

# 广发资管睿利3年定期开放债券型集合资产管理计划 (广发资管睿利3年定开债A) 基金产品资料概要更新

编制日期: 2022年2月16日

送出日期: 2022年2月17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	广发资管睿利 3 年定开债	基金代码	870012
下属基金简称	广发资管睿利 3 年定开债 A	下属基金代码	872022
基金管理人	广发证券资产管理(广东)有限公司	基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金合同生效日	2021-10-11		
基金类型	债券型	交易币种	人民币
运作方式	定期开放式	开放频率	以 3 年为一个运作周期。每个运作周期以封闭期和受限开放期相交替的方式运作, 受限开放期为运作周期首日的季度对日起的连续 3 个工作日。首个运作周期的前 5 个工作日为开放申购期。除受限开放期和首个运作周期的开放申购期以外, 均为封闭期。
基金经理	冯国生	开始担任本基金基金经理的日期	2022-02-14
		证券从业日期	2011-06-29

注: 本集合计划的开放频率请参见《广发资管睿利 3 年定期开放债券型集合资产管理计划招募说明书》等法律文件。

## 二、基金投资与净值表现

### (一) 投资目标与投资策略

投资目标	本集合计划在严格控制风险和保持集合计划资产流动性的前提下, 努力降低组合净值波动率, 力争为集合计划份额持有人实现超越业绩比较基准的长期稳定的投资收益。
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(包含国债、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券、央行票据、金融债券、政策性金融债券、企业债券、公司债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、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、公开发行的次级债）、在全国银行间债券交易市场或证券交易所交易的资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、通知存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、国债期货以及法律法规或中国证监会允许公募基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本集合计划投资于债券的比例不低于集合计划资产的80%；本集合计划投资于股票等权益类资产的比例不超过集合计划资产的20%；在每个受限开放期的前10个工作日和后10个工作日、自由开放期的前3个月和后3个月以及开放期间不受前述投资组合比例的限制；在开放期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%，在封闭期不受前述比例限制，但应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；本集合计划投资于可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债的比例不超过集合计划资产的20%。

如法律法规或监管机构以后允许公募基金投资其他品种或对投资比例要求发生变更，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。

#### 主要投资策略

（一）在运作周期

1、资产配置策略；2、固定收益类资产投资策略；3、信用债投资策略；4、回购策略；5、国债期货投资策略；6、资产支持证券投资策略。

（二）在自由开放期

开放期内，本集合计划为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本集合计划有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小集合计划净值的波动。

#### 业绩比较基准

本集合计划的业绩比较基准为中债综合全价（总值）指数收益率×90%+银行活期存款利率（税后）×10%。

#### 风险收益特征

本集合计划为债券型集合资产管理计划（大集合产品），属于证券投资基金中的较低预期风险和较低预期收益品种，其预期风险与预期收益水平低于股票型基金、股票型集合计划、混合型基金和混合型集合计划，高于货币市场基金。

注：详见《广发资管睿利3年定期开放债券型集合资产管理计划招募说明书》的“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

#### 投资组合资产配置图表

本集合计划合同变更生效日为2021年10月11日，截至本集合计划产品资料概要披露日，本集合计划尚在建仓期内。

### （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

本集合计划合同变更生效日为2021年10月11日，截至本集合计划产品资料概要披露日，本集合计划尚在建仓期内。

## 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	备注
------	-------------------------	---------	----

	M < 100 万元	0.60%
申购费（前收费）	100 万元 ≤ M < 500 万元	0.40%
	M ≥ 500 万元	1000 元/笔
赎回费	N < 7 日	1.50%
	7 日 ≤ N < 30 日	0.10%
	N ≥ 30 日	0.00%

注：本集合计划赎回费的收取及归属安排，具体请参见《广发资管睿利3年定期开放债券型集合资产管理计划招募说明书》等法律文件。

## （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	0.30%
托管费	0.10%
其他费用	信息披露费、会计师费、律师费等，具体详见本集合计划的招募说明书和相关公告

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。

## 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。投资者可能损失投资本金。

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。

本集合计划面临包括但不限于以下风险：市场风险、管理风险、流动性风险、实施侧袋机制对投资者的影响风险、管理人因停业、解散、撤销、破产，或者被中国证监会撤销相关业务许可等原因不能履行职责的风险；合规性风险；以及其他风险等。

本集合计划还面临以下特有风险：

（1）开放期本集合计划达到一定规模时，管理人有权停止认/申购。投资者可能面临因上述原因而无法参与本集合计划的风险。

（2）本集合计划存续期间，连续 60 个工作日出现份额持有人数量不满 200 人或者集合计划资产净值低于 5000 万元情形的，投资者可能面临集合计划因上述原因转换运作方式、与其他集合计划合并或者终止集合合同的风险。

