

信息披露

摩根士丹利华鑫双利增强债券型证券投资基金

2019年第一季度报告

4.2 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,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的利益行为。

4.6 报告期内基金持有人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人数不满二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

5 投资组合报告

5.1 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	—	—
其中:股票	—	—	—
2	固定收益投资	3,369,363,549.84	88.13
其中:债券	3,369,363,549.84	88.13	
4	金融衍生品投资	—	—
5	贵金属投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
其中:买入返售金融资产-买入返售金融资产	—	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	485,686,222.00	12.72
8	其他资产	1,540,739,370.03	39.83
9	合计	5,395,769,146.88	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	医药生物	118,289,300.00	2.56
2	计算机	730,388,948.84	21.08
3	金融地产	50,005,000.00	1.46
4	通信设备	50,005,000.00	1.46
5	公用事业	1,103,800,000.00	33.72
6	交通运输	1,282,716,500.00	36.61
7	中期票据	730,388,948.84	21.08
8	可转债(可交换债)	—	—
9	债券回购	—	—
10	合计	3,369,363,549.84	100.00

5.3 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	证券代码	证券名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000011	招商局	600,000	32,982,000.00	2.72
2	011803	国债逆回购	90,000	90,000.00	0.00
3	130628	14国开债	860,000	84,940,000.00	2.48
4	101404062	14国开债	800,000	81,328,000.00	2.34
5	101555021	10国开债	800,000	80,200,000.00	2.28
6	130628	14国开债	860,000	84,940,000.00	2.48
7	101404062	14国开债	800,000	81,328,000.00	2.34
8	101555021	10国开债	800,000	80,200,000.00	2.28
9	130628	14国开债	860,000	84,940,000.00	2.48
10	101404062	14国开债	800,000	81,328,000.00	2.34

5.4 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	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000011	招商局	600,000	32,982,000.00	2.72
2	011803	国债逆回购	90,000	90,000.00	0.00
3	130628	14国开债	860,000	84,940,000.00	2.48
4	101404062	14国开债	800,000	81,328,000.00	2.34
5	101555021	10国开债	800,000	80,200,000.00	2.28

5.5 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

序号	证券代码	证券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000011	招商局	600,000	32,982,000.00	2.72
2	011803	国债逆回购	90,000	90,000.00	0.00
3	130628	14国开债	860,000	84,940,000.00	2.48
4	101404062	14国开债	800,000	81,328,000.00	2.34
5	101555021	10国开债	800,000	80,200,000.00	2.28

5.6 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

序号	证券代码	证券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000011	招商局	600,000	32,982,000.00	2.72
2	011803	国债逆回购	90,000	90,000.00	0.00
3	130628	14国开债	860,000	84,940,000.00	2.48
4	101404062	14国开债	800,000	81,328,000.00	2.34
5	101555021	10国开债	800,000	80,200,000.00	2.28

5.7 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

序号	证券代码	证券名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000011	招商局	600,000	32,982,000.00	2.72
2	011803	国债逆回购	90,000	90,000.00	0.00
3	130628	14国开债	860,000	84,940,000.00	2.48
4	101404062	14国开债	800,000	81,328,000.00	2.34
5	101555021	10国开债	800,000	80,200,000.00	2.28

5.8 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股指期货投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000011	招商局	600,000	32,982,000.00	2.72
2	011803	国债逆回购	90,000	90,000.00	0.00
3	130628	14国开债	860,000	84,940,000.00	2.48
4	101404062	14国开债	800,000	81,328,000.00	2.34
5	101555021	10国开债	800,000	80,200,000.00	2.28

5.9 报告期末本基金投资的国债期货投资情况

序号	证券代码	证券名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000011	招商局	600,000	32,982,000.00	2.72
2	011803	国债逆回购	90,000	90,000.00	0.00
3	130628	14国开债	860,000	84,940,000.00	2.48
4	101404062	14国开债	800,000	81,328,000.00	2.34
5	101555021	10国开债	800,000	80,200,000.00	2.28

5.10 报告期末本基金投资的股指期货投资情况

序号	证券代码	证券名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000011	招商局	600,000	32,982,000.00	2.72
2	011803	国债逆回购	90,000	90,000.00	0.00
3	130628	14国开债	860,000	84,940,000.00	2.48
4	101404062	14国开债	800,000	81,328,000.00	2.34
5	101555021	10国开债	800,000	80,200,000.00	2.28

