

天风证券天泽六个月定期开放债券型集合资产管理计划基金产品资料概要更新

编制日期：2022年12月09日

送出日期：2022年12月15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	天泽六个月定开债	基金代码	970001
基金简称A	天泽六个月定开债A	基金代码A	970001
基金简称C	天泽六个月定开债C	基金代码C	970002
基金管理人	天风（上海）证券资产管理 管理有限公司	基金托管人	招商银行股份有限公司
基金合同生效日	2020年05月14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	契约型开放式	开放频率	六个月定期开放
基金经理	开始担任本基金基金经理的日期		证券从业日期
汪琪	2021年06月21日		2014年07月01日
王圳杰	2022年12月15日		2017年07月16日
资产管理合同生效后，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5000万元的，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，管理人应当在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			

<p>作方式、与其他大集合产品或基金合并或者终止资产管理合同等，并在6个月内召开集合计划份额持有人大会进行表决。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。</p>	
---	--

注：本概要所述的“基金”也包括按照《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》的要求进行变更后的证券公司大集合资产管理产品。

二、基金投资与净值表现

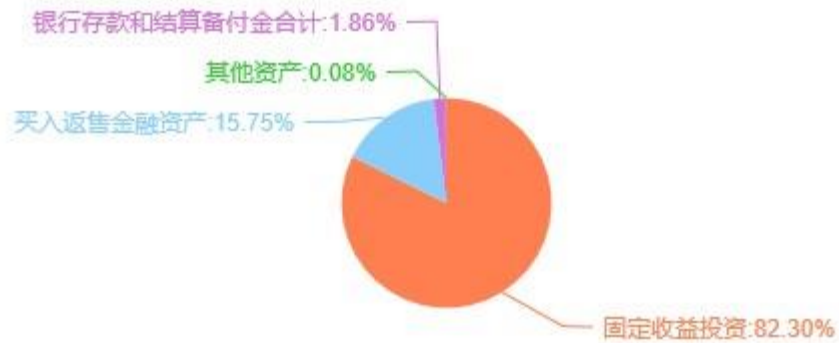
（一）投资目标与投资策略

<p>投资目标</p>	
<p>投资范围</p>	<p>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（国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分））、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具以及经中国证监会允许本集合计划投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。</p> <p>本集合计划不投资于股票资产。</p> <p>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%，但应开放期流动性需要，为保护集合计划份额持有人利益，在每个开放期的前15个工作日和后15个工作日以及开放期期间不受前述投资组合比例的限制。在开放期内，本集合计划所持有现金或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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，在封闭期内，本集合计划不受上述5%的限制。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许本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。</p>
<p>主要投资策略</p>	
<p>业绩比较基准</p>	

