

(上接 D111 版)
(77)上海凯石财富基金销售有限公司
(78)上海浦东区西康南路765号602-115室
办公地址:上海市浦东新区延安东路1号凯石大厦4楼
法定代表人:陈德武
联系人:李瑞明
联系电话:021-63333319
客户服务热线:4000 178 000
网址:www.vstonewealth.com

(79)深圳富济基金销售有限公司
(注册/办公)地址:深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3088号中海大厦
3203单元
法定代表人:刘鹏宇
联系人:刘勇
联系电话:0755-83999077-8814
客户服务热线:0755-83999077
网址:www.fundm.com

(80)北京致隆基金销售有限公司
(79)北京致隆基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
办公地址:北京市海淀区丹棱街6号丹棱 SOHO 大厦1008
法定代表人:赵荣春
联系人:陈静
联系电话:010-57418813
客户服务热线:400-893-6885
网址:www.qianjin.com

(81)上海利得基金销售有限公司
(80)上海利得基金销售有限公司
注册地址:上海市宝山区蕴川路5475号1033室
办公地址:上海市虹口区东大名路1098号浦江金融世纪广场18层
法定代表人:李兴春
联系人:陈洁
联系电话:021-60195121
客户服务热线:400-921-7755
网址:www.leadfund.com.cn

(82)珠海盈米基金销售有限公司
(81)珠海盈米基金销售有限公司
注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203
法定代表人:肖雯
联系人:黄敏娟
联系电话:020-89629099
客户服务热线:020-89629066
公司网址:www.yingmi.com

(83)中证金牛(北京)投资咨询有限公司
(82)中证金牛(北京)投资咨询有限公司
注册地址:北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室
办公地址:北京市宣武门外大街甲一号新华社第三工作区A座5层
法定代表人:钱昊旻
联系人:孙雯
联系电话:010-59335619
客户服务热线:4008-909-998
公司网址:www.jnlc.com

(84)大成基金财富管理有限公司
(83)大成基金财富管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区峨山路505号东方纯一大厦15楼
办公地址:上海市浦东新区峨山路505号东方纯一大厦15楼
法定代表人:姚桃
联系人:孟召臣
联系电话:021-20324176
客户服务热线:400-928-2266
网址:www.dcfunds.com

(85)上海汇成基金销售有限公司
(84)上海汇成基金销售有限公司
注册地址:南京市建邺区江东中路102号708室
办公地址:上海市浦东新区峨山路505号东方纯一大厦15楼
法定代表人:姚桃
联系人:孟召臣
联系电话:021-20324176
客户服务热线:400-928-2266
网址:www.dcfunds.com

(86)北京新永基基金销售有限公司
(85)北京新永基基金销售有限公司
注册地址:北京市昌平区回龙观镇西大街101号1108室
办公地址:北京市昌平区回龙观镇西大街101号1108室
法定代表人:杨任军
联系人:刘昕雨
联系电话:0755-29330513
客户服务热线:400-930-0660
网址:www.jfzwm.com

(87)上海万得基金销售有限公司
(86)上海万得基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址:上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼
法定代表人:王廷富
联系人:徐彦宇
联系电话:021-51327185
客户服务热线:400-821-0203
网址:www.52fund.com.cn

(88)北京新浪乐石基金销售有限公司
(87)北京新浪乐石基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室
办公地址:北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室
法定代表人:李昭琛
联系人:付文廷
联系电话:010-62676405
客户服务热线:010-62675369
网址:www.xincai.com

(89)北京恒天明泽基金销售有限公司
(88)北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址:北京市经济技术开发区安达北路10号5层5122室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路甲19号SOHO嘉盛中心30层
法定代表人:周斌
联系人:张静
联系电话:010-59313591
客户服务热线:4008-980-618
网址:www.chtfund.com

(90)济安财富(北京)基金销售有限公司
(89)济安财富(北京)基金销售有限公司
注册地址:北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室
办公地址:北京市朝阳区朝外大街甲6号万通中心D座28层
法定代表人:孙煜
联系人:杨茜
联系电话:010-58170963
客户服务热线:400-818-8866
网址:www.shengshihv.com

