兴业中证国有企业改革指数增强型证券投资基金招募说明书

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

重要提示

本基金经2017年11月1日中国证券监督管理委员会证监许可[2017]1962号文准予募集注册。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的投资价值和市场前景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,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

投资有风险,投资者拟认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书、基金合同等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,全面认识本基金产品的风险收益特征,并承担基金投资中出现的各类风险,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,本基金的特定风险等,详见招募说明书"风险揭示"章节。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。投资者应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。本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%,但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。基金管理人提醒投资者基金投资的"买者自负"原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负责。

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。

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。

一、绪言

本基金经中国证监会2017年11月1日证监许可[2017]1962号文准予募集注册。

本《招募说明书》依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称"《运作办法》")、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称"《销售办法》")、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称"《信息披露办法》")、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称"《流动性风险规定》")等有关法律法规以及《兴业中证国有企业改革指数增强型证券投资基金基金合同》编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息,或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写,并经中国证监会注册。基金合同是约定基金合同当事人之间权利、义务的法律文件。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,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

二、释义

在本招募说明书中,除非文意另有所指,下列词语或简称具有如下含义:

1、基金或本基金:指兴业中证国有企业改革指数增强型证券投资基金

2、基金管理人:指兴业基金管理有限公司

3、基金托管人:指招商银行股份有限公司

4、基金合同:指《兴业中证国有企业改革指数增强型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充

5、托管协议:指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《兴业中证国有企业改革指数增强型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6、招募说明书或本招募说明书:指《兴业中证国有企业改革指数增强型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新

7、基金份额发售公告:指《兴业中证国有企业改革指数增强型证券投资基金份额发售公告》

8、法律法规:指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等

9、《基金法》:指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过,并经2012年12月28日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订,自2013年6月1日起实施,并经2015年4月24日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修改的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订

10、《销售办法》:指中国证监会2013年3月15日颁布、同年6月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

11、《信息披露办法》:指中国证监会2004年6月8日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

12、《运作办法》:指中国证监会2014年7月7日颁布,同年8月8日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

13、《流动性风险规定》:指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订

14、中国证监会:指中国证券监督管理委员会

15、银行业监督管理机构:指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会

16、基金合同当事人:指受基金合同约束,根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体,包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

17、个人投资者:指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

18、机构投资者:指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

19、合格境外机构投资者:指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

20、人民币合格境外机构投资者:指按照《人民币合格境外机构投资者境内证券投资试点办法》(包括其不时修订)及相关法律法规规定,运用来自境外的人民币资金进行境内证券投资的境外法人

21、投资人:指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者、人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称

22、基金份额持有人:指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

23、基金销售业务:指基金管理人或销售机构宣传推介基金,发售基金份额,办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务

24、销售机构:指兴业基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件,取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议,代为办理基金销售业务的机构

25、登记业务:指基金登记、存管、过户、清算和结算业务,具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等

26、登记机构:指办理登记业务的机构。基金的登记机构为兴业基金管理有限公司或接受兴业基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

27、基金账户:指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

28、基金交易账户:指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理基金业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户

29、基金合同生效日:指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件,基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕,并获得中国证监会书面确认的日期

30、基金合同终止日:指基金合同规定的基金合同终止事由出现后,基金财产清算完毕,清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

31、基金募集期:指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间,最长不得超过3个月

32、存续期:指基金合同生效至终止之间的不定期期限

33、工作日:指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

34、T日:指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

35、T+n日:指自T日起第n个工作日(不包含T日)

36、开放日:指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

37、开放时间:指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

38、《业务规则》:指《兴业基金管理有限公司开放式基金业务规则》,是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则,由基金管理人和投资人共同遵守

39、认购:指在基金募集期内,投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

40、申购:指基金合同生效后,投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

41、赎回:指基金合同生效后,基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

42、基金转换:指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件,申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为

43、转托管:指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作

44、定期定额投资计划:指投资人通过有关销售机构提出申请,约定每期申购日、扣款金额及扣款方式,由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式

45、巨额赎回:指本基金单个开放日,基金净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一开放日基金总份额的10%

46、元:指人民币元

47、基金收益:指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

48、基金资产总值:指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

49、基金资产净值:指基金资产总值减去基金负债后的价值

50、基金份额净值:指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

51、基金资产估值:指计算评估基金资产和负债的价值,以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

52、摆动定价机制:指当遭遇大额申购赎回时,通过调整基金份额净值的方式,将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者,从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响,确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待

53、流动性受限资产:指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产,包括但不限于到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款(含协议约定有条件提前支取的银行存款)、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等

