

摩根士丹利华鑫纯债稳健增利18个月定期开放债券型证券投资基金2019年第1季度报告

2019-03-31

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：中国民生银行股份有限公司

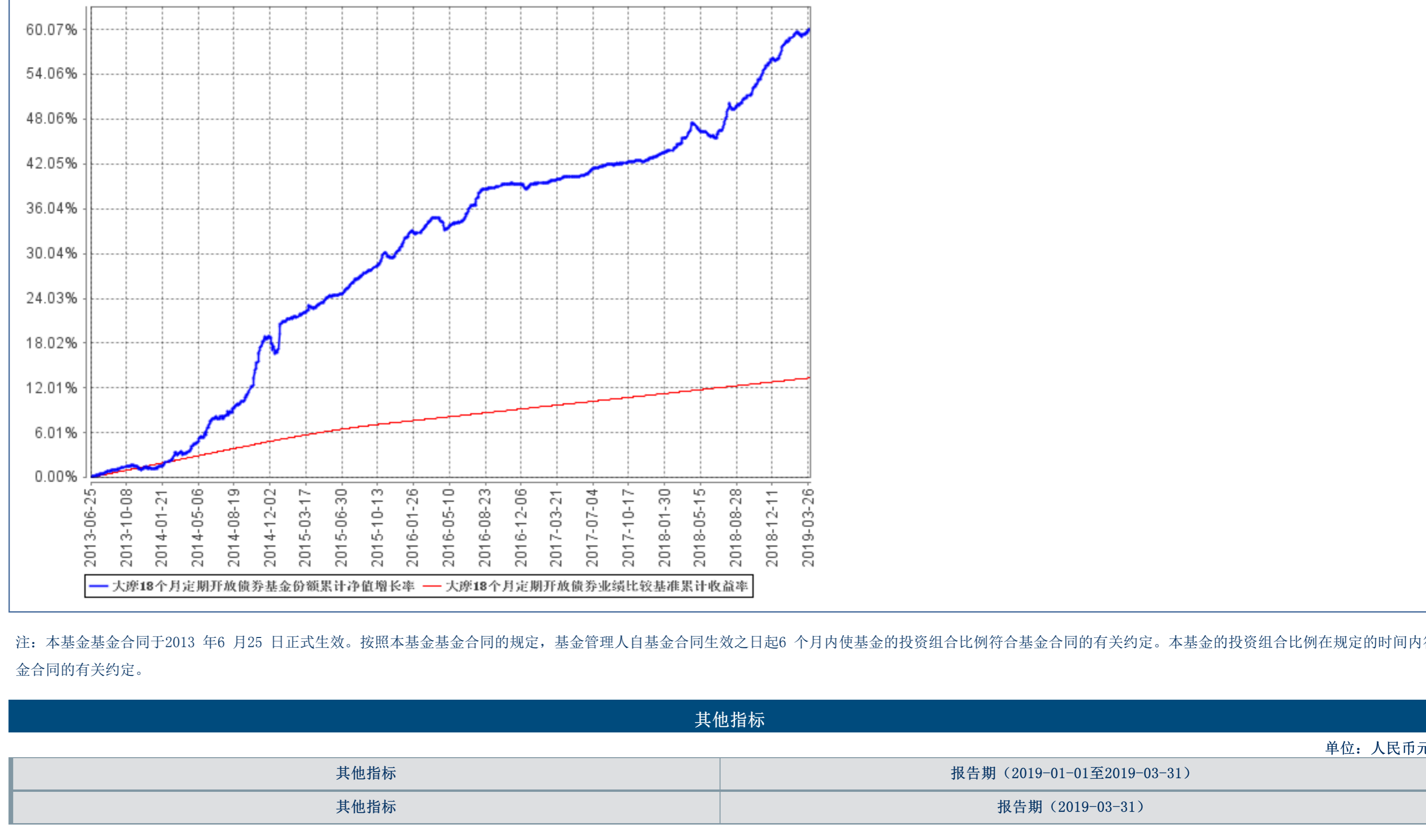
报告送出日期：2019-04-20

重要提示
基金管理人及基金托管人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。

基金基本情况
项目：基金简称、场内简称、基金代码、基金运作方式、基金合同生效日、报告期末基金份额总额、投资目标、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征、基金管理人、基金托管人。

主要财务指标
主要财务指标：本期已实现收益、本期利润、加权平均基金份额本期利润、期末基金资产净值、期末基金份额净值。

基金净值表现
本报告期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
阶段：过去三个月、本报告期基金份额净值增长率、同期业绩比较基准收益率。



其他指标
其他指标：本报告期（2019-01-01至2019-03-31）、本报告期（2019-03-31）。

基金经理（或基金经理小组）简介
姓名：李轶，职务：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。

管理人对于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。

公平交易专项说明
基金管理人严格执行《证券投资基金公平交易制度指导意见》及内部相关制度和流程，通过系统和流程控制保证有效公平交易管理要求。

异常交易行为的专项说明
报告期内，本基金未出现基金管理人管理的所有投资组合参与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3%的情况。

