

圆信永丰中债0-3年政策性金融债指数证券投资基金基金产品资料概要更新

编制日期：2024年12月13日

送出日期：2024年12月18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	圆信永丰中债0-3年政策性金融债指数	基金代码	022022
基金简称A	圆信永丰中债0-3年政策性金融债指数A	基金代码A	022022
基金简称C	圆信永丰中债0-3年政策性金融债指数C	基金代码C	022024
基金管理人	圆信永丰基金管理有限公司	基金托管人	兴业银行股份有限公司
基金合同生效日	2024年11月13日	上市交易所及上市日期	暂未上市
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	开始担任本基金基金经理的日期	证券从业日期	
刘莎莎	2024年11月13日	2010年03月10日	
许燕	2024年12月13日	2011年04月01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个工作日出现前述情形的，基金合同终止，不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

注：请投资者阅读《招募说明书》第九节了解详细情况。

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	本基金的投资范围主要为标的指数成份券和备选成份券，为更好实现投资目标，本基金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、政策性金融债、央行票据、债券回购、货币市场工具、国债期货、银行存款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

	<p>中国证监会相关规定)。</p> <p>本基金不投资权益类资产(包括股票、可转债)。</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。</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%;投资于待偿期0年-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%;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,本基金应当保持不低于基金资产净值5%的现金或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,其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。</p> <p>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。</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,以实现对标的指数的有效跟踪。</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%,年化跟踪误差控制在4%以内。如因标的指数编制规则调整等其他原因,导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围,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>本基金的投资策略包括优化抽样复制策略、替代性策略、其他债券投资策略、国债期货交易策略。</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与预期收益水平高于货币市场基金,低于混合型基金、股票型基金。</p> <p>本基金为指数型基金,主要采用抽样复制法跟踪标的指数的表现,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

无。

(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

无。

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:

圆信永丰中债0-3年政策性金融债指数A

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)	M<100万	0.50%	

收费)	100万≤M<300万	0.30%	
	300万≤M<500万	0.15%	
	M≥500万	1000.00元/笔	
赎回费	N<7天	1.50%	
	N≥7天	0.00%	

圆信永丰中债0-3年政策性金融债指数C

费用类型	份额(S)或金额(M)/持有期限(N)	收费方式/费率	备注
赎回费	N<7天	1.50%	
	N≥7天	0.00%	

注：C类基金份额不收取认购费用、申购费用，但从该类别基金资产中计提销售服务费。

(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	0.15%	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C	0.10%	销售机构
审计费用	4,734.30	会计师事务所
信息披露费	130,000.00	规定披露报刊
其他费用	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。	相关服务机构

注：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、信息披露费的金额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（金额单位为人民币元）。

(三) 基金运作综合费用测算

圆信永丰中债0-3年政策性金融债指数A

无。

圆信永丰中债0-3年政策性金融债指数C

无。

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、本基金特有的风险：

（1）标的指数的风险

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；
- （3）标的指数波动的风险；
- （4）基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险；
- （5）跟踪误差控制未达约定目标的风险；
- （6）标的指数变更的风险；
- （7）指数编制机构停止服务风险；
- （8）成份券停牌或违约的风险；
- （9）投资于政策性金融债的风险；
- （10）招募说明书中指数编制方案简述未及时更新的风险；
- （11）参与国债期货交易的风险；
- （12）基金合同自动终止的风险。

2、开放式基金共有的风险，如市场风险、信用风险、债券收益率曲线变动风险、再投资风险、流动性风险、管理风险、操作或技术风险、合规性风险、其他风险等。

（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。

基金管理人深知个人信息对投资者的重要性，致力于投资者个人信息的保护。基金管理人承诺按照法律法规和相关监管要求的规定处理个人投资者的个人信息。基金管理人需处理的机构投资者信息中可能涉及其法定代表人、受益所有人、经办人等个人信息，也将遵守上述承诺进行处理。投资者应保证其提供的前述个人信息真实、准确、完整，且已履行《个人信息保护法》下个人信息处理者应履行的程序，关注基金管理人官方网站（<http://www.gtsfund.com.cn>）披露的《隐私政策》及其后续做出的不时修订。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站：www.gtsfund.com.cn

客户服务电话：400-607-0088（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

六、其他情况说明

无。