

摩根士丹利优质信价纯债债券型证券投资  
基金  
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：摩根士丹利基金管理（中国）有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 29 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 27 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 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>15</b>
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	38
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	38

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 .....	38
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 .....	39
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 .....	39
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	39
7.11 投资组合报告附注 .....	39
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>40</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	40
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 .....	40
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>41</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>41</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	41
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 .....	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	42
10.4 基金投资策略的改变 .....	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	42
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 .....	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	42
10.8 其他重大事件 .....	45
<b>§ 11 备查文件目录 .....</b>	<b>47</b>
11.1 备查文件目录 .....	47
11.2 存放地点 .....	47
11.3 查阅方式 .....	47

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	摩根士丹利优质信价纯债债券型证券投资基金		
基金简称	大摩优质信价纯债		
基金主代码	000419		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2014 年 11 月 25 日		
基金管理人	摩根士丹利基金管理（中国）有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	598,270,956.33 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	大摩优质信价纯债 A	大摩优质信价纯债 C	大摩优质信价纯债 E
下属分级基金的交易代码	000419	000420	020244
报告期末下属分级基金的份额总额	57,010,803.45 份	52,852,609.58 份	488,407,543.30 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于信用债、利率债等固定收益品种，通过积极主动的投资管理，力争为投资者提供持续稳定的回报。
投资策略	<p>本基金根据宏观经济运行状况、政策形势、利率走势、信用状况等的综合判断，并结合各大类资产的估值水平和风险收益特征，在基金合同规定的范围内决定各类资产的配置比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时进行动态调整。</p> <p>对于固定收益投资，本基金通过分析经济增长、通货膨胀、收益率曲线、信用利差、提前偿付率等指标来发现固定收益市场中存在的各种投资机会，并根据这些投资机会的相对投资价值构建投资组合。本基金信用债投资中以具有最佳“信价比”的中等评级信用债投资为主，一般情况下，在债券类投资产品中，信用债的收益率要高于国债、央行票据等其他债券的收益率。投资中等评级的信用债是通过主动承担适度的信用风险来获取较高的收益，所以在个券的选择当中特别重视信用风险的评估和防范。</p> <p>本基金采用主动投资的策略，通过评估货币政策、财政政策和国际</p>

	环境等因素，分析市场价格中隐含的对经济增长、通货膨胀、违约概率、提前偿付速度等因素的预测，根据固定收益市场中存在的各种投资机会的相对投资价值和相关风险决定总体的投资策略及类属（政府、企业/公司、资产支持证券）和期限（短期、中期和长期）等部分的投资比例，并基于价值分析精选投资品种构建固定收益投资组合。当各种投资机会预期的风险调整后收益发生变化时，本基金对组合的策略和比例做相应调整，以保持基金组合的最优化配置。本基金采用的主要固定收益投资策略包括：利率预期策略、收益率曲线策略、信用利差策略、公司/企业债券策略、资产支持证券策略等。
业绩比较基准	中债国债总全价（总值）指数收益率×40%+中债企业债总全价（总值）指数收益率×60%
风险收益特征	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。

### 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		摩根士丹利基金管理（中国）有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	毛慧	王小飞
	联系电话	(0755)88318883	021-60637103
	电子邮箱	im-disclosure@morganstanley.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8888-668	021-60637228
传真		(0755)82990384	021-60635778
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	北京市西城区金融大街25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	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		518048	100033
法定代表人		ZHOU WENTONG（周文桐）	张金良

### 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	<a href="https://www.morganstanleyfunds.com.cn">https://www.morganstanleyfunds.com.cn</a>
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	摩根士丹利基金管理（中国）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第17层

## § 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	报告期(2024年1月1日-2024年6月30日)
----------	---------------------------

数据和指标	大摩优质信价纯债 A	大摩优质信价纯债 C	大摩优质信价纯债 E
本期已实现收益	1,190,714.99	571,233.64	4,119,357.54
本期利润	2,215,869.40	1,007,258.36	6,284,413.41
加权平均基金份额本期利润	0.0424	0.0354	0.0310
本期加权平均净值利润率	4.00%	3.36%	2.90%
本期基金份额净值增长率	4.15%	3.93%	4.09%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)		
期末可供分配利润	3,782,538.36	2,869,989.66	32,595,929.79
期末可供分配基金份额利润	0.0663	0.0543	0.0667
期末基金资产净值	61,564,522.13	56,421,579.09	527,605,010.63
期末基金份额净值	1.0799	1.0675	1.0803
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)		
基金份额累计净值增长率	47.25%	42.43%	5.09%

注：1. 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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2. 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）；

3. 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

大摩优质信价纯债 A

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	0.64%	0.03%	0.47%	0.03%	0.17%	0.00%
过去三个月	1.82%	0.06%	0.80%	0.06%	1.02%	0.00%
过去六个月	4.15%	0.07%	2.07%	0.06%	2.08%	0.01%
过去一年	5.43%	0.06%	2.86%	0.05%	2.57%	0.01%
过去三年	7.22%	0.13%	5.10%	0.05%	2.12%	0.08%
自基金合同生效起至今	47.25%	0.09%	-3.91%	0.08%	51.16%	0.01%

大摩优质信价纯债 C

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	0.60%	0.03%	0.47%	0.03%	0.13%	0.00%
过去三个月	1.72%	0.06%	0.80%	0.06%	0.92%	0.00%
过去六个月	3.93%	0.07%	2.07%	0.06%	1.86%	0.01%
过去一年	5.00%	0.06%	2.86%	0.05%	2.14%	0.01%
过去三年	5.80%	0.13%	5.10%	0.05%	0.70%	0.08%
自基金合同生效起至今	42.43%	0.09%	-3.91%	0.08%	46.34%	0.01%

