

兴业中证国有企业改革指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新

编制日期：2020年08月27日

送出日期：2020年08月29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	兴业中证国有企业改革指数增强	基金代码	005339
基金简称A	兴业中证国有企业改革指数增强A	基金代码A	005339
基金简称C	兴业中证国有企业改革指数增强C	基金代码C	008220
基金管理人	兴业基金管理有限公司	基金托管人	招商银行股份有限公司
基金合同生效日	2018年07月26日	上市交易所及上市日期	暂未上市
基金类型	股票型	交易币种	人民币
运作方式	开放式（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	
WEIDONG WU（吴卫东）	2018年07月26日	1994年11月01日	
那赛男	2018年09月10日	2009年08月27日	

二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

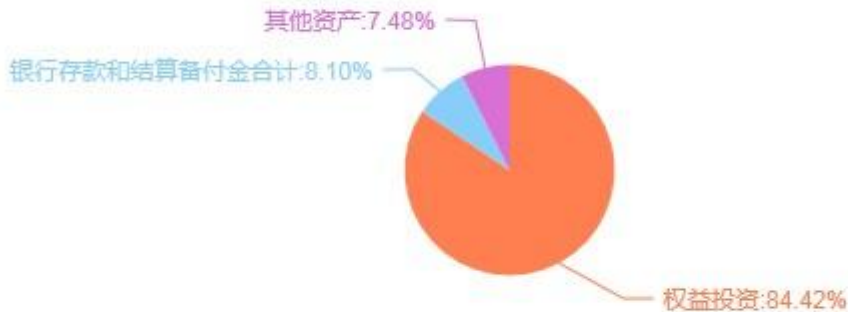
该部分内容基金投资者可通过阅读本基金《招募说明书》中“基金的投资”章节了解详细情况。

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，在力求对中证国有企业改革指数进行有效跟踪的基础上，结合增强型的主动投资，力争使本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年跟踪误差不超过7.75%，以实际高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。
投资范围	本基金为增强型股票指数基金，标的指数为中证国有企业改革指数。 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、股指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

	<p>定。</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，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的80%，其中投资于中证国有企业改革指数成份股及备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%。其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。</p>
主要投资策略	<p>本基金为实现有效跟踪并力争超越标的指数的投资目标，在资产类别配置上，股票资产占基金资产的比例不低于80%，投资于中证国有企业改革指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的80%。本基金还将根据宏观经济趋势、资产估值水平、市场政策等因素的变化在本基金的投资范围内进行适度动态调整股票和债券等资产的配置比例。</p>
业绩比较基准	<p>中证国有企业改革指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%</p>
风险收益特征	<p>本基金为股票指数增强型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。</p>

(二) 投资组合资产配置图表 / 区域配置图表

数据截止日：20200630



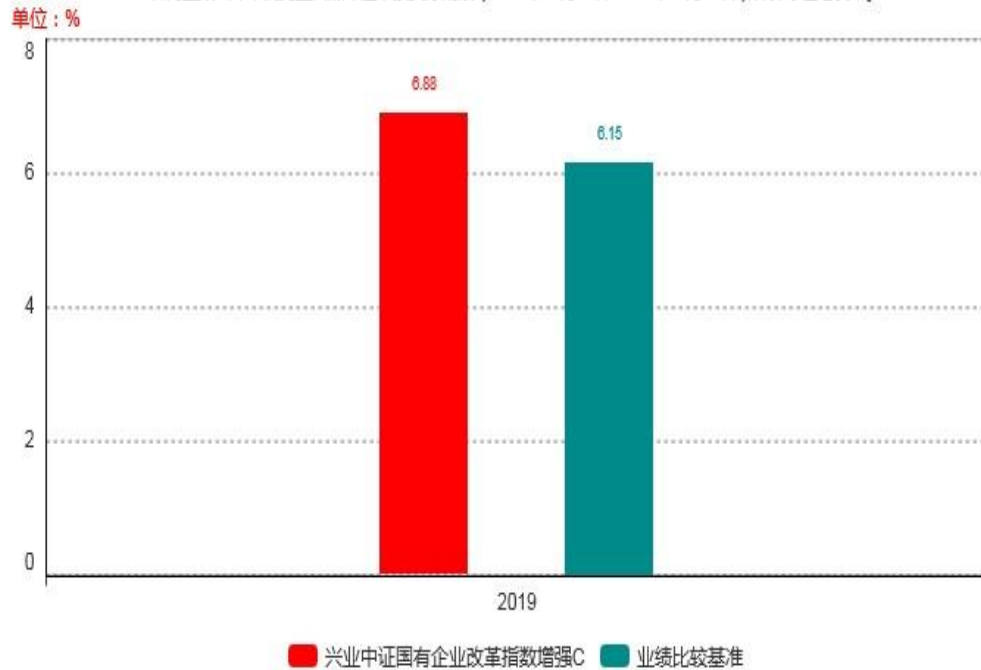
(三) 自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

