

# 富國中債 7-10 年政策性金融債交易型開放式指數證券投資基金發起式聯接基金（E 類份額）基金產品資料概要更新

2024 年 06 月 11 日（信息截至：2024 年 06 月 07 日）

本概要提供本基金的重要信息，是招募說明書的一部分。作出投資決定前，請閱讀完整的招募說明書等銷售文件。

## 一、 產品概況

基金簡稱	富國中債 7-10 年政策性金融債 ETF 發起式聯接	基金代碼	018266
份額簡稱	富國中債 7-10 年政策性金融債 ETF 發起式聯接 E	份額代碼	019596
基金管理人	富國基金管理有限公司	基金託管人	興業銀行股份有限公司
基金合同生效日	2023 年 04 月 07 日	基金類型	基金中基金
運作方式	普通開放式	開放頻率	每個開放日
交易币种	人民币		
基金經理	朱征星	任職日期	2023 年 04 月 07 日
		證券從業日期	2014 年 07 月 01 日
基金經理	李金柳	任職日期	2023 年 04 月 24 日
		證券從業日期	2016 年 07 月 01 日

注：本基金於 2023 年 9 月 26 日起增加 E 類基金份額。

## 二、 基金投資與淨值表現

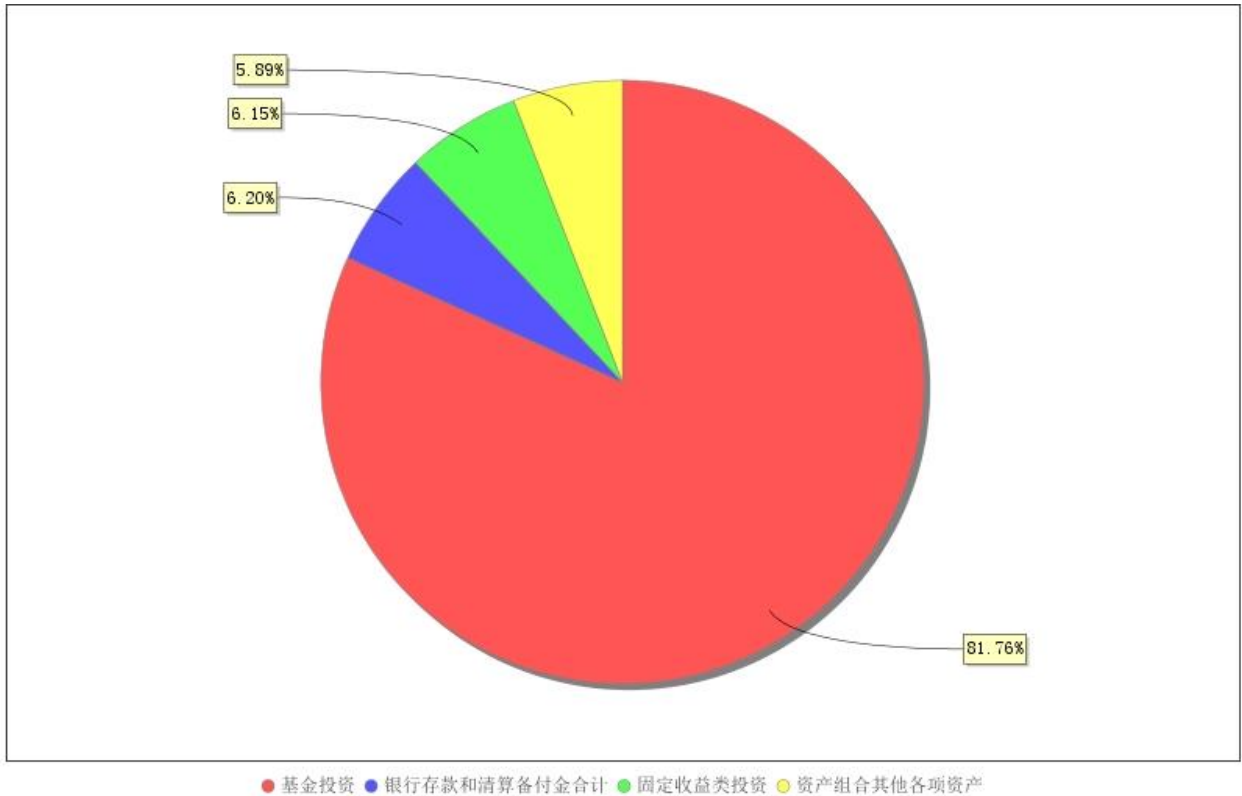
### （一） 投資目標與投資策略

投資目標	本基金通過投資於目標 ETF，緊密跟蹤標的指數，追求與業績比較基準相似的回報。
投資範圍	<p>本基金主要投資於目標 ETF 基金份額、標的指數成份券及備選成份券。為更好地實現投資目標，本基金還可以投資於國內依法發行上市的國債、政策性金融債、債券回購、銀行存款、國債期貨、同業存單、貨幣市場工具及中國證監會允許基金投資的其他金融工具（但須符合中國證監會相關規定）。</p> <p>本基金不投資於股票，也不投資於可轉換債券、可交換債券。</p> <p>如法律法規或監管機構以後允許基金投資其他品種，基金管理人在履行適當程序後，可以將其納入投資範圍。