摩根士丹利华鑫领先优势股票型证券投资基金、摩根士丹利华鑫强收益债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫卓越成长股票型证券投资基金、摩根士丹利华鑫消费领航混合型证券投资基金、摩根士丹利华鑫多因子精选策略股票型证券投资基金、摩根士丹利华鑫深证 300 指数增强型证券投资基金、摩根士丹利华鑫

主题优选股票型证券投资基金、摩根士丹利华鑫多元收益债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫量化配置股票型证券投资基金、摩根士丹利华鑫双利增强债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫纯债稳定增利 18 个月定期开放债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫品质生活精选股票型证券投资基金、摩根士丹利华鑫进取优选股票型证券投资基金、摩根士丹利华鑫纯债稳定添利 18 个月定期开放债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫优质信价纯债债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫量化多策略股票型证券投资基金和摩根士丹利华鑫新机遇灵活配置混合型证券投资基金。同时，公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张雪	基金经理	2014 年 12 月 9 日	-	7	中央财经大学国际金融学硕士，美国特许金融分析师（CFA）。曾任职于北京银行股份有限公司资金交易部，历任交易员、投资经理。2014 年 11 月加入本公司，2014 年 12 月起担任本基金和摩根士丹利华鑫强收益债券型证券投资基金基金经理，2015 年 2 月起任摩根士丹利华鑫优质信价纯债债券型证券投资基金基金经理。
洪天阳	基金经理	2013 年 3 月 26 日	2015 年 2 月 27 日	8	伦敦帝国学院计算科学博士。曾任职于摩根大通银行投资银行部，中银保险北京总公司，历任外汇投资经理、固定收益投资经理、权益类投资经理和组合投资经理等职。2012 年 9 月加入本公司，2012 年 10 月至 2015 年 2 月期间任摩根士丹利华鑫强收益债券型证券投资基金基金经理，2013 年 3 月至 2015 年 2 月期间任本基金基金经理，2014 年 11 月至 2015 年 2 月期间任摩根士丹利华鑫优质信价纯债债券型证券投资基金基金经理。

注：1、基金经理洪天阳先生的任职日期为基金合同生效之日，离任日期为根据本公司决定确定的解聘日期；基金经理张雪女士的任职日期为根据本公司决定确定的聘任日期；

2、基金经理任职、离任已按规定在中国证券投资基金业协会办理完毕基金经理注册、注销；

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，基金管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在认真控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及内部相关制度和流程，通过流程和系统控制保证有效实现公平交易管理要求，并通过对投资交易行为的监控和分析，确保基金管理人旗下各投资组合在研究、决策、交易执行等各方面均得到公平对待。本报告期，基金管理人严格执行各项公平交易制度及流程。

经对报告期内公司管理所有投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异，连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况有 1 次，为量化投资基金之间因执行投资策略而发生的反向交易，基金管理人未发现其他异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年上半年，国内经济仍在逐渐探底过程中，投资、消费及出口均未出现明显的好转。上半年 GDP 同比增长 7%，第三产业贡献增长明显。具体项目来看，上半年固定资产投资累积增长 11.4%，社会消费品零售同比增长 10.4%，进出口同比下降 6.9%。投资中基建投资仍为主要力量，上半年基建投资累积增长 19.2%，债务置换、平台贷款松绑等政策效果开始显现，预计下半年经济企稳仍主要靠基建投资。房地产和制造业增速仍在下滑过程中，上半年房地产投资累积投资增速下滑至 4.6%。

货币政策方面，2015 年上半年央行两次全面降准，一次定向降准，三次降息，目的在于缓解经济下滑压力，降低企业融资成本。但金融向实体经济的传导仍不理想，表现在上半年 M2 增长 11.8%，社融增长 8.81 万亿，小幅低于预期。受益于房地产销售增长，银行贷款在 6 月末增幅小幅反弹，主要是居民贷款及票据融资增长，尚无迹象表明企业自主投资增长。总的来说，经济基

本面在上半年表现疲软，下降速度减缓，上涨动力不足。

受到股市火爆影响，上半年债市维持窄幅波动的格局。收益率曲线在一季度全面上行后二季度小幅陡峭化下行。尤其在 4 月份降准后，市场流动性明显好转，短端收益率下行明显，长端变化不大。机构在大类资产配置上向权益类倾斜。

