

东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)

基金产品资料概要更新

编制日期：2024 年 10 月 29 日

送出日期：2024 年 10 月 30 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 | 东海祥龙混合 (LOF) | 基金代码 | 168301 |
| 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 | 2016 年 12 月 21 日 | 上市交易所及上市日期 | 深圳证券交易所 2017 年 2 月 27 日 |
| 基金类型 | 混合型 | 交易币种 | 人民币 |
| 运作方式 | 上市契约开放式 (LOF) | 开放频率 | 每个开放日 |
| 基金经理 | 张立新 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2024 年 8 月 21 日 |
| | | 证券从业日期 | 2015 年 10 月 3 日 |
| 其他 | 本基金场内简称为“东海祥龙 LOF”。《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 万元的，基金管理人应当在定期报告中予以披露。连续 60 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，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。法律法规另有规定时，从其规定。 | | |

二、基金投资与净值表现

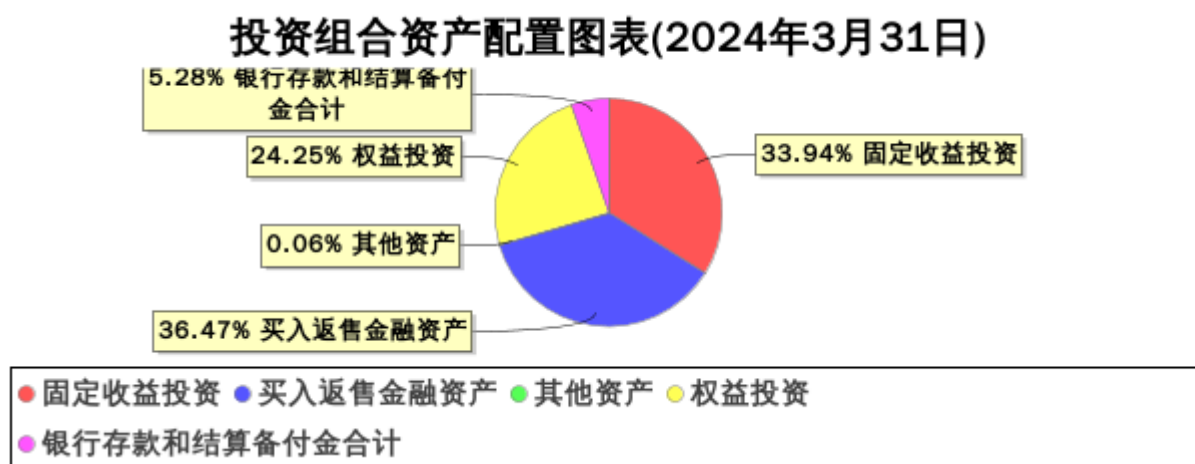
(一) 投资目标与投资策略

(投资者阅读《招募说明书》第十章了解详细情况)

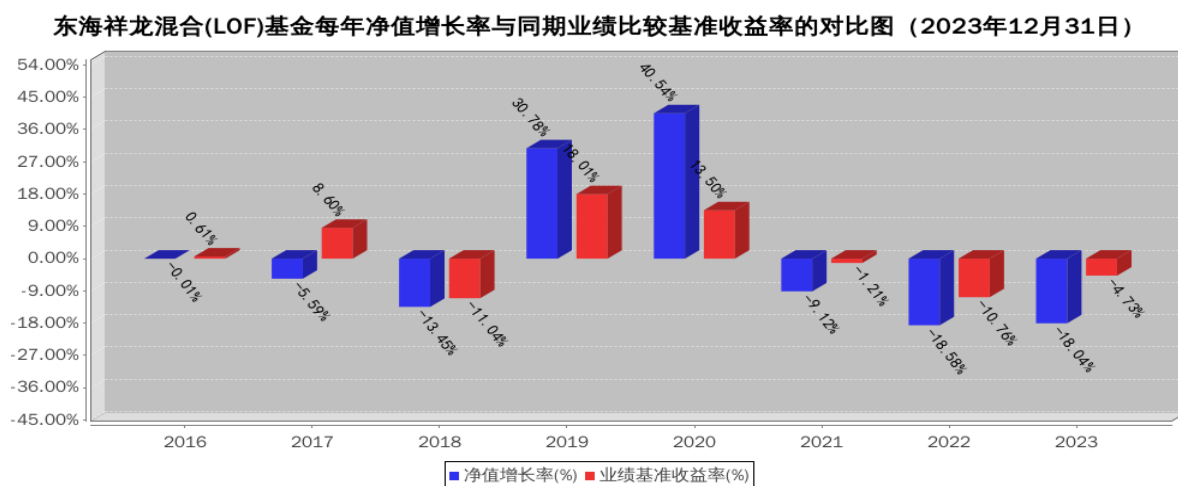
| | |
|------|---|
| 投资目标 | 本基金将在严格控制风险的前提下，充分挖掘和利用市场中潜在的投资机会，力争实现基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资范围 | <p>本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、中小企业私募债、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、次级债）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。</p> <p>如果法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围。</p> <p>基金的投资组合比例为：封闭期内，股票资产占基金资产的比例范围为 0%-100%，</p> |

