

# 广发资管多添利六个月持有期债券型集合资产管理计划（广发资管多添利六个月持有期债券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	广发资管多添利六个月持有期债券	基金代码	879998
下属基金简称	广发资管多添利六个月持有期债券A	下属基金代码	872027
基金管理人	广发证券资产管理（广东）有限公司	基金托管人	广发银行股份有限公司
基金合同生效日	2023-03-27		
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6个月的锁定持有期	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开放持有期首日起才能办理该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	2024-04-09
		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，包括国内依法发行上市的股票（含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许

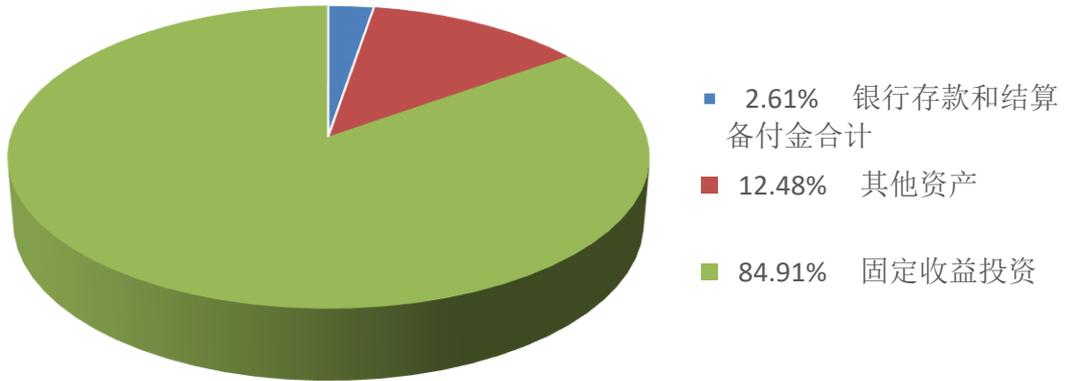
	<p>买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（简称“港股通股票”）、债券（国债、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券、央行票据、金融债券（含公开发行的次级债券）、政策性金融债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含可分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、证券公司发行的短期公司债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据）、在全国银行间债券交易市场或证券交易所交易的资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、通知存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。</p> <p>本集合计划投资于债券的比例不低于集合计划资产的80%；投资于股票等权益类资产、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%（其中港股通股票投资比例不得超过股票资产的50%）；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>
<b>主要投资策略</b>	<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、可转换债券（含可交换债券）投资策略；5、证券公司短期公司债券投资策略；6、回购策略；7、国债期货投资策略；8、股票投资策略。</p>
<b>业绩比较基准</b>	<p>中债综合全价（总值）指数收益率*90%+沪深300指数收益率*8%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*2%。</p>
<b>风险收益特征</b>	<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>本集合计划除了投资A股外，还可根据法律法规规定投资港股通股票。除了需要承担与内地证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本集合计划还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>

