

广发资管弘利3个月滚动持有债券型集合资产管理计划(广发资管弘利3个月滚动持有债券A)基金产品资料概要更新

编制日期：2024年10月22日

送出日期：2024年10月23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	广发资管弘利 3 个月滚动持有债券	基金代码	870007
下属基金简称	广发资管弘利 3 个月滚动持有债券 A	下属基金代码	872031
基金管理人	广发证券资产管理(广东)有限公司	基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金合同生效日	2023-03-20		
基金类型	债券型	交易币种	人民币
运作方式	其他开放式，本集合计划对于每份集合计划份额设定 3 个月的滚动持有期	开放频率	每个开放日开放申购，对于每份集合计划份额，仅可在该集合计划份额对应的每个运作期的到期日办理集合计划份额的赎回
基金经理	骆霖苇	开始担任本基金基金经理的日期	2023-03-20
		证券从业日期	2015-10-13

注：本集合计划为债券型集合资产管理计划，投资范围包括可转换债券，需要承担可转换债券市场的流动性风险、债券价格受所对应股票价格波动影响而波动的风险以及在转股期或换股期不能转股或换股的风险等。本集合计划自本集合合同变更生效日起存续期不得超过 3 年。本集合计划自集合合同生效日起 3 年后，按照中国证监会有关规定执行。

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

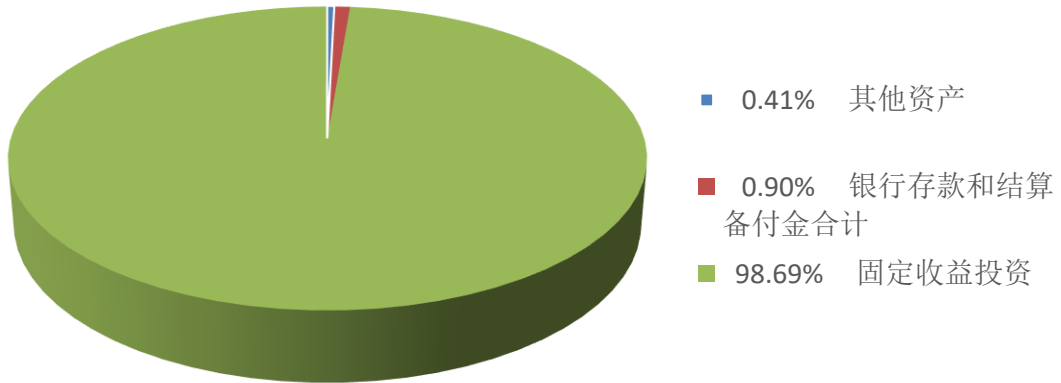
投资目标	本集合计划在严格控制风险和保持集合计划资产流动性的前提下，力争为集合计划份额持有人实现超越业绩比较基准的长期稳定的投资收益。
投资范围	本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（国债、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券、央行票据、金融债券（含公开发行的次级债券）、政策性金融债券、企业债券、公司

	<p>债券、可转换债券（含可分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、证券公司发行的短期公司债券、非金融企业债务融资工具（含短期融资券、超短期融资券、中期票据等在银行间市场交易商协会注册发行的各类债务融资工具）、在全国银行间债券交易市场或证券交易所交易的资产支持证券、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>本集合计划不可以直接买入股票，但可持有因可转换债券或可交换债券转股所形成的股票和因所持股票进行股票配售及派发所形成的股票。因上述原因持有的股票等资产，本集合计划将在其可交易之日起的20个交易日内卖出。</p> <p>本集合计划投资于债券的比例不低于集合计划资产的80%；投资于可转换债券（含可分离交易的转债）及可交换债券的投资比例合计不超过集合计划资产的20%；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，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的5%，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</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或对投资比例要求发生变更，管理人在履行适当程序后，可以相应调整本集合计划的投资范围和投资比例规定。</p>
主要投资策略	<p>主要为1、资产配置策略；2、固定收益类资产投资策略，包括久期管理策略和期限结构配置策略；3、信用债（含资产支持证券）投资策略，包括基于信用利差曲线策略和基于信用债信用分析策略；4、证券公司短期公司债券投资策略；5、回购策略；6、国债期货投资策略；7、可转换债券（含可交换债券）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（1-3年）指数收益率*85%+银行活期存款利率（税后）*15%。</p>
风险收益特征	<p>本集合计划为债券型集合资产管理计划（大集合产品），其预期风险与预期收益水平低于股票型基金、股票型集合计划、混合型基金和混合型集合计划，高于货币市场基金。</p>
<p>注：详见《广发资管弘利 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书》的“第九部分 集合计划的投资”。</p>	

