

兴证全球中证同业存单AAA指数7天持有期 证券投资基金基金合同生效公告

公告送出日期:2023年09月12日

1. 公告基本信息

基金名称	兴证全球中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金
基金简称	兴证全球中证同业存单AAA指数7天持有
基金主代码	018610
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023年9月11日
基金管理人名称	兴证全球基金管理有限公司
基金托管人名称	招商银行股份有限公司
公告依据	《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》《兴证全球中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金合同》《兴证全球中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金招募说明书》等的规定

2. 基金募集情况

基金募集申请获中国证监会核准的文号	证监许可[2023]1068号	
基金募集期间	从2023年8月28日至2023年9月7日止	
验资机构名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	
募集资金划入基金托管专户的日期	2023年09月11日	
募集有效认购总户数(单位:户)	9,168	
募集期间净认购金额(单位:人民币元)	4,999,999,999.27	
认购资金在募集期间产生的利息(单位:人民币元)	1,501,471.08	
募集份额(单位:份)	有效认购份额	4,999,999,999.27
	利息结转的份额	1,501,471.08
	合计	5,001,501,470.35
其中:募集期间基金管理人运用固有资金认购本基金情况	认购的基金份额(单位:份)	-
	占基金总份额比例	-%
其中:募集期间基金管理人的从业人员认购本基金情况	认购的基金份额(单位:份)	3,776,679.62
	占基金总份额比例	0.08%
募集期限届满基金是否符合法律法规规定的办理基金备案手续的条件	是	
向中国证监会办理基金备案手续获得书面确认的日期	2023年9月11日	

注:1、本基金的基金合同自获中国证监会书面确认之日起正式生效。

2、按照有关法律规定,本基金合同生效前的律师费、会计师费、信息披露费用由基金管理人承担。

3、上述从业人员认购的基金份额均为确认份额,已扣除认购费,并包含利息结转份额。

4、本基金管理人高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为0份;本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0份。

3. 其他需要提示的事项

(1)自基金合同生效之日起,本基金管理人开始正式管理本基金。

(2)基金份额持有人可以在本基金合同生效之日起到销售机构查询交易确认情况,也可以通过本基金管理人的客服热线4006780099、021-38824536或公司网站<http://www.xqfunds.com>或通过在线客服直接咨询或转人工咨询相关事宜查询交易确认情况。

(3)基金合同生效后,基金管理人可根据实际情况依法决定本基金开始办理申购业务的具体日期,具体业务办理时间在相关公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过1个月开始办理赎回,具体业务

办理时间在赎回开始公告中规定。如果投资人多次申购本基金,则其持有的每一份基金份额的最短持有期到期日可能不同。

在确定申购开始与赎回开始时间后,基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定在规定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回、转换申请且登记机构确认接受的,其基金份额申购、赎回价格为下一开放日该类基金份额申购、赎回的价格。

风险提示:

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,全面认识本基金产品的风险收益特征,充分考虑自身的风险承受能力,并对于认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资要承担相应风险,包括市场风险、个别风险、流动性风险、运作风险、本基金特定风险、其他风险等。在投资者作出投资决策后,基金投资运作与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行承担。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。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,但不保证投资本基金一定盈利,也不保证最低收益。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,请认真阅读招募说明书,全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策,获得基金投资收益,亦承担基金投资中出现的各类风险。投资本基金可能遇到的风险包括:证券市场整体环境引发的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,大量赎回或暴跌导致的流动性风险,基金投资过程中产生的操作风险,因交收违约和投资债券引发的信用风险,基金投资对象与投资策略引致的特定风险,等等。

一般而言,本基金预期风险和预期的收益率低于股票型基金和偏股混合型基金,高于货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用抽样复制和动态最优化的方法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市场相似的风险收益特征。

本基金特有的风险包括:

1、本基金主要投资于同业存单,存在一定的违约风险、信用风险及利率风险。当同业存单的发行主体出现违约时,本基金可能面临无法收取投资收益甚至损失本金的风险;当本基金投资同业存单发行主体信用评级发生变动不再符合法规规定或基金合同约定时,基金管理人将需要在规定期限内完成调整,可能导致变现损失;金融市场利率波动会导致同业存单市场的价格和收益率的变动,从而影响本基金投资收益水平。

