

东证融汇禧悦 90 天滚动持有中短债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 12 月 05 日

送出日期：2024 年 12 月 13 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	东证融汇禧悦 90 天滚动	基金代码	970096
基金简称 A	东证融汇禧悦 90 天滚动 A	基金代码 A	970096
基金简称 C	东证融汇禧悦 90 天滚动 C	基金代码 C	970097
基金管理人	东证融汇证券资产管理有限公司	基金托管人	招商银行股份有限公司
基金合同生效日	2021 年 12 月 15 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	其他开放式	开放频率	每个开放日申购，每份集合计划设置 90 天滚动运作期
基金经理	应洁茜	开始担任本基金基金	2021 年 12 月 15 日

		经理的日期	
		证券从业日期	2013 年 07 月 22 日
基金经理	李卿睿	开始担任本基金基金	2023 年 01 月 11 日
		经理的日期	
		证券从业日期	2015 年 08 月 10 日
基金经理	郑铮	开始担任本基金基金	2023 年 01 月 11 日
		经理的日期	
		证券从业日期	2016 年 08 月 22 日

其他

东证融汇禧悦 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）为证券公司大集合资产管理产品，根据《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》，参照《基金法》等公开募集证券投资基金相关法律、行政法规及中国证监会的规定进行变更，本概要所述的“基金”也包括变更后的证券公司大集合资产管理产品。本集合计划存续期限自本合同生效之日起至 2025 年 6 月 16 日。本集合计划自 2025 年 6 月 16 日后，按照中国证监会相关规定执行。

注：本产品资料概要所述的“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。

二、基金投资与净值表现**（一）投资目标与投资策略**

请阅读《东证融汇禧悦 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划招募说明书》第十部分“集合计划的投资”了解详细情况。

投资目标

本集合计划在严格管理风险的前提下，主要投资中短期债券，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（国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、中期票据、政府支持机构债、政府支持债、地方政府债、可转换债券（含分离交易可转换债券）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、协议存款、通知存款、定期存款及其他银行存款、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。

本集合计划不参与新股申购或增发新股，也不直接投资于股票等权益类资产，但可持有因可转换债券、可交换债转股所形成的股票等权益类资产。因上述原因持有的股票，本集合计划将在其可交易之日起的 10 个交易日内卖出。

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。

本集合计划的投资组合比例为：本集合计划债

券资产的投资比例不低于集合计划资产的 80%，其中投资于中短期债券的比例不低于非现金资产的 80%。本集合计划持有的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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本集合计划所指的中短期债券是指剩余期限或回售期限不超过 3 年（含）的债券资产，主要包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、中期票据、政府支持机构债、政府支持债、地方政府债、可转换债券（含分离交易可转换债券）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等金融工具。

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。

主要投资策略

本集合计划主要采用：1、资产配置策略，采用专业的投资理念和分析方法，以系统化的研究为基础，通过对各类固定收益类资产的合理配置争取获取稳定收益；2、债券投资策略，在债券投资上主要通过久期配置、类属配置、期限结构配置和个券选择四个层次进行投资管理；

3、资产支持证券投资策略，将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策；4、可转换债券和可交换债券投资策略，采用定量分析和定性分析相结合的方式，考量包括正股基本面、转股溢价率、纯债溢价率、信用风险及流动性等综合因素判断其债券投资价值。

业绩比较基准

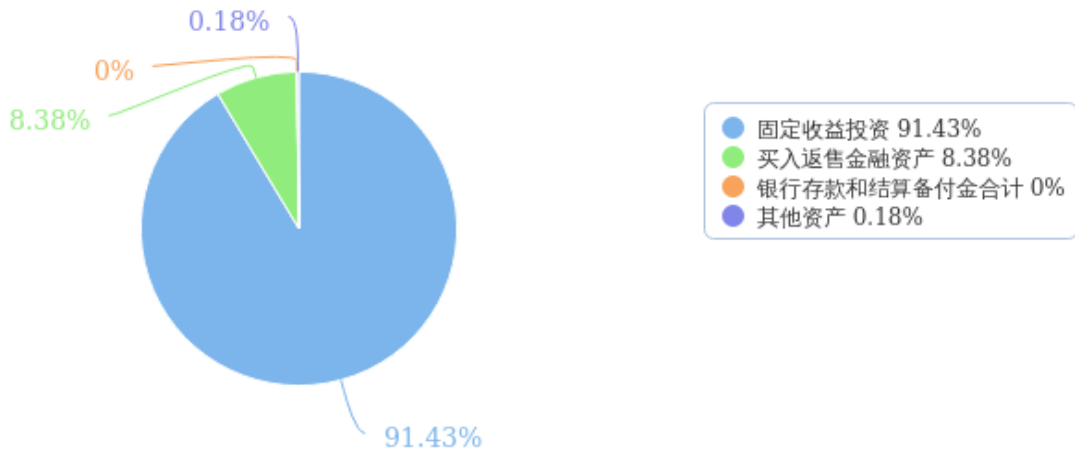
中债综合财富（1-3 年）指数收益率*80%+一年期定期存款利率（税后）*20%

