

安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金(C 类份额)

基金产品资料概要更新

编制日期：2024 年 3 月 7 日

送出日期：2024 年 3 月 14 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 | 安信 90 天滚动持有债券 | 基金代码 | 020391 |
| 下属基金简称 | 安信 90 天滚动持有债券 C | 下属基金交易代码 | 020392 |
| 基金管理人 | 安信基金管理有限责任公司 | 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | 2024 年 1 月 17 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 | 契约型开放式（其他开放式） | 开放频率 | 每个开放日，对于每份基金份额，设定 90 天的滚动运作期。基金管理人仅在该基金份额的每个运作期到期日为基金份额持有人办理赎回。 |
| 基金经理 | 张睿 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2024 年 01 月 17 日 |
| | | 证券从业日期 | 2007 年 07 月 02 日 |
| 其他 | 《基金合同》生效后，连续 20 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，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 50 个工作日出现前述情形的，基金合同自动终止，并按照基金合同的约定程序进行清算，无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

| | |
|------|--|
| 投资目标 | 在严格控制风险和保持较高流动性的前提下，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。 |
| 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，包括债券（国债、地方政府债、央行票据、金融债、企业债、公司债、政府支持债、政府支持机构债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债券）、同业存单、货币市场工具、资产支持证券、债券回购、银行存款、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相关规定）。</p> <p>本基金不直接参与股票投资，但可持有因可转换债券转股、可交换债券换股所形成的股票。因上述原因持有的股票等资产，本基金应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>本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%，本基金投资于可转换债券（含可分离交易可转换债券）及可交换债券的比例合计不超过基金资产的 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，本基金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。 如果法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。</p> |
| 主要投资策略 | 1、久期配置策略。2、收益率曲线策略。3、骑乘策略。4、息差策略。5、类属配置策略。6、个券选择策略。7、信用债投资策略（含资产支持证券）。8、国债期货投资策略。9、可转换和可交换债券投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 中债-综合全价(总值)指数收益率*80%+一年期定期存款利率(税后)*20% |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其预期收益水平和预期风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。根据《证券期货投资者适当性管理办法》及其配套规则，基金管理人及本基金其他销售机构将定期或不定期对本基金产品风险等级进行重新评定，因而本基金的产品风险等级具体结果应以各销售机构提供的最新评级结果为准。 |

注：详见《安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金招募说明书》第九部分“基金的投资”。

(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/最近十年（孰短）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 | 备注 |
|-----------|---------------------------|---------|---------------|
| 申购费 (前收费) | $M \geq 0$ | 0.00% | 本基金 C 类份额无申购费 |
| 赎回费 | - | 0.00% | 本基金不收取赎回费 |

注：本基金 C 类基金份额不收取申购费。

本基金对于每份基金份额设置 90 天的滚动运作期。每个运作期到期日，基金份额持有人可提出赎回申请。基金份额持有人在每个运作期到期日申请赎回基金份额不收取赎回费。

(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 |
|-------|-----------------|
| 管理费 | 0.20% |
| 托管费 | 0.05% |
| 销售服务费 | 0.20% |
| 其他费用 | 会计师费、律师费、信息披露费等 |

注：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。

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。

一) 本基金投资运作过程中面临的主要风险有：

1、市场风险；2、信用风险；3、流动性风险；4、操作风险；5、管理风险；6、合规风险；7、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；8、税负增加风险；9、实施侧袋机制对投资者的影响；10、其他风险。

二) 本基金的特有风险

(1) 信用违约风险

(2) 国债期货的投资风险

(3) 资产支持证券投资风险

资产支持证券的风险主要包括信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险等。

(4) 基金合同终止的风险

《基金合同》生效后，基金资产净值连续 50 个工作日低于 5000 万元或基金份额持有人数量连续 50 个工作日不满 200 人的，基金合同自动终止，并按照基金合同的约定程序进行清算，无需召开基金份额持有人大会。因此基金份额持有人面临基金合同自动终止的风险。

(5) 运作模式的流动性风险

本基金对于每份基金份额设置 90 天的滚动运作期，基金管理人仅在该基金份额的每个运作期到期日为基金份额持有人办理赎回。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，则该基金份额将在该运作期到期日后自动进入下一运作期；在下一运作期到期日前，基金份额持有人将面临无法赎回该基金份额的风险。

(二) 重要提示

安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金的募集申请于 2023 年 12 月 11 日经中国证监会(2023)2781 号文注册。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金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基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

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，除监管规定信息发生重大变更外，基金管理人每年更新一次资料概要。因此，本文件内容可能存在一定的滞后性，敬请投资者同时关注基金管理人发布的临时公告。

基金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。

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，如经友好协商未能解决的，则任何一方应将争议提交深圳国际仲裁院，按照深圳国际仲裁院届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为深圳市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用由败诉方承担。

五、其他资料查询方式

以下资料详见安信基金官方网站 [www.essencefund.com] [客服电话：4008-088-088]

1、《安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金基金合同》、

《安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金托管协议》、

《安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金招募说明书》

2、定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告

- 3、基金份额净值
- 4、基金销售机构及联系方式
- 5、其他重要资料