

大成中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金(D 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	大成中债 3-5 年国开债指数	基金代码	007507
下属基金简称	大成中债 3-5 年国开债指数 D	下属基金交易代码	020505
基金管理人	大成基金管理有限公司	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	2019 年 6 月 27 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	2023 年 12 月 7 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 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 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。		

二、基金投资与净值表现

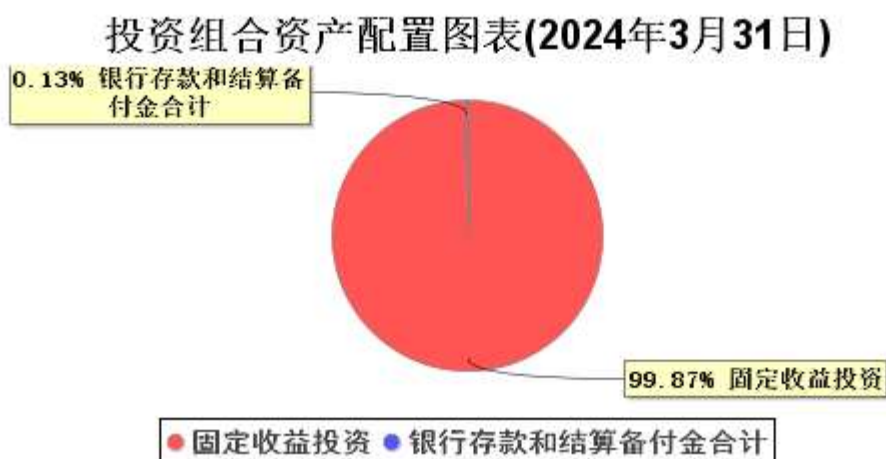
(一) 投资目标与投资策略

详见《大成中债 3-5 年国开行债券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 0.2%以内，年跟踪误差控制在 2%以内。
投资范围	本基金跟踪标的指数为：中债-3-5 年国开行债券指数。 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、各类政策性金融债、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具以及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。本基金不投资股票等权益资产，也不投资各类信用债。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%; 每个交易日日终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。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。
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 0.2% 以内, 年跟踪误差控制在 2% 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。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, 对标的指数的久期等指标进行跟踪, 达到复制标的指数、降低交易成本的目的。</p> <p>2、其他债券投资策略。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> <p>指数成份券发生明显负面事件面临退市风险, 且指数编制机构暂未作出调整的, 基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则, 综合考虑成份券的退市风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响, 据此制定成份券替代策略, 并对投资组合进行相应调整。</p>
业绩比较基准	中债-3-5 年国开行债券指数收益率*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



(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

注: 截至本文件编制日, 本基金 D 类份额属新增份额, 无相关数据。

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
申购费 (前收费)	M < 100 万元	0.5%
	100 万元 ≤ M < 200 万元	0.3%
	200 万元 ≤ M < 500 万元	0.15%
	M ≥ 500 万元	100 元/笔
赎回费	N < 7 天	1.5%
	N ≥ 7 天	0.0

注：养老金客户在基金管理人直销中心办理账户认证手续后，可享受申购费率一折优惠，申购费为固定金额的，则按原费率执行，不再享有费率折扣。

(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
审计费用	60,000.00 元	会计师事务所
信息披露费	120,000.00 元	规定披露报刊
指数许可使用费	当前一日基金资产净值小于 10 亿元，按 0.04% 年费率 当前一日基金资产净值不少于 10 亿元，小于 20 亿元，按 0.03% 年费率 当前一日基金资产净值不少于 20 亿元，按 0.025% 年费率	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，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：

大成中债 3-5 年国开债指数 D

基金运作综合费率（年化）
0.24%

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

根据基金合同的规定，因标的指数的编制与发布等原因，导致原标的指数不宜继续作为本基金的投资标的指数及业绩比较基准，本基金可能变更标的指数，基金的投资组合随之调整，基金收益风险特征可能发生变化，投资人需承担投资组合调整所带来的风险与成本。

2、债券型基金共有的风险，如市场风险、管理风险、流动性风险和其他风险等。

(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，敬请关注基金管理人发布的相关临时公告等。

大成中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2019 年 4 月 16 日证监许可【2019】750 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. 大成中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金基金合同、大成中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金托管协议、大成中债 3-5 年国开行债券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