

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

基金产品资料概要（更新）

编制日期：2021 年 4 月 14 日

送出日期：2021 年 4 月 15 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 | 长信中债1-3年政金债指数 | 基金代码 | 009280 |
| 下属基金简称 | 长信中债1-3年政金债指数A | 下属基金代码 | 009280 |
| 基金管理人 | 长信基金管理有限责任公司 | 基金托管人 | 上海银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | 2020-06-05 | 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 | 陆莹 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2020-06-05 |
| | | 证券从业日期 | 2010-06-29 |
| 其他 | 《基金合同》生效后，在本基金投资的政策性金融债的发行人发生改制，且可能对本基金的投资运作和基金份额持有人利益产生较大影响的情形下，基金管理人在履行适当程序后，本基金将转型或进入基金财产清算程序。 | | |

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》第九章了解详细情况

| | |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金采用被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，以实现对标的有效跟踪。 |
| 投资范围 | <p>本基金的标的指数为中债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券及备选成份券。为了更好地实现投资目标，本基金还可以投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法上市的国债、政策性金融债、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、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。本基金不投资于股票。</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</p> |

投资于待偿期1年-3年（包含1年和3年）的标的指数成份券及其备选成份券的比例不低于本基金非现金基金资产的80%；本基金持有现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）以及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。如法律法规或中国证监会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。

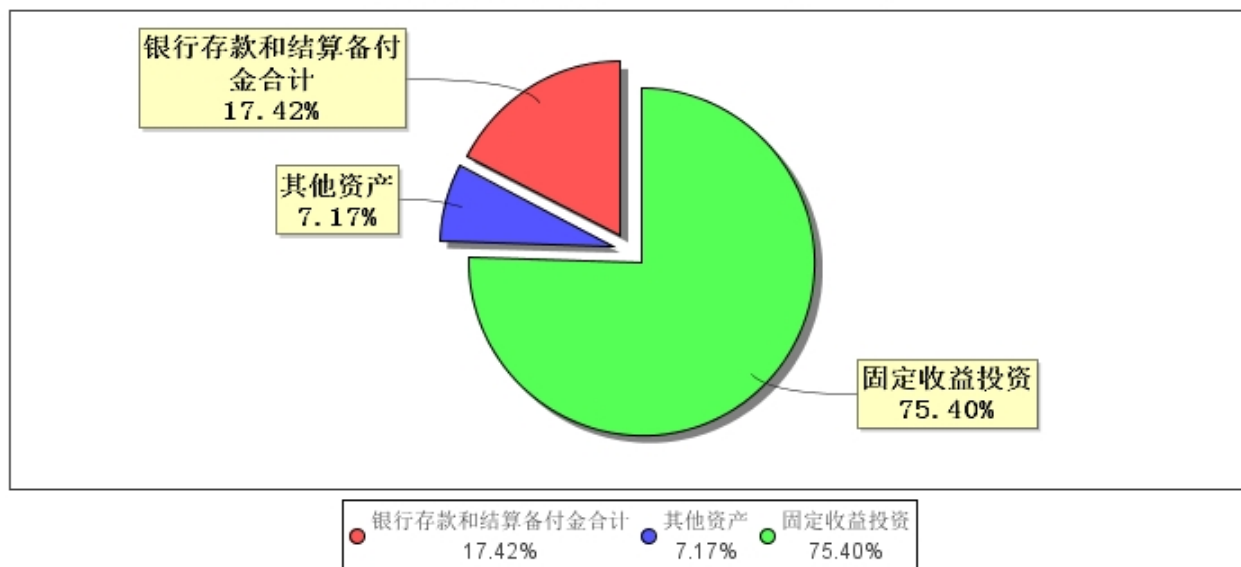
主要投资策略 本基金为被动式指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法跟踪标的指数，即主要按照标的指数的成份券组成及其权重构建基金投资组合，并根据标的指数成份券及其权重的变动进行相应调整，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标的有效跟踪。在正常市场情况下，力争本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

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 本基金为债券型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。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。