本基金上半年主要采取加杠杆并保持适中久期的策略，并在大类资产上择时配置了部分转债仓位。具体来讲，一季度市场资金较为紧张，我们采取了相对保守的策略，信用债 方面主要以短久期轻杠杆为主，同时增加了部分转债配置。二季度经济下滑压力加大，政策面逐渐友好，我们适时调整了策略，在信用债 方面加大了杠杆力度，收益率曲线短端取得了较好的资本利得，并在大类资产配置上降低了转债仓位。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期截至 2015 年 6 月 30 日，本基金 A 类份额净值为 1.186 元，份额累计净值为 1.186 元，C 类份额净值为 1.179 元，累计份额净值为 1.179 元；报告期内 A 类基金份额净值增长率为 4.49%，C 类基金份额净值增长率为 4.52%，同期业绩比较基准收益率为-2.18%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2015 年下半年，经济或仍处于底部徘徊阶段，货币政策和财政政策还有很大空间。经历了 6、7 月份股市剧烈调整后，市场风险偏好明显下降，资金回归债券市场的可能性上升。我们较为看好下半年债券市场，尤其是高等级长久期债券的配置价值。

经济基本面的孱弱为债市提供了很强的支撑。高频数据显示，第二产业仍在去产能过程中，以煤炭、水泥为代表的过剩行业并无见底迹象，股市的大幅震荡也将使第三产业对 GDP 的贡献下降。从更长远的眼光来看，降低实业融资成本、支持实体经济健康发展是政府的终极目标，也是经济见底回升的前提，政府将会维持一个低成本的货币市场环境以促进经济转型。从微观角度看，风险偏好的下降会促进大类资产配置向债市转移，预期下半年资金将逐渐回流债市。

本基金将坚持平衡收益与风险的原则，下半年适度增加杠杆和久期，同时兼顾流动性的管理，在防御为先的基础上择机把握大类资产机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

基金管理人对旗下基金持有的资产按规定以公允价值进行估值。对于相关品种，特别是长期停牌股票等没有市价的投资品种，基金管理人根据中国证监会发布的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的要求进行估值，具体采用的估值政策和程序说明如下：

基金管理人成立基金估值委员会，委员会由主任委员（分管基金运营部的助理总经理）以及

相关成员（包括基金运营部负责人、基金会计、风险管理部及监察稽核部相关业务人员）构成。估值委员会的相关人员均具有一定年限的专业从业经验，具有良好的专业能力，并能在相关工作中保持独立性。其中基金运营部负责具体执行公允价值估值、提供估值建议、跟踪长期停牌股票对资产净值的影响并就调整估值方法与托管行、会计师事务所进行沟通；风险管理部负责评估公允价值估值数据模型，计算并向基金运营部提供使用数据模型估值的证券价格；监察稽核部负责与监管机构的沟通、协调以及检查公允价值估值业务的合法、合规性。

由于基金经理及相关投资研究人员对特定投资品种的估值有深入的理解，经估值委员会主任委员同意，在需要时可以参加估值委员会议并提出估值的建议。估值委员会对特定品种估值方法需经委员充分讨论后确定。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，估值过程中基金经理并未参与。报告期内，本基金管理人未与任何第三方签订与估值相关的任何定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年度最多分配 12 次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 60%。

根据相关法律法规、基金合同的相关规定以及本基金的实际运作情况，本基金本报告期未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监

督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：摩根士丹利华鑫双利增强债券型证券投资基金
报告截止日： 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	7,831,952.19	15,971,519.77
结算备付金		1,438,635.17	752,151.54
存出保证金		17,145.33	43,225.95
交易性金融资产	6.4.7.2	283,907,129.40	137,769,349.75
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		283,907,129.40	137,769,349.75
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	9,904,324.95	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	4,809,016.53	1,465,658.30
应收股利		-	-
应收申购款		3,756,111.58	395,246.06
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		311,664,315.15	156,397,151.37
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2015 年 6 月 30 日**	**上年度末 2014 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-