(91)北京肯瑞德基金销售有限公司
(90)北京肯瑞德基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15
办公地址:北京市亦庄经济开发区科创十一街18号A座17层
法定代表人:江卉
联系人:徐博
联系电话:010-89189285
客户服务热线:95118/400-088-8816
网址:http://fund.jd.com

(92)南京苏宁基金销售有限公司
(91)南京苏宁基金销售有限公司
注册地址:南京市玄武区苏宁大道1-5号
办公地址:南京市玄武区苏宁大道1-5号
法定代表人:钱昊旻
联系人:赵娜
联系电话:18551602256
客户服务热线:95177
网址:www.snjfund.com

(93)北京嘉实基金销售有限公司
(92)北京嘉实基金销售有限公司
注册地址:北京市西城区阜成门内大街7号4号楼40层4601室
办公地址:北京市朝阳区东三环中路7号4号楼40层4601室
法定代表人:杨茜
联系人:李海燕
联系电话:010-65309516
客户服务热线:400-673-7010
网址:www.jianfund.com

(94)上海云湾基金销售有限公司
(93)上海云湾基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层
法定代表人:戴新装
联系人:朱宇彤
联系电话:021-20530012
客户服务热线:400-820-1515
网址:www.zhengtongfunds.com

(95)通华财富(上海)基金销售有限公司
(94)通华财富(上海)基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区公平路667弄107号201室
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场杨高南路799号3号楼9楼
法定代表人:沈茜
联系人:李海燕
联系电话:021-60818588
客户服务热线:400-66-95156
网址:www.tonghuafund.com

(96)上海拓华基金销售有限公司
(95)上海拓华基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
法定代表人:冷飞
联系人:孙琦
联系电话:021-50810687
客户服务热线:021-50810673
网址:www.wacajin.com

(97)上海基煜基金销售有限公司
(96)上海基煜基金销售有限公司
注册地址:上海市崇明县长兴镇潘园公路1800号2号楼6153室(上海泰和经济发展区)
办公地址:上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室
法定代表人:王翔
联系人:李季涛
联系电话:021-63700777
客户服务热线:400-820-5369
网址:www.jiyufund.com.cn

(98)北京蛋卷基金销售有限公司
(97)北京蛋卷基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
办公地址:北京市朝阳区创远路34号院融新科技中心C座17层
法定代表人:钟斐斐
联系人:袁永涛
联系电话:010-61840688
客户服务热线:4000-618-518
网址:www.danjuanapp.com

(99)嘉实基金销售有限公司(深圳)有限公司
(98)嘉实基金销售有限公司(深圳)有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址:深圳市南山区海天二路33号腾讯滨海大厦15楼
法定代表人:刘明军
联系人:谭广华
联系电话:0755-86013388-80618
客户服务热线:95017(拨通后转1再转8)
网址:www.tengxunsi.com 或 www.tsfund.com

(100)上海华夏财富投资管理有限公司
(99)上海华夏财富投资管理有限公司
注册地址:上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室
办公地址:北京市朝阳区东三环中路39号建外SOHO A座31层
法定代表人:毛淮平
联系人:张楠怡
联系电话:010-88066184
客户服务热线:400-817-5666
网址:www.amcfund.com

办公地址:上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼
执行事务合伙人:李丹
联系电话:021-23218189
联系人:俞伟敏
经办注册会计师:许康玮、俞伟敏
四、基金的投资
本基金名称:摩根士丹利华鑫收益债券型证券投资基金
五、基金的投资目标
本基金的投资目标是:在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值,实现基金资产的增值和资本增值。

七、基金的投资方向
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、可转债等,各分类资产可转换。此外,基金还可投资于短期融资券、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。

八、基金的风险控制
本基金通过一级市场股票、可转债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,持有股票或可转债债券分离交易的权证等资产,但本基金不参与二级市场股票、可转债、权证、股票、可转债债券、权证等资产,且其比例不超过基金资产的20%。持有现金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。

(一)投资策略
本基金的投资策略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配置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、固定收益类资产和低风险非固定收益类资产的具体比例。
对于固定收益类资产,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值收益。

