

# 海通安裕中短债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11月29日

送出日期：2022年11月30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    | 海通安裕中短债  | 基金代码           | 851830     |
| 下属基金简称  | 海通安裕中短债 A  | 下属基金交易代码       | 851830     |
| 基金管理人   | 上海海通证券资产管理有限公司   | 基金托管人          | 上海银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | 2021年9月30日   |                |            |
| 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    | 李夏   | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2021年9月30日 |
|         |  | 证券从业日期         | 2015年7月7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，由海通赢家系列一季季鑫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 | 本集合计划在严格控制风险和保持流动性的前提下，通过深入研究宏观经济和政策变化的趋势，制定合理的中短债资产配置策略，把握市场的投资机会，追求集合计划资产的长期稳定增值。  |
| 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，包括国内依法发行、上市的债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券、证券公司短期公司债券等）、资产支持证券、债券回购、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。<br>本集合计划不投资于股票等权益类资产，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。

本集合计划的投资组合比例为：债券资产的投资比例不低于集合计划资产的 80%，其中投资于中短债的比例不低于非现金资产的 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，持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不得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债是指剩余期限不超过三年的债券资产，主要包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券、证券公司短期公司债券等金融工具。

### 主要投资策略

管理人根据对经济周期、市场利率、政策预期、资金价格变化等影响固定收益类资产价格的各项因素进行分析和判断，充分考虑各类资产的流动性、收益性和风险性，制定合理的资产配置策略，确定债券资产、货币市场工具、现金等大类资产的配置比例，在保证组合流动性的基础上，实现稳健收益。本集合计划债券资产策略主要包括：（1）利率债投资策略；（2）信用债投资策略。其他策略包括：（1）回购策略；（2）资产支持证券投资策略；（3）国债期货策略；（4）可转换债券策略。

### 业绩比较基准

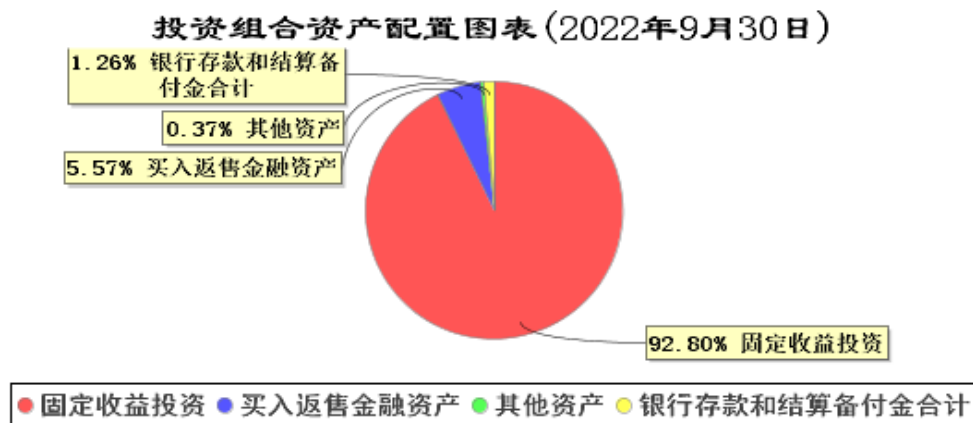
中债总财富(1-3年)指数收益率×80%+活期存款利率×20%

### 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。

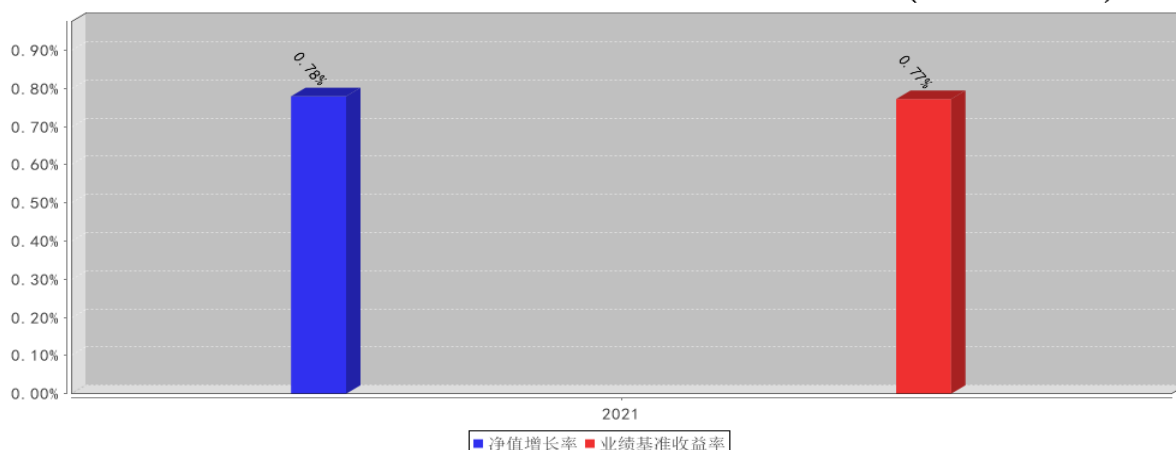
注：详见《海通安裕中短债债券型集合资产管理计划招募说明书》第九部分“集合计划的投资”。

## （二）投资组合资产配置图表 / 区域配置图表



## （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

海通安裕中短债A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图 (2021年12月31日)



注：集合计划的过往业绩不代表未来表现。本集合计划合同生效日为 2021 年 9 月 30 日，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。

### 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<br>(前端收费) | M < 100 万           | 0.3%      |    |
|               | 100 万元 ≤ M < 500 万元 | 0.2%      |    |
|               | M ≥ 500 万元          | 每笔 1000 元 |    |
| 赎回费           | N < 7 日             | 1.5%      |    |
|               | N ≥ 7 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  | 0.3%     |
| 托管费  | 0.05%    |
| 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。投资于本集合计划的特有风险：

(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。

(5) 开放期本集合计划达到一定规模时，管理人有权停止申购。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。

(6) 本集合计划存续期间，连续 20 个工作日出现集合计划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资产管理合同的风险。

(7) 资产管理合同签署后，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。

(8) 变更资产管理合同涉及法律法规规定或资产管理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。

(9) 本集合计划资产管理合同等文书可以电子签名方式签订。投资者签订书面《电子签名约定书》，即表明投资者同意在销售机构参与集合资产管理计划过程中使用电子合同、电子签名。投资者通过身份验证登录销售机构指定的网络系统，确认同意接受相关电子签名合同或其他文书的，视为签署合同或其他文书，与在纸质合同或其他文书上手写签名或者盖章具有同等的法律效力，无须另行签署纸质合同或其他文书。投资者应妥善保管密码，经投资者密码等有效身份验证登录投资者账户后的所有操作视同投资者本人行为，投资者承担由

此产生的一切民事责任和法律后果。

## **(二) 重要提示**

中国证监会对海通赢家系列一季季鑫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](http://www.htsamc.com)][客服电话:95553]

- 《海通安裕中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同》、《海通安裕中短债债券型集合资产管理计划托管协议》、《海通安裕中短债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