

国元元赢六个月定期开放债券型集合资产管理计划产品资料概要更新

编制日期：2024年07月02日

送出日期：2024年07月05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	国元元赢六个月定开债	基金代码	970124
基金管理人	国元证券股份有限公司	基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
基金合同生效日	2022年02月17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	契约型开放式	开放频率	本集合计划以定期开放方式运作，即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。本集合计划自资产管理合同生效后首个开放期结束之日次日起（含该日）以6个月为一个封闭期，封闭期为每个开放期结束之日次日起（含该日）至六个月月度对日的前一日（含该日）止。在每个封闭期内，本集合计划采取封闭运作模式，期间管理人不办理申购、赎回或其他业务。本集合计划的开放期不低于5个工作日且不超过20个工作日，且开放期约定满足法规要求，具体时间由管理人在每个封闭期结束前公告说明。
基金经理	开始担任本基金基金经理的日期	证券从业日期	
柯贤发	2023年08月30日	2011年09月25日	
夏真辉	2013年05月29日	2008年12月24日	
其他	本集合计划由原国元元赢六个月定期开放债券型集合资产管理计划变更而来。存续期限自《国元元赢六个月定期开放债券型集合资产管理计划资产管		

	理合同》生效之日起3年。
--	--------------

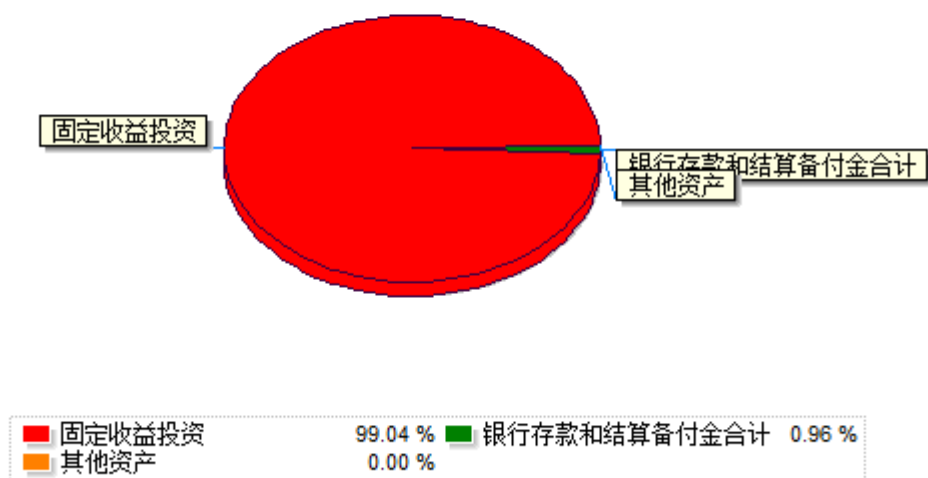
二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

投资目标	在追求资产安全性的基础上，力争为集合计划份额持有人实现长期稳定的投资收益。
投资范围	<p>本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国债、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、资产支持证券、次级债、可转换债券（含可分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、债券回购、同业存单、银行存款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。</p> <p>本集合计划不参与新股申购或增发新股，也不直接买入股票等权益类资产，因持有可转债转股和可交换债券换股所形成的股票，必须在其可交易之日起10个交易日内卖出。</p> <p>法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本集合计划的投资范围。</p> <p>本集合计划债券资产的投资比例不低于集合计划资产的80%，但在开放期开始前10个工作日、开放期以及开放期结束后的10个工作日内，本集合计划债券资产的投资比例不受上述比例限制。本集合计划投资于可转换债券（含可分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券的比例不超过集合计划资产的20%。开放期内，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	本集合计划的投资策略包括类属资产配置策略、久期策略、收益率曲线策略、杠杆策略、个券选择策略、可转债投资策略等，在有效管理风险的基础上，达成投资目标。本集合计划投资于可转换债券（含可分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券的比例不超过集合计划资产的20%。
业绩比较基准	中债-信用债总全价(总值)指数(CBA02703.CS)收益率。
风险收益特征	本集合计划为债券型集合计划，其预期风险和预期收益低于混合型基金、混合型集合计划、股票型基金、股票型集合计划，高于货币市场基金、货币型集合计划。

