

# 摩根士丹利进取优选股票型证券投资基金

## 基金产品资料概要更新

编制日期：2023 年 10 月 16 日

送出日期：2023 年 10 月 17 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	大摩进取优选股票	基金代码	000594
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
基金合同生效日	2014 年 5 月 29 日	上市交易所及上市日期	暂未上市
基金类型	股票型	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	缪东航	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	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

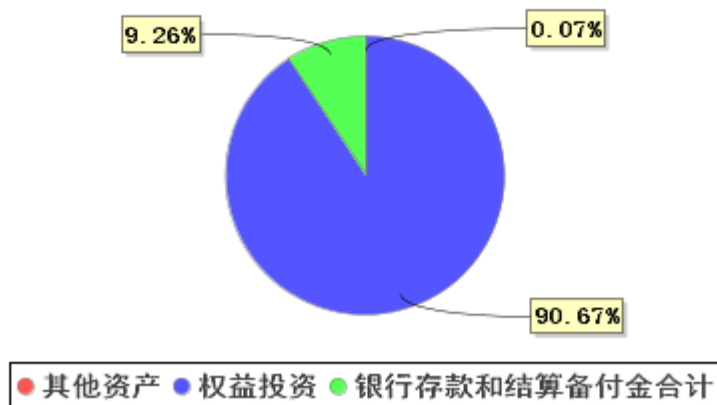
详见《招募说明书》第九部分“基金的投资”

投资目标	在适度控制风险并保持良好流动性的前提下，以进取型策略，选择趋势向上的行业里的具有高度进取精神并拥有一流团队、一流创新能力的优质公司作为投资对象，力争获取超越业绩比较基准的中长期稳定收益。
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，包括国内依法发行上市的股票、债券、权证、货币市场工具以及法律、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的相关规定）。 本基金投资组合的资产配置：股票投资占基金资产的比例为 80%-95%，其中投资于进取优选相关股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；权证投资占基金资产净值的比例不高于 3%；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。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。
主要投资策略	1、大类资产配置策略 从宏观经济、宏观政策、基本面和流动性等四个纬度进行综合分析，在把握经济周期性波动的基础上，动态评估不同资产类在不同时期的投资价值、投资时机以及其风险收益特征，追求股票、债券和货币等大类资产的动态配置及资产的稳健增长。 2、股票投资策略 (1) 行业配置策略

	<p>从经济周期、行业政策和行业基本面指标三个方面评估行业发展趋势，在此基础上判断行业的可持续发展能力，作为本基金行业配置的依据。</p> <p>(2) 个股选择策略</p> <p>采用“自下而上”的个股优选策略，坚持以深入细致的基本面研究为选股的基本原则，投资于具备以下几方面优选特质的上市企业：1) 该企业处于趋势向上的优质行业；2) 该企业为所处行业内最优质的公司；3) 该企业具有激励充分的一流管理团队。依靠定量分析与定性分析相结合的方法对个股进行选择。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>将结合宏观经济变化趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，运用利率预期、久期管理、收益率曲线等投资管理策略，权衡到期收益率与市场流动性构建和调整债券组合，在追求投资收益的同时兼顾债券资产的流动性和安全性。</p> <p>4、权证投资策略</p> <p>在确保与基金投资目标相一致的前提下，通过对权证标的证券的基本面研究，并结合权证定价模型估计权证价值，本着谨慎和风险可控的原则，为取得与承担风险相称的收益，投资于权证。</p>
<p><b>业绩比较基准</b></p>	<p>沪深 300 指数收益率×85%+标普中国债券指数收益率×15%</p>
<p><b>风险收益特征</b></p>	<p>本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金</p>

