

鹏扬中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金 (A 份额)

基金产品资料概要 (更新)

编制日期: 2024 年 5 月 24 日

送出日期: 2024 年 6 月 25 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	鹏扬中债 3-5 年国开债指数	基金代码	014101
下属基金简称	鹏扬中债 3-5 年国开债指数 A	下属基金代码	014101
基金管理人	鹏扬基金管理有限公司	基金托管人	中国民生银行股份有限公司
基金合同生效日	2022-04-27	上市交易所及上市日期	不适用
基金类型	债券型	交易币种	人民币
运作方式	契约型开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	王黎骁	开始担任本基金基金经理的日期	2022-09-13
		证券从业日期	2019-05-13
	焦翠	开始担任本基金基金经理的日期	2023-08-17
		证券从业日期	2013-07-01

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

阅读本公司《鹏扬中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金招募说明书》第九部分了解详细情况。

投资目标	本基金进行被动式指数化投资, 紧密跟踪标的指数, 追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
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政策性金融债、国债、央行票据、债券回购、同业存单、银行存款、国债期货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)。 本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%; 其中, 投资于待偿期为 3 至 5 年(含 3 年和 5 年)的标的指数成份券及其备选成份券的比例不低于本基金非现金基金资产的 80%; 每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后, 本基金持有现金以及到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%, 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	本基金的投资策略包括债券指数化投资策略、国债期货投资策略。 本基金为被动式指数基金, 主要采用抽样复制和动态优化的方法, 投资于标的指数中具有代表性和流动性较好的成份券以及备选成份券, 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, 以实现对标指数的有效跟踪。

在进行国债期货投资时, 将根据风险管理原则, 充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征, 以套期保值为主要目的, 采用流动性好、交易活跃的期货合约, 以降低债券仓位调整的交易成本, 提高投资效率, 从而更好地跟踪标的指数, 实现投资目标。

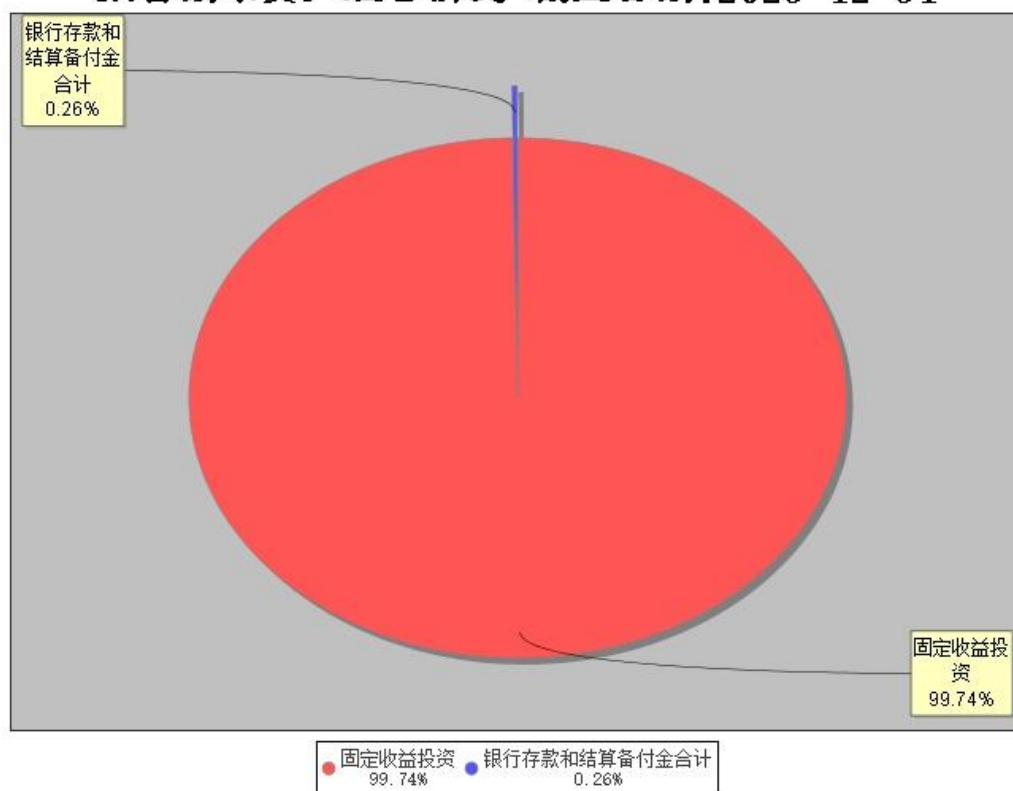
业绩比较基准 中债-3-5 年国开行债券指数*95%+银行活期存款利率(税后)*5%