54、指定媒介:指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒介

55、标的指数:中证国有企业改革指数

56、不可抗力:指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件。

三、基金管理人

(一)基金管理人情况

名称:兴业基金管理有限公司

住所:福建省福州市鼓楼区五四路137号信和广场25楼

办公地址:上海市浦东新区浦明路198号财富金融广场7号楼

法定代表人:卓新章

设立日期:2013年4月17日

批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监许可[2013]288号

组织形式:有限责任公司

注册资本:12亿元人民币

存续期限:持续经营

联系电话:021-22211888

联系人:郭玲燕

股权结构:

股东名称	出资比例
兴业银行股份有限公司	90%
中海集团投资有限公司	10%
合计	100%

(二)主要人员情况

1、董事会成员

卓新章先生,董事长,本科学历。曾任兴业银行宁德分行副行长、行长,兴业银行总行信贷审查部总经理,兴业银行福州分行副行长,兴业银行济南分行行长,兴业银行基金业务筹建工作小组负责人,兴业银行总行基金金融部总经理,兴业银行总行资产管理部总经理,兴业银行金融市场总部副总裁等职。现任兴业基金管理有限公司董事长,兴业财富资产管理有限公司执行董事。

明东先生,董事,硕士学位。曾先后在中远财务有限责任公司及中国远洋运输(集团)总公司资产经营中心、总裁事务部、资本运营部工作,历任中国远洋控股股份有限公司投资者关系部总经理、证券事务代表,中国远洋运输(集团)总公司/中国远洋控股股份有限公司证券事务部总经理。现任中远海运发展股份有限公司副总经理、党委委员,中海集团投资有限公司总经理。

汤夕生先生,董事,硕士学位。曾任建设银行浦东分行办公室负责人,兴业银行上海分行南市支行行长,兴业银行上海分行副行长等职。现任兴业基金管理有限公司总经理,兼任上海市基金同业公会第三届副会长。

朱利民先生,独立董事,硕士学位。曾任国家体改委试点司主任科员、副处长、处长,国家体改委下属中华股份制咨询公司副总经理,中国证监会稽查局副局长、中国证监会派出机构工作协调部主任、兼投资者教育办公室主任,中信建投证券股份有限公司合规总监、监事会主席等职。

黄泽民先生,独立董事,博士学位。曾任华东师范大学商学院院长,第十届、十一届、十二届全国政协委员等职。现任华东师范大学终身教授、博导、国际金融研究所所长,兼任上海世界经济学会副会长,中国金融学会学术委员,中国国际金融学会理事,中国国际经济关系学会常务理事,全国日本经济学会副会长,上海市人民政府参事。

曹和平先生,独立董事,博士学位。曾任中共中央书记处农研室国务院农村发展研究中心农业部研究室副主任,北京大学经济学院副院长,云南大学副校长,北京大学供应链研究中心主任,北京大学中国都市经济研究基地首席专家等职。现任北京大学经济学院教授(博士生导师),北京大学环境、资源与发展经济学创系主任,兼任北京大学数字中国研究院副院长,中国经济规律研究会副会长,中国西部促进会副会长,中国环境科学学会绿色金融分会主任,中央电视台财经频道评论员,北京大学供应链研究中心顾问,互联网普惠金融研究院院长,广州市、西安市、哈尔滨市、厦门市、广安市和青岛市金融咨询决策专家委员,云南省政府经济顾问。

2、监事会成员

顾卫平先生,监事会主席,硕士学位。曾任上海农学院农业经济系金融教研室主任、系副主任,兴业银行上海分行副行长,兴业银行天津分行行长,兴业银行广州分行行长等职。现任兴业银行总行资产管理部总经理。

杜海英女士,监事,硕士学位。曾任中海(海南)海盛船务股份有限公司发展部科长、发展部副主任(主持工作)、发展部主任,中共中国海运(集团)总公司党校副校长,集团管理干部学院副院长等职。现任中远海运发展股份有限公司总经理助理、中海集团投资有限公司副总经理、河南远海中原物流产业发展基金管理有限公司董事长。

李骏先生,职工监事,硕士学位。曾任渣打银行全球金融市场部主任,海富通基金管理有限公司机构业务部副总经理,兴业基金管理有限公司综合管理部副总经理。现任兴业基金管理有限公司产品研发部总经理。

