

# 东海增益债券型发起式证券投资基金（东海增益债券发起式 A 份额）

## 基金产品资料概要

编制日期：2024 年 11 月 21 日

送出日期：2024 年 11 月 22 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	东海增益债券发起式	基金代码	022399
下属基金简称	东海增益债券发起式 A	下属基金交易代码	022399
基金管理人	东海基金管理有限责任公司	基金托管人	兴业银行股份有限公司
基金合同生效日	-	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	普通开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	邵炜	开始担任本基金基金经理的日期	-
		证券从业日期	2012 年 6 月 29 日
其他	<p>《基金合同》生效之日起三年后的对应日，若基金资产净值低于 2 亿元，基金合同按其约定程序进行基金财产清算并终止，无需召开基金份额持有人大会审议，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。若届时法律法规或中国证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充，则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。</p> <p>《基金合同》生效满 3 年后继续存续的，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于人民币 5000 万元的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情况的，基金管理人应当在 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，解决方案包括持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。</p>		

### 二、基金投资与净值表现

#### (一) 投资目标与投资策略

（投资者阅读《招募说明书》第九章了解详细情况）

投资目标	本基金主要投资于债券资产，严格管理权益类品种的投资比例，在控制基金资产净值波动的基础上，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资范围	本基金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交易的债券（国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可交换债

	<p>券、可转换债券（含分离交易可转债）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、国债期货、股票（含创业板及经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金（不包括 QDII 基金、香港互认基金、FOF 基金、可投资基金的非 FOF 基金、货币市场基金、非本基金管理人管理的基金（全市场的股票型 ETF 除外）等，以及法律法规或中国证监会允许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>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%，本基金对股票、存托凭证、股票型基金、混合型基金等权益类资产及可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债）的合计投资比例不超过基金资产的 20%；本基金持有其他基金，其市值不超过基金资产净值的 10%；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，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。其中，计入上述权益类资产的混合型基金需符合下列两个条件之一：</p> <p>1、基金合同约定股票及存托凭证资产投资比例不低于基金资产 60%的混合型基金；</p> <p>2、根据基金披露的定期报告，最近四个季度中任一季度股票及存托凭证资产占基金资产比例均不低于 60%的混合型基金。</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，基金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>（一）资产配置策略、（二）债券投资策略 1、普通债券投资策略（1）久期控制（2）期限结构配置（3）市场比较（4）相对价值判断（5）信用风险评估 2、信用债券投资策略 3、可转换债券投资策略 4、可交换债券投资策略 5、债券回购杠杆策略、（三）股票投资策略、（四）国债期货投资策略、（五）存托凭证投资策略、（六）基金投资策略</p>
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期收益和风险高于货币市场基金，但低于股票型基金和混合型基金。

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

无

(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

无

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
认购费	M < 100 万元	0.6%
	100 万元 ≤ M < 300 万元	0.4%
	300 万元 ≤ M < 500 万元	0.2%
	M ≥ 500 万元	1,000 元/笔

申购费 (前收费)	M < 100 万元	0.8%
	100 万元 ≤ M < 300 万元	0.5%
	300 万元 ≤ M < 500 万元	0.3%
	M ≥ 500 万	1,000 元/笔
赎回费	N < 7 日	1.5%
	7 日 ≤ N < 30 日	0.1%
	N ≥ 30 日	0%

注：本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持有期少于 7 日的投资人收取的赎回费，赎回费总额的 100% 归入基金财产；对持有期不少于 7 日的投资人收取的赎回费，赎回费总额 25% 归入基金财产，其余用于市场推广、登记等各项费用。

## (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	0.40%	基金管理人和销售机构
托管费	0.10%	基金托管人
其他费用	《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用，法律法规、中国证监会另有规定的除外；《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费、财产保全费和仲裁费；基金份额持有人大会费用；基金的证券、期货交易或结算费用；基金的银行汇划费用；基金相关账户的开户及维护费用；基金投资其他基金产生的其他基金的销售费用，但法律法规禁止从基金财产中列支的除外；按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。	

注：本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

本基金投资于基金管理人管理的其他基金部分不收取管理费。本基金投资于基金托管人托管的其他基金部分不收取托管费。

基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不得收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金财产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费用。

## (三) 基金运作综合费用测算

## 四、风险揭示与重要提示

### (一) 风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

1、本基金特有的风险包括：

#### (1) 债券投资风险

本基金为债券型基金，投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，具有对债券市场的系统性风险，不能完全规避市场下跌的风险，在市场大幅上涨时也不能保证基金净值能够完全跟随或超越市场上涨幅度。因此，本基金需要承担由于市场利率波动造成的利率风险、发债主体的信用质量变化造成的信用风险，以及无法偿债造成的信用违约风险；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) 国债期货投资风险

本基金的投资范围包括国债期货，国债期货的投资可能面临市场风险、基差风险、流动性风险等风险。

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价差的波动，影响套期保值或套利效果，使之发生意外损失的风险。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。

### （3）资产支持证券投资风险

本基金可投资于资产支持证券。资产支持证券是一种债券性质的金融工具，其向投资者支付的本息来自于基础资产池产生的现金流或剩余权益。与股票和一般债券不同，资产支持证券不是对某一经营实体的利益要求权，而是对基础资产池产生的现金流和剩余权益的要求权，是一种以资产信用为支持的证券。资产支持证券存在信用风险、利率风险、提前偿付风险、操作风险和法律风险等。

