

东海证券海鑫双悦 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划

基金产品资料概要更新

编制日期：2024 年 9 月 3 日

送出日期：2024 年 9 月 4 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	东海证券海鑫双悦 3 个月滚动持有债券型	基金代码	970107
下属基金简称	东海证券海鑫双悦 3 个月滚动持有债券型 A	下属基金交易代码	970107
下属基金简称	东海证券海鑫双悦 3 个月滚动持有债券型 C	下属基金交易代码	970108
基金管理人	东海证券股份有限公司	基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金合同生效日	2021 年 12 月 20 日	上市交易所及上市日期	不涉及上市
基金类型	债券型	交易币种	人民币
运作方式	其他开放式	开放频率	每个交易日开放申购，但对于每份集合计划份额设定 3 个月的滚动运作期
基金经理	潘一菲	开始担任本基金基金经理的日期	2021 年 12 月 20 日
		证券从业日期	2016 年 9 月 11 日

注：东海证券海鑫双悦 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划简称“本集合计划”。本集合计划的投资经理潘一菲自 2019 年 10 月 17 日起担任原东海证券双月盈集合资产管理计划投资经理。

二、基金投资与净值表现

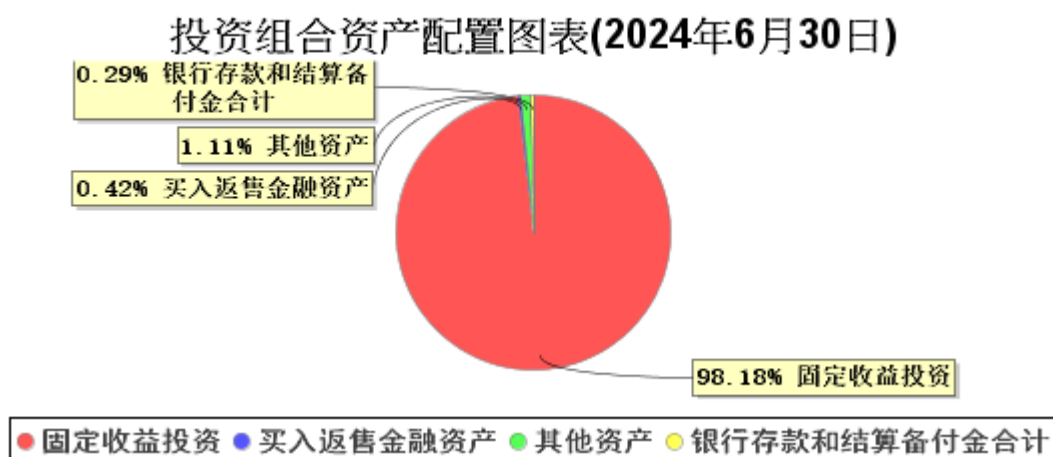
(一) 投资目标与投资策略

具体请查阅本集合计划的《东海证券海鑫双悦 3 个月滚动持有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”了解详细情况。

投资目标	本集合计划主要投资于债券资产，在控制集合计划资产净值波动的基础上，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。
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、金融债、地方政府债、政府支持机构债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、可转换债券、可交换债券）、资产支持证券、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、债券回购、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）。

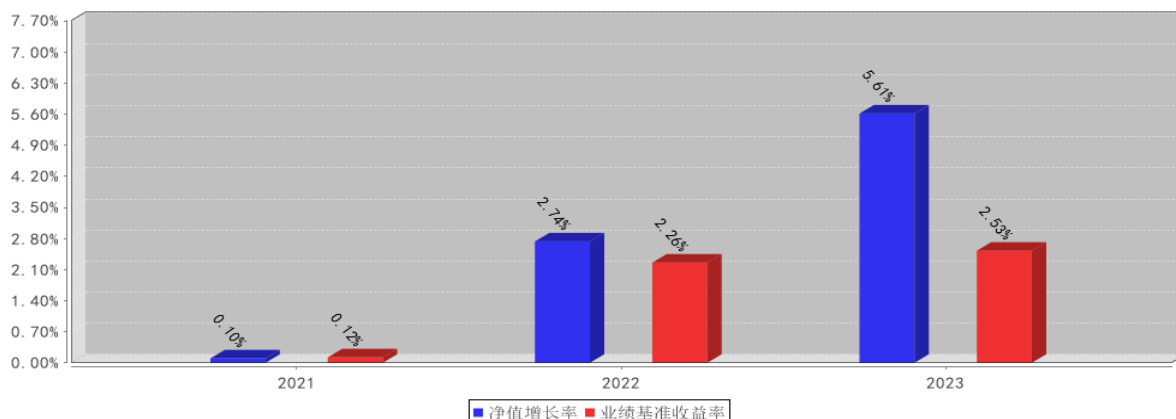
	<p>本集合计划不参与新股申购或增发新股，也不直接买入股票等权益类资产，因持有可转换债券转股和可交换债券换股形成的股票应在其可交易之日起的 10 个交易日内卖出。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>集合计划的投资组合比例为：</p> <p>本集合计划投资于债券的比例不低于集合计划资产的 80%。每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本集合计划持有现金或者到期日在 1 年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p>
<p>主要投资策略</p>	<p>本集合计划的主要投资策略包括：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、买入持有策略； 2、久期调整策略 3、收益率曲线配置策略 4、板块轮换策略 5、骑乘策略 6、个券选择策略 7、信用债券投资策略 8、可转换债券/可交换债券投资策略 9、国债期货投资策略 10、融资杠杆策略 11、资产支持证券投资策略
<p>业绩比较基准</p>	<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>
<p>风险收益特征</p>	<p>本集合计划为债券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/区域配置图表

