

海通鑫逸债券型集合资产管理计划（C类份额）产品资料概要（更新）

编制日期：2024年6月19日

送出日期：2024年6月20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 | 海通鑫逸 | 基金代码 | 851860 |
| 下属基金简称 | 海通鑫逸 C | 下属基金交易代码 | 851880 |
| 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7日 | 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 | 每个工作日开放 |
| 基金经理 | 钱韬 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2024年5月15日 |
| | | 证券从业日期 | 2013年8月19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，由海通赢家系列一半年鑫集合资产管理计划转型而来。 | | |

二、基金投资与净值表现

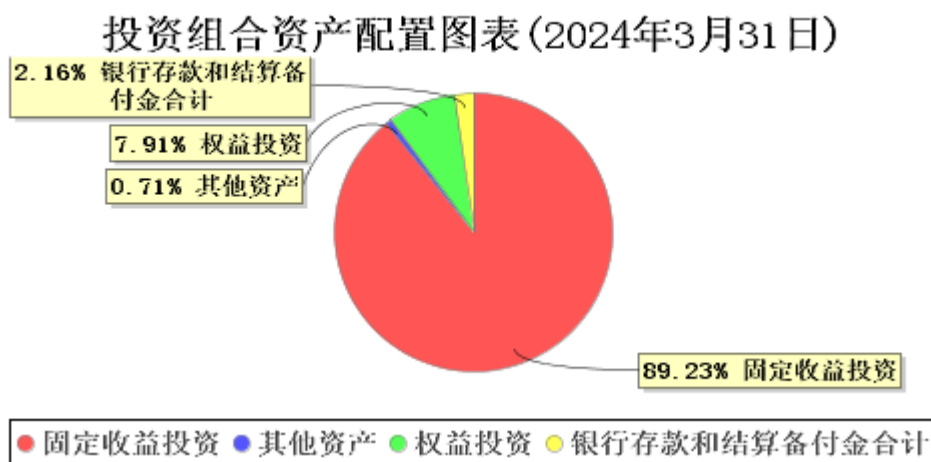
（一）投资目标与投资策略

| | |
|------|---|
| 投资目标 | 本集合计划采取稳健的资产配置策略，主要投资于固定收益类品种，严格管理权益类品种的投资比例，把握相对确定的股票二级市场投资机会，在控制风险的基础上，追求集合计划资产的长期稳定增值。 |
| 投资范围 | <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（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、国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、存托凭证及其他依法发行、上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、国债期货以及法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具。</p> <p>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。</p> <p>本集合计划的投资组合比例为：本集合计划债券资产的投资比例不低于计划资产的80%，投资股票（含存托凭证）的比例不高于计划资产的20%（投资于港股通标的股票的</p> |

| | |
|--------|--|
| | 比例合计占股票资产的 0%-50%); 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。本集合计划将港股通标的股票投资的比例下限设为零, 本集合计划可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化, 选择将部分集合计划资产投资于港股通标的股票或选择不将集合计划资产投资于港股通标的股票, 集合计划资产并非必然投资港股通标的股票。 |
| 主要投资策略 | 管理人通过对影响债券投资的宏观经济状况和货币政策等因素的分析判断, 形成对未来市场利率变动方向和收益率曲线形状变化的预期, 主动地调整债券投资组合的久期, 提高债券投资组合的收益水平。本集合计划债券投资策略包括: (1) 信用债投资策略; (2) 可转债投资策略。其他投资策略包括: (1) 资产支持证券投资策略; (2) 现金资产投资策略; (3) 股票投资策略; (4) 港股通标的股票投资策略; (5) 国债期货投资策略; (6) 存托凭证投资策略; (7) 其他策略。 |
| 业绩比较基准 | 中债-综合全价(总值)指数收益率×85%+沪深 300 指数收益率×10%+银行活期存款利率(税后)×5% |
| 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。本集合计划可投资港股通标的股票, 会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 |

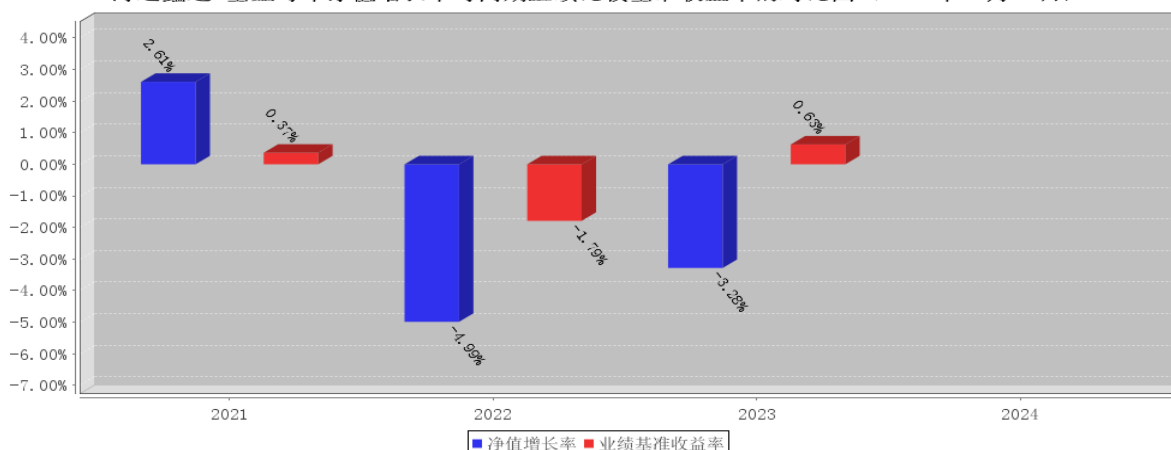
注: 详见《海通鑫逸债券型集合资产管理计划招募说明书》第九部分“集合计划的投资”。

