

## 财通资管鸿启90天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新

编制日期：2021年08月19日

送出日期：2021年08月23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    | 财通资管鸿启90天滚动持有发起式中短债   | 基金代码        | 013216     |
| 基金简称A   | 财通资管鸿启90天滚动持有发起式中短债A  | 基金代码A       | 013216     |
| 基金简称C   | 财通资管鸿启90天滚动持有发起式中短债C  | 基金代码C       | 013217     |
| 基金管理人   | 财通证券资产管理有限公司  | 基金托管人       | 杭州银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | 2021年08月18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      |
| 基金经理    | 开始担任本基金基金经理的日期  | 证券从业日期      |            |
| 陈希希     | 2021年08月18日   | 2010年10月01日 |            |
| 其他      | 基金合同生效满三年之日，若基金资产净值低于2亿元，本基金将根据基金合同的约定进行基金财产清算并终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。《基金合同》生效满三年后继续存续的，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5000万元情形的，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形的，基金管理人应当10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、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。 |             |            |

注：1、本基金对每份基金份额设置90天滚动持有期，在每个运作期到期日前，基金份额持有人不能提出赎回申请。如果基金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基金份额进入下一个运作期。

2、本基金暂不向机构投资者公开发售（公募资产管理产品、发起资金提供方除外），如未来本基金开放向机构投资者公开发售或对发售对象的范围予以进一步限定，基金管理人将另行公告。

### 二、基金投资与净值表现

#### （一）投资目标与投资策略

（请阅读《招募说明书》第九章了解详细情况）

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 在严格控制风险的基础上，把握市场机会，追求基金资产的稳健增值。  |
| 投资范围   | <p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，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、公开发行的次级债、公开发行的二级资本债、可分离交易可转债的纯债部分、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、国债期货、货币市场工具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>本基金不投资于股票、权证等资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。</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>本基金债券资产的投资比例不低于基金资产的80%，其中投资于中短债主题证券的比例不低于非现金基金资产的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。</p> <p>本基金所指的中短债主题证券是指剩余期限或回售期限不超过三年的证券，主要包括国债、金融债、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、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债、公开发行的二级资本债、可分离交易可转债的纯债部分、资产支持证券等金融工具。</p> |
| 主要投资策略 | 1、资产配置策略；2、固定收益类投资策略；3、资产支持证券投资策略；4、国债期货投资策略   |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为：中债综合财富(1年以下)指数收益率*60%+中债综合财富(1-3年)指数收益率*30%+一年期定期存款利率(税后)*10%  |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，理论上其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。   |

## （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：

财通资管鸿启90天滚动持有发起式中短债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              | 0.40%   | 非养老金客户 |

|  |             |            |        |
|--|-------------|------------|--------|
|  | M<100万      | 0.16%      | 养老金客户  |
|  | 100万≤M<500万 | 0.20%      | 非养老金客户 |
|  | 100万≤M<500万 | 0.08%      | 养老金客户  |
|  | M≥500万      | 1000.00元/笔 |        |

**申购费 A:** 本基金的申购费用应在投资人申购 A 类基金份额时收取, 申购费用由投资人承担, 不列入基金财产, 主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。投资人可以多次申购本基金, 申购费用按每笔申购申请单独计算。因红利再投资而产生的基金份额, 不收取相应的申购费用。

## (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   |
|--------|--|
| 管理费    | 0.20%  |
| 托管费    | 0.05%  |
| 销售服务费C | 0.20%  |
| 其他费用   | 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用、会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费, 基金份额持有人大会费用, 基金的证券、期货交易费用, 基金的银行汇划费用, 基金的开户费用、账户维护费用, 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 |

## 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

本基金属于债券型基金, 投资范围主要为良好流动性的金融工具, 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、公开发行的次级债、公开发行的二级资本债、可分离交易可转债的纯债部分、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、国债期货、货币市场工具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。因此本基金将受到来自固定收益市场、衍生品市场方面风险: 一方面, 如果固定收益市场系统性风险爆发或对各类固定收益金融工具的选择不准确都将对本基金的净值表现造成不利影响; 另一方面, 尽管本基金以套期保值为目的参与衍生品投资, 但是由于衍生品通常具有杠杆效应, 价格剧烈波动时将会对本基金的净值造成影响。

本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%。因此, 本基金将无法完全避免债券市场的系统性风险。债券的投资收益会受到宏观经济、政府产业政策、货币政策、市场需求变化、行业波动等

因素的影响，可能存在所选投资标的的风险收益特征与市场一致预期不符而造成个券价格表现低于预期的风险。

持有期限内不能赎回基金份额的风险。本基金对每份A类、C类份额设置90天滚动持有期，在每个运作期到期日前，基金份额持有人不能提出赎回申请。投资者面临在持有期限届满前资金不能赎回的风险。

基金合同提前终止风险。本基金为发起式基金，基金合同生效满三年之日，若基金资产净值低于2亿元，本基金将根据基金合同的约定进行基金财产清算并终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。

## 2、投资资产支持证券的特定风险

本基金可投资资产支持证券，投资资产支持证券可能面临资产支持证券的标的信用风险、流动性风险，及证券化过程中的法律风险等，由此可能导致基金或基金份额持有人利益受损。

## 3、投资国债期货的特定风险

本基金可投资于国债期货，国债期货作为一种金融衍生品，其价值取决于一种或多种基础资产或指数，其评价主要源自于对挂钩资产的价格与价格波动的预期。投资国债期货所面临的风险主要是市场风险、流动性风险、基差风险、保证金风险、信用风险和操作风险。

此外，由于衍生品通常具有杠杆效应，价格波动比标的工具更为剧烈，并且其定价相当复杂，不适当的估值也有可能使基金资产面临损失风险。

## 4、本基金参与债券回购的风险

债券回购为提升整体基金组合收益提供了可能，但也存在一定的风险。债券回购的主要风险包括信用风险、投资风险及波动性加大的风险，其中，信用风险指回购交易中交易对手在回购到期时，不能偿还全部或部分证券或价款，造成基金净值损失的风险；投资风险是指在进行回购操作时，回购利率大于债券投资收益而导致的风险以及由于回购操作导致投资总量放大，致使整个组合风险放大的风险；而波动性加大的风险是指在进行回购操作时，在对基金组合收益进行放大的同时，也对基金组合的波动性（标准差）进行了放大，即基金组合的风险将会加大。回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对基金净值造成损失的可能性也就越大。

## 5、实施侧袋机制对投资者的影响

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拥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，基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时以主袋账户资产为基准，不反映侧袋账户特定资产的真实价值及变化情况。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，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。

## 6、开放式基金共有的风险如市场风险、管理风险、流动性风险和其他风险。

## （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。

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会，按照上海国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为上海市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有决定，仲裁费用由败诉方承担。

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

以下资料详见财通证券资产管理有限公司网站[[www.ctzg.com](http://www.ctzg.com)][客服电话:95336]

财通资管鸿启90天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金基金合同、托管协议、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

## 六、 其他情况说明

无