海通海升六个月持有期债券型集合资产管理计划（A类份额）产品资料概要（更新）

编制日期：2022年1月20日

送出日期：2022年1月21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	海通海升六个月持有	**基金代码**	850003
下属基金简称	海通海升六个月持有A	**下属基金交易代码**	850003
基金管理人	上海海通证券资产管理有限公司	**基金托管人**	中国农业银行股份有限公司
基金合同生效日	2021年1月14日		
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**	A类份额每个开放日办理申购赎回业务；每份A类份额设定六个月的锁定持有期，自其开放持有期首日起才能办理赎回业务。
基金经理	邱博文	**开始担任本基金基金经理的日期**	2021年4月19日
		证券从业日期	2015年1月3日
其他	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，由海通季季红集合资产管理计划转型而来。		

二、基金投资与净值表现

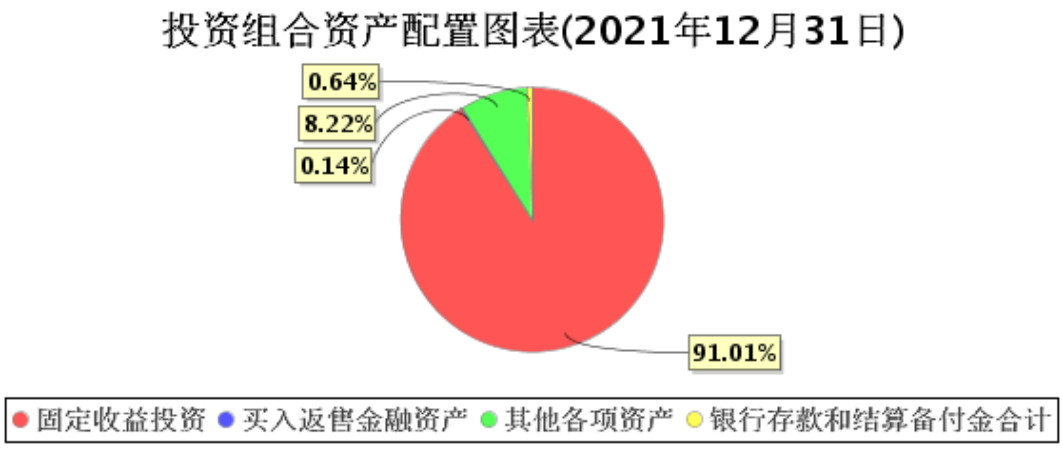
（一）投资目标与投资策略

投资目标	在控制和分散投资组合风险的前提下，实现集合计划资产长期稳定增值。
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、金融债券、中央银行票据、地方政府债券、企业债券、公司债券、次级债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券）、债券回购、资产支持证券、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款和其他银行存款)、同业存单、货币

	市场工具、国债期货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）。 本集合计划不直接投资于股票，但可持有因可转换债券和可交换债券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。 本集合计划各类资产的投资比例范围为：投资于债券资产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，集合计划保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于集合计划资产净值的 5%，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
主要投资策略	1、信用债券投资策略 信用债券的信用利差与债券发行人所在行业特征和自身情况密切相关。本集合计划将通过行业分析、公司资产负债分析、公司现金流分析、公司运营管理分析等调查研究，分析违约风险即合理的信用利差水平，对信用债券进行独立、客观的价值评估。 2、可转换债券投资策略 本计划持续跟踪可转换债券市场的供求变化、流动性以及估值溢价水平，判断转股溢价率和纯债溢价率，从而挑选出具有投资价值的可转换债券。同时，在控制风险的基础上，运用转股策略、条款博弈策略、套利策略等进行投资，获取收益。
业绩比较基准	中债综合财富（总值）指数收益率×90%+1 年期定期存款利率（税后）×10%
风险收益特征	本集合计划属于债券型集合资产管理计划，预期风险和收益水平低于股票型集合资产管理计划、股票型基金、混合型集合资产管理计划和混合型基金、高于货币型集合资产管理计划和货币市场基金。

注：详见《海通海升六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



注：无。

（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：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	金额（M）／持有期限（N）	收费方式／费率	备注
认购费	-	-	
	-	-	
	-	-	
申购费（前端收费）	M＜100 万元	0.3%	
	100 万元≤M＜500 万元	0.2%	
	500 万元≤M	每笔 1000 元	
赎回费	N＜7 日	1.5%	
	7 日≤N	0%	

（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	0.5%
托管费	0.1%
其他费用	-

注：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；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。

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《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、特定风险、操作或技术风险、合规性风险和其它风险。其中特定风险包括：

1、本集合计划投资于债券资产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、国债期货投资风险

本集合计划可投资国债期货，国债期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当相应期限国债收益率出现不利变动时，可能会导致投资人权益遭受较大损失。国债期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来重大损失。

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、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。

（二）重要提示

中国证监会对海通季季红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。

五、其他资料查询方式

以下资料详见上海海通证券资产管理有限公司官方网站[www.htsamc.com][客服电话:95553]

- 《海通海升六个月持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》、《海通海升六个月持有期债券型集合资产管理计划托管协议》、《海通海升六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