

汇安中债-广西壮族自治区公司信用类债券指数证券投资基金

基金产品资料概要（更新）

编制日期：2021年3月8日

送出日期：2021年3月9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	汇安中债-广西信用债	基金代码	008549
下属基金简称	汇安中债-广西信用债A		汇安中债-广西信用债C
下属基金代码	008549		008550
下属前端交易代码	-		-
下属后端交易代码	-		-
基金管理人	汇安基金管理有限责任公司	基金托管人	招商银行股份有限公司
基金合同生效日	2019-12-27	上市交易所及上市日期	-
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	每个交易日
基金经理	张再奇	开始担任本基金基金经理的日期	2019-12-27
		证券从业日期	2014-08-11
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

投资目标	本基金采用被动式指数化投资，通过抽样复制法选择合适的债券进行投资，以实现对标指数的有效跟踪。
投资范围	本基金主要投资于中债-广西壮族自治区公司信用类债券指数的成份券和具有良好流

动性的固定收益类金融工具，包括国债、中央银行票据、金融债、地方政府债券、企业债、公司债、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、期限在一年以内（含一年）的银行存款、同业存单及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

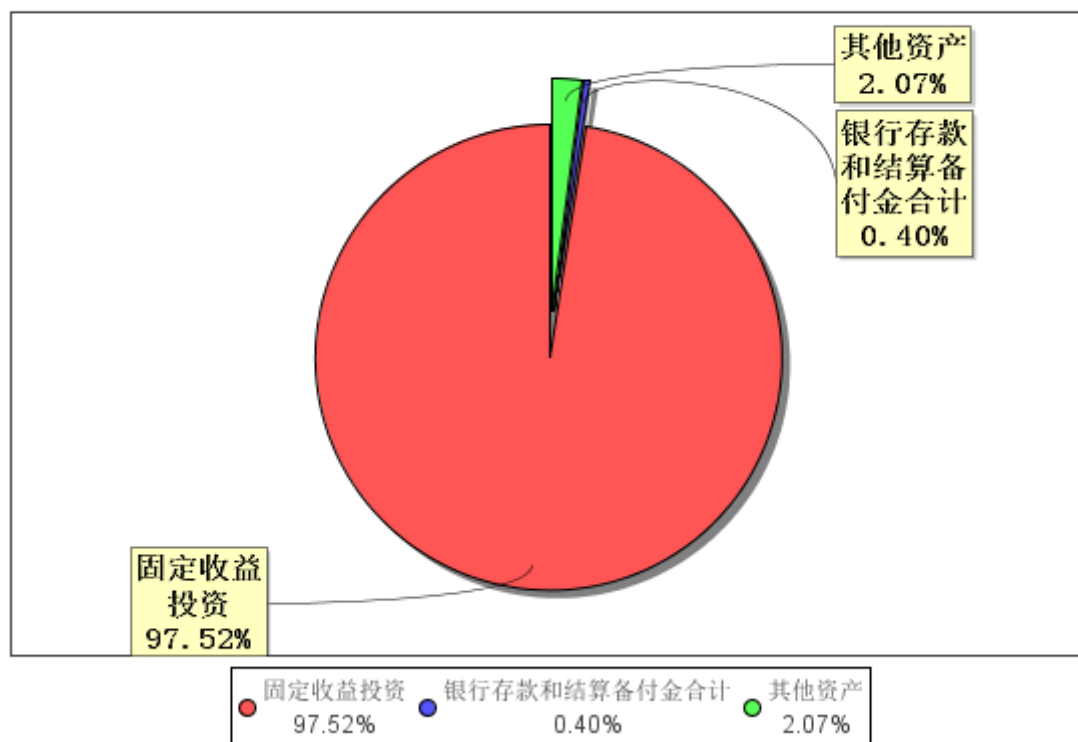
如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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%；本基金持有的现金或者到期日在一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、存出保证金和应收申购款等。

主要投资策略	本基金为被动式指数基金，采用抽样复制法，主要以标的指数的成份券构成为基础，综合考虑跟踪效果、操作风险等因素构建投资组合，并根据本基金资产规模、日常申赎情况、市场流动性以及债券特性、交易惯例等情况，进行优化，选择合适的债券进行投资，以实现对标的指数的有效跟踪。
业绩比较基准	中债-广西壮族自治区公司信用类债券指数收益率×95%+同期银行存款活期利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为债券型指数基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金、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

投资组合资产配置图表
数据截止日期：2020年9月30日



（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

—
—

注：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：

汇安中债-广西信用债 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（前收费）	M<1,000,000	0.8%	—
	1,000,000≤M<2,000,000	0.5%	—
	2,000,000≤M<5,000,000	0.3%	—
	M≥5,000,000	1000元/笔	—
赎回费	N<7日	1.5%	—
	7日≤N<30日	0.1%	—
	N≥30日	0%	—

汇安中债-广西信用债 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日	1.5%	—
	7日≤N<30日	0.1%	—
	N≥30日	0%	—

申购费：本基金A类基金份额的申购费用由A类基金份额投资者承担，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用，不列入基金财产。

赎回费：本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对于持有期限不满7日的基金份额持有人，收取的赎回费全额计入基金财产；对于持有期满7日（含）不满30日的基金份额持有人，将赎回费总额的25%计入基金财产。未计入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。如法律法规对赎回费的强制性规定发生变动，本基金将依新法规进行修改，不需召开基金份额持有人大会。

