

大成景悦中短债债券型证券投资基金(C类份额)

基金产品资料概要更新

编制日期：2024年6月3日

送出日期：2024年6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	大成景悦中短债债券	基金代码	008820
下属基金简称	大成景悦中短债C	下属基金交易代码	008821
基金管理人	大成基金管理有限公司	基金托管人	中国农业银行股份有限公司
基金合同生效日	2020年6月19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	郑欣	开始担任本基金基金经理的日期	2023年10月27日
		证券从业日期	2016年7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人民币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，基金合同应当终止，无需召开基金份额持有人大会。		

二、基金投资与净值表现

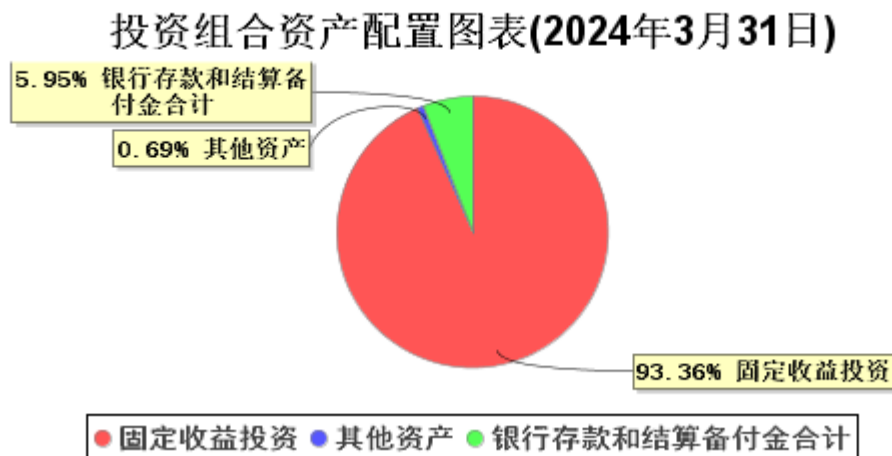
(一) 投资目标与投资策略

详见《大成景悦中短债债券型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	在严格控制投资风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产长期稳定增值。
投资范围	<p>本基金投资于债券（包括国内依法发行上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府机构债、地方政府债、可分离交易可转债的纯债部分）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款等）、同业存单、货币市场工具、国债期货、信用衍生品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的相关规定。本基金不投资于股票、可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）和可交换债券。</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，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。</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%，其中投资于中短期债券的比例不低于非现金基金资产的80%。本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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>

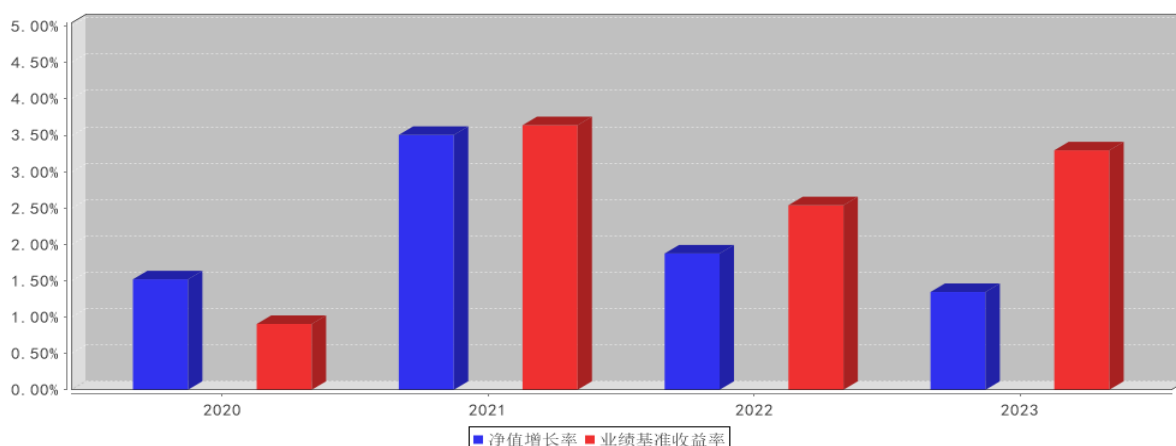
	<p>本基金所指的中短期债券是指剩余期限不超过三年的债券资产，主要包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府机构债、地方政府债、可分离交易可转债的纯债部分。其中剩余期限是指计算日至债券到期日为止所剩余的天数，以下情况除外：</p> <p>1、含回售权的债券的剩余期限以计算日至下一个行权日的实际剩余天数计算；</p> <p>2、可变利率或浮动利率债券的剩余期限以计算日至下一个利率调整日的实际剩余天数计算。</p> <p>如法律法规或中国证监会对剩余期限计算方法另有规定的从其规定。</p> <p>如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，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>本基金在严格控制风险和保持较高流动性的前提下，重点投资中短期债券，力争获得长期稳定的投资收益。</p> <p>本基金以中长期利率趋势分析为基础，结合经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，实施积极的债券投资组合管理，以获取较高的债券组合投资收益。</p> <p>1、久期配置，2、债券类属配置，3、信用债投资策略，4、资产支持证券投资策略，5、国债期货投资策略，6、信用衍生品投资策略</p>
业绩比较基准	中债综合财富(1-3年)指数收益率*85%+一年期定期存款利率(税后)*15%
风险收益特征	本基金为债券型基金，一般而言，其长期预期风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