（二）投资组合资产配置图表/区域配置图表

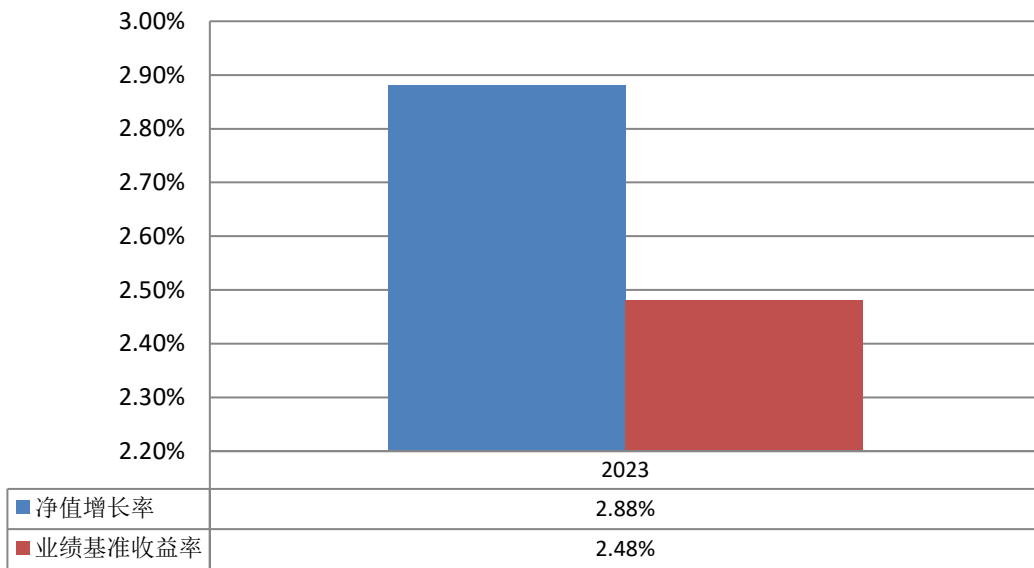
投资组合资产配置图表

数据截止日期：2024-06-30



(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

数据截止日期：2023-12-31



注：集合合同生效当年期间的相关数据按实际存续期计算。本集合计划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

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	备注
申购费 (前收费)	M < 100 万元	0.30%	
	100 万元 ≤ M < 500 万元	0.20%	

M ≥ 500 万元

1000 元/笔

注：1、本集合计划A类份额的申购费用由集合计划申购人承担，不列入集合计划财产，主要用于本集合计划的市场推广、销售、登记等各项费用。因红利自动再投资而产生的集合计划份额，不收取相应的申购费用；

2、本集合计划对于每份集合计划份额设定3个月的滚动持有期，投资人持有满三个月后赎回，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	收费方
管理费	0.30%	基金管理人、销售机构
托管费	0.05%	基金托管人
审计费用	36,000.00	会计师事务所
信息披露费	120,000.00	规定披露报刊
其他费用	律师费、诉讼费、仲裁费、份额持有人大会费用、证券、期货交易费用、银行汇划费用、账户维护费用等，具体详见本集合计划的招募说明书和相关公告	相关服务机构

注：1、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。

2、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：

基金运作综合费率（年化）
0.39%

注：本集合计划管理费率、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。

本集合计划为债券型集合资产管理计划（大集合产品），其预期风险与预期收益水平低于股票型基金、股票型集合计划、混合型基金和混合型集合计划，高于货币市场基金。

本集合计划面临包括但不限于以下风险：市场风险，包括政策风险、经济周期风险、利率风险、上市公司经营风险、衍生品风险、购买力风险、信用风险等；管理风险；流动性风险；管理人因停业、解散、撤销、破产，或者被中国证监会撤销相关业务许可等原因不能履行职责的风险；合规性风险；以及其他风险等。

本集合计划还面临以下特有风险：

（1）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

而无法申购本集合计划的风险。

(2) 本集合计划存续期间,连续 60 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集合合同的风险。

(3) 对于法律法规规定和集合合同约定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。

(4) 变更集合合同涉及法律法规规定或集合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。

(5) 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,管理人仅在该份额的每个运作期到期日为份额持有人办理赎回,在非运作期到期日,管理人不能为份额持有人办理赎回,且本集合计划不上市交易,份额持有人面临流动性风险。

2) 运作期到期日,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

如果份额持有人在每份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,份额持有人不能赎回份额,份额持有人持有的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 3 个月的风险

本集合计划名称为广发资管弘利 3 个月滚动持有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,每份份额的每个实际运作期期限或有不同,可能长于或短于 3 个月。

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部分的相关约定。

(6) 投资于资产支持证券的风险

本集合计划可投资于资产支持证券。

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、利率风险、流动性风险、评级风险等风险。

3) 与 SPV 管理相关的风险。主要包括 SPV 管理人违约违规风险、托管人违约违规风险、账户管理风险、资产服务机构违规等风险。

4) 其他风险。主要包括政策和法律风险、税收风险、发生不可抗力事件的风险、技术风险和操作风险。

(7) 投资于国债期货的风险

国债期货的投资可能面临市场风险、基差风险、流动性风险。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。

(8) 本集合计划为债券型集合资产管理计划,投资范围包括可转换债券,需要承担可转换债券市场的流动性风险、债券价格受所对应股票价格波动影响而波动的风险以及在转股期或换股期不能转股或换股的风险等。

(二) 重要提示

中国证监会对本集合计划合同变更的审批,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。

本集合计划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，但不保证集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

本集合计划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。

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

五、其他资料查询方式

以下资料详见集合计划管理人网站[www.gfam.com.cn][95575]

1、广发资管弘利 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同、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