

申万宏源双季增享6个月持有期债券型集合资产管理计划（申万宏源双季增享6个月债券B份额）

基金产品资料概要更新

编制日期：2024年11月14日

送出日期：2024年11月14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	申万宏源双季增享6个月债券	基金代码	970188
下属基金简称	申万宏源双季增享6个月债券B	下属基金交易代码	970189
基金管理人	申万宏源证券资产管理有限公司	基金托管人	兴业银行股份有限公司
基金合同生效日	2022年10月13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	其他开放式	开放频率	每两周开放一次赎回，不开放申购
基金经理	丁杰科	开始担任本基金基金经理的日期	2020年1月3日
		证券从业日期	2011年12月10日
基金经理	季程	开始担任本基金基金经理的日期	2018年3月29日
		证券从业日期	2014年5月16日
基金经理	秦庆	开始担任本基金基金经理的日期	2022年10月13日
		证券从业日期	2008年6月30日
其他	本集合计划存续期限自本集合计划合同生效之日起3年。		

申万宏源  
骑

注：1、本概要所述的“基金”系指按照《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》的要求完成合同变更后的证券公司大集合资产管理计划申万宏源双季增享6个月持有期债券型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）。管理人拟向中国证监会申请公募基金管理资格，在取得公募基金管理资格后，管理人将按照相关监管规定将本集合计划注册变更为公募基金。

2、丁杰科女士、季程先生分别自2020年1月3日、2018年3月29日开始任职申银万国灵通快利7天集合资产管理计划的投资主办人，申银万国灵通快利7天集合资产管理计划经证监会批准参照公募基金运作并更名为申万宏源双季增享6个月持有期债券型集合资产管理计划，《申万宏源双季增享6个月持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“《资产管理合同》”）自2022年10月13日起正式生效。秦庆先生为新增投资经理。

3、对于投资者依据《申银万国灵通快利7天集合资产管理计划资产管理合同》认购或参与集合计划获得的申银万国灵通快利7天集合资产管理计划份额，自本《资产管理合同》生效之日起投资者持有的上述份额全部自动转换为本集合计划B类计划份额。在本集合计划存续期间，B类份额每两周开放一次赎回，且赎回仅开放1天，不开放申购。管理人有权在B类计划份额开始办理赎回业务后确定开放赎回的首个周三，并在相关公告中公告。此后，每两周后的对应周的周三开放一次赎回（如遇节假日则当次不开放赎回）

4、申万宏源证券有限公司资管子公司申万宏源证券资产管理有限公司已取得中国证券监督管理委员会颁发的《经营证券期货业务许可证》，本集合计划已平移至资管子公司运作管理，即本集合计划管理人变更为资管子公司，本集合计划合同及托管协议项下管理人的权利和义务由资管子公司承继，并由其履行管理人职责。