(二)利率预期策略
当市场利率上升时,固定收益证券的价格一般会下跌;反之,市场利率下降时,固定收益证券的价格一般会上升。证券的久期越长,证券价格随市场利率变动的幅度一般也越大。固定收益证券久期衡量证券价格对市场利率变化的敏感度,主要取决于证券的到期期限和票面利率;其它条件等同的情况下,到期期限越长,固定票面利率越低,久期越长。
本基金采用特有的利率预期模型,对经济增长和通货膨胀等经济因素进行研究分析,判断经济运行的周期特征,结合国家货币政策、财政政策、资金供求、国际环境等其他因素,在当前市场利率水平的基础上,预测未来一段时间市场利率水平的变动趋势,在市场利率水平上升前降低固定收益投资组合的平均久期以规避利率风险,下降前提高组合的平均久期,以获取超额收益的资本利得收益。

(三)信用风险评估策略
对于非国家发行或担保的固定收益证券,由于存在发行机构无能力按期偿付本金和利息的信用风险,其市场利率会高于同等条件的无信用风险的证券,这部分利差的差额被称为信用利差。信用利差会随发行机构偿付能力市场预期的变化而变化,导致有信用类风险的固定收益证券市场价格的波动。权威信用评级机构的评级对信用利差有重要影响。
本基金参考权威评级机构的信用评级,根据经济、行业和发行机构的现状和前景,采用特有的信用分析模型对各种有信用风险的固定收益证券的发行机构及证券本身进行信用评级,分析违约和损失的概率变化趋势。同时,本基金结合信用利差的历史统计数据,判断当前信用利差的合理性,相对投资价值,结合信用利差化投资组合的信用质量配置,选择最具有投资价值的品种,通过信用利差获取超额的投资收益。

(四)资产支持证券投资策略
资产支持证券包括信贷资产支持证券和企业资产支持证券。根据目前监管机构的规定,基金只能投资信用评级在BBB及以上级别的资产支持证券,并且投资比例不超过基金净值的20%。本基金在综合分析资产支持证券的资产质量和构成、证券的条款、利率风险、信用评级、流动性和提前偿付速度等因素的基础上,评估证券的相对投资价值并作出相应的投资决策。资产支持证券投资也是本基金增强收益的策略之一。

(五)其他辅助策略
除了以上所述的主要投资策略外,本基金积极寻找固定收益市场其它具有吸引力的辅助投资机会,在考虑投资组合总体策略和控制投资风险的基础上采用适当的方法获取额外的增值收益。可利用的辅助投资策略包括但不限于:
1. 骑乘收益率曲线
收益率曲线向上倾斜的情况下,购买收益率曲线最陡峭处顶端的债券,通过随期限缩短,收益率率下降导致债券价格的上漲获取额外资本利得。
2. 跨市场套利
利用同一债券在不同市场(银行或交易所市场、一级或二级市场)交易价格的差异套利。
3. 跨期套利
通过期限相近的品种由于某些特性(市场供需、流动性或赋税等)不同而导致的收益率率差异套利。
4. 非固定收益投资策略
本基金主要通过投资可转换债券(包括可分离交易品种)间接投资权益,可持有股票或可转债分离交易品种的权证,但持有比例不超过基金净值的3%。可转换债券实际上是一种普通公司(企业)债券和认股权证的合成品;转股价格为转权的行权价,权证的数量为转股比例,而转股期限为权证的期限。
本基金对可转换债券权证部分发行主体的基本面、标的股票的价格和转股条款(包括回售和赎回等)深入分析,利用期权定价模型对权证部分进行估值;同时对标的债券部分确定收益分析方法进行估值;在考虑组合总体投资策略的基础上选择相对投资价值较高的可转换债券投资。

(六)组合构建
本基金根据投资委员会确定的总体投资策略和原则以及研究团队提供的分析和投资建议等信息,在遵守基金合同的前提下,在投资决策委员会的授权范围内构建具体的投资组合,进行组合的日常管理。
(7)交易执行
本基金实行集中交易制度。交易团队负责执行基金经理投资指令,同时承担一线风险监控职责。
(8)风险与绩效评估
投资管理团队由风险管理部和监察稽核部组成,风险管理部定期或不定期地对基金投资绩效及风险进行评估;监察稽核部对基金投资的合规性进行日常监控;风险管理委员会定期召开会议,结合市场、法律等环境的变化,对基金投资组合进行风险评估,并提出风险防范措施及意见。

