

东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金

基金产品资料概要（更新）

编制日期：2024年6月19日

送出日期：2024年6月20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 | 东吴鼎泰纯债债券 | 基金代码 | 006026 |
| 下属基金简称 | 东吴鼎泰纯债债券A | | 东吴鼎泰纯债债券C |
| 下属基金代码 | 006026 | | 014570 |
| 下属前端交易代码 | - | | - |
| 下属后端交易代码 | - | | - |
| 基金管理人 | 东吴基金管理有限公司 | 基金托管人 | 中国光大银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | 2018-11-02 | 上市交易所及上市日期 | 暂未上市 - |
| 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 | 杜澄楷 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2023-10-26 |
| | | 证券从业日期 | 2008-08-01 |
| | | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2022-05-09 |
| | 邵笛 | 证券从业日期 | 2006-10-01 |

注：东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金自2021年12月20日起增设C类基金份额。

二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

请投资者阅读《招募说明书》第九章了解详细情况

| | |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金在严格控制风险的基础上，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。 |
| 投资范围 | 本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单及其他货币市场工具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的相关规定）。 本基金不投资于股票、权证，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，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。

基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的 80%；本基金保持不低于基金资产净值的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。

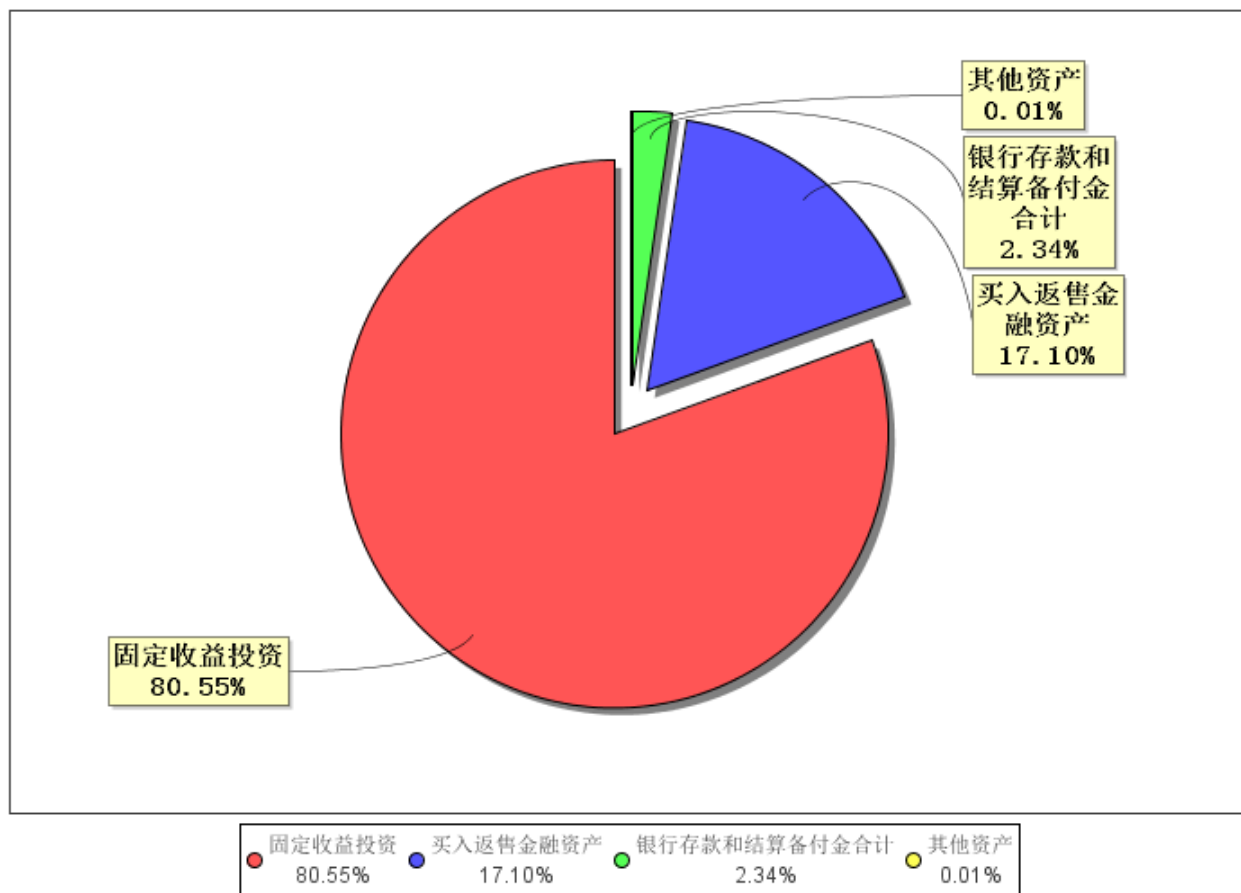
主要投资策略 本基金在对宏观经济和债券市场综合研判的基础上，通过自上而下的宏观分析和自下而上的个券研究，使用主动管理、数量投资和组合投资的投资手段，追求基金资产长期稳健的增值。