</p> <p>基金的投資組合比例為：本基金投資於目標 ETF 的比例不得低於基金資產淨值的 90%，因法律法規的規定而受限制的情形除外。每個交易日日終在扣除國債期貨合約需繳納的交易保證金後，本基金持有的現金或者到期日在一年以內的政府債券不低於基金資產淨值的 5%，其中現金不包括結算備付金、存出保證金、應收申購款等。</p> <p>如法律法規或中國證監會變更投資品種的投資比例限制，基金管理人在履行適當程序後，可以調整上述投資品種的投資比例。</p>
主要投資策略	<p>本基金以目標 ETF 為主要投資標的，方便投資者通過本基金投資目標 ETF。本基金並不參與目標 ETF 的管理。在正常市場情況下，本基金力爭淨值增長率與業績比較基準之間的日均跟蹤偏離度的絕對值不超過 0.3%，年跟蹤誤差不超過 4%。</p> <p>如因標的指數編制規則調整或其他因素導致跟蹤偏離度和跟蹤誤差超過正常範圍的，基金管理人將採取合理措施避免跟蹤誤差進一步擴大。</p> <p>當標的指數成份券發生明顯負面事件面臨退市或違約風險，且指數編制機構暫</p>

	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。本基金的资产配置策略、目标 ETF 投资策略、债券投资策略、国债期货投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	中债-7-10 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 ETF 联接基金，目标 ETF 为债券型基金，因此在通常情况下其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金，低于股票型基金和混合型基金。本基金为指数基金，通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，具有与标的指数相似的风险收益特征。

