

## 天风六个月滚动持有债券型集合资产管理计划(A类份额)基金产品资料概要更新

编制日期：2024年06月25日

送出日期：2024年06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	天风六个月滚动债	基金代码	970039
基金简称A	天风六个月滚动债A	基金代码A	970039
基金管理人	天风（上海）证券资产管理 有限公司	基金托管人	兴业银行股份有限公司
基金合同生效日	2021年09月22日	上市交易所及上市日期	暂未上市
基金类型	债券型	交易币种	人民币
运作方式	其他开放式	开放频率	每个开放日开放申购；每份集合计划份额每满6个月可赎回
基金经理	开始担任本基金基金经理的日期	证券从业日期	
王圳杰	2021年09月22日		2017年07月16日

注：本概要所述的“基金”也包括按照《证券公司大集合资产管理业务适用操作指引》的要求进行变更后的证券公司大集合资产管理产品。

## 二、基金投资与净值表现

## (一) 投资目标与投资策略

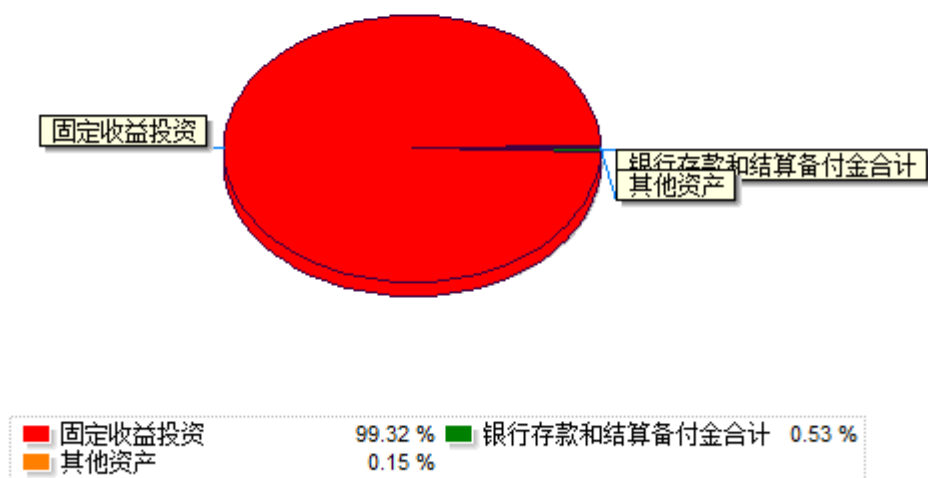
敬请投资者仔细阅读《天风六个月滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书》第十部分“集合计划的投资”了解详细情况。

投资目标	本集合计划在严格控制风险和充分考虑投资安全的基础上，力争实现集合计划资产的长期稳健增值。
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，包括债券（含国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（含协议存款、定期存款及其他银行存款）、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）。 本集合计划不投资于股票资产。

	<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,管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。</p> <p>集合计划的投资组合比例为:本集合计划投资于债券资产比例不低于集合计划资产的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,本集合计划持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资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、应收申购款等。</p> <p>如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,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	<ol style="list-style-type: none"> <li>1、资产配置策略</li> <li>2、债券投资策略 <ol style="list-style-type: none"> <li>(1) 债券久期策略</li> <li>(2) 曲线相对价值策略</li> <li>(3) 曲线骑乘策略</li> <li>(4) 杠杆息差策略</li> <li>(5) 信用债投资策略</li> <li>(6) 可转换债券投资策略</li> </ol> </li> <li>3、资产支持证券投资策略</li> <li>4、国债期货投资策略</li> </ol>
业绩比较基准	中债综合财富(1年以下)指数收益率 $\times$ 80%+银行一年期定期存款利率(税后) $\times$ 20%
风险收益特征	本集合计划为债券型集合资产管理计划,预期收益和预期风险高于货币市场基金及货币市场型集合资产管理计划,低于混合型基金及混合型集合资产管理计划、股票型基金及股票型集合资产管理计划。

