

# 富国汇诚 18 个月封闭式债券型证券投资基金（C 类份额）基金产品 资料概要更新

2024 年 06 月 06 日（信息截至：2024 年 06 月 05 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	富国汇诚 18 个月封闭式债券	基金代码	017803
份额简称	富国汇诚 18 个月封闭式债券 C	份额代码	017804
基金管理人	富国基金管理有限公司	基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
基金合同生效日	2023 年 02 月 28 日	基金类型	债券型
运作方式	封闭式	开放频率	不开放
交易币种	人民币		
基金经理	张洋	任职日期	2023 年 02 月 28 日
		证券从业日期	2011 年 08 月 01 日

## 二、基金投资与净值表现

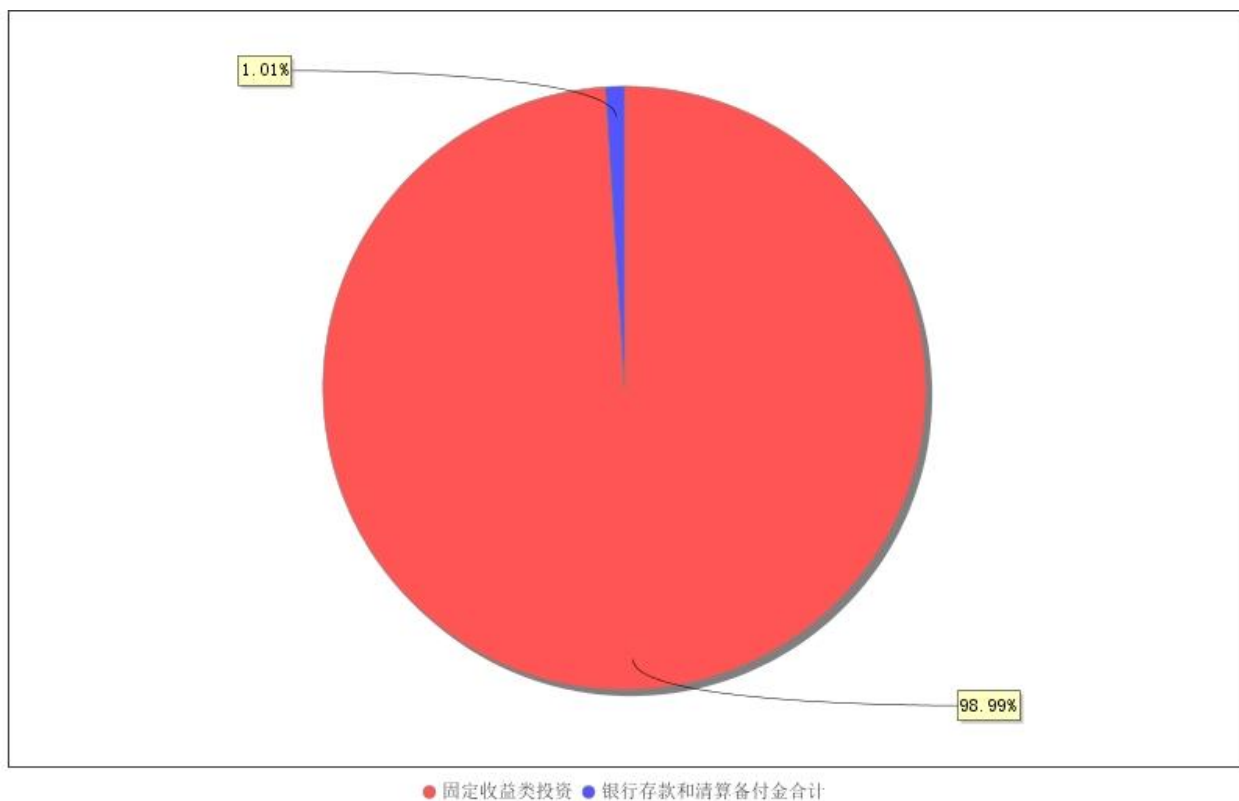
### （一）投资目标与投资策略

投资目标	本基金在严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为基金份额持有人创造高于业绩比较基准的投资收益。
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、地方政府债券、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转换债券、可交换债券、短期融资券（含超短期融资券）、政府支持债券、政府支持机构债券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、现金等货币市场工具、信用衍生品、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固定收益类金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金不直接从二级市场买入股票，但可持有因可转换债券转股所形成的股票。因上述原因持有的股票，本基金将在其可交易之日的 10 个交易日内卖出。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。本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%，存续期到期日前 3 个月内不受此比例限制；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，本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金等。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。
主要投资策略	本基金投资策略分为两部分，一部分为买入拟持有至到期类资产，另一部分为买入交易性资产；其中持有至到期类资产，即采用摊余成本法估值的债券资产不低于基金净资产的 50%；对于买入交易性资产，即采用市价法估值的债券资产不低于基金净资产的 20%。本基金基金合同生效后 3 个月为建仓期，力争在建仓期结束前达到上述资产投资比例目标。如因基金资产价格波动等原因导致摊余成本法估值和市价法估值的债券资产被动不符合上述规定投资比例的，应在 1 个月内调整至符合比例要求，本基金存续期到期日前 2 个月内不受上述比例限

	制。本基金的投资标的根据持有目的的不同，分为持有至到期类资产和交易性资产。对于“以持有到期为目的”的债券资产，采用持有至到期投资策略，以摊余成本法计量；对于“以交易型为目的”的固定收益类资产，采用交易性资产投资策略，以公允价值计量且其变动计入当期损益。此外，本基金在债券的投资中主要基于对国家财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪，采用久期控制下的主动性投资策略，主要包括：久期控制、期限结构配置、信用风险控制、跨市场套利和相对价值判断等管理手段，对债券市场、债券收益率曲线以及各种债券价格的变化进行预测，相机而动、积极调整。本基金的子单元管理、动态收益增强策略、国债期货投资策略和信用衍生品投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率×90%+1年期定期存款利率（税后）×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，在通常情况下其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金，低于股票型基金和混合型基金。

