

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:兴业银行股份有限公司  
报告送出日期:2017年10月25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。

本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。

本报告期内财务资料未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

\$ 2 基金产品概况

基金简称 大摩利兴利18个月定期开放债券

基金主代码 003094

交易代码 003094

契约型开放式。本基金以定期开放方式运作，即采取在每个封闭期结束后开放一个开放期，在开放期内接受申购和赎回，本报告期内实现收益加上本期公允价值变动收益。

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。

本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。

本报告期内财务资料未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

\$ 3 主要财务指标

基金简称 大摩利兴利18个月定期开放债券

基金主代码 003094

交易代码 003094

契约型开放式。本基金以定期开放方式运作，即采取在每个封闭期结束后开放一个开放期，在开放期内接受申购和赎回，本报告期内实现收益加上本期公允价值变动收益。

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。

本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。

本报告期内财务资料未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

\$ 4 基金主要财务指标

基金简称 大摩利兴利18个月定期开放债券

基金主代码 003094

交易代码 003094

契约型开放式。本基金以定期开放方式运作，即采取在每个封闭期结束后开放一个开放期，在开放期内接受申购和赎回，本报告期内实现收益加上本期公允价值变动收益。

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。

本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。

本报告期内财务资料未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

\$ 5 主要财务指标

基金简称 大摩利兴利18个月定期开放债券

基金主代码 003094

交易代码 003094

契约型开放式。本基金以定期开放方式运作，即采取在每个封闭期结束后开放一个开放期，在开放期内接受申购和赎回，本报告期内实现收益加上本期公允价值变动收益。

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。

本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。

本报告期内财务资料未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

\$ 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债券投资明细

序号 代码 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 041769023 17国银CP001 600,000 50,210,000.00 8.06

2 136519 16深01 600,000 48,685,000.00 7.92

3 122346 15深01 490,000 47,632,900.00 7.69

4 112220 14深01 394,180 40,670,376.00 6.53

5 1390040 11化债06 400,000 40,524,000.00 6.51

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

序号 代码 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(%)

A 农、林、牧、渔业 - - -

B 采矿业 - - -

C 制造业 49,958,814,87 8.02

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 3,294,400,000 0.53

K 房屋建筑业 - - -

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 53,243,214,97 8.56

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十名证券投资基金情况

序号 代码 债券代码 债券名称 数量(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 132004 15国银债 269,640,000 0.04

2 应收证券款 - - -

3 应收股利 - - -

4 应收利息 10,007,095.14

5 应收申购款 - - -

6 其他应收款 - - -

7 待摊费用 - - -

8 其他 - - -

9 合计 10,099,339.20

8 报告期内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组合

序号 代码 债券代码 债券名称 数量(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600504 6.919,273.40 1.11

2 600503 269,640,000 0.04

3 600525 长园集团 150,901,312 0.20

4 002475 立昂视讯 149,301,307,546.40 0.50

5 601231 环旭电子 210,000,2,996,700.00 0.48

6 002186 华天科技 300,000,2,617,000.00 0.40

7 002856 申通快递 100,000,2,500,000.00 0.36

8 002188 丽珠集团 100,000,2,450,000.00 0.35

9 002187 乐歌股份 100,000,2,400,000.00 0.34

10 合计 591,523,769.60 9.60

9 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合

序号 代码 债券代码 债券名称 数量(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 132004 15国银债 269,640,000 0.04

2 600503 269,640,000 0.04

3 600525 长园集团 150,901,312 0.20

4 002475 立昂视讯 149,301,307,546.40 0.50

5 601231 环旭电子 210,000,2,996,700.00 0.48

6 002186 华天科技 300,000,2,617,000.00 0.40

7 002856 申通快递 100,000,2,450,000.00 0.35

8 002188 丽珠集团 100,000,2,400,000.00 0.34

9 002187 乐歌股份 100,000,2,400,000.00 0.34

10 合计 591,523,769.60 9.60

10 报告期内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组合

序号 代码 债券代码 债券名称 数量(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600504 6.919,273.40 1.11

2 600503 269,640,000 0.04

3 600525 长园集团 150,901,312 0.20

4 002475 立昂视讯 149,301,307,546.40 0.50

5 601231 环旭电子 210,000,2,996,700.00 0.48

6 002186 华天科技 300,000,2,617,000.00 0.40

7 002856 申通快递 100,000,2,450,000.00 0.35

8 002188 丽珠集团 100,000,2,400,000.00 0.34

9 002187 乐歌股份 100,000,2,400,000.00 0.34

10 合计 591,523,769.60 9.60

11 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合

序号 代码 债券代码 债券名称 数量(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 132004 15国银债 269,640,000 0.04

2 600503 269,640,000 0.04

3 600525 长园集团 150,901,312 0.20

4 002475 立昂视讯 149,301,307,546.40 0.50

5 601231 环旭电子 210,000,2,996,700.00 0.48

6 002186 华天科技 300,000,2,617,000.00 0.40

7 002856 申通快递 100,000,2,450,000.00 0.35

8 002188 丽珠集团 100,000,2,400,000.00 0.34

9 002187 乐歌股份 100,000,2,400,000.00 0.34

10 合计 591,523,769.60 9.60

12 报告期内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组合

序号 代码 债券代码 债券名称 数量(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600504 6.919,273.40 1.11