

国泰君安君享利30天滚动持有债券型发起式证券投资基金（C类份额）
基金产品资料概要更新

编制日期：2024年11月05日

送出日期：2024年11月26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 | 国泰君安君享利30天滚动持有债券发起 | 基金代码 | 018509 |
| 下属基金简称 | 国泰君安君享利30天滚动持有债券发起C | 下属基金代码 | 018510 |
| 基金管理人 | 上海国泰君安证券资产管理有限公司 | 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | 2023-11-27 | 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 | 其他开放式 | 开放频率 | 每个开放日可申购，每笔份额的滚动运作期为30天，每个运作期到期日前，基金份额持有人不能提出赎回申请 |
| 基金经理 | 杜浩然 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2023-11-27 |
| | | 证券从业日期 | 2014-07-02 |
| 其他 | 《基金合同》生效之日起3年后的对应日，若基金资产净值低于2亿元，《基金合同》自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续基金合同期限。《基金合同》生效后继续存续的，连续50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，本基金将依据《基金合同》的约定进入基金财产清算程序并终止，不需召开基金份额持有人大会。 | | |

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

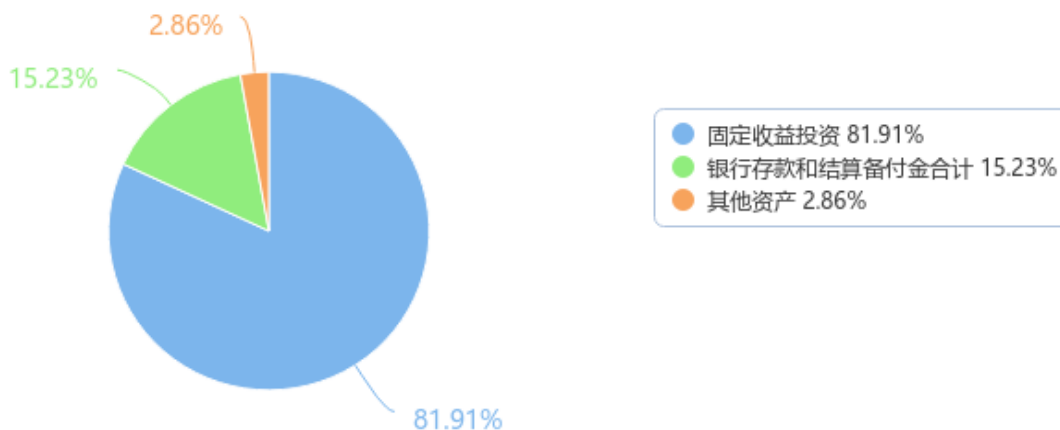
(敬请投资者仔细阅读《国泰君安君享利30天滚动持有债券型发起式证券投资基金招募说明书》“基金的投资”章节了解详细情况。)

| | |
|------|--|
| 投资目标 | 在严格控制风险和保持较高流动性的基础上，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资范围 | <p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券（包括超短期融资券）、资产支持证券、公开发行的次级债券、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、国债期货、同业存单、银行存款、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。</p> <p>本基金不投资于股票等资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。</p> |

| | |
|--------|---|
| | <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 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，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券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、应收申购款等。</p> <p>如果法律法规对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，待履行适当程序后，以变更后的规定为准。</p> |
| 主要投资策略 | <p>本基金将密切关注债券市场的运行状况与风险收益特征，分析宏观经济运行状况和金融市场运行趋势，自上而下决定类属资产配置及组合久期，并依据内部信用评级系统，深入挖掘价值被低估的标的券种。本基金采取的投资策略主要包括类属资产配置策略、利率策略、信用策略等。在谨慎投资的基础上，力争实现组合的稳健增值。</p> |
| 业绩比较基准 | <p>中债综合财富（总值）指数收益率×80%+一年期定期存款利率（税后）×20%</p> |
| 风险收益特征 | <p>本基金为债券型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。</p> |

