

东海海鑫双悦 3 个月持有期债券型证券投资基金（东海海鑫双悦 3 个月持有债券 C 份额）

基金产品资料概要

编制日期：2025 年 5 月 6 日

送出日期：2025 年 5 月 12 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    | 东海海鑫双悦 3 个月持有债券   | 基金代码           | 023707                                          |
| 下属基金简称  | 东海海鑫双悦 3 个月持有债券 C | 下属基金交易代码       | 023708                                          |
| 基金管理人   | 东海基金管理有限责任公司      | 基金托管人          | 中国工商银行股份有限公司                                    |
| 基金合同生效日 | 2025 年 05 月 12 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，每份基金份额设置 3 个月最短持有期，最短持有期到期日（含该日）起开放赎回 |
| 基金经理    | 张浩硕               | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2025 年 5 月 12 日                                 |
|         |                   | 证券从业日期         | 2016 年 10 月 22 日                                |

注：东海海鑫双悦 3 个月持有债券型证券投资基金由东海证券海鑫双悦 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划转型而来。

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

具体请查阅本基金的《东海海鑫双悦 3 个月持有期债券型证券投资基金招募说明书》第十部分“基金的投资”了解详细情况。

|      |                                                                                                                                                                                             |
|------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 本基金主要投资于债券资产，在控制基金资产净值波动的基础上，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。                                                                                                                                             |
| 投资范围 | 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（含国债、央行票据、金融债、地方政府债、政府支持机构债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、可转换债券、可交换债券）、资产支持证券、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、债券回购、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 |

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>国证监会相关规定）。</p> <p>本基金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，因持有可转换债券转股和可交换债券换股形成的股票应在其可交易之日起的 10 个交易日内卖出。</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：</p> <p>本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%。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，本基金持有现金或者到期日在 1 年以内的政府债券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。</p> <p>若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许，本基金管理人在履行适当程序后，可对上述资产配置比例进行调整。</p> |
| 主要投资策略 | <p>本基金的主要投资策略包括：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、买入持有策略；</li> <li>2、久期调整策略</li> <li>3、收益率曲线配置策略</li> <li>4、板块轮换策略</li> <li>5、骑乘策略</li> <li>6、个券选择策略</li> <li>7、信用债券投资策略</li> <li>8、可转换债券、可交换债券投资策略</li> <li>9、国债期货投资策略</li> <li>10、融资杠杆策略</li> <li>11、资产支持证券投资策略</li> </ol>                                                                                  |
| 业绩比较基准 | 中债综合全价(总值)指数收益率*80%+一年期定期存款利率(税后)*20%                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，理论上其预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |

### 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用                                                                                                                                                                                                               |         |    |
| 赎回费          | <p>本基金对每份基金份额设置 3 个月的最短持有期，每份基金份额自最短持有期到期日（含该日）起，投资者可以提出赎回申请，不收取赎回费用。</p> <p>对于持有原东海证券双月盈集合资产管理计划份额和/或东海证券海鑫双悦 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划份额转型后变更为本基金相应类别的基金份额，其持有期自原东海证券双月盈集合资产管理计划和/或东海证券海鑫双悦 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划的集合计划份额确认之日起连续计算。</p> |         |    |

#### (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 | 0.30%                                                                                                                                                               | 销售机构       |
| 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、律师费、诉讼费和仲裁费；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；基金的开户费用及账户维护费用；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。详见本基金《招募说明书》“基金的费用与税收”章节。 |            |

注：上表中年度费用金额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。本基金交易证券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。

本基金在投资运作过程中可能面临各种风险，包括市场风险、管理风险、流动性风险、操作或技术风险、合规性风险、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险、其它风险及本基金的特定风险等。

本基金的特定风险包括如下内容：

（1）本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%。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）本基金对每份基金份额，设定 3 个月的最短持有期限，对投资者存在流动性风险。在最短持有期内不得办理赎回或转换转出业务，最短持有期届满后方可提出赎回申请。因此，基金份额持有人面临在最短持有期内不能赎回基金份额的风险。请投资者合理安排资金进行投资。

（3）若本基金发生了巨额赎回，基金管理人有可能采取部分延期赎回的措施以应对巨额赎回，因此在巨额赎回情形发生时，基金份额持有人存在不能及时获得赎回款项的风险。

#### （4）国债期货的投资风险

本基金可投资于国债期货，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。

#### （5）资产支持证券的投资风险

本基金可投资资产支持证券，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。

#### （6）流通受限证券的风险

本基金可投流通受限证券，因此本基金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。

具体风险请查阅本基金《招募说明书》第十八部分“风险揭示”的具体内容。

## （二）重要提示

中国证监会对原集合计划变更为东海证券海鑫双悦 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划的批准、东海证券海鑫双悦 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划的变更注册，并不表明其对本基金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本基金财产，但不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资者自依据《基金合同》取得基金份额，即成为本基金基金份额持有人和《基金合同》的当事人。

《基金合同》生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在规定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见东海基金管理有限责任公司官方网站 [<https://www.donghaifunds.com>] [客服电话：40095 95531]

《东海海鑫双悦 3 个月持有期债券型证券投资基金基金合同》

《东海海鑫双悦 3 个月持有期债券型证券投资基金托管协议》

《东海海鑫双悦 3 个月持有期债券型证券投资基金招募说明书》

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。