

光大阳光北斗星 9 个月持有期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 26 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	光大阳光北斗星 9 个月持有债券	基金代码	865048
下属基金简称	光大阳光北斗星 9 个月持有债券 A	下属基金交易代码	865048
基金管理人	上海光大证券资产管理有限公司	基金托管人	中国民生银行股份有限公司
基金合同生效日	2022 年 9 月 1 日	上市交易所及上市日期	-
基金类型	债券型	交易币种	人民币
运作方式	普通开放式	开放频率	每个交易日开放，9 个月持有期锁定
基金经理	张丁	开始担任本基金基金经理的日期	2022 年 09 月 01 日
		证券从业日期	2008 年 07 月 28 日
基金经理	曾炳祥	开始担任本基金基金经理的日期	2022 年 09 月 01 日
		证券从业日期	2017 年 07 月 12 日

注：1. 集合计划的首任投资经理，其“任职日期”为集合计划合同生效日；非首任投资经理，其“任职日期”指根据公司决议确定的聘任日期；

2. 本集合计划为证券公司大集合资产管理产品，根据《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》，参照《基金法》等公开募集证券投资基金相关法律、行政法规及中国证监会的规定进行变更。

二、基金投资与净值表现

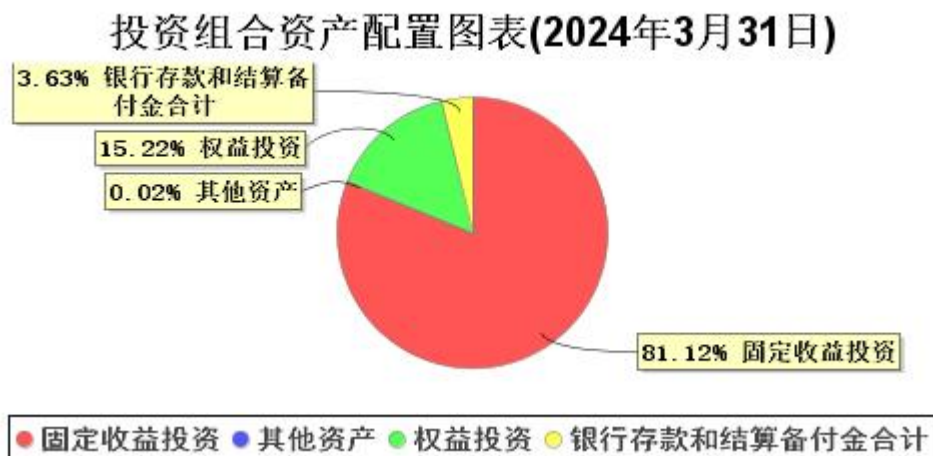
（一）投资目标与投资策略

投资目标	本集合计划主要投资于债券为主的固定收益类产品，并在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过对不同资产类别的优化配置，充分挖掘市场潜在的投资机会，力求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（含国债、央行票据、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、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、可交换债券、可转换债券（含分离型可转换债券）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、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）、货币市场工具等；国内依法发行上市的股票（包含主板、创业板及其他经中国证监会核准上市或注册的股票）、港股通标的股票、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，但须符合中国证监会相关规定。
主要投资策略	1. 资产配置策略；2. 固定收益品种投资策略；3. 权益品种的投资策略；4. 资产支持证券的投资策略；5. 国债期货的投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×10%+中债综合指数收益率×85%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×5%
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资产管理计划，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。本集合计划可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本集合计划还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、以及通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。

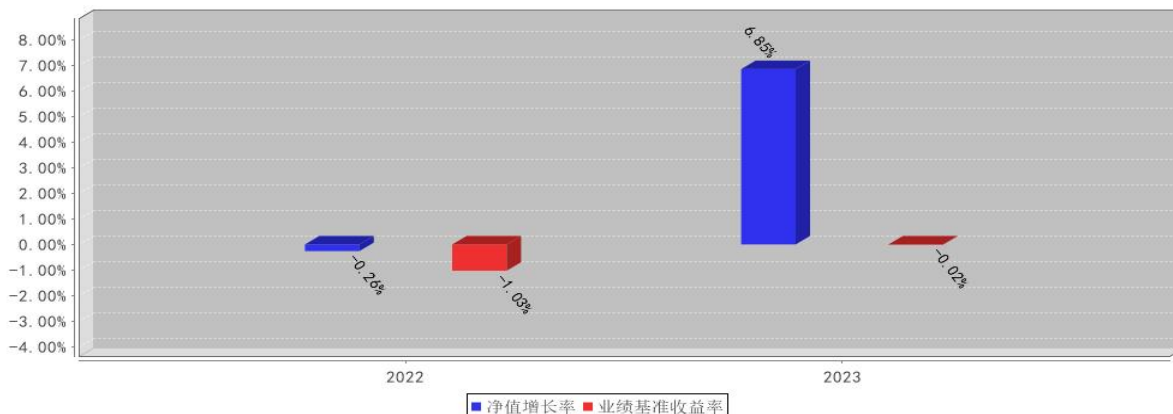
注：详见《光大阳光北斗星 9 个月持有期债券型集合资产管理计划招募说明书》第九部分“集合计划的投资”