(九)组合调整
基金管理人根据投资业绩、证券市场和上市公司的发展变化,基金申购和赎回的现金流量情况以及组合风险与绩效评估的结果,对投资组合进行动态调整。
本基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下,有权根据市场环境变化和实际需要调整上述投资策略,并在更新的招募说明书中公告。
十、基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准 = 中债综合指数
中债综合指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制,是以2001年12月31日为基期,基点为100点,并于2002年12月31日发布。中债综合指数的样本具有广泛的行业代表性,涵盖主要交易市场(银行间市场、交易所市场等)、不同发行主体(政府、企业等)和期限(长期、中期、短期)等,能够很好地反映中国债券市场总体价格水平及变动趋势,适合作为本基金业绩比较基准的业绩比较基准。
如未来由于市场变化导致本基金业绩比较基准与本基金的投资目标、投资策略、风险收益特征等不相匹配,本基金管理人可以在与托管人协商一致并报中国证监会备案后,适当调整业绩比较基准并及时公告。
十一、基金的风险收益特征
本基金属债券型证券投资基金,长期平均风险和预期收益低于股票和混合型基金,高于货币型基金。
十二、基金的投资组合报告
基金管理人、基金托管人、基金销售机构在履行适当程序后,可以将其纳入披露范围。

在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。本投资组合报告期数据截至2019年6月30日,本投资组合所列财务数据未经审计。
1、报告期末基金资产组合情况
序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)
1 权益投资 31,336,596.93 0.58
其中:股票 31,336,596.93 0.58
2 基金投资 - -
3 固定收益投资 5,060,908,643.85 94.08
其中:债券 5,060,908,643.85 94.08
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 85,166,981.58 1.58
8 其他资产 201,964,206.22 3.75
9 合计 5,379,376,428.58 100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合
代码 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
A 农林、牧、渔 - -
B 采矿业 - -
C 制造业 23,013,471.93 0.57
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 - -
E 建筑业 - -
F 批发和零售业 - -
G 交通运输、仓储和邮政业 - -
H 住宿和餐饮业 - -
I 信息技术、软件和信息技术服务业 - -
J 金融业 8,323,125.00 0.21
K 房地产业 - -
L 租赁和商务服务业 - -
M 科学研究和技术服务业 - -
N 水利、环境和公共设施管理业 - -
O 国民服务、修理和其他服务业 - -
P 教育 - -
Q 卫生和社会工作 - -
R 文化、体育和娱乐业 - -
S 综合 - -
合计 31,336,596.93 0.78

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
1 603228 鼎捷电子 575,193 23,013,471.93 0.57
2 601128 常熟银行 1,078,125 8,323,125.00 0.21

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合
序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
1 国债债券 69,830,101.60 1.73
2 央行票据 - -
3 金融债券 129,990,000.00 3.23
其中:政策性金融债 129,990,000.00 3.23
4 企业债 1,593,009,473.00 39.55
5 企业短期融资券 2,167,257,500.00 53.80
6 中期票据 722,594,000.00 17.94
7 可转债(可交换债) 378,227,569.25 9.39
8 同业存单 - -
9 其他 - -
10 合计 5,060,908,643.85 125.63

5、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债券投资明细
序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
1 011801960 18鲁钢铁 SCP016 1,000,000 100,700,000.00 2.50
2 011902023 19闽海峡 SCP001 1,000,000 100,340,000.00 2.49
3 011900863 19广州国资 SCP001 1,000,000 99,940,000.00 2.48
4 041800371 18文鸟国资 CP001 900,000 90,765,000.00 2.25
5 011801988 18陕交建 SCP004 800,000 80,448,000.00 2.00

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
序号 证券代码 证券名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
1 011801960 18鲁钢铁 SCP016 1,000,000 100,700,000.00 2.50
2 011902023 19闽海峡 SCP001 1,000,000 100,340,000.00 2.49
3 011900863 19广州国资 SCP001 1,000,000 99,940,000.00 2.48
4 041800371 18文鸟国资 CP001 900,000 90,765,000.00 2.25
5 011801988 18陕交建 SCP004 800,000 80,448,000.00 2.00

