

摩根士丹利华鑫多元兴利 18 个月定期开放债券型  
证券投资基金清算报告

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：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：二零一八年五月九日

## 一、重要提示

摩根士丹利华鑫多元兴利 18 个月定期开放债券型证券投资基金(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[2016]第 1554 号《关于准予摩根士丹利华鑫多元兴利 18 个月定期开放债券型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《摩根士丹利华鑫多元兴利 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集,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,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”中“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定:“在任一开放期的最后一日日终,如发生以下情形之一的,则无须召开基金份额持有人大会,本基金将于该日次一工作日起根据基金合同第十九部份的约定进行基金财产清算并终止:(1)基金资产净值加上当日有效申购申请金额及基金转换中转入申请金额扣除有效赎回申请金额及基金转换中转出申请金额后的余额低于 2 亿元;(2)基金份额持有人人数少于 200 人。”截至本基金首个开放期最后一日(即 2018 年 4 月 13 日)日终,本基金资产净值加上当日有效申购申请金额及基金转换中转入申请金额扣除有效赎回申请金额及基金转换中转出申请金额后的余额为 11,736,298.08 元,低于 2 亿元,已触发《基金合同》中约定的基金终止条款。为维护基金份额持有人的利益,根据《基金合同》有

关规定，无须召开基金份额持有人大会，本基金于 2018 年 4 月 16 日进入基金财产清算程序并终止。

本基金基金合同终止及基金财产清算安排详见刊登在 2018 年 4 月 17 日《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》和基金管理人网站（<http://www.msfn.com.cn>）上的《摩根士丹利华鑫多元兴利 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》。

本基金清算期自 2018 年 4 月 16 日起至 2018 年 5 月 4 日止，由基金管理人摩根士丹利华鑫基金管理有限公司、基金托管人兴业银行股份有限公司、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：摩根士丹利华鑫多元兴利 18 个月定期开放债券型证券投资基金

2、基金简称：大摩兴利 18 个月开放债券

3、基金代码：003094

4、基金运作方式：契约型开放式

5、基金合同生效日：2016 年 9 月 22 日

6、基金管理人：摩根士丹利华鑫基金管理有限公司

7、基金托管人：兴业银行股份有限公司

### 三、财务会计报告

#### 资产负债表（经审计）

会计主体：摩根士丹利华鑫多元兴利18个月定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2018年4月15日

单位：人民币元

| 资 产           | 2018 年 4 月 15 日<br>(基金最后运作日) |
|---------------|------------------------------|
| <b>资 产：</b>   |                              |
| 银行存款          | 30,997,269.71                |
| 结算备付金         | 2,204,764.82                 |
| 存出保证金         | 109,864.62                   |
| 应收利息          | 124,972.19                   |
| 应收申购款         | 99.94                        |
| 资产总计          | 33,436,971.28                |
| <b>负 债：</b>   |                              |
| 应付赎回款         | 16,655,453.28                |
| 应付管理人报酬       | 28,753.41                    |
| 应付托管费         | 5,391.27                     |
| 应付交易费用        | 9,597.01                     |
| 应交税金          | 60,955.15                    |
| 预提费用          | 173,917.65                   |
| 负债合计          | 16,934,067.77                |
| <b>所有者权益：</b> |                              |
| 实收基金          | 15,866,660.16                |
| 未分配利润         | 636,243.35                   |
| 所有者权益合计       | 16,502,903.51                |
| 负债和所有者权益总计    | 33,436,971.28                |

注：报告截止日 2018 年 4 月 15 日（基金最后运作日），基金份额净值 1.0401 元，基金份额总额 15,866,660.16 份。

#### 四、清盘事项说明

##### 1、基本情况

摩根士丹利华鑫多元兴利 18 个月定期开放债券型证券投资基金(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[2016]第 1554 号《关于准予摩根士丹利华鑫多元兴利 18 个月定期开放债券型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《摩根士丹利华鑫多元兴利 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金基金合同于 2016 年 9 月 22 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 600,547,593.77 份基金份额(含募集期间认购资金利息结转份额)。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,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,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《摩根士丹利华鑫多元兴利18个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国债、央行票据、金融债、企业债、中小企业私募债、公司债、地方政府债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、可转换债券(包括可交换债券)、可分离债券、质押及买断式回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具等固定收益类资产;股票、权证等权益类资产,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)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:本基

金投资于债券的比例不低于基金资产的80%，但在每次开放期前三个月、开放期及开放期结束后三个月的期间内，基金投资不受上述比例限制。本基金投资于权益类资产的比例不高于基金资产的20%。在开放期，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%，在封闭期，本基金不受该比例的限制。本基金的业绩比较基准为： $90\% \times \text{中证综合债券收益率} + 10\% \times \text{沪深300指数收益率}$ 。

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”中“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定：

