

长盛中债 0-3 年政策性金融债指数证券投资基金（长盛中债 0-3 年政金债指数 C 份额）

基金产品资料概要更新

编制日期：2025 年 10 月 16 日

送出日期：2025 年 10 月 17 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    | 长盛中债 0-3 年政金债指数                                                                                                                                       | 基金代码           | 021519          |
| 下属基金简称  | 长盛中债 0-3 年政金债指数 C                                                                                                                                     | 下属基金交易代码       | 021520          |
| 基金管理人   | 长盛基金管理有限公司                                                                                                                                            | 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 | 2024 年 12 月 4 日                                                                                                                                       | 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    | 王赛飞                                                                                                                                                   | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2024 年 12 月 4 日 |
|         |                                                                                                                                                       | 证券从业日期         | 2012 年 7 月 2 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 个工作日出现上述情形的，基金管理人可直接终止《基金合同》，且无需召开基金份额持有人大会。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。 |                |                 |

二、基金投资与净值表现

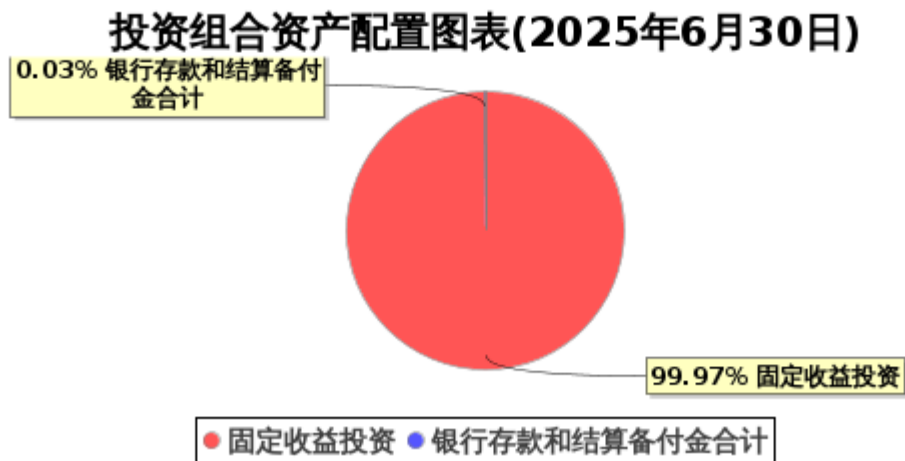
(一) 投资目标与投资策略

（投资者阅读《招募说明书》中“基金的投资”章节了解详细情况）

|      |                                                                                                                                                                                                                                                |
|------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 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。                                                                                                                                                                                          |
| 投资范围 | 本基金标的指数为中债-0-3 年政策性金融债指数及其未来可能发生的变更。<br>本基金主要投资于标的指数成份债券和备选成份债券。为更好实现投资目标，本基金还可投资于国内依法发行上市的国债、政策性金融债、央行票据、债券回购、银行存款、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（但须符合中国证监会相关规定）。<br>本基金不投资于股票，也不投资于信用债。<br>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>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%；投资待偿期为 0-3 年（包含 3 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%；本基金每个交易日日终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。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 主要投资策略 | <p>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 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致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误差进一步扩大。</p> <p>本基金运作过程中，当标的指数成份券发生明显负面事件面临退市或违约风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份券进行调整。</p> <p>1、优化抽样复制策略</p> <p>本基金将采用抽样复制和动态最优化的方法，主要以标的指数的成份券构成为基础，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优化，以保证对标的有效跟踪。</p> <p>2、替代性策略</p> <p>当由于市场流动性不足或因法规规定等其他原因，导致标的指数成份券和备选成份券无法满足投资需求时，基金管理人可以在成份券和备选成份券外寻找其他债券构建替代组合，对指数进行跟踪复制。替代组合的构建将以债券流动性为约束条件，按照与被替代债券久期相近、信用评级相似、到期收益率及剩余期限基本匹配为主要原则，控制替代组合与被替代债券的跟踪偏离度和跟踪误差最小化。</p> <p>3、其他债券投资策略</p> <p>对于非成份券的债券，本基金综合运用久期调整、收益率曲线策略、类属配置等组合管理手段进行日常管理。另外，本基金债券投资将适当运用杠杆策略，通过债券回购融入资金，然后买入收益率更高的债券以获得收益。</p> |
| 业绩比较基准 | 中债-0-3 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 | <p>本基金为债券型基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。同时，本基金为指数型基金，本基金主要投资于标的指数成份券及其备选成份券，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。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |

## （二）投资组合资产配置图表/区域配置图表



### 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）<br>/持有期限（N） | 收费方式/费率 |
|------|-------------------------|---------|
| 赎回费  | N<7 天                   | 1.5%    |
|      | N≥7 天                   | 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 | 0.10%                                                                                                                               | 销售机构       |
| 审计费用  | 85,000.00 元                                                                                                                         | 会计师事务所     |
| 信息披露费 | 120,000.00 元                                                                                                                        | 规定披露报刊     |
| 其他费用  | 《基金合同》生效后与基金相关的律师费、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等费用，以及相关法律法规和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。费用类别详见本基金《基金合同》及《招募说明书》或其更新。 |            |

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。

#### (三) 基金运作综合费用测算

本基金暂无年报数据，故不披露基金综合运作费率。

### 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。

本基金面临的常规风险：市场风险、管理风险、信用风险、流动性风险（包括但不限于拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估，巨额赎回情形下的流动性风险管理措施，实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响，实施侧袋机制对投资者的影响等）等。

本基金面临的特定风险包括：1、指数化投资相关风险；2、标的指数波动的风险；3、标的指数跟踪偏离的风险；4、标的指数编制方案变更的风险；5、跟踪误差控制未达约定目标的风险；6、标的指数值计算出错的风险；7、标的指数变更的风险；8、指数编制机构停止服务的风险；9、成份券违约的风险；10、与投资政策性金融债相关的风险；11、成份券停牌的风险；12、基金合同直接终止的风险。

## （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。

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。

关于本基金争议解决方式详见本基金基金合同，请投资者务必详细阅读相关内容。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[网址：[www.csfund.com.cn](http://www.csfund.com.cn)][客服电话：400-888-2666]

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