

## 天风天盈一年定期开放混合型集合资产管理计划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	天风天盈一年定开混合	基金代码	970023
基金管理人	天风（上海）证券资产管理有限公司	基金托管人	中信银行股份有限公司
基金合同生效日	2021年08月30日	上市交易所及上市日期	暂未上市
基金类型	混合型	交易币种	人民币
运作方式	定期开放式	开放频率	一年定期开放
基金经理	开始担任本基金基金经理的日期	证券从业日期	
贾玉淼	2023年04月20日	2002年10月01日	
邱天	2023年08月10日	2016年07月01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〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉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

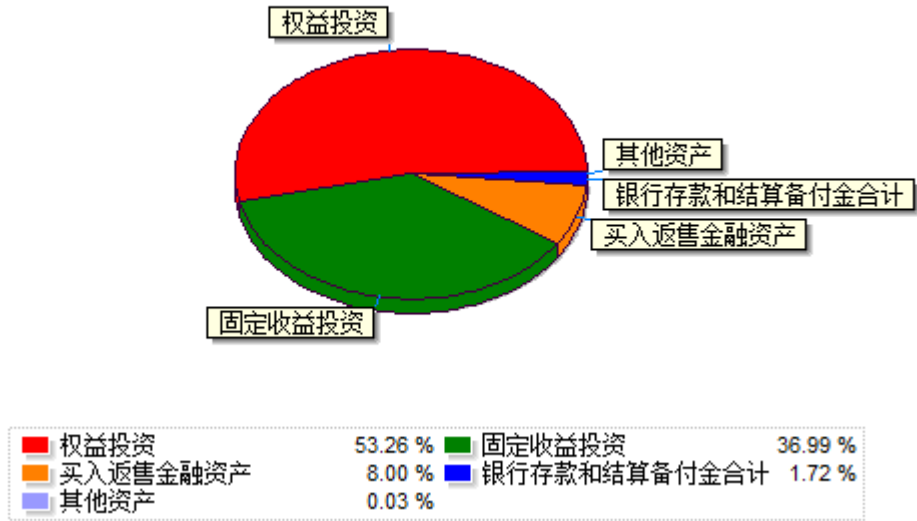
敬请投资者仔细阅读《天风天盈一年定期开放混合型集合资产管理计划招募说明书》第九部分“集合计划的投资”了解详细情况。

投资目标	本集合计划依托管理人的投资研究优势，在深入分析、精选投资标的的基础上，主要投资于具备良好价值、持续增长能力的优秀企业，通过科学合理的资产配置，力争实现集合计划资产的长期稳定增值。
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，包括股票（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市或准予注册的股票）、港股通标的股票、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、可分离交易债券、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（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货等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）。

	<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>本集合计划的投资组合比例为：本集合计划投资于股票资产的比例为集合计划资产的20%-65%（其中，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0%-50%）。</p> <p>开放期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约和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%。封闭期内，本集合计划不受上述5%的限制，但每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本集合计划保持不低于交易保证金一倍的现金。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>
<p>主要投资策略</p>	<p>（一）封闭期投资策略</p> <p>1、资产配置策略：主要通过自上而下地研究宏观经济运行趋势、深入分析财政及货币政策对经济运行的影响，判断市场走势、利率变化、资产波动性等因素，决定大类资产在品种、级别、期限等维度的分布配置，力争实现投资组合稳健增值、同时降低投资组合波动。</p> <p>2、股票投资策略：主要包括行业配置策略、股票精选策略、港股通标的股票投资策略以及量化增强策略。</p> <p>3、债券投资策略：主要包括债券久期策略、曲线相对价值策略、曲线骑乘策略、杠杆息差策略、信用债投资策略以及可转换债券投资策略。</p> <p>4、资产支持证券投资策略：本集合计划将在国内资产证券化产品具体政策框架下，采用基本面分析和数量化模型相结合，对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。</p> <p>5、国债期货投资策略：本集合计划将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。</p> <p>6、股指期货投资策略：本集合计划以套期保值和有效管理为目标，在控制风险的前提下，谨慎适当参与股指期货的投资。</p> <p>（二）开放期投资策略</p> <p>开放期内，本集合计划为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本集合计划有关投资限制与投资比例的前提下，将增加高流动性的投资品种的配置，满足开放期流动性需求。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>中证全指指数收益率×40% +恒生指数收益率×10%+中债综合财富指数收益率×50%</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本集合计划为混合型集合资产管理计划，其风险收益水平低于股票型基金及股票型集合资产管理计划，高于债券型基金及债券型集合资产管理计划、货币市场基金及货币型集合资产管理计划。</p>