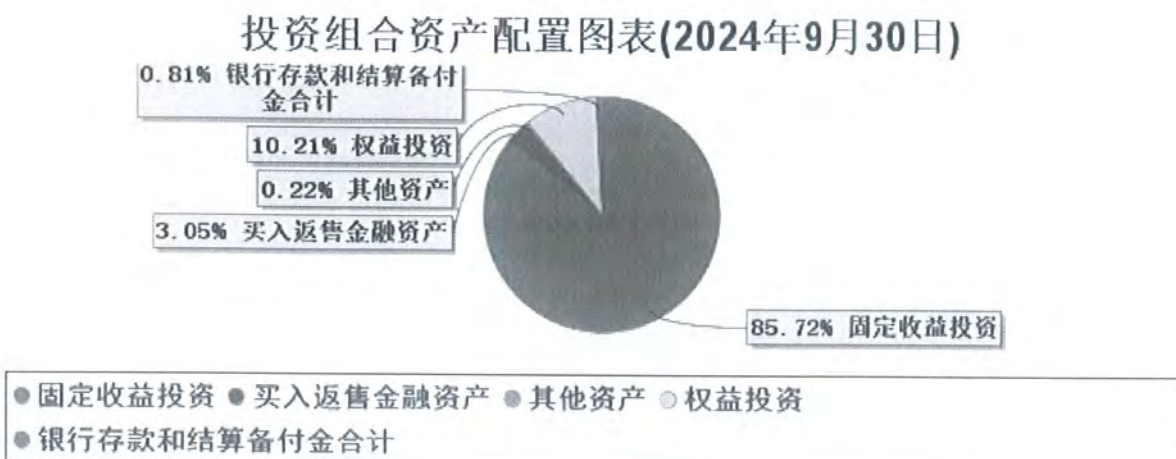
## 二、基金投资与净值表现

### （一）投资目标与投资策略

投资目标	本集合计划在追求本金安全、严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力求为持有人提供超越业绩比较基准的稳健回报，实现集合计划资产长期稳健增值。
投资范围	<p>本集合计划主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票）、债券（包括国内依法发行的国债、地方政府债、政府支持机构债、央行票据、金融债券（含次级债券）、政策性金融债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含分离交易可转债、可交换债券）、证券公司发行的短期公司债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据）、债券回购、银行存款（包括协议存款、通知存款、定期存款）、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许投资其他品种，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：本集合计划投资于债券的比例不低于集合计划总资产的80%；投资于股票、可转换债券（含分离交易可转债、可交换债券）等权益类资产的投资比例合计不超过集合计划总资产的20%；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，现金或者到期日在一年以内的政府债券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>如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种或对投资比例要求发生变更，集合计划管理人在履行适当程序后，可以相应调整本集合计划的投资范围和投资比例规定。</p>
主要投资策略	<p>坚持稳健投资，在严格控制风险的基础上，追求长期持续稳定的合理回报。本集合计划的债券投资策略包括久期偏离策略、类别选择策略、相对价值策略、个券选择策略、信用债投资策略。</p> <p>本集合计划的投资策略还包括国债期货投资策略、股票投资策略等。</p>
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率*90%+ 沪深300指数收益率*10%
风险收益特征	本集合计划为债券型集合资产管理计划，在通常情况下其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、现金管理型集合计划，低于股票型基金、股票型集合计划、混合型基金和混合型集合计划。

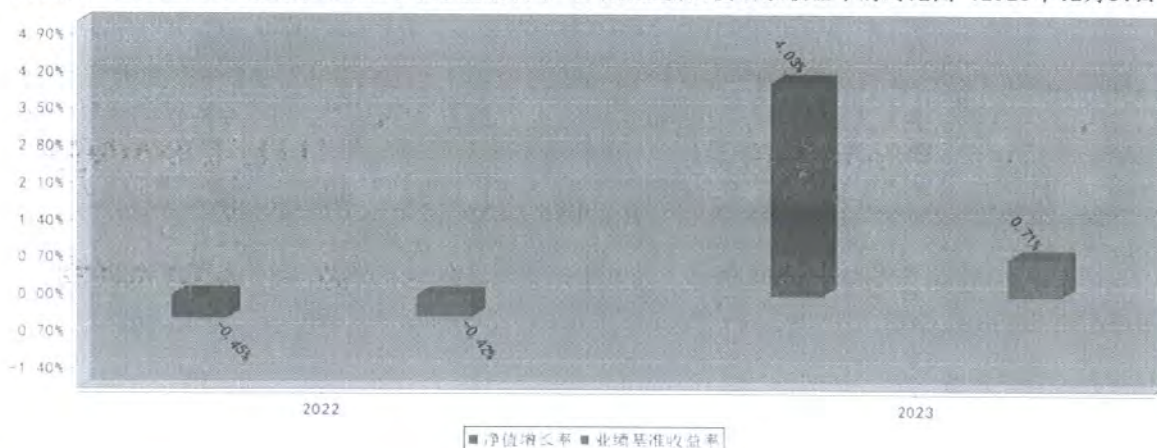
注：详见《申万宏源双季增享6个月持有期债券型集合资产管理计划招募说明书》第九部分“集合计划的投资”。

## (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

申万宏源双季增享6个月债券B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：1. 本集合计划的过往业绩不代表未来表现。