大摩优质信价纯债 E

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	0.63%	0.03%	0.47%	0.03%	0.16%	0.00%
过去三个月	1.78%	0.06%	0.80%	0.06%	0.98%	0.00%
过去六个月	4.09%	0.07%	2.07%	0.06%	2.02%	0.01%

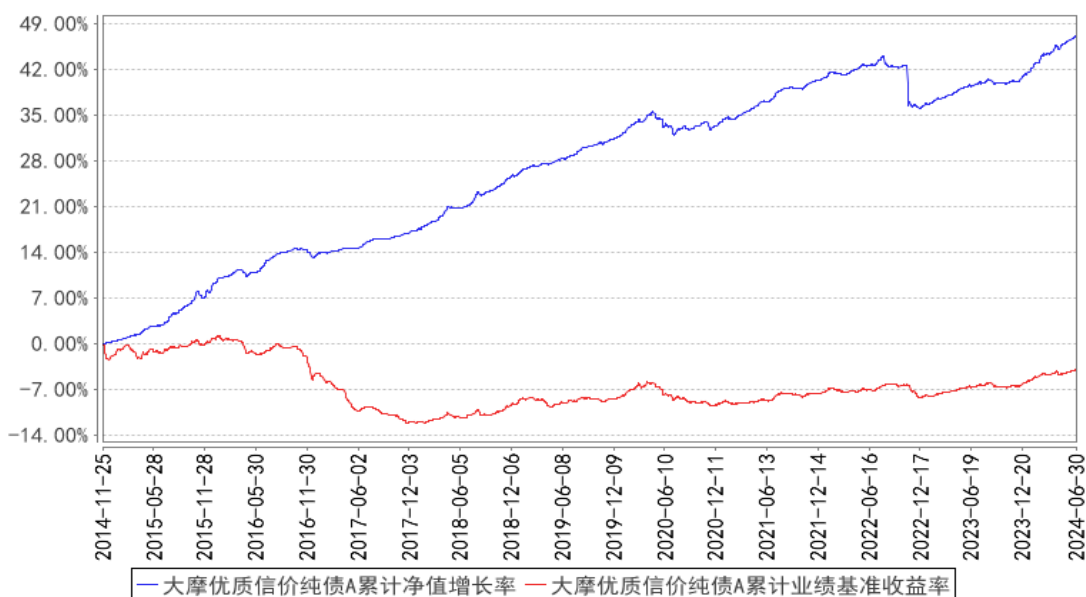


自基金合同生效起 至今	5.09%	0.07%	2.74%	0.06%	2.35%	0.01%
----------------	-------	-------	-------	-------	-------	-------

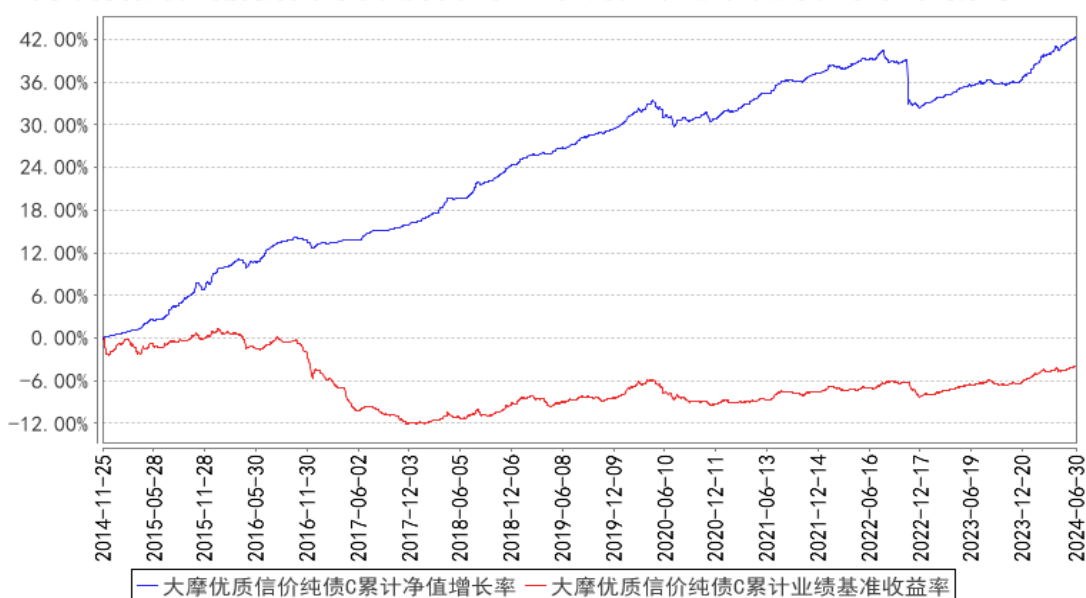
注：本基金从 2023 年 12 月 6 日起新增 E 类份额，E 类份额自 2023 年 12 月 6 日起存续。

