

上海证券弘利债券型集合资产管理计划（上证弘利债券 A 份额）

基金产品资料概要更新

编制日期：2024 年 6 月 28 日

送出日期：2024 年 06 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	上证弘利	基金代码	970122
下属基金简称	上证弘利债券 A	下属基金交易代码	970122
基金管理人	上海证券有限责任公司	基金托管人	广发银行股份有限公司
基金合同生效日	2022 年 1 月 11 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	契约型开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	张乃禄	开始担任本基金基金经理的日期	2022 年 7 月 1 日
		证券从业日期	2004 年 3 月 18 日
基金经理	徐铭	开始担任本基金基金经理的日期	2022 年 12 月 9 日
		证券从业日期	2016 年 9 月 5 日
其他	投资者依据原《上海证券心安增利债券分级集合资产管理计划资产管理合同》参与集合计划获得的上海证券心安增利债券分级集合资产管理计划份额，自本集合计划合同生效之日起将全部自动转换为本集合计划的 A 类份额，管理人对本次自动转换不收取申购或转换费用		

注：上海证券弘利债券型集合资产管理计划由上海证券心安增利债券分级集合资产管理计划变更而来。上海证券心安增利债券分级集合资产管理计划于 2013 年 5 月 21 日正式成立。上海证券心安增利债券分级集合资产管理计划变更获中国证监会机构部函〔2021〕3579 号文批复。自 2022 年 1 月 11 日，《上海证券弘利债券型集合资产管理计划集合资产管理合同》生效，原《上海证券心安增利债券分级集合资产管理计划资产管理合同》自同日起失效。

二、基金投资与净值表现

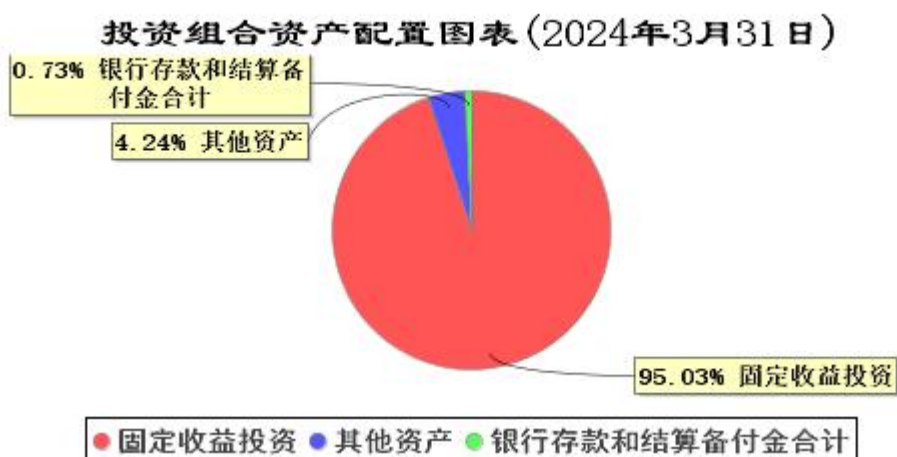
（一）投资目标与投资策略

详见《上海证券弘利债券型集合资产管理计划招募说明书》“九、集合计划的投资”

投资目标	在控制风险的前提下，追求集合计划财产的稳健增值。
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，包括国内依法发行上市的国债、央行票据、金融债、地方政府债、政府支持机构债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、证券公司发行的短期公司债券、债券回购、资产支持证券、可转换债券（含可分离交易可转债纯债部分）、可交换债券、现金、银行存

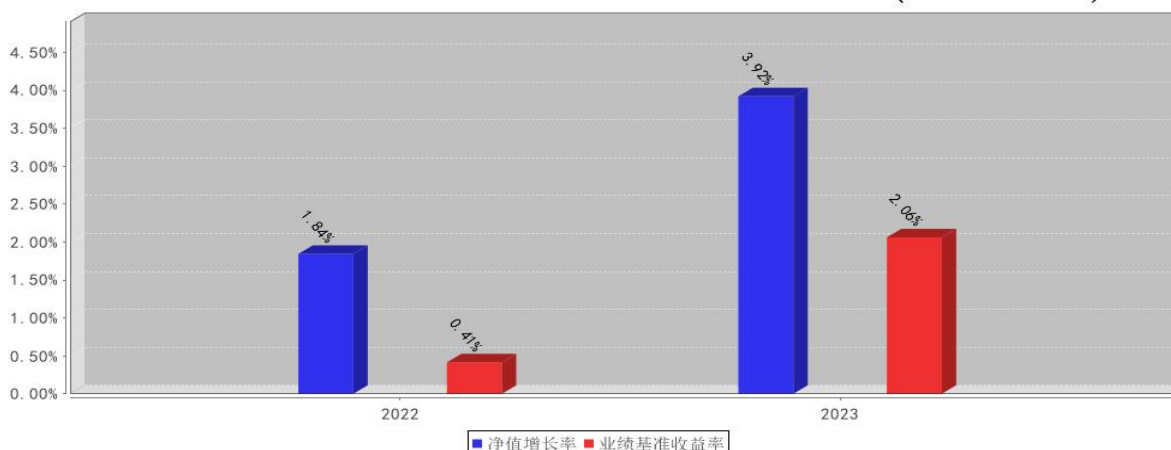
	<p>款（包括协议存款、通知存款、定期存款）、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许公开募集证券投资基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。</p> <p>本集合计划不直接从二级市场买入股票等资产，也不参与一级市场新股申购和新股增发。本集合计划持有的可转换债券、可交换债券不可转股，须在转股前卖出。如法律法规或监管机构以后允许公开募集证券投资基金投资其他品种，集合计划管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>集合计划的投资组合比例为：本集合计划投资于债券资产的比例不低于集合计划资产的80%，本集合计划每个交易日日终持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于集合计划资产净值的5%，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	<ol style="list-style-type: none"> 1、资产配置策略 2、固定收益品种投资策略 <ol style="list-style-type: none"> (1) 久期策略 (2) 收益率曲线策略 (3) 信用债券投资策略 (4) 资产支持证券等品种投资策略 (5) 可转债及可交债投资策略 (6) 证券公司短期公司债券投资策略
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率。
风险收益特征	本集合计划为债券型集合资产管理计划，在通常情况下，本集合计划预期收益及预期风险水平高于货币市场基金，低于股票型基金、混合型基金、股票型集合资产管理计划、混合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



