大成深证基准做市信用债交易型开放式指数证券投资基金

基金产品资料概要更新

编制日期：2026 年 11 月 16 日

送出日期：2026 年 11 月 19 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	大成深证基准做市信用债 ETF	**基金代码**	159395
基金管理人	大成基金管理有限公司	**基金托管人**	兴业银行股份有限公司
上市交易所及上市日期	深圳证券交易所		2025 年 1 月 27 日
基金合同生效日	2025 年 1 月 16 日		
基金类型	债券型	**交易币种**	人民币
运作方式	交易型开放式	**开放频率**	每个开放日
基金经理	万晓慧	**开始担任本基金基金经理的日期**	2025 年 1 月 16 日
		证券从业日期	2016 年 5 月 9 日
基金经理	方锐	**开始担任本基金基金经理的日期**	2025 年 7 月 10 日
		证券从业日期	2016 年 11 月 10 日
基金经理	石丽君	**开始担任本基金基金经理的日期**	2026 年 11 月 16 日
		证券从业日期	2019 年 5 月 6 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。 基金场内简称：信用债 ETF 大成		

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

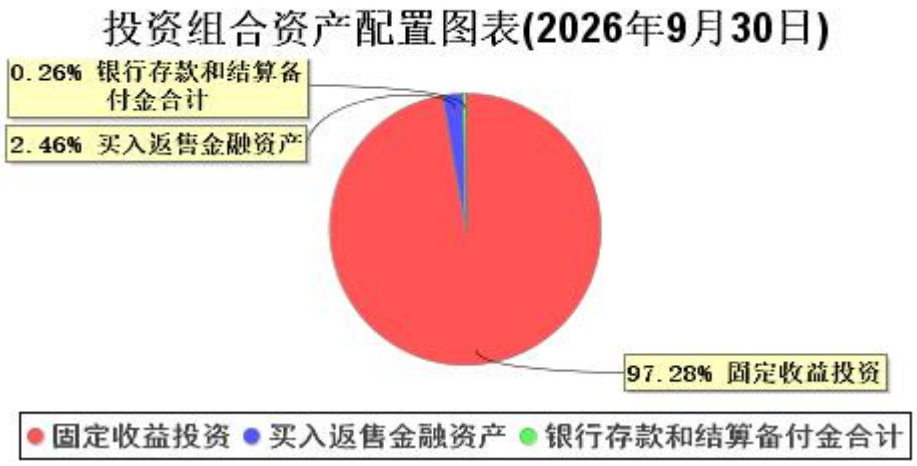
详见《大成深证基准做市信用债交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书》第十部分“基金的投资”。

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。力争本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。

