

## 太平洋证券30天滚动持有债券型集合资产管理计划产品资料概要更新

编制日期：2024年08月09日

送出日期：2024年08月12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	太平洋证券30天滚动持有债券	基金代码	970142
基金简称A	太平洋证券 30 天滚动持有债券 A	基金代码A	970142
基金简称C	太平洋证券 30 天滚动持有债券 C	基金代码C	970143
基金管理人	太平洋证券股份有限公司	基金托管人	兴业银行股份有限公司
基金合同生效日	2022年04月01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	契约型开放式	开放频率	每个交易日可申购；每份份额设置30天滚动运作期
基金经理	开始担任本基金基金经理的日期	证券从业日期	
李岩	2022年12月07日	2015年08月02日	

注：本报告所述“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》的要求进行变更后的证券公司大集合资产管理产品。太平洋证券30天滚动持有债券型集合资产管理计划是由太平洋证券14天现金增益集合资产管理计划转型而来，经中国证券监督管理委员会机构部函[2022]326号文，准予变更。

## 二、基金投资与净值表现

## (一) 投资目标与投资策略

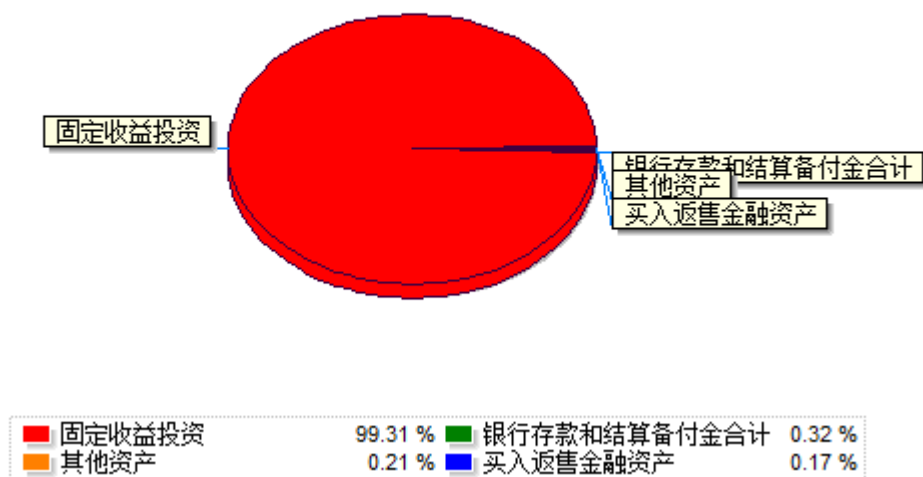
投资者可阅读《太平洋证券30天滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书》（更新）（简称《招募说明书》（更新））“集合计划的投资”部分了解详细情况。

投资目标	在保持投资组合低风险和较高流动性的前提下，追求集合计划资产长期稳健的增值。
投资范围	本集合计划主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括债券（含国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债、可转换公司债券、可交换债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、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

	<p>存款)、货币市场工具、现金等,以及法律法规或中国证监会允许集合资产管理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>本集合计划不直接投资股票;因持有可转换公司债券、可交换债券转股所得的股票,本集合计划将在其可交易之日起的10个交易日内卖出。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许集合资产管理计划投资其他品种,管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。</p> <p>本集合计划的投资组合比例为:债券资产的比例不低于集合计划总资产的80%;投资于可转换公司债券、可交换债券的比例合计不超过集合计划总资产的20%;本集合计划保持不低于集合计划资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p> <p>如果法律法规或监管机构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>本集合计划将密切关注宏观经济及债券市场运行情况,动态调整类属资产配置比例,并通过自下而上精选债券,力争获取优化收益。本集合计划采取的投资策略主要包括资产配置策略、债券类属配置策略、久期调整策略,收益率曲线配置策略,息差策略。</p>
业绩比较基准	<p>中债综合财富(1年以下)指数收益率*90%+一年期定期存款利率(税后)*10%</p>
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、混合型集合资产管理计划、股票型基金和股票型集合资产管理计划。</p>

