

摩根士丹利华鑫中债 1-3 年农发行债券指 数证券投资基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

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：浙商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 4 月 28 日（基金合同生效日）起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	15
§ 7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	35
7.6 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	35

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	36
7.8 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贵金属投资明细	36
7.9 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	36
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	36
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	36
7.12 投资组合报告附注	36
§ 8 基金份额持有人信息	37
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	37
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	37
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	37
§ 9 开放式基金份额变动	38
§ 10 重大事件揭示	38
10.1 基金份额持有人大会决议	38
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	38
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	38
10.4 基金投资策略的改变	38
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	38
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	38
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	39
10.8 其他重大事件	39
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	40
11.1 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	40
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	41
§ 12 备查文件目录	41
12.1 备查文件目录	41
12.2 存放地点	42
12.3 查阅方式	42

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	摩根士丹利华鑫中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金
基金简称	大摩中债 1-3 年农发行债券指数
基金主代码	010492
交易代码	010492
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 4 月 28 日
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	浙商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	100,296,215.64 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过指数化投资，争取获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	<p>1、本基金为指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标的指数的有效跟踪。</p> <p>2、债券指数化投资策略</p> <p>（1）债券投资组合的构建策略构建投资组合的过程主要分为三步：划分债券层级、筛选目标组合成份券和逐步调整建仓。一是划分债券层级，本基金根据债券的剩余期限将标的指数成份券划分层级，按照分层抽样的原理，确定各层级成份券及其权重；二是筛选目标组合成份券，分层完成后，本基金在各层级成份券内利用动态最优化或随机抽样等方法筛选出与各层级总体风险收益特征（例如久期、凸性等）相近的且流动性较好（主要考虑发行规模、日均成交金额、期间成交天数等指标）的个券组合，或部分投资于非成份券，以更好的实现对标的指数的跟踪；三是逐步建仓本基金将根据实际的市场流动性情况和市场投资机会逐步建仓。</p> <p>（2）债券投资组合的调整策略</p> <p>一是定期调整，基金管理人将每月评估投资组合整体以及各层级债券与标的指数的偏离情况，定期对投资组合进行调整，以确保组合总体特征与标的指数相似，并缩小跟踪误差。</p> <p>二是不定期调整，当发生较大的申购赎回、组合中债券派息、债券到期以及市场波动剧烈等情况，导致投资组合与标的指数出现偏离，本基金将综合考虑市场流动性、交易成本、偏离程度等因素，对投资组合进行不定期的动态调整以缩小跟踪误差。</p>
业绩比较基准	中债 1-3 年农发行债券指数收益率 \times 95% + 银行活期存款利率（税后） \times 5%。
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益理论上低于股票

	型基金、混合型基金，高于货币市场基金。 本基金为指数型基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的债券市场相似的风险收益特征。
--	--

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		摩根士丹利华鑫基金管理有限公司	浙商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	许菲菲	朱巍
	联系电话	(0755)88318883	0571-87659806
	电子邮箱	xxpl@msfunds.com.cn	zhuwei@czbank.com
客户服务电话		400-8888-668	95527
传真		(0755)82990384	0571-88268688
注册地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第二座第 17 层 01-04 室	杭州市萧山区鸿宁路 1788 号
办公地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第二座第 17 层	杭州市延安路 368 号
邮政编码		518048	310006
法定代表人		王鸿嫔	沈仁康

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.msfunds.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	摩根士丹利华鑫基金管理有限公司	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第二座 17 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年4月28日(基金合同生效日) - 2021年6月30日)
本期已实现收益	1,051,685.82
本期利润	1,201,034.20
加权平均基金份额本期利润	0.0035
本期加权平均净值利润率	0.35%
本期基金份额净值增长率	0.47%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)

期末可供分配利润	362,917.56
期末可供分配基金份额利润	0.0036
期末基金资产净值	100,767,065.59
期末基金份额净值	1.0047
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	0.47%

注：1. 本基金基金合同于 2021 年 4 月 28 日正式生效，截至报告期末未满半年。

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. 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，而非当期发生数）；

