

东海证券海睿致远灵活配置混合型集合资产管理计划

集合计划产品资料概要更新

编制日期：2024年6月26日

送出日期：2024年6月28日

本概要提供本集合计划的重要信息，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

| | | | |
|-----------|------------|--------------------|--------------|
| 集合计划简称 | 东海海睿致远 | 集合计划代码 | 970048 |
| 集合计划管理人 | 东海证券股份有限公司 | 集合计划托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 集合计划合同生效日 | 2021年7月19日 | 上市交易所及上市日期 | - |
| 集合计划类型 | 混合型 | 交易币种 | 人民币 |
| 运作方式 | 普通开放式 | 开放频率 | 每个开放日 |
| 集合计划经理 | 刘迟到 | 开始担任本集合计划集合计划经理的日期 | 2023年11月16日 |
| | | 证券从业日期 | 2010年2月11日 |

注：东海证券海睿致远灵活配置混合型集合资产管理计划简称“本集合计划”。

二、集合计划投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

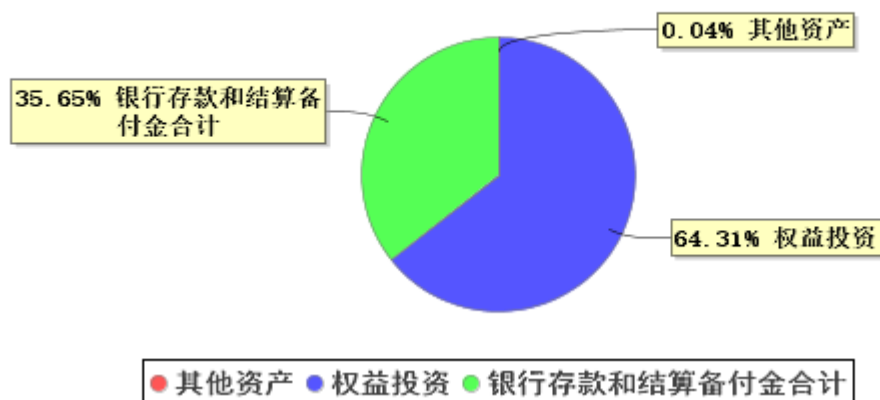
具体请查阅本集合计划的《东海证券海睿致远灵活配置混合型集合资产管理计划招募说明书》第九部分“集合计划的投资”了解详细情况。

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 本集合计划在严格控制风险并保持良好流动性的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，谋求集合计划资产的长期增值。 |
| 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，包括国内依法发行的股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券（含公司债、企业债、国债、金融债、央行票据、中期票据、短期融资券、可转换公司债券、可分离交易债券、可交换债券）、债券回购、资产支持证券、股指期货、国债期货等各类金融工具、银行存款及其他中国证监会允许投资的金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。 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。 集合计划的投资组合比例为：股票资产占集合计划资产的比例为0%-95%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本集合计划持有现金或到期日在1年以内的政府债券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、应收申购款等。 |
| 主要投资策略 | 本集合计划采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。 |

| | |
|--------|--|
| 业绩比较基准 | 中证 800 指数收益率× 80%+中国债券总指数收益率× 20% |
| 风险收益特征 | 本集合计划是一只混合型集合资产管理计划，理论上其预期收益和预期风险高于货币市场集合计划、债券型集合计划、债券型集合资产管理计划，低于股票型集合计划、股票型集合资产管理计划。 |

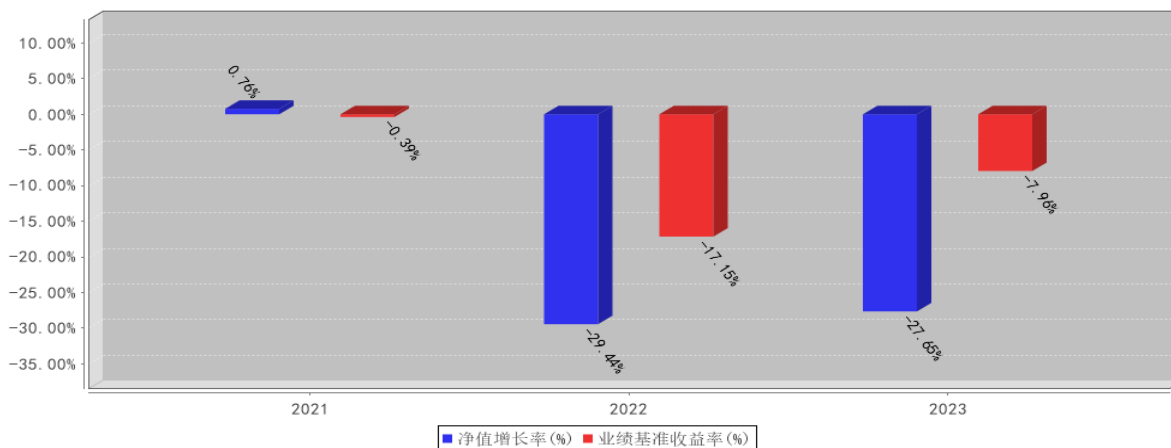
(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表(2024年3月31日)



