

摩根士丹利多元收益债券型证券投资基金 2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 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

报告送出日期：2026 年 10 月 26 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大摩多元收益债券
基金主代码	233012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 8 月 28 日
报告期末基金份额总额	74,148,768.66 份
投资目标	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和权益类资产，力争使投资者获得长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金按照自上而下的方法，通过综合分析国内外宏观经济态势、法规政策、利率走势、资金供求关系、证券市场走势、流动性风险、信用风险等因素，研判各类固定收益类资产的投资机会，以及参与新股申购、股票增发、可转换债券转股、股票二级市场交易等权益类投资工具类资产的投资机会。 本基金采用的主要普通债券投资策略包括：利率预期策略、收益率曲线策略、信用利差策略、公司/企业债

	券策略等。 本基金对公司/企业债券特有的风险进行综合分析和评估，结合市场利率变化趋势、久期配置、市场供需、组合总体投资策略和组合流动性要求等因素，选择相对投资价值较高的证券投资。此外，本基金还可以通过债券回购融入和滚动短期资金作为杠杆，投资于收益率高于融资成本的其它获利机会（包括期限较长或同期限不同市场的逆回购），以获取额外收益。 本基金主要采取定量与定性分析相结合的方法、行业配置与个股精选，投资于权益类投资工具类资产（股票、权证等）。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*15%+中债-综合财富(总值)指数收益率 *75%+中证可转换债券指数收益率*5%+活期存款基准利率*5%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其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。	
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	
下属分级基金的基金简称	大摩多元收益债券 A	大摩多元收益债券 C
下属分级基金的交易代码	233012	233013
报告期末下属分级基金的份额总额	46,794,508.11 份	27,354,260.55 份

注：自 2026 年 9 月 22 日起，本基金业绩比较基准由“标普中国债券指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%”调整为“沪深 300 指数收益率*15%+中债-综合财富(总值)指数收益率 *75%+中证可转换债券指数收益率*5%+活期存款基准利率*5%”。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日）	
	大摩多元收益债券 A	大摩多元收益债券 C

1. 本期已实现收益	111,049.98	28,495.37
2. 本期利润	-1,116,496.31	-660,988.31
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0233	-0.0238
4. 期末基金资产净值	61,408,078.02	34,958,800.70
5. 期末基金份额净值	1.3123	1.2780

注：1. 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。

2. 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。

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

大摩多元收益债券 A

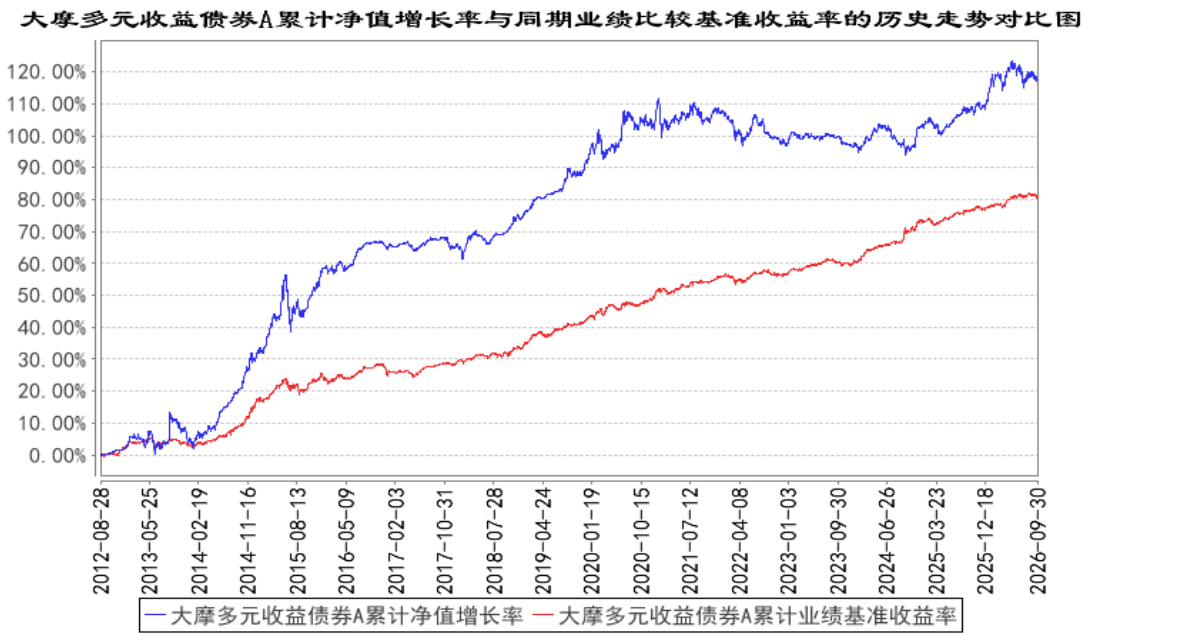
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	-1.73%	0.32%	-0.77%	0.14%	-0.96%	0.18%
过去六个月	0.99%	0.35%	1.41%	0.14%	-0.42%	0.21%
过去一年	4.08%	0.33%	2.10%	0.12%	1.98%	0.21%
过去三年	8.93%	0.25%	12.54%	0.12%	-3.61%	0.13%
过去五年	6.20%	0.24%	16.91%	0.12%	-10.71%	0.12%
过去七年	16.18%	0.27%	28.44%	0.13%	-12.26%	0.14%
过去十年	30.62%	0.25%	41.51%	0.13%	-10.89%	0.12%
自基金合同 生效起至今	117.49%	0.33%	80.32%	0.16%	37.17%	0.17%