4. 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

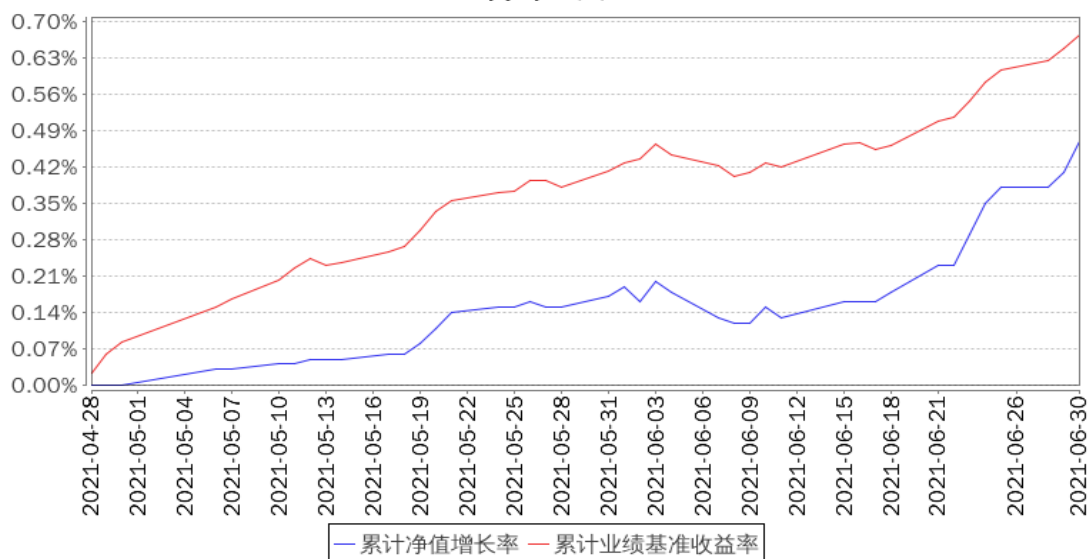
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.30%	0.03%	0.26%	0.02%	0.04%	0.01%
自基金合同生效起至今	0.47%	0.02%	0.67%	0.02%	-0.20%	0.00%

注：1、本基金基金合同于 2021 年 4 月 28 日正式生效，截至本报告期末未满一年；

2、按照本基金基金合同的规定基金管理人自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截至本报告期末，本基金仍处于建仓期。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

大摩中债1-3年农发行债券指数累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2021 年 4 月 28 日正式生效，截至本报告期末未满一年；

2、按照本基金基金合同的规定基金管理人自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截至本报告期末，本基金仍处于建仓期。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

摩根士丹利华鑫基金管理有限公司（以下简称“公司”）是一家中外合资基金管理公司，前身为经中国证监会证监基金字[2003]33 号文批准设立并于 2003 年 3 月 14 日成立的巨田基金管理有限公司。公司的主要股东包括摩根士丹利国际控股公司、华鑫证券有限责任公司等国内外机构。

截止 2021 年 6 月 30 日，公司旗下共管理 32 只开放式基金，其中股票型基金 4 只，混合型基金 16 只，指数型基金 3 只，债券型基金 9 只。同时，公司还管理着多个私募资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
施同亮	基金经理	2021 年 4 月 28 日	-	11 年	清华大学数学硕士。历任中信建投证券股份有限公司债券分析师，中银国际证券股份有限公司首席债券分析师。2014 年 12 月加入本公司，历任固定收益投资部信用分析师、基金经理助理，现任固定收益投资部

					基金经理。2017 年 1 月起担任摩根士丹利华鑫优质信价纯债债券型证券投资基金基金经理，2020 年 11 月起担任摩根士丹利华鑫丰裕 63 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，2021 年 4 月起担任摩根士丹利华鑫中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、基金经理的任职日期为基金合同生效之日；

2、基金经理的任职已按规定在中国证券投资基金业协会办理完毕基金经理注册；

3、证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对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利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及内部相关制度和流程，通过流程和系统控制保证有效实现公平交易管理要求，并通过对投资交易行为的监控和分析，确保基金管理人旗下各投资组合在研究、决策、交易执行等各方面均得到公平对待。本报告期，基金管理人严格执行各项公平交易制度及流程。

经对报告期内公司管理所有投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异，连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现异常情况。

4.3.2 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 5% 的情况，基金管理人未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，中国经济仍处于疫后修复阶段，国内局部地区的疫情对经济的影响总体比较有限。基数效应对全年经济的扰动加大，两年平均是衡量经济表现相对客观的方法，按此口径，前两个季度 GDP 同比增长分别为 5.0% 和 5.5%，处于在向潜在增速回归的过程中。生产端延续较为强势的表现，受益于国内全产业链和外需的提振，6 月工业增加值两年平均增长 6.5%，稳定在疫情前的