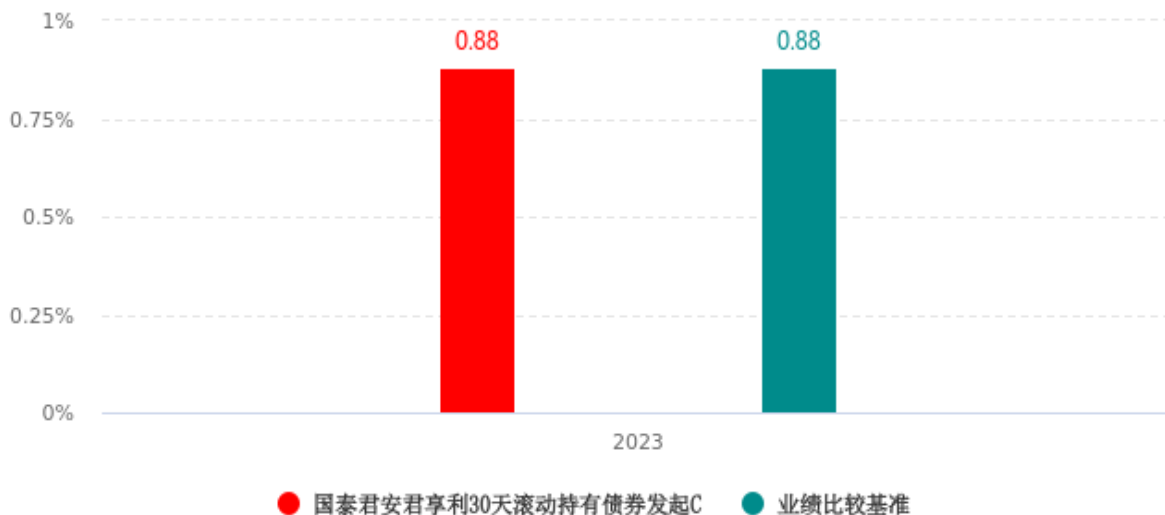
（二）投资组合资产配置图表 / 区域配置图表

投资组合资产配置图表（数据截至日期：2024年09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，合同生效当年不满完整自然年度，按实际期限
（2023年11月27日-2023年12月31日）计算净值增长率



注：1、基金合同生效当年按实际期限计算，不按整个自然年度进行折算。
2、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

注：本基金C类份额不收取认购费、申购费。

基金合同生效后，本基金对于每份基金份额，设定 30 天的滚动运作期，投资者需至少持有本基金基金份额满 30 天。每个运作期到期日，基金份额持有人可提出赎回申请，不收取赎回费。

（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 | 0.20% | 基金管理人和销售机构 |
| 托管费 | 0.05% | 基金托管人 |
| 销售服务费 | 0.20% | 销售机构 |
| 审计费用 | 10,000.00 | 会计师事务所 |
| 信息披露费 | 0 | 规定披露报刊 |
| 其他费用 | 《基金合同》生效后与基金相关的律师费、诉讼费和仲裁费；基金份额持有人大会费用；基金的证券/期货交易费用；基金的银行汇划费用；基金的开户费用、账户维护费用；按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。 | 相关服务机构 |

注：1、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。审计费用、信息披露费为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

2、本基金本年度信息披露费预计将由基金管理人承担。

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。

本基金包括证券市场风险、流动性风险、信用风险、管理风险、启用侧袋机制的风险、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险、其他风险及本基金特定风险。本基金特定风险包括但不限于：

1、 特殊安排的运作方式

本基金对每份基金份额设置30天的滚动运作期。每个运作期到期日前，基金份额持有人不能提出赎回申请。每个运作期到期日，基金份额持有人方可提出赎回申请。如果基金份额持有人在当期运作期到期日未申请赎回或赎回被确认失败，则自该运作期到期日下一日起该基金份额进入下一个运作期。故投资者在运作期间到期日前无法赎回的风险，以及错过当期运作期到期日未能赎回而进入下一运作期的风险。

2、 运作期限或有变化的风险

本基金名称为国泰君安君享利30天滚动持有债券型发起式证券投资基金，但是考虑到周末、法定节假日等原因，每份认/申购基金份额的实际运作期限或有不同，可能长于30天。

3、 流动性风险

由于本基金特殊运作方式的安排，投资者的单笔认/申购存在30天的锁定期，因而对于同一时点认/申购的资金将极有可能面临集中赎回的情形，由此将有可能触发本基金的巨额赎回机制。在发生巨额赎回时，如果基金资产变现能力差，可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险。

针对本基金特殊安排有可能带来的流动性风险，基金管理人将采取相应的风险管理措施：

（1）本基金认/申购资金的持有期限可以合理预测和估计，可根据资金的属性配置相应久期的债券资产；

（2）本基金触发巨额赎回情形下流动性风险时，基金管理人将依据基金合同约定的相应风险管理措施应对此类流动性风险。

4、 本基金可投资于国债期货。国债期货的投资可能面临市场风险、基差风险、流动性风险。市场风险是因期货市场价格波动使所持有的期货合约价值发生变化的风险。基差风险是期货市场的特有风险之一，是指由于期货与现货间的价差的波动，影响套期保值或套利效果，使之发生意外损益的风险。流动性风险可分为两类：一类为流通量风险，是指期货合约无法及时以所希望的价格建立或了结头寸的风险，此类风险往往是由市场缺乏广度或深度导致的；另一类为资金量风险，是指资金量无法满足保证金要求，使得所持有的头寸面临被强制平仓的风险。

5、本基金投资资产支持证券，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。信用风险指的基金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，造成基金财产损失。

6、基金合同生效之日起3年后的对应日，若基金资产净值低于2亿元，基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续基金合同期限。《基金合同》生效后3年后继续存续的，连续50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，本基金将依据《基金合同》的约定进入基金财产清算程序并终止，不需召开基金份额持有人大会。因此基金份额持有人将可能面临《基金合同》自动终止的风险。

（二）重要提示

中国证监会对国泰君安君享利30天滚动持有债券型发起式证券投资基金的注册，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本基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

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

以下资料详见管理人网站，网址：www.gtjazg.com，客服电话：95521

基金合同、托管协议、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

六、 其他情况说明

关于争议的处理：各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会（上海国际仲裁中心），按照上海国际经济贸易仲裁委员会（上海国际仲裁中心）届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为上海市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有决定，仲裁费用由败诉方承担。