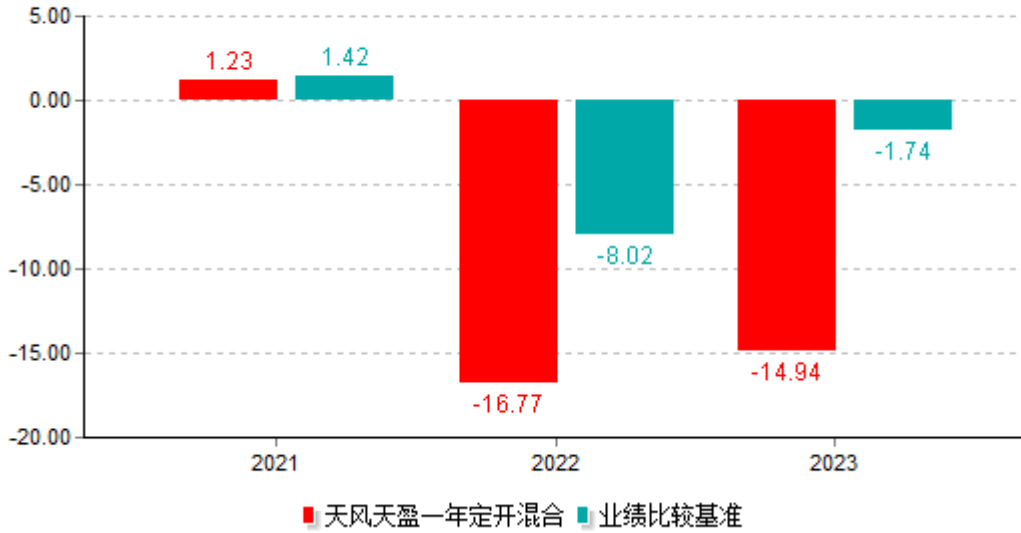
(二) 投资组合资产配置图表 / 区域配置图表

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8月30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	1.00%	
	100万≤M<300万	0.50%	
	300万≤M<500万	0.20%	
	M≥500万	0.00	
赎回费	N<7天	1.50%	
	7天≤N<30天	0.75%	
	30天≤N<90天	0.50%	
	90天≤N<180天	0.50%	
	N≥180天	0.00	

注：1、本集合计划已经存续，因此没有发售安排，未设置认购费。

2、1个月按照30日计算。本集合计划对持续持有期少于30日的投资人收取的赎回费，将赎回费全额计入集合计划财产；对持续持有期等于或长于30日、少于3个月的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的75%计入集合计划财产；对持续持有期等于或长于3个月但少于6个月的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的50%计入集合计划财产；对持续持有期等于或长于6个月的投资人，将不低于赎回费总额的25%计入集合计划财产。未计入集合计划财产的赎回费用于支付登记费和其他必要的手续费。如法律法规对赎回费的强制性规定发生变动，本集合计划将依新法规进行修改，不需召开集合计划份额持有人大会。

## (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	1.20%	基金管理人、销售机构
管理人业绩报酬	在投资者赎回确认日和本集合计划终止日，管理人将根据投资者的期间年化收益率(R)，对集合计划份额期间年化收益率超过6%以上部分按照20%的比例收取业绩报酬。	基金管理人、销售机构
托管费	0.08%	基金托管人
审计费用	7,000.00	会计师事务所
信息披露费	80,000.00	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；集合计划份额	

	<p>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；因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；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。</p>	
--	--	--

注：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。

### （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	1.44%

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）。业绩报酬（若有）不纳入测算范围。

## 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。

本集合计划为混合型集合资产管理计划，其风险收益水平低于股票型基金及股票型集合资产管理计划，高于债券型基金及债券型集合资产管理计划、货币市场基金及货币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、本集合计划为混合型集合资产管理计划，投资于股票资产的比例为集合计划资产的20%-65%（其中，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0%-50%）。因此，内地和港股通标的股票市场和债券市场的变化均会影响到集合计划的业绩表现，具有对市场的系统性风险，不能完全规避市场下跌的风险，在市场大幅上涨时也不能保证集合计划份额净值能够完全跟随或超越市场上涨幅度。

2、投资港股通标的股票的风险。本集合计划可能投资于法律法规规定范围内的香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本集合计划还面临汇率风险、香港市场风险、市场制度以及交易规则不同等境外证券市场投资所面临的特有风险。

3、投资股指期货、国债期货的风险：股指期货、国债期货的投资可能面临市场风险、基差风险、流动性风险。

4、投资可转换债券、可交换债券的风险：本集合计划可投资于可转换债券、可交换债券，需要承担可转换债券和可交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等。

5、投资资产支持证券的风险，包括：（1）与基础资产相关的风险有信用风险、现金流预测风险和原始权益人的风险；（2）与资产支持证券相关的风险有市场利率风险、流动性风险、评级风险、提前偿付及延期偿付风险。

6、本集合计划以定期开放的方式运作，即采用开放运作和封闭运作交替循环的方式。封闭期为1年，在每个封闭期内，集合计划份额持有人面临不能赎回集合计划份额的风险。若集合计划份额持有人错过某一开放期而未能赎回，其份额需至下一开放期方可赎回。

## （二）重要提示

天风天盈一年定期开放混合型集合资产管理计划（以下简称“集合计划”或“本集合计划”）由天风证券天盈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盈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。

本集合计划以逐笔计提的方式收取业绩报酬，且按照《资产管理合同》约定披露的集合计划份额净值、集合计划份额累计净值未扣除管理人业绩报酬。不同时间申购的集合计划份额因申购当日的集合计划份额净值、集合计划份额累计净值不同以及持有期不同，赎回时应收取的管理人业绩报酬也不同，集合计划份额持有人实际赎回金额以登记机构确认数据为准。

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. 集合计划资产管理合同、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

## 六、其他情况说明

无。