较高水平。需求端而言，消费恢复偏慢，6 月社零两年同比增长 4.9%，疫情造成就业和收入的结构冲击决定了消费的恢复较为波折，特别是餐饮、旅游等服务消费，预计是更为缓慢的过程。投资端是内需主要的支撑，6 月两年同比增长 5.7%，其中房地产投资维持韧性，销售面积持续高增，制造业受盈利恢复和政策支持保持缓慢恢复的趋势，基建受财政后置的影响持续低迷。应该说，上半年出口的表现较为超预期，6 月两年平均增速维持在 15%附近，前期对于海外供需缺口收敛替代我国出口的担忧并未兑现，外贸的优势又一次彰显。通胀方面，6 月 PPI 同比增长 8.8%，较 5 月有所回落，但通胀压力并未释放，CPI 同比增长 1.1%，核心 CPI 同比增长 0.9%，较疫情前仍有较大差距，PPI 与 CPI 裂口拉大，暂未出现通胀传导的迹象。政策上延续了不急转弯的总基调，社融在去年宽信用后出现自然回落，对经济的影响相对有限，货币和财政政策保持稳定，流动性维持较为充裕的状态。

本基金截至半年末仍处于建仓期。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期截至 2021 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.0047 元，份额累计净值为 1.0047 元，报告期内基金份额净值增长率为 0.47%，同期业绩比较基准收益率为 0.67%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年我国经济动能有弱化的迹象，出口订单回落，对于出口的传导预计偏缓慢，地产面临融资端的约束，地产企业的经营周转面临考验，但地产投资的韧性还在，所以经济暂时看不到失速下滑的风险。但经济结构性问题不容小觑，消费的恢复偏慢，中小企业受原材料成本挤压经营困难，也需要给与一定的政策扶持。通胀压力阶段性缓和，对货币政策的影响有限，但仍需对价格走向的演化保持警惕。而海外面临的问题更为复杂，变种病毒的蔓延还在继续，美国高通胀、低就业的两难问题也在考验美联储的货币政策，预计转向是个偏慢的过程，在这个过程中风险资产的波动可能加剧。国内债市独立性较高，在前期降准的刺激下，收益率快速下行，我们不认为现阶段有开启宽松周期的基础，目前位置处于偏低的历史分位数，如果没有流动性的再宽松，债市进一步下行的空间有限。同时上半年利率债供给缺位，下半年国债和地方债都面临较大的发行压力，易对流动性造成冲击。

本基金将坚持平衡收益与风险的原则，保持组合良好的流动性。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在

0.25%以上的，则及时就所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见。

本基金管理人设有基金估值委员会，委员会由主任委员（分管基金运营部的公司领导）以及相关成员（包括研究管理部负责人、基金运营部负责人、基金会计、风险管理部及监察稽核部相关业务人员）构成。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会的相关人员均具有一定年限的专业从业经验，具有良好的专业能力，并能在相关工作中保持独立性。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和估值方法的最终决策和日常估值的执行。

由于基金经理、相关投资研究人员、债券信用分析师对特定投资品种的估值有深入的理解，经估值委员会主任委员同意，在需要时可以列席估值委员会会议并提出估值建议，估值委员会对特定品种估值方法需经委员充分讨论后确定。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、基金合同的相关规定以及本基金的实际运作情况，本基金本报告期未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对摩根士丹利华鑫中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，摩根士丹利华鑫中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金的管理人——摩根士丹利华鑫基金管理有限公司在摩根士丹利华鑫中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的

行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，摩根士丹利华鑫中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对摩根士丹利华鑫基金管理有限公司编制和披露的摩根士丹利华鑫中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金 2021 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了复核，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：摩根士丹利华鑫中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	2,064,173.29
结算备付金		5,028,333.33
存出保证金		8,088.18
交易性金融资产	6.4.7.2	114,871,500.00
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		114,871,500.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	826,673.13
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		122,798,767.93
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-

卖出回购金融资产款		21,944,847.08
应付证券清算款		-
应付赎回款		4,006.70
应付管理人报酬		20,223.47
应付托管费		6,741.16
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	4,188.84
应交税费		-
应付利息		11,494.38
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	40,200.71
负债合计		22,031,702.34
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	100,296,215.64
未分配利润	6.4.7.10	470,849.95
所有者权益合计		100,767,065.59
负债和所有者权益总计		122,798,767.93

