

招商资管智远增利债券型集合资产管理计划 (D类份额) 产品资料概要(更新)

编制日期: 2024年11月11日

送出日期: 2024年11月14日

本概要提供本集合计划的重要信息,是招募说明书的一部分。作出投资决策前,请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

集合计划简称	招商资管智远增利债券D	集合计划代码	880011
管理人	招商证券资产管理有限公司	托管人	中信银行股份有限公司
合同生效日	2021年11月18日	上市交易所及上市日期	暂未上市
集合计划类型	债券型	交易币种	人民币
运作方式	普通开放式	开放频率	不开放申购,每个开放日可赎回
基金经理	姚彦如	开始担任本基金基金经理的日期	2023年12月4日
		证券从业日期	2020年6月22日
其他	每个集合计划账户每次单笔申购金额不得低于1元(含申购费)		

注:招商资管智远增利债券型集合资产管理计划由招商证券智远增利集合资产管理计划变更而来。招商证券智远增利集合资产管理计划于2012年3月14日成立。智远增利合同变更获中国证监会机构部函[2021]625号文批复。自2021年11月18日,《招商资管智远增利债券型集合资产管理计划集合资产管理合同》生效,原《招商证券智远增利集合资产管理计划集合资产管理合同》自同日起失效。

二、集合计划投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

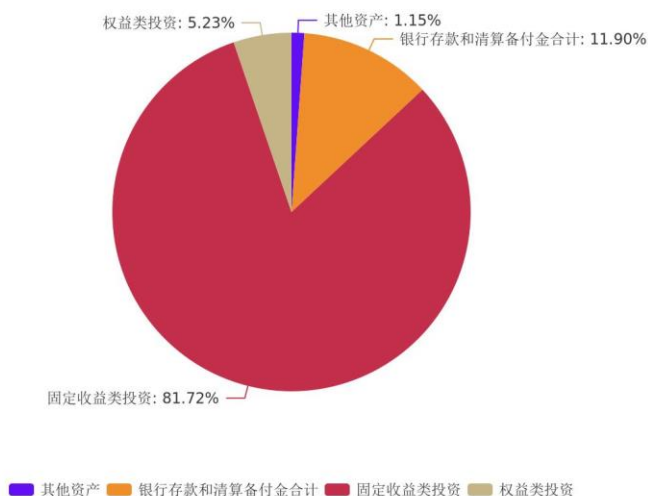
详见《招商资管智远增利债券型集合资产管理计划招募说明书》第九部分“集合计划的投资”

投资目标	本集合计划主要投资于具有良好流动性的债券类资产及现金管理类工具,同时适时适度地参与权益类资产投资,在控制投资风险前提下,努力为委托人谋求收益,实现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包括国内依法发行上市的股票(包括主板、中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、债券(包括国债、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、次级债券、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、可转换债券、可交换债券)、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、国债期货以及法律法规或中国证监会允许本集合计划投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许投资其他品种,集合计划管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,并可依据届时有有效的法律法规适时合理地调整投资范围。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%,投资于股票资产的比例不高于集合计划资产的20%。本集合计划投资的信用债券经国内信用

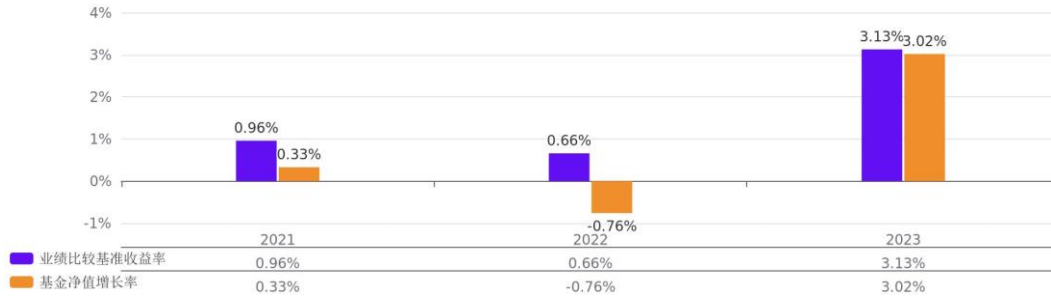
	<p>评级机构认定的债项评级或主体评级须在 AA（含 AA）以上。其中投资于评级 AA 的信用债比例不高于信用债资产的 30%，且评级 AA 的信用债单一主体投资比例不高于信用债资产的 5%；投资评级 AA+的信用债比例不高于信用债资产的 50%；投资评级 AAA 的信用债比例不低于信用债资产的 50%。以上评级不含中债资信评级。本集合计划投资于可转换债券、可交换债券的比例不高于集合计划资产的 20%。本集合计划每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于集合计划资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p>
主要投资策略	<p>1、资产配置策略 2、债券投资策略 (1) 久期配置策略 (2) 收益率曲线策略 (3) 债券类属配置策略 (4) 骑乘策略 (5) 可转债与可交债投资策略 (6) 信用债投资策略 3、资产支持证券投资策略 4、股票投资策略 (1) 个股选择策略 (2) 新股申购策略 5、现金管理类投资策略 6、国债期货投资策略</p>
业绩比较基准	<p>本集合计划的业绩比较基准为：中债综合财富（总值）指数收益率 *90%+沪深 300 指数收益率 *10%。</p>
风险收益特征	<p>本集合计划是债券型集合资产管理计划，预期风险和预期收益高于货币市场基金，低于股票型基金、混合型基金。</p>

