

前海开源可转债债券型发起式证券投资基金

基金产品资料概要更新

编制日期：2024年11月14日

送出日期：2024年12月11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 | 前海开源可转债债券 | 基金代码 | 000536 |
| 基金管理人 | 前海开源基金管理有限公司 | 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | 2014年03月25日 | 基金类型 | 债券型 |
| 上市交易所 | 暂未上市 | 上市日期 | - |
| 运作方式 | 普通开放式 | 开放频率 | 每个开放日 |
| 交易币种 | 人民币 | | |
| 基金经理 | 章俊 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2024年07月19日 |
| | | 证券从业日期 | 2006年04月01日 |
| 其他 | 《基金合同》生效后，基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续20个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案；基金合同生效之日起三年后的对应日，若基金资产规模低于2亿元，基金合同自动终止。法律法规另有规定时，从其规定。 | | |

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

详见《前海开源可转债债券型发起式证券投资基金招募说明书》第九章“基金的投资”。

| | |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金主要利用可转债品种兼具债券和股票的特性，在合理控制风险、保持适当流动性的基础上，力争取得超越基金业绩比较基准的收益。 |
| 投资范围 | 本基金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股票、存托凭证、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金所投资的固定收益类资产包括可转债（含分离交易可转债）、公司债、金融债、企业债、国债、央行票据、地方政府债、中期票据、短期融资券、资产支持证券、次级债、债券回购、银行存款等。本基金同时投资于A股股票、存托凭证、权证等权益类品种，但须符合中国证监会的相关规定。 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。 |

基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%；投资于可转债（含分离交易可转债）的投资比例不低于非现金基金资产的80%；股票等权益类资产的投资比例不超过基金资产的20%；现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

主要投资策略

本基金的投资策略主要有以下四方面内容：1、资产配置策略。2、债券投资策略。3、股票投资策略。4、存托凭证投资策略。

业绩比较基准

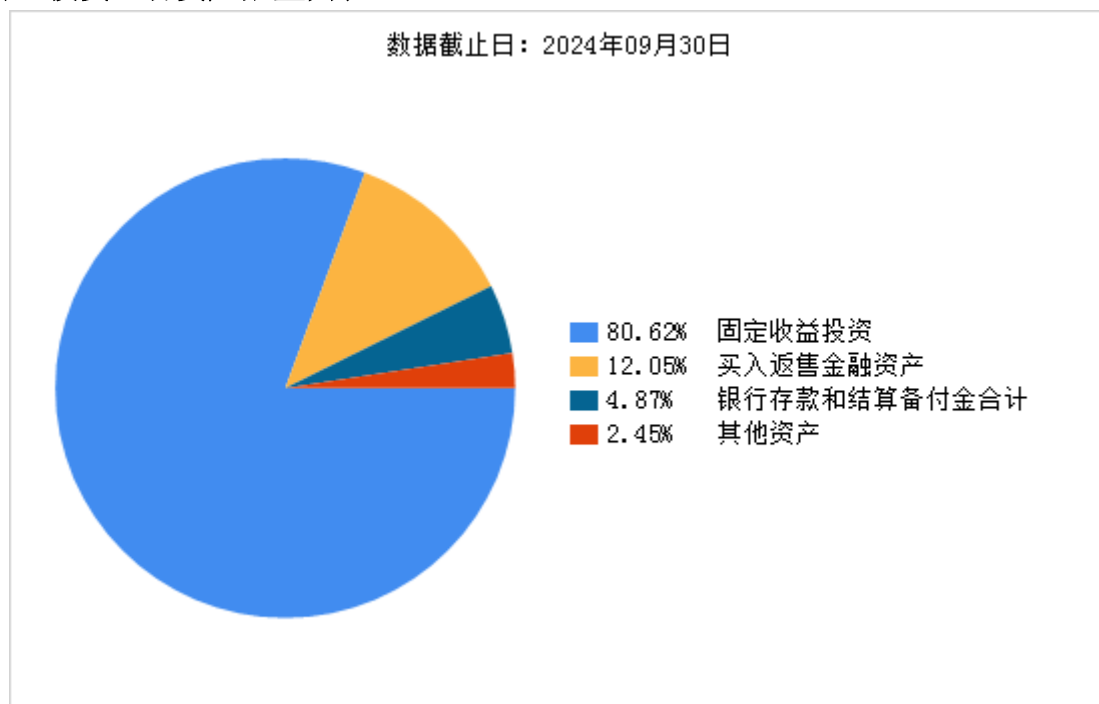
中证可转换债券指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×20%+沪深300指数收益率×10%。