注：1. 报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0047 元，基金份额总额 100,296,215.64 份。

2. 本基金基金合同生效日为 2021 年 4 月 28 日，2021 年半年度实际报告期间为 2021 年 4 月 28 日至 2021 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.2 利润表

会计主体：摩根士丹利华鑫中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金

本报告期：2021 年 4 月 28 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 4 月 28 日（基金合同 生效日）至 2021 年 6 月 30 日
一、收入		1,390,946.27
1. 利息收入		1,188,315.37
其中：存款利息收入	6.4.7.11	119,250.04
债券利息收入		693,754.93
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		375,310.40
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		53,178.10
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-

基金投资收益	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	53,178.10
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	149,348.38
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	104.42
减：二、费用		189,912.07
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	88,135.10
2. 托管费	6.4.10.2.2	29,378.38
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	2,860.28
5. 利息支出		28,937.60
其中：卖出回购金融资产支出		28,937.60
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.20	40,600.71
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,201,034.20
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,201,034.20

注：本基金基金合同生效日为 2021 年 4 月 28 日，2021 年半年度实际报告期间为 2021 年 4 月 28 日至 2021 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：摩根士丹利华鑫中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金

本报告期：2021 年 4 月 28 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 4 月 28 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	500,404,979.36	-	500,404,979.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,201,034.20	1,201,034.20
三、本期基金份额交易产生的基	-400,108,763.72	-730,184.25	-400,838,947.97

金净值变动数 (净值减少以 “-”号填列)			
其中: 1. 基金申 购款	114,447.12	204.96	114,652.08
2. 基金赎 回款	-400,223,210.84	-730,389.21	-400,953,600.05
四、本期向基金 份额持有人分配 利润产生的基金 净值变动(净值 减少以“-”号填 列)	-	-	-
五、期末所有者 权益(基金净值)	100,296,215.64	470,849.95	100,767,065.59

注: 本基金基金合同生效日为 2021 年 4 月 28 日, 2021 年半年度实际报告期间为 2021 年 4 月 28 日至 2021 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年, 本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

王鸿斌

邓寰乐

谢先斌

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

摩根士丹利华鑫中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]第 2535 号《关于准予摩根士丹利华鑫中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金注册的批复》核准, 由摩根士丹利华鑫基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《摩根士丹利华鑫中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式, 存续期限不定, 首次设立募集不包括认购资金利息共募集 500,404,875.86 元, 业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第 0438 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案, 《摩根士丹利华鑫中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金基金合同》于 2021 年 4 月 28 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 500,404,979.36 份基金份额, 其中认购资金利息折合 103.50 份基金份额。本基金的基金管理人为摩根士丹利华鑫基金管理有限公司, 基金托管人为浙商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《摩根士丹利华鑫中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，为更好实现投资目标，还可以投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的国债、政策性金融债、债券回购、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于待偿期 1-3 年（含 1 年和 3 年）的标的指数成份券和备选成份券的比例不得低于非现金基金资产的 80%。本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中债 1-3 年农发行债券指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《摩根士丹利华鑫中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金基金合同》和的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年 4 月 28 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 4 月 28 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2021 年 4 月 28 日(基金合同生效日)起至 2021 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款

项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不

活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》提供的现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以利息及

利息性质的收入为销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖债券的差价收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

(4)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
活期存款	2,064,173.29
定期存款	-
其中:存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	2,064,173.29

6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	5,006,911.10	5,003,500.00
	银行间市场	109,715,240.52	109,868,000.00
	合计	114,722,151.62	114,871,500.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	114,722,151.62	114,871,500.00	149,348.38

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	205.47
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2,262.70
应收债券利息	824,201.36
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	3.60
合计	826,673.13

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	4,188.84
合计	4,188.84

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-

预提费用	31,387.20
应付指数使用费	8,813.51
合计	40,200.71

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 4 月 28 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	500,404,979.36	500,404,979.36
本期申购	114,447.12	114,447.12
本期赎回（以“-”号填列）	-400,223,210.84	-400,223,210.84
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	100,296,215.64	100,296,215.64

注：1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 本基金自 2021 年 4 月 9 日至 2021 年 4 月 26 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 500,404,875.86 元。根据《摩根士丹利华鑫中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 103.50 元在本基金成立后，折算为 103.50 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

