

汇百川 CFETS0-5 年期气候变化高等级债券综合指数证券投资基金基金产品资料概要

编制日期：2026 年 03 月 09 日

送出日期：2026 年 03 月 13 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	汇百川 CFETS0-5 年期 气候变化高等级债券综 合指数	基金代码	026415
基金管理人	汇百川基金管理有限公 司	基金托管人	上海浦东发展银行股份 有限公司
基金合同生效日	-	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	开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	倪伟	开始担任本基金基金 经理的日期	-
		证券从业日期	2015 年 11 月 13 日
其他	<p>1、《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，本基金将根据基金合同第十九部分的约定进行基金财产清算并终止，而无须召开基金份额持有人大会。2、未来若出现标的指数不符合要求（因成份券价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求及法律法规、监管机构另有规定的情形除外）、指数编制机构退出、标的指数许可使用授权终止等情形，基金管理人应当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，基金合同终止。3、若将来本基金管理人推出跟踪同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），则基金管理人在履行适当程序后有权决定将本基金转换为该 ETF 的联接基金，并相应修改《基金合同》。在遵守法律法规有关联接基金规定的前提下，基金投资目标、投资范围和投资策略等条款中将增加投资目标 ETF 的相关内容，同时相应变更基金名称、类别。此项调整需经基金管理人与基金托管人协商一致，履行适当程序后及时公告，无需召开基金份额持有人大会审议。</p>		

注：本基金类型为债券指数型

## 二、基金投资与净值表现

### (一) 投资目标与投资策略

请投资者详细阅读《汇百川 CFETS0-5 年期气候变化高等级债券综合指数证券投资基金招募说明书》第九部分了解详细情况。

<b>投资目标</b>	<p>本基金采用被动式指数化投资，以标的指数的成份券及备选成份券为主要投资对象来实现对标的指数的有效跟踪，力争实现与标的指数表现相似的长期回报。在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。</p>
<b>投资范围</b>	<p>本基金标的指数为 CFETS 0-5 年期气候变化高等级债券综合指数。</p> <p>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，包括非属成份券及备选成份券的债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可分离交易可转债的纯债部分及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、现金、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的相关规定)。</p> <p>本基金不投资于股票等资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。</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>本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，本基金投资于标的指数成份券和备选成份券的比例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，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、应收申购款等。</p> <p>如果法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。</p>
<b>主要投资策略</b>	<p>本基金将对标的指数采用抽样复制法和动态最优化的方式进行投资，在综合考虑跟踪效果、操作风险、投资可行性等因素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，构建与标的指数风险收益特征相似的资产组合，力争实现对标的指数的有效跟踪。</p> <p>在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则或其他因素导致跟踪偏离度、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>当标的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基金份额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>本基金具体的投资策略包括气候变化高等级债券指数化投资策略、其他债券投资策略、流动性管理策略以及衍生产品投资策略等。</p>
<b>业绩比较基准</b>	CFETS 0-5 年期气候变化高等级债券综合指数收益率
<b>风险收益特征</b>	本基金为债券型基金，其预期风险及预期收益水平理论上高于货币市场基金，低于混合型基金及股票型基金。

本基金为指数型基金，主要采用抽样复制法和动态最优化的方式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。

**(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
认购费	M<100 万元	0.3%	直销机构不收取认购费用
	100 万元≤M<500 万元	0.1%	直销机构不收取认购费用
	M≥500 万元	1000.00 元/笔	直销机构不收取认购费用
申购费(前收费)	M<100 万元	0.3%	直销机构不收取申购费用
	100 万元≤M<500 万元	0.1%	直销机构不收取申购费用
	M≥500 万元	1000.00 元/笔	直销机构不收取申购费用
赎回费	N<7 天	1.5%	100%归入基金资产
	7 天≤N<30 天	1%	100%归入基金资产
	N≥30 天	0%	

注：1、通过直销机构认/申购本基金基金份额的，在认/申购时不收取认/申购费用。

2、通过除直销机构以外的其他销售机构认/申购本基金基金份额的认/申购费由投资者承担，认/申购费按每笔基金份额认/申购申请单独计算。基金认/申购费用不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等募集期间发生的各项费用。

3、N 为自然日。

4、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。赎回费用全额归入基金财产。

**(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
其他费用	详见本基金《招募说明书》第十三部分“基金的费用与税收”	

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、上表中年费用金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

## 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、本基金特有的风险

- （1）标的指数的风险
- （2）跟踪误差控制未达约定目标的风险
- （3）指数编制机构停止服务的风险
- （4）成份券停牌、摘牌或违约的风险
- （5）国债期货投资风险
- （6）资产支持证券投资风险
- （7）自动终止的风险
- （8）基金转换为联接基金的风险
- （9）证券经纪商交易结算模式的风险

#### 2、本基金面临的其他风险

市场风险、管理风险、流动性风险、操作或技术风险、交易对手风险、合规性风险、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、启用侧袋机制的风险和其他风险。具体详见本基金《招募说明书》的风险揭示部分。

### （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。

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（上海国际仲裁中心），根据该会届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。除非仲裁裁

决另有规定，仲裁费用由败诉方承担。

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。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[[www.riversfund.com](http://www.riversfund.com)][客服电话：400-101-1190]

1、《汇百川 CFETS0-5 年期气候变化高等级债券综合指数证券投资基金基金合同》、《汇百川 CFETS0-5 年期气候变化高等级债券综合指数证券投资基金托管协议》、《汇百川 CFETS0-5 年期气候变化高等级债券综合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

## 六、其他情况说明

无。