太平洋证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划产品资料概要更新

编制日期：2022年09月09日

送出日期：2022年09月13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	太平洋证券六个月滚动持有债券	基金代码	980003
基金管理人	太平洋证券股份有限公司	基金托管人	兴业银行股份有限公司
基金合同生效日	2020年04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	契约型开放式	开放频率	每个交易日可申购;每笔份额每满6个月可赎回
基金经理	开始担任本基金基金经理的日期		证券从业日期
武媚	2020年04月26日		2014年10月13日

注：本报告所述“基金”也包括按照《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的要求进行变更后的证券公司大集合资产管理产品。太平洋证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划是由太平洋红珊瑚稳盈债券集合资产管理计划转型而来，经中国证券监督管理委员会机构部函[2020]711号文，准予变更。

二、 基金投资与净值表现

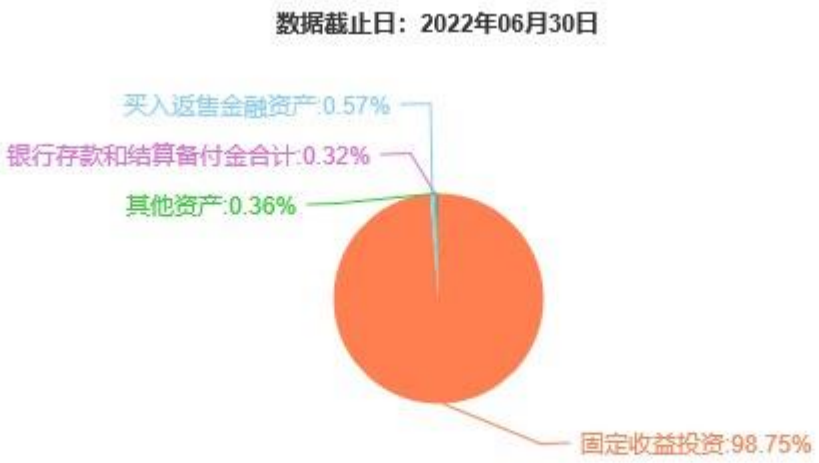
（一）投资目标与投资策略

投资者可阅读《太平洋证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书（更新）》“集合计划的投资”章节了解详细情况。

投资目标	在保持投资组合低风险和较高流动性的前提下，追求集合计划资产长期稳健的增值。
投资范围	本集合计划主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括债券（国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换公司债券、可交换债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单等以及法律法规或中国证监会允许本集合计划投资的其他金融工具。 本集合计划不直接投资股票；因可转换公司债券、可交换债券转股所得的股票，本集合计划将在其可交易之日起的10个交易日内卖出。 如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种，管理人在履行适

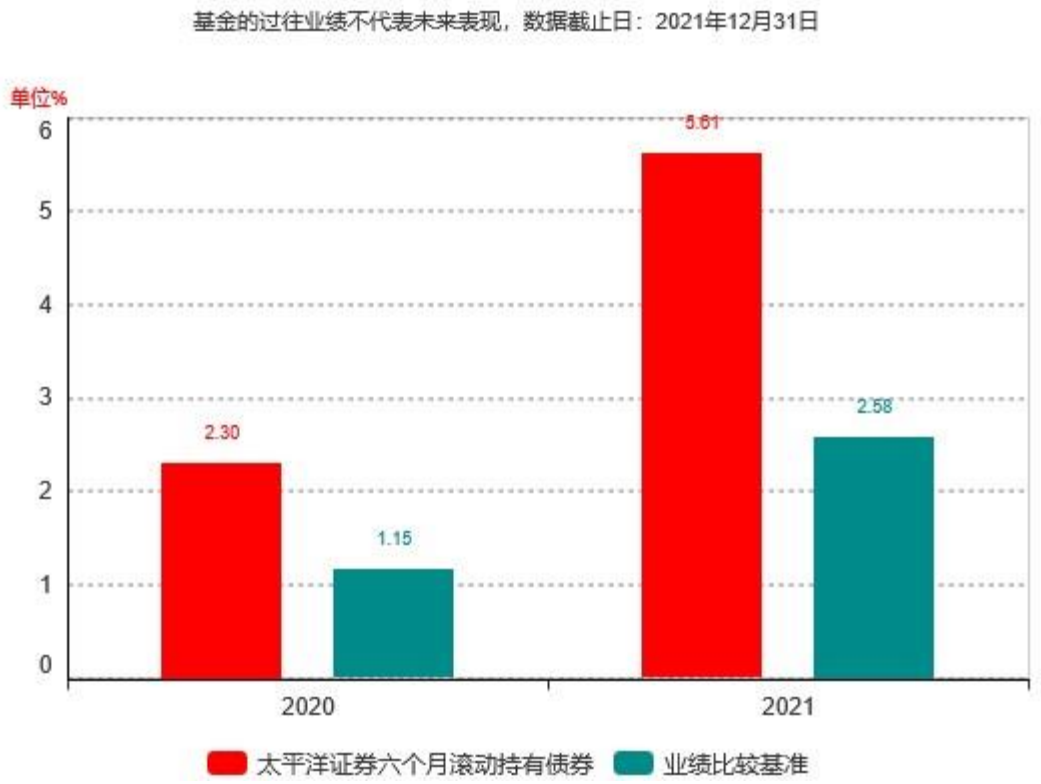
	当程序后，可以将其纳入投资范围。 本集合计划的投资组合比例为：债券资产的比例不低于集合计划资产的80%；本集合计划持有的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于集合计划资产净值的5%；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。 如果法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。
主要投资策略	本集合计划将密切关注宏观经济及债券市场运行情况，动态调整类属资产配置比例，并通过自下而上精选债券，获取优化收益。本集合计划采取的投资策略主要包括久期调整策略，收益率曲线配置策略，息差策略以及利率债、信用债、可转债、资产支持证券的投资策略。
业绩比较基准	中债综合财富(1年以下)指数收益率*80%+一年期定期存款利率(税后)*20%
风险收益特征	本集合计划为债券型集合计划，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和货币型集合计划，低于混合型基金、混合型集合计划、股票型基金和股票型集合计划。

