

摩根士丹利华鑫纯债稳定增值 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：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：二零二二年六月十六日

一、重要提示

摩根士丹利华鑫纯债稳定增值 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[2015]第 2016 号《关于准予摩根士丹利华鑫纯债稳定增值 18 个月定期开放债券型证券投资基金注册的批复》准予注册,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《摩根士丹利华鑫纯债稳定增值 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”或“《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,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

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:“基金合同生效后,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,基金合同将于该日次日终止并根据第十九部分的约定进行基金财产清算:(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。”截至本基金最近一个开放期最后一日(即2022年5月27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24,224,366.56元,低于2亿元,触发基金合同约定的前述终止条件。为维护基金份额持有人的利益,根据《基金

合同》有关规定，本基金于2022年5月28日进入基金财产清算程序，无须召开基金份额持有人大会。

本基金基金合同终止及基金财产清算安排详见本基金基金管理人于2022年5月28日披露的《摩根士丹利华鑫纯债稳定增值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2022年5月28日起至2022年6月15日止，由基金管理人摩根士丹利华鑫基金管理有限公司、基金托管人中国民生银行股份有限公司、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：摩根士丹利华鑫纯债稳定增值18个月定期开放债券型证券投资基金

2、基金简称：大摩增值18个月开放债券A/大摩增值18个月开放债券C

3、基金代码：001859/001860

4、基金运作方式：本基金为契约型开放式基金，以定期开放方式运作，即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。

5、基金合同生效日：2016年3月2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：中国民生银行股份有限公司

三、财务会计报告

资产负债表（经审计）

会计主体：摩根士丹利华鑫纯债稳定增值18个月定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2022年5月27日

单位：人民币元

资 产	2022年5月27日 (基金最后运作日)
资 产:	
银行存款	30,742,000.31
结算备付金	8,464,238.55
存出保证金	8,603.31
资产总计	39,214,842.17
负 债:	
应付赎回款	9,786,354.06
应付管理人报酬	74,554.96
应付托管费	21,301.41
应付销售服务费	5,488.34
应付交易费用	1,542.5
其他负债	78,758.16
负债合计	9,967,999.43
所有者权益:	
实收基金	23,986,116.11
未分配利润	5,260,726.63
所有者权益合计	29,246,842.74
负债和所有者权益总计	39,214,842.17

注：报告截止日 2022 年 5 月 27 日（基金最后运作日），大摩增值 18 个月开放债券 A 基金份额净值 1.228 元，基金份额总额 17,534,761.95 份；大摩增值 18 个月开放债券 C 基金份额净值 1.196 元，基金份额总

额 6,451,354.16 份。大摩增值 18 个月开放债券份额总额合计为 23,986,116.11 份。

四、清盘事项说明

1、基本情况

本基金经中国证监会证监许可[2015]第 2016 号《关于准予摩根士丹利华鑫纯债稳定增值 18 个月定期开放债券型证券投资基金注册的批复》准予注册，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《摩根士丹利华鑫纯债稳定增值 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 3 月 2 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,282,435,260.02 份（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，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《摩根士丹利华鑫纯债稳定增值 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，包括国内依法发行上市的国债、央行票据、金融债、企业债、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、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）。本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。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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。在封闭期，本基金不受上述 5% 的限制。本基金的业绩比较基准为： $1/2 \times [\text{同期1年期银行定期存款利率（税后）} + \text{同期2年期银行定期存款利率（税后）}]$ 。

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：

“基金合同生效后，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，基金合同将于该日次日终止并根据第十九部分的约定进行基金财产清算：

(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

截至本基金最近一个开放期最后一日（即 2022 年 5 月 27 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 24,224,366.56 元，低于 2 亿元，触发基金合同约定的前述终止条件。为维护基金份额持有人的利益，根据《基金合同》有关规定，本基金于 2022 年 5 月 28 日进入基金财产清算程序，无须召开基金份额持有人大会。

3、清算起始日

根据基金合同规定及《摩根士丹利华鑫纯债稳定增值 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 2022 年 5 月 28 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 2022 年 5 月 27 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 2022 年 5 月 28 日至 2022 年 6 月 15 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、资产处置情况（以本基金最后运作日各项余额为基数）

