

# 达诚定海双月享 60 天滚动持有短债债券型证券投资基金（C 类份额）

## 基金产品资料概要更新

编制日期：2023 年 9 月 27 日

送出日期：2023 年 9 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    | 达诚定海双月享 60 天滚动持有短债   | 基金代码           | 013964   |
| 下属基金简称  | 达诚定海双月享 60 天滚动持有短债 C | 下属基金交易代码       | 013965   |
| 基金管理人   | 达诚基金管理有限公司           | 基金托管人          | 上海银行股份有限公司   |
| 基金合同生效日 | 2022 年 3 月 22 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    | 其他开放式                | 开放频率           | 每个开放日开放申购，60 天滚动持有，每份基金份额可以在 60 天的滚动运作期到期日就该基金份额提出赎回申请 |
| 基金经理    | 王栋                   | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2022 年 5 月 27 日  |
|         |                      | 证券从业日期         | 2012 年 6 月 25 日  |
| 基金经理    | 陈佶                   | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2022 年 3 月 22 日  |
|         |                      | 证券从业日期         | 2014 年 8 月 14 日  |

### 二、基金投资与净值表现

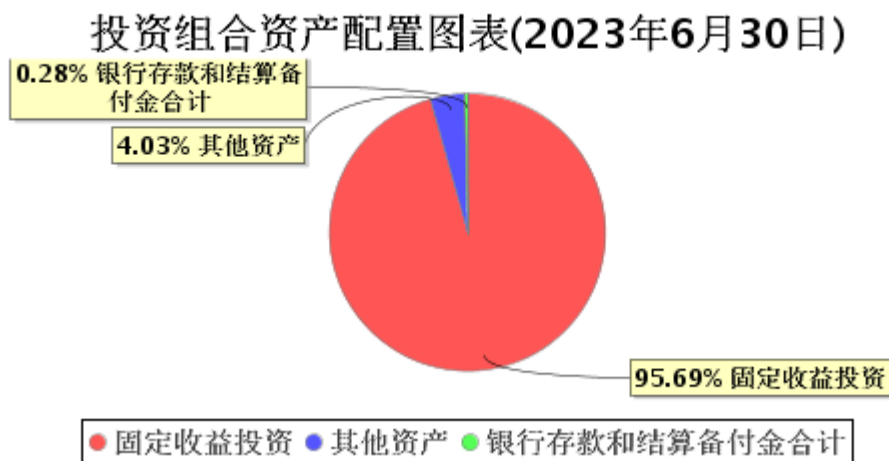
#### (一) 投资目标与投资策略

投资者可阅读本基金《招募说明书》第九部分“基金的投资”了解详情

|      |   |
|------|---|
| 投资目标 | 本基金在控制风险和保持较高流动性的前提下，追求基金资产的稳健增值。   |
| 投资范围 | 本基金的投资范围包括国内依法发行、上市的债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、次级债、企业债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、公司债、政府支持机构债券、可分离交易可转债的纯债部分、证券公司短期公司债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包含协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、国债期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。<br>本基金不投资于股票，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产不低于基金资产的 80%，其 |

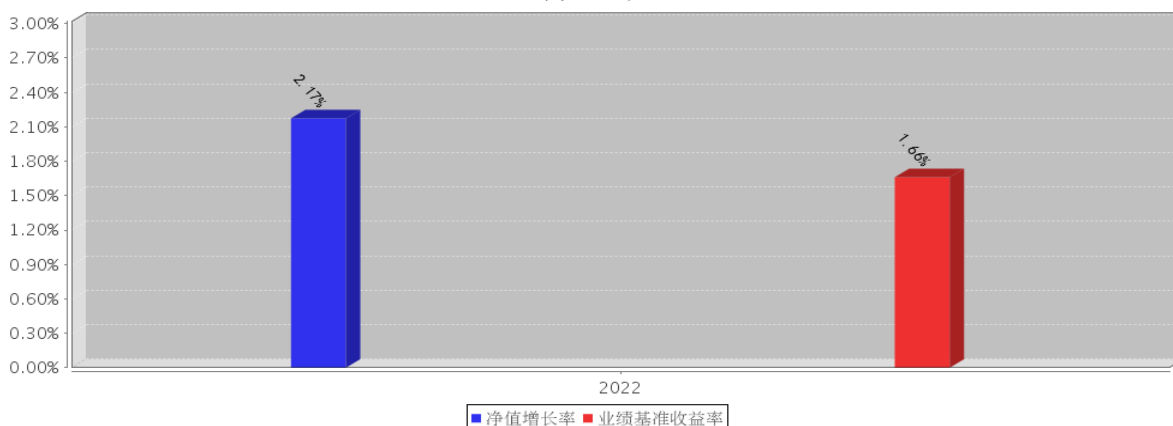
|        |  |
|--------|--|
|        | 中投资于短期债券的比例不低于非现金资产的 80%；每个交易日日终，扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金所指的短期债券是指剩余期限不超过 397 天（含）的债券资产，主要包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、次级债、企业债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、公司债、政府支持机构债券、可分离交易可转债的纯债部分、证券公司短期公司债券等金融工具。其中，剩余期限指距离到期日或回售日的期限，存在回售日的以回售日为准。 |
| 主要投资策略 | 本基金主要投资于短期债券，并控制投资组合久期，力求在承担较低风险和保持组合较好流动性的前提下，实现基金资产的稳健增值。本基金主要投资策略有固定收益类资产投资策略、衍生产品投资策略等。  |
| 业绩比较基准 | 中债综合财富（1 年以下）指数收益率×85%+一年期定期存款基准利率（税后）×15%   |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金和股票型基金。  |

