

海通安润 90 天滚动持有中短债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：2025 年 05 月 08 日

送出日期：2025 年 05 月 09 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 | 海通安润 90 天滚动持有中短债 | 基金代码 | 970134 |
| 下属基金简称 | 海通安润 90 天滚动持有中短债 C | 下属基金交易代码 | 970135 |
| 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 | 2022 年 2 月 10 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 | 其他 | 开放频率 | 每个开放日申购，每份集合计划份额设定 90 天滚动运作期 |
| 基金经理 | 肖彦 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2022 年 2 月 10 日 |
| | | 证券从业日期 | 2017 年 4 月 3 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，由海通月月财集合资产管理计划转型而来。 | | |

二、基金投资与净值表现

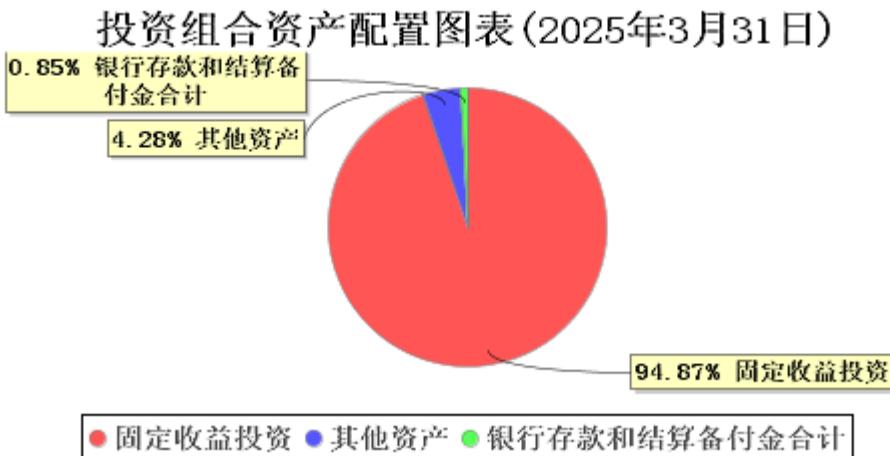
（一）投资目标与投资策略

| | |
|------|--|
| 投资目标 | 在严格控制风险的基础上，重点投资中短债，力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 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。 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 | 本集合计划主要投资于中短期债券，并控制投资组合久期，力求在承担较低风险和保持组合较好流动性的前提下，实现集合计划资产的稳健增值。 主要投资策略有：固定收益类资产投资策略（包括：债券投资策略、可转债投资策略、资产支持证券投资策略、杠杆投资策略、银行存款、同业存单投资策略）、衍生产品投资策略、其他策略。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合财富(1 年以下)指数收益率*50%+中债综合财富(1-3 年)指数收益率*35%+一年期定期存款利率(税后)*15% |
| 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。 |

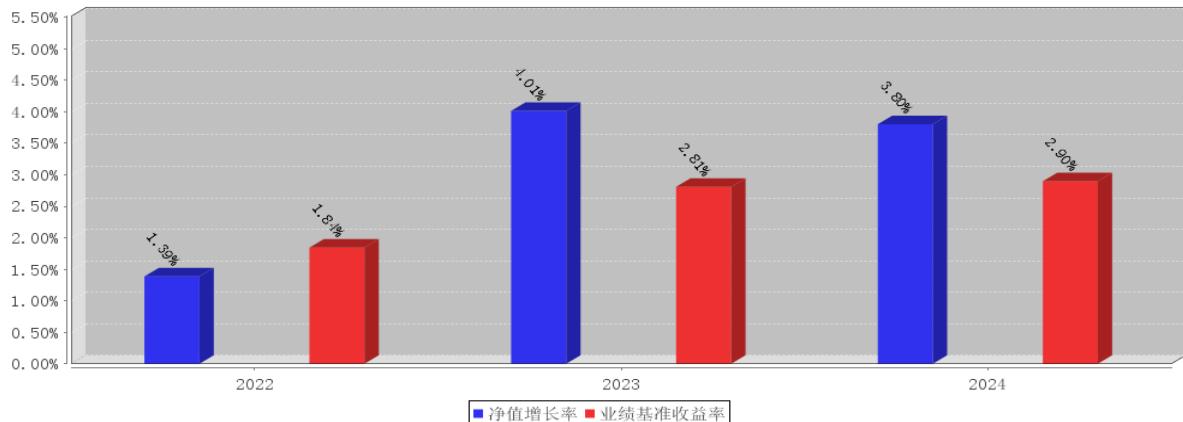
注：详见《海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划招募说明书》第九部分“集合计划的投资”。

（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

海通安润90天滚动持有中短债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（2024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 2022 年 2 月 10 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

(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 | 0.3% | 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 | 0.3% | 销售机构 |
| 审计费用 | 12,000.00 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。审计费用、信息披露费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

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：

海通安润 90 天滚动持有中短债 C

| 基金运作综合费率（年化） | |
|--------------|-------|
| 持有期间 | 0.74% |

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、本集合计划特定风险、操作或技术风险、合规性风险及其他风险。其中本集合计划的特定风险包括：

1、滚动持有运作方式的风险

（1）每个运作期到期日前，集合计划份额持有人不能赎回集合计划份额的风险

对于每份集合计划份额，管理人仅在该集合计划份额的每个运作期到期日为集合计划份额持有人办理赎回，在非运作期到期日，管理人不能为集合计划份额持有人办理赎回，且本集合计划不上市交易，集合计划份额持有人面临流动性风险。

（2）运作期到期日，集合计划份额持有人未申请赎回或赎回被确认失败，到期的集合计划份额自动进入下一个运作期风险如果集合计划份额持有人在每份集合计划份额的当期运作期到期日未申请赎回或赎回被确认失败，则该集合计划份额将在该运作期到期后自动进入下一个运作期。在下一个运作期到期日前，集合计划份额持有人不能赎回集合计划份额，集合计划份额持有人持有的集合计划份额将面临滚动运作的风险。

（3）每份集合计划份额每个实际运作期可能长于或短于 90 天的风险。本集合计划名称为海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划，但是考虑到周末、法定节假日等非工作日原因，每份集合计划份额的每个实际运作期期限或有不同，可能长于或短于 90 天。投资者应当在熟悉并了解本集合计划运作规则的基础上，结合自身投资目标、投资期限等情况审慎作出投资决策，及时行使赎回权利。本集合计划的运作期和申购赎回安排请参见招募说明书第八章的相关约定

2、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；

3、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。

4、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量买入或卖出，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。

5、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。

（二）重要提示

中国证监会对海通月月财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]

《海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同》、《海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划托管协议》、《海通安润 90 天滚动持有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