

# 新华双利债券型证券投资基金（新华双利债券A）基金产品资料概要（更新）

编制日期：2021年1月7日

送出日期：2021年1月8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    | 新华双利债券       | 基金代码           | 002765       |
| 下属基金简称  | 新华双利债券 A     | 下属基金代码         | 002765       |
| 基金管理人   | 新华基金管理股份有限公司 | 基金托管人          | 中国建设银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | 2016-07-13   |                |              |
| 基金类型    | 债券型          | 交易币种           | 人民币          |
| 运作方式    | 普通开放式        | 开放频率           | 每个开放日        |
| 基金经理    | 曹巍浩          | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2020-12-08   |
|         |              | 证券从业日期         | 2007-07-09   |
|         | 王丹           | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2020-12-08   |
|         |              | 证券从业日期         | 2010-07-01   |

## 二、基金投资与净值表现

### （一）投资目标与投资策略

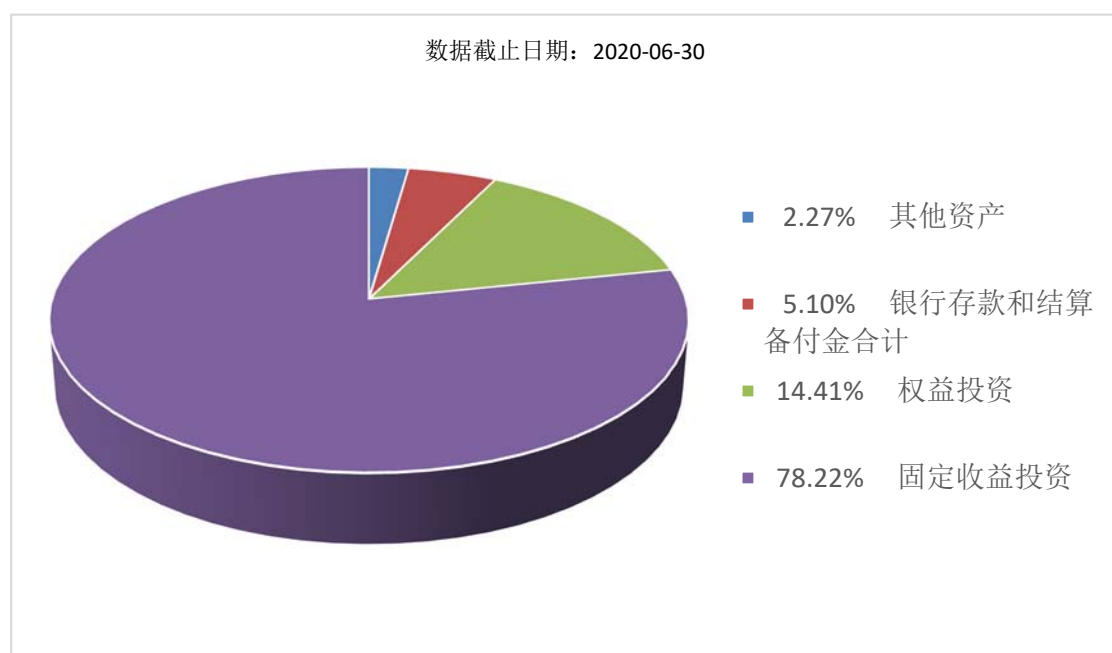
投资者可阅读《招募说明书》第九章了解详细情况。

|      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 在严格控制投资风险并保持较高资产流动性的前提下，通过配置债券等固定收益类金融工具，追求基金资产的长期稳定增值，通过适量投资权益类资产力争获取增强型回报。                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 投资范围 | <p>本基金的投资对象为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、权证、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、中小企业私募债、短期融资券、资产支持证券、债券回购等）、货币市场工具（包括银行存款、大额存单等）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：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%，持有现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申</p> |