卖出回购金融资产款		37,999,850.00	35,000,000.00
应付证券清算款		2,000,517.78	5,014,680.42
应付赎回款		1,594,679.99	1,110,602.18
应付管理人报酬		160,551.12	88,218.74
应付托管费		42,813.63	23,525.00
应付销售服务费		5,173.82	11,035.78
应付交易费用	6.4.7.7	9,311.96	2,866.38
应交税费		275,600.00	275,600.00
应付利息		12,950.46	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	193,986.94	109,315.60
负债合计		42,295,435.70	41,635,844.10
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	227,143,333.44	101,273,805.00
未分配利润	6.4.7.10	42,225,546.01	13,487,502.27
所有者权益合计		269,368,879.45	114,761,307.27
负债和所有者权益总计		311,664,315.15	156,397,151.37

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.186 元，C 类基金份额净值 1.179 元，基金份额总额 227,143,333.44 份，其中 A 类基金份额总额 211,645,495.16 份，C 类基金份额总额 15,497,838.28 份。

6.2 利润表

会计主体：摩根士丹利华鑫双利增强债券型证券投资基金
本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		5,580,493.45	44,053,244.90
1.利息收入		8,173,493.23	17,359,295.56
其中：存款利息收入	6.4.7.11	154,854.59	351,107.71
债券利息收入		8,018,413.55	16,554,690.77
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		225.09	453,497.08
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,602,076.96	-7,864,825.20
其中：股票投资收益	6.4.7.12	304,548.47	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-1,906,625.43	-7,864,825.20
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-

股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-1,044,396.67	34,446,842.39
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	53,473.85	111,932.15
减：二、费用		1,281,446.54	10,249,510.28
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	585,807.31	2,292,797.02
2．托管费	6.4.10.2.2	156,215.30	611,412.52
3．销售服务费	6.4.10.2.3	41,923.42	243,104.24
4．交易费用	6.4.7.19	28,082.53	13,697.00
5．利息支出		354,416.53	6,845,570.38
其中：卖出回购金融资产支出		354,416.53	6,845,570.38
6．其他费用	6.4.7.20	115,001.45	242,929.12
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,299,046.91	33,803,734.62
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,299,046.91	33,803,734.62

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：摩根士丹利华鑫双利增强债券型证券投资基金
本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	101,273,805.00	13,487,502.27	114,761,307.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,299,046.91	4,299,046.91
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 （净值减少以“-”号填列）	125,869,528.44	24,438,996.83	150,308,525.27
其中：1.基金申购款	222,675,244.91	40,214,806.64	262,890,051.55
2.基金赎回款	-96,805,716.47	-15,775,809.81	-112,581,526.28
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	227,143,333.44	42,225,546.01	269,368,879.45

项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	864,513,379.74	-8,098,003.89	856,415,375.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	33,803,734.62	33,803,734.62
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 （净值减少以“-”号填列）	-543,331,599.20	-5,469,194.73	-548,800,793.93
其中：1.基金申购款	46,899,462.42	1,472,433.37	48,371,895.79
2.基金赎回款	-590,231,061.62	-6,941,628.10	-597,172,689.72
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	321,181,780.54	20,236,536.00	341,418,316.54

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

高潮生	张力	谢先斌
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

摩根士丹利华鑫双利增强债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2012] 1684 号《关于核准摩根士丹利华鑫双利增强债券型证券投资基金募集的批复》核准，由摩根士丹利华鑫基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《摩根士丹利华鑫双利增强债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 3,967,741,507.65 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2013)第 161 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《摩根士丹利华鑫双利增强债券型证券投资基金基金合同》于 2013 年 3 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 3,970,122,929.23 份基金份额，其中认购资金利息折合 2,381,421.58 份基金份额。本基金的基金管理人为摩根士丹利华鑫基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《摩根士丹利华鑫双利增强债券型证券投资基金基金合同》和《摩根士丹利华鑫双利增强债券型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金自募集期起根据认购/申购费用、赎回费用与

销售服务费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。认购/申购时收取认购/申购费用，赎回时根据持有期限收取赎回费用并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额称为 A 类；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用及赎回费用的基金份额，称为 C 类。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，各类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自由选择认购、申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《摩根士丹利华鑫双利增强债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资具有良好流动性的金融工具，包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券、公司债、中期票据、中小企业私募债、可转债、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本基金的投资组合比例为：固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%，其中，信用债和可转债合计投资比例不低于固定收益类资产的 80%；现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金不直接在二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股申购和新股增发。本基金通过分离交易可转债认购所获得的认股权证，在其可上市交易后 10 个交易日内全部卖出。本基金所持可转换公司债券转股获得的股票在其可上市交易后的 10 个交易日内全部卖出。本基金的业绩比较基准为：中债企业债总全价指数收益率×40%+天相可转债指数收益率×40%+中债国债总全价指数收益率×20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《 摩根士丹利华鑫双利增强债券型证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年上半年财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

