

方正证券鑫享三个月滚动持有债券型集合资产管理计划(E类份额)基金产品资料概要更新

编制日期：2024年05月27日

送出日期：2024年05月29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	方正证券鑫享三个月滚动债券	基金代码	970150
下属基金简称	方正证券鑫享三个月滚动债券E	下属基金代码	970151
基金管理人	方正证券股份有限公司	基金托管人	中国建设银行股份有限公司
基金合同生效日	2022年05月25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	其他开放式	开放频率	每个开放日开放申购，设置三个月滚动运作期。
基金经理	开始担任本基金基金经理的日期	证券从业日期	
宫健	2022年05月25日	2012年04月19日	
其他	本集合计划由“方正金泉友灵活配置集合资产管理计划”根据中国证券监督管理委员会证券基金机构监管部《关于准予方正金泉友灵活配置集合资产管理计划合同变更的回函》变更而来。		

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

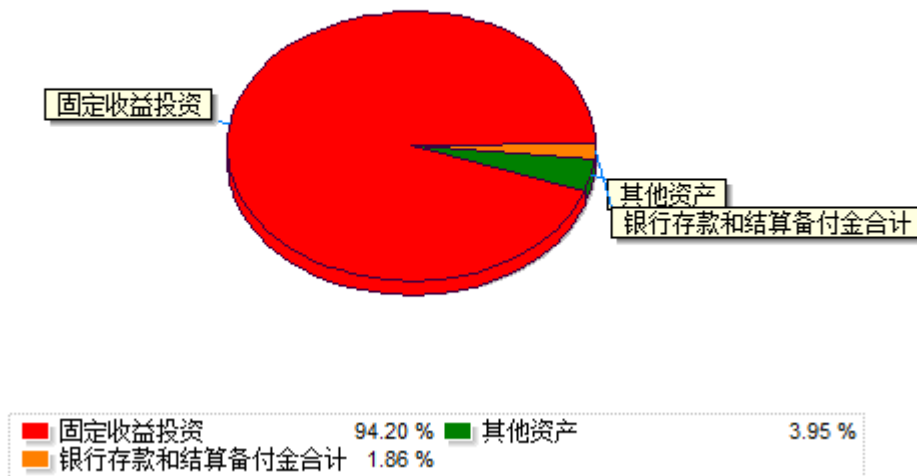
投资者可阅读《方正证券鑫享三个月滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书》第十部分“集合计划的投资”了解详细情况。

投资目标	本集合计划的投资目标是在充分考虑集合计划投资安全的基础上，力争实现集合计划资产的长期稳健增值。
投资范围	本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（国债、地方政府债、政府支持机构债、央行票据、金融债券（含次级债券）、政策性金融债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据）、银行存款（包括协议存款、通知存款、定期存款）、同业存单、债券回购、货币市场工具、资产支持证券、国债期货以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具（但须符合中国

	<p>证监会相关规定)。</p> <p>本集合计划不参与新股申购或增发新股，也不直接买入股票等权益类资产，因持有可转换债券转股和可交换债券换股形成的股票应在其可交易之日起的10个交易日内卖出。</p> <p>集合计划的投资组合比例为：</p> <p>本集合计划投资于债券的比例不低于集合计划资产的80%，投资于可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券的比例合计不超过集合计划资产的20%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本集合计划所持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的5%，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p> <p>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。</p>
主要投资策略	1、资产配置策略；2、债券投资策略；3、资产支持证券投资策略；4、国债期货投资策略。
业绩比较基准	中债综合财富(1年以下)指数收益率*90%+一年期定期存款利率(税后)*10%
风险收益特征	本集合计划为债券型集合资产管理计划，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和货币型集合资产管理计划，低于混合型基金、混合型集合资产管理计划、股票型基金和股票型集合资产管理计划。

