

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

[2014] 第一季度报告

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:2014年4月22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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年4月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	摩根士丹利华鑫纯债稳定增利18个月定期开放债券基金		
基金代码	000064		
交易代码	000064		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2013年6月26日		
报告期末基金份额总额	1,224,607,642.00份		
投资目标	在严格控制投资风险的前提下，追求超过同期业绩比较基准的收益增长。		
投资策略	本基金将坚持“平衡收益与风险”的原则，未来一个季度的投资策略将择机把握大类资产机会，我们将逐步增加债券组合的杠杆和杠。		
投资组合报告	§ 5 投资组合报告		
§ 1 报告期末基金资产组合情况	§ 2 基金产品概况		
序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权证投资	-	-
2	固定收益投资	2,012,403,020.30	96.50
3	货币市场基金	2,012,403,020.30	96.50
4	银行存款	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他资产	-	-
7	合计	2,058,447,400.01	100.00
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	§ 3 主要财务指标和基金净值表现		
本基金本报告期未持有股票。	单位:人民币元		
5.3 报告期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	§ 4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合		
本基金本报告期未持有股票。	单位:人民币元		
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合	§ 5 投资组合报告		
序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	47,415,000.00	3.80
2	企业债券	-	-
3	金融债券	263,194,000.00	21.10
4	企业债	1,701,894,929.30	136.46
5	中期票据	-	-
6	短期融资券	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	2,012,403,020.30	100.00
5.5 报告期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	§ 6 开放式基金份额变动		
本基金本报告期未持有股票。	单位:人民币元		
5.6 报告期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	§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况		
本基金本报告期未持有贵金属。	7.1 基金管理人持有本基金的文件		
5.7 报告期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	7.2 基金管理人运用自有资金买卖贵金属的情况		
根据本基金基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。	7.3 其他贵金属投资		
5.8 报告期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	7.4 报告期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		
本基金本报告期未持有权证。	7.5 报告期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		
5.9 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名仓单交易情况	7.6 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细		
5.10 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名黄金租赁情况	7.7 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.11 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名特殊品种投资情况	7.8 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.12 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合	7.9 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.13 其他资产构成	7.10 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
序号	名称	金额(元)	
1	存出保证金	25,156,37	
2	应收证券清算款	-	
3	应收股利	-	
4	应收利息	27,770,103.20	
5	应收申购款	-	
6	其他应收款	-	
7	待摊费用	-	
8	其他	-	
9	合计	27,796,298.67	
5.10.4 报告期未持有的处于转持期的可转换债券明细	7.11 报告期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		
本基金本报告期未持有处于转持期的可转换债券。	7.12 报告期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		
5.10.5 报告期前前十名股票中存在流通受限情况的说明	7.13 报告期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		
本基金本报告期未持有股票。	7.14 报告期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		
5.10.6 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名特殊品种投资情况	7.15 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.7 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合	7.16 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.8 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产	7.17 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.9 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.18 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.10 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.19 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.11 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.20 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.12 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.21 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.13 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.22 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.14 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.23 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.15 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.24 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.16 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.25 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.17 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.26 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.18 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.27 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.19 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.28 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.20 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.29 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.21 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.30 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.22 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.31 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.23 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.32 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.24 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.33 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.25 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.34 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.26 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.35 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.27 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.36 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.28 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.37 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.29 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.38 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.30 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.39 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.31 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.40 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.32 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.41 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.33 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.42 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.34 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.43 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.35 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.44 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.36 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.45 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.37 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.46 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.38 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.47 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.39 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.48 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.40 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.49 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.41 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.50 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.42 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.51 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.43 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.52 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.44 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.53 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.45 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.54 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.46 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.55 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.47 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.56 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.48 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.57 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.49 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.58 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.50 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.59 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.51 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.60 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.52 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.61 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.53 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.62 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.54 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.63 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.55 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.64 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.56 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.65 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.57 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.66 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.58 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.67 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.59 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.68 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.60 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.69 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.61 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.70 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.62 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.71 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.63 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.72 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.64 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.73 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.65 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.74 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.66 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.75 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.67 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.76 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.68 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.77 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.69 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.78 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		
5.10.70 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资	7.79 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资情况		