大摩多元收益债券 C

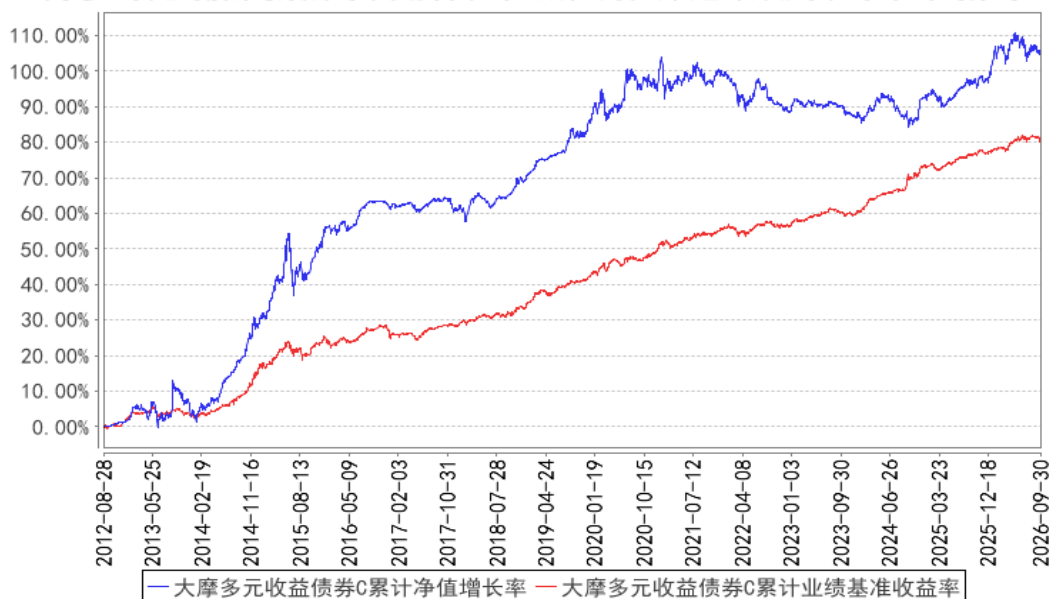
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	-1.84%	0.32%	-0.77%	0.14%	-1.07%	0.18%

过去六个月	0.79%	0.35%	1.41%	0.14%	-0.62%	0.21%
过去一年	3.67%	0.33%	2.10%	0.12%	1.57%	0.21%
过去三年	7.63%	0.25%	12.54%	0.12%	-4.91%	0.13%
过去五年	4.10%	0.24%	16.91%	0.12%	-12.81%	0.12%
过去七年	12.94%	0.27%	28.44%	0.13%	-15.50%	0.14%
过去十年	25.38%	0.24%	41.51%	0.13%	-16.13%	0.11%
自基金合同 生效起至今	104.87%	0.33%	80.32%	0.16%	24.55%	0.17%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



大摩多元收益债券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



注：1、本基金合同于 2012 年 8 月 28 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的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