（1）以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

（2）对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（3）对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

（4）基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	7,831,952.19
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	7,831,952.19

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2015 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	138,776,966.40	139,182,129.40	405,163.00
	银行间市场	144,648,308.05	144,725,000.00	76,691.95
	合计	283,425,274.45	283,907,129.40	481,854.95
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		283,425,274.45	283,907,129.40	481,854.95

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	9,904,324.95	-
合计	9,904,324.95	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,395.14
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	647.40
应收债券利息	4,801,673.49
应收买入返售证券利息	5,292.80
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	7.70
合计	4,809,016.53

注：“其他”为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	3,446.76
银行间市场应付交易费用	5,865.20
合计	9,311.96

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	832.35
预提费用	193,154.59
合计	193,986.94

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

大摩双利增强债券 A		
项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	77,342,973.07	77,342,973.07
本期申购	209,629,356.00	209,629,356.00
本期赎回(以"-"号填列)	-75,326,833.91	-75,326,833.91
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以"-"号填列)	-	-
本期末	211,645,495.16	211,645,495.16

金额单位：人民币元

大摩双利增强债券 C		
项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	23,930,831.93	23,930,831.93
本期申购	13,045,888.91	13,045,888.91
本期赎回(以"-"号填列)	-21,478,882.56	-21,478,882.56
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以"-"号填列)	-	-
本期末	15,497,838.28	15,497,838.28

注： 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

大摩双利增强债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	10,008,570.69	414,337.69	10,422,908.38
本期利润	4,128,317.46	-824,033.82	3,304,283.64
本期基金份额交易产生的变动数	26,239,918.26	-522,628.88	25,717,289.38
其中：基金申购款	38,903,424.88	-829,999.34	38,073,425.54
基金赎回款	-12,663,506.62	307,370.46	-12,356,136.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	40,376,806.41	-932,325.01	39,444,481.40

单位：人民币元

大摩双利增强债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,937,412.64	127,181.25	3,064,593.89
本期利润	1,215,126.12	-220,362.85	994,763.27
本期基金份额交易产生的变动数	-1,303,389.81	25,097.26	-1,278,292.55
其中：基金申购款	2,183,893.41	-42,512.31	2,141,381.10
基金赎回款	-3,487,283.22	67,609.57	-3,419,673.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,849,148.95	-68,084.34	2,781,064.61

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	50,836.14
定期存款利息收入	85,250.00
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	14,534.99
其他	4,233.46
合计	154,854.59

注：“其他”为申购款利息收入和结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	10,060,940.23
减：卖出股票成本总额	9,756,391.76
买卖股票差价收入	304,548.47

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,906,625.43
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-

合计	-1,906,625.43

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	537,308,498.78
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	521,129,014.41
减：应收利息总额	18,086,109.80
买卖债券差价收入	-1,906,625.43

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-1,044,396.67
——股票投资	-
——债券投资	-1,044,396.67
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-1,044,396.67

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	30,748.13
转出费收入	22,725.72
合计	53,473.85

注：1.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。对 A 类基金份额所收取的赎回费总额的 25%应归基金财产，其余用于支付登记结算费和其他必要的手续费，对 C 类基金份额所收取的赎回费全额计入基金财产。

2.本基金的转换费由转出基金赎回费和转入基金申购补差费构成，其中 A 类份额赎回费部分的 25%归入基金资产，C 类份额所收取的赎回费全额计入基金财产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	22,487.53
银行间市场交易费用	5,595.00
合计	28,082.53

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
审计费用	34,712.18
信息披露费	49,588.57
银行费用	12,646.86
债券帐户维护费	17,853.84
其他	200.00
合计	115,001.45

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
摩根士丹利华鑫基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金销售机构
华鑫证券有限责任公司(″华鑫证券″)	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日 至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日 至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	585,807.31	2,292,797.02
其中:支付销售机构的客户维护费	140,728.34	1,286,294.09

注：支付基金管理人摩根士丹利华鑫基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.75%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值 × 0.75% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日 至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日 至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	156,215.30	611,412.52