本基金属于债券型基金, 风险与收益高于货币市场基金, 低于混合型基金与股票型基金。

风险收益特征 本基金为指数基金, 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。

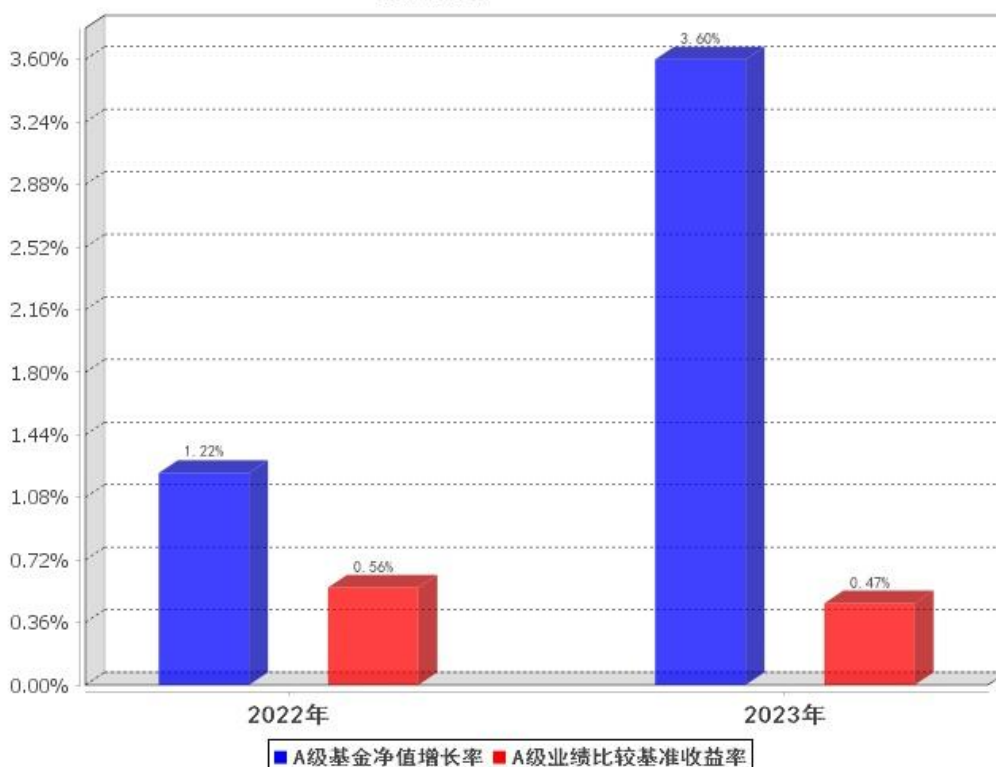
(二) 投资组合资产配置图表

报告期末资产组合情况-截止日期:2023-12-31



(三) 自基金合同生效以来/最近十年(孰短)基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

A级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图
截止日期: 2023-12-31



注: (1) 本基金基金合同生效日为 2022 年 4 月 27 日。
(2) 合同生效当年按实际存续期计算, 不按整个自然年度进行折算。
(3) 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

以下费用在申购/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	备注
申购费 (前收费)	M < 1,000,000	0.40%	其他投资者
	1,000,000 ≤ M < 5,000,000	0.20%	其他投资者
	M ≥ 5,000,000	1,000 元/笔	其他投资者
	M < 1,000,000	0.04%	特定投资群体
	1,000,000 ≤ M < 5,000,000	0.02%	特定投资群体
	M ≥ 5,000,000	1,000 元/笔	特定投资群体
赎回费	N < 7 天	1.50%	-
	N ≥ 7 天	0.00%	-

注: 特定投资群体是指全国社会保障基金、依法设立的基本养老保险基金、依法制定的企业年金计划筹集的资金及其投资运营收益形成的企业补充养老保险基金 (包括企业年金单一计划以及集合计划), 以及可以投资基金的其他社会保险基金。如将来出现可以投资基金的住房公积金、享受税收优惠的个人养老账户、经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型, 基金管理人可将其纳入特定投资群体范围。

(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、销售机构
托管费	0.05%	基金托管人
审计费用	50,000	会计师事务所
信息披露费	120,000	规定披露报刊

注：1、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。

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、基金合同生效后与本基金相关的律师费、诉讼费、仲裁费、基金份额持有人大会费用等可以在基金财产中列支的其他费用按照国家有关规定和基金合同约定在基金财产中列支。费用类别详见本基金基金合同及招募说明书或其更新。

(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：

鹏扬中债 3-5 年国开债指数 A

基金运作综合费率 (年化)

0.36%

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。

本基金的风险主要包括：市场风险、管理风险、流动性风险、操作和技术风险、合规性风险、本基金特有风险、基金管理人职责终止风险、基金自动清盘风险及其他风险等。

本基金特有的风险：本基金为指数基金，投资者投资于本基金面临标的指数波动风险、基金投资组合收益率与标的指数收益率偏离的风险、跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份券停牌或违约等潜在风险。本基金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、流动性风险、投资集中度风险等。本基金可投资国债期货，期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当相应期限国债收益率出现不利变动时，可能会导致投资人权益遭受较大损失。国债期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来重大损失。

当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人履行相应程序后，可以启用侧袋机制。侧袋机制实施期间，基金管理人将对基金简称进行特殊标识，并不办理侧袋账户的申购赎回。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。

(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。基金投资者作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。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。

基金合同生效后，基金产品资料概要的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。

与本基金/基金合同相关的争议解决方式为仲裁。因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市，具体内容详见《基金合同》。

五、 其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站 www.pyamc.com 或拨打客服电话 400-968-6688

- 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

六、 其他情况说明

无