

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  
报告送出日期:2019年4月20日

§ 1 重要提示  
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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年4月18日复核了本基金报告中的财务指标、净值表现及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未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期中财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 大摩双利增强债券

基金代码 000204

交易代码 000204

基金运作方式 灵活配置开放式

报告期末基金份额 2,941,326,000.02份

投资目标 本基金将坚持绝对收益策略，在严格控制风险的基础上，力争获得超越基准收益的回报。

投资策略 本基金将坚持绝对收益策略，在严格控制风险的基础上，力争获得超越基准收益的回报。

风险收益特征 本基金为债券型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，高于货币市场基金。

基金管理人 摩根士丹利华鑫基金管理有限公司

下属二级基金的简称 大摩双利增强债券A 大摩双利增强债券C

下属二级基金的代码 000204 000025

报告期末二级基金的份额 1,880,130,803.97份 1,061,115,107.02份

报告期末二级基金的份额净值 3.229 1.061

3.1 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2019年1月1日 - 2019年3月31日)

大摩双利增强债券A 大摩双利增强债券C

1.本期已实现收益 16,772,400.07 9,098,063.13

2.本期利润 37,046,381.00 21,031,107.00

3.加权平均基金份额本期利润 0.0244 0.0256

4.期末基金资产净值 2,176,271,052.00 1,346,300,420.00

5.期末基金份额净值 1.061 1.053

注:1.以上各项基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金时所发生的基金交易费用(例如,开放式基金的申购赎回费等),计入费用后实际收益水平将低于不计费用时。

2.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。

3.基金净值表现

3.2 本基金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

大摩双利增强债券A

大摩双利增强债券C

报告期三个季度 20.22% 1.40% 10.50% 0.00% 9.64% 0.64%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

大摩双利增强债券C

报告期三个季度 2.10% 0.08% 7.00% 0.08% -4.90% -0.31%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

大摩双利增强债券C

报告期三个季度 2.10% 0.08% 7.00% 0.08% -4.90% -0.31%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

大摩双利增强债券C

报告期三个季度 2.10% 0.08% 7.00% 0.08% -4.90% -0.31%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

大摩双利增强债券C

报告期三个季度 2.10% 0.08% 7.00% 0.08% -4.90% -0.31%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

大摩双利增强债券C

报告期三个季度 2.10% 0.08% 7.00% 0.08% -4.90% -0.31%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

大摩双利增强债券C

报告期三个季度 2.10% 0.08% 7.00% 0.08% -4.90% -0.31%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

大摩双利增强债券C

报告期三个季度 2.10% 0.08% 7.00% 0.08% -4.90% -0.31%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

大摩双利增强债券C

报告期三个季度 2.10% 0.08% 7.00% 0.08% -4.90% -0.31%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

大摩双利增强债券C

报告期三个季度 2.10% 0.08% 7.00% 0.08% -4.90% -0.31%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

大摩双利增强债券C

报告期三个季度 2.10% 0.08% 7.00% 0.08% -4.90% -0.31%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

大摩双利增强债券C

报告期三个季度 2.10% 0.08% 7.00% 0.08% -4.90% -0.31%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

大摩双利增强债券C

报告期三个季度 2.10% 0.08% 7.00% 0.08% -4.90% -0.31%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

大摩双利增强债券C

报告期三个季度 2.10% 0.08% 7.00% 0.08% -4.90% -0.31%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

大摩双利增强债券C

报告期三个季度 2.10% 0.08% 7.00% 0.08% -4.90% -0.31%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

大摩双利增强债券C

报告期三个季度 2.10% 0.08% 7.00% 0.08% -4.90% -0.31%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

大摩双利增强债券C

报告期三个季度 2.10% 0.08% 7.00% 0.08% -4.90% -0.31%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

大摩双利增强债券C

报告期三个季度 2.10% 0.08% 7.00% 0.08% -4.90% -0.31%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

大摩双利增强债券C

报告期三个季度 2.10% 0.08% 7.00% 0.08% -4.90% -0.31%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

大摩双利增强债券C

报告期三个季度 2.10% 0.08% 7.00% 0.08% -4.90% -0.31%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

大摩双利增强债券C

报告期三个季度 2.10% 0.08% 7.00% 0.08% -4.90% -0.31%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

大摩双利增强债券C

报告期三个季度 2.10% 0.08% 7.00% 0.08% -4.90% -0.31%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

大摩双利增强债券C

报告期三个季度 2.10% 0.08% 7.00% 0.08% -4.90% -0.31%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

大摩双利增强债券C

报告期三个季度 2.10% 0.08% 7.00% 0.08% -4.90% -0.31%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

大摩双利增强债券C

报告期三个季度 2.10% 0.08% 7.00% 0.08% -4.90% -0.31%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

大摩双利增强债券C

报告期三个季度 2.10% 0.08% 7.00% 0.08% -4.90% -0.31%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

大摩双利增强债券C

报告期三个季度 2.10% 0.08% 7.00% 0.08% -4.90% -0.31%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

大摩双利增强债券C

报告期三个季度 2.10% 0.08% 7.00% 0.08% -4.90% -0.31%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

大摩双利增强债券C

报告期三个季度 2.10% 0.08% 7.00% 0.08% -4.90% -0.31%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

大摩双利增强债券C

报告期三个季度 2.10% 0.08% 7.00% 0.08% -4.90% -0.31%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

大摩双利增强债券C

报告期三个季度 2.10% 0.08% 7.00% 0.08% -4.90% -0.31%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

大摩双利增强债券C

报告期三个季度 2.10% 0.08% 7.00% 0.08% -4.90% -0.31%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

大摩双利增强债券C

报告期三个季度 2.10% 0.08% 7.00% 0.08% -4.90% -0.31%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

大摩双利增强债券C

报告期三个季度 2.10% 0.08% 7.00% 0.08% -4.90% -