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大摩双利增强债券 A	大摩双利增强债券 C	合计
摩根士丹利华鑫基金	-	70.93	70.93
中国建设银行	-	34,011.39	34,011.39
合计	-	34,082.32	34,082.32
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大摩双利增强债券 A	大摩双利增强债券 C	合计
摩根士丹利华鑫基金	-	48,635.15	48,635.15
中国建设银行	-	187,600.09	187,600.09
合计	-	236,235.24	236,235.24

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.4%。本基金销售服务费按前一日 C 类基金份额的资产净值的 0.40%年费率计提，逐日累计至每月月底，由摩根士丹利华鑫基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费＝前一日 C 类基金份额的资产净值 × 0.40 % / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	7,831,952.19	50,836.14	22,907,343.97	262,901.35

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券交易。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
122383	15 恒大 01	2015 年 6 月 24 日	2015 年 7 月 17 日	新债未上市	100.00	100.00	400,000	40,000,000.00	40,000,000.00	-
112253	15 荣盛 01	2015 年 6 月 26 日	2015 年 7 月 23 日	新债未上市	100.00	100.00	200,000	20,000,000.00	20,000,000.00	-
132002	15 天集 EB	2015 年 6 月 11 日	2015 年 7 月 2 日	新债未上市	100.00	100.00	3,500	350,000.00	350,000.00	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
1480305	14 渝茶园债	2015 年 7 月 2 日	105.71	200,000	21,142,000.00
合计				200,000	21,142,000.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所证券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 18,000,000.00 元，于 2015 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型证券投资基金。本基金主要投资于债券等固定收益类资产，包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券、公司债、中期票据、中小企业私募债、可转债、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在严格控制风险的前提下通过基金主动的投资管理，合理配置债券等固定收益类金融工具，力争使投资者获得长期稳定的投资回报。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任，其下设的风险控制和审计委员会负责制定风险管理政策，检查公司和基金运作的合法合规情况；公司经营层对内部控制制度的有效执行承担责任，其下设的风险管理委员会负责讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；督察长监督检查基金和公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况；监察稽核部、风险管理部分工负责风险监督与控制，前者负责协调并与各部门合作完成运营及合规风险管理，后者主要负责基金投资的信用风险、市场风险以及流动性风险的管理；基金经理、投资总监以及投资决策委员会负责对基金投资业务风险进行直接管理。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
A-1	-	19,846,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	50,138,000.00	-
合计	50,138,000.00	19,846,000.00

注：未评级的债券为超短期融资券。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
AAA	48,792,943.00	46,346,170.00
AAA 以下	174,918,186.40	61,571,179.75
未评级	10,058,000.00	10,006,000.00
合计	233,769,129.40	117,923,349.75

注：未评级债券为政策性金融债。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金份额持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本

基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金所持大部分证券在银行间同业市场交易，其余亦在证券交易所上市，因此除附注6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2015 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 37,999,850.00 元将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	7,831,952.19	-	-	-	7,831,952.19
结算备付金	1,438,635.17	-	-	-	1,438,635.17
存出保证金	17,145.33	-	-	-	17,145.33
交易性金融资产	68,988,943.00	130,389,186.40	84,529,000.00	-	283,907,129.40
买入返售金融资产	9,904,324.95	-	-	-	9,904,324.95
应收利息	-	-	-	4,809,016.53	4,809,016.53
应收申购款	-	-	-	3,756,111.58	3,756,111.58