3. 根据《摩根士丹利华鑫中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金基金合同》、《摩根士丹利华鑫中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金招募说明书》及《摩根士丹利华鑫中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金开放日常申购(赎回、转换、定期定额投资)业务公告》的相关规定，本基金于 2021 年 4 月 28 日(基金合同生效日)至 2021 年 5 月 30 日止期间暂不向投资人开放，基金交易申购、赎回、转换和定期定额投资业务自 2021 年 5 月 31 日起开始办理。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	1,051,685.82	149,348.38	1,201,034.20
本期基金份额交易产生的变动数	-688,768.26	-41,415.99	-730,184.25
其中：基金申购款	222.22	-17.26	204.96
基金赎回款	-688,990.48	-41,398.73	-730,389.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	362,917.56	107,932.39	470,849.95

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年4月28日（基金合同生效日）至2021年6月30日
活期存款利息收入	58,734.59
定期存款利息收入	52,500.00
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	7,995.60
其他	19.85
合计	119,250.04

6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2021年4月28日（基金合同生效日）至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	53,178.10
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	53,178.10

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年4月28日（基金合同生效日）至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	221,900,199.78
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	220,283,087.18
减：应收利息总额	1,563,934.50
买卖债券差价收入	53,178.10

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021 年 4 月 28 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	149,348.38
股票投资	-
债券投资	149,348.38
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	149,348.38

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 4 月 28 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	104.42
合计	104.42

注：本基金的赎回费用按基金份额持有人持有时间的增加而递减。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。本基金赎回费全额计入基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 4 月 28 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	85.28
银行间市场交易费用	2,775.00
合计	2,860.28

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 4 月 28 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	15,484.16
信息披露费	12,903.04
证券出借违约金	-
债券账户维护费	3,000.00
指数使用费	8,813.51
其他	400.00
合计	40,600.71

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.015% 的年费率计提，逐日累计，按季支付。从基金成立的第二季度起，标的指数许可使用费的收取下限为每季度（自然季度）人民币 50,000 元。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
摩根士丹利华鑫基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
浙商银行股份有限公司（“浙商银行”）	基金托管人、基金销售机构
-	-

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的交易。本基金基金合同于 2021 年 4 月 28 日正式生效，无上年度可比期间数据。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 4 月 28 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	88,135.10
其中：支付销售机构的客户维护费	13,252.90

注：1. 支付基金管理人摩根士丹利华鑫基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

2. 本基金基金合同于 2021 年 4 月 28 日正式生效，无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 4 月 28 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	29,378.38

注：1. 支付基金托管人浙商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.05% / 当年天数。

2. 本基金基金合同于 2021 年 4 月 28 日正式生效，无上年度可比期间数据。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。本基金基金合同于 2021 年 4 月 28 日正式生效，无上年度可比期间数据。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

本基金本报告期末与关联方进行证券出借业务。本基金基金合同于 2021 年 4 月 28 日正式生效，无上年度可比期间数据。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况，本基金基金合同于 2021 年 4 月 28 日正式生效，无上年度可比期间数据。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末基金管理人之外的其他关联方未投资本基金，本基金基金合同于 2021 年 4 月 28 日正式生效，无上年度可比期间数据。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 4 月 28 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
浙商银行	2,064,173.29	58,734.59

注：本基金的银行存款由基金托管人浙商银行保管，按银行同业利率计息。本基金基金合同于 2021 年 4 月 28 日正式生效，无上年度可比期间数据。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。本基金基金合同于 2021 年 4 月 28 日正式生效，无上年度可比期间数据。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。本基金基金合同于 2021 年 4 月 28 日正式生效，无上年度可比期间数据。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末(2021 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 21,944,847.08 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
------	------	-------	--------	-------	--------

160417	16 农发 17	2021 年 7 月 2 日	101.24	231,000	23,386,440.00
合计				231,000	23,386,440.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型基金，其长期预期风险和预期收益水平低于股票型、混合型基金，高于货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的债券市场相似的风险收益特征。本基金在日常经营活动中面临的与金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任，其下设的风险控制和审计委员会负责制定风险管理政策，检查公司和基金运作的合法合规情况；公司经营层对内部控制制度的有效执行承担责任，其下设的风险管理委员会负责讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；督察长监督检查基金和公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况；监察稽核部、风险管理部分工负责风险监督与控制，前者负责合规风险管理，后者主要负责操作风险和基金投资的信用风险、市场风险以及流动性风险的监督管理；基金经理、投资总监以及投资决策委员会负责对基金投资业务风险进行直接管理。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款

