

国联安中小企业综合指数证券投资基金 (LOF)

基金产品资料概要更新

编制日期：2021-04-12

送出日期：2021-05-20

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	国联安中小综指 (LOF)	基金代码	162510
基金管理人	国联安基金管理有限公司	基金托管人	中国建设银行股份有限公司
基金合同生效日	2012-03-23	上市交易所及上市日期	深交所 / 2015-05-20
基金类型	股票型	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	黄欣	开始担任本基金基金经理的日期	2016-08-19
		证券从业日期	2002-11-01
其他	本基金的封闭期于 2015 年 3 月 23 日到期。根据基金合同的有关规定，本基金的基金合同生效满三年后，本基金无需召开基金份额持有人大会，即转换为上市开放式基金 (LOF)。		

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

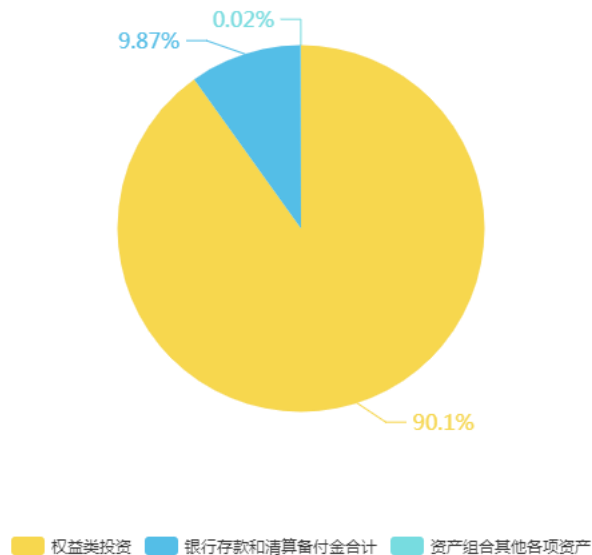
投资目标	本基金进行被动式指数化投资，通过严谨的数量化管理和投资纪律约束，力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，为投资者提供一个投资中小企业综合指数的有效工具，从而分享中国经济中长期增长的稳定收益。
投资范围	<p>本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股、新股（包含原中小板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为 85%—100%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；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，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证以及其他金融工具的投资比例符合法律法规和中国证监会的规定。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，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>本基金管理人自《基金合同》生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合上述相关规定。</p> <p>本基金的标的指数为中小企业综合指数。</p>

主要投资策略	本基金采用市值优先兼顾行业分层的抽样复制的方法来复制标的指数。选择数量合理的成分股，构建目标组合，实现稳定地跟踪目标指数的目的。
业绩比较基准	95%×中小企业综合指数+5%×活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为被动投资型指数基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。

注：敬请投资者阅读更新的《招募说明书》相关章节了解详细情况。

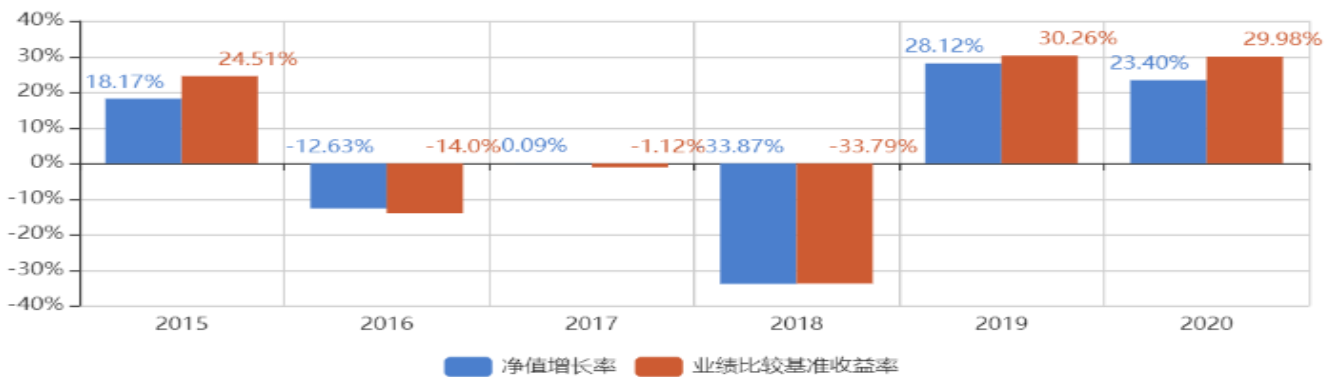
(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表截止日为2021-03-31