业绩比较基准 中国债券综合财富指数收益率

风险收益特征 本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金中具有中低风险收益特征的品种。

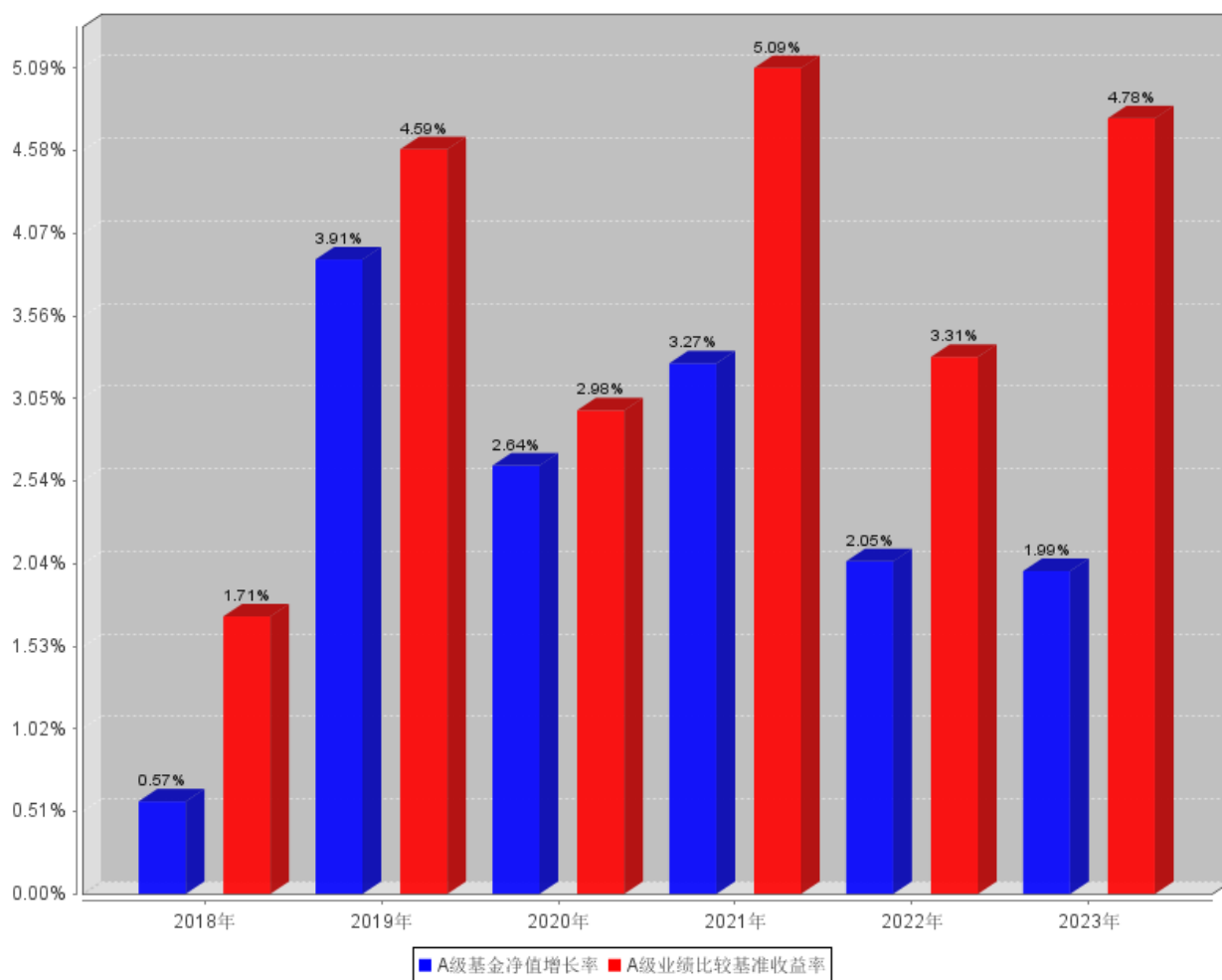
（二）投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表
数据截止日期：2023年12月31日