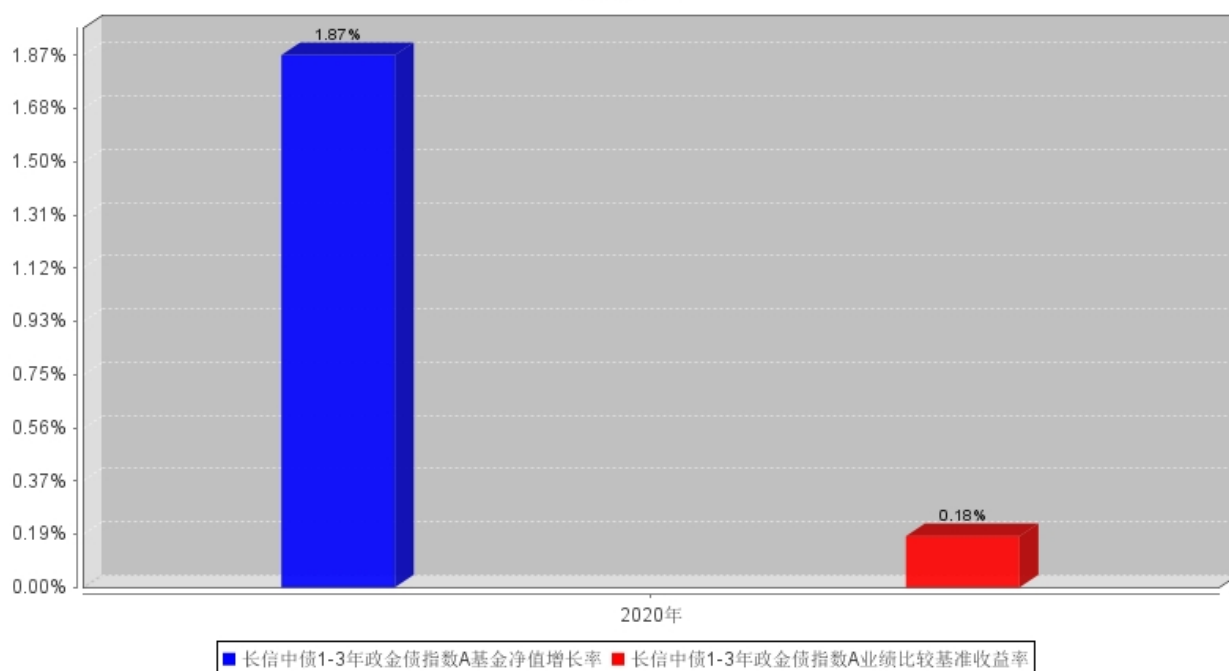
（二）投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表
数据截止日期：2020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

长信中债1-3年政金债指数A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：1、业绩表现截止日期2020年12月31日。基金过往业绩不代表未来表现。

2、本基金基金合同生效日为2020年6月5日，2020年净值增长率按当年实际存续期计算。

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：

| 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 | 0.50% | 非养老金客户 |
| | 1,000,000 ≤ M < 5,000,000 | 0.30% | 非养老金客户 |
| | M ≥ 5,000,000 | 1000元/笔 | 非养老金客户 |
| | M < 1,000,000 | 0.025% | 养老金客户 |
| | 1,000,000 ≤ M < 5,000,000 | 0.015% | 养老金客户 |
| | M ≥ 5,000,000 | 1000元/笔 | 养老金客户 |
| 赎回费 | N < 7天 | 1.50% | - |
| | 7天 ≤ N < 30天 | 0.10% | - |
| | N ≥ 30天 | 0.00% | - |

注：M为申购金额，单位为元；N为持有期限。

（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 | - |

注：1、标的指数许可使用费：基金资产净值10亿人民币以下（不包括10亿人民币整），年度费率0.04%；

基金资产净值10亿-20亿人民币之间（包括10亿人民币整，不包括20亿人民币整），年度费率0.03%；基金资产净值超过20亿人民币（包括20亿人民币整），年度费率0.025%。

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。

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。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，利率风险，基金运作风险，包括由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险等。本基金主要投资于政策性金融债，可能面临政策性银行改制后的信用风险、政策性金融债流动性风险、投资集中度风险等。

当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人履行相应程序后，可以启用侧袋机制，具体详见基金合同和本招募说明书的有关章节。侧袋机制实施期间，基金管理人将对基金简称进行特殊标识，并不办理侧袋账户的申购赎回。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。

本基金为债券型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。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。为了更好地实现投资目标，本基金还可以投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法上市的国债、政策性金融债、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、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。本基金不投资于股票。

投资人应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》、基金产品资料概要等基金法律文件，了解基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资人的风险承受能力相适应。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

（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。

基金投资者应阅读并完全理解基金合同第二十一章“争议的处理和适用的法律”中的所有内容，知悉合同相关争议应提交上海国际经济贸易仲裁委员会在上海进行仲裁。

本产品资料概要有关财务数据和净值表现截止日如上图所示。本次更新根据《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》更新相关事宜。本基金托管人上海银行股份有限公司已经复核了本次更新的产品资料概要。

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

本公司网址：www.cxfund.com.cn

本公司客户服务专线：400-700-5566（免长途话费）

- 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

-