

长城中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金（长城中债 3-5 年国开债指数 A 份额）

基金产品资料概要（更新）

编制日期：2021 年 3 月 23 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 | 长城中债3-5年国开债指数 | 基金代码 | 009324 |
| 下属基金简称 | 长城中债3-5年国开债指数A | 下属基金代码 | 009324 |
| 基金管理人 | 长城基金管理有限公司 | 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | 2020-11-19 | 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 | 张桢 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2020-11-19 |
| | | 证券从业日期 | 2014-07-11 |
| 其他 | 《基金合同》生效后，连续50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，基金管理人应当终止《基金合同》，无需召开基金份额持有人大会进行表决。出现标的指数不符合要求（因成份券价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，基金合同终止。 | | |

二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

详见《长城中债3-5年国开行债券指数证券投资基金招募说明书》第九部分“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，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，本基金力争使日均偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。 |
| 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、银行存款以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）。 本基金不参与股票等权益类资产的投资，不投资于除政策性金融债以外的债券资产。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%，投资待偿期在3年-5年（包含3和5年）的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%；本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的标的指数为中债-3-5年国开行债券指数。

主要投资策略 本基金为指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法，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，以实现对标指数的有效跟踪。
本基金主要以标的指数的成份券构成为基础，综合考虑跟踪效果、操作风险等因素，根据债券流动性、基金日常申购赎回以及债券交易特性及交易惯例等情况，采取“久期匹配”等优化策略对基金资产进行抽样化调整，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。

业绩比较基准 中债-3-5年国开行债券指数收益率×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

（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

三、投资本基金涉及的费用

（一）基金销售相关费用

注：以下费用在认购 / 申购 / 赎回基金过程中收取。投资者多次认 / 申购，认 / 申购费率按每笔认 / 申购申请单独计算。

认购费：（1）A类基金份额认购费率

认购金额(含认购费) 认购费率

100万元以下 0.3%

100万元(含)－500万元 0.1%

500万元以上(含) 每笔1000元

注：上述认购费率适用于除通过本公司直销柜台认购本基金A类基金份额的养老金客户以外的其他投资者。

（2）A类基金份额特定认购费率

认购金额(含认购费) 认购费率

100万元以下 0.06%

100万元(含)－500万元 0.02%

500万元以上(含) 每笔1000元

注：上述特定认购费率适用于通过本公司直销柜台认购本基金A类基金份额的养老金客户。

申购费：（1）A类基金份额申购费率

申购金额(含申购费) 申购费率

100万元以下 0.4%
 100万元(含)－500万元 0.2%
 500万元以上(含) 每笔1000元

注：上述申购费率适用于除通过本公司直销柜台申购的养老金客户以外的申购本基金A类基金份额的其他投资者。

（2）A类基金份额特定申购费率

申购金额(含申购费) 申购费率
 100万元以下 0.08%
 100万元(含)－500万元 0.04%
 500万元以上(含) 每笔1000元

注：上述特定申购费率适用于通过本公司直销柜台申购本基金A类基金份额的养老金客户。

赎回费：持有期限（T） 赎回费率

T<7日 1.5%
 7日≤T<30日 0.05%
 T≥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 | 0.150% |
| 托管费 | 0.050% |
| 销售服务费 | - |
| 指数许可使用费 | 0.015% |
| - | 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、诉讼费和仲裁费，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，以及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，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。 |

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、市场风险

本基金投资于证券市场，而证券市场价格因受到经济因素、政治因素、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而产生波动，从而导致基金收益水平发生变化，产生风险，主要风险因素包括：（1）政策风险；（2）利率风险；（3）再投资风险；（4）购买力风险；（5）信用风险；（6）公司经营风险；（7）经济周期风险。

2、流动性风险

3、管理风险

4、本基金的特定风险：（1）主要投资标的的风险；（2）标的指数波动的风险；（3）标的指数计算错误的风险；（4）标的指数变更风险；（5）基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险；（6）跟踪误差控制未达约定目标的风险；（7）成份券停牌、摘牌或违约的风险；（8）指数编制机构停止服务的风险；

(9) 基金合同自动终止风险。

5、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险

6、其他风险

(二) 重要提示

长城中债3-5年国开行债券指数证券投资基金经2020年2月20日中国证券监督管理委员会证监许可[2020]312号文注册募集。

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。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[www.ccfund.com.cn][客服电话：400-8868-666]

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

-