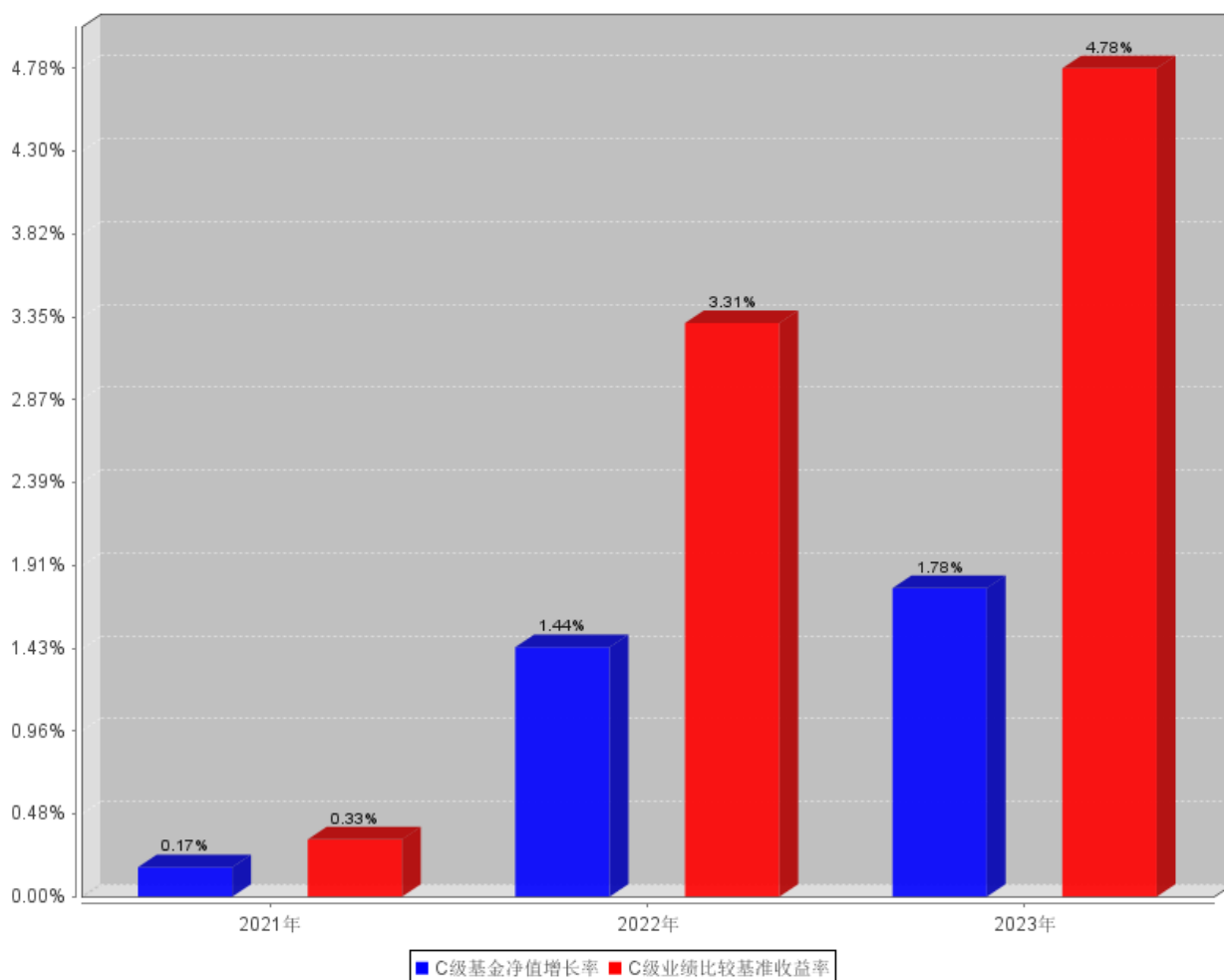


（三）自基金合同生效以来/最近十年（孰短）基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

A级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



C级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



1. 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。
2. 业绩比较基准=中国债券综合财富指数收益率。
3. 本基金于2021年12月20日开始分为A、C两类。
4. 本基金C类份额在2021年12月23日前无有效份额，故该份额的净值增长率与同期业绩比较基准收益率均于2021年12月23日起计算。

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：

东吴鼎泰纯债债券 A

| 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<5,000,000 | 0.5% | - |
| | M≥5,000,000 | 1000元/笔 | - |
| 赎回费 | N<7日 | 1.5% | - |
| | 7日≤N<90日 | 0.1% | - |
| | N≥90日 | 0% | - |

东吴鼎泰纯债债券 C

| 费用类型 | 份额 (S) 或金额 (M) / 持有期限 (N) | 收费方式/费率 | 备注 |
|------|---------------------------|---------|----|
| 赎回费 | N<7日 | 1.5% | - |
| | N≥7日 | 0% | - |

（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 | 年费率0.3% | 基金管理人和销售机构 |
| 托管费 | 年费率0.1% | 基金托管人 |
| 销售服务费 | 东吴鼎泰纯债债券A - 东吴鼎泰纯债债券C 年费率0.2% | 销售机构 |
| 审计费用 | 年费用金额27000.00元 | 会计师事务所 |
| 信息披露费 | - | 规定披露报刊 |
| 其他费用 | 费用的计算方法及支付方式详见 招募说明书及相关公告 | - |

注：（1）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。