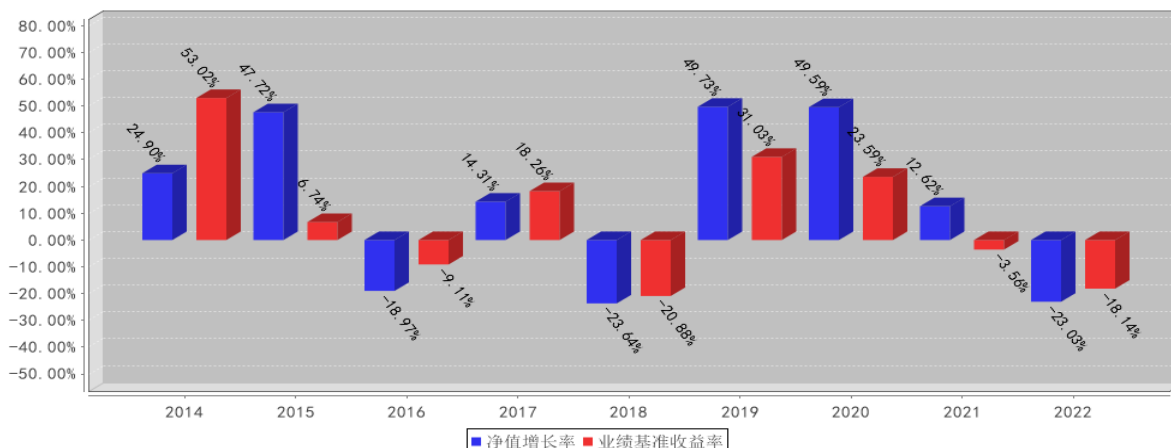
(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表 (2023年3月31日)



(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

大摩进取优选股票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:1、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。

2、本基金基金合同生效日为 2014 年 05 月 29 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) /持有期限 (N)	收费方式/费率
申购费 (前收费)	M<100 万	1.5%
	100 万≤M<500 万	1.0%
	M≥500 万	1,000 元/笔
赎回费	N<7 日	1.5%
	7 日≤N<30 日	0.75%
	30 日≤N<365 日	0.5%
	365 日≤N<730 日	0.25%
	N≥730 日	0%

注：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	1.20%
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、诉讼费、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) 本基金为股票型基金，在投资管理中会至少维持 80%的股票投资比例，具有对股票市场的系统性风险，不能完全规避市场下跌的风险和个股下跌风险，在市场大幅上涨时也不能保证基金净值能够完全跟随或超越市场上涨幅度。本基金在股票投资中重点投资于进取优选相关股票，这种评估具有一定的主观性，将在个股投资决策中给基金带来一定的不确定性的风险。该类型股票的波动会受到宏观经济环境、行业周期和公司自身经营状况等因素的影响，因此，本基金整体表现在特定时期内可能低于其他基金。基于投资范围的规定，本基金的波动性可能较高，市场风险和流动性风险可能更大。

#### (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) 本基金投资科创板的风险

本基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于科创板或选择不将基金资产投资于科创板，基金资产并非必然投资于科创板。

科创板股票在发行、上市、交易、退市制度等方面的规则与其他板块不同，除与其他投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临以下风险：

1) 流动性风险：由于科创板股票的投资者门槛较高，股票流动性弱于 A 股其他板块，投资者可能在特定阶段对科创板个股形成一致性预期，因此存在基金持有股票无法正常交易的风险。

2) 退市风险：科创板的退市标准将比 A 股其他板块更加严格，且不再设置暂停上市、恢复上市和重新上市等环节，因此上市公司退市风险更大，可能给基金净值带来不利影响。

3) 系统性风险：科创板企业均为市场认可度较高的科技创新企业，在企业经营及盈利模式上存在趋同，所以科创板个股相关性较高，市场表现不佳时，系统性风险将更为显著。

4) 交易价格波动风险：科创板股票竞价交易设置较宽的涨跌幅限制，首次公开发行上市的股票，上市后的前 5 个交易日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为 20%，较宽的涨跌幅限制可能使得股票价格产生较大波动，从而导致本基金净值出现较大波动的风险。

(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注册，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【<https://www.morganstanleyfunds.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