其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	88,181,000.64	130,389,186.40	84,529,000.00	8,565,128.11	311,664,315.15
负债					
卖出回购金融资产款	37,999,850.00	-	-	-	37,999,850.00
应付证券清算款	-	-	-	2,000,517.78	2,000,517.78
应付赎回款	-	-	-	1,594,679.99	1,594,679.99
应付管理人报酬	-	-	-	160,551.12	160,551.12
应付托管费	-	-	-	42,813.63	42,813.63
应付销售服务费	-	-	-	5,173.82	5,173.82
应付交易费用	-	-	-	9,311.96	9,311.96
应付利息	-	-	-	12,950.46	12,950.46
应交税费	-	-	-	275,600.00	275,600.00
其他负债	-	-	-	193,986.94	193,986.94
负债总计	37,999,850.00	-	-	4,295,585.70	42,295,435.70
利率敏感度缺口	50,181,150.64	130,389,186.40	84,529,000.00	4,269,542.41	269,368,879.45
上年度末 2014 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	15,971,519.77	-	-	-	15,971,519.77
结算备付金	752,151.54	-	-	-	752,151.54
存出保证金	-	-	-	43,225.95	43,225.95
交易性金融资产	74,932,000.00	42,837,349.75	20,000,000.00	-	137,769,349.75
应收利息	-	-	-	1,465,658.30	1,465,658.30
应收申购款	-	-	-	395,246.06	395,246.06
资产总计	91,655,671.31	42,837,349.75	20,000,000.00	1,904,130.31	156,397,151.37
负债					
卖出回购金融资产款	35,000,000.00	-	-	-	35,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	5,014,680.42	5,014,680.42
应付赎回款	-	-	-	1,110,602.18	1,110,602.18
应付管理人报酬	-	-	-	88,218.74	88,218.74
应付托管费	-	-	-	23,525.00	23,525.00
应付销售服务费	-	-	-	11,035.78	11,035.78
应付交易费用	-	-	-	2,866.38	2,866.38
应交税费	-	-	-	275,600.00	275,600.00
其他负债	-	-	-	109,315.60	109,315.60
负债总计	35,000,000.00	-	-	6,635,844.10	41,635,844.10
利率敏感度缺口	56,655,671.31	42,837,349.75	20,000,000.00	-4,731,713.79	114,761,307.27

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

		影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（ 2015 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2014 年 12 月 31 日 ）
	市场利率上升 25 个基点	-1,320,000.00	-690,000.00
	市场利率下降 25 个基点	1,340,000.00	690,000.00

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金不直接购买股票、权证等权益类资产，但可持有因可转债转股所形成的股票和因投资分离交易可转债而产生的权证，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金是债券型基金，投资于固定收益类资产占基金资产比例不低于基金资产的 80%，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%。此外，本基金的基金管理人日常对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性权益类投资(2014 年 12 月 31 日：同)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响（2014 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最

低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 116,248.00 元，属于第二层次的余额为 283,790,881.40 元，无属于第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第一层次 46,991,349.75 元，第二层次 90,778,000.00 元，无第三层次)。于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债均属于第一层次(2014 年 12 月 31 日：同)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于 2015 年 3 月 25 日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值（附注 6.4.5），并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	283,907,129.40	91.09
	其中：债券	283,907,129.40	91.09
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-

4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	9,904,324.95	3.18
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	9,270,587.36	2.97
7	其他各项资产	8,582,273.44	2.75
8	合计	311,664,315.15	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600028	中国石化	4,018,000.00	3.50
2	002521	齐峰新材	2,558,500.00	2.23
3	601988	中国银行	1,915,000.00	1.67
4	600016	民生银行	1,264,891.76	1.10

注：”买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600028	中国石化	4,242,000.00	3.70
2	002521	齐峰新材	2,525,904.35	2.20
3	601988	中国银行	2,033,000.00	1.77
4	600016	民生银行	1,260,035.88	1.10

注:“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	9,756,391.76

卖出股票收入（成交）总额	10,060,940.23

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	15,181,500.00	5.64
	其中：政策性金融债	15,181,500.00	5.64
4	企业债券	218,471,381.40	81.10
5	企业短期融资券	50,138,000.00	18.61
6	中期票据	-	-
7	可转债	116,248.00	0.04
8	其他	-	-
9	合计	283,907,129.40	105.40

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	122383	15 恒大 01	400,000	40,000,000.00	14.85
2	1380400	13 海西债	300,000	32,691,000.00	12.14
3	1480583	14 芜湖县建投债	300,000	30,696,000.00	11.40
4	011599099	15 桂建工 SCP002	300,000	30,114,000.00	11.18
5	1480305	14 渝茶园债	200,000	21,142,000.00	7.85

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.10.3 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。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体除 11 西钢债的发行主体西宁特殊钢股份有限公司（以下简称“西宁特钢”）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。

2014 年 10 月 28 日，上海证券交易所发布《关于对西宁特殊钢股份有限公司及有关责任人予以通报批评的决定》（〔2014〕39 号），决定对西宁特钢未及时披露重大事项的行为给予以通报批评。

本基金投资 11 西钢债（122077）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 11 西钢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。

7.11.2

本基金本报告期末未持有股票 。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	17,145.33
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,809,016.53
5	应收申购款	3,756,111.58
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,582,273.44