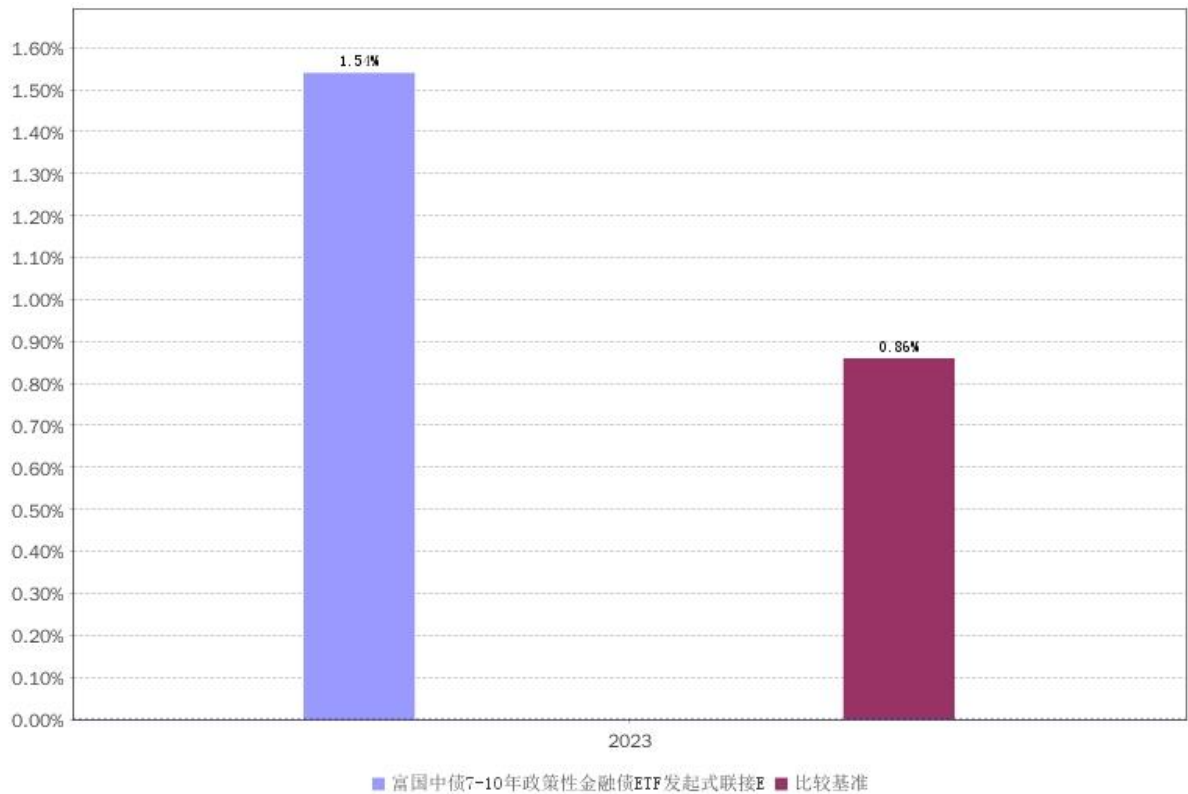
注：详情请阅读《招募说明书》中“基金的投资”章节的相关内容。

## (二) 投资组合资产配置图表



注：截止日期 2024 年 03 月 31 日。

## (三) 自基金合同生效以来基金（E 份额）每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图



注：本基金合同生效日 2023 年 04 月 07 日。该份额生效日 2023 年 09 月 27 日。业绩表现截止日期 2023 年 12 月 31 日。基金过往业绩不代表未来表现。

### 三、投资本基金涉及的费用

#### （一）基金销售相关费用

费用类型	金额（M）/持有期限（N）	费率（普通客户）	费率（特定客户）
赎回费	N < 7 天	1.5%	
	N ≥ 7 天	0	

注：本基金 E 类基金份额不收取申购费用，赎回费用在投资者赎回基金过程中收取，具体请见《招募说明书》相关内容。

#### （二）基金运作相关费用

费用类别	年费率/收费方式	收取方
管理费	0.15%	基金管理人、销售机构
托管费	0.05%	基金托管人
销售服务费	0.01%	销售机构
审计费用	40,000.00 元/年	会计师事务所
信息披露费	120,000.00 元/年	规定披露报刊

注：以上费用将从基金资产中扣除；基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费、托管费。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。审计费用、信息披露费为基金整体承担的年费用金额，非单个份额类别费用。年费用金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。除上述费用外的其他运作费用，详见《招募说明书》中的“基金费用与税收”章节。

#### （三）基金运作综合费用测算

基金运作综合费率（年化）
0.24%

注：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上表所示。基金管理费率、托管费率、销售服务费率为基金现行费率，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。

本基金投资中的风险包括：证券市场整体环境引发的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，大量赎回或暴跌导致的流动性风险，基金投资过程中产生的操作风险，因交收违约和投资债券引发的信用风险，指数化投资的风险，投资于目标 ETF 基金带来的风险，以及基金投资对象与投资策略引致的特有风险等等。

本基金的特定风险包括：1、投资于目标 ETF 基金带来的风险

本基金为目标 ETF 联接基金，投资于目标 ETF 的比例不得低于基金资产净值的 90%，因此，本基金将面临例如目标 ETF 的管理风险与操作风险、目标 ETF 特定风险（包括基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险、退市风险、申购/赎回失败的风险、退补现金替代方式的风险、基金份额赎回对价的变现风险、套利风险、申购赎回清单差错风险、第三方机构服务的风险及投资特定品种的投资风险等）、目标 ETF 的技术风险等风险。

目标 ETF 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。上述风险可能影响本基金的净值表现。

#### 2、指数化投资的风险

本基金的指数化投资风险包括标的指数的风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险、成份券停牌、摘牌或违约的风险和指数编制机构停止服务的风险等。

#### 3、国债期货投资风险

国债期货的投资可能面临市场风险、基差风险、流动性风险。

#### 4、终止清盘风险

本基金存在着无法存续的风险。

### （二） 重要提示

中国证监会对本基金募集的注册/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。

与本基金或基金合同相关的一切争议将提交上海国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为上海市，仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

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、定期公告等披露文件。

## 五、 其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站(www.fullgoal.com.cn)，客户服务热线：95105686，4008880688

(全国统一，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