

## 睿远稳益增强30天持有期债券型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新

编制日期：2024年06月12日

送出日期：2024年06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	睿远稳益增强30天持有债券	基金代码	018756
基金简称A	睿远稳益增强30天持有债券A	基金代码A	018756
基金管理人	睿远基金管理有限公司	基金托管人	招商银行股份有限公司
基金合同生效日	2023年09月19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	对于每份基金份额设定30天最短持有期，自每份基金份额的最短持有期届满后的下一个开放日（含）起，基金份额持有人可提出赎回申请或转换转出申请
基金经理	开始担任本基金基金经理的日期	证券从业日期	
侯振新	2023年09月19日	2019年03月29日	
其他	《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续50个工作日出现前述情形的，本基金将根据基金合同第十九部分的约定进行基金财产清算并终止，而无须召开基金份额持有人大会。		

注：本基金为二级债基。本基金投资股票及可转换债券、可交换债券的投资比例合计不超过基金资产的20%，因此债市、股市的变化将影响到基金业绩表现，在通常情况下本基金的预期风险水平高于纯债基金。

## 二、基金投资与净值表现

## (一) 投资目标与投资策略

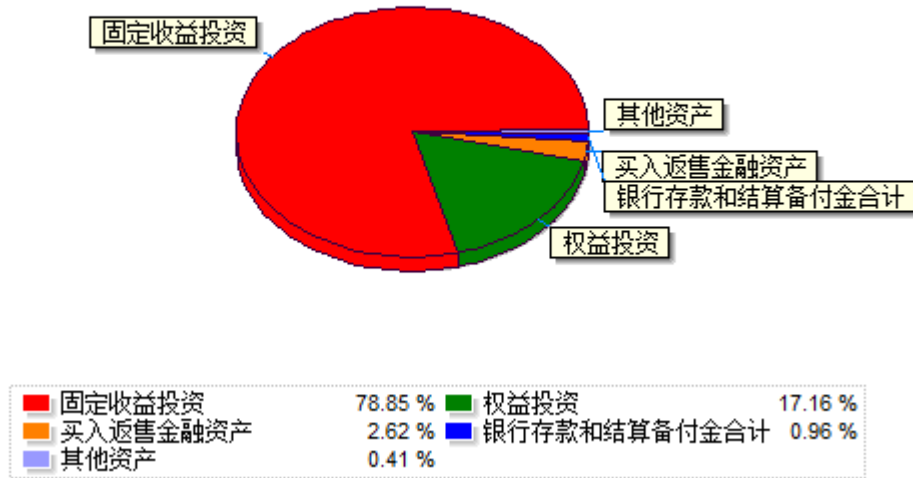
投资目标	在控制风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资范围	本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券（包括国债、金融债、地方政府债、政府支持债券、政府支持机构债券、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换

	<p>债券（含可分离交易可转换债券的纯债部分）、可交换债券、次级债及其他经中国证监会允许投资的债券）、股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、港股通标的股票、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、国债期货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。</p> <p>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。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%；股票及可转换债券、可交换债券的投资比例合计不超过基金资产的20%；其中，港股通标的股票投资比例不超过股票资产的50%；每个交易日日终，在扣除国债期货合约所需缴纳的交易保证金后，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%。</p> <p>如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金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>
<p>主要投资策略</p>	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将充分发挥基金管理人的研究优势，采取“自上而下”分析的方式进行资产配置，通过对宏观经济趋势、市场环境、财政政策、货币政策、行业周期阶段等的评估分析，研判国内经济发展形势，在严格控制投资组合风险的前提下，确定或调整投资组合中债券、股票、现金等各类资产的配置比例，从而实现本基金长期、持续、稳定增值。</p> <p>2、债券市场投资策略</p> <p>本基金通过分析各类债券资产的信用风险、流动性风险、盈利能力、经风险调整后的收益率水平等，预期各类资产的风险与收益率变化，动态地调整配置的债券类别和配置比例。</p> <p>3、股票投资策略</p> <p>本基金采用“自下而上”的投资研究方法，通过对上市企业的深入研究，精选具备投资价值的标的构建股票组合。宏观经济和行业研究内化在公司研究中，作为公司研究的重要部分，结合公司的经营管理研究作出客观的价值判断。</p> <p>4、杠杆策略。5、国债期货投资策略。6、资产支持证券投资策略。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>中债综合财富（总值）指数收益率×85%+沪深300指数收益率×9%+中证港股通综合指数（CNY）收益率×3%+银行活期存款利率（税后）×3%</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。本基金如果投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>