### （4）投资存托凭证的风险

本基金可投资存托凭证，存托凭证是指由存托人签发、以境外证券为基础在中国境内发行、代表境外基础证券权益的证券。本基金投资存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还可能面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

### （5）基金投资其他基金的风险

本基金可投资其他基金，包括全市场的股票型 ETF 及基金管理人旗下的基金。本基金对被投资基金的评估具有一定的主观性，将在基金投资决策中给基金带来一定的不确定性的风险。被投资基金的波动会受到宏观经济环境、行业周期、基金经理管理能力和基金管理人自身经营状况等因素的影响。因此，本基金整体表现可能受所投资基金的影响。

本基金除了承担投资其他基金的管理费、托管费和销售费用（其中申购本基金基金管理人自身管理的其他基金（ETF 除外）应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金财产的赎回费用除外）、销售服务费等）外，还须承担本基金本身的管理费、托管费和销售费用（其中不收取基金财产中持有本基金管理人管理的其他基金部分的管理费、本基金托管人托管的其他基金部分的托管费），因此，本基金最终获取的回报与直接投资于其他基金获取的回报存在差异。

### （6）与发起式基金运作方式相关的基金合同提前终止风险

本基金为发起式基金，《基金合同》生效之日起三年后的对应日，若基金资产净值低于 2 亿元，基金合同按其约定程序进行基金财产清算并终止，无需召开基金份额持有人大会审议，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。因此，本基金存在基金合同提前终止的风险。

### （7）杠杆风险

本基金可以通过债券回购放大杠杆，进行杠杆操作将会放大组合收益波动，对组合业绩稳定性有较大影响，同时杠杆成本波动也会影响组合收益率水平，在市场下行或杠杆成本异常上升时，有可能导致基金资产收益的超预期下降风险。

### （8）流动性风险评估

#### 1) 投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金的投资标的均在相关法律法规及中国证监会规定的合法范围之内，且具备良好的可投资性和流动性。本基金的投资范围的设定合理、明确，操作性较强。本基金债券资产投资占基金资产的比例不低于 80%，本基金对股票、存托凭证、股票型基金、混合型基金等权益类资产及可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债）的合计投资比例不超过基金资产的 20%；本基金持有其他基金，其市值不超过基金资产净值的 10%。实际投资过程中，本基金主要投资于债券资产，严格管理权益类品种的投资比例，在控制基金资产

净值波动的基础上，力争实现基金资产的长期稳健增值。根据《流动性风险管理规定》的相关要求，本基金会审慎评估所投资资产的流动性，并针对性制定流动性风险管理措施，因此本基金流动性风险也可以得到有效控制。

## 2) 巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一开放日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

a) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

b) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日该类基金份额的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

c) 当基金出现巨额赎回时，在单个基金份额持有人赎回申请超过上一开放日基金总份额 10%的情形下，基金管理人认为支付该基金份额持有人的全部赎回申请有困难或者因支付该基金份额持有人的全部赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人可以对该单个基金份额持有人超出 10%的赎回申请实施延期办理，延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该类基金份额的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。但是如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择“取消赎回”的，则其当日未获受理部分赎回申请将被撤销。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。对该单个基金份额持有人 10%以内（含 10%）的赎回申请与其他投资者的赎回申请按上述 a）、b）方式处理，具体见相关公告。

d) 暂停赎回：连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在规定媒介上进行公告。

当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真、短信、电子邮件或由基金销售机构通知等方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并于两日内在规定媒介上刊登公告。

## 3) 实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

本基金在面临大规模赎回的情况下有可能因为无法变现造成流动性风险。

如果出现流动性风险，基金管理人经与基金托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可实施备用的流动性风险管理工具，包括但不限于延期办理巨额赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、收取短期赎回费、摆动定价、暂停基金估值、实施侧袋机制等，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施，同时基金管理人应时刻防范可能产生的流动性风险，对流动性风险进行日常监控，保护基金份额持有人的利益。当实施备用的流动性风险管理工具时，有可能无法按合同约定的时限支付赎回款项。

侧袋机制是一种流动性风险管理工具，是将特定资产分离至专门的侧袋账户进行处置清算，并以处置变现后的款项向基金份额持有人进行支付，目的在于有效隔离并化解风险。但基金启用侧袋机制后，侧袋账户份额将停止披露基金份额净值，并不得办理申购、赎回和转换，仅主袋账户份额正常开放赎回，因此启用侧袋机制时持有基金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，基金份额持有人可能因此面临损失。

实施侧袋机制期间，因本基金不披露侧袋账户份额的净值，即便基金管理人在基金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，因此对于特定资产的公允价值和最终变现价格，基金管理人不承担任何保证和承诺的责任。

基金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。

启用侧袋机制后，基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时仅需考虑主袋账户资产，基金业绩指标应当以主袋账户资产为基准，因此本基金披露的业绩指标不能反映特定资产的真实价值及变化情况。

2、开放式基金共有的风险，如市场风险、信用风险、管理风险、流动性风险、其他风险等。

3、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险。

## （二）重要提示

中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金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基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见东海基金管理有限责任公司官方网站 [<https://www.donghaifunds.com>] [客服电话：40095 95531]

《东海增益债券型发起式证券投资基金基金合同》

《东海增益债券型发起式证券投资基金托管协议》

《东海增益债券型发起式证券投资基金招募说明书》

定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告

基金份额净值

基金销售机构及联系方式

其他重要资料