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

数据截止日：2024-03-31



(三) 自集合计划合同生效以来/最近十年（孰短）集合计划每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图



注：（1）以上数据为从2021年11月18日(合同生效日)至2023年12月31日。（2）集合计划合同生效当年期间的相关数据按实际存续期计算。（3）集合计划的过往业绩不代表未来表现。

三、投资本集合计划涉及的费用

（一）集合计划销售相关费用

以下费用在申购/赎回集合计划过程中收取：

费用类型	金额 (M) / 持有期限 (T)	收费方式/费率
申购费	D类份额不开放申购	D类份额不开放申购
赎回费	T < 7 日	1.50%
	7 日 ≤ T < 180 日	0.40%
	180 日 ≤ T < 365 日	0.30%
	365 日 ≤ T < 730 日	0.20%
	T ≥ 730 日	0

（二）集合计划运作相关费用

以下费用将从集合计划资产中扣除：

费用类别	收费方式/年费率	收取方
管理费	0.70%	管理人和销售机构
托管费	0.10%	托管人
销售服务费	无	-
业绩报酬	D类份额在D类份额持有人赎回D类份额时，管理人将根据D类份额持有人的持有期间年化收益率（R），对D类份额持有期间年化收益率超过6%以上部分按照20%的比例收取管理人业绩报酬。	管理人
审计费用	7,300.00	会计师事务所
信息披露费	0.00	规定披露报刊

其他费用	除法律法规、中国证监会另有规定外，《集合计划合同》生效后与集合计划相关的信息披露费用；《集合计划合同》生效后与集合计划相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；集合计划份额持有人大会费用；集合计划的证券、期货交易费用；集合计划的银行汇划费用；账户开户费用、账户维护费用；按照国家有关规定和《集合计划合同》约定，可以在集合计划财产中列支的其他费用。	-
------	--	---

注：本集合计划交易证券产生的费用和税负，按实际发生额从集合计划资产扣除。按年收取的费用为集合计划整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以集合计划定期报告披露为准。

（三）基金运作综合费用测算

费用类别	基金运作综合费率（年化）
基金运作综合费率	1.03%

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，投资者购买时应认真阅读本集合计划的《招募说明书》等销售文件。

投资者面临的风险主要可分为市场风险、信用风险、管理风险、流动性风险、操作风险、合规性风险、本集合计划特有的风险与其他风险。其中本集合计划特有的风险如下：

（1）本集合计划为债券型集合计划，主要投资于债券等固定收益类资产，亦能小部分资产投资于股票市场，因此债券市场和股票市场的变化均会影响到本集合计划的业绩表现。（2）本集合计划投资资产支持证券的风险包括：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、现金流预测风险等与基础资产相关的风险；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、资产支持证券的利率风险、资产支持证券的流动性风险、评级风险等与资产支持证券相关的风险；3）其他风险，主要包括政策风险、税收风险、发生不可抗力事件的风险、技术风险和操作风险。（3）投资国债期货的风险：国债期货的投资可能面临市场风险、基差风险、流动性风险。（4）启用侧袋机制的风险，当本集合计划启用侧袋机制时，实施侧袋机制期间，侧袋账户份额将停止披露集合计划份额净值，并不得办理申购、赎回和转换。启用侧袋机制时持有集合计划份额的持有人将在启用侧袋机制后同时持有主袋账户份额和侧袋账户份额，侧袋账户份额不能赎回，其对应的特定资产的变现时间具有不确定性，最终变现价格也具有不确定性并且有可能大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，集合计划份额持有人可能因此面临损失。（5）本集合计划自集合计划合同变更生效日起存续期至2025年2月17日，本集合计划份额持有人将面临在2025年2月17日资产管理合同到期的风险。

（二）重要提示

中国证监会对本集合计划的备案，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。

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，但不保证集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

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

本集合计划的争议解决处理方式为仲裁，详见本集合计划合同，请投资者务必仔细阅读相关内容。

五、其他资料查询方式

以下资料详见招商证券资产管理有限公司官方网站 [https://amc.cmschina.com/] [客服电话：95565]

1、《招商资管智远增利债券型集合资产管理计划集合资产管理合同》

- 2、《招商资管智远增利债券型集合资产管理计划托管协议》
- 3、《招商资管智远增利债券型集合资产管理计划招募说明书》
- 4、定期报告，包括集合计划季度报告、中期报告和年度报告
- 5、集合计划份额净值
- 6、销售机构及联系方式
- 7、其他重要资料

六、其他情况说明

无。