(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

海通鑫逸C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（2023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7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 | 份额（S）或金额（M） /持有期限（N） | 收费方式/费率 |
|------|-------------------------|---------|
| 赎回费 | N < 7 日 | 1.5% |
| | 7 日 ≤ N < 30 日 | 0.75% |
| | 30 日 ≤ N < 90 日 | 0.1% |
| | N ≥ 90 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/年费率或金额 | 收取方 |
|-------|--------------|------------|
| 管理费 | 0.7% | 基金管理人和销售机构 |
| 业绩报酬 | - | - |
| 托管费 | 0.05% | 基金托管人 |
| 销售服务费 | 0.4% | 销售机构 |
| 审计费用 | 9,000.00 元 | 会计师事务所 |
| 信息披露费 | 120,000.00 元 | 规定披露报刊 |

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。

（三）基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

海通鑫逸 C

| | 基金运作综合费率（年化） |
|------|--------------|
| 持有期间 | 1.25% |

注：集合计划管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为集合计划现行费率，其他运作费用以最近一次集合计划年报披露的相关数据为基准测算。

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）股票等权益类资产的投资风险

本集合计划投资于股票（含存托凭证）的比例不高于计划资产的 20%，如果股票等权益类市场出现整体下跌，本集合计划的净值表现将会受到影响。

（3）港股通标的股票的投资风险

本集合计划投资于港股通标的股票的比例合计占股票资产的 0%-50%。若本集合计划参与港股通标的股票的投资，还需承担汇率风险以及境外市场的风险。

1) 汇率风险

本集合计划以人民币计价，但本集合计划通过港股通投资香港证券市场，可投资的港股通标的股票以港币计价。由于人民币汇率在未来存在不确定性，存在因汇率变动而蒙受损失的可能性，因此，投资本集合计划存在一定的汇率风险。

2) 香港市场的风险

A. 与内地 A 股市场相比，港股市场上外汇资金流动更为自由，海外资金的流动对港股价格的影响巨大，因此，受到全球宏观经济和货币政策变动等因素所导致的系统性风险影响更大。

B. 香港市场交易规则有别于内地 A 股市场规则，参与香港股票投资还将面临包括但不限于如下特殊风险：

a. 香港市场实行 T+0 回转交易，香港市场证券交易价格并无涨跌幅上下限的规定，因此每日涨跌幅空间相对较大。

b. 只有内地与香港两地均为交易日且能够满足结算安排的交易日才为港股通交易日。在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险。

c. 香港出现台风、黑色暴雨或者香港联合交易所（以下简称“联交所”）规定的其他情形时，联交所将可能停市，投资者将面临在停市期间无法进行交易的风险；出现境内证券交易服务公司认定的交易异常情况时，境内证券交易服务公司可能暂停提供部分或者全部港股通服务，投资者将面临在暂停服务期间无法进行港股通交易的风险。

d. 由于香港市场实行 T+2 日（T 日买卖股票，资金和股票在 T+2 日才进行交收）的交收安排，本集合计划在 T 日（港股通交易日）卖出股票，T+2 日（港股通交易日，即为卖出当日之后第二个港股通交易日）在香港市场完成清算交收，卖出的资金在 T+3 日才能回到人民币资金账户。因此交收制度的不同以及港股通交易日的设定原因，本集合计划可能面临卖出港股后资金不能及时到账，造成支付赎回款日期比正常情况延后的风险。

C. 本集合计划的港股投资通过港股通进行，面临着港股通制度及其调整的风险：

a. 根据现行的港股通规则，本集合计划因所持港股通股票权益分派、转换、上市公司被收购等情形或者其他异常情况，所取得的港股通股票以外的联交所上市证券，可以通过港股通卖出，但不得买入；因发行人供股、港股通股票权益分派或者转换等情形取得的联交所上市股票的认购权利凭证在联交所上市的，可以通过港股通卖出，但不得买入，其行权等事宜按照中国证监会、中国登记结算有限责任公司的相关规定处理；因港股通股票权益分派、转换或者上市公司被收购等所取得的非联交所上市证券，不得通过港股通买入或卖出。

b. 本集合计划将仅通过沪港、深港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度进行境外投资。在联交所开市前阶段，当日额度使用完毕的，新增的买单申报将面临失败的风险；在联交所持续交易时段，当日额度使用完毕的，当日本集合计划将面临不能通过港股通进行买入交易的风险。

c. 现行的港股通规则，对港股通下可投资的港股范围进行了限制，并定期或不定期根据范围限制规则对具体的可投资标的进行调整，对于调出在投资范围的港股，只能卖出不能买入；本集合计划可能因为港股通可投资标的范围的调整而不能及时买入看好的投资标的，而错失投资机会的风险。

本集合计划将港股通标的股票投资的比例下限设为零，本集合计划可根据投资策略需要或不同配置市场环境的变化，选择将部分集合计划资产投资于港股通标的股票或选择不将集合计划资产投资于港股通标的股票，集合计划资产并非必然投资港股通标的股票。

（4）存托凭证投资风险

本集合计划的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的集合计划所面临的共同风险外，本集合计划还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

（5）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。

（6）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。

（7）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。

（8）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。

（9）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。

（10）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。

（11）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。

（12）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半年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] [客服电话：95553]

《海通鑫逸债券型集合资产管理计划资产管理合同》、《海通鑫逸债券型集合资产管理计划托管协议》、《海通鑫逸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