

摩根士丹利华鑫货币市场基金清算报告

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：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二零一五年二月七日

一、重要提示

摩根士丹利华鑫货币市场基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监许可【2006】120号文核准募集，于2006年8月17日成立并正式运作，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据市场环境变化，为保护基金份额持有人的利益，基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《摩根士丹利华鑫货币市场基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，提议终止《基金合同》。

摩根士丹利华鑫货币市场基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，大会投票表决起止时间为2014年12月24日起至2015年1月19日17:00止。2015年1月20日，在本基金的基金托管人交通银行股份有限公司授权代表的监督下，本基金管理人对本次大会表决进行了计票，上海市通力律师事务所对计票过程进行了见证，北京市方正公证处对计票过程及结果进行了公证。会议审议并通过了《关于终止摩根士丹利华鑫货币市场基金基金合同有关事项的议案》，决定终止《基金合同》。基金份额持有人大会的表决结果及决议生效的公告详见刊登在2015年1月21日《上海证券报》和基金管理人网站（<http://www.msfnfunds.com.cn>）上的《摩根士丹利华鑫基金管理有限公司关于摩根士丹利华鑫货币市场基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

本基金从1月22日起进入清算期，由基金管理人摩根士丹利华鑫基金管理有限公司、基金托管人交通银行股份有限公司、普华永道

中天会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

二、基金概况

1、基金名称：摩根士丹利华鑫货币市场基金（基金简称：大摩货币，基金代码：163303）

2、基金运作方式：契约型开放式

3、基金合同生效日：2006年8月17日

4、2015年1月22日基金份额总额：47,087,675.40份。

5、投资目标：在力争本金安全和保证资产高流动性的前提下，追求高于业绩比较基准的收益率。

6、投资策略：本基金主要为投资人提供短期现金管理工具，最主要的投资策略是，通过优化以久期为核心的资产配置和品种选择，在保证安全性和流动性的前提下，最大限度地提升基金资产的收益。

7、业绩比较基准：一年期银行定期储蓄存款的税后利率=（1-利息税率）×一年期银行定期储蓄存款利率

8、风险收益特征：本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种，预期风险和预期收益都低于债券基金、混合基金和股票基金。

9、基金管理人：摩根士丹利华鑫基金管理有限公司

10、基金托管人：交通银行股份有限公司

三、基金运作情况概述

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[2006]120 号文《关于核准摩根士丹利华鑫货币市场基金募集的批复》核准，由基金管理人摩根士丹利华鑫基金管理有限公司于 2006 年 8 月 1 日至 2006 年 8 月 11 日向社会公开发行募集，基金合同于 2006 年 8 月 17 日正式生效，首次设立募集规模为 1,332,065,230.28 份基金份额。自 2006 年 8 月 17 日至 2015 年 1 月 21 日期间，本基金按基金合同正常运作。

为适应市场环境变化，保护基金份额持有人的利益，基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《基金合同》的有关规定，提议终止《基金合同》。本基金基金份额持有人大会于 2014 年 12 月 24 日起至 2015 年 1 月 19 日 17:00 以通讯方式召开，会议审议并通过了《关于终止摩根士丹利华鑫货币市场基金基金合同有关事项的议案》，决定按照《关于终止摩根士丹利华鑫货币市场基金基金合同有关事项议案的说明》规定，终止《基金合同》。本基金从 2015 年 1 月 22 日起进入清算期。

四、财务报表

经审计的资产负债表

会计主体：摩根士丹利华鑫货币市场基金

报告截止日：2015年1月21日

单位：人民币元

资产	最后运作日 2015年1月21日
资产：	
银行存款	1,609,213.76
结算备付金	46,000,000.00
应收利息	53,591.20
资产总计	47,662,804.96
负债：	
应付赎回款	307,258.45
应付管理人报酬	11,212.50
应付托管费	3,397.69
应付销售服务费	8,494.32
应付交易费用	175.00
应付利润	39,349.71
其他负债	75,000.00
负债合计	444,887.67
所有者权益：	
实收基金	47,217,917.29
未分配利润	-
所有者权益合计	47,217,917.29
负债和所有者权益总计	47,662,804.96

五、基金财产分配

1、清算费用

按照《摩根士丹利华鑫货币市场基金基金合同》第十八部分“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的规定，清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

考虑到本基金清算的实际情况，从保护基金份额持有人利益的角度出发，本基金的清算费用将由基金管理人代为支付。

2、资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、2015年1月21日所有者权益	47,217,917.29
加：清算期间净收益	36,768.81
加：应付利润未结转余额	39,349.71
减：基金净赎回金额 (于2015年1月22日确认的投资者赎回申请)	(130,350.36)
二、2015年1月30日所有者权益	47,163,685.45

资产处置及负债清偿后，于2015年1月30日本基金剩余财产为人民币47,163,685.45元，根据本基金的《基金合同》约定，依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

本基金清算期为自2015年1月22日至2015年2月9日，清算小组决定于2015年2月9日将基金剩余财产划出托管户进行分配，因此，自清算起始日2015年1月22日至2015年2月8日之间的利息归份额持有人所有。截至2015年2月8日止的应收利息以当前适用的利率预估为91,239.68元，由基金管理人以自有资金垫付并于2015年1月30日划入托管账户，基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

截至2015年1月30日止，经基金管理人以及基金托管人确认，本基金托管账户银行存款余额为人民币1,164,675.45元，其中人民币91,239.68元为基金管理人代垫的自2014年12月21日至2015年2月8日期间以当前适用的利率预估的银行存款和结算备付金及直销申购款的应收利息。基金管理人垫付资金以及垫付资金到账日起孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。

3、基金财产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。

六、备查文件

1、备查文件目录

(1) 摩根士丹利华鑫货币市场基金 2015 年 1 月 21 日（基金最后运作日）资产负债表及审计报告

(2) 《摩根士丹利华鑫货币市场基金清算报告》的法律意见

2、存放地点

基金管理人的办公场所。

3、查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅。

摩根士丹利华鑫货币市场基金基金财产清算小组

2015 年 1 月 30 日