

# 国信睿丰债券型集合资产管理计划（A类份额）

## 基金产品资料概要更新

编制日期：2024年6月27日

送出日期：2024年6月28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	国信睿丰债券	基金代码	938666
下属基金简称	国信睿丰债券A	下属基金代码	938666
基金管理人	国信证券股份有限公司	基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金合同生效日	2022年12月23日		
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	每个开放日开放申购
基金经理	梁策	开始担任本基金基金经理的日期	2022年12月23日
		证券从业日期	2011年10月20日
	凌铃	开始担任本基金基金经理的日期	2023年12月20日
		证券从业日期	2013年12月31日
	张浩冉	开始担任本基金基金经理的日期	2024年04月02日
		证券从业日期	2018年09月07日

其他

本集合计划由国信“金理财”债券1号集合资产管理计划变更而来。变更后的《国信睿丰债券型集合资产管理计划资产管理合同》于2022年12月23日起生效，原《国信“金理财”债券1号集合资产管理合同》同日起失效。本集合计划自集合计划合同变更生效日起，存续期不得超过3年，本集合计划自集合计划合同生效日起3年后，按照中国证监会有关规定执行。

注：本集合计划投资于可转换债券及股票的比例合计不超过集合计划资产的20%，在通常情况下本集合计划的预期风险水平高于纯债型集合资产管理计划。

### 二、基金投资与净值表现

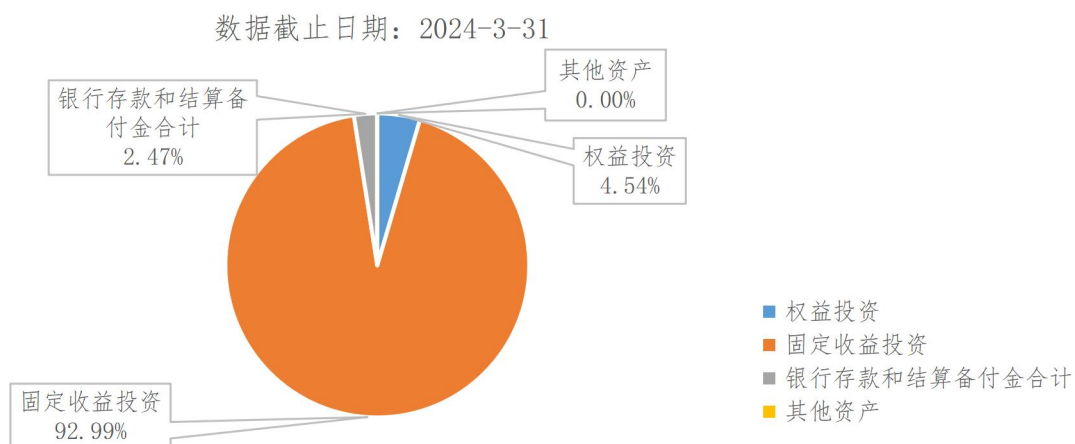
#### （一）投资目标与投资策略

投资者可阅读《招募说明书》的“第九部分 集合计划的投资”章节了解详细情况

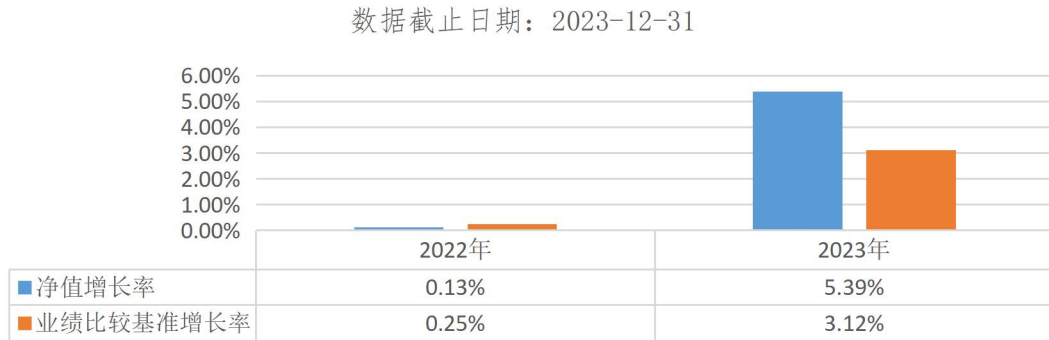
在保持集合计划资产流动性和严格控制集合计划资产风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，追求集合计划资产的长期稳健增值。

投资范围	<p>本集合计划投资于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（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票（含存托凭证））、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、国债期货以及法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。</p> <p>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，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。</p> <p>本集合计划的投资组合比例为：本集合计划投资于债券资产的比例不低于集合计划资产的 80%；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，本集合计划保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的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。本集合计划投资于可转换债券及股票的比例合计不超过集合计划资产的 20%。</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，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	<p>本集合计划主要投资策略包括资产配置策略、久期控制策略、期限结构配置策略、基于信用利差曲线策略、基于信用债信用分析策略、国债期货投资策略、股票投资策略、存托凭证投资策略。未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，集合计划可在履行适当程序后，相应调整和更新相关投资策略。</p>
业绩比较基准	中债新综合财富指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10%
风险收益特征	<p>本集合计划为债券型集合资产管理计划，其预期收益和预期风险通常高于货币市场基金，低于混合型基金、混合型集合资产管理计划、股票型基金、股票型集合资产管理计划。</p>

