

# 摩根士丹利华鑫双利增强债券型证券投资基金（大摩双利增强债券 C 类份额）

## 基金产品资料概要更新

编制日期：2022 年 11 月 14 日

送出日期：2022 年 11 月 15 日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。

作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

### 一、产品概况

|         |                 |                |                  |
|---------|-----------------|----------------|------------------|
| 基金简称    | 大摩双利增强债券        | 基金代码           | 000024           |
| 下属基金简称  | 大摩双利增强债券 C      | 下属基金交易代码       | 000025           |
| 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          | 中国建设银行股份有限公司     |
| 基金合同生效日 | 2013 年 3 月 26 日 | 上市交易所及上市日期     | 暂未上市             |
| 基金类型    | 债券型             | 交易币种           | 人民币              |
| 运作方式    | 普通开放式           | 开放频率           | 每个开放日            |
| 基金经理    | 葛飞              | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2021 年 4 月 17 日  |
|         |                 | 证券从业日期         | 2011 年 10 月 17 日 |
|         | 周梦琳             | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2022 年 11 月 10 日 |
|         |                 | 证券从业日期         | 2012 年 7 月 9 日   |

### 二、基金投资与净值表现

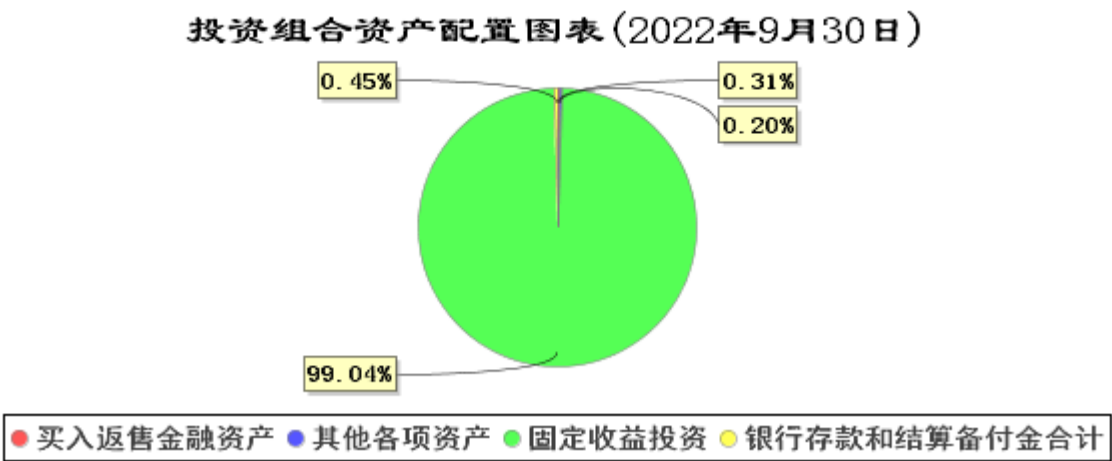
#### （一）投资目标与投资策略

详见《招募说明书》第九部分“基金的投资”

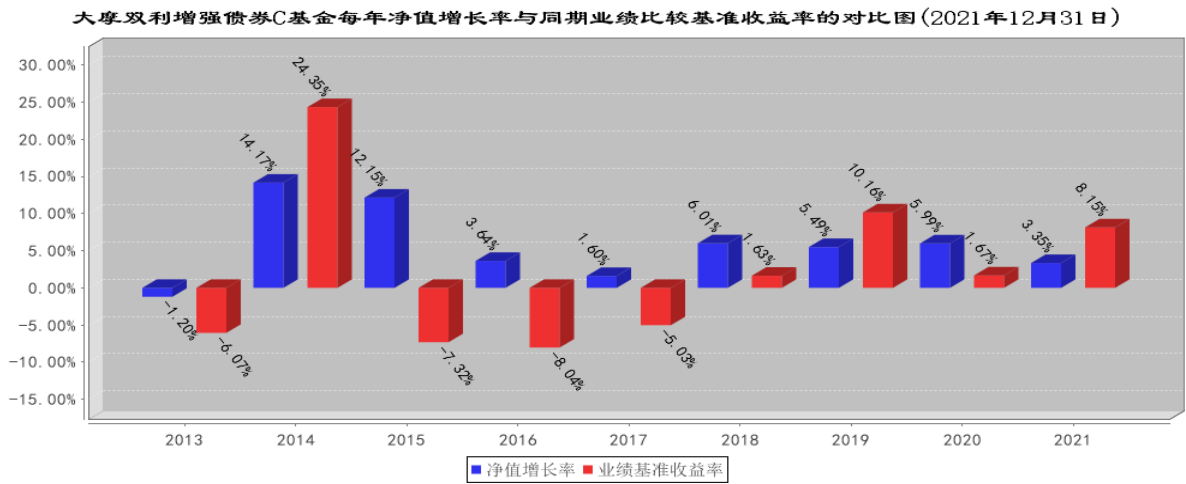
|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金投资目标是在严格控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理，合理配置债券等固定收益类金融工具，力争使投资者获得长期稳定的投资回报。                                                                                                                                                                                                                 |
| 投资范围   | 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、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券、公司债、中期票据、中小企业私募债、可转债、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产，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。<br>本基金各类资产的投资比例范围为：固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%，其中，信用债和可转债合计投资比例不低于固定收益类资产的 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%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。 |
| 主要投资策略 | 本基金将坚持稳健配置策略，在严格控制风险的基础上，力争使投资者获得长期稳定的投资回报。<br>在大类资产配置的基础上，本基金采取以下策略，将固定收益类资产在信用债、可转债                                                                                                                                                                                               |