5.11 报告期末本基金投资的国债期货投资情况

序号	证券代码	证券名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000011	招商局	600,000	32,982,000.00	2.72
2	011803	国债逆回购	90,000	90,000.00	0.00
3	130628	14国开债	860,000	84,940,000.00	2.48
4	101404062	14国开债	800,000	81,328,000.00	2.34
5	101555021	10国开债	800,000	80,200,000.00	2.28

5.12 报告期末本基金投资的股指期货投资情况

序号	证券代码	证券名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000011	招商局	600,000	32,982,000.00	2.72
2	011803	国债逆回购	90,000	90,000.00	0.00
3	130628	14国开债	860,000	84,940,000.00	2.48
4	101404062	14国开债	800,000	81,328,000.00	2.34
5	101555021	10国开债	800,000	80,200,000.00	2.28

5.13 报告期末本基金投资的国债期货投资情况

序号	证券代码	证券名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000011	招商局	600,000	32,982,000.00	2.72
2	011803	国债逆回购	90,000	90,000.00	0.00
3	130628	14国开债	860,000	84,940,000.00	2.48
4	101404062	14国开债	800,000	81,328,000.00	2.34
5	101555021	10国开债	800,000	80,200,000.00	2.28

5.14 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权证投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000011	招商局	600,000	32,982,000.00	2.72
2	011803	国债逆回购	90,000	90,000.00	0.00
3	130628	14国开债	860,000	84,940,000.00	2.48
4	101404062	14国开债	800,000	81,328,000.00	2.34
5	101555021	10国开债	800,000	80,200,000.00	2.28

5.15 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

序号	证券代码	证券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000011	招商局	600,000	32,982,000.00	2.72
2	011803	国债逆回购	90,000	90,000.00	0.00
3	130628	14国开债	860,000	84,940,000.00	2.48
4	101404062	14国开债	800,000	81,328,000.00	2.34
5	101555021	10国开债	800,000	80,200,000.00	2.28

5.16 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股指期货投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000011	招商局	600,000	32,982,000.00	2.72
2	011803	国债逆回购	90,000	90,000.00	0.00
3	130628	14国开债	860,000	84,940,000.00	2.48
4	101404062	14国开债	800,000	81,328,000.00	2.34
5	101555021	10国开债	800,000	80,200,000.00	2.28

5.17 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国债期货投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000011	招商局	600,000	32,982,000.00	2.72
2	011803	国债逆回购	90,000	90,000.00	0.00
3	130628	14国开债	860,000	84,940,000.00	2.48
4	101404062	14国开债	800,000	81,328,000.00	2.34
5	101555021	10国开债	800,000	80,200,000.00	2.28

5.18 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

序号	证券代码	证券名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000011	招商局	600,000	32,982,000.00	2.72
2	011803	国债逆回购	90,000	90,000.00	0.00
3	130628	14国开债	860,000	84,940,000.00	2.48
4	101404062	14国开债	800,000	81,328,000.00	2.34
5	101555021	10国开债	800,000	80,200,000.00	2.28

5.19 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

序号	证券代码	证券名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000011	招商局	600,000	32,982,000.00	2.72
2	011803	国债逆回购	90,000	90,000.00	0.00
3	130628	14国开债	860,000	84,940,000.00	2.48
4	101404062	14国开债	800,000	81,328,000.00	2.34
5	101555021	10国开债	800,000	80,200,000.00	2.28

5.20 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

序号	证券代码	证券名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000011	招商局	600,000	32,982,000.00	2.72
2	011803	国债逆回购	90,000	90,000.00	0.00
3	130628	14国开债	860,000	84,940,000.00	2.48
4	101404062	14国开债	800,000	81,328,000.00	2.34
5	101555021	10国开债	800,000	80,200,000.00	2.28

5.21 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

序号	证券代码	证券名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000011	招商局	600,000	32,982,000.00	2.72
2	011803	国债逆回购	90,000	90,000.00	0.00
3	130628	14国开债	860,000	84,940,000.00	2.48
4	101404062	14国开债	800,000	81,328,000.00	2.34
5	101555021	10国开债	800,000	80,200,000.00	2.28

5.22 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

序号	证券代码	证券名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000011	招商局	600,000	32,982,000.00	2.72
2	011803	国债逆回购	90,000	90,000.00	0.00
3	130628	14国开债	860,000	84,940,000.00	2.48
4	101404062	14国开债	800,000	81,328,000.00	2.34
5	101555021	10国开债	800,000	80,200,000.00	2.28

5.23 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

5.6 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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