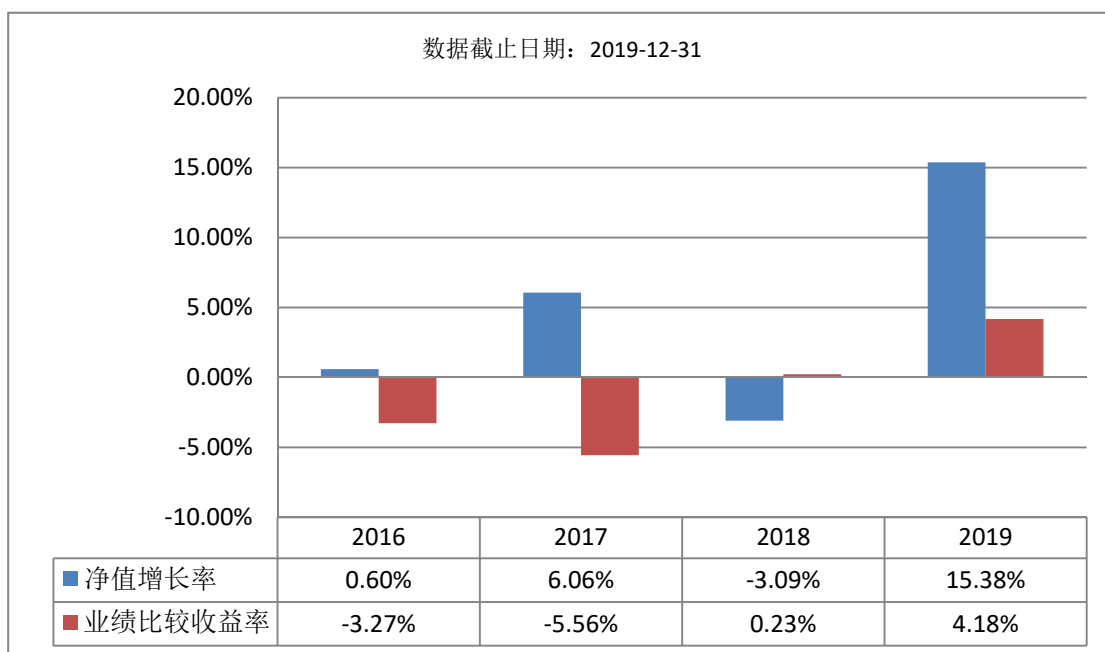
|        |                                                                                                                                                                                                                                    |
|--------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | 购款等)或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;对股票(含存托凭证)、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的20%,其中,权证投资占基金资产净值的比例为0-3%。                                                                                                                                         |
| 主要投资策略 | 本基金的投资策略主要包括:大类资产配置策略、固定收益类资产投资策略以及权益类资产投资策略。首先,本基金管理人将采用战略性与战术性相结合的大类资产配置策略,在基金合同规定的投资比例范围内确定各大类资产的配置比例。在此基础上,一方面综合运用久期策略、收益率曲线策略以及信用策略进行固定收益类资产投资组合的构建;另一方面采用自下而上的个股精选策略,精选具有持续成长性且估值相对合理,同时股价具有趋势向上的股票构建权益类资产投资组合,以提高基金的整体收益水平。 |
| 业绩比较基准 | 中债企业债总全价指数收益率×60%+中债国债总全价指数收益率×30%+沪深300指数收益率×10%                                                                                                                                                                                  |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金,预期收益和风险水平低于混合型基金、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

投资组合资产配置图表



## (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



注：1、本基金于 2016 年 7 月 13 日成立，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。

2、基金的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（前收费） | M < 50 万元               | 0.80%    |    |
|          | 50 万元 ≤ M < 200 万元      | 0.50%    |    |
|          | 200 万元 ≤ M < 500 万元     | 0.30%    |    |
|          | M ≥ 500 万元              | 1000 元/笔 |    |
| 赎回费      | N < 7 天                 | 1.50%    |    |
|          | 7 天 ≤ N < 30 天          | 0.75%    |    |
|          | 30 天 ≤ N < 365 天        | 0.10%    |    |
|          | 365 天 ≤ N < 730 天       | 0.05%    |    |
|          | N ≥ 730 天               | 0.00%    |    |

#### （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  | 0.70%    |
| 托管费  | 0.20%    |

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。

#### 1、本基金的主要风险

本基金的主要风险包括：市场风险、流动性风险、现金储备管理风险、信用风险、交易对手违约风险、管理风险、本基金的特有风险、资产配置风险、不可抗力风险及其他风险。

#### 2、本基金的特有风险

根据本基金投资范围的规定，本基金投资于债券的资产占基金资产比例不低于 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发债主体特别是公司债、企业债的发债主体的信用质量变化造成的信用风险，以及无法偿债造成的信用违约风险；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。

本基金投资于可转换债券品种，可转换债券的条款相对于普通债券和股票而言更为复杂，对这些条款研究不足导致的事件可能为本基金带来损失。例如，当可转换债券的价格明显高于其赎回价格时，若本基金未能在可转换债券被赎回前转股或卖出，则可能产生不必要的损失。

本基金投资中小企业私募债券，中小企业私募债是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。由于不能公开交易，一般情况下，交易不活跃，潜在较大流动性风险。外部评级机构一般不对这类债券进行外部评级，可能也会降低市场对该类债券的认可度，从而影响该类债券的市场流动性。同时由于债券发行主体的资产规模较小、经营的波动性较大，且各类材料不公开发布，也大大提高了分析并跟踪发债主体信用基本面的难度。当发债主体信用质量恶化时，受市场流动性所限，本基金可能无法卖出所持有的中小企业私募债，由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还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。

### (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

以下资料详见基金管理人网站[www.ncfund.com.cn][4008198866]

- 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。