

# 新疆前海联合中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金

## (C 类份额) 基金产品资料概要

编制日期: 2022-04-14

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。

送出日期: 2022-04-16

### 一、产品概况

基金简称	前海联合中债 1-3 年国开行债券指数 C	基金代码	011211
基金管理人	新疆前海联合基金管理有限公司	基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司
基金合同生效日			
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	张文	开始担任本基金基金经理的日期	-
		证券从业日期	2012-11-01
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, 基金管理人应当在 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案, 如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等, 并在 6 个月内召集基金份额持有人大会。法律法规或中国证监会另有规定时, 从其规定。		

### 二、基金投资与净值表现

#### (一) 投资目标与投资策略

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相似总回报, 追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。在正常市场情况下, 本基金力争追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%, 年跟踪误差控制在 4% 以内。
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, 还可以投资于国内依法发行上市的国债、政策性金融债、债券回购、货币市场工具、同业存单、银行存款、国债期货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相关规定。

	<p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。</p>
主要投资策略	<p>本基金为被动式指数基金,采用抽样复制和动态最优化的方法,选取标的指数成份券和备选成份券中流动性较好的债券,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。</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%,年跟踪误差控制在4%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>指数成份券发生明显负面事件面临退市或违约风险,且指数编制机构暂未作出调整的,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。</p> <p>主要投资策略包括:1、资产配置策略;2、债券投资策略;3、其他债券投资策略;4、国债期货投资策略。</p>
业绩比较基准	中债-1-3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	<p>本基金是债券型基金,理论上其预期风险和预期收益水平低于股票型基金和混合型基金,高于货币市场基金。</p> <p>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。</p>

注:投资者可阅读《新疆前海联合中债1-3年国开行债券指数证券投资基金招募说明书》第九部分“基金的投资”了解详细情况

#### (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/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

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:

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%	
	7天≤N<30天	0.10%	
	30天≤N	0.00%	

注:本基金C类份额无认购费/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
------	----------

管理费	0.15%
托管费	0.05%
销售服务费	0.10%
其他	《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用、会计师事务所费、律师费、仲裁费、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；基金的证券、期货账户开户费用、银行账户维护费用；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：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。

#### 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、本基金特有风险

（1）本基金为债券型基金，本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%。债券的投资收益会受到宏观经济、货币政策、市场需求变化等因素的影响，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）本基金为被动式指数基金，采用抽样复制和动态最优化的方法，选取标的指数成份券和备选成份券中流动性较好的债券，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。指数化投资的主要风险包括：标的指数波动的风险、标的指数计算出错的风险、基金跟踪偏离风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险、指数编制机构停止服务的风险、成份券停牌的风险、成份券违约的风险等。

##### （3）投资国债期货的风险

本基金可投资于国债期货，国债期货作为一种金融衍生品，具备一些特有的风险点。投资国债期货主要存在以下风险：市场风险、流动性风险、基差风险、保证金风险、信用风险、操作风险等。

##### （4）投资政策性金融债的风险

①政策性银行改制后的信用风险。若未来政策性银行进行改制，政策性金融债的性质有可能发生较大变化，债券信用等级也可能相应调整，基金投资可能面临一定信用风险。

②政策性金融债的流动性风险。政策性金融债市场投资者行为具有一定趋同性，在极端市场环境下，可能集中买进或卖出，增加流动性风险。

③投资集中度风险。政策性金融债发行人较为单一，若单一主体发生重大事项变化，可能对基金净值表现产生较大影响。

##### 2、实施侧袋机制对投资者的影响

侧袋机制是一种流动性风险管理工具，是将特定资产分离至专门的侧袋账户进行处置清算，并以处置变现后的款项向基金份额持有人进行支付，目的在于有效隔离并化解风险。但基金启用侧袋机制后，侧袋账户份额将停止披露基金份额净值，并不得办理申购、赎回和转换，仅主袋账户份额正常开放赎回，因此启用侧袋机制时持有基金份额的持有人将在启用侧袋机制后同时持有主袋账户份额和侧袋账户份额，侧袋账户份额不能赎回，其对应特定资产的变现时间具有不确定性，最终变现价格也具有不确定性并且有可能大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，基金份额持有人可能因此面临损失。实施侧袋机制期间，因本基金不披露侧袋账户份额的净值，即便基金管理人在基金定期报告中披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的，

也不作为特定资产最终变现价格的承诺，因此对于特定资产的公允价值和最终变现价格，基金管理人不承担任何保证和承诺的责任。基金管理人将根据主袋账户运作情况合理确定申购政策，因此实施侧袋机制后主袋账户份额存在暂停申购的可能。启用侧袋机制后，基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时仅需考虑主袋账户资产，基金业绩指标应当以主袋账户资产为基准，因此本基金披露的业绩指标不能反映特定资产的真实价值及变化情况。

3、本基金主要风险还有市场风险、管理风险、流动性风险、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险、合规性风险、其他风险。

本基金风险详见《新疆前海联合中债1-3年国开行债券指数证券投资基金招募说明书》第十七部分“风险揭示”。

## **(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3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、准确的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。

各方当事人同意，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，应提交上海国际经济贸易仲裁委员会，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为上海市，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。

## **五、其他资料查询方式**

以下资料详见新疆前海联合基金管理有限公司官方网站[[www.qh1hfund.com](http://www.qh1hfund.com)][客服电话：4006-4000-99；0755-88697000]

《新疆前海联合中债1-3年国开行债券指数证券投资基金基金合同》、  
《新疆前海联合中债1-3年国开行债券指数证券投资基金托管协议》、  
《新疆前海联合中债1-3年国开行债券指数证券投资基金招募说明书》  
定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告  
基金份额净值  
基金销售机构及联系方式  
其他重要资料

## **六、其他情况说明**

无。