

# 长盛中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金（长盛中债 1-3 年政金债 A 份额）

## 基金产品资料概要（更新）

编制日期：2021 年 5 月 12 日

送出日期：2021 年 5 月 13 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    | 长盛中债1-3年政金债                                                                                                         | 基金代码           | 008679       |
| 下属基金简称  | 长盛中债1-3年政金债A                                                                                                        | 下属基金代码         | 008679       |
| 基金管理人   | 长盛基金管理有限公司                                                                                                          | 基金托管人          | 中国工商银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | 2020-06-19                                                                                                          | 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    | 普通开放式                                                                                                               | 开放频率           | 每个开放日        |
| 基金经理    | 王赛飞                                                                                                                 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2020-06-19   |
|         |                                                                                                                     | 证券从业日期         | 2012-07-02   |
| 其他      | 《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5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续50个工作日出现上述情形的，直接终止《基金合同》，且无需召开基金份额持有人大会。 |                |              |

### 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 | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，本基金力争追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差控制在 4%以内。                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 投资范围 | <p>本基金的标的指数是中债 1-3 年政策性金融债指数。</p> <p>本基金主要投资于标的指数成份债券和备选成份债券。为更好地实现基金的投资目标，本基金少量投资于其他债券（含国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、央行票据、中期票据、短期融资券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具及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：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，其中投资于待偿期1年-3年（包含1年和3年）的指数成分券及其备选成分券的比例不低于</p> |

本基金非现金资产的80%；每个交易日日终，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，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

##### 1、完全复制策略

本基金主要采取完全复制法构建基金债券投资组合，并根据标的指数成份债券及其权重的变动而进行相应的调整。

##### 2、替代性策略

当成份债券市场流动性不足或因法规规定本基金不能投资关联方债券等情况导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将通过投资备选成份债券为主，并辅以非成份债券等金融工具来构建替代组合进行跟踪复制。

在正常市场情况下，基金管理人力争本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

#### 业绩比较基准

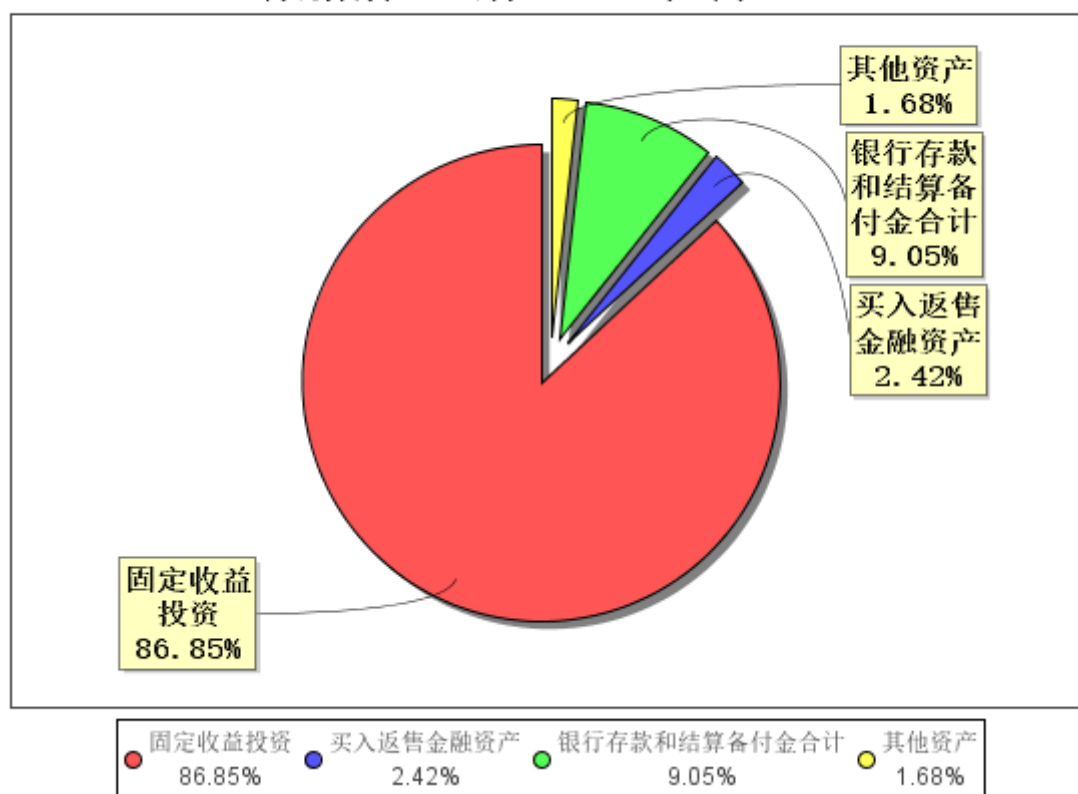
中债 1-3 年政策性金融债指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后) ×5%

#### 风险收益特征

本基金属于债券型基金，其预期的收益与风险低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数以及标的指数所代表的债券市场相似的风险收益特征。