### 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

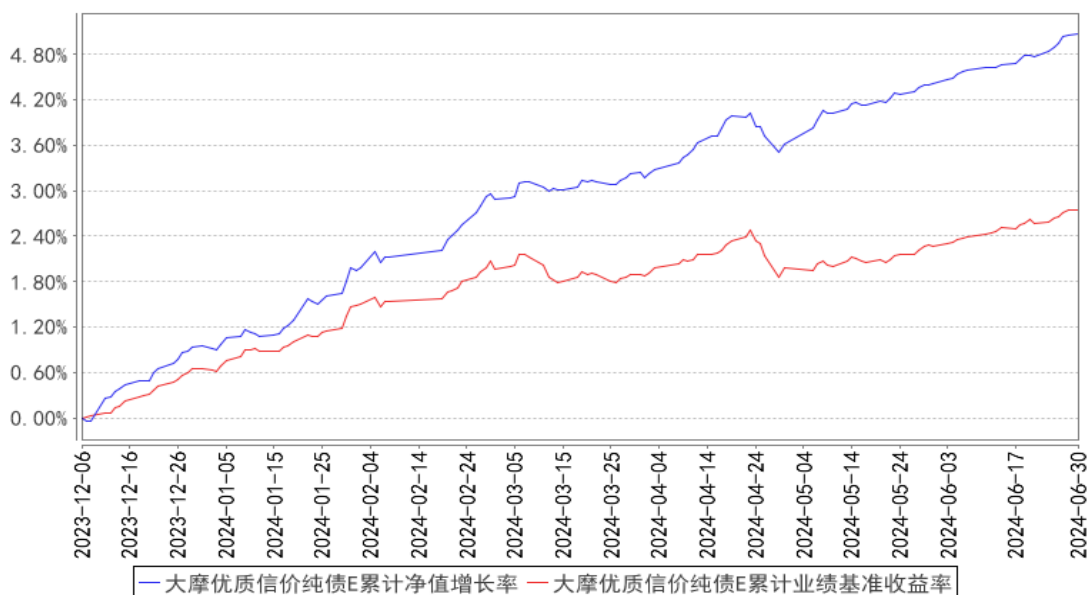
大摩优质信价纯债A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



大摩优质信价纯债C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



大摩优质信价纯债E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：本基金基金合同于 2014 年 11 月 25 日正式生效。按照本基金合同的规定，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。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

本基金从 2023 年 12 月 6 日起新增 E 类份额，E 类份额自 2023 年 12 月 6 日起存续。

## § 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

摩根士丹利基金管理（中国）有限公司（以下简称“公司”）是一家外国法人独资基金管理公司，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、摩根士丹利华鑫基金管理有限公司。公司的股东为摩根士丹利国际控股公司。

截至 2024 年 6 月 30 日，公司旗下共管理 35 只公募基金，其中股票型 4 只，混合型 19 只，指数型 1 只，债券型 10 只、基金中基金 1 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	固定收益投资部副总监（主持工作）、基金经理	2017 年 1 月 9 日	-	14 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

					副总监（主持工作）兼基金经理。2017 年 1 月起担任摩根士丹利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 月至 2021 年 8 月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，2021 年 9 月起担任摩根士丹利强收益债券型证券投资基金基金经理，2022 年 7 月起担任摩根士丹利安盈稳固六个月持有期债券型证券投资基金基金经理，2022 年 8 月起担任摩根士丹利纯债稳定增利 18 个月定期开放债券型证券投资基金、摩根士丹利民丰盈和一年持有期混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期；非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；基金的基金经理助理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券基金从业人员范围的相关规定。

#### 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

二季度经济状态延续一季度——制造业和出口有韧性，地产和基建下行，消费走弱，旧动能逐渐弱化。当季不变价 GDP 同比从 5.3% 下滑至 4.7%，不及预期，随着低基数的褪去，下半年完成全年经济增长目标的压力增大。

经济数据方面，6 月社零当月同比 2%，前值 3.7%，低于市场预期，从累计同比看，2024 年上半年表现较好的行业有通讯器材、粮油食品饮料、中西药品、石油制品、家电家具等；表现较弱的是文化办公用品、建筑装潢、汽车等；结合 2022 年及 2023 年的表现来看，韧性最强的行业是粮油食品、中西药品、石油制品以及饮料业，最弱的行业是文化办公、建筑装潢、化妆品等。

工业增加值同比从 5 月的 5.6% 回落至 6 月的 5.3%，增速较高的行业有铁路船舶航空运输、计算机通信电子设备制造、有色加工、化学制造、橡胶塑料制品、酒精饮料和汽车制造等；增速较低的主要是农副食品加工、非金属制品业等一些传统行业。

制造业投资 6 月当月同比 9.3%，略低于前值的 9.4%；制造业投资前 6 个月累计同比为 9.5%，略低于前值 9.6%，整体较高的增速有出口修复、新产业投资的影响，以及设备更新的影响。

基建（不含电力）上半年累计同比 5.4%，2023 年是 5.9%，今年以来缺资金与缺项目的情况并存。分行业看，有国债资金支持的水利管理业今年增速较高，运输业分化，铁路好于道路；地方财政融资力度较弱。

地产方面，6 月 30 城新房销售降幅从 5 月的 -38% 收窄至 -20%；6 月房地产开发到位资金累计同比 -22.6%，前值 -24.3%；其中，国内贷款累计同比 -6.6%，前值 -6.2%；自筹资金同比 -9.1%，前值 -9.8%；定金及个人预收款同比 -34.1%，前值 -36.7%；个人按揭贷款同比 -37.7%，前值 -40.2%。70 个大中城市新建商品住宅价格指数 6 月环比为 -0.7%（前值 -0.7%）；新开工、施工、竣工累计同比分别 -23.7%、-12%、-21.8%，以 2019 年为参照，2024 年 6 月新开工、施工、竣工分别只有 2019 年同期的 31%、29% 和 75%，已经是非常低的水平。

出口上半年增速 3.6%，韧性依然较强，制造业周期整体震荡偏上，且受益于完整的产业链、较强的生产和物流能力，出口在价格优势的基础上可能也积累了一定的品牌认知，尽管后续可能面临欧美严峻的关税挑战，对出口也不宜过度悲观。