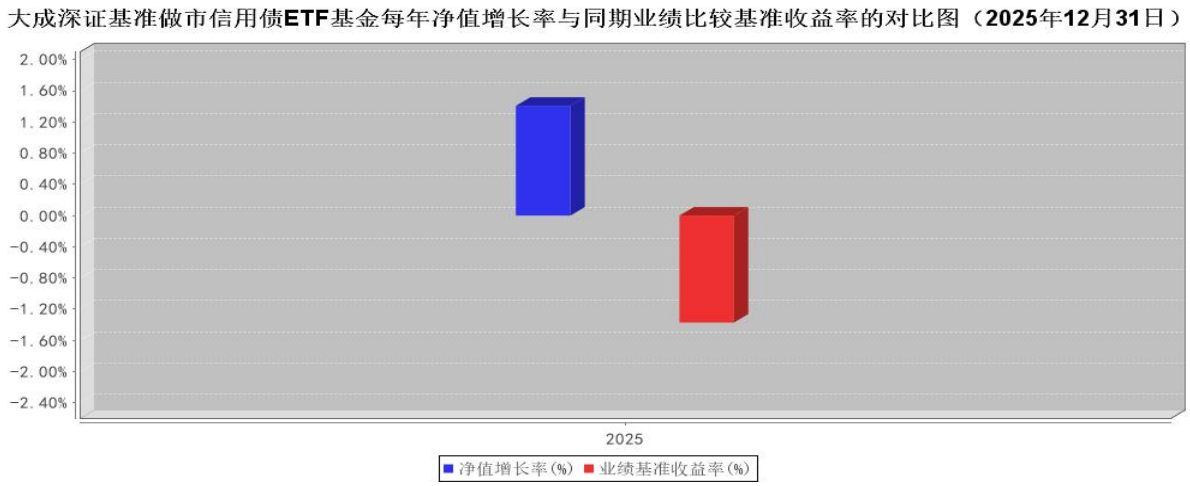
投资范围	本基金的标的指数为深证基准做市信用债指数。 本基金主要投资于标的指数成份债券和备选成份债券。为更好地实现基金的投资目标，本基金可以投资国内依法发行、上市的债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债券、企业债券、公司债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据、公开发行的次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、可分离交易可转债的纯债部分）、资产支持证券、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、债券回购、国债期货、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。 在建仓完成后，本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的 80%；本基金投资于标的指数成份债券和备选成份债券的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。本基金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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。 如果法律法规对该比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，本基金做相应调整。
主要投资策略	本基金为指数基金，主要采用代表性分层抽样复制策略，投资于标的指数中具有代表性的部分成份券，或选择非成份券作为替代，使得债券投资组合的总体特征（如久期、剩余期限分布和到期收益率等）与标的指数相似。 （一）分层抽样策略 分层抽样复制法指的是采用一定的抽样方法从构成指数的成份债券中抽取若干成份债券构成用于复制指数跟踪组合的方法。采取该方法可以在控制跟踪误差的基础上，进一步减少组合维护及再平衡所需的费用。 本基金将首先通过对标的指数中各成份债券的信用评级、历史流动性及收益率等进行分析，初步选择流动性较好的成份券作为备选，其次将通过对标的指数按照久期、剩余期限、信用等级、到期收益率以及债券发行主体等进行分层抽样，以使构建组合与标的指数在以上特征上尽可能相似，达到复制标的指数、降低交易成本的目的。 由于采用抽样复制，本基金组合中的个券只数、权重与标的指数可能存在差异。此外本基金在控制跟踪误差的前提下，可通过风险可控的积极管理获得超额收益，以弥补基金费用等管理成本，控制与标的指数的偏离度。 （二）替代性策略 若成份券遇到包括但不限于债券还本派息、退市、流动性不足、债券到期等法规限制或组合优化需要等情况，基金管理人可以部分持有现金或在成份券及备选成份券外寻找其他债券构建替代组合，对指数进行跟踪复制。 替代组合的构建将以债券流动性为约束条件，按照与被替代债券久期相近、信用评级相似、到期收益率及剩余期限基本匹配为主要原则，控制替代组合与被替代债券的跟踪偏离度和跟踪误差最小化。 当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。 （三）债券投资策略 （四）资产支持证券投资策略 （五）衍生品投资策略

业绩比较基准	深证基准做市信用债指数收益率
风险收益特征	本基金属于债券型基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金与股票型基金。 本基金属于指数基金，采用分层抽样复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的债券市场组合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：1、基金的过往业绩不代表未来表现。

2、如合同生效当年不满完整自然年度的，按实际期限计算净值增长率。

三、投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

（1）投资人在申购或赎回本基金时，申购赎回代理机构可按照不超过 0.50%标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记机构等收取的相关费用。

（2）场内交易费用以证券公司实际收取为准。

(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	80,000.00 元	会计师事务所
信息披露费	120,000.00 元	规定披露报刊
其他费用	《基金合同》生效后与基金相关的律师费、仲裁费和诉讼费；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、账户开户及维护费用；基金上市费及年费、注册登记费用、IOPV 计算与发布费用（如有）、收益分配中发生的费用；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：

基金运作综合费率（年化）
0.20%

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。

本基金为交易型开放式指数基金，采用分层抽样复制策略跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数以及标的指数所代表的市场的风险收益特征相似，其面临的主要风险包括市场风险、管理风险、操作风险、技术风险、不可抗力、特有风险和其他风险。

本基金的特定风险：

（1）标的指数回报与债券市场平均回报偏离的风险；（2）标的指数波动的风险；（3）基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险；（4）标的指数变更的风险；（5）跟踪误差控制未达约定目标的风险；（6）成份券停牌的风险；（7）成份券违约的风险；（8）指数编制机构停止服务的风险；（9）基金合同终止的风险；（10）基金份额二级市场交易价格折溢价的风险；（11）参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险；（12）退市风险；（13）投资人申购赎回失败的风险；（14）申购赎回的代理买卖风险；（15）资产支持证券风险；（16）投资国债期货的风险；（17）流动性风险评估；（18）第三方机构服务的风险；（19）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。

(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，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

大成深证基准做市信用债交易型开放式指数证券投资基金经中国证监会 2024 年 12 月 31 日证监许可【2024】1968 号文注册募集。

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. 大成深证基准做市信用债交易型开放式指数证券投资基金基金合同、大成深证基准做市信用债交易型开放式指数证券投资基金托管协议、大成深证基准做市信用债交易型开放式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