2. 本集合计划合同生效之日为2022年10月13日，合同生效当年的净值增长率及同期业绩比较基准按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3. 2023年12月27日，本集合计划发生投资经理变更，增聘投资经理叶蕊；2024年11月14日，解聘投资经理叶蕊。

## 三、投资本基金涉及的费用

### (一) 基金销售相关费用

#### 认购费

注：本集合计划已成立，投资本集合计划不涉及认购费。

#### 申购费

注：在本集合计划存续期间，B类份额每两周开放一次赎回，且赎回仅开放1天，不开放申购。管理人有权在B类计划份额开始办理赎回业务后确定开放赎回的首个周三，并在相关公告中公告。此后，每两周后的对应周的周三开放一次赎回（如遇节假日则当次不开放赎回）。

#### 赎回费

注：本集合计划B类计划份额赎回时不收取赎回费。

## （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	0.2%	基金管理人和销售机构
业绩报酬	本集合计划B类计划份额采用逐笔计提法提取业绩报酬，若单个集合计划B类计划份额持有人的单笔份额在其持有期间的年化收益率超过业绩报酬计提基准（4%）时，按照超过业绩报酬计提基准部分的20%提取业绩报酬。本集合计划业绩报酬在集合计划份额持有人赎回/转出集合计划份额或《资产管理合同》终止清算时收取。	基金管理人和销售机构
托管费	0.05%	基金托管人
审计费用	8,000.00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	《资产管理合同》生效后与集合计划相关的律师费、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/期货等交易费用；集合计划的银行汇划费用；账户开户费用、账户维护费用；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、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、以上费用年金额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：

申万宏源双季增享6个月债券B

	基金运作综合费率（年化）
-	0.30%

注：1、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。

2、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。

## 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，投资者购买本集合计划时应认真阅读本集合计划的《资产管理合同》、《招募说明书》等销售文件。

本集合计划的主要风险包括市场风险、管理风险、流动性风险、特有风险、操作或技术风险、合规性风险和其他风险。本集合计划的特有风险主要包括：

1、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；

2、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；

3、本集合计划对于A类计划份额、C类计划份额设置6个月锁定持有期，集合计划份额在锁定持有期内不办理赎回及转换转出业务。自锁定持有期结束后即进入开放持有期，可以办理赎回及转换转出业务。因此A类计划份额、C类计划份额集合计划份额持有人面临在锁定持有期内不能赎回集合计划份额的风险；

4、本集合计划B类计划份额采用逐笔计提法提取业绩报酬，其每日披露的集合计划份额净值为未扣除集合计划管理人业绩报酬前的集合计划份额净值。由于赎回/转出或者集合计划终止清算时集合计划管理人可能计提业绩报酬，投资者实际赎回/转出/清算金额，以登记机构确认数据为准。此外，B类计划份额每两周开放一次赎回，且赎回仅开放1天，如遇节假日则当次不开放赎回，故投资者在其余时间内还将不能赎回集合计划份额的风险。

## （二）重要提示

中国证监会对申银万国灵通快利7天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。

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，但不保证本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

投资者自依《资产管理合同》取得本集合计划份额，即成为本集合计划份额持有人和《资产管理合同》的当事人。

本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，本概要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，敬请同时关注管理人发布的相关临时公告等。

因《资产管理合同》而产生的或与《资产管理合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方有权将上述争议提交上海仲裁委员会，按照申请仲裁时该会现行有效的仲裁规则进行仲裁。《资产管理合同》受中国法律管辖。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见申万宏源证券资产管理有限公司官方网站 [www.swhyzqgl.com] [客服电话：95523]

《申万宏源双季增享6个月持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》、《申万宏源双季增享6个月持有期债券型集合资产管理计划托管协议》、《申万宏源双季增享6个月持有期债券型集合资产管理计划招募说明书》

定期报告，包括本集合计划季度报告、中期报告和年度报告

本集合计划份额净值

销售机构及联系方式

其他重要资料

申万宏源  
证券  
有限公司

