

东方臻萃 3 个月定期开放纯债债券型证券投资基金

基金产品资料概要更新

编制日期：2024 年 6 月 26 日

送出日期：2024 年 6 月 27 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	东方臻萃 3 个月定开债券	基金代码	009461
下属基金简称	东方臻萃 3 个月定开债券 A	下属基金交易代码	009461
下属基金简称	东方臻萃 3 个月定开债券 C	下属基金交易代码	009462
基金管理人	东方基金管理股份有限公司	基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司
基金合同生效日	2020 年 5 月 21 日	上市交易所及上市日期	-
基金类型	债券型	交易币种	人民币
运作方式	定期开放式	开放频率	每 3 个月开放一次
基金经理	车日楠	开始担任本基金基金经理的日期	2021 年 5 月 12 日
		证券从业日期	2015 年 7 月 13 日
其他	《基金合同》生效后，在任一开放期最后一日日终，发生下列情形之一的，本基金将自动终止基金合同并进行基金财产清算，无需召开基金份额持有人大会：1、基金份额持有人数量不满 200 人；2、当日基金资产净值加上当日净申购金额或者减去当日净赎回金额后低于 5000 万元。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。		

二、基金投资与净值表现

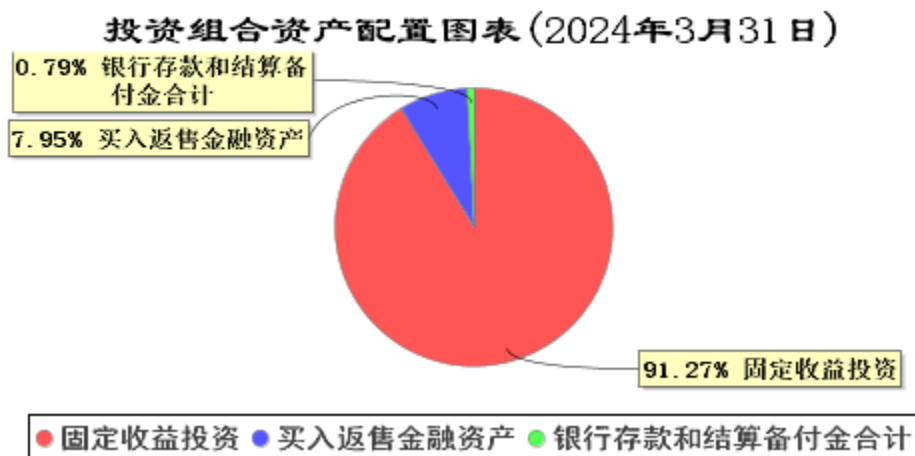
(一) 投资目标与投资策略

(请投资者阅读《招募说明书》第八部分了解详细情况)

投资目标	在严格控制风险并保持良好流动性的基础上，追求基金资产的长期稳健增值。
投资范围	<p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、次级债券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、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相关规定）。</p> <p>本基金不投资股票等权益类资产，也不投资可转换债券、可交换债券。</p> <p>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。</p> <p>基金的投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于 80%，但在每个开放期前 10 个工作日、开放期间及开放期结束后 10 个工作日内，基金投资不受上述比例限制；开</p>

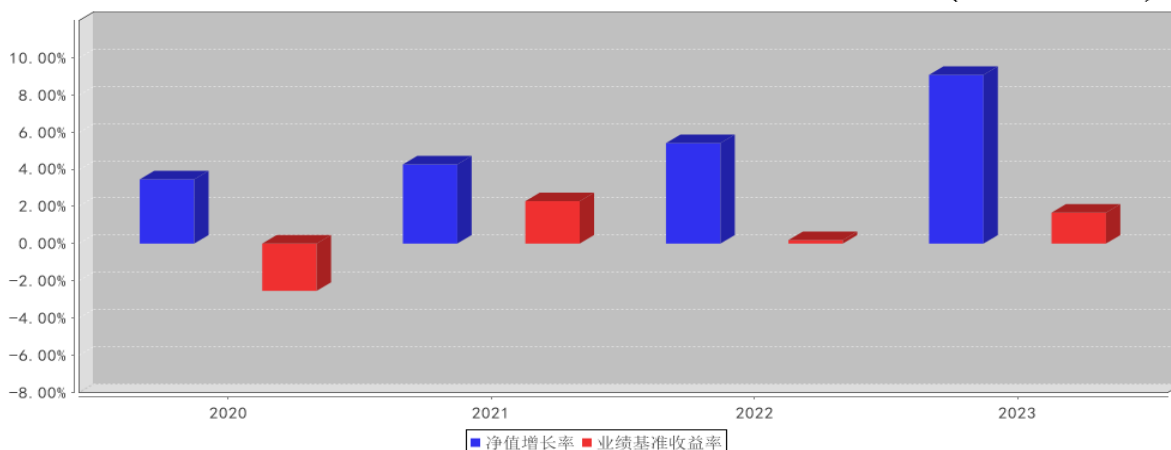
	放期内，本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%；封闭期内，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。 当法律法规的相关规定变更时，基金管理人可以根据法律从法规的规定，在履行适当程序后对上述资产配置比例进行适当调整。
主要投资策略	本基金的主要投资策略包括：封闭期投资策略、资产支持证券投资策略、国债期货投资策略、其他金融工具的投资策略、开放期投资策略等。
业绩比较基准	中债总全价指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，理论上其长期平均预期风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