基金份额净值可能因市场中的各类投资品种的价格变化而出现一定幅度的波动。投资者购买本基金可能承担净值波动或本金亏损的风险。

2、本基金有关指数投资的风险

本基金通过被动式指数化投资以实现跟踪标的指数,但由于基金费用、交易成本、指数成份券取价规则和基金估值方法之间的差异等因素,可能造成本基金实际收益率与指数收益率存在偏离。

作为一只指数型基金,本基金特有的风险主要表现在以下几方面:

(1)标的指数的风险:即标的指数因为编制方法的缺陷有可能导致标的指数的表现与总体市场表现的差异,因标的指数编制方法的不成熟也可能导致指数调整较大,增加基金投资成本,并有可能因此而增加跟踪误差,影响投资收益。

(2)标的指数回报与同业存单市场平均回报偏离的风险

标的指数并不能完全代表整个同业存单市场。标的指数成份券的平均回报率与整个同业存单市场的平均回报率可能存在偏离。

(3)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、发行人经营状况、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而波动,导致指数波动,从而使基金收益水平发生变化,产生风险。

(4)标的指数变更的风险

根据基金合同规定,如出现变更标的指数的情形,本基金将变更标的指数。基于原标的指数的投资政策将会改变,投资组合将随之调整,基金的收益风险特征将与新的标的指数保持一致,投资者须承担此项调整带来的风险与成本。

(5)跟踪偏离风险及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0.2%以内,年化跟踪误差控制在2%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。

本基金还可能面临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:

i. 由于标的指数调整成份券或变更编制方法,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。

ii. 由于标的指数成份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。

iii. 由于标的指数是每天将利息进行再投资的,而组合同业存单利息收入只在卖券时和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。

iv. 由于成份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。

v. 由于基金投资过程中的同业存单及证券交易成本,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。

vi. 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。

vii. 其他因素产生的偏离。基金投资组合中个别成份券的持有比例与标的指数中该成份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。

(6)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,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期间,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。

(7)成份券停牌、摘牌或违约的风险

标的指数的当前成份券可能会改变、停牌、摘牌或违约,此后也可能会有其他同业存单加入成为该指数的成份券。本基金投资组合与相关指数成份券之间并非完全相关,在标的指数的成份券调整时,存在由于成份券停牌、违约或流动性差等原因无法及时买卖成份券,从而影响本基金对标的指数的跟踪程度。当标的指数的成份券摘牌或违约时,本基金可能无法及时卖出而导致基金净值下降、跟踪偏离度和跟踪误差扩大等风险。

本基金运作过程中,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,但并不保证能因此避免该成份券对本基金基金财产的影响,当基金管理人对该成份券予以调整时也可能产生跟踪偏离度和跟踪误差扩大等风险。

3、除标的指数成份券及其备选成份券以外,本基金投资范围还包括非属成份券及备选成份券的其他同业存单,以及其他具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行的国债、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、可分离交易可转债的纯债部分、地方政府债券、政府机构债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、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。因此,本基金除承担由于市场利率波动造成的利率风险外还要承担如企业债、公司债等信用品种的发债主体信用恶化造成的信用风险。

4、本基金的投资范围包括资产支持证券。资产支持证券存在信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、操作风险和法律风险等,详见招募说明书的“风险揭示”部分。

5、本基金对每份基金份额设定最短持有期限,对投资者存在流动性风险。本基金主要运作方式设置为允许投资者每个开放日申购,但对于每份基金份额设定7天最短持有期限,最短持有期限内基金份额持有人不能就该基金份额提出赎回或转换转出申请。即投资者要考虑在最短持有期限届满前资金不能赎回或转换转出的风险。

6、基金管理人自基金合同生效之日起不超过1个月开始办理赎回,对投资者存在流动性风险。投资者可能面临基金份额在基金合同生效之日起1个月内不能赎回的风险。

7、当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时,基金管理人履行相应程序后,可以启动侧袋机制,具体详见基金合同和招募说明书“侧袋机制”等有关章节。侧袋机制实施期间,基金管理人将对基金简称进行特殊标识,并不办理侧袋账户的申购赎回。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。