(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

大成景悦中短债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%
	N ≥ 7 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	0.3%	基金管理人和销售机构
托管费	0.1%	基金托管人
销售服务费	0.25%	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
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、基金份额持有人大会费用、基金的证券、期货交易费用、基金的银行汇划费用、基金的开户费用、账户维护费用。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。

(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：

大成景悦中短债 C

基金运作综合费率（年化）
0.89%

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、本基金特有风险：

(1) 本基金为债券型基金，债券的投资比例不低于基金资产的 80%，债券投资的特定风险即成为本基金及投资者主要面对的特定投资风险。债券的投资收益会受到宏观经济、政府产业政策、货币政策、市场需求变化、行业波动等因素的影响，可能存在所选投资标的的成长性与市场一致预期不符而造成个券价格表现低于预期的风险。

(2) 本基金投资资产支持证券，资产支持证券的主要风险包括：信用风险也称为违约风险、利率风险、流动性风险、由于提前偿付而使投资者遭受损失的可能性、操作风险、法律风险等。

(3) 本基金投资国债期货，国债期货的主要风险如下：

1) 市场风险：国债价格的波动将可能影响国债期货合约的价格波动；国债期货合约价格的波动将直接影响基金资产净值；国债期货与现货合约以及国债期货不同合约之间价格差的波动可能导致特定策略组合在部分时间点上价值产生不利方向的波动。

2) 流动性风险：国债期货业务的流动性风险主要包括持仓组合变现的流动性风险和无法缴足保证金的资金流动性风险。持仓组合变现的流动性风险是指持仓品种变现时由于市场流动性严重不足、或头寸持有集中度过大导致未在合理价位成交而造成变现损失的风险；无法缴足保证金的资金流动性风险指当国债期货业务支付现金的义务大于组合现金头寸而发生流动性危机的风险。

3) 信用风险：信用风险指由于发行人或交易对手违约而产生损失的风险。由于国债期货业务持有的合约均为中金所场内交易的标准品种，因此该业务的信用风险较小。

4) 合规性风险：国债期货业务开展过程中，存在可能违反相关监管法规，从而受到监管部门处罚的风险，主要包括业务超出监管机关规定范围、风险控制指标超过监管部门规定阈值等方面的风险。

5) 国债期货实物交割风险：国债期货到期时采取实物交割方式，因此可能存在因实物交割导致被逼空的风险

(4) 信用衍生品投资风险

本基金可投资于信用衍生品，信用衍生品作为一种金融衍生品，具备一些特有的风险点。

(5) 本基金收益分配方式有现金分红和红利再投资两种，对于选择红利再投资的投资者，其因红利再投资所得的份额自确认之日起开始计算持有时间，并于该份额赎回时按照本基金相关法律文件的约定选择适用的赎回费率并计算赎回费，敬请投资人留意。

2、本基金还面临证券投资基金投资共有的风险，如市场风险、管理风险、流动性风险、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。

大成景悦中短债债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2019 年 12 月 13 日证监许可【2019】2839 号文予以注册。

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。

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. 大成景悦中短债债券型证券投资基金基金合同、大成景悦中短债债券型证券投资基金托管协议、大成景悦中短债债券型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