资金方面，由于基本面低迷，资金持续偏松，在取消存款规模考核和手工补息后，出现了存

款搬家去定期和非银的现象，流动性分层情况也有明显改善。

上半年本基金保持中高的久期和仓位。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期截至 2024 年 6 月 30 日，本基金 A 类份额净值为 1.0799 元，份额累计净值为 1.4215 元，C 类份额净值为 1.0675 元，份额累计净值为 1.3829 元；E 类份额净值为 1.0803 元，份额累计净值为 1.0803 元。报告期内 A 类基金份额净值增长率为 4.15%，C 类基金份额净值增长率为 3.93%，E 类基金份额净值增长率为 4.09%，同期业绩比较基准收益率为 2.07%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为需求不足需要通过加杠杆来解决，目前仍等待中央通过特别国债、政策性金融工具、专项债、补贴居民等政策；中央在收储或者专项债方面不仅需要帮地方解决加杠杆的问题，还得帮地方解决资本金的问题；但相比于中央加杠杆刺激传统经济，经济转型无疑是更重要的，而对传统刺激政策只有在触碰底线时才会考虑，整体来说由于经济发展模式和政策思路的转变，强刺激难以出现。

政策端一直以各方面的防风险为前提，上半年央行较为在意稳汇率，这很大程度上受到了上半年美国通胀反弹的影响；现阶段，随着完成国内全年增长目标的压力大于内外平衡的压力（上半年增长不及预期，后续贸易摩擦增加，近期美元走弱），决策层对于经济增长的诉求提升，货币宽松也陆续兑现，但需要关注后续特朗普如果上台或引发人民币汇率贬值，稳汇率的压力可能会加大。

我们认为债市短期内有利因素多，债市下行的阻力可能主要来自下行过快引起的央行干预，虽然央行的干预只影响节奏不改变方向，但这一因素难以预料，把握市场节奏的重要性上升。

本基金将坚持平衡收益与风险的原则，对大类资产进行配置。未来一个季度本基金将维持中性偏高的久期和仓位，并特别重视信用风险的防范。

#### 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（基金运营部的业务条线负责人）以及相关成员（包括研究管理部负责人、固定收益投资部信用研究员、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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,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,本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

## § 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：摩根士丹利优质信价纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	7,899,399.15	3,678,927.57
结算备付金		1,816,237.59	640,370.32
存出保证金		14,219.18	523.92
交易性金融资产	6.4.7.2	806,130,218.15	84,045,324.43
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		806,130,218.15	84,045,324.43
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		49,674,157.51	4,010,427.96
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		865,534,231.58	92,375,574.20
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		208,539,930.74	16,894,513.90
应付清算款		4,936.85	1,507,023.92
应付赎回款		10,857,158.70	43,986.97

应付管理人报酬		161,640.78	20,478.57
应付托管费		53,880.24	6,390.95
应付销售服务费		61,535.04	4,383.78
应付投资顾问费		-	-
应交税费		24,300.50	5,288.87
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	239,736.88	196,325.54
负债合计		219,943,119.73	18,678,392.50
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	598,270,956.33	71,184,601.30
未分配利润	6.4.7.12	47,320,155.52	2,512,580.40
净资产合计		645,591,111.85	73,697,181.70
负债和净资产总计		865,534,231.58	92,375,574.20

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额 598,270,956.33 份，其中大摩优质信价纯债 A 基金份额净值 1.0799 元，份额总额 57,010,803.45 份；大摩优质信价纯债 C 基金份额净值 1.0675 元，份额总额 52,852,609.58 份；大摩优质信价纯债 E 基金份额净值 1.0803 元，份额总额 488,407,543.30 份。

## 6.2 利润表

会计主体：摩根士丹利优质信价纯债债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		11,173,949.19	2,536,152.35
1. 利息收入		36,920.12	15,659.42
其中：存款利息收入	6.4.7.13	36,435.53	15,659.42
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		484.59	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		7,478,140.24	1,624,950.11
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	7,478,140.24	1,624,950.11
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-



收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	3,626,235.00	892,855.67
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	32,653.83	2,687.15
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>1,666,408.02</b>	<b>748,328.45</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	438,223.61	295,539.86
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	146,074.53	78,810.63
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	162,470.45	32,444.28
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		799,260.72	210,651.67
其中：卖出回购金融资产支出		799,260.72	210,651.67
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		10,887.16	6,335.24
8. 其他费用	6.4.7.23	109,491.55	124,546.77
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>9,507,541.17</b>	<b>1,787,823.90</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>9,507,541.17</b>	<b>1,787,823.90</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>9,507,541.17</b>	<b>1,787,823.90</b>

### 6.3 净资产变动表

会计主体：摩根士丹利优质信价纯债债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	71,184,601.30	-	2,512,580.40	73,697,181.70
二、本期期初净资产	71,184,601.30	-	2,512,580.40	73,697,181.70

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	527,086,355.03	-	44,807,575.12	571,893,930.15
(一)、综合收益总额	-	-	9,507,541.17	9,507,541.17
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	527,086,355.03	-	35,300,033.95	562,386,388.98
其中：1. 基金申购款	1,625,328,723.22	-	110,353,970.07	1,735,682,693.29
2. 基金赎回款	-1,098,242,368.19	-	-75,053,936.12	-1,173,296,304.31
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	598,270,956.33	-	47,320,155.52	645,591,111.85
项目	上年度可比期间			
	2023年1月1日至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	84,182,195.32	-	491.27	84,182,686.59
二、本期期初净资产	84,182,195.32	-	491.27	84,182,686.59
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-10,129,832.53	-	1,688,744.90	-8,441,087.63
(一)、综合收益总额	-	-	1,787,823.90	1,787,823.90
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-10,129,832.53	-	-99,079.00	-10,228,911.53
其中：1. 基金申购款	4,310,629.08	-	47,964.41	4,358,593.49
2. 基金赎回款	-14,440,461.61	-	-147,043.41	-14,587,505.02