赵正义女士,职工监事,硕士学位。曾任上海上会会计师事务所审计员,生命人寿保险股份有限公司稽核审计部助理总经理,海富通基金管理有限公司监察稽核部稽核经理、财务部高级财务经理,兴业基金管理有限公司监察稽核部副总经理。现任兴业基金管理有限公司财富管理总部副总经理。

3、公司高级管理人员

卓新章先生,董事长,简历同上。

汤夕生先生,总经理,简历同上。

王薏女士,督察长,本科学历。历任兴业银行信贷管理部总经理助理、副总经理,兴业银行广州分行副行长,兴业银行信用审查部总经理,兴业银行小企业部总经理,兴业银行金融市场总部风险总监、金融市场风险管理部总经理。现任兴业基金管理有限公司党委委员、督察长。

黄文锋先生,副总经理,硕士学位。历任兴业银行厦门分行鹭江支行行长、集美支行行长,兴业银行厦门分行公司业务部兼同业部、国际业务部总经理,兴业银行厦门分行党委委员、行长助理,兴业银行总行投资银行部副总经理,兴业银行沈阳分行党委委员、副行长。现任兴业基金管理有限公司党委委员、副总经理。

张顺国先生,副总经理,本科学历。历任泰阳证券上海管理总部总经理助理,深圳发展银行上海分行金融机构部副总经理、商人银行部副总经理,深圳发展银行上海分行宝山支行副行长,兴业银行上海分行漕河泾支行行长、静安支行行长、上海分行营销管理部总经理,兴业基金管理有限公司总经理助理、上海分公司总经理,上海兴晟股权投资管理有限公司总经理。现任兴业基金管理有限公司党委委员、副总经理,兼任兴投(平潭)资本管理有限公司执行董事。

庄孝强先生,总经理助理,本科学历。历任兴业银行宁德分行计划财会部副总经理,兴业银行总行审计部福州分部业务二处副处长、上海分部业务二处副处长,兴业银行总行资产管理部总经理助理,兴业财富资产管理有限公司总经理。现任兴业基金管理有限公司党委委员、总经理助理,兼任上海兴晟股权投资管理有限公司执行董事。

4、本基金拟任基金经理

WEIDONG WU(吴卫东)先生,哥伦比亚大学物理学博士。二十三年证券从业经验,曾在美国证券交易协会(NASD)注册。1994-1998年任德意志银行量化策略研究员(Associate Director),1998-2002年任摩尔(Moore)资产管理公司资深策略研究员,2002-2006任千禧(Millennium)基金公司投资经理,2007-2010任梯度(Gradient)资产管理公司投资经理,2010-2013任兴业银行资产管理部研究总监,2013年7月加入兴业基金管理公司,2015年1月23日至2018年1月18日任兴业多策略灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理,2015年9月17日至2016年11月29日任兴业国企改革灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2017年12月26日起至今任兴业量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。

5、投资策略委员会成员

汤夕生先生,总经理。

黄文锋先生,副总经理。

冯烜先生,股票投资部投资总监。

刘方旭,股票投资部公募投资副总监。

吴列伟,股票投资部专户投资副总监。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

(三)基金管理人的职责按照《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人必须履行以下职责:

1、依法募集资金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;

2、办理基金备案手续;

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账,进行证券投资;

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配收益;

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

6、编制季度、半年度和年度基金报告;

7、计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回价格;

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项;

9、按照规定召集基金份额持有人大会;

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;

11、以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;

12、法律、行政法规和中国证监会规定的或《基金合同》约定的其他职责。

(四)基金管理人承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》(以下简称"《证券法》")的行为,并承诺建立健全的内部控制制度,采取有效措施,防止违反《证券法》行为的发生;

2、基金管理人承诺不从事以下违反《基金法》的行为,并承诺建立健全的内部风险控制制度,采取有效措施,防止下列行为的发生:

(1)将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资;

(2)不公平地对待管理的不同基金财产;

(3)利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益;

(4)向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;

(5)侵占、挪用基金财产;

(6)泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动;

(7)玩忽职守,不按照规定履行职责;

(8)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺加强人员管理,强化职业操守,督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范,诚实信用、勤勉尽责,不从事以下活动:

(1)越权或违规经营;

(2)违反基金合同或托管协议;

(3)故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益;

(4)在向中国证监会报送的资料中弄虚作假;

(5)拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管;

(6)玩忽职守、滥用职权,不按照规定履行职责;

(7)泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息,或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动;

(8)违反证券交易场所业务规则,利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格,扰乱市场秩序;

(9)故意损害投资人及其他同业机构、人员的合法权益;

(10)以不正当手段谋求业务发展;