详见《天风证券天泽六个月定期开放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”。

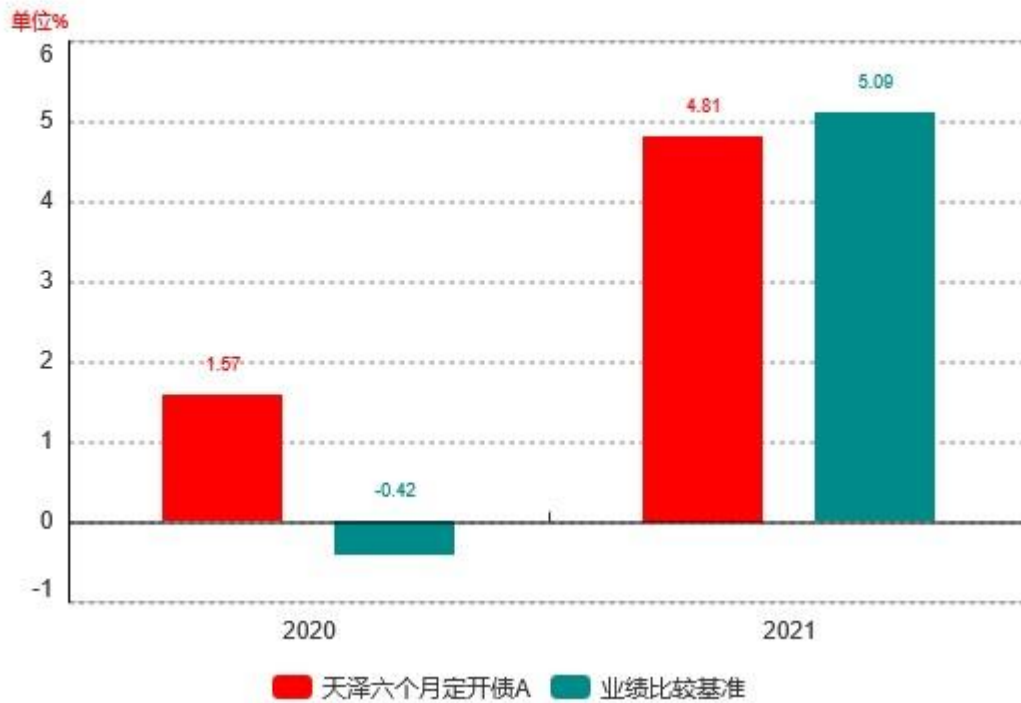
（二）投资组合资产配置图表 / 区域配置图表

数据截止日：2022年06月30日

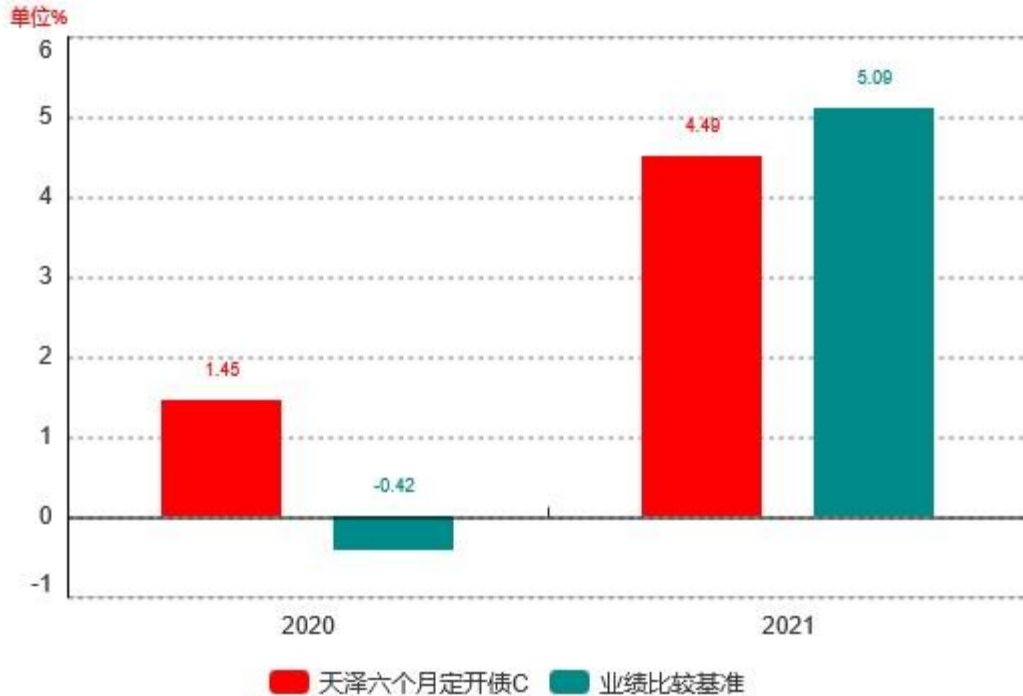


(三) 自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

基金的过往业绩不代表未来表现，数据截止日：2021年12月31日



基金的过往业绩不代表未来表现，数据截止日：2021年12月31日



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：

天泽六个月定开债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	0.50%	
	100万 ≤ M < 1000万	0.30%	
	M ≥ 1000万	1000.00元/笔	
赎回费	N < 7天	1.50%	
	7天 ≤ N < 180天	0.50%	
	N ≥ 180天	0.00%	

天泽六个月定开债C

费用类型	份额 (S) 或金额 (M) / 持有期限 (N)	收费方式/费率	备注
赎回费	N < 7天	1.50%	
	7天 ≤ N < 180天	0.50%	
	N ≥ 180天	0.00%	

申购费 A: 若 A 类计划份额投资者有多笔申购，申购费率按每笔申购申请单独计算。

本集合计划A类计划份额的申购费用由A类计划份额投资者承担，主要用于本集合计划的市场推广、销售、登记等各项费用，不列入集合计划财产。

申购费 C：本集合计划 C 类计划份额不收取申购费用。

赎回费 A：本集合计划的赎回费用由赎回份额的集合计划份额持有人承担，在集合计划份额持有人赎回份额时收取。对持有期限不满 7 天的投资者收取的赎回费，全额计入集合计划财产；对持有期限满 7 天不满 6 个月的投资者收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 50%计入集合计划财产。未计入集合计划财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。（其中 6 个月指 180 天）