（1）银行存款为人民币 30,742,000.31 元，其中存储于基金托管人中国民生银行的活期存款为 30,690,836.58 元，应计活期存款利息 51,163.73 元，待实际划付清算款时，剩余应计活期存款利息由基金管理人摩根士丹利华鑫基金管理有限公司以自有资金垫付，供清盘分配使用，待回款后再返还基金管理人。

(2) 结算备付金为人民币 8,464,238.55 元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的结算备付金 8,454,210.53 元，已于 2022 年 6 月 2 日返还并划入托管账户；应计结算备付金利息 10,028.02 元，待实际划付清算款时，剩余应计结算备付金利息由基金管理人摩根士丹利华鑫基金管理有限公司以自有资金垫付，供清盘分配使用，待回款后再返还基金管理人。

(3) 结算保证金为人民币 8,603.31 元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司上海、深圳分公司的结算保证金 8,592.93 元，已于 2022 年 6 月 2 日返还并划入托管账户；应计结算保证金利息 10.38 元，待实际划付清算款时，剩余应计结算保证金利息由基金管理人摩根士丹利华鑫基金管理有限公司以自有资金垫付，供清盘分配使用，待回款后再返还基金管理人。

2、负债清偿情况（以本基金最后运作日各项余额为基数）

(1) 应付赎回款为人民币 9,786,354.06 元，其中应付赎回款为人民币 9,722,311.86 元，该款项已于 2022 年 5 月 30 日及 2022 年 5 月 31 日支付；应付转出款为人民币 64,042.20 元，该款项已于 2022 年 5 月 30 日支付。

(2) 应付管理人报酬为人民币 74,554.96 元，该款项已于 2022 年 6 月 2 日支付。

(3) 应付托管费为人民币 21,301.41 元，该款项已于 2022 年 6 月 2 日支付。

(4) 应付销售服务费为人民币 5,488.34 元，该款项已于 2022 年 6 月 2 日支付。

(5) 应付交易费用为人民币 1,542.50 元，该款项已于 2022 年 6 月 7 日支付。

(6) 其他负债为人民币 78,758.16 元，其中应付赎回费为人民币 915.13 元已于 2022 年 5 月 30 日及 2022 年 5 月 31 日支付，应付转出费为人民币 7.50 元已于 2022 年 5 月 30 日支付，银行间账户维护费为人民币 6,000.00 元已于 2022 年 6 月 7 日支付；其中预提信息披露费用为人民币 48,329.19 元待收到信息披露费发票后再行支付，应付审计费用为人民币 23,506.34 元待收到审计费发票后再行支付。

3、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项 目	自 2022 年 5 月 28 日至 2022 年 6 月 15 日止期间
一、清算收益	
1. 利息收入	6,418.11
清算收益小计	6,418.11
二、清算费用	
1. 其他费用	
其中：银行费用	541.20
律师费	25,000.00
其他	200.00
清算费用小计	25,741.20
三、清算净收益	-19,323.09

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、2022年5月27日所有者权益	29,246,842.74
加：清算期间净收益	-19,323.09
减：基金净赎回金额 (于2022年5月30日确认的投资者赎回与转出申请)	5,022,476.18

二、2022年6月15日所有者权益	24,205,043.47
-------------------	---------------

资产处置及负债清偿后，于2022年6月15日本基金剩余财产为人民币24,205,043.47元。根据本基金的《基金合同》约定以及《摩根士丹利华鑫纯债稳定增值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》，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本基金基金份额持有人所有。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人摩根士丹利华鑫基金管理有限公司将于清算款划出日以自有资金垫付该笔款项（该金额可能与实际结息金额存在略微差异），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) 摩根士丹利华鑫纯债稳定增值 18 个月定期开放债券型证券投资基金 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 5 月 27 日(基金最后运作日)止期间的财务报表及审计报告

(2) 上海市通力律师事务所关于《摩根士丹利华鑫纯债稳定增值 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。

摩根士丹利华鑫纯债稳定增值 18 个月定期开放债券型证券投资基金

基金财产清算小组

2022 年 6 月 15 日