7、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
序号 名称 金额(元)
1 存出保证金 123,849.85
2 应收债券清算款 96,200,486.48
3 应收股利 -
4 应收利息 104,218,930.85
5 应收申购款 1,420,939.04
6 其他应收款 -
7 待摊费用 -
8 其他 -
9 合计 201,964,206.22

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
序号 债券代码 债券名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
1 110049 瀚尔转债 50,576,512.00 1.26
2 113011 光大转债 44,444,000.00 1.10
3 128024 宁行转债 43,771,642.20 1.09
4 113013 国君转债 42,086,778.00 1.04
5 113019 玲珑转债 39,182,363.80 0.97
6 110042 航电转债 28,188,460.00 0.70
7 120029 蓝源转债 22,839,457.74 0.57
8 132004 15国盛EB 19,706,000.00 0.49
9 128047 国盛转债 19,597,474.38 0.49
10 128020 水晶转债 16,847,742.99 0.42
11 113516 苏农转债 11,363,928.80 0.28
12 128022 众信转债 6,479,200.00 0.16
13 128034 江银转债 2,140,600.00 0.05
14 128048 聚兴转债 2,098,400.00 0.05
15 128045 机电转债 1,866,139.52 0.05
16 113504 艾华转债 221,275.70 0.01

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。
十二、基金的业绩
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,基金过往业绩并不代表其未来表现。
投资组合业绩:投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
1. 自基金合同生效以来至2019年6月30日,本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益对比表:
阶段 份额净值增长率① 份额净值增长率基准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准差④ ①-③ ②-④
自基金合同生效日起至2009年12月31日 0.00% 0.00% 0.04% 0.00% -0.04% 0.00%
自2010年1月1日至2010年12月31日 10.36% 0.21% 2.05% 0.07% 8.31% 0.14%
自2011年1月1日至2011年12月31日 -1.07% 0.19% 5.33% 0.08% -6.40% 0.11%
自2012年1月1日至2012年12月31日 9.05% 0.17% 3.60% 0.06% 5.45% 0.11%
自2013年1月1日至2013年12月31日 5.11% 0.35% -0.47% 0.09% 5.58% 0.26%
自2014年1月1日至2014年12月31日 13.44% 0.16% 10.34% 0.11% 3.10% 0.05%
自2015年1月1日至2015年12月31日 13.56% 0.23% 8.15% 0.08% 5.41% 0.15%
自2016年1月1日至2016年12月31日 4.83% 0.06% 1.85% 0.09% 2.98% -0.03%
自2017年1月1日至2017年12月31日 2.27% 0.03% 0.24% 0.06% 2.03% -0.03%
自2018年1月1日至2018年12月31日 6.49% 0.06% 8.22% 0.07% -1.73% -0.01%
自2019年1月1日至2019年6月30日 2.26% 0.07% 1.82% 0.06% 0.44% 0.01%
自基金合同生效日起至2019年6月30日 88.21% 0.18% 48.87% 0.08% 39.34% 0.10%

2. 自基金合同生效以来基金业绩累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益对比表
阶段 基金业绩累计净值增长率① 基金业绩比较基准收益率② ①-②
自基金合同生效日起至2009年12月31日 0.00% 0.04% -0.04%
自2010年1月1日至2010年12月31日 10.36% 2.05% 8.31%
自2011年1月1日至2011年12月31日 -1.07% 5.33% -6.40%
自2012年1月1日至2012年12月31日 9.05% 3.60% 5.45%
自2013年1月1日至2013年12月31日 5.11% -0.47% 5.58%
自2014年1月1日至2014年12月31日 13.44% 10.34% 3.10%
自2015年1月1日至2015年12月31日 13.56% 8.15% 5.41%
自2016年1月1日至2016年12月31日 4.83% 1.85% 2.98%
自2017年1月1日至2017年12月31日 2.27% 0.24% 2.03%
自2018年1月1日至2018年12月31日 6.49% 8.22% -1.73%
自2019年1月1日至2019年6月30日 2.26% 1.82% 0.44%