风险收益特征

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市场型集合资产管理计划，低于股票型基金、股票型集合资产管理计划、混合型基金和混合型集合资产管理计划。

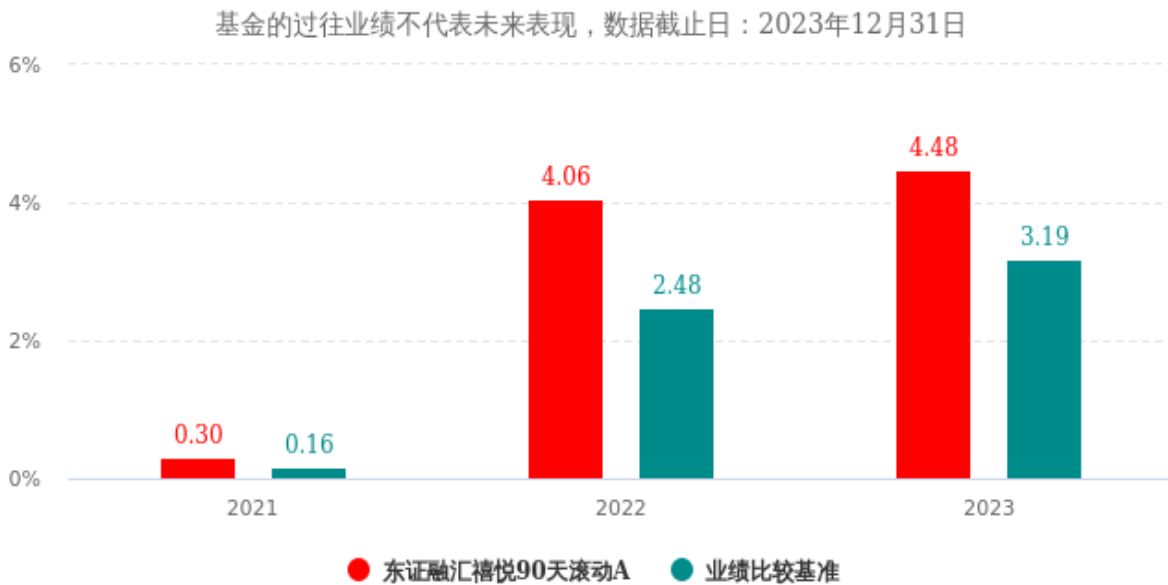
（二）投资组合资产配置图表/区域配置图表

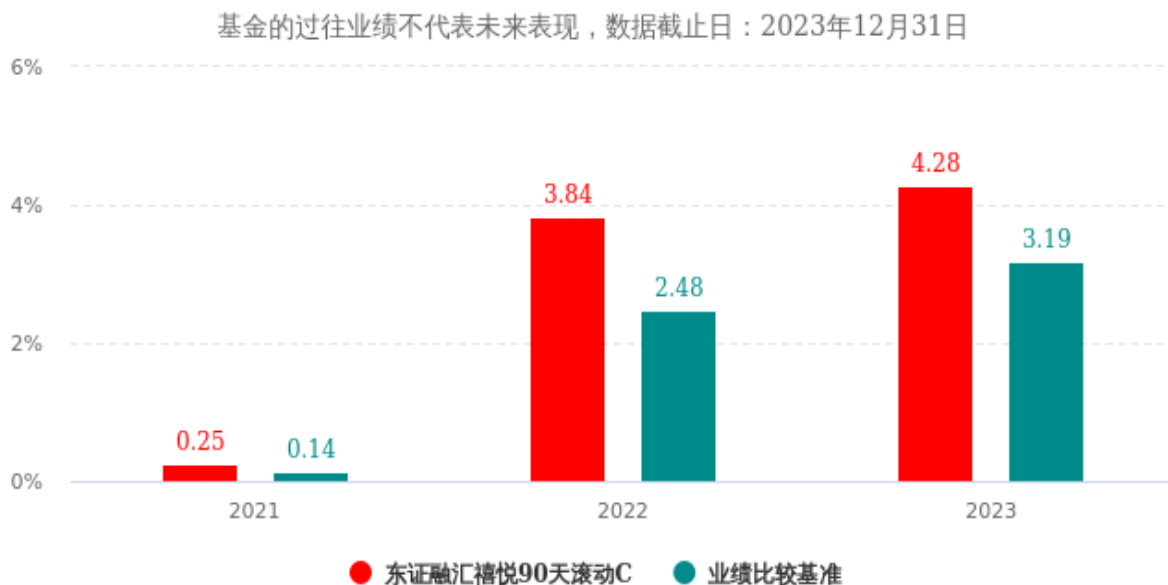
投资组合资产配置图表（数据截至日期：2024年09月30日）



(三) 自基金合同生效以来/最近十年（孰短）基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较

图





注：本集合计划合同生效日为 2021 年 12 月 15 日，本集合计划 C 类份额于 2021 年 12 月 17 日首次申购确认，2021 年 12 月 15 日至 2021 年 12 月 16 日期间，本集合计划 C 类份额为零。合同生效当年（2021 年）相关数据和指标按实际存续期计算，未按自然年度折算。集合计划的过往业绩不代表未来表现。