“在任一开放期的最后一日日终，如发生以下情形之一的，则无须召开基金份额持有人大会，本基金将于该日次一工作日起根据基金合同第十九部分的约定进行基金财产清算并终止：

（1）基金资产净值加上当日有效申购申请金额及基金转换中转入申请金额扣除有效赎回申请金额及基金转换中转出申请金额后的余额低于 2 亿元；

（2）基金份额持有人人数少于 200 人。”

## 2、清算原因

截至本基金首个开放期最后一日（即 2018 年 4 月 13 日）日终，本基金资产净值加上当日有效申购申请金额及基金转换中转入申请金额扣除有效赎回申请金额及基金转换中转出申请金额后的余额为 11,736,298.08 元，低于 2 亿元，已触发《基金合同》中约定的基金终止条款。为维护基金份额持有人的利益，根据《基金合同》有关规定，

无须召开基金份额持有人大会,本基金于该日次一工作日进入基金财产清算程序并终止。

### 3、清算起始日

根据基金合同规定及《关于摩根士丹利华鑫多元兴利 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金清算起始日为 2018 年 4 月 16 日。

### 4、清算报表编制基础

本基金的清算报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》及《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制的。于 2018 年 4 月 15 日(基金最后运作日)，所有资产以可收回的金额与原账面价值孰低计量，负债以预计需要清偿的金额计量。由于报告性质所致，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

## 五、清算情况

自 2018 年 4 月 16 日至 2018 年 5 月 4 日止清算期间，基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

### 1、清算费用

按照《摩根士丹利华鑫多元兴利 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》第十九部分“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承担。

## 2、资产处置情况

（1）本基金最后运作日结算备付金人民币 2,204,764.82 元，该款项已于 2018 年 5 月 3 日划入托管账户。

（2）本基金最后运作日结算保证金人民币 109,864.62 元，该款项已于 2018 年 5 月 3 日划入托管账户。

（3）本基金最后运作日应收利息人民币 124,972.19 元，2018 年 4 月 16 日至本基金清算款划出日前一日的银行存款、结算备付金及结算保证金将按规定继续计提利息。

（4）本基金最后运作日应收申购款人民币 99.94 元，该款项已于 2018 年 4 月 16 日划入托管账户。

## 3、负债清偿情况

（1）本基金最后运作日应付赎回款为人民币 16,655,453.28 元，该款项已于 2018 年 4 月 16 日及 2018 年 4 月 17 日支付。

（2）本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 28,753.41 元，该款项已于 2018 年 4 月 17 日支付。

（3）本基金最后运作日应付托管费为人民币 5,391.27 元，该款项已于 2018 年 4 月 17 日支付。



（4）本基金最后运作日应付税费为人民币 60,955.15 元，该款项已于 2018 年 4 月 17 日支付。

（5）本基金最后运作日应付交易费用为人民币 9,597.01 元，该款项已于 2018 年 4 月 18 日支付。

（6）本基金最后运作日预提费用为人民币 173,917.65 元，为预提审计费用、信息披露费和债券账户维护费。其中预提 2017 年度审计费用 60,000.00 元已于 2017 年 4 月 24 日支付；预提 2018 年度审计费用 17,259.90 已于 2018 年 4 月 16 日做费用反冲处理，不由基金资产承担；预提的信息披露费 86,300.55 元已于 2018 年 5 月 4 日支付；预提的债券账户维护费 10,357.20 元已于 2018 年 4 月 18 日及 2018 年 4 月 27 日支付。

#### 4、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、2018年4月15日所有者权益                    | 16,502,903.51 |
| 加：清算期间净收益                            | 26,587.43     |
| 减：基金净赎回金额<br>（于2018年4月16日确认的投资者赎回申请） | 4,766,636.29  |
| 二、2018年5月4日所有者权益                     | 11,762,854.65 |

资产处置及负债清偿后，于 2018 年 5 月 4 日本基金剩余财产为人民币 11,762,854.65 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。

自本基金进入清算程序起至全部清算款划出前一日，本基金由银行存款、结算备付金及结算保证金产生的利息亦属份额持有人所有。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，截至清算款划出日前一日的应收利息由基金管理人以自有资金垫付，供清盘分配使用。基金管理人垫付的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。结息后将由基金托管人退还基金管理人，与之前预估数所产生的误差也由基金管理人承担。

#### 5、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) 摩根士丹利华鑫多元兴利 18 个月定期开放债券型证券投资基金 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 4 月 15 日(基金最后运作日)止期间的财务报表及审计报告

(2) 关于《摩根士丹利华鑫多元兴利 18 个月定期开放债券型证券投资基金清算报告》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。

摩根士丹利华鑫多元兴利 18 个月定期开放债券型证券投资基金

基金财产清算小组

2018 年 5 月 4 日