回款				
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	74,052,362.79	-	1,689,236.17	75,741,598.96

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：

ZHOU WENTONG (周文桐)

贺草

杜志强

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

摩根士丹利优质信价纯债债券型证券投资基金(原名为“摩根士丹利华鑫优质信价纯债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[2013]第 1210 号《关于核准摩根士丹利华鑫优质信价纯债债券型证券投资基金募集的批复》核准,由摩根士丹利基金管理(中国)有限公司(原摩根士丹利华鑫基金管理有限公司,已于 2023 年 6 月 1 日办理完成股权及相应董事变更的工商变更登记,于 2023 年 6 月 2 日办理完成名称的相关工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《摩根士丹利华鑫优质信价纯债债券型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证券投资基金,存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,061,223,253.13 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(2014)第 716 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《摩根士丹利华鑫优质信价纯债债券型证券投资基金基金合同》于 2014 年 11 月 25 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,061,869,816.94 份,其中认购资金利息折合 646,563.81 份基金份额。本基金的基金管理人为摩根士丹利基金管理(中国)有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据基金管理人于 2023 年 6 月 8 日发布的《摩根士丹利基金管理(中国)有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》,自 2023 年 6 月 8 日起,摩根士丹利华鑫优质信价纯债债券型证券投资基金更名为摩根士丹利优质信价纯债债券型证券投资基金。

根据《关于摩根士丹利优质信价纯债债券型证券投资基金下调基金管理费率和基金托管费率、

增设 E 类基金份额并相应修改基金合同等法律文件的公告》，本基金于 2023 年 12 月 6 日新增 E 类份额。根据《摩根士丹利优质信价纯债债券型证券投资基金基金合同》和《摩根士丹利优质信价纯债债券型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金根据认购费/申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取前端认购/申购费的，称为 A 类；不收取前端申购费，而从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类和 E 类。A 类、C 类、E 类基金份额分别设置代码，分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。投资者可自行选择认购、申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《摩根士丹利优质信价纯债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、地方政府债、金融债、公司债、企业债、债券回购、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、银行存款以及法律法规或监管部门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）。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股申购和新股增发，不参与可转债投资。

本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产净值的 80%，信用债的投资比例不低于非现金基金资产的 80%，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：中债国债总全价（总值）指数收益率×40%+中债企业债总全价（总值）指数收益率×60%。

#### 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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（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》、本基金基金合同和在财务报表附注所列示的中国证监会、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 2024 年上半年度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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年上半年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

## 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 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。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2024 年 6 月 30 日
活期存款	7,899,399.15
等于：本金	7,898,269.50
加：应计利息	1,129.65
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	7,899,399.15

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	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	59,040,686.64	702,363.95	59,774,073.95	31,023.36
	银行间市场	734,138,438.58	8,408,894.20	746,356,144.20	3,808,811.42
	合计	793,179,125.22	9,111,258.15	806,130,218.15	3,839,834.78
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	793,179,125.22	9,111,258.15	806,130,218.15	3,839,834.78	

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：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

注：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**

注：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 债权投资**

无。

**6.4.7.6 其他债权投资**

无。

**6.4.7.7 其他权益工具投资**

无。

**6.4.7.8 其他资产**

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

**6.4.7.9 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	22.53
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	41,097.53
其中：交易所市场	-
银行间市场	41,097.53
应付利息	-
预提费用	198,616.82
合计	239,736.88

**6.4.7.10 实收基金**

金额单位：人民币元

## 大摩优质信价纯债 A

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	49,097,497.28	49,097,497.28
本期申购	17,569,041.26	17,569,041.26
本期赎回（以“-”号填列）	-9,655,735.09	-9,655,735.09
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	57,010,803.45	57,010,803.45

## 大摩优质信价纯债 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	12,374,398.21	12,374,398.21
本期申购	66,910,245.94	66,910,245.94
本期赎回（以“-”号填列）	-26,432,034.57	-26,432,034.57
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	52,852,609.58	52,852,609.58

## 大摩优质信价纯债 E

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	9,712,705.81	9,712,705.81
本期申购	1,540,849,436.02	1,540,849,436.02
本期赎回（以“-”号填列）	-1,062,154,598.53	-1,062,154,598.53
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	488,407,543.30	488,407,543.30

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

## 6.4.7.11 其他综合收益

无。

## 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

## 大摩优质信价纯债 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,126,417.52	-316,785.65	1,809,631.87
本期期初	2,126,417.52	-316,785.65	1,809,631.87
本期利润	1,190,714.99	1,025,154.41	2,215,869.40
本期基金份额交易产生的变动数	465,405.85	62,811.56	528,217.41
其中：基金申购款	1,046,946.84	126,538.56	1,173,485.40
基金赎回款	-581,540.99	-63,727.00	-645,267.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,782,538.36	771,180.32	4,553,718.68

## 大摩优质信价纯债 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------



上年度末	415,859.84	-80,964.81	334,895.03
本期期初	415,859.84	-80,964.81	334,895.03
本期利润	571,233.64	436,024.72	1,007,258.36
本期基金份额交易产生的变动数	1,882,896.18	343,919.94	2,226,816.12
其中：基金申购款	3,191,300.19	504,303.90	3,695,604.09
基金赎回款	-1,308,404.01	-160,383.96	-1,468,787.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,869,989.66	698,979.85	3,568,969.51