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>和其他资产间进行配置。</p> <p>首先，本基金分别对影响信用债市场的信贷水平、信用利差水平、信用债市场供求关系等因素进行分析；然后，对影响可转债市场的转股溢价率、隐含波动率、对应正股的市场走势、可转债市场供求关系等因素进行分析研究；最后，本基金根据上述分析结论，预测和比较信用债、可转债两类资产未来的收益率与风险，并结合二者的相关关系，确定并调整信用债、可转债两类资产的配置比例，在收益与风险间寻求最佳平衡。</p> <p>本基金将以自上而下的在基准利率曲线分析和信用利差分析基础上相应实施的投资策略，以及自下而上的个券精选策略，作为本基金的信用债券投资策略。</p> <p>基于行业分析、企业基本面分析和可转债估值模型分析，本基金在一、二级市场投资可转债，以达到控制风险，实现基金资产稳健增值的目的。</p> <p>除信用债与可转债外，本基金还将在综合考虑组合收益、利率风险以及流动性的前提下，投资于国债、央行票据等利率品种。</p> |
| 业绩比较基准 | 中债企业债总全价指数收益率×40%+中证可转债指数收益率×40%+中债国债总全价指数收益率×20%                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，长期预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表



(三) 自基金合同生效以来/最近十年（孰短）基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图



注：1、业绩表现截止日期 2021 年 12 月 31 日。基金过往业绩不代表未来表现。

2、本基金基金合同生效日为 2013 年 03 月 26 日，成立当年按实际期限计算净值增长率。

### 三、投资本基金涉及的费用

#### （一）基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取：

| 费用类型 | 份额（S）或金额（M）<br>/持有期限（N）     | 收费方式/费率 |
|------|-----------------------------|---------|
| 赎回费  | $N < 7$ 日                   | 1.5%    |
|      | $7 \text{ 日} \leq N < 30$ 日 | 0.75%   |
|      | $N \geq 30$ 日               | 0%      |

#### 申购费

本基金 C 类份额计提销售服务费而不收取申购费。

#### （二）基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

| 费用类别  | 收费方式/年费率 |
|-------|----------|
| 管理费   | 0.75%    |
| 托管费   | 0.20%    |
| 销售服务费 | 0.40%    |

注：本基金其他运作费用包括信息披露费用、会计师费、律师费、持有人大会费用等。本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

### 四、风险揭示与重要提示

#### （一）风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。基金风险表现为基金收益的波动，基金管理过程中任何影响基金收益的因素都是基金风险的来源。基金的风险按来源可以分为市场风险、管理风险、流动性风险、操作风险、合规性风险、政策变更风险、本基金特有的风险、法律风险和其他风险等。

##### 1、本基金特有风险

（1）本基金为债券型基金，主要投资于固定收益类品种。因此，本基金需要承担由于市场利率波动造成的利率风险、债券发债主体的信用风险以及发债主体信用恶化造成的信用风险，如果持有的信用债出现评级下调或信用违约风险，将给基金净值带来较大的负面影响和波动；如果债券市场出现整体下跌，将无法完全避免债券市场系统性风险。

##### （2）本基金投资中小企业私募债的风险

本基金投资范围包括中小企业私募债，该类债券是根据相关法律法规由非上市的中小企业采用非公开方式发行的债券，由于不能公开交易，一般情况下，交易不活跃，存在较大流动性风险。同时，由于中小企业私募债的债券发行主体资产规模较小、经营的波动性较大，且各类文件（如招募说明书、审计报告等）不公开发布，也大大提高了分析并跟踪发债主体信用基本面的难度，投资过程中的信用风险也相应增加。当发债主体信用质量恶化时，受市场流动性所限，本基金可能无法卖出所持有的相关中小企业私募债，亦可能出现债券到期后，发债主体不能按时或不能清偿债务的风险，由此可能给基金净值带来不利影响或损失。

##### （3）本基金投资资产支持证券的风险

本基金投资范围包括资产支持证券，尽管基金管理人本着谨慎和控制风险的原则进行投资，但仍面临以下风险：

A、信用风险：若本基金所投资的资产支持证券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降，可能造成基金财产损失。

B、利率风险：市场利率波动会导致资产支持证券的收益率和价格的变动，一般而言，如果市场利率上升，本基金持有资产支持证券将面临价格下降、本金损失的风险，而如果市场利率下降，资产支持证券利息的再投资收益将面临下降的风险。

C、流动性风险：受资产支持证券市场规模及交易活跃程度的影响，资产支持证券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，存在一定的流动性风险。

D、提前偿付风险：债务人可能会由于利率变化等原因进行提前偿付，从而使基金资产面临再投资风险。

E、法律风险：由于法律法规方面的原因，某些市场行为受到限制或合同不能正常执行，导致基金财产的损失。

（4）本基金可能因持续规模较小或基金持有人人数不足等原因，导致基金转型、合并或终止的风险。

2、本基金特有风险外的其他风险请详见本基金的招募说明书。

## （二）重要提示

中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，除非仲裁裁决另有规定，仲裁费由败诉方承担。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站【[www.msfnfunds.com.cn](http://www.msfnfunds.com.cn)】【客服电话：400-8888-668】

1. 本基金合同、托管协议、招募说明书
2. 定期报告、包括基金季度报告、中期报告和年度报告
3. 基金份额净值
4. 基金销售机构及联系方式
5. 其他重要资料