

# 中银证券凌瑞 6 个月持有期混合型证券投资基金（C 类份额）

## 基金产品资料概要更新

编制日期：2024 年 6 月 27 日

送出日期：2024 年 6 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    | 中银证券凌瑞 6 个月持有期混合  | 基金代码           | 017389  |
| 下属基金简称  | 中银证券凌瑞 6 个月持有期混合 C  | 下属基金交易代码       | 017390  |
| 基金管理人   | 中银国际证券股份有限公司  | 基金托管人          | 中国农业银行股份有限公司  |
| 基金合同生效日 | 2023 年 6 月 19 日   | 上市交易所及上市日期     | -   |
| 基金类型    | 混合型   | 交易币种           | 人民币   |
| 运作方式    | 其他开放式   | 开放频率           | 本基金每个开放日开放申购，但对于每份基金份额，设定 6 个月的持有期。持有期内该基金份额封闭运作。持有期到期日的下一个工作日起，基金份额持有人可提出赎回申请。 |
| 基金经理    | 王玉玺   | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2023 年 6 月 19 日   |
|         |   | 证券从业日期         | 2016 年 8 月 7 日  |
| 其他      | 1、本基金为偏债混合型基金，对权益类资产、可转换债券、可分离交易可转债（不含可分离交易可转债的纯债部分）及可交换债券的投资合计占基金资产的比例为 10%-30%； 2、本基金投资于全市场的股票型 ETF 及基金管理人旗下的股票型基金、计入权益类资产的混合型基金。本基金对经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金投资比例不超过基金资产净值的 10%。 |                |   |

注：本基金对每份基金份额设置 6 个月的最短持有期限，持有期内该基金份额封闭运作。持有期到期日的下一个工作日起，基金份额持有人可提出赎回申请。

对于每份基金份额，持有期指基金合同生效日（对认购份额而言，下同）或基金份额申购确认日（对申购份额而言，下同）起，至基金合同生效日或基金份额申购确认日后 6 个月的月度对日的前一日止。

### 二、基金投资与净值表现

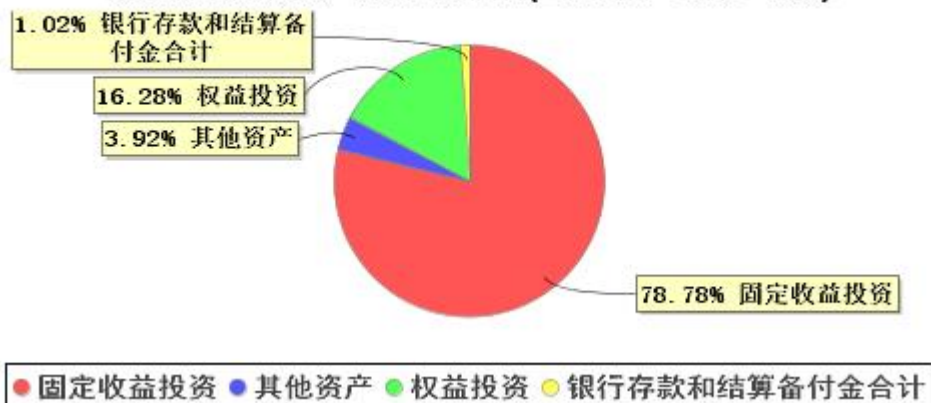
#### （一）投资目标与投资策略

|      |  |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的管理，追求基金资 |
|------|--|

|               |   |
|---------------|---|
|               | 产的长期稳定回报。   |
| <b>投资范围</b>   | <p>本基金的投资范围包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金（不包含货币市场基金、QDII 基金、香港互认基金、基金中基金和其他投资范围包含基金的基金）、股票（含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）、债券（包括国债、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、中央银行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债券等）、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款（包含协议存款、通知存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、股票期权、信用衍生品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）。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。基金的投资组合比例为：本基金对权益类资产、可转换债券、可分离交易可转债（不含可分离交易可转债的纯债部分）及可交换债券的投资合计占基金资产的比例为 10%-30%，本基金投资的权益类资产包括股票、存托凭证、股票型基金以及至少满足以下一条标准的混合型基金：（1）基金合同约定的股票资产占基金资产的比例不低于 60%；（2）基金最近 4 期季度报告中披露的股票资产占基金资产的比例均不低于 60%。本基金对经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金投资比例不超过基金资产净值的 10%。每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留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基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资限制，基金管理人在严格履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。</p> |
| <b>主要投资策略</b> | <p>本基金通过资产配置策略、债券投资策略、股票投资策略、基金投资策略、可转换债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略及信用衍生品投资策略，力争实现基金资产的长期稳健增值。</p>   |
| <b>业绩比较基准</b> | <p>中债综合全价指数收益率*80%+中证 800 指数收益率*15%+同期银行活期存款利率(税后)*5%</p>   |
| <b>风险收益特征</b> | <p>本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金，但低于股票型基金。</p>   |