## (二) 投资组合资产配置图表 / 区域配置图表

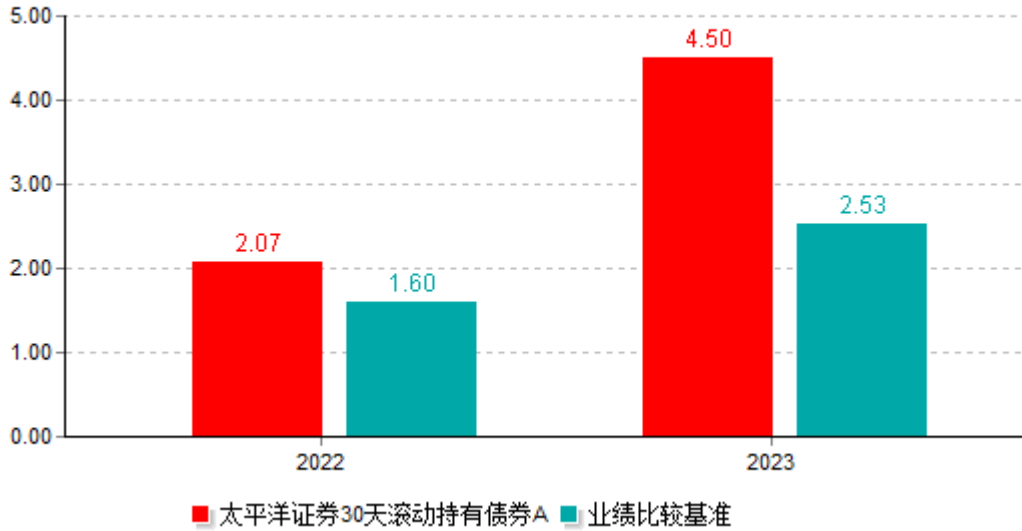
数据截止日: 2024年06月30日



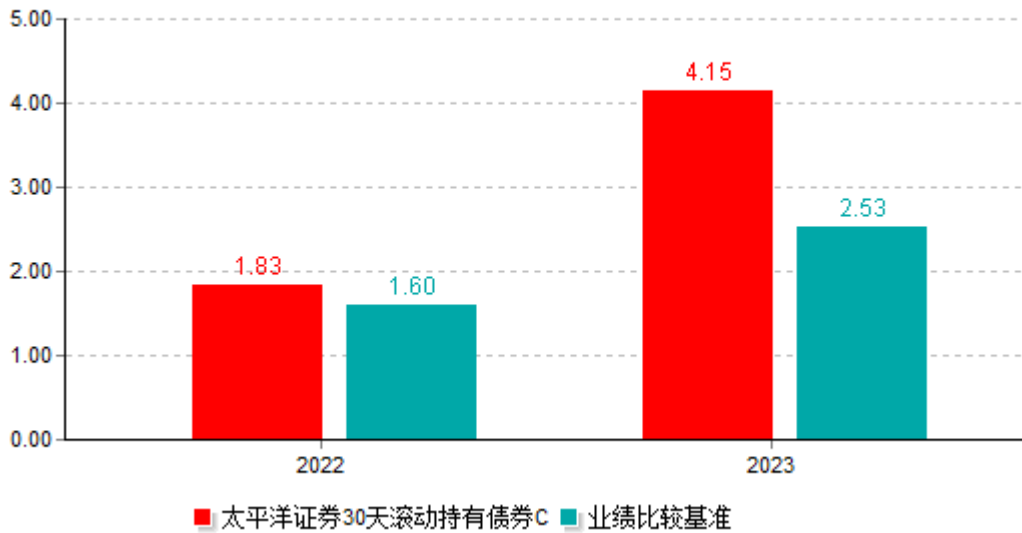
注: 本集合计划合同生效日为2022年4月1日, 集合计划类型为债券型。

## (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，数据截止日：2023年12月31日  
单位%



基金的过往业绩不代表未来表现，数据截止日：2023年12月31日  
单位%



### 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：

太平洋证券30天滚动持有债券A

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 (前收费)	M < 100万	0.10%	
	100万 ≤ M < 500万	0.08%	

	500万≤M<1000万	0.05%	
	M≥1000万	1000.00元/笔	
赎回费	N<7天	1.50%	
	N≥30天	0.00元/笔	

## 太平洋证券30天滚动持有债券C

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（前收费）		0.00	
赎回费	N<7天	1.50%	
	N≥30天	0.00元/笔	

认购费：太平洋证券30天滚动持有债券型集合资产管理计划是由太平洋证券14天现金增益集合资产管理计划转型而来，故变更后的《太平洋证券30天滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》（简称《资产管理合同》）中未设置认购费。

申购费：本集合计划C类份额不收取申购费，对A类份额收取申购费。本集合计划投资者通过销售机构首次申购本集合计划的单笔最低金额为人民币1元（含申购费）。实际操作中，各销售机构对本集合计划最低申购金额、交易级差以及申购费率有其他规定的，具体以各销售机构公布的为准，投资者需遵循销售机构的相关规定。申购费用由申购本集合计划的A类份额投资人承担，在A类份额投资人申购集合计划份额时收取，不列入集合计划财产，投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

赎回费：对持续持有期少于7日的投资人收取1.5%的赎回费，并全额计入集合计划资产。但由于本集合计划对每份份额设定30天的滚动运作期，本集合计划一般情况下不收取赎回费用。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。