(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

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. 净值表现数据截止日为2020年12月31日。

2. 本基金于2015年3月24日由国联安双力中小板综指分级证券投资基金转型而来，合同生效当年净值增长率按实际存续期计算；原国联安双力中小板综指分级证券投资基金的基金合同于2012年3月23日生效，其A份额及B份额分别于2015年3月23日日终转换为国联安双力中小板综指证券投资基金的基金份额，并于2015年3月24日更名为国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)；原国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)于2021年4月6日更名为国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)；

3. 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：

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<100 万元	1.2%	非养老金客户
	100 万元≤M<500 万元	0.7%	非养老金客户
	500 万元≤M<1000 万元	0.2%	非养老金客户
	1000 万元≤M	1000 元/笔	非养老金客户
	M<100 万元	0.48%	养老金客户
	100 万元≤M<500 万元	0.28%	养老金客户
	500 万元≤M<1000 万元	0.08%	养老金客户
	1000 万元≤M	1000 元/笔	养老金客户
赎回费	N<7 天	1.5%	场外赎回费
	7 天≤N<365 天	0.5%	场外赎回费
	365 天≤N<730 天	0.25%	场外赎回费
	730 天≤N	0%	场外赎回费
	N<7 天	1.5%	场内赎回费
	7 天≤N	0.5%	场内赎回费

注： 敬请投资者阅读更新的《招募说明书》及销售机构相关公告了解详细情况。

（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	0.75%
托管费	0.22%
销售服务费	0.00%
其他费用	《基金合同》生效后与基金相关的标的指数许可使用费、信息披露费用、会计师费、律师费、诉讼费；基金上市费及年费；基金收益分配中发生的费用；基金份额持有人大会费用；基金的证券交易费用；基金的银行汇划费用；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。

本基金在投资运作过程中面临一定的市场风险、信用风险、管理风险、流动性风险、操作风险、合规性风险、其他风险及本基金特有的风险。

1. 市场风险：本基金主要投资于证券期货市场，而证券期货市场价格因受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而产生波动，使基金运作客观上面临一定的市场风险。

2. 信用风险：信用风险主要指债券、资产支持证券、短期融资券等信用证券发行主体信用状况恶化，到期不能履行合约进行兑付的风险，另外，信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。

3. 管理风险：基金管理人的专业技能、研究能力及投资管理水平直接影响到其对信息的占有、分析和对经济形势、证券价格走势的判断，进而影响基金的投资收益水平。同时，基金管理人的投资管理制度、风险管理和内部控制制度是否健全，能否有效防范道德风险和其他合规性风险，以及基金管理人的职业道德水平等，也会对基金的风险收益水平造成影响。

4. 流动性风险：流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。

5. 操作风险：在基金的运作过程中，可能因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，或者技术系统的故障差错而影响交易的正常进行甚至导致基金份额持有人利益受到影响。这种风险可能来自基金管理人、基金托管人、基金登记机构、销售机构、证券交易所及其登记结算机构等。

6. 合规性风险：合规风险指基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者违反《基金合同》有

关规定的风险。

7. 其他风险：因本基金公司业务快速发展而在制度建设、人员配备、风险管理和内控制度等方面不完善而产生的风险；因金融市场危机、行业竞争压力可能产生的风险；战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，可能严重影响证券/期货市场运行，导致本基金资产损失；其他意外导致的风险。

8. 本基金特有的风险

(1) 指数基金投资风险

本基金为指数基金，在基金的投资运作过程中可能面临指数基金特有的风险，包括标的指数回报与股票/债券市场平均回报偏离风险、标的指数跟踪误差风险、标的指数变更风险等。

(2) 股指期货的投资风险

本基金可投资于股指期货，股指期货作为一种金融衍生品，其所面临的风险包括杠杆风险、强制平仓风险、无法平仓风险、强行减仓风险、政策变化份风险、连带风险及合作方风险等。

(3) 本基金的特定风险还包括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、成份股停牌等风险。

(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的当事人。

本基金为指数基金，投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份券停牌等潜在风险，详见招募说明书“风险揭示”章节。

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①本基金管理人网站：www.cpicfunds.com；②本基金管理人客户服务电话：021-38784766，400-7000-365（免长途话费）。

- 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

无。