

# 摩根士丹利华鑫强收益债券型证券投资基金

## 基金产品资料概要更新

编制日期：2023 年 5 月 24 日

送出日期：2023 年 5 月 25 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	大摩强收益债券	基金代码	233005
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	中国银行股份有限公司
基金合同生效日	2009 年 12 月 29 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	施同亮	开始担任本基金基金经理的日期	2021 年 9 月 28 日
		证券从业日期	2010 年 7 月 1 日

### 二、基金投资与净值表现

#### (一) 投资目标与投资策略

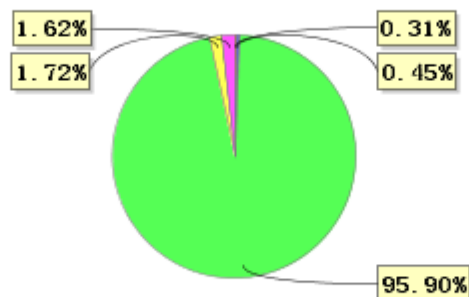
详见《招募说明书》第十部分“基金的投资”

投资目标	本基金的投资目标是在严格控制风险的前提下审慎投资、主动管理，寻求最大化的总回报，包括当期收益和资本增值。
投资范围	本基金的投资对象包括国内依法发行上市的债券、股票、权证以及法律、法规或监管机构允许基金投资的其它金融工具。 本基金对债券等固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 80%。基金可以投资的债券等固定收益类资产包括国债、金融债、企业债、公司债、资产支持证券、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、浮动利率债券、债券回购、银行存款、大额存单以及法律法规或监管机构允许基金投资的其它固定收益类金融工具。本基金还可以通过一级市场股票、可转换债券等参与权益类投资，持有因一级市场购入、可转换债券转股所形成的股票，持有股票派发或可转换债券分离交易的权证等资产，但不直接从二级市场购入股票或权证。本基金投资于非固定收益类资产（股票、权证等）的比例不超过基金资产的 20%，持有现金或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。
主要投资策略	本基金的资产配置以投资债券等固定收益类资产为主，并着重投资于信用类固定收益证券和适当投资低风险非固定收益证券，在综合考虑基金组合的流动性需求、本金安全和投资风险控制的基础上，根据市场中投资机会的相对价值和风险决定现金类资产、非现金类固定收益资产和低风险非固定收益类资产的具体比例。 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

	<p>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。本基金着重投资于承载一定信用风险、收益率相对较高的投资级信用类固定收益证券，以增强基金的收益。此外，本基金还可以利用回购进行无风险套利和在严格控制风险的前提下适当使用杠杆以获取增强收益。</p> <p>对于非固定收益投资，本基金根据对股票市场趋势的判断，积极寻找和仔细评估可转换债券和一级市场股票的投资机会，在严格控制投资风险的基础上审慎投资，通过权益类投资获取额外的增强收益。</p>
业绩比较基准	中债综合指数
风险收益特征	本基金属债券型证券投资基金，其长期平均风险和预期收益低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

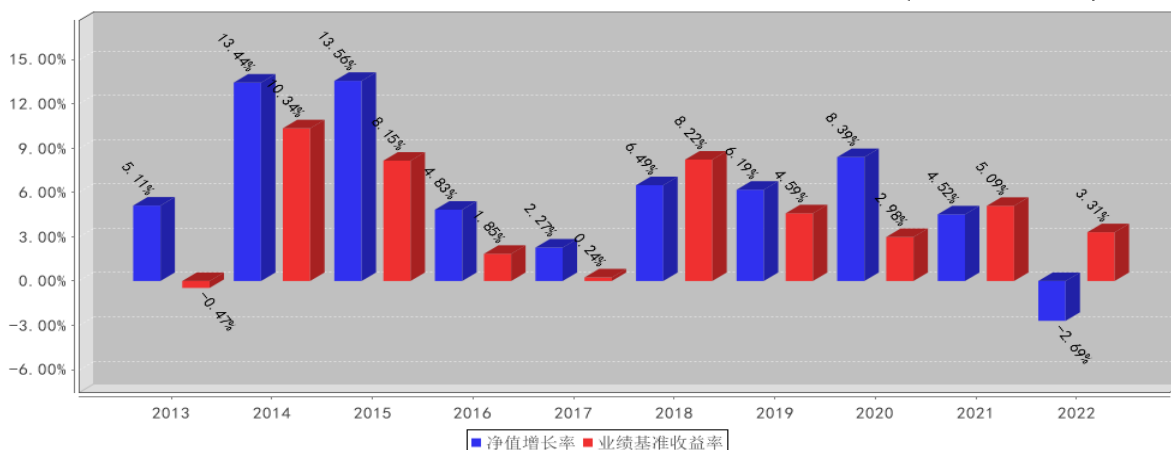
投资组合资产配置图表(2023年3月31日)



- 买入返售金融资产 ● 其他资产 ● 固定收益投资 ● 权益投资
- 银行存款和结算备付金合计

(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

大厚强收益债券基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图(2022年12月31日)



注:业绩表现截止日期 2022 年 12 月 31 日。基金过往业绩不代表未来表现。

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) /持有期限 (N)	收费方式/费率
申购费 (前收费)	M < 100 万	0.8%
	100 万 ≤ M < 500 万	0.5%
	M ≥ 500 万	1,000 元/笔
赎回费	N < 7 日	1.5%
	7 日 ≤ N < 365 日	0.1%
	365 日 ≤ N < 730 日	0.05%
	N ≥ 730 日	0%

#### 申购费

本基金对于通过本公司直销中心申购本基金的养老金客户实施特定申购费率。费率详见《招募说明书》。

#### (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	0.70%
托管费	0.20%

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。

(3) 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