（二）投资组合资产配置图表 / 区域配置图表



注：本集合计划合同生效日为2020年4月26日，集合计划类型为债券型。

（三）自基金合同生效以来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：本集合计划合同生效日为2020年4月26日。

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	备注
申购费（前收费）	0.01万≤M<100万	0.50%	
	100万≤M<500万	0.30%	
	M≥500万	1000.00元/笔	
赎回费	N<7天	1.50%	
	N≥6月	0.00元/笔	

认购费：太平洋证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划是由太平洋红珊瑚稳盈债券集合资产管理计划转型而来，故变更后的《太平洋证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》中未设置认购费。

申购费：投资者通过销售机构首次申购本集合计划的单笔最低金额为人民币 100 元（含申购费）。实际操作中，各销售机构对本集合计划最低申购金额、交易级差以及申购费率有其他规定的，具体以各销售机构公布的为准，投资者需遵循销售机构的相关规定。申购费用由申购本集合计划的投资人承担，在投资人申购集合计划份额时收取，不列入集合计划财产，投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

赎回费：本集合计划一般情况下不收取赎回费用，但对持续持有期少于 7 日的投资人收取 1.5%的赎回费，并全额计入集合计划资产。投资人需至少持有本集合计划份额满 6 个月，在 6 个月持有期内不能提出赎回申请，持有满 6 个月后赎回不收取赎回费用。

（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	0.50%
托管费	0.05%
销售服务费	0.00%

注：1）本集合计划交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从集合计划资产扣除；

2）本集合计划管理费、托管费按前一日集合计划资产净值计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

四、 风险揭示与重要提示

（一）风险揭示

集合计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利，也不保证最低收益，投资者可能损失投资本金。投资有风险，投资者投资于本集合计划前应认真阅读本集合计划的《太平洋证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》、《太平洋证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书（更新）》等法律文件及相关公告，如实填写个人信息并核对自身的风险承受能力，选择与自己风险识别能力和风险承受能力相匹配的集合计划产品。投资者需了解所投资集合计划产品，了解自身风险承受能力，自主判断集合计划的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

（二）重要提示

1、作出投资决定前，请阅读完整的《太平洋证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书（更新）》等销售文件；

2、中国证监会对本集合计划变更的同意，并不表明其对本集合计划的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本集合计划没有风险；

3、集合计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利，也不保证最低收益；

4、集合计划投资者自依合同取得集合计划份额，即成为集合计划份额持有人和《太平洋证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》的当事人；

5、本集合计划每个开放日开放申购，但投资者需至少持有本集合计划份额满6个月，在6个月持有期限内，份额不能赎回（具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间）。在每个运作期到期日（对于每笔份额，第一个运作期到期日指资产管理合同生效日（对本集合计划合同生效前相应集合计划份额而言，下同）或集合计划份额申购申请日（对申购份额而言，下同）满6个月对应的月度对日，第二个运作期到期日为资产管理合同生效日或集合计划份额申购申

请日满12个月对应的月度对日，以此类推），本集合计划份额持有人方可就该计划份额提出赎回申请。如果集合计划份额持有人在当期运作期到期日未申请赎回，则自该运作期到期日下一工作日起该集合计划份额进入下一个运作期。因此集合计划日常开放赎回不代表投资者可随时进行赎回；

6、本集合计划产品资料概要信息发生重大变更的，集合计划管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，集合计划管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比集合计划的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取集合计划的相关信息，敬请同时关注集合计划管理人发布的相关临时公告等；

7、因履行本合同发生的争议，由各方协商解决，协商不成的，任何一方可提请中国证券业协会证券纠纷行业调解，调解不成，任何一方均有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会按其届时有效的仲裁规则进行仲裁解决。

五、 其他资料查询方式

（一）查询方式

投资者可登录管理人网站（https://www.tpyzq.com）查询，或在营业时间内至管理人或托管人的办公场所免费查阅。投资者对本集合计划如有疑问，可拨打客服电话（95397）咨询本集合计划管理人。

（二）查询内容

1.中国证监会同意合同变更的文件；

2.《太平洋证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》；

3.《太平洋证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书》及其更新；

4.《太平洋证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划托管协议》；

5.管理人业务资格批复、营业执照；

6.报告期内在指定信息披露媒体上公开披露的各项公告（包括但不限于本集合计划产品资料概要、定期报告、份额净值、销售机构及其联系方式等）。

六、 其他情况说明

无。