(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

上证弘利债券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
申购费 (前收费)	M < 1,000,000	0.30%
	1,000,000 ≤ M < 5,000,000	0.10%
	M ≥ 5,000,000	1,000.00 元/笔
赎回费	N < 7 天	1.5%
	N ≥ 7 天	0%

认购费

无

（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	0.40%	基金管理人
托管费	0.05%	基金托管人
审计费用	10,000.00 元	会计师事务所
信息披露费	120,000.00 元	规定披露报刊
其他费用	除法律法规、中国证监会另有规定外，《集合计划合同》生效后与集合计划相关的信息披露费用；《集合计划合同》生效后与集合计划相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；集合计划份额持有人大会费用；集合计划的证券交易费用；集合计划的银行汇划费用；账户开户费用、	相关服务机构

	账户维护费用；按照国家有关规定和《集合计划合同》约定，可以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、基金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：

上证弘利债券 A

	基金运作综合费率（年化）
持有期间	0.62%

注：集合计划管理费、托管费率、销售服务费（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。

投资者面临的风险主要可分为市场风险、信用风险、杠杆风险、管理风险、流动性风险、操作风险、合规性风险、本集合计划特有的风险、法律文件风险收益特征表述与销售机构集合计划风险评价可能不一致的风险及其他风险。其中本集合计划特有的风险如下：

1、债券等固定收益类资产的投资风险

本集合计划为债券型集合计划，主要投资于债券等固定收益类资产，因此债券市场的变化均会影响到本集合计划的业绩表现。集合计划管理人将发挥专业研究优势，加强固定收益类产品的深入研究，持续优化组合配置，以控制特定风险。

2、资产支持证券的投资风险

本集合计划投资资产支持证券的风险包括：（1）与基础资产相关的风险，主要包括特定原始权益人破产风险、现金流预测风险等与基础资产相关的风险；（2）与资产支持证券相关的风险，主要包括资产支持证券信用增级措施相关风险、资产支持证券的利率风险、资产支持证券的流动性风险、评级风险等与资产支持证券相关的风险；（3）其他风险，主要包括政策风险、税收风险、发生不可抗力事件的风险、技术风险和操作风险。

3、投资证券公司发行的短期公司债券的风险

本集合计划投资范围包括证券公司短期公司债券，由于证券公司短期公司债券非公开发行和交易，且限制投资者数量上限，潜在流动性风险相对较大。若发行主体信用质量恶化或投资者大量赎回需要变现资产时，受流动性所限，本集合计划可能无法卖出所持有的证券公司短期公司债券，由此可能给集合计划净值带来不利影响或损失。

4、启用侧袋机制的风险

当本集合计划启用侧袋机制时，实施侧袋机制期间，侧袋账户份额将停止披露集合计划份额净值，并不得办理申购、赎回和转换。启用侧袋机制时持有集合计划份额的持有人将在启用侧袋机制后同时持有主袋账户份额和侧袋账户份额，侧袋账户份额不能赎回，其对应的特定资产的变现时间具有不确定性，最终变现价格也具有不确定性并且有可能大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，集合计划份额持有人可

能因此面临损失。

实施侧袋机制期间，集合计划管理人计算各项投资运作指标和集合计划业绩指标时以主袋账户资产为基准，不反映侧袋账户特定资产的真实价值及变化情况。本集合计划不披露侧袋账户份额的净值，即便集合计划管理人在集合计划定期报告中披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的，也不作为特定资产最终变现价格的承诺，对于特定资产的公允价值和最终变现价格，集合计划管理人不承担任何保证和承诺的责任。

集合计划管理人将根据主袋账户运作情况合理确定申购政策，因此实施侧袋机制后主袋账户份额存在暂停申购的可能。

（二）重要提示

中国证监会对本集合计划的备案，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。

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。

各方当事人同意，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，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会解决，根据该会届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为上海市，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，除非仲裁裁决另有规定，仲裁费由败诉方承担。

五、其他资料查询方式

以下资料详见上海证券有限责任公司官方网站 [<https://www.shzq.com/>] [客服电话：4008-918-918]

- 1、《上海证券弘利债券型集合资产管理计划集合资产管理合同》
- 2、《上海证券弘利债券型集合资产管理计划托管协议》
- 3、《上海证券弘利债券型集合资产管理计划招募说明书》
- 4、定期报告，包括集合计划季度报告、中期报告和年度报告
- 5、集合计划份额净值
- 6、销售机构及联系方式
- 7、其他重要资料

六、其他情况说明

无。