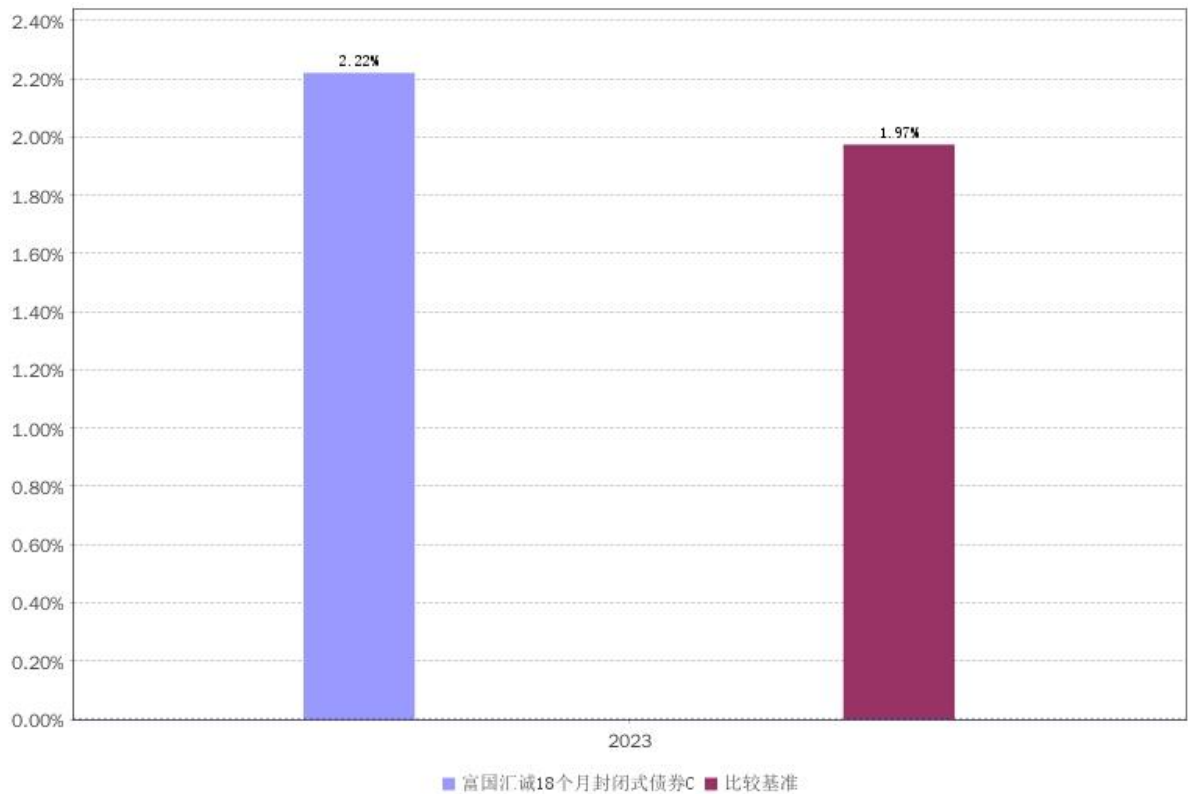
注：详情请阅读《招募说明书》中“基金的投资”章节的相关内容。

## （二）投资组合资产配置图表



注：截止日期 2024 年 03 月 31 日。

## （三）自基金合同生效以来基金（C 份额）每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图



注：本基金合同生效日 2023 年 02 月 28 日。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

注：本基金在存续期内封闭运作，不办理申购与赎回等业务（由于基金存续期到期自动赎回的除外）。

#### （二）基金运作相关费用

费用类别	年费率/收费方式	收取方
管理费	0.30%	基金管理人、销售机构
托管费	0.05%	基金托管人
销售服务费	0.20%	销售机构
审计费用	20,000.00 元/年	会计师事务所
信息披露费	120,000.00 元/年	规定披露报刊

注：以上费用将从基金资产中扣除；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。审计费用、信息披露费为基金整体承担的年费用金额，非单个份额类别费用。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。除上述费用外的其他运作费用，详见《招募说明书》中的“基金费用与税收”章节。

#### （三）基金运作综合费用测算

基金运作综合费率（年化）
0.55%

注：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上表所示。基金管理费率、托管费率、销售服务费率均为基金现行费率，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。

本基金投资中的风险包括：证券市场整体环境引发的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，暴跌导致的流动性风险，基金投资过程中产生的操作风险，因交收违约和投资债券引发的信用风险，基金投资对象与投资策略引致的特有风险等等。

本基金的特定风险包括：

#### 1、封闭式运作风险

本基金采用封闭式运作，基金存续期为 18 个月，即自基金合同生效日起至基金合同生效日所对应的 18 个月月度对日止。除基金合同另有约定外，本基金在存续期内不办理申购与赎回等业务，也不上市交易。因此，在存续期内，基金份额持有人将面临因不能赎回或卖出基金份额而出现的流动性约束。