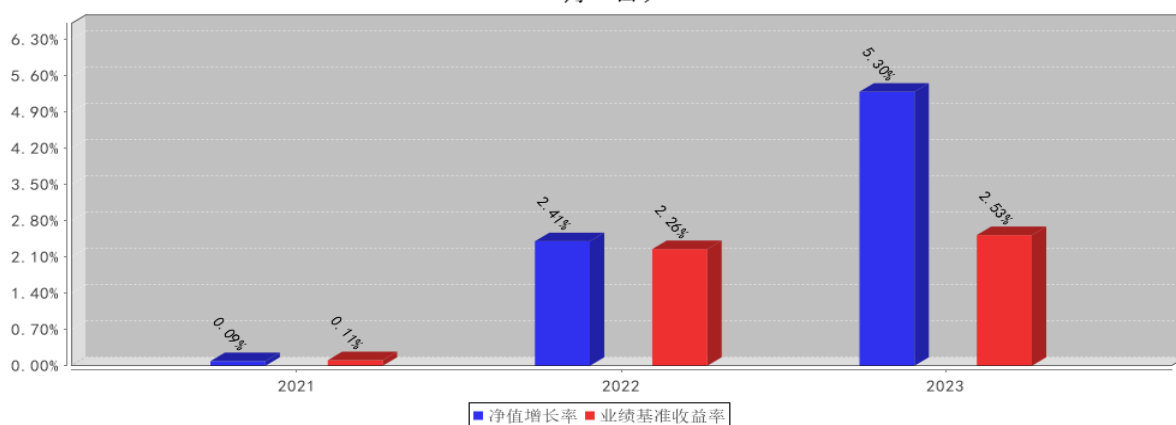


(三) 自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

东海证券海鑫双悦3个月滚动持有债券型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）



东海证券海鑫双悦3个月滚动持有债券型C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。

合同生效当年不满完整自然年度，按实际期限（2021年12月20日-2021年12月31日）计算净值增长率。

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：

东海证券海鑫双悦3个月滚动持有债券型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 < 50 万元	0.30%	-
	50 万元 ≤ M < 200 万元	0.20%	-
	200 万元 ≤ M < 500 万元	0.10%	-
	M ≥ 500 万元	1,000 元/笔	按笔收取

东海证券海鑫双悦3个月滚动持有债券型C

费用类型	份额(S)或金额(M)	收费方式/费率	备注
------	-------------	---------	----

	/持有期限 (N)		
申购费 (前收费)	不收取申购费		

注:本集合计划的申购费用由申购集合计划份额的投资人承担,主要用于本集合计划的市场推广、销售、注册登记等各项费用,不列入集合计划财产。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。

赎回费

本集合计划不收取赎回费用。

(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	东海证券海鑫双悦 3 个月滚动持有债券型 A	0.5%	集合计划管理人和销售机构
	东海证券海鑫双悦 3 个月滚动持有债券型 C	0.5%	
托管费	东海证券海鑫双悦 3 个月滚动持有债券型 A	0.1%	基金托管人
	东海证券海鑫双悦 3 个月滚动持有债券型 C	0.1%	基金托管人
销售服务费	东海证券海鑫双悦 3 个月滚动持有债券型 C	0.3%	销售机构
审计费用	50,000.00 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	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、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、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) 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:

东海证券海鑫双悦 3 个月滚动持有债券型 A

	基金运作综合费率 (年化)
--	---------------

持有期间	0.64%
------	-------

注：基金运作综合费率=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基金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。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集合计划年报披露的相关数据为基准测算。

东海证券海鑫双悦 3 个月滚动持有债券型 C

基金运作综合费率(年化)	
持有期间	0.94%

注：基金运作综合费率=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基金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。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) 本集合计划投资于债券的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发债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) 本集合计划对于每份集合计划份额，设定 3 个月的滚动运作期。每个运作期到期日前，本集合计划份额持有人不能提出赎回申请。每个运作期到期日，本集合计划份额持有人可提出赎回申请。因此，在运作期内，集合计划份额持有人将面临不能赎回集合计划份额而出现的流动性约束。

(3) 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工作日起该集合计划份额进入下一个运作期。因此，若集合计划份额持有人未在当期运作期到期日申请赎回，将继续持有至下一个运作期。

(4) 若本集合计划在开放期发生了巨额赎回，管理人有可能采取部分延期赎回的措施以应对巨额赎回，因此在巨额赎回情形发生时，集合计划份额持有人存在不能及时获得赎回款项的风险。

(5) 国债期货的投资风险

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。

(6) 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。

(7) 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双月盈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、《东海证券海鑫双悦 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》、《东海证券海鑫双悦 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划托管协议》、《东海证券海鑫双悦 3 个月滚动持有债券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。