

大成彭博巴克莱政策性银行债券 3-5 年指数证券投资基金(C 类份额)

基金产品资料概要更新

编制日期：2020 年 9 月 4 日

送出日期：2020 年 9 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 | 大成彭博巴克莱政策性银行债券 3-5 年指数 | 基金代码 | 009221 |
| 下属基金简称 | 大成彭博巴克莱政策性银行债券 3-5 年指数 C | 下属基金交易代码 | 009222 |
| 基金管理人 | 大成基金管理有限公司 | 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 | 2020 年 6 月 8 日 | | |
| 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 | 方孝成 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2020 年 9 月 4 日 |
| | | 证券从业日期 | 2006 年 1 月 1 日 |
| 基金经理 | 韩笑 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2020 年 6 月 8 日 |
| | | 证券从业日期 | 2013 年 2 月 1 日 |
| 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 个工作日出现前述情形的，基金合同自动终止，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

详见《大成彭博巴克莱政策性银行债券 3-5 年指数证券投资基金招募说明书》第十二部分“基金的投资”。

| | |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金通过指数化投资，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。 |
| 投资范围 | 本基金跟踪标的指数为：彭博巴克莱政策性银行债券 3-5 年指数。 本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，为更好实现投资目标，还可以投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的国债，政策性金融债，债券回购，银行存款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。本基金不投资股票，也不投资各类信用债。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。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%，投资标的指数成份券 |

| | |
|---------------|---|
| | 和备选成份券的比例不低于本基金非现金基金资产的 80%;本基金应当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。如法律法规或监管机构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 | <p>在正常市场情况下,基金管理人力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均偏离度的绝对值控制在 0.35%以内,年跟踪误差控制在 4%以内。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。</p> <p>(1) 指数投资策略</p> <p>1、债券投资组合的构建策略</p> <p>构建投资组合的过程主要分为三步:划分债券层级、筛选目标组合成份券和逐步调整建仓。</p> <p>2、债券投资组合的调整策略</p> <p>具体包括:①定期调整;②不定期调整。</p> <p>(2) 其他债券投资策略</p> <p>为了在一定程度上弥补基金费用,基金管理人还可以在控制风险的前提下,使用其他投资策略。</p> |
| 业绩比较基准 | 彭博巴克莱政策性银行债券 3-5 年指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5% |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券,具有与标的指数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

本基金合同生效日为 2020 年 06 月 08 日,截至本文件编制日,本基金尚未披露季度报告。

(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

本基金的基金合同生效日为 2020 年 06 月 08 日,截至本文件编制日,本基金尚未披露年度报告。

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 |
|------|-------------------------|---------|
| 赎回费 | N<7 天 | 1.5% |
| | 7 天≤N<30 天 | 0.1% |
| | N≥30 天 | 0.0 |

注:本基金份额不收取认购费、申购费。

(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 | 0.1% |

| | |
|-------------|--|
| 其他费用 | 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用、会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费，指数许可使用费，基金份额持有人大会费用，基金的证券交易费用，基金的银行汇划费用，基金相关账户的开户及维护费用，按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。 |
|-------------|--|

注：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。

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、产品特有风险

(1) 标的指数风险：即标的指数因为编制方法的缺陷有可能导致标的指数的表现与总体市场表现存在差异，因标的指数编制方法的不成熟也可能导致指数调整较大，增加基金投资成本，并有可能因此而增加跟踪误差，影响投资收益。

(2) 标的指数回报与债券市场平均回报偏离的风险：标的指数并不能完全代表整个债券市场。标的指数成份债券的平均回报率与整个债券市场的平均回报率可能存在偏离。

(3) 标的指数波动的风险：标的指数成份债券的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资人心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。

(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：根据基金合同的规定，因标的指数的编制与发布等原因，导致原标的指数不宜继续作为本基金的投资标的指数及业绩比较基准，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金可能变更标的指数，基金的投资组合随之调整，基金收益风险特征可能发生变化，投资人需承担投资组合调整所带来的风险与成本。

(6) 本基金主要投资于政策性金融债，可能面临以下风险：1) 政策性银行改制后的信用风险。2) 政策性金融债的流动性风险。3) 投资集中度风险。

2、债券型基金共有的风险，如市场风险、管理风险、流动性风险、其他风险等。

(二) 重要提示

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。

大成彭博巴克莱政策性银行债券 3-5 年指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2020 年 3 月 10 日证监许可【2020】399 号文予以注册。

中国证监会对本基金募集的注册或核准，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。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[www.dcfund.com.cn]客服电话[4008885558]

1. 大成彭博巴克莱政策性银行债券 3-5 年指数证券投资基金基金合同、大成彭博巴克莱政策性银行债券 3-5 年指数证券投资基金托管协议、大成彭博巴克莱政策性银行债券 3-5 年指数证券投资基金招募说明书

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