2、自 2026 年 9 月 22 日起，本基金业绩比较基准由“标普中国债券指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%”调整为“沪深 300 指数收益率×15%+中债-综合财富（总值）指数收益率×75%+中证可转换债券指数收益率×5%+活期存款基准利率×5%”。根据过往仓位情况，将基准中的股票资产的基准要素权重从 10%提高到 15%，将基准中的债券资产的基准要素权重从 90%降低到 80%，其中，将债券资产中的利率债及信用债的基准要素权重设置为 75%，增加 5%的可转债的基准要素权重，并增加 5%的现金类资产基准。在债券指数的选取方面，综合考虑基准指数与产品定位和投资风格的匹配度，同时兼顾考虑基准指数的表征性、认可度，以及基准指数券种、久期、信用等级分布特征等，将债券部分的指数由标普中国债券指数调整为中债-综合财富（总值）指数及中证可转换债券指数。中债-综合财富（总值）指数隶属于中债总指数族，该指数成份券包含除资产支持证券、美元债券、可转债以外剩余的所有公开发行且上市流通的债券，是一个反映境内人民币债券市场价格走势情况的宽基指数，是中债指数应用最广泛指数之一。中证可转换债券指数由在沪深证券交易所上市的可转换债券组成，以反映沪深交易所可转换债券的总体表现。以上两个债券指数更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。基金业绩比较收益率在调整前后期间分别根据相应的指标计算。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴慧文	固定收益投资部联席总监、基金经理	2024 年 08 月 20 日	-	14 年	武汉大学金融工程硕士。曾任长城证券股份有限公司固定收益部投资经理，安信证券资产管理有限公司资管公募部投资主办。2023 年 8 月加入本公司，曾任固定收益投资部总监助理、副总监，现任固定收益投资部联席总监兼基金经理。2024 年 3 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，2024 年 4 月至 2025 年 9 月担任摩根士丹利纯债稳定添利 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，2024 年 5 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基金经理，2024 年 8 月起担任摩根士丹利多元收益债券型证券投资基金基金经理，2024 年 11 月至 2026 年 1 月担任摩根士丹利中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金经理，2024 年 12 月起担任摩根士丹利稳丰利率债债券型证券投资基金基金经理，2025 年 8 月起担任摩根士丹利恒安 30 天持有期债券型证券投资基金基金经理，2025 年 11 月起担任摩根士丹利中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金基金经理，2025 年 12 月起担任摩根士丹利添益债券型证券投资基金基金经理，2026 年 1 月至 2026 年 9 月担任摩根士丹利恒利债券型证券投资基金的基金经理，2026 年 1 月起担任摩根士丹利双利增强债券型证券投资基金基金经理。
王卫铭	专户理财部投资副总监、投资经理兼基金经理	2024 年 11 月 20 日	-	19 年	武汉大学金融学硕士，特许金融分析师（CFA）。曾任深圳航空有限责任公司战略及股改专员、国信证券有限责任公司深圳泰然九路证券营业部投资顾问。2010 年 3 月加入本公司，历任市场发展部产品分析经理、投资总监业务助理、交易管理部交易员、专户理财部投资经理助理，现任专户理财部投资副总监、投资经理兼基金经理。2024 年 11 月起担任摩根士丹利多元收益债券型证券投资基金基金经理，2024 年 12 月起担任

					摩根士丹利领先优势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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
王卫铭	公募基金	2	377,927,167.64	2024 年 11 月 20 日
	私募资产管理计划	2	89,550,916.53	2013 年 01 月 11 日
	其他组合	-	-	-
	合计	4	467,478,084.17	-

注：1、王卫铭于 2026 年 7 月 31 日离任 1 只私募资产管理计划“摩根士丹利基金-长城证券富泽 1 号单一资产管理计划”；

2、“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

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）不同投资组合同向交

易的交易价差进行分析，未发现异常情况。

本报告期内，本基金管理人针对同一基金经理兼任私募资产管理计划投资经理管理的多个投资组合，加强了对投资指令、交易行为、非交易所竞价撮合业务的管理，加强了事后报告机制。同时，本基金管理人进一步加强基金经理兼任私募资产管理计划投资经理管理的多个投资组合在不同时间窗下反向交易和同向交易的交易价差监控的分析，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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年三季度债市整体震荡走强，超长端下行显著，收益率曲线整体趋于平坦。7 月在政策宽松预期带动下长端利率开启下行通道，8 月中旬行情进一步演绎，10 年期、30 年期国债收益率均下探至年内低点，月末小幅震荡回弹，9 月再度迎来做多窗口，跨季资金呵护叠加资金持续入场，以及地产等宽信用政策低于预期，超长债再度走强。行情整体由弱基本面、流动性呵护主导。