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
大摩双利增强债券 A	1,792	118,105.75	169,060,862.21	79.88%	42,584,632.95	20.12%
大摩双利增强债券 C	684	22,657.66	-	-	15,497,838.28	100.00%
合计	2,476	91,738.02	169,060,862.21	74.43%	58,082,471.23	25.57%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	大摩双利增强债券 A	19,900.67	0.0094%
	大摩双利增强债券 C	-	-
	合计	19,900.67	0.0088%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金	大摩双利增强债券 A	0

投资和研究部门负责人持有本开放式基金	大摩双利增强债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	大摩双利增强债券 A	0
	大摩双利增强债券 C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大摩双利增强债券 A	大摩双利增强债券 C
基金合同生效日（2013 年 3 月 26 日）基金份额总额	2,785,713,794.41	1,184,409,134.82
本报告期期初基金份额总额	77,342,973.07	23,930,831.93
本报告期基金总申购份额	209,629,356.00	13,045,888.91
减:本报告期基金总赎回份额	75,326,833.91	21,478,882.56
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	211,645,495.16	15,497,838.28

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人的重大人事变动如下：

本报告期内，中国证券监督管理委员会核准 Sheldon Gao（高潮生）先生担任本公司总经理职务，公司于 2015 年 4 月 16 日公告了上述事项。

本报告期内，徐卫先生不再担任基金管理人副总经理，公司于 2015 年 5 月 30 日公告了上述事项。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金未改变投资策略。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	2	7,535,035.88	74.89%	6,859.99	74.89%	-
海通证券	1	2,525,904.35	25.11%	2,299.63	25.11%	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中信证券（山东）	2	-	-	-	-	-

中信证券（浙江）	2	-	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-	-

注：1.专用交易单元的选择标准

（1）实力雄厚，信誉良好；

（2）财务状况良好，经营行为规范；

（3）内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

（4）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；

（5）研究实力较强，能及时、定期、全面地为本基金提供研究服务；

（6）为基金份额持有人提供高水平的综合服务。

2.基金管理人根据以上标准进行考察后确定合作券商。基金管理人与被选择的证券经营机构签订《专用证券交易单元租用协议》，报证券交易所办理交易单元相关租用手续。

3. 本报告期内，本基金减少了租用东海证券公司的 1 个交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长江证券	131,365,562.75	62.08%	1,796,800,000.00	93.94%	-	-
海通证券	49,258,374.70	23.28%	115,900,000.00	6.06%	-	-

宏信证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	30,988,827.12	14.64%	-	-	-	-
中信证券（山东）	-	-	-	-	-	-
中信证券（浙江）	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	本基金 2014 年 4 季度报告	《中国证券报》	2015 年 1 月 22 日
2	本基金基金经理变更公告	《中国证券报》	2015 年 2 月 28 日

3	本公司关于旗下基金参与杭州数米基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2015 年 3 月 3 日
4	本基金 2014 年年度报告	《中国证券报》	2015 年 3 月 26 日
5	本公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	《中国证券报》	2015 年 3 月 26 日
6	本公司关于高级管理人员变更的公告	《中国证券报》	2015 年 4 月 16 日
7	本基金 2015 年 1 季度报告	《中国证券报》	2015 年 4 月 21 日
8	本公司关于增加北京创金启富投资管理有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》	2015 年 4 月 29 日
9	本基金招募说明书(更新)(2015 年第 1 号)	《中国证券报》	2015 年 5 月 8 日
10	本公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》	2015 年 5 月 30 日
11	本公司关于旗下部分基金参与中国农业银行网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2015 年 6 月 1 日
12	本公司关于旗下部分基金参与交通银行网上银行、手机银行申购费率优惠的公告	《中国证券报》	2015 年 6 月 30 日

注:上述公告同时在公司网站 www.msfunds.com.cn 上披露。

§11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

1、中国证监会核准本基金募集的文件;

2、本基金基金合同;

3、本基金托管协议;

4、本基金招募说明书;

5、基金管理人业务资格批件、营业执照;

6、基金托管人业务资格批件、营业执照;

7、报告期内在指定报刊上披露的各项公告。

11.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件，还可以通过基金管理人网站查阅或下载。

摩根士丹利华鑫基金管理有限公司
2015 年 8 月 25 日