

大成彭博农发行债券 1-3 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：2024 年 9 月 25 日

送出日期：2024 年 9 月 28 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	大成彭博农发行债券 1-3 年指数	基金代码	009219
下属基金简称	大成彭博农发行债券 1-3 年指数 C	下属基金交易代码	009220
基金管理人	大成基金管理有限公司	基金托管人	兴业银行股份有限公司
基金合同生效日	2020 年 6 月 24 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	刘传毅	开始担任本基金基金经理的日期	2024 年 1 月 9 日
		证券从业日期	2016 年 7 月 1 日
基金经理	范昕	开始担任本基金基金经理的日期	2024 年 9 月 25 日
		证券从业日期	2017 年 5 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

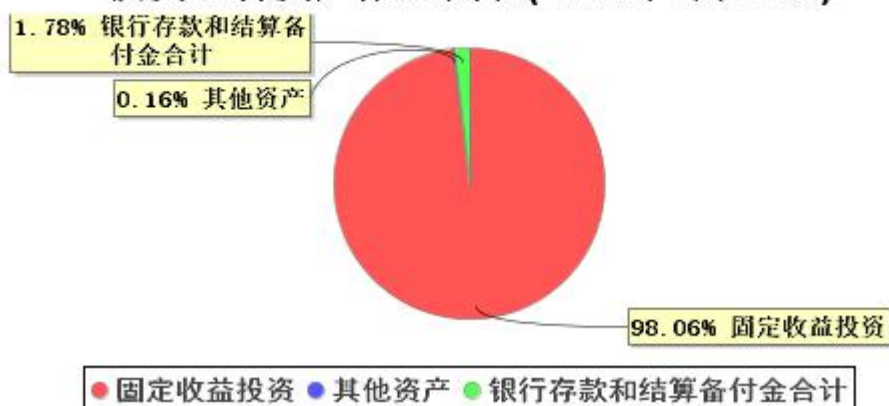
详见《大成彭博农发行债券 1-3 年指数证券投资基金更新招募说明书》第八部分“基金的投资”。

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，

	<p>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%，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。</p> <p>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。</p>
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>①划分债券层级</p> <p>②筛选目标组合成份券</p> <p>③逐步建仓</p> <p>（2）债券投资组合的调整策略</p> <p>①定期调整</p> <p>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。例如，基金管理人可以利用银行间市场与交易所市场，或债券一、二级市场间的套利机会进行跨市场套利；还可以使用事件驱动策略，即通过分析重大事件发生对投资标的定价的影响而进行套利；也可以使用公允价值策略，即通过对债券市场价格与模型价格偏离度的研究，采取相应的增/减仓操作；或运用杠杆原理进行回购交易等。</p>
业绩比较基准	彭博农发行债券 1-3 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。

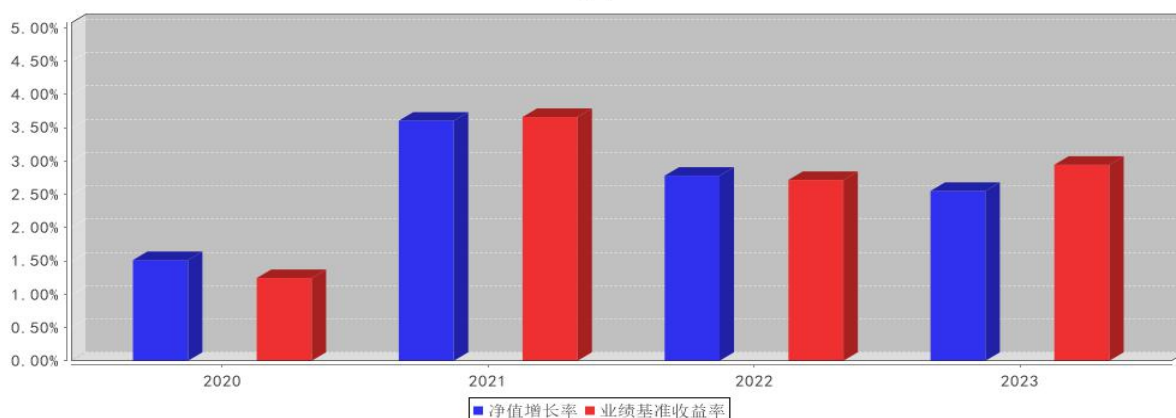
(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表(2024年6月30日)



(三) 自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

大成彭博农发行债券1-3年指数C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图 (2023年12月31日)



注：1、基金的过往业绩不代表未来表现。

2、如合同生效当年不满完整自然年度的，按实际期限计算净值增长率。

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%
	$7 \text{ 天} \leq N < 30$ 天	0.1%
	$N \geq 30$ 天	0.0

注：本基金份额不收取申购费。

(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/年费率或金额	收取方

管理费	0.15%	基金管理人和销售机构
托管费	0.05%	基金托管人
销售服务费	0.1%	销售机构
审计费用	30,000.00 元	会计师事务所
信息披露费	80,000.00 元	规定披露报刊
指数许可使用费	0.015%	指数编制公司
其他费用	《基金合同》生效后与基金相关的律师费、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：（1）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。

（2）审计费用、信息披露费为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

（3）根据基金管理人与彭博公司签署的指数使用许可协议的约定，标的指数许可使用费的收取下限为每季度 2500 美元。

（三）基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

大成彭博农发行债券 1-3 年指数 C

基金运作综合费率（年化）
0.38%

注：基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

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
- (6) 跟踪误差控制未达约定目标的风险
- (7) 指数编制机构停止服务的风险
- (8) 成份券停牌的风险

标的指数成份券可能因各种原因临时或长期停牌，发生成份券停牌时可能面临如下风险：基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

(9) 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。若未来政策性银行进行改制，政策性金融债的性质有可能发生较大变化，债券信用等级也可能相应调整，基金投资可能面临一定信用风险。

2) 政策性金融债的流动性风险。政策性金融债市场投资者行为具有一定趋同性，在极端市场环境下，可能集中买进或卖出，增加流动性风险。

3) 投资集中度风险。政策性金融债发行人较为单一，若单一主体发生重大事项变化，可能对基金净值表现产生较大影响。

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、启用侧袋机制的风险、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。

大成彭博巴克莱农发行债券 1-3 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】398 号文予以注册。根据基金管理人于 2021 年 8 月 24 日刊登的《大成基金管理有限公司关于大成彭博巴克莱农发行债券 1-3 年指数证券投资基金更名和修订基金合同部分条款的公告》，大成彭博巴克莱农发行债券 1-3 年指数证券投资基金自 2021 年 8 月 24 日起更名为“大成彭博农发行债券 1-3 年指数证券投资基金”，更名后，该基金的基金代码不变，标的指数名称变更不涉及指数编制方法的实质性变更。

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。

本基金标的指数为彭博农发行债券 1-3 年指数，该指数的样本空间、选样方法等信息详见本基金招募说明书。

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. 大成彭博农发行债券 1-3 年指数证券投资基金基金合同、大成彭博农发行债券 1-3 年指数证券投资基金托管协议、大成彭博农发行债券 1-3 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