

# 东海祥瑞债券型证券投资基金（东海祥瑞 A 级份额）

## 基金产品资料概要（更新）

编制日期：2022 年 3 月 9 日

送出日期：2022 年 3 月 14 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    | 东海祥瑞   | 基金代码           | 002381       |
| 下属基金简称  | 东海祥瑞A级   | 下属基金代码         | 002381       |
| 基金管理人   | 东海基金管理有限责任公司   | 基金托管人          | 中国工商银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | 2016-03-24   | 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    | 张浩硕  | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2022-03-09   |
|         |  | 证券从业日期         | 2016-10-22   |
| 其他      | 其他《基金合同》生效后，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，基金管理人应当在十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，并于六个月内召开基金份额持有人大会进行表决。法律法规另有规定时，从其规定。 |                |              |

### 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 | 在有效控制组合净值波动率的前提下，力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。  |
| 投资范围 | <p>本基金的投资范围主要为具有良好流动性的固定收益类品种，包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、地方政府债、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、次级债、债券回购、银行存款等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。</p> <p>本基金不投资于股票等权益类资产，也不投资于可转换债券、可交换债券。基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%，持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或变更投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整本基金的投资范围和投资比例规定。</p> |

**主要投资策略**

1、固定收益投资策略

本基金将采取久期偏离、期限结构配置、类属配置、个券选择等积极的投资策略，构建债券投资组合。

2、资产支持证券投资策略

本基金通过对资产支持证券资产池结构和质量的跟踪考察、分析资产支持证券的发行条款、预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响，谨慎投资资产支持证券。

3、息差策略

本基金将通过正回购，融资买入收益率高于回购成本的债券，适当运用杠杆息差方式来获取主动管理回报，选取具有较好流动性的债券作为杠杆买入品种，灵活控制杠杆组合仓位，降低组合波动率。

4、流动性管理策略

本基金管理人将在流动性优先的前提下，综合平衡基金资产在流动性资产和收益性资产之间的配置比例，通过现金留存、持有高流动性债券种、正回购、降低组合久期等方式提高基金资产整体的流动性。同时，基金管理人将密切关注投资者大额申购和赎回的需求变化规律，提前做好资金准备。

