

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:中国人保资产管理股份有限公司
报告日期:2019年8月23日

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责任。
基金托管人:中国人保资产管理股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报表和基金净值等信息,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

2.1 基金基本情况
基金名称:摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金
基金代码:000163
基金管理人:摩根士丹利华鑫基金管理有限公司

2.2 基金产品说明
基金的投资目标:本基金主要投资于国内基础行业上市公司股票,为基金份额持有人谋求长期资本增值。
基金的投资策略:本基金采取自上而下的资产配置,结合自下而上的个股精选,形成投资组合。
基金的风险收益特征:本基金为证券投资基金中的中高风险品种,预期风险收益水平高于债券型基金,低于股票型基金。

2.3 基金管理人及基金托管人
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:中国人保资产管理股份有限公司
基金管理人地址:深圳市福田区福安街1号

2.4 信息披露方式
基金管理人网站:www.mofund.com
基金年度报告全文的存放地点:基金管理人、基金托管人处

3 主要会计数据和财务指标
3.1 主要财务指标
本期利润总额:10,877,603.48
本期净利润:23,296,408.53
期末净资产:1,160,287,779.83

3.2 基金净值表现
截至2019年6月30日,本基金份额净值为1.0219元,较年初增长2.19%。
本基金成立以来累计净值增长率为5.54%,同期业绩比较基准收益率为4.56%。

3.3 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。
本基金的投资目标是:在严格控制风险的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

3.4 基金管理人及基金托管人
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:中国人保资产管理股份有限公司

3.5 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。
本基金的投资目标是:在严格控制风险的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

3.6 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。
本基金的投资目标是:在严格控制风险的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

3.7 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。
本基金的投资目标是:在严格控制风险的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

3.8 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。
本基金的投资目标是:在严格控制风险的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

3.9 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。
本基金的投资目标是:在严格控制风险的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

3.10 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。
本基金的投资目标是:在严格控制风险的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

3.11 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。
本基金的投资目标是:在严格控制风险的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

3.12 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。
本基金的投资目标是:在严格控制风险的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

3.13 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。
本基金的投资目标是:在严格控制风险的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

3.14 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。
本基金的投资目标是:在严格控制风险的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

3.15 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。
本基金的投资目标是:在严格控制风险的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

3.16 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。
本基金的投资目标是:在严格控制风险的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

3.17 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。
本基金的投资目标是:在严格控制风险的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

3.18 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。
本基金的投资目标是:在严格控制风险的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

3.19 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。
本基金的投资目标是:在严格控制风险的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

3.20 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。
本基金的投资目标是:在严格控制风险的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

3.21 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。
本基金的投资目标是:在严格控制风险的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

3.22 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。
本基金的投资目标是:在严格控制风险的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

3.23 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。
本基金的投资目标是:在严格控制风险的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

3.24 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。
本基金的投资目标是:在严格控制风险的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

3.25 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。
本基金的投资目标是:在严格控制风险的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

3.26 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。
本基金的投资目标是:在严格控制风险的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

3.27 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。
本基金的投资目标是:在严格控制风险的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

3.28 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。
本基金的投资目标是:在严格控制风险的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

3.29 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。
本基金的投资目标是:在严格控制风险的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

3.30 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。
本基金的投资目标是:在严格控制风险的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

3.31 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。
本基金的投资目标是:在严格控制风险的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

3.32 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。
本基金的投资目标是:在严格控制风险的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

3.33 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。
本基金的投资目标是:在严格控制风险的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

3.34 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。
本基金的投资目标是:在严格控制风险的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金

2019 半年度 报告摘要

2019年6月30日

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二十人或者基金资产净值低于五万元的情况。

5.1 报告期内本基金托管人遵守情况
本报告期,中国光大银行股份有限公司(下称“托管人”)按照《证券投资基金法》、《证券投资基金托管业务管理办法》及相关法律法规、基金合同、托管协议等的规定,依法安全保管了基金的全部资产,对基金的投资运作进行了全面的会计核算和估值核算,未发现任何违法违规事项。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵信合规、净值信息、利润分配等情况的说明
本报告期,中国光大银行股份有限公司(下称“托管人”)按照《证券投资基金法》、《证券投资基金托管业务管理办法》及相关法律法规、基金合同、托管协议等的规定,依法安全保管了基金的全部资产,对基金的投资运作进行了全面的会计核算和估值核算,未发现任何违法违规事项。