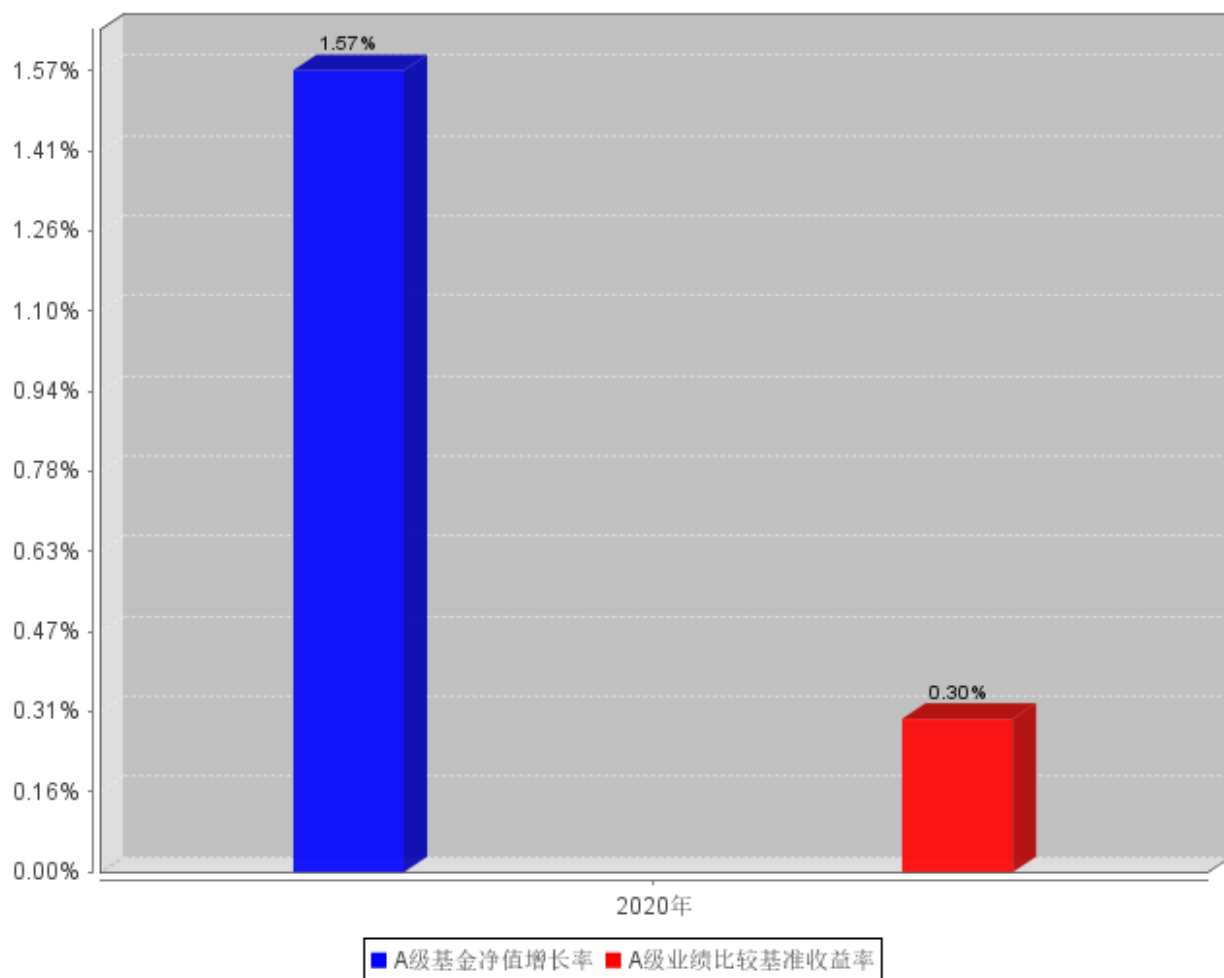
### （二）投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表  
数据截止日期：2021年3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



注：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） | $M < 1,000,000$                | 0.40%   | -  |
|          | $1,000,000 \leq M < 5,000,000$ | 0.20%   | -  |
|          | $M \geq 5,000,000$             | 1000元/笔 | -  |
| 赎回费      | $N < 7$ 天                      | 1.5%    | -  |
|          | $7 \leq N < 30$ 天              | 0.1%    | -  |
|          | $N \geq 30$ 天                  | 0%      | -  |

注：养老金费率等相关内容详见本基金招募说明书。

#### （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   | 0.15%           |
| 托管费   | 0.05%           |
| 销售服务费 | —               |
| 其他费用  | 会计师费、律师费、信息披露费等 |

注：1. 指数许可使用费按前一日的基金资产净值所适应的年度费率计提。当前一日的基金资产净值少于 10 亿元（不包括 10 亿元），指数许可使用费按前一日的基金资产净值的 0.04% 的年费率计提；当前一日的基金资产净值不少于 10 亿元、少于 20 亿元（包括 10 亿元，不包括 20 亿元），指数许可使用费按前一日的基金资产净值的 0.03% 的年费率计提；当前一日的基金资产净值不少于 20 亿元（包括 20 亿元），指数许可使用费按前一日的基金资产净值的 0.025% 的年费率计提。

2. 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。本基金的其他费用详见招募说明书。

## 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。

本基金主要面临的常规风险有：市场风险、管理风险、流动性风险（包括但不限于巨额赎回风险、启用摆动定价或侧袋机制等流动性风险管理工具带来的风险等）、信用风险等。

本基金面临的特定风险为：1、标的指数的风险；2、标的指数回报与债券市场平均回报偏离的风险；3、标的指数波动的风险；4、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险；5、标的指数变更的风险；6、与投资政策性金融债相关的风险；7、标的指数变更的风险；8、跟踪误差控制未达约定目标的风险；9、指数编制机构停止服务的风险；10、成份券停牌的风险；11、投资资产支持证券的风险；12、投资流动受限证券的风险等。

### （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。

关于本基金争议解决方式详见本基金基金合同，请投资者务必详细阅读相关内容。

## 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.csfunds.com.cn](http://www.csfunds.com.cn)][客服电话：400-888-2666]：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。

## 六、其他情况说明

—