三、投资本基金涉及的费用

（一）基金销售相关费用

以下费用在申购/赎回基金过程中收取：

东证融汇禧悦 90 天滚动 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 万元	0.3%	
	100 万元≤M<500 万元	0.15%	
	元		

	M≥500 万元	1000.00 元/笔	
赎回费			不收取赎回费用（按法律法规要求收取的赎回费除外）

东证融汇禧悦 90 天滚动 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
赎回费			不收取赎回费用（按法律法规要求收取的赎回费除外）

(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	0.30%	基金管理人和销售机构
托管费	0.05%	基金托管人
销售服务费 C 类	0.20%	销售机构
审计费用	54,000.00 元/年	会计师事务所
信息披露费	120,000.00 元/年	规定披露报刊
其他费用	《资产管理合同》生效后与集 合计划相关的会计师费、律师 费和诉讼费；集合计划份额持 相关服务机构	

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；集合计划的开户费
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：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。

审计费、信息披露费金额为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。除上述费用外的其他运作费用，详见《东证融汇禧悦 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划更新招募说明书》第十五部分“集合计划费用与税收”了解详细情况。

（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：

东证融汇禧悦 90 天滚动 A

基金运作综合费用测算明细的类别	基金运作综合费率（年化）
-	0.35%

注：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。

东证融汇禧悦 90 天滚动 C

基金运作综合费用测算明细的类别	基金运作综合费率（年化）
-----------------	--------------

-

0.55%

注：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。

本集合计划的风险主要包括：

1、市场风险：

（1）政策风险；（2）经济周期风险；（3）信用风险；（4）利率风险；（5）购买力风险；（6）债券收益率曲线风险；（7）再投资风险

2、管理风险

3、流动性风险

4、本集合计划特定风险：

（1）滚动持有运作方式的风险

1）每个运作期到期日前，份额持有人不能赎回集合计划份额的风险

对于每份集合计划份额，管理人仅在该集合计划份额的每个运作期到期日为集合计划份额持有人办理赎回。在非运作期到期日，管理人不能为份额持有人办理赎回，且本集合计划不上市交易，份额持有人面临流动性风险。

2）当期运作期到期日，份额持有人未申请赎回或赎回被确认失败，则该份额自该运作期到期日次一日起自动进入下一个运作期风险。如果份额持有人在每份份额的当期运作期到期日未申请赎回或赎回被确认失败，则该份额将在该运作期到期日次一日起自动进入下一运作期。在下一运作期

到期日前，份额持有人不能赎回份额，份额持有人持有的份额将面临滚动运作的风险。

3) 每份份额每个实际运作期可能长于或短于 90 天的风险

本集合计划名称为东证融汇禧悦 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划，但是考虑到周末、法定节假日等非工作日原因，每份份额的每个实际运作期限或有不同，可能长于或短于 90 天。

投资者应当在熟悉并了解本集合计划运作规则的基础上，结合自身投资目标、投资期限等情况审慎作出投资决策，及时行使赎回权利。

(2) 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，低于股票型基金、股票型集合资产管理计划、混合型基金和混合型集合资产管理计划。

(3) 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。

(4) 本集合计划自资产管理合同变更生效日起存续至 2025 年 6 月 16 日，本集合计划份额持有人将面临在 2025 年 6 月 16 日资产管理合同到期的风险。

5、操作或技术风险

6、合规性风险

7、本集合计划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

8、其他风险

(二) 重要提示

中国证监会对东北证券元伯 2 号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。

本集合计划产品资料概要的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，管理人至少每年更新一次。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，敬请同时关注管理人发布的相关临时公告等。

因履行本集合计划资产管理合同发生的争议，由当事人协商解决，协商不成的，提交上海国际经济贸易仲裁委员会，按照该会届时有有效的仲裁规则仲裁，仲裁地为上海。仲裁裁决是终局性的，对各方均有约束力。仲裁费用由败诉方承担。

五、其他资料查询方式

以下资料详见管理人网站，网址：www.dzronghui.com，客服电话：021-80105551

- 1、集合计划资产管理合同、托管协议、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
- 5、其他重要资料

六、其他情况说明

无