基本面而言，国内经济修复节奏偏弱，三季度 PMI 仅 9 月回到荣枯线以上。生产端保持韧性，规上工业增加值保持正增长，高新技术产业持续托底生产端，但内需修复乏力，地产投资、居民消费改善不及预期，三季度新增社融总量不及季节性，实体信贷需求偏弱，资金持续向债券资产沉淀，构成债市核心支撑。价格端 CPI 同比低位运行，PPI 仍偏弱，为货币政策偏松保留空间。

资金面上，央行延续适度宽松基调，灵活运用逆回购、MLF 对冲财政缴款和地方债发行等季节性压力，资金中枢整体平稳，DR001 和 DR007 维持在政策利率附近窄幅波动。但三季度为地方债净融资季节性高点，单月最大净融资规模破万亿，持续消耗银行体系超额准备金，叠加理财回表、债基阶段性赎回扰动，资金面波动有所放大，跨季时点资金利率短暂冲高。

政策面上，LPR 连续 16 个月持稳，价格型工具按兵不动，结构性工具加力，总量刺激相对克制。三季度专项债、超长期特别国债集中发行，加快形成实物工作量，同时市场稳增长政策预期平稳，未出现强刺激政策落地，利好债市多头格局延续。

权益部分，2026 年三季度对市场影响最大的宏观变量来自于地缘冲突升级推动国际油价逆转了第二季度的回落趋势并持续上行创出新高。与此同时，美国经济呈现出制造业过热的趋势，二者共同导致美联储 9 月份选择了加息，而作为全球资产定价锚的十年美债利率创出近二十年来

的新高。以上宏观变化在 7 月份导致了具有“高估值，远久期”特征的全球科技牛市行情出现大幅回撤，由于 A 股的拥挤程度更高，导致其 8-9 月份的科技板块反弹亦显乏力，而石油石化、煤炭、银行、非银金融、家电等行业中具有红利属性的防御资产则表现较好，成长板块中仅订单确定且筹码出清的医药行业获得正收益。

三季度本产品降低转债仓位到低位，增配超长债券，获取大类资产均衡超额收益。权益组合调整方向逐渐转向防御，一方面增加金融、油气、化工、煤炭板块等具有红利属性的资产配置，另一方面降低电子、电力设备等成长方向的配置比例。

展望四季度，内需偏弱、融资需求不足、政策发力低于预期，仍对债市形成支撑，而债市已经累积较多浮盈，提前定价了资金中枢低位趋稳、政策不及预期、内需较弱等综合定价，债市大概率在四季度初维持区间震荡格局，11 月进入持盈保泰窗口，机构或有止盈，12 月或有小幅迎开门红行情，具体幅度依据所在的点位定价幅度和赔率。在信用利差分位数较低环境下，信用品种跟随利率定价，进一步压低信用利差的幅度或有限。转债端目前百元溢价率已回归至年内低点，估值已不贵，未来走势依据权益贝塔的走势情况，鉴于流动性状态很难大幅改善，场内负债出清状态仍补充充分，四季度权益或有反弹，但仍是结构性机会为主。权益方面目前市场最大风险仍在于分母端的扰动，四季度油价和美债长端利率仍然是重点观察的市场变量，目前我们仍将以偏防御的权益投资策略进行应对，同时密切关注即将陆续披露的上市公司三季报带来的增量信息变化。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期截至 2026 年 9 月 30 日，本基金 A 类份额净值为 1.3123 元，份额累计净值为 2.1052 元，C 类份额净值为 1.2780 元，份额累计净值为 2.0037 元；报告期内 A 类基金份额净值增长率为-1.73%，C 类基金份额净值增长率为-1.84%，同期业绩比较基准收益率为-0.77%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 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	17,554,499.40	13.39