(三) 自集合计划合同生效以来集合计划每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

东海海睿致远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)



注：集合计划过往业绩不代表未来表现，数据截止日：2023 年 12 月 31 日。

三、投资本集合计划涉及的费用

(一) 集合计划销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回集合计划过程中收取：

| 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 | M < 100 万 | 1.50% | - |

| | | | |
|-------|-------------|----------|------|
| (前收费) | 100万≤M<300万 | 1.20% | - |
| | 300万≤M<500万 | 0.80% | - |
| | M≥500万 | 1,000元/笔 | 按笔收取 |
| 赎回费 | N<7天 | 1.50% | - |
| | 7天≤N<30天 | 0.75% | - |
| | 30天≤N<180天 | 0.50% | - |
| | N≥180天 | 0 | - |

注：赎回份额持有时间的计算，以该份额在登记机构的登记日开始计算。

申购费

投资人如果有多笔申购，申购费按每笔集合计划份额申购申请单独计算。

(二) 集合计划运作相关费用

以下费用将从集合计划资产中扣除：

| 费用类别 | 收费方式/年费率或金额 | 收取方 |
|-------|--|--------------|
| 管理费 | 1.2% | 集合计划管理人和销售机构 |
| 托管费 | 0.2% | 集合计划托管人 |
| 审计费用 | 10,000.00元 | 会计师事务所 |
| 信息披露费 | 50,000.00元 | 规定披露报刊 |
| 其他费用 | 按照国家有关规定和《资产管理合同》、《招募说明书》的约定，可以在集合计划财产中列支的其他费用按实际发生额从集合计划财产中扣除。具体费用详见集合计划《资产管理合同》、《招募说明书》及其更新。 | |

注：

- 1、本集合计划交易证券、集合计划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、以上费用为集合计划整体承担费用，非单个份额类型费用，且年金额为预估值，最终金额以集合计划定期报告披露为准。

(三) 集合计划运作综合费用测算

若投资者认购/申购本集合计划份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

| | 集合计划运作综合费率（年化） |
|------|----------------|
| 持有期间 | 1.72% |

注：

集合计划运作综合费率=固定管理费率+托管费率+销售服务费率(若有)+其他运作费用合计占集合计划每日平均资产净值的比例(年化)，业绩报酬(若有)不纳入测算范围。集合计划管理费率、托管费率、销售服务费率(若有)为集合计划现行费率，其他运作费用以最近一次集合计划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。

本集合计划在投资运作过程中可能面临各种风险，包括市场风险、管理风险、流动性风险、操作或技术风险、合规性风险、其它风险及特有风险等。

本集合计划的特定风险包括如下内容：

(1) 本集合计划投资于股票资产的比例占集合计划资产的0%-95%。因此，本集合计划将面临股票市场下跌的风险。

(2) 本集合计划投资于债券。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发行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。

(3) 本集合计划的投资范围包括资产支持证券。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。

(4) 股指期货、国债期货的风险

本集合计划可投资于股指期货、国债期货等金融衍生品。投资股指期货、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连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。

(5) 流通受限证券的风险

本集合计划可投流通受限证券，因此本集合计划可能由于持有流通受限证券而面临流动性风险以及流通受限期间内证券价格大幅下跌的风险。

具体风险请查阅本集合计划《招募说明书》第十七部分“风险揭示”的具体内容。

(二) 重要提示

中国证监会对东海证券飞龙2号-朱雀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投资价值和市场前景做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。

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本集合计划财产，但不保证投资于本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

投资者自依据《集合计划合同》取得集合计划份额，即成为本集合计划份额持有人和《集合计划合同》的当事人。

《集合计划合同》生效后，产品资料概要的信息发生重大变更的，管理人应当在三个工作日内，更新产品资料概要，并登载在规定网站及集合计划销售机构网站或营业网点；产品资料概要其他信息发生变更的，管理人至少每年更新一次。集合计划终止运作的，管理人不再更新产品资料概要。

五、其他资料查询方式

以下资料详见管理人网站[www.longone.com.cn][客服电话：95531]

1、《东海证券海睿致远灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》、《东海证券海睿致远灵活配置混合型集合资产管理计划托管协议》、《东海证券海睿致远灵活配置混合型集合资产管理计划招募说明书》

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[销售机构：东海证券股份有限公司][联系方式：021-20333333]

5、其他重要资料

六、其他情况说明

无。