存放在本基金的托管行浙商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	5,003,500.00
合计	5,003,500.00

注：本基金持有的未评级的债券为国债。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日
AAA	0.00
AAA 以下	0.00
未评级	109,868,000.00
合计	109,868,000.00

注：本基金持有的未评级的债券为政策银行债。

6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日
AAA	0.00
AAA 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2021 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例未超过 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2021 年 6 月 30 日，本基金最近工作日确认的净赎回金额未超过组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿

透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,064,173.29	-	-	-	2,064,173.29
结算备付金	5,028,333.33	-	-	-	5,028,333.33
存出保证金	8,088.18	-	-	-	8,088.18
交易性金融资产	5,003,500.00	109,868,000.00	-	-	114,871,500.00
应收利息	-	-	-	826,673.13	826,673.13
资产总计	12,104,094.80	109,868,000.00	-	826,673.13	122,798,767.93
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,006.70	4,006.70
应付管理人报酬	-	-	-	20,223.47	20,223.47
应付托管费	-	-	-	6,741.16	6,741.16
卖出回购金融资产款	21,944,847.08	-	-	-	21,944,847.08
应付交易费用	-	-	-	4,188.84	4,188.84
应付利息	-	-	-	11,494.38	11,494.38
其他负债	-	-	-	40,200.71	40,200.71

负债总计	21,944,847.08	-	-	86,855.26	22,031,702.34
利率敏感度缺口	-9,840,752.28	109,868,000.00	-	739,817.87	100,767,065.59

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2021年6月30日）
分析	市场利率上升 25 个基点	-530,410.00
	市场利率下降 25 个基点	533,931.00

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券，因此无重大其他价格风险。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日, 本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 114,871,500.00 元, 无属于第一层与第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券, 若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况, 本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次; 并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度, 确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 6 月 30 日, 本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债, 其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外, 截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位: 人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中: 股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	114,871,500.00	93.54
	其中: 债券	114,871,500.00	93.54
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	7,092,506.62	5.78

8	其他各项资产	834,761.31	0.68
9	合计	122,798,767.93	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

根据本基金基金合同规定，本基金不参与股票投资。

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

根据本基金基金合同规定，本基金不参与股票投资。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

根据本基金基金合同规定，本基金不参与股票投资。

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

根据本基金基金合同规定，本基金不参与股票投资。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

根据本基金基金合同规定，本基金不参与股票投资。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	5,003,500.00	4.97
2	央行票据	-	-
3	金融债券	109,868,000.00	109.03
	其中：政策性金融债	109,868,000.00	109.03
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	114,871,500.00	114.00

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	092118002	21 农发清发 02	400,000	40,140,000.00	39.83
2	200202	20 国开 02	400,000	39,356,000.00	39.06
3	160417	16 农发 17	300,000	30,372,000.00	30.14
4	019649	21 国债 01	50,000	5,003,500.00	4.97

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

根据本基金基金合同规定，本基金不参与资产支持证券投资。

7.8 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贵金属投资明细

根据本基金基金合同规定，本基金不参与贵金属投资。

7.9 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

根据本基金基金合同规定，本基金不参与权证投资。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

根据本基金基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体除国家开发银行外，其余的没有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。

2020 年 12 月，中国银行保险监督管理委员会发布《中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表》（银保监罚决字〔2020〕67 号）对国家开发银行为违规的政府购买服务项目提供融资等违法违规行为，处以罚款。

本基金投资 20 国开 02（200202）决策流程符合本基金管理人投资管理制度的相关规定。针对上述情况，本基金管理人进行了分析和研究，认为上述事件对 20 国开 02 的投资价值未造成实质性影响。本基金管理人将继续对上述公司进行跟踪研究。

7.12.2 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

根据本基金基金合同规定，本基金不参与股票投资。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	8,088.18
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	826,673.13
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	834,761.31

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

根据本基金基金合同规定，本基金不参与可转债投资。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

根据本基金基金合同规定，本基金不参与股票投资。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

根据本基金基金合同规定，本基金不参与股票投资。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
183	548066.75	99,999,000.00	99.70	297,215.64	0.30

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	50,997.39	0.0508

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021 年 4 月 28 日） 基金份额总额	500,404,979.36
基金合同生效日起至报告期期末基金 总申购份额	114,447.12
减：基金合同生效日起至报告期期末基 金总赎回份额	400,223,210.84
基金合同生效日起至报告期期末基金 拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	100,296,215.64