(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/最近十年（孰短）基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

达诚定海双月享60天滚动持有短债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（2022年12月31日）



注：基金的过往业绩不代表未来表现。基金合同生效日为 2022 年 3 月 22 日，合同生效当年不满完整自然年度的，按实际期限计算净值增长率。

### 三、投资本基金涉及的费用

#### （一）基金销售相关费用

无。

#### （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  |
|-------|---|
| 管理费   | 0.30%   |
| 托管费   | 0.05%   |
| 销售服务费 | 0.20%   |
| 其他费用  | 基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；基金合同生效后与基金相关的会计师费、审计费、律师费、公证费、诉讼费和仲裁费等费用；基金份额持有人大会费用；基金的证券、期货交易费用；基金的银行汇划费用；基金的开户费用、账户维护费用；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及招募说明书或其更新。 |

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。

### 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。投资本基金的主要风险有：市场风险、信用风险、流动性风险、管理风险、操作风险、合规性风险、启用侧袋机制的风险、本基金特有的风险、基金管理人职责终止风险及其他风险。此外，建议重点关注本基金特有风险如下：

1、本基金为债券型基金，本基金投资于债券资产不低于基金资产的 80%，其中投资于短期债券的比例不低于非现金资产的 80%；每个交易日日终，扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。因此，本基金需要承担由于市场利率波动造成的利率风险以及信用债的发债主体信用恶化造成的信用风险。

2、由于本基金特殊运作方式的安排，投资者的单笔认购/申购存在 60 天的滚动锁定期，因而对于同一时点申购的资金将极有可能面临集中赎回的情形，由此将有可能触发本基金的巨额赎回机制。在发生巨额赎回时，如果基金资产变现能力差，可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险。针对本基金特殊安排有可能带来的流动性风险，基金管理人将采取相应的风险管理措施：1）本基金申购资金的持有期限可以合理预测和估计，可根据资金的属性配置相应久期的债券资产；2）本基金触发巨额赎回情形下流动性风险时，基金管理人将依据基金合同约定的相应风险管理措施应对此类流动性风险。以上所述因素可能会给本基金投资带来特殊交易风险。

3、国债期货投资风险。本基金的投资范围包括国债期货，国债期货的投资可能面临市场风险、基差风险、流动性风险。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了或结头寸的风险，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。

4、资产支持证券投资风险。本基金投资资产支持证券，资产支持证券是一种债券性质的金融工具，其

向投资者支付的本息来自于基础资产池产生的现金流或剩余权益。与股票和一般债券不同，资产支持证券不是对某一经营实体的利益要求权，而是对基础资产池所产生的现金流和剩余权益的要求权，是一种以资产信用为支持的证券，所面临的风险主要包括交易结构风险、各种原因导致的基础资产池现金流与对应证券现金流不匹配产生的信用风险、市场交易不活跃导致的流动性风险等，由此可能造成基金财产损失。

5、流通受限证券投资风险。本基金可投资流通受限证券，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值，本基金的基金净值可能由于估值方法的原因偏离所持有证券的收盘价所对应的净值，因此，投资者在申购赎回时，需考虑估值方法对基金净值的影响。另外，本基金可能由于投资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。

6、特殊安排的运作方式。每个运作期到期日前，基金份额持有人不能提出赎回申请。每个运作期到期日，基金份额持有人方可提出赎回申请。如果基金份额持有人在当期运作期到期日未申请赎回，则自该运作期到期日下一日起该基金份额进入下一个运作期。故投资者在运作期间到期日前无法赎回的风险，以及错过当期运作期到期日未能赎回而进入下一运作期的风险。

7、运作期限或有变化的风险。本基金名称为达诚定海双月享 60 天滚动持有短债债券型证券投资基金，但是考虑到周末、法定节假日等原因，每份基金份额的实际运作期限或有不同，可能长于或短于 60 天。

8、本基金采用证券经纪商交易结算模式，即本基金将通过基金管理人选定的证券经营机构进行场内交易和结算，该种交易结算模式可能存在操作风险、资金使用效率降低的风险、交易结算风险、投资信息安全保密风险、无法完成当日估值等风险。

9、本基金的份额登记、估值核算等业务由基金管理人委托的基金服务机构负责日常运营。为本基金提供运营外包服务的机构已获得中国证监会的认可，同时，基金管理人将持续评估该机构的人员配备情况、业务操作的专业能力、业务隔离措施、软硬件设施等是否能够满足本基金的运作需要。虽然具有以上基础，但是基金管理人仍然无法保证委托的基金服务机构可以永久符合监管部门的法律法规，如在基金存续期内该机构出现违法违规、操作风险事件或无法继续存续等情况，可能会对本基金的正常运作产生不利影响。

## （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。

与本基金/基金合同相关的争议解决方式为仲裁。因本基金产生的或与基金合同有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方有权根据基金合同的约定提交至仲裁机构进行仲裁。具体仲裁机构和仲裁地点详见本基金合同的具体约定。

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

以下资料详见基金管理人网站[[www.integrity-funds.com](http://www.integrity-funds.com)]咨询电话[021-60581258]

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

## 六、其他情况说明

无。