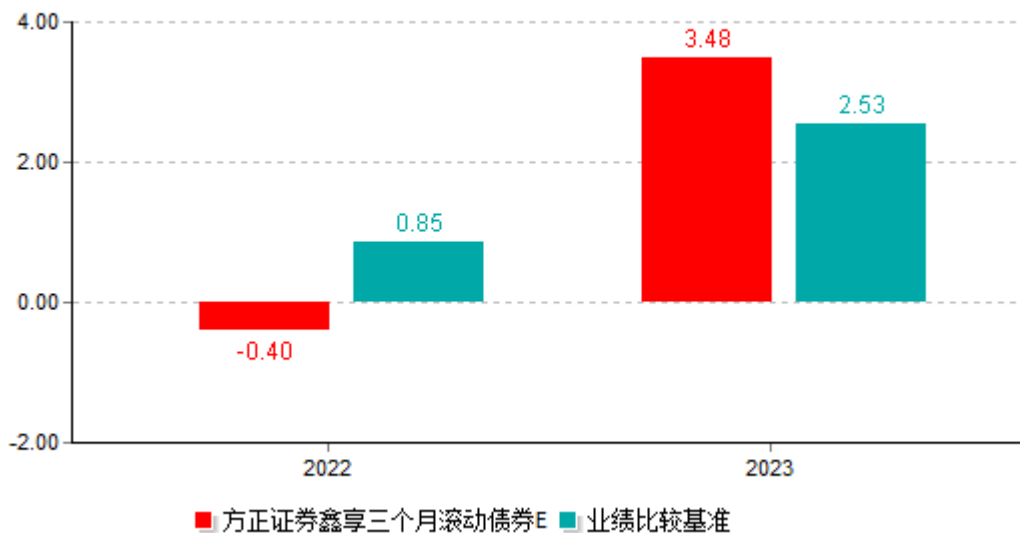
(二) 投资组合资产配置图表 / 区域配置图表

数据截止日：2024年03月31日



(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

基金的过往业绩不代表未来表现，数据截止日：2023年12月31日
单位%



注：1、基金合同生效日为2022年5月25日，方正证券鑫享三个月滚动债券E自2022年7月1日起开放申购和赎回业务，首个投资者于2022年7月12日提交申购申请，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

2、2022年10月13日，对E类基金份额10月12日的赎回申请按照1.0073元进行确认，赎回确认后E类基金份额为0。2022年10月17日，对E类基金份额10月14日的申购申请按照1.0000元进行确认。

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）			-
赎回费	N<7天	1.50%	本集合计划采用三个月滚动持有的运作方式，投资者需至少持有本集合计划份额满三个月，在三个月持有期内不能提出赎回申请，持有满

			三个月后赎回不收取赎回费用。
	N≥7天	0.00%	本集合计划采用三个月滚动持有的运作方式，投资者需至少持有本集合计划份额满三个月，在三个月持有期内不能提出赎回申请，持有满三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/年费率或金额	收取方
管理费	年费率0.3%	基金管理人和销售机构
托管费	年费率0.1%	基金托管人
销售服务费E	年费率0.05%	销售机构
审计费用	100,000.00	会计师事务所
信息披露费	80,000.00	规定披露报刊
其他费用	合同生效后与集合计划相关的律师费、诉讼费、仲裁费，集合计划份额持有人大会费用，银行汇划费用、相关账户开户及维护费用及按照国家有关规定和《资产管理合同》约定，可在集合计划财产中列支的其他费用。	

注：1、本集合计划交易证券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、审计费用、信息披露费的金额为集合计划整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以集合计划定期报告披露为准。

（三）基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

	基金运作综合费率（年化）
持有期	0.53%

注：基金运作综合费用包含由基金资产承担的费用，如管理费、托管费、销售服务费、审计费用、信息披露费、银行间账户维护费、银行汇划费等费用，不包括基金交易产生的证券交易费用、税金及附加、信用减值损失（若有）等。基金管理费率、托管费率、销售服务费率均为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

四、风险揭示与重要提示

（一）风险揭示

本集合计划不提供任何保证。投资者可能损失本金。

投资有风险，投资者购买本集合计划时应认真阅读本集合计划的《招募说明书》等销售文件。

投资者应及时关注集合计划管理人出具的适当性意见，各销售机构关于适当性的意见不必然一致，集合计划管理人的适当性匹配意见并不表明对集合计划的风险和收益做出实质性判断或者保证。集合计划合同中关于集合计划风险收益特征与集合计划风险等级因考虑因素不同而存在差异。投资者应当了解集合计划的风险收益情况，结合自身投资目的、期限、投资经验及风险承受能力谨慎决策并自行承担风险，不应采信不符合法律法规要求的销售行为及违规宣传推介材料。