风险收益特征

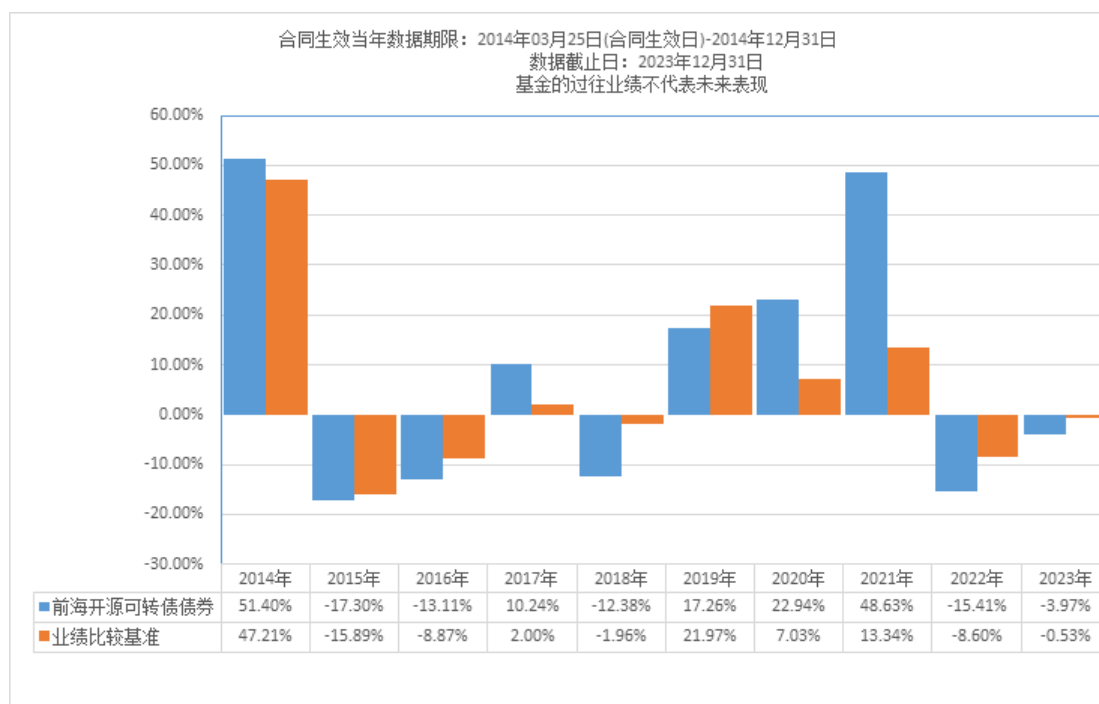
本基金为债券型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金。

注：不同的销售机构采用的评价方法不同，本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，投资人在购买本基金时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。

（二）投资组合资产配置图表



（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



注：本基金的基金合同于2014年3月25日生效，2014年本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率按本基金实际存续期计算。

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 | 0.80% | - |
| | 100万元≤M<500万元 | 0.60% | - |
| | 500万元≤M<1000万元 | 0.30% | - |
| | M≥1000万元 | 1000元/笔 | - |
| 赎回费 | N<7天 | 1.50% | - |
| | 7天≤N<366天 | 0.10% | - |
| | 366天≤N<731天 | 0.05% | - |
| | N≥731天 | 0.00% | - |

（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 | 1.00% | 基金管理人和销售机构 |
| 托管费 | 0.20% | 基金托管人 |
| 审计费用 | 9.00万元 | 会计师事务所 |
| 信息披露费 | 12.00万元 | 规定披露报刊 |
| 其他费用 | 本基金其他费用详见基金合同或招募说明书费用章节，按实际发生金额从基金资产扣除。 | - |

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。

2、审计费用、信息披露费年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

（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）

1.21%

注：基金运作综合费率=固定管理费率+托管费率+销售服务费率（若有）+其他运作费用合计占基金每日平均资产净值的比例（年化），其中，基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金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。

1、本基金特定风险

本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%；投资于可转债（含分离交易可转债）的投资比例不低于非现金基金资产的80%。因此，本基金主要投资于可转债品种，需要承担企业因经营不善导致的一系列对可转债缺乏偿还能力、对可转债赋予条款不予履行等违约风险。另外，本基金投资的可转债需要承担可转债市场的流动性风险、由可转债对应正股价格波动带来的可转债价格波动风险，以及在转股期内由于可转债正股价格低于转股价而导致不能获得转股收益的风险等。

同时，本基金投资于股票等权益类资产的投资比例不超过基金资产的20%，这虽然提升了预期收益水平，也增加了一定的预期风险水平。

本基金的投资范围包括存托凭证，可能面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与创新企业、境外发行人、存托凭证发行机制以及交易机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外证券交易机制、法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

2、市场风险。3、信用风险。4、流动性风险。5、启用侧袋机制的风险。6、管理风险。7、操作或技术风险。8、大额赎回风险。9、其他风险。10、本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。

（二）重要提示

中国证监会对本基金募集的注册，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基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

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，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

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，基金管理人至少每年更新一次。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

以下资料详见基金管理人网站[www.qhkyfund.com][客服电话：4001-666-998]

- 《前海开源可转债债券型发起式证券投资基金基金合同》、《前海开源可转债债券型发起式证券投资基金托管协议》、《前海开源可转债债券型发起式证券投资基金招募说明书》
- 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

无。