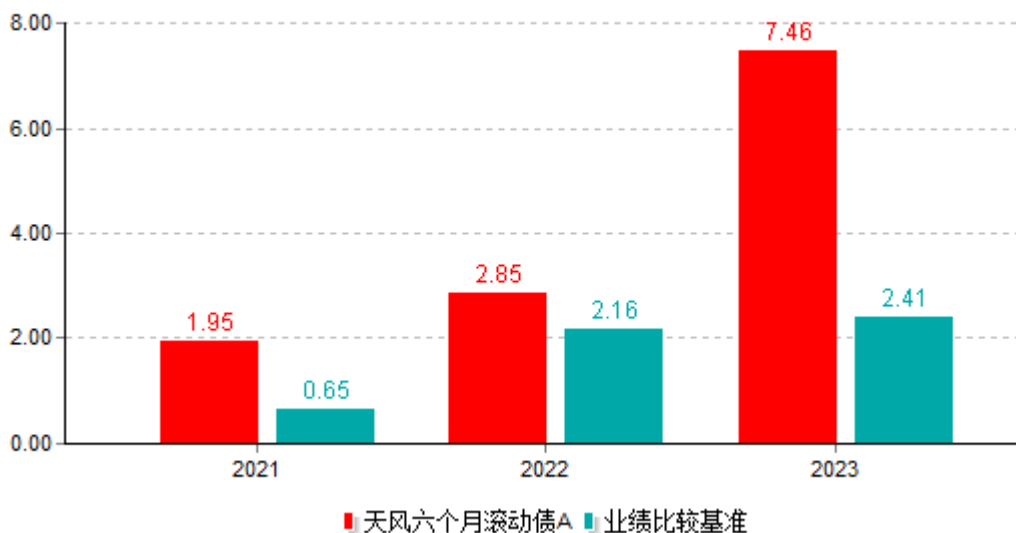
## (二) 投资组合资产配置图表 / 区域配置图表

数据截止日：2024年03月31日



(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

基金的过往业绩不代表未来表现，数据截止日：2023年12月31日  
单位%



注：本集合计划资产管理合同生效之日为2021年9月22日，资产管理合同生效当年按实际期限计算，不按整个自然年度计算。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	0.50%	
	100万≤M<500万	0.30%	
	M≥500万	0.00	
赎回费		0.00	本集合计划设定6个月的滚动运作期，不收取赎回费用。

注：本集合计划已经存续，因此没有发售安排，未设置认购费。

## （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	0.50%	基金管理人、销售机构
托管费	0.05%	基金托管人
审计费用	7,000.00	会计师事务所
信息披露费	120,000.00	规定披露报刊
其他费用	除法律法规、中国证监会另有规定外，《资产管理合同》生效后与集合计划相关的信息披露费用；《资产管理合同》生效后与集合计划相关的会计师费、审计费、律师费、诉讼费和仲裁费等；集合计划份额持有人大会费用；集合计划的证券/期货交易费用；集合计划的银行汇划费用；集合计划相关账户的开户及维护费用；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：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、以上费用年金额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）
--	--------------

持有期	0.57%
-----	-------

注：1、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。

2、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）。

#### 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《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，预期收益和预期风险高于货币市场基金及货币市场型集合资产管理计划，低于混合型基金及混合型集合资产管理计划、股票型基金及股票型集合资产管理计划。

本集合计划投资运作过程中面临的主要风险有：市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、技术风险、管理风险、合规性风险、本集合计划特有风险及其他风险。本集合计划特有风险包括但不限于：

1、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%，不投资于股票资产。因此，本集合计划需要承担债券市场整体下跌的风险。

2、本集合计划对于每份集合计划份额，设定6个月的滚动运作期。对于每份集合计划份额，第一个运作期指资产管理合同生效日（对资产管理合同生效前相应份额而言，下同）或集合计划份额申购确认日（对申购份额而言，下同）起（即第一个运作期起始日），至资产管理合同生效日或集合计划份额申购申请日满6个月对应的月度对日（即第一个运作期到期日）止。第二个运作期指第一个运作期到期日的次一工作日起，至资产管理合同生效日或集合计划份额申购申请日满12个月对应的月度对日止，第三个运作期指第二个运作期到期日的次一工作日起，至资产管理合同生效日或集合计划份额申购申请日满18个月对应的月度对日止。以此类推。每个运作期到期日前，本集合计划份额持有人不能提出赎回申请，因此面临流动性风险。如果集合计划份额持有人在当期运作期到期日未申请赎回，则自该运作期到期日下一工作日起该集合计划份额进入下一个运作期。

##### 3、 投资资产支持证券的风险

本集合计划可投资于资产支持证券，可能给本集合计划带来额外风险，包括信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、操作风险和法律风险等，由此可能给集合计划净值带来不利影响或损失。管理人将本着谨慎和控制风险的原则进行资产支持证券投资，请集合计划份额持有人关注包括投资资产支持证券可能导致的集合计划净值波动、流动性风险和信用风险在内的各项风险。

##### 4、 投资国债期货的风险

本集合计划可投资于国债期货。国债期货的投资可能面临市场风险、杠杆性风险、到期日风险、强制平仓风险、基差风险。市场风险是指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。杠杆性风险是指国债期货交易采用保证金交易方式，潜在损失可能成倍放大，具有杠杆性风险。到期日风险是指国债期货合约到期时，如本集合计划仍持有未平仓合约，交易所将按照交割结算价将集合计划持有的合约进行现金交割，集合计划存在无法继续持有到期合约的可能，具有到期日风险。国债期货合约采取实物交割方式，如集合计划未能在规定期限内如数交付可交割国债或者

未能在规定期限内如数缴纳交割贷款，将构成交割违约，交易所将收取相应的惩罚性违约金。强制平仓风险是指如集合计划参与交割不符合交易所或者期货公司相关业务规定，期货公司有权不接受集合计划的交割申请或对集合计划的未平仓合约强行平仓，由此产生的费用和结果将由集合计划承担。基差风险是指使用国债期货对冲市场风险的过程中，集合计划财产可能因为国债期货合约与合约标的价格波动不一致而面临期现基差风险。在需要将期货合约展期时，合约平仓时的价格与下一个新合约开仓时的价格之差也存在不确定性，面临跨期基差风险。

## （二）重要提示

天风六个月滚动持有债券型集合资产管理计划（以下简称“集合计划”或“本集合计划”）由天风证券天泽1号集合资产管理计划变更而来。

中国证监会对天风证券天泽1号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集合计划财产，但不保证投资于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。

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。

各方当事人同意，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提交上海国际经济贸易仲裁委员会申请仲裁，根据该会届时有有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点在上海市。仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费用、律师费用由败诉方承担，除非仲裁裁决另有决定。

## 五、 其他资料查询方式

以下资料详见集合计划管理人网站[<https://www.tfzqam.com>][客服电话：95391/400-800-5000]

1. 《天风六个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》、《天风六个月滚动持有债券型集合资产管理计划托管协议》、《天风六个月滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书》
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。