#### 2、摊余成本法的估值风险

本基金采用摊余成本法和市价法相结合的混合估值原则对本基金进行估值。基金管理人采用摊余成本法进行估值过程中存在一定的特定风险，包括但不限于：

（1）使用摊余成本法估值不等同于保本，本基金采用摊余成本法估值的基金资产在极端情况下仍然存在计提减值准备可能导致基金份额净值下跌的风险。

（2）本基金采用摊余成本法估值的基金资产采用买入并持有到期策略，可能损失一定的交易收益。

#### 3、延期清算的风险

本基金将于存续期到期日将全部基金份额持有人所持有的基金份额自动赎回。如因市场成交量不足、暂停交易、缺乏交易对手、持有债券的信用状况急剧恶化等原因导致基金资产无法变现或者无法以合理价格变现，基金管理人将已变现的基金财产按持有人持有的基金份额比例分配。基金资产无法变现或者无法以合理价格变现的，管理人将于特殊情形消除后尽快完成变现，并在完成变现后进行二次或多次清算。因此投资者面临延期清算的风险。

#### 4、国债期货投资风险

本基金可投资国债期货，若投资国债期货可能面临市场风险、基差风险、流动性风险。

#### 5、资产支持证券投资风险

本基金可投资资产支持证券，若投资存在一定的流动性风险、违约风险、信用风险、现金流预测风险、操作风险。

#### 6、信用衍生品投资风险

为对冲信用风险，本基金可能投资于信用衍生品，若投资信用衍生品可能面临流动性风险、偿付风险以及价格波动风险等。

### （二） 重要提示

中国证监会对本基金募集的注册/核准，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。

与本基金或基金合同相关的一切争议将提交位于上海的上海国际经济贸易仲裁委员会仲裁，仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

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、定期公告等披

露文件。

## 五、 其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站([www.fullgoal.com.cn](http://www.fullgoal.com.cn)), 客户服务热线: 95105686, 4008880688  
(全国统一, 免长途话费)

1. 基金合同、托管协议、招募说明书
2. 定期报告, 包括基金季度报告、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
5. 其他重要资料