## (二) 投资组合资产配置图表



(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：（1）以上数据为从2022年12月23日（变更后）至2023年12月31日。（2）基金合同生效当年期间的相关数据按实际存续期计算。（3）基金的过往业绩不代表未来表现。

### 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
申购费（前收费）	M < 100 万元	0.60%
	100 万元 ≤ M < 300 万元	0.40%
	300 万元 ≤ M < 500 万元	0.20%
	M ≥ 500 万元	1000 元/笔
赎回费	N < 7 日	1.50%
	7 日 ≤ N < 30 日	0.30%
	N ≥ 30 日	0

注：原国信“金理财”债券1号集合资产管理计划投资人份额持有时间从登记机构确认投资人持有原国信“金理财”债券1号集合资产管理计划份额或国信“金理财”债券分级1号集合资产管理计划份额之日起连续计算。

#### （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	固定费率 0.80%	基金管理人和销售机构
托管费	固定费率 0.10%	基金托管人
审计费用	5700.00 元	会计师事务所
信息披露费	120000.00 元	规定披露报刊
其他费用	按照国家有关规定和《集合计划合同》约定，可在集合计划财产中列支的律师费、诉讼费、保全费和仲裁费、份额持有人大会费用、证券/期货交易费用、	
		相关服务机构

费用类别	收费方式/年费率或金额	收取方
	银行汇划费用、开户费用、账户维护费用等，按费用实际支出金额列入当期费用	

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财产中扣除。

（2）审计费用、信息披露费为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

### （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）
1.02%

注：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

本集合计划不提供任何保证。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。

本集合计划面临的风险主要包括市场风险、管理风险、流动性风险、特有风险、估值风险、操作或技术风险、合规性风险以及其他风险。其中，本集合计划特有风险主要包括：

（1）本集合计划投资于债券资产的投资比例不低于集合计划资产的 80%。因此，本集合计划需要承担由于市场利率波动造成的利率风险以及如企业债、公司债等信用品种的债发主体信用恶化造成的信用风险；如果债券市场出现整体下跌，将无法完全避免债券市场系统性风险。

（2）本集合计划投资品种包含资产支持证券，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。价格波动风险指的是市场利率波动会导致资产支持证券的收益率和价格波动。流动性风险指的是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。信用风险指的集合计划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，造成集合计划财产损失。

（3）本集合计划自集合计划合同变更生效日起，存续期不得超过 3 年，本集合计划自集合计划合同生效日起 3 年后，按照中国证监会有关规定执行。本集合计划可能按照中国证监会、法律法规的要求终止或发生管理人变更等情形，投资者可能面临投资计划无法实现，被动终止参与本集合计划的风险。

（4）本集合计划可投资于国债期货。国债期货的投资可能面临市场风险、基差风险、流动性风险。市场风险是因期货市场价格波动使所持有的期货合约价值发生变化的风险。基差风险是期货市场的特有风险之一，是指由于期货与现货间的价差的波动，影响套期保值或套利效果，使之发生意外损益的风险。流动性风险可分为两类：一类为流通量风险，是指期货合约无法及时以所希望的价格建立或了结头寸的风险，此类风险往往是由市场缺乏广度或深度导致的；另一类为资金量风险，是指资金量无法满足保证金要求，使得所持有的头寸面临被强制平仓的风险。

(5) 集合计划资产可投资于存托凭证, 会面临与创新企业、境外发行人、中国存托凭证发行机制以及交易机制等差异带来的特有风险, 包括但不限于创新企业业务持续能力和盈利能力等经营风险, 存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险; 存托协议自动约束存托凭证持有人的风险; 存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险; 存托凭证退市的风险; 因地上市造成存托凭证价格差异以及受境外市场影响交易价格大幅波动的风险; 存托凭证持有人权益被摊薄的风险; 已在境外上市的基础证券发行人, 在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险; 境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险等, 集合计划净值可能受到存托凭证的境外基础证券价格波动影响, 存托凭证的境外基础证券的相关风险可能直接或间接成为本集合计划的风险。

本集合计划可以投资于可转换债券, 可转换债券的价格受到其相对应股票价格波动的影响, 同时可转换债券还有信用风险与转股风险。转股风险指相对应股票价格跌破转股价, 不能获得转股收益, 从而无法弥补当初付出的转股期权价值。

## (二) 重要提示

中国证监会对国信“金理财”债券1号集合资产管理计划变更为本集合计划的核准, 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财产, 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。

当本集合计划持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时, 管理人可以依照法律法规及集合计划合同的约定启用侧袋机制。实施侧袋机制期间, 管理人不办理侧袋账户份额的申购、赎回和转换, 请集合计划份额持有人仔细阅读《集合计划合同》、《招募说明书》相关内容并关注本集合计划启用侧袋机制的特定风险。

各方当事人因《集合计划合同》而产生的或与《集合计划合同》有关的一切争议, 如经友好协商未能解决的最终将通过仲裁方式处理, 详见《集合计划合同》。

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。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见集合计划管理人网站: [www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn), 客服电话: 95536

- 集合计划合同、托管协议、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