十三、基金费用与税收
(一)基金运作有关费用
1. 基金管理人的管理费;
(1)基金管理人的管理费;
(2)基金托管人的托管费;
(3)因基金的证券交易或结算而产生的费用(包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等);
(4)基金合同生效日后的信息披露费;
(5)基金份额持有人大会费用;
(6)基金合同生效日后的会计师费和律师费;
(7)基金资产的审计汇划费用;
(8)按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。
2. 基金费用计提方法、计提标准和支付方式
(1)基金管理人的管理费
基金管理人按基金资产净值的0.7%年费率计提。
在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的0.7%年费率计提。计算方法如下:
H = E × 0.7% ÷ 当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值
基金管理费每日计提,按月支付。经基金管理人及基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。
(2)基金托管人的托管费
基金托管人按基金资产净值的0.2%年费率计提。
在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.2%年费率计提。计算方法如下:
H = E × 0.2% ÷ 当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日基金资产净值
基金托管费每日计提,按月支付。经基金管理人及基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。
(3)本基金第一(一)款第3至第8项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定,列入或摊入当期基金费用。
(二)与基金销售有关的费用
1. 申购费用
本基金以申购金额为基数采用比例费率计算申购费,投资人在一天内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。申购费用由投资人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。
本基金自2013年11月1日起,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。养老金客户指基本养老金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老保险金,包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方和行业社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划,如将来出现经养老金监管部门认可的新的养老金客户类型,基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围,并按规定向中国证监会备案。
通过基金管理人的直销中心申购本基金基金份额的养老金客户申购费率见下表:
申购金额(M) 申购费率
M<=100元 0.32%
100元<M<=500元 0.2%
M≥500元 每笔1000元
除养老金客户外的其他投资者申购本基金基金份额申购费率见下表:
申购金额(M) 申购费率
M<=100元 0.80%
100元<M<=500元 0.50%
M≥500元 每笔1000元
申购费用=申购金额-净申购金额
净申购金额=(1-申购费率)×申购金额/(1-申购费率)
本基金的申购费用由基金投资人承担,计算方式如下:
转出金额=转出份额×转出基金当日基金份额净值
转出基金赎回费=转出金额×转出基金赎回费率
申购补差费=转入总金额×申购补差费率/(1+申购补差费率)
转换费用=转出基金赎回费+申购补差费
(1)对于实行级差申购费率(不同申购金额对应不同申购费率)的基金,以转入总金额对应的转出基金申购费率、转入基金申购费率计算申购补差费用。
(2)转出基金赎回费不低于25%的部分归入转出基金资产。
(3)计算基金赎回费用所涉及的申购费用和赎回费用均按基金合同、招募说明书及相关公告的费率费率执行,对于通过本公司网上交易、费率优惠活动期间发生的基金转换业务,按照本公司最新公告的相关费率计算基金转换费用。
基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式,并最迟应于新的费率或收费方式实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。
(三)不列入基金费用的项目
本条第一(一)款约定以外的其他费用,以及基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失,以及处理与基金运作无关的事项而发生的费用均不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。
(四)基金管理费和基金托管费的调整
基金管理人及基金托管人可协商调低基金管理费、基金托管费,无须召开基金份额持有人大会。
(五)税收
基金运作过程中涉及的各项纳税主体,依照国家法律法规的规定履行纳税义务。
十四、对招募说明书更新部分的说明
摩根士丹利华鑫基金管理有限公司依据《基金法》、《运作管理办法》、《销售管理办法》、《信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,对2019年8月9日刊登的《摩根士丹利华鑫收益债券型证券投资基金招募说明书(更新)》进行了更新,主要更新的内容如下:
序号 修改内容 说明
1 重要提示 更新了本招募说明书重要提示内容,以及所载内容截止日期
2 第一部分 前言 修改相关法律法规名称
3 第二部分 释义 根据基金合同修改相关释义
4 第三部分 基金管理人 根据基金合同修改相关表述
5 第八部分 基金份额的申购、赎回与转换 根据基金合同修改相关表述
6 第十四部分 基金的收益与分配 根据基金合同修改相关表述
7 第十五部分 基金费用与税收 根据基金合同修改相关表述
8 第十六部分 基金的会计与审计 根据基金合同修改相关表述
9 第十七部分 基金的信息披露 根据基金合同修改与基金的信息披露相关的表述
10 第十八部分 风险揭示 根据最新情况更新风险提示
11 第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算 根据基金合同修改相关表述
12 第二部分 基金合同的的内容摘要 根据基金合同的修订相应修改基金合同的内容摘要
13 第二十一部分 基金托管协议的内容摘要 根据托管协议的修订相应修改基金合同的内容摘要