## 大摩优质信价纯债 E

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	428,406.49	-60,352.99	368,053.50
本期期初	428,406.49	-60,352.99	368,053.50
本期利润	4,119,357.54	2,165,055.87	6,284,413.41
本期基金份额交易产生的变动数	28,048,165.76	4,496,834.66	32,545,000.42
其中：基金申购款	93,155,986.26	12,328,894.32	105,484,880.58
基金赎回款	-65,107,820.50	-7,832,059.66	-72,939,880.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	32,595,929.79	6,601,537.54	39,197,467.33

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	28,744.38
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	7,647.78
其他	43.37
合计	36,435.53

## 6.4.7.14 股票投资收益

注：本基金本报告期无股票投资收益。

## 6.4.7.15 债券投资收益

## 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	5,279,163.08
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,198,977.16
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	7,478,140.24

#### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,252,647,794.62
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,233,128,002.29
减：应计利息总额	17,278,953.92
减：交易费用	41,861.25
买卖债券差价收入	2,198,977.16

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.18 衍生工具收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.19 股利收益

注：本基金本报告期无股利收益。

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	3,626,235.00
股票投资	-
债券投资	3,626,235.00
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	3,626,235.00

## 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	31,635.23
基金转换费收入	1,018.60
合计	32,653.83

## 6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

## 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	29,835.26
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
银行费用	21,274.73
债券账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	109,491.55

## 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

截至财务报表批准报出日，本基金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
摩根士丹利基金管理（中国）有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构

注：于 2023 年 7 月 18 日，基金管理人公告公司股权变更交割手续办理完毕，由摩根士丹利国际控股公司依法受让原股东华鑫证券有限责任公司与深圳基石创业投资有限公司 51% 股权，Morgan Stanley 成为实际控制人。华鑫证券有限责任公司与深圳基石创业投资有限公司自 2023 年 7 月 18 日起不再作为本基金关联方。

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

##### 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 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	438,223.61	295,539.86
其中：应支付销售机构的客户维护费	198,951.47	132,856.71
应支付基金管理人的净管理费	239,272.14	162,683.15

注：自2014年11月25日至2023年12月5日，支付基金管理人摩根士丹利基金管理（中国）有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.75%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×0.75%/当年天数。

根据《关于摩根士丹利优质信价纯债债券型证券投资基金下调基金管理费率和基金托管费率、增设E类基金份额并相应修改基金合同等法律文件的公告》，自2023年12月6日起，支付基金管理人摩根士丹利基金管理（中国）有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.30%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×0.30%/当年天数。

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	146,074.53	78,810.63

注：自2014年11月25日至2023年12月5日，支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.20%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×0.20%/当年天数。

根据《关于摩根士丹利优质信价纯债债券型证券投资基金下调基金管理费率和基金托管费率、增设E类基金份额并相应修改基金合同等法律文件的公告》，自2023年12月6日起，支付基金托

管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期			
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	大摩优质信价 纯债 A	大摩优质信价纯债 C	大摩优质信价 纯债 E	合计
摩根士丹利基金管理（中国）有限公司	-	38.53	-	38.53
中国建设银行股份有限公司	-	9,761.77	-	9,761.77
合计	-	9,800.30	-	9,800.30
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间			
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	大摩优质信价 纯债 A	大摩优质信价纯债 C	大摩优质信价 纯债 E	合计
摩根士丹利基金管理（中国）有限公司	-	34.43	-	34.43
中国建设银行股份有限公司	-	10,975.11	-	10,975.11
华鑫证券	-	-	-	-
合计	-	11,009.54	-	11,009.54

注：1、支付 C 类基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.40%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：日销售服务费=前一日 C 类基金资产净值×0.40%/当年天数。

2、支付 E 类基金销售机构的销售服务费按前一日 E 类基金资产净值 0.10%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：日销售服务费=前一日 E 类基金资产净值×0.10%/当年天数。

3、华鑫证券有限责任公司自 2023 年 7 月 18 日起不再作为本基金关联方。

**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**

注：本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

**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**

注：本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行证券出借业务。

**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**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

**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**

注：本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

**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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	7,899,399.15	28,744.38	2,340,009.58	5,253.94

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况**

注：本基金本报告期无利润分配事项。

**6.4.12 期末（2024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**

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

注：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 2024 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 188,039,930.74 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
230208	23 国开 08	2024 年 7 月 1 日	102.20	716,000	73,171,943.67
092280080	22 光大银行 二级资本债 01A	2024 年 7 月 3 日	105.46	200,000	21,092,043.72
102382015	23 无锡城南 MTN001	2024 年 7 月 3 日	105.26	200,000	21,051,693.99
102382311	23 长春城投 MTN002	2024 年 7 月 3 日	108.24	100,000	10,823,868.85
092280014	22 上海银行 二级资本债 01	2024 年 7 月 3 日	107.49	100,000	10,749,353.01
232380066	23 中行二级 资本债 03A	2024 年 7 月 3 日	107.36	100,000	10,735,931.15
232380052	23 农行二级 资本债 02A	2024 年 7 月 3 日	106.78	100,000	10,677,721.31
232380089	23 中信银行 二级资本债 01A	2024 年 7 月 3 日	105.71	100,000	10,570,967.21
102300327	23 临沂城发 MTN002	2024 年 7 月 3 日	101.56	100,000	10,156,221.92
232480004	24 农行二级 资本债 01A	2024 年 7 月 3 日	103.46	58,000	6,000,725.64
092200008	22 农行二级 资本债 02A	2024 年 7 月 3 日	105.08	55,000	5,779,271.97
102383155	23 济南高新 MTN005B	2024 年 7 月 3 日	104.70	50,000	5,235,120.22
102382042	23 青岛北发 MTN003	2024 年 7 月 3 日	104.50	50,000	5,225,169.40
102480337	24 邯郸交投 MTN001	2024 年 7 月 3 日	103.14	50,000	5,157,169.95
合计				1,979,000	206,427,202.01

