

东吴安鑫中短债债券型集合资产管理计划(B类份额)产品资料概要(更新)

编制日期：2024年6月28日

送出日期：2024年6月28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 | 东吴安鑫中短债 | 基金代码 | 970087 |
| 下属基金简称 | 东吴安鑫中短债B | 下属基金交易代码 | 970088 |
| 下属基金前端交易代码 | - | 下属基金后端交易代码 | - |
| 基金管理人 | 东吴证券股份有限公司 | 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 境外投资顾问 | - | 境外托管人 | - |
| 基金合同生效日 | 2021年12月20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 | 每个开放日 |
| 基金经理 | 江逸舟 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2021年12月20日 |
| | | 证券从业日期 | 2021年11月02日 |
| 其他 | - | | |

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

详见《东吴安鑫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”。

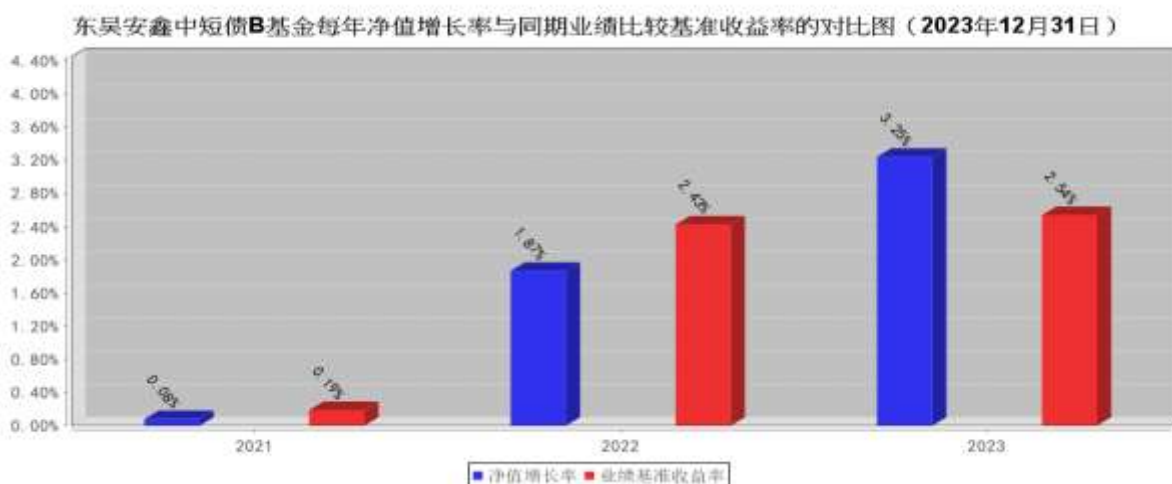
| | |
|------|--|
| 投资目标 | 本集合计划在严格控制风险和谨慎控制组合净值波动率的前提下，重点投资中短债主题证券，追求集合计划的长期、持续增值，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资范围 | 本集合计划的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可分离交易可转换债的纯债部分、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、通知存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、国债期货以及法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。其中企业债、公司债、中期票据、超短期融资券等信用债的主体、债项或担保方信用等级评级不低于 AA，短期融资券债项评级不低于 A-1。本集合计划不投资于股票等权益类资产，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。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：投资于债券资产的比例不低于集合计划资产的 80%，其中投资于中短债主题证券的资产比例不低于非现金集合计划资产的 80%。每个交易日日终在扣国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本集合计划保留的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、存出保证金和应收申购款等。本集合计划所指的中短债主题证券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、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、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可分离交易可转换债的纯债部分、资产支持证券等金融工具。如法律法规或监管机构允许集合计划投资其他品种或变更投资比例限制，管理人在履行适当程序后，可以相应调整上述集合计划的投资范围和投资比例规定。 |
| 主要投资策略 | 1、资产配置策略；2、债券投资策略；3、杠杆策略；4、国债期货投资策略；5、资产支持证券投资策略 |
| 业绩比较基准 | 中债总财富（1-3年）指数收益率×80%+一年期定期存款利率（税后）×20% |
| 风险收益特征 | 本集合计划为债券型集合计划，其风险收益水平低于混合型基金、混合型集合计划、股票型基金和股票型集合计划，高于货币型基金和货币型集合计划。 |

(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



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 |
|--------------|-------------------------|---------|
| 认购费 | M | - |
| | S | - |
| 申购费 (前收费) | M | - |
| | S | - |
| 申购费 (后收费) | - | - |
| 赎回费 | N<7天 | 1.5% |
| | 7天≤N<30天 | 0.1% |
| | N≥30天 | 0 |

注：对于申购集合计划B类份额的投资人，申购费率为零。

认购费

申购费

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 | 固定费率 | 0.3% | 基金管理人和销售机构 |
| - | - | | - |
| 托管费 | 固定费率 | 0.08% | 基金托管人 |
| 销售服务费 | 固定费率 | 0.01% | 销售机构 |
| 审计费用 | 固定金额 | 40,000.00元 | 会计师事务所 |
| 信息披露费 | 固定金额 | 80,000.00元 | 规定披露报刊 |
| 指数许可使用费 | - | | 指数编制公司 |
| 其他费用 | 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。 | | |

注：本集合计划交易证券等产生的费用和税负，按实际发生额从集合计划资产扣除。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。

(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：

东吴安鑫中短债B

| | 基金运作综合费率（年化） |
|--|--------------|
| | |

| | |
|---|--------|
| - | 0.52 % |
|---|--------|

注：本集合计划管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为现行费率，其他运作费用以最近一次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本集合计划的《招募说明书》等销售文件。

本集合计划面临的主要风险包括但不限于：市场风险，管理风险，流动性风险，启用侧袋机制的风险等。

本集合计划为债券型集合资产管理计划，投资于债券资产的比例不低于集合计划资产的80%，其中投资于中短债主题证券的资产比例不低于非现金集合计划资产的80%，因此，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。

本集合计划投资范围包括国债期货，可能给本集合计划带来额外风险，包括杠杆风险、期货价格与集合计划投资品种价格的相关度降低带来的风险等，由此可能增加本集合计划净值的波动性。

本集合计划可投资于资产支持证券，因此可能面临资产支持证券的信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、法律风险和操作风险。

《资产管理合同》生效后，连续20个工作日出现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，投资人可能面临集合计划因上述原因转换运作方式、与其他公开募集性质的集合资产管理计划合并或者终止《资产管理合同》的风险。

（二）重要提示

中国证监会对本集合计划募集的批准，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。

投资者实际赎回金额，以登记机构确认数据为准。

集合计划产品资料概要信息发生重大变更的，管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比集合计划的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取集合计划的相关信息，敬请同时关注管理人发布的相关临时公告等。

因《资产管理合同》而产生的或与《资产管理合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议向集合计划管理人住所地有管辖权的法院提起诉讼，集合计划管理人住所地在苏州，也可根据事后达成的仲裁协议向仲裁机构申请仲裁。

五、其他资料查询方式

以下资料详见管理人网站[www.dwzq.com.cn][客服电话：95330]

- 1、资产管理合同、托管协议、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