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表



(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

光大阳光北斗星9个月持有债券A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图（2023年12月31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
认购费	本集合计划 A 类份额不开放认购		
申购费 (前收费)	M<100 万元	0.7%	-
	100 万元≤M<500 万元	0.4%	-
	500 万元≤M<1,000 万元	0.1%	-
	M≥1,000 万元	1000 元/笔	-
赎回费	N<7 日	1.5%	-

赎回费

本集合计划不收取赎回费。其中，由红利再投资的 A 类或 C 类份额，对持有期少于 7 日的投资者收取 1.5% 的赎回费，并全额计入集合计划财产。

(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	A 类份额固定管理费率为 0.7%/年，无业绩报酬	基金管理人
托管费	0.1%/年	基金托管人
销售服务费	A 类份额无销售服务费	销售机构
审计费用	16500 元	会计师事务所
信息披露费	120000 元	规定披露报刊
其他费用	会计费、律师费、信息披露费等	

注：本集合计划交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

(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：

光大阳光北斗星 9 个月持有债券 A

	基金运作综合费率（年化）
持有期间	0.89%

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。

本集合计划的风险主要包括：

1. 市场风险：

（1）政策风险；（2）经济周期风险；（3）信用风险；（4）利率风险；（5）购买力风险；（6）债券收益率曲线风险；（7）再投资风险。

2. 管理风险

3. 流动性风险

4. 操作或技术风险

5. 合规性风险

6. 本集合计划的特有风险：

（1）资产支持证券的投资风险

本集合计划投资资产支持证券，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。

（2）港股投资风险

本集合计划可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分集合计划资产投资于港股或选择不将集合计划资产投资于港股，集合计划资产并非必然投资港股。

本集合计划投资股通标的股票的比例较小，但仍将承担投资港股通标的股票的相关风险，包括但不限于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，如港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对集合计划的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。

（3）国债期货投资风险

本集合计划可投资于国债期货等金融衍生品。投资国债期货主要存在以下风险：

市场风险：定义为由于投资标的物价格变动而产生的衍生品的价格波动；

市场流动性风险：当衍生品合约无法及时变现所带来的风险；

基差风险：定义为衍生品市场价格与联动之标的价格不一致所产生的风险；

结算流动性风险：定义为当集合计划之保证金部位不足而无法交易衍生品，或因指数波动导致保证金低于维持保证金而必须追缴保证金的风险；

保证金风险：是指由于无法及时筹措资金满足建立或者维持衍生品合约头寸所要求的保证金而带来的风险。

信用风险：定义为交易对手不愿或无法履行契约之风险；

作业风险：定义为因交易过程、交易系统、人员疏失、或其他不可预期事件所导致的损失。

（4）特殊安排的运作方式

资产管理合同生效后，原光太阳光北斗星 2 号集合资产管理计划份额变更为本集合计划的 A 类份额。集合计划 A 类份额可以办理申购业务并设置锁定持有期，锁定持有期起始日由管理人公告约定，每份 A 类份额的锁定持有期为 9 个月，在锁定持有期内不办理赎回业务。锁定持有期到期后进入开放持有期，每份 A 类份额自其开放持有期首日起才能办理赎回业务。因此 A 类份额的份额持有人面临在锁定持有期内不能赎回资产管理计划份额的风险。

集合计划 C 类份额设置锁定持有期，每份 C 类份额的锁定持有期为 9 个月，在锁定持有期内不办理赎

回业务。锁定持有期起始日指 C 类份额申购申请确认日，锁定持有期到期后进入开放持有期，每份 C 类份额自其开放持有期首日起才能办理赎回业务。因此 C 类份额的份额持有人面临在锁定持有期内不能赎回资产管理计划份额的风险。

(5) 运作期限或有变化的风险

本集合计划名称为光大阳光北斗星 9 个月持有期债券型集合资产管理计划，但是考虑到周末、法定节假日等原因，每份集合计划份额的实际运作期限或有不同，可能长于或短于 9 个月。

7. 其他风险

(二) 重要提示

中国证监会对本集合计划募集的注册，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，集合计划管理人依照法律法规及资产管理合同的约定履行相应程序后，可以启动侧袋机制，具体安排详见资产管理合同、本招募说明书等集合计划法律文件中关于侧袋机制的有关内容。侧袋机制实施期间，集合计划管理人将对集合计划简称进行特殊标识，并不办理侧袋账户份额的申购赎回等业务。请集合计划份额持有人仔细阅读相关内容并关注本集合计划启用侧袋机制的特定风险。

本资料概要所述的“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》的要求完成的证券公司大集合产品。

基金产品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，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确的获取基金相关信息，敬请同时关注管理人发布的临时公告等。

五、其他资料查询方式

以下资料详见集合计划管理人网站：

网址：<http://www.ebscn-am.com/>，客服电话：95525

1. 集合计划合同、托管协议、招募说明书
 2. 定期报告，包括集合计划季度报告、中期报告和年度报告
 3. 集合计划份额净值
 4. 集合计划销售机构及联系方式
- 其他重要资料。