1、本集合计划的特有风险

（1）对于每份计划份额，第一个运作期指资产管理合同生效日（对资产管理合同生效前相应计划份额而言，下同）或集合计划份额申购确认日（对资产管理合同生效后申购份额而言，下同）起（即第一个运作期起始日），至资产管理合同生效日或集合计划份额申购申请日满三个月对应的月度对日（即第一个运作期到期日）止。第二个运作期指第一个运作期到期日的下一工作日起，至资产管理合同生效日或集合计划份额申购申请日满六个月对应的月度对日（即第二个运作期到期日）止。以此类推。每个运作期到期日前，集合计划份额持有人不能提出赎回申请，因此面临流动性风险。

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或赎回被确认失败，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。因此集合计划份额持有人面临在运作期内不能赎回集合计划份额的风险，以及错过运作期到期日以至未能赎回而进入下一运作期的风险。

（2）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资产管理计划，低于混合型基金、混合型集合资产管理计划、股票型基金和股票型集合资产管理计划。

（3）本集合计划投资资产支持证券，资产支持证券是一种债券性质的金融工具。资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险。集合计划管理人将本着谨慎和控制风险的原则进行资产支持证券投资，请集合计划份额持有人关注包括投资资产支持证券可能导致的集合计划净值波动、流动性风险和信用风险在内的各项风险。

（4）集合计划收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，集合计划登记机构可将集合计划份

额持有人的现金红利自动转为相应类别集合计划份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

(5) 本集合计划可投资国债期货，主要面临的风险有：

1) 流动性风险

本集合计划在国债期货市场成交不活跃时，可能在建仓和平仓期货时面临交易价格或者交易数量上的风险。

2) 基差风险

基差是指现货价格与国债期货价格之间的差额。若集合计划运作中出现基差波动不确定性加大、基差向不利方向变动等情况，则可能对本集合计划投资产生影响。

3) 合约展期风险

若本集合计划所持有的国债期货合约临近交割期限需要向较远月份的合约进行展期时，展期过程中可能发生价差损失以及交易成本损失，将对投资收益产生影响。

4) 保证金不足风险

由于国债期货价格朝不利方向变动，导致期货保证金账户的资金低于金融期货交易所、期货经纪商的最低保证金要求，如果不能及时补充保证金，期货头寸将被强行平仓，导致无法规避对冲系统性风险，直接影响本集合计划投资策略的实现和收益水平，从而产生风险。

5) 衍生品杠杆风险

国债期货作为金融衍生品的投资收益与风险具有杠杆效应。若行情向不利方向剧烈变动，本集合计划可能承受超出保证金甚至本集合计划资产本金的损失。

2、市场风险：证券市场价格因受各种因素的影响而引起的波动，将使本集合计划资产面临潜在的风险，本集合计划的市场风险来源于集合计划持有的资产市场价格的波动。主要包括政策风险、利率风险、购买力风险、债券收益率曲线变动风险、再投资风险、经济周期风险、上市公司经营风险等。

3、本集合计划还面临开放式集合计划共有的风险，如流动性风险、信用风险、管理风险及其他风险。其他具体风险请详细阅读《招募说明书》第十八部分风险揭示。

4、本集合计划法律文件风险收益特征表述与销售机构风险评价可能不一致的风险。

(二) 重要提示

方正证券鑫享三个月滚动持有债券型集合资产管理计划经中国证券监督管理委员会基金机构监管部《关于准予方正金泉友灵活配置集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函[2022]497号）准予变更。中国证监会对方正金泉友灵活配置集合资产管理计划变更为本集合计划的批准，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。

集合计划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。

集合计划投资者自依集合计划合同取得集合计划份额，即成为集合计划份额持有人和集合计划合同的当事人。

集合计划资料概要信息发生重大变更的，管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，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，敬请同时关注管理人发布的相关临时公告等。

本产品资料概要所述的“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。

五、 其他资料查询方式

以下资料详见方正证券股份有限公司官方网站[www.foundersc.com][客服电话：95571]

《方正证券鑫享三个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》

《方正证券鑫享三个月滚动持有债券型集合资产管理计划托管协议》

《方正证券鑫享三个月滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书》

定期报告，包括集合计划季度报告、中期报告和年度报告

集合计划份额净值

集合计划销售机构及联系方式

其他重要资料

六、 其他情况说明

无。