（2）审计费用、信息披露费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。

（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：

东吴鼎泰纯债债券 A

| | 基金运作综合费率（年化） |
|---|--------------|
| - | 0.48% |

东吴鼎泰纯债债券 C

| | 基金运作综合费率（年化） |
|---|--------------|
| - | 0.68% |

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。

本基金主要风险包括市场风险、管理风险、流动性风险、合规性风险、投资管理风险及其他风险等。本基金特有风险如下：

（1）特定投资对象的风险

本基金为债券型基金，对债券类资产的投资比例不低于基金资产的80%，本基金需承担债券市场的系统性风险，以及因个别债券违约所形成的信用风险。

（2）投资债券回购的风险

债券回购为提升整体基金组合收益提供了可能，但也存在一定的风险。债券回购的主要风险包括信用风险、投资风险及波动性加大的风险，其中，信用风险指回购交易中交易对手在回购到期时，不能偿还全部或部分证券或价款，造成基金净值损失的风险；投资风险是指在进行回购操作时，回购利率大于债券投资收益而导致的风险以及由于回购操作导致投资总量放大，致使整个组合风险放大的风险；而波动性加大的风险是指在进行回购操作时，在对基金组合收益进行放大的同时，也对基金组合的波动性（标准差）进行了放大，即基金组合的风险将会加大。回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对基金净值造成损失的可能性也就越大。

（3）投资资产支持证券的风险

资产支持证券的投资风险主要包括流动性风险、利率风险及评级风险等。由于资产支持证券的投资收益来自于基础资产产生的现金流或剩余权益，因此资产支持证券投资还面临基础资产特定原始权益人的破产风险及现金流预测风险等与基础资产相关的风险。

（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。

本基金的争议解决处理方式为仲裁。具体仲裁机构和仲裁地点详见本基金合同的具体约定。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[网址：www.scfund.com.cn][客服电话：400-821-0588]

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