报告期内基金的投资策略和运作分析
经济在经历了去年四季度快速下滑后，于今年一季度迎来一定程度反弹，国内经济数据出现反弹，从微观高频数据来看，开工逐步恢复，新订单同样上行。

报告期内基金的业绩表现
本报告期截至2019年3月31日，本基金份额净值为1.081元，份额累计净值为1.497元，报告期内基金份额净值增长率为2.44%，同期业绩比较基准收益率为0.08%。

报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
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。

投资组合报告
报告期末基金资产组合情况
序号：1 权益类投资、2 固定收益投资、3 贵金属投资、4 金融衍生品投资、5 买入返售金融资产、6 银行存款和结算备付金合计、7 其他资产、8 合计。

报告期末按行业分类的境内股票投资组合
序号：A 农、林、牧、渔业、B 采矿业、C 制造业、D 电力、热力、燃气及水生产和供应业、E 建筑业、F 批发和零售业、G 交通运输、仓储和邮政业、H 住宿和餐饮业、I 信息传输、软件和信息技术服务业、J 金融业、K 房地产业、L 租赁和商务服务业、M 科学研究和技术服务业、N 水利、环境和公共设施管理业、O 居民服务、修理和其他服务业、P 教育、Q 卫生和社会工作、R 文化、体育和娱乐业、S 综合、合计。

报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
行业类别：A 基础材料、B 消费者必需品、C 消费者用品、D 能源、E 金融、F 医疗健康、G 工业、H 信息技术、I 电信服务、J 公用事业、K 房地产、合计。

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：1 127449 16太湖02、2 10176041 17海口城多02、3 112274 15金02、4 112470 16广01、5 122446 15万1201。

报告期末按品种分类的债券投资组合
序号：1 国债债券、2 央行票据、3 金融债券、4 企业债券、5 企业短期融资券、6 中期票据、7 可转债（可交换债）、8 同业存单、9 其他、10 合计。

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债券投资明细
序号：1 127449 16太湖02、2 10176041 17海口城多02、3 112274 15金02、4 112470 16广01、5 122446 15万1201。

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资产支持证券投资明细
注：本基金本报告期末持有资产支持证券。

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
注：根据本基金合同约定，本基金不参与贵金属投资。

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权证投资明细
注：本基金本报告期末持有权证。

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
代码：、名称：、持仓量（买/卖）、合约市值（元）、公允价值变动（元）、风险说明。

本基金股指期货的投资政策
注：根据本基金合同约定，本基金不参与股指期货交易。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
代码：、名称：、持仓量（买/卖）、合约市值（元）、公允价值变动（元）、风险说明。

本期国债期货投资评价
注：根据本基金合同约定，本基金不参与国债期货交易。

投资组合报告附注
受到调查以及处罚情况
注：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。

申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库
注：根据本基金合同约定，本基金不参与股票投资。

其他资产构成
序号：1 存出保证金、2 应收证券清算款、3 应收股利、4 应收利息、5 应收申购款、6 其他应收款、7 待摊费用、8 其他、9 合计。

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注：根据本基金合同约定，本基金不参与可转债投资。

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注：根据本基金合同约定，本基金不参与股票投资。

开放式基金份额变动
项目：报告期初基金份额总额、报告期间基金总申购份额、报告期间基金总赎回份额、报告期间基金份额变动份额、报告期末基金份额总额。

基金管理人运用固有资金投资本基金情况
基金管理人持有本基金份额变动情况
项目：报告期初基金管理人持有的基金份额、报告期间买入/申购总份额、报告期间卖出/赎回总份额、报告期末基金管理人持有的基金份额、报告期末基金管理人持有基金份额占基金份额总额比例。

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
序号：、交易方式、交易日期、交易数量（份）、交易金额（元）、适用费率。

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况
项目：基金管理人自有资金、基金管理人高级管理人员、基金管理人从业人员、基金管理人股东、其他、合计。

报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况
投资者类别：机构、个人。

影响投资者决策的其他重要信息
影响投资者决策的其他重要信息：、。

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. 本基金的招募说明书；4. 本基金的托管协议；5. 基金管理人业务资格批复、营业执照；6. 基金托管人业务资格批复、营业执照；7. 报告期内在指定报刊上披露的各项公告。

存放地点
基金管理人、基金托管人处。

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。

目录
重要提示
基金产品概况
主要财务指标和基金净值表现
基金经理报告
公平交易专项说明
报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
报告期内基金的投资组合报告
公平交易专项说明
异常交易行为的专项说明
报告期内基金的投资策略和运作分析
报告期内基金的业绩表现
报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
投资组合报告
报告期末按行业分类的境内股票投资组合
报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
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
报告期末按品种分类的债券投资组合
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债券投资明细
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资产支持证券投资明细
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
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权证投资明细
报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金股指期货的投资政策
报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本期国债期货投资评价
投资组合报告附注
受到调查以及处罚情况
申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库
其他资产构成
报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
开放式基金份额变动
基金管理人运用固有资金投资本基金情况
基金管理人持有本基金份额变动情况
基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
报告期末发起式基金发起资金持有份额情况
报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况
影响投资者决策的其他重要信息
备查文件目录
存放地点
查阅方式