（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	0.30%
托管费	0.10%
汇安中债-广西信用债A	—
销售服务费	0.50%
汇安中债-广西信用债C	

注：1、本基金以下费用，按实际发生额从基金资产扣除：

- （1）《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- （2）《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；

- （3）基金份额持有人大会费用；
- （4）基金的证券交易费用；
- （5）基金的银行汇划费用；
- （6）基金的相关账户的开户及维护费用；
- （7）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。

2、基金标的指数许可使用费

本基金作为指数基金，需根据与中债金融估值中心有限公司签署的指数许可使用协议的约定向中债金融估值中心有限公司支付指数许可使用费。指数许可使用费费率水平根据基金资产季度平均净值分档设置。

（1）基金资产季度平均净值为10亿人民币以下（不包括10亿人民币整），季度费率为1bp，年度费率为4bp；

（2）基金资产季度平均净值为10亿-20亿人民币之间（包括10亿人民币整，不包括20亿人民币整），季度费率为0.75bp，年度费率为3bp；

（3）基金资产季度平均净值超过20亿人民币（包括20亿人民币整），季度费率为0.625bp，年度费率为2.5bp。

注：1bp=基本点数=1/10,000=0.01%。

指数许可使用费按前一日的基金资产净值与基金资产季度平均净值所适用的年度费率计提。指数许可使用费每日计算，逐日累计。

计算方法如下：

$H = E \times \text{基金资产季度平均净值所适用的年度费率} / \text{当年天数}$

H为每日应计提的指数许可使用费

E为前一日的基金资产净值

指数许可使用费的计费时间从基金成立日的后一日开始计算；基金成立的首个季度费用按照基金成立日所在季度剩余自然日计提。

指数许可使用费的支付方式为每季度支付一次，由基金管理人向基金托管人发送划付指令，经基金托管人复核后于每年1月，4月，7月，10月的前十个工作日内从基金资产中一次性向中债金融估值中心有限公司支付上一季度的指数许可使用费。

如果标的指数使用相关费用的计算方法和费率等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算相关费用。基金管理人应及时按照《信息披露办法》的规定在指定媒介进行公告。

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、投资于本基金的主要风险有：市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、管理风险、合规风险、本基金的特有风险、基金管理人职责终止风险、启用侧袋机制的风险及其他风险。

2、本基金特有风险包括：

（1）标的指数波动的风险

标的指数成份券的价格可能受到政治因素、经济因素、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数值波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。

（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）基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

以下因素可能使基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离：

1）由于标的指数调整成份债券或变更编制方法，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度与跟踪误差。

2）由于标的指数成份债券在标的指数中的权重发生变化，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差。

3）由于标的指数是每天将利息进行再投资的，而组合债券利息收入只在卖券时和债券付息时才收到利息部分的现金，然后才可能进行这部分资金的再投资，因此在利息再投资方面可能会导致基金收益率偏离标的指数收益率，从而产生跟踪偏离度。另外，指数成份债券在付息时，根据法规，持有人需缴纳利息税，因此实际收到的利息金额将低于票面利息金额，相应的，利息再投资收益也较全额票面利息降低，该两方面差异也进一步导致基金收益率偏离标的指数收益率和加大跟踪误差偏离度。

4）由于成份债券流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合或承担冲击成本而产生跟踪偏离度和跟踪误差。

5）由于基金投资过程中的证券交易成本，以及基金管理费和托管费等费用的存在，使基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度与跟踪误差。

6）在本基金指数化投资过程中，基金管理人的管理能力，例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等，都会对本基金的收益产生影响，从而影响本基金对标的指数的跟踪程度。

7）其他因素产生的偏离。基金投资组合中个别债券的持有比例与标的指数中该债券的权重可能不完全相同；因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大；因基金申购与赎回带来的现金变动；因指数发布机构指数编制错误等，由此产生跟踪偏离度与跟踪误差。

（4）跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内，年化跟踪误差控制在4%以内，但因标的指数编制规则调整或其他因素可能导致跟踪误差超过上述范围，本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

（5）标的指数值计算出错的风险

尽管指数编制机构将采取一切必要措施以确保指数的准确性，但不对此作任何保证，亦不因指数的任何错误对任何人负责。因此，如果标的指数值出现错误，投资人参考指数值进行投资决策，则可能导致损失。

（6）标的指数变更的风险

根据基金合同规定，如发生导致标的指数变更的情形，基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，变更标的指数并调整基金的业绩比较基准，基金投资组合将随之调整，届时基金的风险收益特征将可能发生变化，投资人须承担此项调整带来的风险与成本。

（7）指数编制机构停止服务的风险

本基金的标的指数由指数编制机构发布并管理和维护，未来指数编制机构可能由于各种原因停止对指数的管理和维护，本基金将根据基金合同的约定自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、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进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，本基金合同终止。投资人将面临更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等风险。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定并实施前，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作，该期间由于标的指数不再更新等原因可能导致指数表现与相关市场表现存在差异，影响投资收益。

（8）成份券停牌或违约的风险

可能面临因成份券发行人不能按时支付债券利息或偿还本金，从而带来损失的风险。

本基金运作过程中，当指数成份券发生明显负面事件面临停牌或违约风险，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，由此可能影响投资者的投资损益并使基金产生跟踪偏离度和跟踪误差。

（9）资产支持证券投资风险

（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.huianfund.cn][010-56711690]

- 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。