注：详见《广发资管多添利六个月持有期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”。

## （二）投资组合资产配置图表/区域配置图表

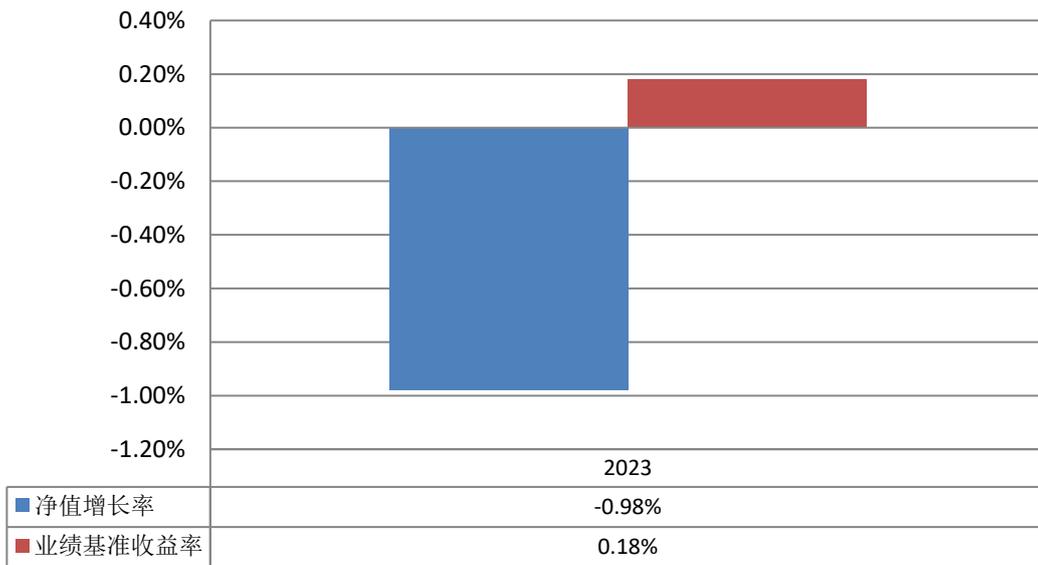
### 投资组合资产配置图表

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	0.50%	
	100 万元 ≤ M < 500 万元	0.30%	

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、本集合计划份额最短持有期为6个月，持有满6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	0.60%	基金管理人、销售机构
托管费	0.05%	基金托管人
审计费用	9,500.47	会计师事务所
信息披露费	20,000.00	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、银行账户维护费、投资港股通标的股票而产生的相关费用等，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）
1.59%

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；实施侧袋机制对投资者的影响；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，管理人有权停止认/申购。投资者可能面临因上述原

因而无法认/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) 锁定持有期内不能赎回的风险

本集合计划对每份集合计划份额设定锁定持有期,锁定持有期为 6 个月。锁定持有期到期后进入开放持有期,每份集合计划份额自开放持有期首日起才能办理赎回业务。因此集合计划份额持有人面临在锁定持有期内不能赎回集合计划份额的风险。

(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) 集合计划投资港股通标的的风险

本集合计划可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化,选择将部分集合计划资产投资于港股或选择不将集合计划资产投资于港股,集合计划资产并非必然投资港股。

本集合计划资产若投资于港股,会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险,包括港股市场股价波动较大的风险(港股市场实行 T+0 回转交易,且对个股不设涨跌幅限制,港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动)、汇率风险(汇率波动可能对集合计划的投资收益造成损失)、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险(在内地开市香港休市的情形下,港股通不能正常交易,港股不能及时卖出,可能带来一定的流动性风险)等。

1) 本集合计划将通过“内地与香港股票市场交易互联互通机制”投资于香港市场,在市场进入、投资额度、可投资对象、交易规则、税务政策等方面都有一定的限制,而且此类限制可能会不断调整,这些限制因素的变化可能对本集合计划进入或退出当地市场造成障碍,从而对投资收益以及正常的申购赎回产生直接或间接的影响。

2) 香港市场交易规则有别于内地 A 股市场规则,此外,在“内地与香港股票市场交易互联互通机制”下参与香港股票投资还将面临包括但不限于如下特殊风险:

i) 香港市场证券交易价格并无涨跌幅上下限的规定,因此每日涨跌幅空间相对较大;

ii) 只有沪港两地均为交易日且能够满足结算安排的交易日才为港股通交易日;

iii) 香港出现台风、黑色暴雨或者联交所规定的其他情形时,联交所将可能停市,投

投资者将面临在停市期间无法进行港股通交易的风险；出现上交所证券交易服务公司认定的交易异常情况时，上交所证券交易服务公司可能暂停提供部分或者全部港股通服务，投资者将面临在暂停服务期间无法进行港股通交易的风险；

iv) 投资者因港股通股票权益分派、转换、上市公司被收购等情形或者异常情况，所取得的港股通股票以外的联交所上市证券，只能通过港股通卖出，但不得买入，上交所另有规定的除外；因港股通股票权益分派或者转换等情形取得的联交所上市股票的认购权利在联交所上市的，可以通过港股通卖出，但不得行权；因港股通股票权益分派、转换或者上市公司被收购等所取得的非联交所上市证券，可以享有相关权益，但不得通过港股通买入或卖出；

v) 代理投票方面，由于中国结算是汇总投资者意愿后再向香港结算提交投票意愿，中国结算对投资者设定的意愿征集期比香港结算的征集期稍早结束，投票没有权益登记日的，以投票截止日的持有作为计算基准；投票数量超出持有数量的，按照比例分配持有基数。

以上所述因素可能会给本集合计划投资带来特殊交易风险。

#### (9) 投资存托凭证的风险

本集合计划投资存托凭证，可能受到存托凭证的境外基础证券价格波动影响，存托凭证的境外基础证券的相关风险可能直接或间接成为本集合计划的风险。除价格波动风险外，本集合计划还将面临存托凭证发行机制相关的风险，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；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

(10) 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、广发资管多添利六个月持有期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