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 20,500,000.00 元，于 2024 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：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

本基金为债券型证券投资基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，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。本基金投资的金融工具主要包括国内依法发行上市的国债、央行票据、地方政府债、金融债、公司债、企业债、债券回购、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、银行存款以及法律法规或监管部门允许基金投资的其他金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是主要投资于信用债、利率债等固定收益品种，通过积极主动的投资管理，力争为投资者提供持续稳定的回报。

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中国建设银行，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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	33,991,769.58	19,169,665.39
合计	33,991,769.58	19,169,665.39

注：本基金持有的未评级的债券为超短期融资债、国债和政策银行债。

#### 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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	320,953,077.29	38,171,103.30
AAA 以下	68,456,593.58	-
未评级	382,728,777.70	26,704,555.74
合计	772,138,448.57	64,875,659.04

注：本基金持有的未评级的债券为政策银行债、公司债、国债和中期票据。

#### 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2024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（净资产）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 2024 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 2024 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 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	7,899,399.15	-	-	-	7,899,399.15
结算备付金	1,816,237.59	-	-	-	1,816,237.59
存出保证金	14,219.18	-	-	-	14,219.18
交易性金融资产	49,436,854.35	640,966,794.90	115,726,568.90	-	806,130,218.15
应收申购款	-	-	-	49,674,157.51	49,674,157.51
资产总计	59,166,710.27	640,966,794.90	115,726,568.90	49,674,157.51	865,534,231.58
负债					
应付赎回款	-	-	-	10,857,158.70	10,857,158.70
应付管理人报酬	-	-	-	161,640.78	161,640.78
应付托管费	-	-	-	53,880.24	53,880.24
应付清算款	-	-	-	4,936.85	4,936.85
卖出回购金融资产款	208,539,930.74	-	-	-	208,539,930.74
应付销售服务费	-	-	-	61,535.04	61,535.04
应交税费	-	-	-	24,300.50	24,300.50
其他负债	-	-	-	239,736.88	239,736.88
负债总计	208,539,930.74	-	-	11,403,188.99	219,943,119.73
利率敏感度缺口	-149,373,220.47	640,966,794.90	115,726,568.90	38,270,968.52	645,591,111.85
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,678,927.57	-	-	-	3,678,927.57
结算备付金	640,370.32	-	-	-	640,370.32
存出保证金	523.92	-	-	-	523.92
交易性金融资产	34,588,854.25	43,214,580.02	6,241,890.16	-	84,045,324.43
应收申购款	-	-	-	4,010,427.96	4,010,427.96
资产总计	38,908,676.06	43,214,580.02	6,241,890.16	4,010,427.96	92,375,574.20
负债					
应付赎回款	-	-	-	43,986.97	43,986.97
应付管理人报酬	-	-	-	20,478.57	20,478.57
应付托管费	-	-	-	6,390.95	6,390.95
应付清算款	-	-	-	1,507,023.92	1,507,023.92
卖出回购金融资产款	16,894,513.90	-	-	-	16,894,513.90
应付销售服务费	-	-	-	4,383.78	4,383.78
应交税费	-	-	-	5,288.87	5,288.87

其他负债	-	-	-	196,325.54	196,325.54
负债总计	16,894,513.90	-	-	1,783,878.60	18,678,392.50
利率敏感度缺口	22,014,162.16	43,214,580.02	6,241,890.16	2,226,549.36	73,697,181.70

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		
分析	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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	市场利率上升25个基点	-13,520,000.00	-840,000.00
市场利率下降25个基点	13,870,000.00	870,000.00	

#### 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固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

### 6.4.14 公允价值

#### 6.4.14.1 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。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	806,130,218.15	84,045,324.43
第三层次	-	-
合计	806,130,218.15	84,045,324.43

#### 6.4.14.2.2 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，确定相关债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 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工具(2023 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	806,130,218.15	93.14
	其中：债券	806,130,218.15	93.14
	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	9,715,636.74	1.12
8	其他各项资产	49,688,376.69	5.74
9	合计	865,534,231.58	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注：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

注：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

注：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	54,729,469.44	8.48
2	央行票据	-	-
3	金融债券	452,339,240.47	70.07
	其中：政策性金融债	183,908,529.59	28.49
4	企业债券	65,684,606.04	10.17
5	企业短期融资券	3,044,395.08	0.47
6	中期票据	230,332,507.12	35.68
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	806,130,218.15	124.87

## 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	230208	23 国开 08	800,000	81,756,361.64	12.66
2	240205	24 国开 05	400,000	41,575,005.46	6.44
3	240210	24 国开 10	400,000	40,344,219.18	6.25
4	230023	23 附息国债 23	300,000	33,807,344.26	5.24
5	2228006	22 中国银行二级 01	300,000	31,274,852.46	4.84

## 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**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**

注：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**

注：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国债期货交易情况说明****7.10.1 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。

**7.10.2 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。

**7.11 投资组合报告附注****7.11.1 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**

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、中国人民银行的处罚。中国邮政储蓄银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策流程符合本基金管理人投资管理制度的相关规定。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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。

**7.11.2 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。

**7.11.3 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	14,219.18
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	49,674,157.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	49,688,376.69

**7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

注：根据本基金基金合同规定，本基金不参与可转债投资。

## 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：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

份额级别	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（%）
大摩优质信价纯债 A	6,123.00	9,310.93	21.91	-	57,010,781.54	100.00
大摩优质信价纯债 C	4,851.00	10,895.20	81,582.35	0.15	52,771,027.23	99.85
大摩优质信价纯债 E	16,595.00	29,431.01	21,428,539.62	4.39	466,979,003.68	95.61
合计	27,569	21,700.86	21,510,143.88	3.60	576,760,812.45	96.40