赎回费 C：本集合计划的赎回费用由赎回份额的集合计划份额持有人承担，在集合计划份额持有人赎回份额时收取。对持有期限不满 7 天的投资者收取的赎回费，全额计入集合计划财产；对持有期限满 7 天不满 6 个月的投资者收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 50%计入集合计划财产。未计入集合计划财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。（其中 6 个月指 180 天）

（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	0.60%
托管费	0.15%
销售服务费C	0.30%

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《招募说明书》等销售文件。

本集合计划为债券型集合资产管理计划，其风险收益水平低于股票型基金及股票型集合资产管理计划、混合型基金及混合型集合资产管理计划，高于货币市场基金。

本集合计划投资运作过程中面临的主要风险有：市场风险、管理风险、流动性风险、合规性风险、本集合计划特有风险及其他风险。本集合计划特有风险：

1、根据本集合计划投资范围的规定，本集合计划主要投资于各类固定收益证券，无法完全规避发债主体特别是短期融资券、中期票据、公司债、企业债的发债主体的信用质量变化造成的信用风险；另外，如果持有的信用债出现信用违约风险，将给集合计划净值带来较大的负面影响和波动。

2、本集合计划可投资于资产支持证券。资产支持证券是一种债券性质的金融工具，其向投资者支付的本息来自于基础资产池产生的现金流或剩余权益。与股票和一般债券不同，资产支持证券不是对某一经营实体的利益要求权，而是对基础资产池产生的现金流和剩余权益的要求权，是一种以资产信用为支持的证券，所面临的风险主要包括交易结构风险、各种原因导致的基础资产池现金流与对应证券现金流不匹配产生的信用风险、市场交易不活跃导致的流动性风险等。

3、本集合计划以定期开放的方式运作，即采用开放运作和封闭运作交替循环的方式。本集合计划的首个开放期自资产管理合同生效后管理人公告的开放之日起，后续每个开放期自每个封闭期结束之后第一个工作日（含该日）起，本集合计划每个开放期不少于5个工作日、不超过20个工作日，开放期的具体时间以管理人届时有效公告为准。本集合计划的封闭期为自每一开放期结束之日次日（含该日）起至6个月的月度对日的前一日（含该日）的期间。首个封闭期为首个开放期结束之日次日（含该日）起6个月的月度对日的前一日（含该日）的期间，第二个封闭期为第二个开放期结束之日次日（含该日）起至6个月的月度对日的前一日（含该日）的期间，以此类推。在每个封闭期内，本集合计划采取封闭运作模式，集合计划份额持有人不得申请申购、赎回本集合计划，集合计划份额持有人面临不能赎回集合计划份额的风险。集合计划份额持有人若错过某一个开放期而未能赎回，其持有的份额将转入下一个封闭期，至下一个开放期方可赎回。

（二）重要提示

天风证券天泽六个月定期开放债券型集合资产管理计划（以下简称“集合计划”或“本集合计划”）由天风证券天泽5号集合资产管理计划变更而来。天风证券天泽5号集合资产管理计划自2013年3月12日至2013年3月14日公开募集，经中勤万信会计师事务所有限公司对集合计划进行验资并出具勤信验字（2013）第（11）号验资报告后，于2013年3月20日成立并开始运作，中国证券业协会出具中证协函（2013）310号备案确认函。根据中国证监会于2018年11月28日发布的《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》（证监会公告（2018）39号），天风证券天泽5号集合资产管理计划参照《中华人民共和国证券投资基金法》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，并将集合计划名称变更为“天风证券天泽六个月定期开放债券型集合资产管理计划”。

天风证券股份有限公司（以下简称“天风证券”）于2020年3月获得中国证监会《关于核准天风证券股份有限公司设立资产管理子公司的批复》（证监许可（2020）517号），并于2020年8月成立天风（上海）证券资产管理有限公司（以下简称“天风资管”）。天风资管注册资本金10亿元，由天风证券100%控股，已于2020年12月正式获得《经营证券期货业务许可证》。天风证券于2021年3月30日发布《关于天风证券天泽六个月定期开放债券型集合资产管理计划修改资产管理合同、托管协议和招募说明书的公告》，本集合计划管理人由天风证券变更为天风资管。

中国证监会对天风证券天泽5号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投资价值和市场前景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。

投资者自依资产管理合同取得集合计划份额，即成为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

以下资料详见集合计划管理人网站[www.tfzqam.com][客服电话：95391/400-800-5000]

1. 《天风证券天泽六个月定期开放债券型集合资产管理计划资产管理合同》、《天风证券天泽六个月定期开放债券型集合资产管理计划托管协议》、《天风证券天泽六个月定期开放债券型集合资产管理计划招募说明书》

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

六、其他情况说明

无。