注：投资者欲了解详细情况，请阅读《睿远稳益增强30天持有期债券型证券投资基金招募说明书》第九部分“基金的投资”。本基金产品有风险，投资需谨慎。

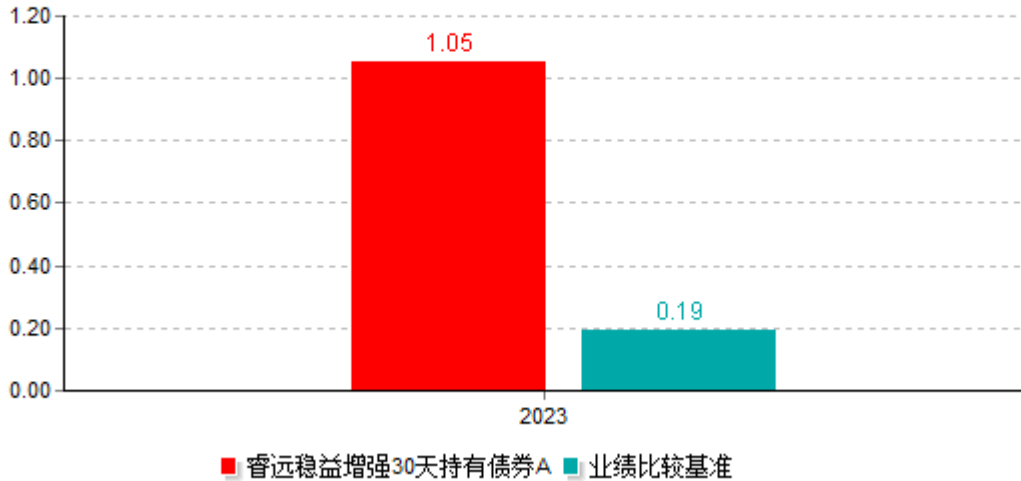
**（二）投资组合资产配置图表 / 区域配置图表**

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。  
 合同生效当年不满完整自然年度，按实际期限（2023年09月19日-2023年12月31日）计算净值增长率。  
 单位%



注：基金合同生效当年相关数据按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

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)	0<M<500万	0.60%	

收费)	M≥500万	1000.00元/笔	
赎回费	N>0天	0.00%	-

本基金不收取赎回费用。但每份基金份额设有30日（含）最短持有期，持有期满后基金份额持有人方可就对应的基金份额提出赎回申请

## （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	0.60%	基金管理人和销售机构
托管费	0.15%	基金托管人
审计费用	40,000.00	会计师事务所
信息披露费	120,000.00	规定披露报刊
其他费用	《基金合同》生效后与基金相关的律师费、公证费、诉讼费和仲裁费；基金份额持有人大会费用；基金的证券/期货等交易费用；基金的银行汇划费用；基金的相关账户的开户及维护费用；因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。	

注：以上费用将从基金资产中扣除；本基金交易证券等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。审计费用、信息披露费为基金整体承担的年费用金额，非单个份额类别费用。年费用金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。除上述费用外的其他运作费用，详见《招募说明书》中的“基金费用与税收”章节。

## （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）
0.76%

注：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上表所示。基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）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

本基金不提供任何保证。投资者可能损失本金。投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

本基金的风险包括：债券投资风险、股票投资风险、信用风险、流动性风险、操作风险、管理风险、合规风险和特有风险等。

其中特有风险包括：

1. 本基金为债券型基金，债券资产的投资比例不低于基金资产的80%，该类债券的特定风险即成为本基金及投资者主要面对的特定投资风险。同时本基金对权益类资产及可转换债券（不含可分离

