

# 华泰紫金中债1-5年国开行债券指数证券投资基金

## 基金产品资料概要更新

编制日期：2021年3月26日

送出日期：2021年3月30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	华泰紫金中债 1-5 年国开债指数	基金代码	008964
下属基金简称	华泰紫金中债 1-5 年国开债指数 A	下属基金代码	008964
	华泰紫金中债 1-5 年国开债指数 C		008965
基金管理人	华泰证券（上海）资产管理有限公司	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	2020-05-15		
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	阮毅	开始担任本基金基金经理的日期	2020/5/15
		证券从业日期	2011/6/1
	陈晨	开始担任本基金基金经理的日期	2020/8/27
		证券从业日期	2009/7/1
	杨义山	开始担任本基金基金经理的日期	2020/8/27
		证券从业日期	2018/10/29

### 二、基金投资与净值表现

#### （一）投资目标与投资策略

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。
投资范围	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，包括政策性金融债、债券回购

	<p>以及银行存款。</p> <p>本基金不投资于除政策性金融债以外的债券资产。</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>
<b>主要投资策略</b>	<p>本基金主要采用分层和动态优化复制的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标的指数的有效跟踪。</p> <p>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0.25%，年化跟踪误差控制在3%以内。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪误差进一步扩大。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将主要采用分层和动态优化复制的方法，主要以标的指数的成份券为基础，综合考虑债券流动性、基金日常申购赎回以及银行间和交易所债券交易特性及交易惯例等情况，进行替代优化，以保证对标的指数的有效跟踪。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>本基金通过采用分层和动态优化复制的方法进行被动式指数化投资，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可采取适当方法，如“久期盯住”等优化策略对基金资产进行调整，降低交易成本，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。</p>
<b>业绩比较基准</b>	中债-1-5年国开行债券指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%。
<b>风险收益特征</b>	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、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（若有）**

无

**（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（若有）**

无

**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：

华泰紫金中债1-5年国开债指数A

费用类型	金额（M） /持有期限（N）	收费方式/费率
申购费（前收费）	M<100 万	0.4%
	100 万≤M<200 万	0.2%
	200 万≤M<500 万	0.1%

	M $\geq$ 500 万	1000 元/笔
赎回费	N $<$ 7 日	1.5%
	7 日 $\leq$ N $<$ 30 日	0.1%
	N $\geq$ 30 日	0

华泰紫金中债1-5年国开债指数C

费用类型	金额 (M) /持有期限 (N)	收费方式/费率
申购费 (前收费)	-	不收取申购费
赎回费	N $<$ 7 日	1.5%
	7 日 $\leq$ N $<$ 30 日	0.1%
	N $\geq$ 30 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
管理费	0.15%
托管费	0.05%
销售服务费 (华泰紫金中债 1-5 年国开债指数 A)	不收取销售服务费
销售服务费 (华泰紫金中债 1-5 年国开债指数 C)	0.1%

注: 本基金交易证券、基金 (如有) 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。投资于本基金的主要风险有:

1、市场风险, 主要包括: (1) 政策风险; (2) 经济周期风险; (3) 利率风险; (4) 通货膨胀风险; (5) 再投资风险; (6) 杠杆风险; (7) 债券收益率曲线风险; 2、信用风险; 3、流动性风险; 4、操作风险; 5、管理风险; 6、合规风险; 7、本基金的特定风险: 指数化投资风险, 包括 (1) 标的指数的流动性风险; (2) 标的指数波动的风险; (3) 基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险; (4) 指数编制机构停止服务的风险; (5) 成份券违约的风险; (6) 跟踪误差控制未达约定目标的风险。

### (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。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站 <https://htamc.htsc.com.cn/>, 客服电话: 4008895597

- 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