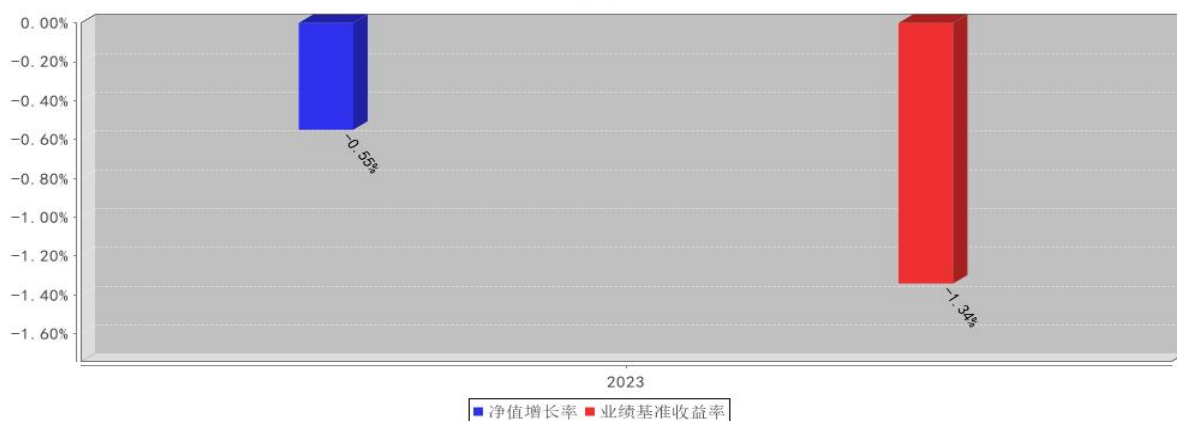
(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

## 投资组合资产配置图表(2024年3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

中银证券凌瑞6个月持有期混合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：本基金基金合同于2023年6月19日生效。合同生效当年不满完整自然年度，按实际期限计算净值增长率。业绩表现截止日期为2023年12月31日。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：

| 费用类型         | 份额(S)或金额(M)<br>/持有期限(N) | 收费方式/费率 | 备注                       |
|--------------|-------------------------|---------|--------------------------|
| 申购费<br>(前收费) |                         |         | 本基金C类基金份额不收取申购费，收取销售服务费。 |
| 赎回费          |                         |         | 本基金不收取赎回费用。              |

## (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  | 0.60%       | 基金管理人和销售机构 |

|       |  |        |
|-------|--|--------|
| 托管费   | 0.15%  | 基金托管人  |
| 销售服务费 | 0.20%  | 销售机构   |
| 审计费用  | 40,000.00 元  | 会计师事务所 |
| 信息披露费 | 70,000.00 元  | 规定披露报刊 |
| 其他费用  | 按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。费用类别详见本基金《基金合同》和《招募说明书》及其更新。 |        |
|       |  | 相关服务机构 |

注：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。审计费用和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。

### （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：

中银证券凌瑞 6 个月持有期混合 C

|      | 基金运作综合费率（年化） |
|------|--------------|
| 持有期间 | 1.00%        |

注：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。

本基金的主要风险包括市场风险、管理风险、技术风险、流动性风险、特有风险和其他风险。其中特有风险如下：

1、本基金投资品种包含资产支持证券品种，由于资产支持证券一般都针对特定机构投资人发行，且仅在特定机构投资人范围内流通转让，该品种的流动性较差，且抵押资产的流动性较差，因此，持有资产支持证券可能给组合资产净值带来一定的风险。另外，资产支持证券还面临提前偿还和延期支付的风险。本公司将本着谨慎和控制风险的原则进行资产支持证券投资。

2、本基金投资股指期货，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。

3、本基金投资股票期权，股票期权价格主要受到标的资产价格水平、标的资产价格波动率、期权到期时间、市场利率水平等因素的影响。因此，投资股票期权主要存在 Delta 风险、Gamma 风险、Vega 风险、Theta 风险以及 Rho 风险。同时，进行股票期权投资还面临流动性风险、信用风险、操作风险等。

4、本基金投资存托凭证，将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国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。

5、本基金对于每份基金份额设定 6 个月的持有期，投资者持有的基金份额自持有期到期日的下一个工作日起方可提出赎回申请。因此，投资者面临在基金份额持有期内不能赎回基金份额的风险。

#### 6、基金投资其他基金的风险

本基金可投资于其他公开募集证券投资基金，因此本基金所持有的基金的业绩表现、持有基金的基金管理人水平等因素将影响到本基金的业绩表现。

#### 7、基金合同终止的风险

《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 50 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当终止《基金合同》，无须召开基金份额持有人大会。因此基金份额持有人可能面临基金合同终止的风险。

## (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。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见本基金管理人网站 [www.bocifunds.com](http://www.bocifunds.com)（客服热线：956026 / 400-620-8888（免长途话费）选择 6 公募基金业务转人工）：

1. 基金合同、托管协议、招募说明书
2. 本基金季度报告、中期报告和年度报告
3. 基金份额净值
4. 基金销售机构及联系方式