交易可转债纯债部分)、可交换债券的投资比例合计不超过基金资产的20%;其中,港股通标的股票投资比例不超过股票资产的50%,其预期风险水平高于纯债型基金。

2. 本基金设有最短持有期,每份基金份额的最短持有期为30天,相应基金份额在最短持有期内不可办理赎回及转换转出业务。因此基金份额持有人面临在最短持有期内不能赎回或转换转出基金份额的风险。

3. 港股投资风险。本基金投资范围包括港股通标的股票,除与其他投资于内地市场股票的基金所面临的共同风险外,本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资者结构、投资标的构成、市场制度以及交易规则等差异所带来的特有风险。

4. 收益率曲线风险。本基金投资涉及债券收益率曲线策略,由于久期等指标对利率风险的衡量是建立在收益率曲线只发生平行位移的前提下,但收益率曲线可能会发生扭曲或蝶形等非平行变化,并导致久期等指标无法全面反映利率风险的真实水平。久期相同的货币市场工具组合若期限结构配置不同,则其收益率水平在收益率曲线发生非平行位移时会产生较大的差异。

5. 杠杆放大风险。本基金或采用杠杆操作、息差放大的投资策略,市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险均会相应增加,特别是,当收益率的实际走势与预期走势相反的情况下,市场出现融资的成本高于买入的债券的收益率,杠杆放大从而导致基金资产出现较大的损失。

6. 投资资产支持证券风险。本基金投资品种包含资产支持证券品种,由于资产支持证券一般都针对特定机构投资人发行,且仅在特定机构投资人范围内流通转让,该品种的流动性较差,且对应抵押资产的流动性较差,因此,持有资产支持证券可能给组合资产净值带来一定的风险。另外,资产支持证券还面临提前偿还和延期支付的风险。

7. 投资流动性受限资产的风险。基金投资有明确锁定期的非公开发行股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值,故本基金的净值可能由于估值方法的原因偏离所持有股票的收盘价所对应的净值,投资者在申购赎回时,需考虑该估值方式对基金净值的影响。另外,本基金可能由于持有流动性受限资产而面临流动性风险以及流动性受限期间内证券价格大幅下跌的风险。

8. 投资国债期货可能面临的杠杆性风险、到期日风险、强制平仓风险,以及使用国债期货对冲市场风险的过程中,基金财产可能因为国债期货合约与合约标的价格波动不一致而面临期现基差风险。

9. 投资科创板股票的风险。包括市场风险、流动性风险、退市风险、集中度风险、系统性风险、政策风险和其他风险等。

10. 投资存托凭证的风险。本基金的投资范围包括存托凭证,除与其他仅投资于境内市场股票的基金所面临的共同风险外,本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险,以及与创新企业发行人、境外发行人、存托凭证发行机制和交易机制等相关的风险。

11. 投资北交所股票的风险。包括中小企业经营风险、股价大幅波动风险、退市风险、流动性风险、系统性风险、监管规则变化的风险、发行风险等。

12. 基金合同自动终止风险。《基金合同》生效后,连续50个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的,《基金合同》终止,不需召开基金份额持有人大会。故基金份额持有人可能面临基金合同自动终止的风险。

以上所述因素可能会给本基金投资带来特殊交易风险。

## (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。

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

本基金的争议解决处理方式为仲裁。因基金合同产生的或与基金合同有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交深圳国际仲裁院，仲裁地点为深圳市。

## 五、 其他资料查询方式

以下资料详见睿远基金官方网站 [www.foresightfund.com] [客服电话：400-920-1000]

《睿远稳益增强30天持有期债券型证券投资基金基金合同》、《睿远稳益增强30天持有期债券型证券投资基金托管协议》、《睿远稳益增强30天持有期债券型证券投资基金招募说明书》

定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告

基金份额净值

基金销售机构及联系方式

其他重要资料

## 六、 其他情况说明

本基金产品资料概要是招募说明书及其更新的摘要文件，仅用于向投资者提供简明的基金概要信息。投资者投资本基金前应仔细阅读基金合同和基金的招募说明书及其更新等法律文件。