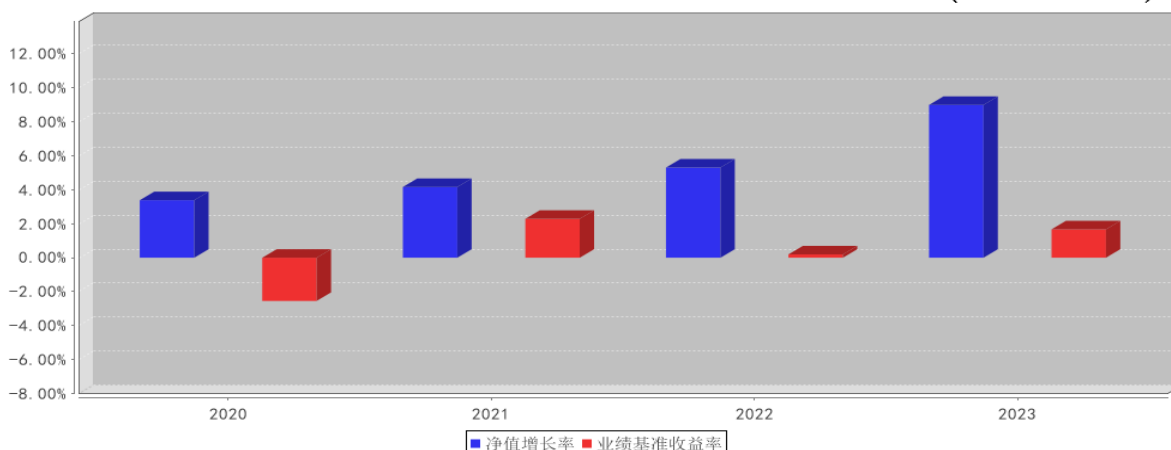


(三) 自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

东方臻萃3个月定开债券A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图 (2023年12月31日)



东方臻萃3个月定开债券C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图（2023年12月31日）



注：业绩表现截止日期 2023 年 12 月 31 日，基金合同生效当年的相关数据按实际存续期计算。基金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：

东方臻萃 3 个月定开债券 A

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 < 1,000,000	0.80%	-
	1,000,000 ≤ M < 3,000,000	0.60%	-
	3,000,000 ≤ M < 5,000,000	0.40%	-
	M ≥ 5,000,000	1,000 元/笔	-
赎回费	N < 7 日	1.50%	同一开放期内申购且赎回
	N ≥ 7 日	1.00%	同一开放期内申购且赎回
	-	0.00%	持有满一个封闭期

东方臻萃 3 个月定开债券 C

费用类型	份额 (S) 或金额 (M) /持有期限 (N)	收费方式/费率	备注
赎回费	N < 7 日	1.50%	同一开放期内申购且赎回
	N ≥ 7 日	1.00%	同一开放期内申购且赎回
	-	0.00%	持有满一个封闭期

注：金额单位为人民币元。

(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	0.30%		基金管理人和销售机构
托管费	0.10%		基金托管人
销售服务费	东方臻萃 3 个月定期开债券 C	0.10%	销售机构
审计费用	35,000.00 元		会计师事务所
信息披露费	120,000.00 元		规定披露报刊

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、信息披露费为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

3、基金合同生效后与本基金相关的律师费、诉讼费、仲裁费、基金份额持有人大会费用等可以在基金财产中列支的其他费用按照国家有关规定和《基金合同》约定在基金财产中列支。费用类别详见本基金基金合同及招募说明书或其更新。

(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：

东方臻萃 3 个月定期开债券 A

基金运作综合费率（年化）
0.44%

东方臻萃 3 个月定期开债券 C

基金运作综合费率（年化）
0.54%

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）。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。投资者可能损失投资本金。

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。

本基金所面临的风险主要包括以下部分：系统性风险、非系统性风险、流动性风险、启用侧袋机制的风险、运作风险、本基金特有的风险、法律风险和其他风险。其中，本基金特有的风险指：

本基金为定期开放债券基金，投资人只能在开放期进行申购与赎回（基金合同另有约定的除外）。投资人持有的本基金份额在封闭期期间不能按基金净值自由赎回，存在一定程度的流动性风险。

本基金在投资中将国债期货纳入到投资范围中，因此，可能面临市场风险、基差风险、流动性风险等。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。

本基金将资产支持证券纳入到投资范围当中，可能带来以下风险：

①信用风险：基金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，造成基金财产损失。

②利率风险：市场利率波动会导致资产支持证券的收益率和价格的变动，一般而言，如果市场利率上升，本基金持有资产支持证券将面临价格下降、本金损失的风险，而如果市场利率下降，资产支持证券利息的再投资收益将面临下降的风险。

③流动性风险：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。

④提前偿付风险：债务人可能会由于利率变化等原因进行提前偿付，从而使基金资产面临再投资风险。

⑤操作风险：基金相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、交易错误、IT 系统故障等风险。

⑥法律风险：由于法律法规方面的原因，某些市场行为受到限制或合同不能正常执行，导致基金财产的损失。

自动清算风险：本基金设置了自动清算条款，即《基金合同》生效后，在任一开放期最后一日日终，发生下列情形之一的，本基金将自动终止基金合同并进行基金财产清算，无需召开基金份额持有人大会：

- 1、基金份额持有人数量不满 200 人；
- 2、当日基金资产净值加上当日净申购金额或者减去当日净赎回金额后低于 5000 万元。

(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。

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。

基金投资人请认真阅读基金合同的争议处理相关章节，充分了解本基金争议处理的相关事项。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[www.orient-fund.com 或 www.df5888.com][客服电话 400-628-5888]

基金合同、托管协议、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