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	大摩优质信价纯债 A	46,423.75	0.081430
	大摩优质信价纯债 E	66,954.91	0.013709
	合计	113,378.66	0.018951

## 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	份额级别	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	大摩优质信价纯债 A	0
	大摩优质信价纯债 C	0
	大摩优质信价纯债 E	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	大摩优质信价纯债 A	0
	大摩优质信价纯债 C	0
	大摩优质信价纯债 E	0



	合计	0
--	----	---

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大摩优质信价纯债 A	大摩优质信价纯债 C	大摩优质信价纯债 E
基金合同生效日（2014 年 11 月 25 日）基金份额总额	780,771,513.23	281,098,303.71	-
本报告期期初基金份额总额	49,097,497.28	12,374,398.21	9,712,705.81
本报告期基金总申购份额	17,569,041.26	66,910,245.94	1,540,849,436.02
减：本报告期基金总赎回份额	9,655,735.09	26,432,034.57	1,062,154,598.53
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	57,010,803.45	52,852,609.58	488,407,543.30

## § 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：

1、2024 年 1 月 1 日至 2024 年 4 月 30 日期间，ZHOU WENTONG（周文桐）先生担任本公司副总经理；自 2024 年 5 月 1 日起，ZHOU WENTONG（周文桐）先生由本公司副总经理转任本公司总经理，王鸿嫔女士于同日离任本公司总经理。

2、自 2024 年 3 月 31 日起，李锦女士离任本公司副总经理。

3、自 2024 年 5 月 1 日起，ZHOU HAN（周涵）先生担任本公司首席信息官，王鸿嫔女士于同日离任本公司首席信息官。

4、自 2024 年 5 月 16 日起，毛慧女士担任本公司督察长，许菲菲女士于同日离任本公司督察长。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受到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 (%)	
上海证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-

国金证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-

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，本基金减少租用方正证券、川财证券、中金财富各 1 个交易单元。

### 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(%)
上海证券	-	-	-	-	-	-

东兴证 券	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-
中信证 券	195,804,387 .06	62.60	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中银国 际	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华鑫证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
国投证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	25,819,744. 24	8.25	12,300,000.0 0	0.94	-	-
国海证 券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-

开源证 券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	91,154,658. 59	29.14	1,298,574,00 0.00	99.06	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
财通证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
长城证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 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	摩根士丹利基金管理（中国）有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2024年1月2日
2	摩根士丹利基金管理（中国）有限公司关于旗下部分基金增加财通证券股份有限公司为销售机构并参与费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024年1月15日
3	关于摩根士丹利优质信价纯债债券型证券投资基金 E 类份额增加销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024年1月18日
4	摩根士丹利基金管理（中国）有限公司旗下全部基金 2023 年 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024年1月19日
5	摩根士丹利基金管理（中国）有限公司旗下全部基金 2023 年 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024年1月19日
6	关于摩根士丹利优质信价纯债债券型证券投资基金 E 类份额增加平安证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024年1月19日
7	摩根士丹利基金管理（中国）有限公司	中国证监会规定报刊及	2024年1月23日

	司关于提醒投资者及时更新、完善身份资料信息以免影响业务办理的公告	网站	
8	摩根士丹利基金管理（中国）有限公司关于北京分公司法定名称变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 1 月 24 日
9	摩根士丹利基金管理（中国）有限公司关于暂停公司官网、网上交易系统、在线客服相关服务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 1 月 26 日
10	关于摩根士丹利优质信价纯债债券型证券投资基金 E 类份额增加销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 1 月 26 日
11	摩根士丹利基金管理（中国）有限公司关于部分直销银行账户信息变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 2 月 5 日
12	摩根士丹利优质信价纯债债券型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 2 月 7 日
13	摩根士丹利优质信价纯债债券型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 2 月 7 日
14	摩根士丹利优质信价纯债债券型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 2 月 7 日
15	摩根士丹利优质信价纯债债券型证券投资基金（E 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 2 月 7 日
16	摩根士丹利基金管理（中国）有限公司关于旗下基金增加博时财富基金销售有限公司为销售机构并参与费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 3 月 11 日
17	摩根士丹利基金管理（中国）有限公司关于旗下部分基金参与华福证券有限责任公司费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 3 月 19 日
18	摩根士丹利基金管理（中国）有限公司关于旗下基金增加深圳市前海排排网基金销售有限责任公司为销售机构并参与费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 3 月 22 日
19	摩根士丹利基金管理（中国）有限公司旗下基金 2023 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 3 月 28 日
20	摩根士丹利基金管理（中国）有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 3 月 28 日
21	摩根士丹利基金管理（中国）有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 4 月 2 日
22	摩根士丹利基金管理（中国）有限公	中国证监会规定报刊及	2024 年 4 月 19 日

	司旗下全部基金 2024 年 1 季度报告提示性公告	网站	
23	摩根士丹利基金管理（中国）有限公司旗下全部基金 2024 年 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 4 月 19 日
24	摩根士丹利基金管理（中国）有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 5 月 1 日
25	摩根士丹利基金管理（中国）有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 5 月 16 日
26	摩根士丹利基金管理（中国）有限公司关于暂停海银基金销售有限公司办理旗下基金相关业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 5 月 31 日
27	摩根士丹利基金管理（中国）有限公司旗下基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 6 月 14 日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 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。

### 11.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

### 11.3 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。

摩根士丹利基金管理（中国）有限公司

2024 年 8 月 29 日