注：本基金基金合同于 2021 年 4 月 28 日正式生效。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人的重大人事变动如下：

2021 年 5 月 26 日，基金管理人法定代表人变更为总经理王鸿嫔女士。基金管理人于 2021 年 5 月 28 日公告了上述事项。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金未改变投资策略。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国盛证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 专用交易单元的选择标准

- (1) 实力雄厚，信誉良好；
- (2) 财务状况良好，经营行为规范；
- (3) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- (5) 研究实力较强，能及时、定期、全面地为本基金提供研究服务；
- (6) 为基金份额持有人提供高水平的综合服务。

2. 基金管理人根据以上标准进行考察后确定合作券商。基金管理人与被选择的证券经营机构签订《专用证券交易单元租用协议》，报证券交易所办理交易单元相关租用手续。

3. 本报告期内，本基金的所有交易单元均为新增的交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国盛证券	84,307,873.60	100.00%	1,135,700,000.00	100.00%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	本基金基金合同及招募说明书提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021年4月6日
2	本基金托管协议	中国证监会规定报刊及	2021年4月6日

		网站	
3	本基金基金份额发售公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 4 月 6 日
4	本基金基金产品资料概要	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 4 月 6 日
5	本基金基金合同	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 4 月 6 日
6	本基金招募说明书	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 4 月 6 日
7	关于本基金增加部分销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 4 月 9 日
8	本公司关于旗下基金参加东方财富证券认购费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 4 月 19 日
9	关于本基金增加招商银行股份有限公司招赢通平台为销售机构并参与认购费率优惠的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 4 月 26 日
10	关于本基金提前结束募集的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 4 月 27 日
11	本基金基金合同生效公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 4 月 29 日
12	本公司关于直销网上交易停止受理工行直连支付渠道认购、申购及定期定额投资业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 5 月 25 日
13	本基金开放日常申购（赎回、转换、定期定额投资）业务公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 5 月 27 日
14	本基金参与部分销售机构费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 5 月 27 日
15	本公司关于法定代表人变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 5 月 28 日
16	本公司关于旗下部分基金参与部分销售机构费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 6 月 8 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)

机构	1	2021年6月2日-2021年6月30日	0	99,999,000.00	0	99,999,000.00	99.70
	2	2021年6月2日-2021年6月10日	0	100,000,000.00	100,000,000.00	0	0
	3	2021年6月2日-2021年6月3日	0	99,999,000.00	99,999,000.00	0	0

产品特有风险

本基金存在单一投资者持有基金份额占比较大的情形。本基金属于开放式基金，在本基金存续期间，若上述投资者集中大额赎回本基金，可能会发生巨额赎回的情形，本基金投资者可能会面临以下风险：

1. 基金份额净值波动风险

由于我国证券市场的波动性较大，在市场价格下跌时会出现交易量急剧减少的情形，此时若出现巨额赎回可能会导致基金资产变现困难，从而产生流动性风险，甚至影响基金份额净值。此外，当出现巨额赎回时，因基金运作特点导致的费用计提、计入基金资产的赎回费以及基金持仓证券价格波动等因素，也可能会影响基金份额净值，极端情况下可能会造成基金份额净值的大幅波动。

2. 无法赎回基金的流动性风险

当发生巨额赎回时，根据《基金合同》的约定，基金管理人可能决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能暂停接受基金的赎回申请，投资人将面临无法及时赎回所持有基金份额的风险。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

截至 2021 年 8 月 19 日，本基金已连续 45 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人，可能触发基金合同终止情形。基金管理人已分别于 2021 年 7 月 30 日、2021 年 8 月 13 日、2021 年 8 月 20 日针对本基金可能触发基金合同终止情形于规定媒介披露《关于摩根士丹利华鑫中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告》、《关于摩根士丹利华鑫中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金可能触发基金合同终止情形的第二次提示性公告》、《关于摩根士丹利华鑫中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金可能触发基金合同终止情形的第三次提示性公告》。敬请投资者关注相关风险。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予本基金注册的批复文件；
- 2、本基金基金合同；
- 3、本基金托管协议；
- 4、本基金招募说明书；

- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内在规定媒介上披露的各项公告。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

12.3 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。

摩根士丹利华鑫基金管理有限公司

2021 年 8 月 27 日