（3）对于法律法规规定和集合合同约定可不经份额持有人大会决议通过的事项，由管理人和托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。投资者可能面临由于上述原因发生合同变更的风险。

（4）变更集合合同涉及法律法规规定或本合同约定应经份额持有人大会决议通过的事项的，应召开份额持有人大会决议通过。部分投资者可能因为未能提供有效的联系方式或者未能将变动后的联系方式及时通知管理人，而无法及时获知合同变更事项，从而存在风险。

（5）本集合计划以 3 年为一个运作周期，每个运作周期以封闭期和受限开放期相交替的方式运作，共包含为 12 个封闭期和 11 个受限开放期。首个运作周期的前 5 个工作日为开放申购期，开放申购期后进入运作周期的第一个封闭期，在开放申购期内，本集合计划仅开放申购业务，不开放赎回业务。在每个运作周期内，除受限开放期和首个运作周期的开放申购期以外，均为封闭期。在封闭期内，本集合计划不接受份额的申购和赎回。投资人面临在

封闭期无法赎回的风险。在每个受限开放期内的每个工作日，本集合计划将对净赎回数量进行控制，确保净赎回数量占该前一日集合计划份额总数的比例不超过 10%（含）。如净赎回数量占比超过 10%，则对当日的申购申请进行全部确认，对赎回申请的确认按照该日净赎回额度（即前一日集合计划份额总数乘以 10%）加计当日的申购申请占该日实际赎回申请的比例进行部分确认。每个受限开放期第一个工作日和第二个工作日的未确认的赎回申请作自动延期赎回处理，自动转入下一开放日继续赎回，与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权，第三个工作日的未确认的赎回申请不作自动延期赎回处理，将自动取消。如净赎回数量小于零，即发生净申购时，则对当日的赎回申请全部确认，按照该日净申购额度加计当日的赎回申请占该日实际申购申请的比例对当日的申购申请进行部分确认，受限开放期内的每个工作日净申购额度将在受限开放期前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。投资人面临在受限开放期无法全部赎回及申购失败的风险。

#### （6）投资于资产支持证券的风险

本集合计划可投资于资产支持证券。所涉风险包括：①与基础资产相关的风险：主要包括特定原始权益人破产风险、现金流预测风险等风险。②与资产支持证券相关的风险：主要包括资产支持证券信用增级措施相关风险、利率风险、流动性风险、评级风险等风险。③与 SPV 管理相关的风险：主要包括 SPV 管理人违约违规风险、托管人违约违规风险、账户管理风险、资产服务机构违规等风险。④其他风险：主要包括政策和法律风险、税收风险、发生不可抗力事件的风险、技术风险和操作风险。

#### （7）投资于国债期货的风险

国债期货的投资可能面临市场风险、基差风险、流动性风险。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的价差的波动，影响套期保值或套利效果，使之发生意外损益的风险。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，是指资金量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。

## （二）重要提示

中国证监会对本集合计划合同变更的审批，并不表明其对本集合计划的投资价值和市场前景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。

本集合计划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，但不保证集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

本集合计划投资者自依集合计划合同取得基金份额，即成为集合计划份额持有人和集合计划合同的当事人。

本集合计划产品资料概要信息发生重大变更的，本集合计划管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，本集合计划管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比本集合的实际情况可能会存在一定的滞后，如需及时、准确获取本集合计划的相关信息，敬请同时关注本集合计划管理人发布的相关临时公告等。

在每个受限开放期内的每个工作日，本集合计划将对净赎回数量进行控制，确保净赎回数量占该前一日集合计划份额总数的比例不超过 10%（含）。如净赎回数量占比超过 10%，则对当日的申购申请进行全部确认，对赎回申请的确认按照该日净赎回额度（即前一日集合计划份额总数乘以 10%）加计当日的申购申请占该日实际赎回申请的比例进行部分确认。每个受限开放期第一个工作日和第二个工作日的未确认的赎回申请作自动延期赎回处理，自动转入下一开放日继续赎回，与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权，第三个工作日的未确认的赎回申请不作自动延期赎回处理，将自动取消。如净赎回数量小于零，即发生净申购时，则对当日的赎回申请全部确认，按照该日净申购额度加计当日的赎回申请占该日实际申购申请的比例对当日的申购申请进行部分确认，受限开放期内的每个工作日净申购额度将在受限开放期前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见集合计划管理人网站[[www.gfam.com.cn](http://www.gfam.com.cn)][95575]

- 1、广发资管睿利 3 年定期开放债券型集合资产管理计划资产管理合同、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