	其中：股票	17,554,499.40	13.39
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	87,711,100.68	66.88
	其中：债券	87,711,100.68	66.88
	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	-2,113.61	-0.00
	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	15,127,445.99	11.53
8	其他资产	10,758,023.50	8.20
9	合计	131,148,955.96	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	5,096,853.00	5.29
C	制造业	5,868,015.40	6.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	850,560.00	0.88
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	852,905.00	0.89
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	4,886,166.00	5.07
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	居民服务、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	17,554,499.40	18.22

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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	600309	万华化学	13,600	937,040.00	0.97
2	601328	交通银行	109,800	850,950.00	0.88
3	600803	新奥股份	44,300	850,560.00	0.88
4	601009	南京银行	69,300	830,214.00	0.86
5	600583	海油工程	112,900	747,398.00	0.78
6	002648	卫星化学	27,500	729,025.00	0.76
7	002128	电投能源	25,000	697,500.00	0.72
8	002475	立讯精密	14,100	696,963.00	0.72
9	601319	中国人保	80,800	644,784.00	0.67
10	601225	陕西煤业	24,700	642,941.00	0.67

5.4 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	国家债券	8,512,214.76	8.83
2	央行票据	-	-
3	金融债券	22,929,089.31	23.79
	其中：政策性金融债	22,929,089.31	23.79
4	企业债券	27,586,524.23	28.63
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	22,558,551.64	23.41
7	可转债（可交换债）	6,124,720.74	6.36
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	87,711,100.68	91.02

5.5 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	210210	21 国开 10	160,000	17,541,396.16	18.20
2	102580131	25 济南高新 MTN001	80,000	8,253,812.60	8.56
3	245616	26 先导 01	80,000	8,049,630.68	8.35
4	132580150	25 青城新能 GN002 (碳中和债)	75,000	7,724,899.32	8.02
5	102682430	26 泉州交通 MTN003	60,000	6,040,385.75	6.27

5.6 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：报告期内，本基金未参与国债期货交易；截至报告期末，本基金未持有国债期货合约。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本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

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。

5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	16,011.66
2	应收证券清算款	10,737,895.53
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	4,116.31
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	10,758,023.50

5.10.4 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	127056	中特转债	981,346.44	1.02
2	123176	精测转 2	561,600.39	0.58
3	113694	清源转债	368,042.82	0.38
4	127082	亚科转债	321,701.18	0.33
5	123107	温氏转债	286,543.03	0.30
6	113051	节能转债	260,768.53	0.27
7	118024	冠宇转债	214,391.00	0.22
8	127108	太能转债	206,267.71	0.21
9	127030	盛虹转债	200,082.73	0.21
10	123142	申昊转债	194,557.39	0.20
11	113652	伟 22 转债	192,560.18	0.20
12	127095	广泰转债	190,652.67	0.20
13	113059	福莱转债	181,316.71	0.19
14	123119	康泰转 2	136,426.71	0.14
15	110098	南药转债	116,799.58	0.12
16	113052	兴业转债	113,181.42	0.12
17	113655	欧 22 转债	107,878.39	0.11
18	123193	海能转债	101,058.53	0.10
19	123149	通裕转债	100,117.96	0.10
20	113058	友发转债	93,839.30	0.10
21	127040	国泰转债	79,844.72	0.08
22	113686	泰瑞转债	76,502.12	0.08
23	113054	绿动转债	69,978.93	0.07
24	123144	裕兴转债	67,925.71	0.07
25	113656	嘉诚转债	64,031.83	0.07
26	123253	永贵转债	63,753.55	0.07
27	127089	晶澳转债	59,382.22	0.06
28	118060	瑞可转债	58,810.75	0.06
29	113680	丽岛转债	52,861.13	0.05
30	118037	上声转债	48,603.79	0.05
31	123215	铭利转债	39,918.11	0.04
32	113677	华懋转债	31,089.95	0.03
33	111015	东亚转债	25,269.25	0.03
34	118056	路维转债	17,866.67	0.02

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大摩多元收益债券 A	大摩多元收益债券 C
报告期期初基金份额总额	48,669,293.90	27,807,000.20
报告期期间基金总申购份额	1,444,251.00	1,482,224.43
减:报告期期间基金总赎回份额	3,319,036.79	1,934,964.08
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	46,794,508.11	27,354,260.55

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：截至本报告期末，基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期，基金管理人未运用固有资金申购、赎回本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准本基金募集的文件；
- 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。

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

9.3 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

2026 年 10 月 26 日