**（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%	管理人
托管费	0.05%	基金托管人
销售服务费C	0.30%	销售机构
审计费用	20,000.00	会计师事务所
信息披露费	120,000.00	规定披露报刊
其他费用	按照国家有关规定和《资产管理合同》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) 本集合计划管理费、托管费按前一日集合计划资产净值计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

### (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：

太平洋证券30天滚动持有债券A

	基金运作综合费率（年化）
持有期	0.68%

注：管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为产品现行费率，其他运作费用以最近一次产品年报披露的相关数据为基准测算。

太平洋证券30天滚动持有债券C

	基金运作综合费率（年化）
持有期	0.98%

注：管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为产品现行费率，其他运作费用以最近一次产品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，投资者投资于本集合计划前应认真阅读本集合计划的《资产管理合同》、《招募说明书（更新）》等法律文件及相关公告，如实填写个人信息并核对自身的风险承受能力，选择与自己风险识别能力和风险承受能力相匹配的集合计划产品。

本集合计划面临的风险包括：市场风险、管理风险、流动性风险、特定风险、操作或技术风险、合规性风险、本集合计划法律文件风险收益特征表述与销售机构风险评价可能不一致的风险、其他风险。其中，特定风险包括：

1、根据申购规则和销售服务费收取方式的不同，本集合计划份额分为A类份额和C类份额，各类份额净值不同。投资者需要了解，各类集合计划份额类别对应的可供分配收益及赎回金额将有所不同。

对于每份份额，第一个运作期指资产管理合同生效日（对于投资者依据原《太平洋证券14天现金增益集合资产管理计划资产管理合同》参与原集合计划获得的太平洋证券14天现金增益集合资产管理计划份额而言，下同）或该集合计划份额申购确认日（对申购份额而言，下同）起（即第一个运作期起始日），至资产管理合同生效日或该集合计划份额申购申请日后的第30天（即第一个运作期到期日，如该日为非工作日则顺延至下一个工作日）止。第二个运作期指第一个运作期到期日的次一日起，至资产管理合同生效日或该集合计划份额申购申请日后的第60天（即第二个运作期到期日，如该日为非工作日则顺延至下一个工作日）止，第三个运作期指第二个运作期到期日的次一日起，至资产管理合同生效日或集合计划份额申购申请日后的第90天（即第三个运作期到期日，如该日为非工作日则顺延至下一个工作日）止。以此类推。如果集合计划份额持有人在当期运作期到期

日未申请赎回，则自该运作期到期日下一日起该集合计划份额进入下一个运作期。因此集合计划份额持有人面临在运作期内不能赎回集合计划份额的风险，以及错过运作期到期日以至未能赎回而进入下一运作期的风险。

2、本集合计划为债券型集合资产管理计划，债券资产的比例不低于集合计划总资产的80%，本集合计划不直接投资股票。因此，本集合计划需要承担债券市场整体下跌的风险。

3、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。

4、本集合计划可能面临启用侧袋估值的风险。

本集合计划的运作特点详见《资产管理合同》和《招募说明书（更新）》的约定。本集合计划的一般风险及特定风险详见《招募说明书（更新）》的“风险揭示”部分。

## （二）重要提示

1、作出投资决定前，请阅读完整的《太平洋证券30天滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书（更新）》等销售文件；

2、中国证监会对太平洋证券14天现金增益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；

3、集合计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利，也不保证最低收益；

4、集合计划投资者自依《资产管理合同》取得集合计划份额，即成为集合计划份额持有人和《资产管理合同》的当事人；

5、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；

6、因履行《资产管理合同》发生的争议，由各方协商解决，协商不成的，任何一方可提请中国证券业协会证券纠纷行业调解，调解不成，任何一方均有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会按其届时有效的仲裁规则进行仲裁解决。

## 五、其他资料查询方式

### （一）查询方式

投资者可登录管理人网站（<https://www.tpyzq.com>）查询，或在营业时间内至管理人或托管人的办公场所免费查阅。投资者对本集合计划如有疑问，可拨打客服电话（95397）咨询本集合计划管理人。

### （二）查询内容

1、中国证监会同意合同变更的文件；

2、《太平洋证券30天滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》；

- 3、《太平洋证券30天滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书》及其更新；
- 4、《太平洋证券30天滚动持有债券型集合资产管理计划托管协议》；
- 5、管理人业务资格批复、营业执照；
- 6、报告期内在规定媒介上公开披露的各项公告（包括但不限于本集合计划产品资料概要、定期报告、份额净值、销售机构及其联系方式等）。

## 六、其他情况说明

无。