5.3 托管人对报告期内本基金投资运作遵信合规、净值信息、利润分配等情况的说明
本报告期,中国光大银行股份有限公司(下称“托管人”)按照《证券投资基金法》、《证券投资基金托管业务管理办法》及相关法律法规、基金合同、托管协议等的规定,依法安全保管了基金的全部资产,对基金的投资运作进行了全面的会计核算和估值核算,未发现任何违法违规事项。

6.1 资产负债表
单位:人民币元
资产 负债和所有者权益
流动资产 31,596,522.16 39,431,648.48
非流动资产 106,463,173.13 120,651,931.91

6.2 利润表
单位:人民币元
项目 本期 上期
营业收入 127,900,605.36 145,485,000.10
营业支出 127,900,605.36 145,485,000.10

6.3 所有者权益变动表
单位:人民币元
项目 本期 上期
所有者权益 127,900,605.36 145,485,000.10

6.4 现金流量表
单位:人民币元
项目 本期 上期
经营活动产生的现金流量 470,594,007.17 1,366,466.75

6.5 主要财务指标
单位:人民币元
项目 本期 上期
期末净资产 1,160,287,779.83 1,137,992,371.31

6.6 基金份额持有人数量及持有基金份额情况
截至2019年6月30日,本基金份额持有人数量为1,160,287,779.83份。

6.7 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。

6.8 基金管理人及基金托管人
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:中国人保资产管理股份有限公司

6.9 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。

6.10 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。

6.11 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。

6.12 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。

6.13 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。

6.14 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。

6.15 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。

6.16 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。

6.17 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。

6.18 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。

6.19 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。

6.20 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。

6.21 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。

6.22 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。

6.23 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。

6.24 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。

6.25 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。

6.26 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。

6.27 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。

6.28 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。

6.29 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。

6.30 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。

6.31 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。

6.32 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。

6.33 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。

注:买入金额“按买卖成交金额-成交佣金”或“成交数量”孰低,不考虑相关交易费用。
7.4.2 买入金额“按买卖成交金额-成交佣金”或“成交数量”孰低,不考虑相关交易费用。

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 公允价值占净值比例(%)

注:上述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。
6.4.8 本报告期及上年度可比期间内未发生关联方交易。
6.4.8.1 关联方披露
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 本期, 上期

注:关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。
6.4.8.1.2 基金托管费
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 本期, 上期

注:关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。
6.4.8.1.3 基金托管费
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 本期, 上期

注:关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。
6.4.8.1.4 基金托管费
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 本期, 上期

注:关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。
6.4.8.1.5 基金托管费
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 本期, 上期

注:关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。
6.4.8.1.6 基金托管费
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 本期, 上期

注:关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。
6.4.8.1.7 基金托管费
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 本期, 上期

注:关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。
6.4.8.1.8 基金托管费
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 本期, 上期

注:关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。
6.4.8.1.9 基金托管费
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 本期, 上期

注:关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。
6.4.8.1.10 基金托管费
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 本期, 上期

注:关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。
6.4.8.1.11 基金托管费
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 本期, 上期

注:关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。
6.4.8.1.12 基金托管费
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 本期, 上期

注:关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。
6.4.8.1.13 基金托管费
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 本期, 上期

注:关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。
6.4.8.1.14 基金托管费
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 本期, 上期

注:关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。
6.4.8.1.15 基金托管费
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 本期, 上期

注:关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。
6.4.8.1.16 基金托管费
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 本期, 上期

注:关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。
6.4.8.1.17 基金托管费
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 本期, 上期

注:关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。
6.4.8.1.18 基金托管费
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 本期, 上期

注:关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。
6.4.8.1.19 基金托管费
单位:人民币元

注:关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。
6.4.8.1.20 基金托管费
单位:人民币元