基金的过往业绩不代表未来表现，数据截止日：2019年12月31日



基金的过往业绩不代表未来表现。

合同生效当年不满完整自然年度，按实际期限（2019年11月18日-2019年12月31日）计算净值增长率。



注：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。基金的过往业绩不代表未来表现。

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：

兴业中证国有企业改革指数增强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<50万	1.20%	
	50万≤M<100万	0.80%	
	100万≤M<500万	0.40%	
	500万≤M	1000.00元/笔	
赎回费	N<7天	1.50%	
	7天≤N<30天	0.75%	
	30天≤N<365天	0.50%	
	365天≤N	0.00%	

兴业中证国有企业改革指数增强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%	
	7天≤N<30天	0.50%	
	30天≤N	0.00%	

申购费 C: C类基金份额不收取申购费

(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	1.00%
托管费	0.15%
销售服务费A	0.00%
销售服务费C	0.40%
标的指数许可使用费	0.016%

本基金需根据与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付指数许可使用费。

通常情况下,指数许可使用费按照前一日基金资产净值的0.016%的年费率进行计提,且收取下限为每季人民币5万元。计费期间不足一季度的,根据实际天数按比例计算。

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。

本基金主要投资于证券市场，承担的风险包括因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险等。

另外，本基金特有风险包括：

1、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

标的指数为主题指数，并不能完全代表整个股票市场。标的指数成份股的平均回报率与整个股票市场的平均回报率存在偏离。

2、标的指数的系统性风险

标的指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资人心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。

3、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

由于标的指数调整成份股或变更编制方法、标的指数成份股发生配股或增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化、成份股派发现金红利、新股市值配售、成份股停牌或摘牌、股流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合以及与基金运作相关的费用等因素使本基金产生跟踪偏离度和跟踪误差。

4、主动增强投资的风险

根据本基金的投资策略，为了获得超越指数的投资回报，可以在被动跟踪指数的基础上进行一些优化调整，如在一定幅度内减少或增强成份股的权重、替换或者增加一些非成份股。调整投资组合的决策存在一定的不确定性，其投资收益率可能高于指数收益率但也有可能低于指数收益率。

5、本基金可投资中小企业私募债券，中小企业私募债券是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。由于不能公开交易，一般情况下，交易不活跃，潜在较大流动性风险。当发债主体信用质量恶化时，受市场流动性所限，本基金可能无法卖出所持有的中小企业私募债券，由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。

6、本基金可投资于股指期货，股指期货作为一种金融衍生品，具备一些特有的风险点。投资股指期货所面临的主要风险是市场风险、流动性风险、基差风险、保证金风险、信用风险和操作风险等。具体为：

1) 市场风险是指由于股指期货价格变动而给投资人带来的风险。市场风险是股指期货投资中最主要的风险。

2) 流动性风险是指由于股指期货合约无法及时变现所带来的风险。

3) 基差风险是指股指期货合约价格和标的指数价格之间价格差的波动所造成的风险，以及不同股指期货合约价格之间价格差的波动所造成的期限价差风险。

4) 保证金风险是指因股指期货采用保证金交易而存在杠杆，使基金财产可能产生更大收益波动的风险。

5) 信用风险是指期货经纪公司违约而产生损失的风险；

6) 操作风险是指由于内部流程的不完善，业务人员出现差错或者疏漏，或者系统出现故障等原因造成损失的风险。

7、本基金投资资产支持证券，资产支持证券是一种债券性质的金融工具。资产支持证券的风险主要包括资产风险及证券化风险。资产风险源于资产本身，包括价格波动风险、流动性风险等。证券化风险主要表现为信用评级风险、法律风险等。

（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。

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，任何一方均有权将争议提交华南国际经济贸易仲裁委员会，按照华南国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为深圳市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，《基金合同》当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

《基金合同》受中国法律（为本基金合同之目的，不含港澳台地区法律）管辖。

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<http://www.cib-fund.com.cn> 或拨打客服热线4000095561咨询。

基金合同、托管协议、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

本基金产品资料概要中涉及的与托管相关的基金信息已经本基金托管人复核。除非另有说明，本基金产品资料概要所载内容截止日为2020年8月20日，投资组合资产配置图表 / 区域配置图表数据截止日为2020年6月30日，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数据截止日为2019年12月31日（本基金产品资料概要中的财务数据未经审计）。