| | |
|--------|--|
| | 非公开发行股票资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；转换为上市开放式基金（LOF）后，股票资产占基金资产的比例范围为 0%-95%，每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券投资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、存出保证金和应收申购款等。 |
| 主要投资策略 | 本基金投资策略主要包括：1、类别资产配置策略；2、股票投资策略；3、股指期货投资策略；4、国债期货投资策略；5、债券投资策略；6、权证投资策略；7、资产支持证券投资策略；8、中小企业私募债券投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50% |
| 风险收益特征 | 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、债券型基金，低于股票型基金，属于中高预期风险、中高预期收益的基金品种。 |

(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对比图



注：本基金合同于 2016 年 12 月 21 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。业绩表现截止日期 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) /持有期限(N) | 收费方式/费率 | 备注 |
|--------------|---------------------------|-----------|------|
| 申购费 (前收费) | M < 1000000 元 | 1.5% | - |
| | 1000000 元 ≤ M < 5000000 元 | 0.6% | - |
| | M ≥ 5000000 元 | 1,000 元/笔 | - |
| 赎回费 | N < 7 日 | 1.5% | 场外份额 |
| | 7 日 ≤ N < 30 日 | 0.75% | 场外份额 |
| | 30 日 ≤ N < 365 日 | 0.5% | 场外份额 |
| | 365 日 ≤ N < 730 日 | 0.25% | 场外份额 |
| | N ≤ 730 日 | 0% | 场外份额 |
| | N < 7 日 | 1.5% | 场内份额 |
| | N ≥ 7 日 | 0.5% | 场内份额 |

注：本基金在场内和场外的申购费率相同。场内交易费用以证券公司实际收取为准。

(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 | 0.5% | 基金管理人和销售机构 |
| 托管费 | 0.1% | 基金托管人 |
| 审计费用 | 16,000.00 元 | 会计师事务所 |
| 信息披露费 | 0.00 元 | 规定披露报刊 |
| 其他费用 | 详见招募说明书的基金费用与税收章节 | |

注：上表中年费用金额为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年费用金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

(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） |
|------|--------------|
| 持有期间 | 0.62% |

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。

1、本基金的特有风险

(1) 流动性风险

基金合同生效后,在封闭期内不开放申购、赎回业务。因此,在封闭期内,基金份额持有人将面临因不能赎回基金份额而出现的流动性约束。

(2) 折价风险

在本基金封闭期内,持有人只能通过证券市场二级市场交易卖出基金份额变现。在证券市场持续下跌、基金二级市场交易不活跃等情形下,有可能出现基金份额二级市场交易价格低于基金份额净值的情形,即基金折价交易,从而影响持有人收益或产生损失。

(3) 投资定向增发股票风险

在本基金封闭期内,本基金以参与投资定向增发股票为主要投资目标,公募基金参与定向增发,如果估值日非公开发行有明确锁定期的股票的初始取得成本低于在证券交易所上市交易的同一股票的市价,将按照监管机构或行业协会有关规定确定股票公允价值,本基金基金净值可能由于估值方法的原因偏离所持有股票的收盘价所对应的净值,投资者在二级市场交易或受限申购赎回时,需考虑该估值方式对基金净值的影响。

(4) 基金投资中小企业私募债券的风险

本基金可投资中小企业私募债券,中小企业私募债券是指中小微型企业在中国境内以非公开方式发行和转让,约定在一定期限还本付息的公司债券,其发行人是非上市中小微企业,发行方式为面向特定对象的私募发行。因此,中小企业私募债券较传统企业债的信用风险及流动性风险更大,从而增加了本基金整体的债券投资风险。

(5) 基金投资股指期货、国债期货的风险

投资于股指期货、国债期货需承受市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险和法律风险等。

(6) 基金投资资产支持证券的风险

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。资产支持证券存在信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、操作风险和法律风险等。

2、开放式基金共有的风险,如市场风险、管理风险、流动性风险、信用风险、操作风险、合规风险、其他风险等。

(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

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

《东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》、

《东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金(LOF)托管协议》、

《东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金(LOF)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