摩根士丹利华鑫收益债券型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图:
(2009年12月29日至2019年6月30日)
大摩收益债券基金业绩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:本基金业绩比较基准 = 中债综合指数

十三、基金费用与税收
(一)基金运作有关费用
1. 基金管理人的管理费;
(1)基金管理人的管理费;
(2)基金托管人的托管费;
(3)因基金的证券交易或结算而产生的费用(包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等);
(4)基金合同生效日后的信息披露费;
(5)基金份额持有人大会费用;
(6)基金合同生效日后的会计师费和律师费;
(7)基金资产的审计汇划费用;
(8)按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。
2. 基金费用计提方法、计提标准和支付方式
(1)基金管理人的管理费
基金管理人按基金资产净值的0.7%年费率计提。
在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的0.7%年费率计提。计算方法如下:
H = E × 0.7% ÷ 当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值
基金管理费每日计提,按月支付。经基金管理人及基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。
(2)基金托管人的托管费
基金托管人按基金资产净值的0.2%年费率计提。
在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.2%年费率计提。计算方法如下:
H = E × 0.2% ÷ 当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日基金资产净值
基金托管费每日计提,按月支付。经基金管理人及基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。
(3)本基金第一(一)款第3至第8项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定,列入或摊入当期基金费用。
(二)与基金销售有关的费用
1. 申购费用
本基金以申购金额为基数采用比例费率计算申购费,投资人在一天内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。申购费用由投资人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。
本基金自2013年11月1日起,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。养老金客户指基本养老金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老保险金,包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方和行业社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划,如将来出现经养老金监管部门认可的新的养老金客户类型,基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围,并按规定向中国证监会备案。
通过基金管理人的直销中心申购本基金基金份额的养老金客户申购费率见下表:
申购金额(M) 申购费率
M<=100元 0.32%
100元<M<=500元 0.2%
M≥500元 每笔1000元
除养老金客户外的其他投资者申购本基金基金份额申购费率见下表:
申购金额(M) 申购费率
M<=100元 0.80%
100元<M<=500元 0.50%
M≥500元 每笔1000元
申购费用=申购金额-净申购金额
净申购金额=(1-申购费率)×申购金额/(1-申购费率)
本基金的申购费用由基金投资人承担,计算方式如下:
转出金额=转出份额×转出基金当日基金份额净值
转出基金赎回费=转出金额×转出基金赎回费率
申购补差费=转入总金额×申购补差费率/(1+申购补差费率)
转换费用=转出基金赎回费+申购补差费
(1)对于实行级差申购费率(不同申购金额对应不同申购费率)的基金,以转入总金额对应的转出基金申购费率、转入基金申购费率计算申购补差费用。
(2)转出基金赎回费不低于25%的部分归入转出基金资产。
(3)计算基金赎回费用所涉及的申购费用和赎回费用均按基金合同、招募说明书及相关公告的费率费率执行,对于通过本公司网上交易、费率优惠活动期间发生的基金转换业务,按照本公司最新公告的相关费率计算基金转换费用。
基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式,并最迟应于新的费率或收费方式实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。
(三)不列入基金费用的项目
本条第一(一)款约定以外的其他费用,以及基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失,以及处理与基金运作无关的事项而发生的费用均不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。
(四)基金管理费和基金托管费的调整
基金管理人及基金托管人可协商调低基金管理费、基金托管费,无须召开基金份额持有人大会。
(五)税收
基金运作过程中涉及的各项纳税主体,依照国家法律法规的规定履行纳税义务。
十四、对招募说明书更新部分的说明
摩根士丹利华鑫基金管理有限公司依据《基金法》、《运作管理办法》、《销售管理办法》、《信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,对2019年8月9日刊登的《摩根士丹利华鑫收益债券型证券投资基金招募说明书(更新)》进行了更新,主要更新的内容如下:
序号 修改内容 说明
1 重要提示 更新了本招募说明书重要提示内容,以及所载内容截止日期
2 第一部分 前言 修改相关法律法规名称
3 第二部分