**业绩比较基准**

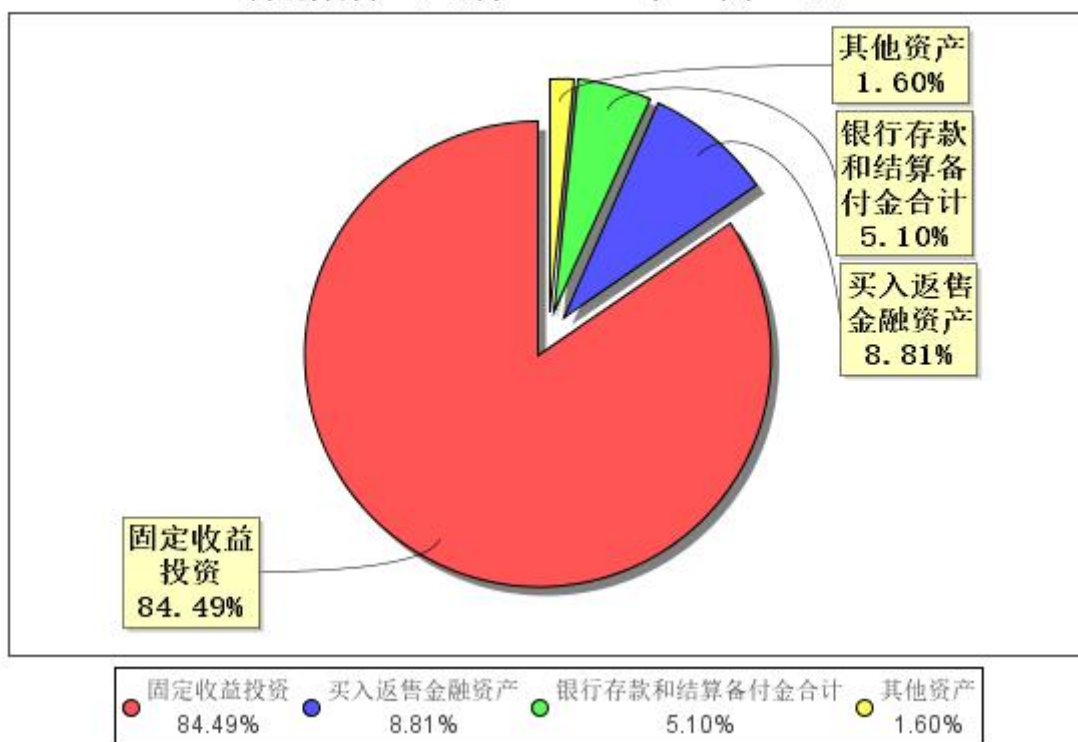
中债综合指数收益率×90%+1年期定期存款利率（税后）×10%

**风险收益特征**

本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。

**（二）投资组合资产配置图表/区域配置图表**

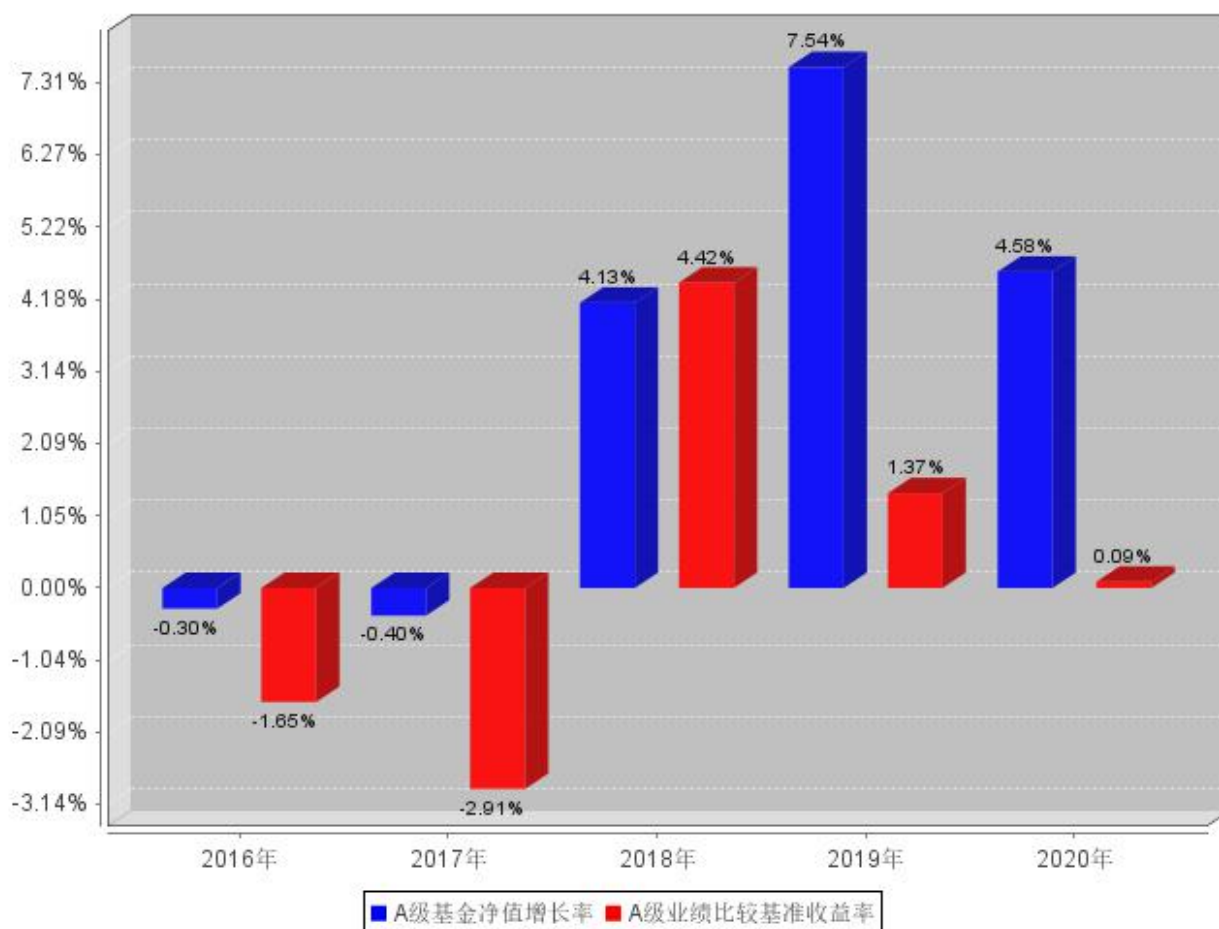
**投资组合资产配置图表**  
数据截止日期：2021年12月31日



**（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

A级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于2016年3月24日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。业绩表现截止日期2020年12月31日。基金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 |
|----------|-----------------------|---------|----|
| 申购费（前收费） | M<1,000,000           | 0.8%    | -  |
|          | 1,000,000≤M<5,000,000 | 0.5%    | -  |
|          | M≥5,000,000           | 1000元/笔 | -  |
| 赎回费      | N<7日                  | 1.5%    | -  |
|          | 7日≤N<30日              | 0.1%    | -  |
|          | N≥30日                 | 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   | 0.50%            |
| 托管费   | 0.20%            |
| 销售服务费 | -                |
| 其他费用  | 信息披露费用、会计师费、律师费等 |

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。

## 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、本基金的特定风险

本基金为债券型基金，债券的投资比例不低于基金资产的80%，该类债券的特定风险即成为本基金及投资者主要面对的特定投资风险。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成长性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。

2、本基金投资资产支持证券的风险。本基金投资资产支持证券，主要存在以下风险：（1）信用风险（2）利率风险（3）流动性风险（4）提前偿付风险（5）操作风险（6）法律风险。

3、开放式基金共有的风险，如市场风险、管理风险、流动性风险、信用风险、合规风险、操作风险等。

4、本基金启用侧袋机制的风险。

### （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]

《东海祥瑞债券型证券投资基金基金合同》、

《东海祥瑞债券型证券投资基金托管协议》、

《东海祥瑞债券型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