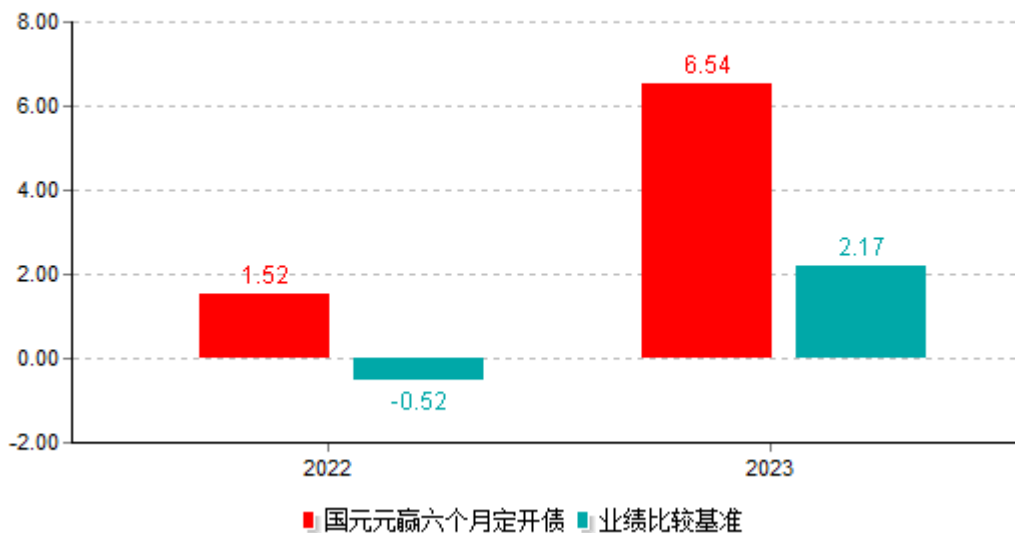
(二) 投资组合资产配置图表 / 区域配置图表

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%



无

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)	0<M<50万	0.60%	

收费)	50万≤M<100万	0.40%	
	100万≤M<500万	0.30%	
	M≥500万	1000.00元/笔	
赎回费	N<7天	0.15%	
	N≥7天	0.00%	

申购费：本集合计划由原国元元赢六个月定期开放债券型集合资产管理计划变更而来。存续期限自《国元元赢六个月定期开放债券型集合资产管理计划资产管理合同》生效之日起3年。

本集合计划的申购费用由投资人承担，并应在投资人申购时收取，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、注册登记等各项费用。因红利再投资而产生的集合计划份额，不收取相应的申购费用。

赎回费：本集合计划的赎回费在集合计划份额持有人赎回集合计划份额时收取。集合计划份额的赎回费率按照持有时间递减，即集合计划份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低。

赎回费用由赎回集合计划份额的集合计划份额持有人承担，在集合计划份额持有人赎回集合计划份额时收取，并全额计入集合计划财产。

（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
托管费	0.10%	基金托管人
审计费用	80,000.00	会计师事务所
信息披露费	120,000.00	规定披露报刊
其他费用	《资产管理合同》生效后与集合计划相关的信息披露费用、会计师费、律师费、审计费、诉讼费和仲裁费，集合计划份额持有人大会费用，集合计划的证券交易费用，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：本集合计划交易证券等产生的费用和税负，按实际发生额从集合计划资产扣除。本集合计划实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支。本集合计划管理费率、托管费率、销售服务费率为基金现行费率，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。

（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）
0.64%

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。

本集合计划面临的主要风险有市场风险、管理风险、流动性风险、操作或技术风险、合规风险、本集合计划特有的风险以及其他风险。

本集合计划特有的风险包括：

1、本集合计划债券资产不低于集合计划总资产的80%，但在开放期开始前10个工作日、开放期以及开放期结束后的10个工作日内，本集合计划债券资产的投资比例不受上述比例限制。因此，本集合计划需要承担由于市场利率波动造成的利率风险以及如企业债、公司债等信用品种的发债主体信用恶化造成的信用风险；如果债券市场出现整体下跌，将无法完全避免债券市场系统性风险。

2、本集合计划以定期开放的方式进行运作，封闭期长度为6个月，封闭期间不办理申购、赎回或其他业务；在某个封闭期结束和下一封闭期开始之间设置开放期，受理本集合计划的申购、赎回等申请，开放期的时长不少于五个工作日并且最长不超过二十个工作日。因此，在封闭期内，集合计划份额持有人将面临不能赎回或卖出集合计划份额而出现的流动性约束。

3、若本集合计划在开放期发生了巨额赎回，管理人有可能采取延缓支付赎回款项的措施以应对巨额赎回，因此在巨额赎回情形发生时，集合计划份额持有人存在不能及时获得赎回款项的风险。

4、资产支持证券的投资风险

本集合计划投资资产支持证券，资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险。价格波动风险指的是市场利率波动会导致资产支持证券的收益率和价格波动。流动性风险指的是受资产支持证券市场规模及交易活跃程度的影响，资产支持证券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，存在一定的流动性风险。信用风险指的是集合计划所投资的资产支持证券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降，造成集合计划财产损失。

5、流通受限证券的风险

本集合计划可投流通受限证券，因此本集合计划可能由于持有流通受限证券而面临流动性风险以及流通受限期间内证券价格大幅下跌的风险。

（二）重要提示

1、中国证监会对原集合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。

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本集合计划财产，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集合资产管理计划份额，即成为集合计划份额持有人和资产管理合同的当事人。

本集合计划未经任何一级政府、机构及部门担保。集合计划投资者自愿投资于本集合计划，须自行承担投资风险。

2、除管理人直接办理本集合计划的销售外，本集合计划还通过管理人委托的其他销售机构销售，但是，集合计划资产并不是销售机构的存款或负债，也没有经集合计划销售机构担保收益，销售机构并不能保证其收益或本金安全。

因本集合计划有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交合肥仲裁委员会，根据其届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地为合肥。

五、 其他资料查询方式

以下资料详见国元证券股份有限公司官方网站 [<http://www.gyzq.com.cn>] [客服电话：95578]

国元元赢六个月定期开放债券型集合资产管理计划资产管理合同

国元元赢六个月定期开放债券型集合资产管理计划托管协议

国元元赢六个月定期开放债券型集合资产管理计划招募说明书

定期报告，包括季度报告、中期报告和年度报告

集合计划份额净值

集合计划销售机构及联系方式

其他重要资料

六、 其他情况说明

暂无。