(11)有悖社会公德,损害证券投资基金人员形象;

(12)信息披露不真实,有误导、欺诈成分;

(13)法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。

4、本基金管理人将根据基金合同的规定,按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制等全权处理本基金的投资。

5、本基金管理人不从事违反《基金法》的行为,并建立健全内部控制制度,采取有效措施,保证基金财产不用于下列投资或者活动:

(1)承销证券;

(2)违反规定向他人贷款或者提供担保;

(3)从事承担无限责任的投资;

(4)买卖其他基金份额,但中国证监会另有规定的除外;

(5)向其基金管理人、基金托管人出资;

(6)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;

(7)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

(五)基金经理承诺

1、依照有关法律法规和基金合同的规定,本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益;

2、不利用职务之便为自己及其被代理人、受雇人或任何第三人谋取利益;

3、不违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定,泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息,或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动;

4、不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

(六)基金管理人的风险管理制度

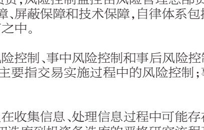
投资业务风险可以分为基本风险和操作风险。基本风险包括投资对象的市场风险和流动性风险;操作风险包括交易过程风险和投资纪律执行风险等。

本公司建立健全了的风险管理体系,针对基金运作各个环节构建了相应的风险管理方法,并加以有效执行。

1、风险管理体系

本基金的风险管理体系包括风险控制决策体系、风险控制监控体系、风险控制执行体系、风险控制保障体系及自律体系。其中,风险控制执行体系是在风险控制决策、监控、保障和自律体系共同支持下完成的,各个风险控制环节的关系如图1所示:

图1:风险控制体系示意图



风险控制决策由投资策略委员会负责,风险控制监控由风险管理总部负责,风险控制执行由各业务部门和职能部门负责,风险控制保障包括财务保障、屏蔽保障和技术保障,自律体系包括法制教育和道德培养等。

督察长全面介入各个风险控制环节之中。

2、投资风险管理

本基金的投资风险控制包括事前风险控制、事中风险控制和事后风险控制。事前风险控制主要指投资分析和投资决策中的风险控制;事中风险控制主要指交易实施过程中的风险控制;事后风险控制主要指投资组合构建之后的风险评估与跟踪。

(1)投资分析的风险控制

投资分析风险主要指投资研究人员在收集信息、处理信息过程中可能存在的致使基金份额持有人遭受损失的风险因素。对此,本公司建立了从研究初选库到投资备选库的严格研究流程和制度,并有效执行,以防范投资分析风险。

(2)投资决策的风险控制

投资决策风险主要是指因投资决策失误所导致的可能使投资遭受损失的风险。对此,本公司制定了详细的投资决策流程和制度,以防范投资决策风险。如建立严格的投资备选库制度,严格的投资权限审批制度,定期或不定期绩效和风险评估等。

(3)基金交易的风险控制

交易风险是指基金投资交易实施过程中可能产生的风险。本公司严格执行集中交易制度,确保交易执行过程的公平独立。为了确保交易过程的独立性与公平性,中央交易室独立于基金管理部门,以有效控制交易风险。

(4)投资风险的事后控制

本公司对基金投资进行实时监控,并按月、按季进行风险定期评估,以加强投资风险的事后控制。风险管理总部每月对基金投资风险进行评估,并将评估报告提交投资策略委员会讨论和审议;每季度分析市场环境变化和重大事件影响,报告面临的各项风险暴露情况,对基金投资风险提出建议和警告;根据投资策略委员会或投资主管的要求,不定期对基金投资的特定风险进行评估,并提交相关报告。

(七)基金管理人的风险管理和内部控制制度

1、内部控制的原则

(1)全面性原则。内部控制制度覆盖公司的各项业务、各个部门和各级人员,并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节。

(2)独立性原则。公司设立独立的督察长与监察稽核部门,并使它们保持高度的独立性与权威性。

(3)相互制约原则。公司部门和岗位的设置权责分明、相互牵制,并通过切实可行的相互制衡措施来消除内部控制中的盲点。

(4)重要性原则。公司的发展必须建立在风险控制完善和稳固的基础上,内部风险控制与公司业务发展同等重要。

2、内部控制的主要内容

(1)控制环境

公司董事会、监事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系。基金管理人在董事会下设立有独立董事参加的审计与风险管理委员会,负责评价与完善公司的内部控制体系;公司监事会负责审阅外部独立审计机构的审计报告,确保公司财务报告的真实性、可靠性,督促实施有关审计建议。

公司管理层在总经理领导下,认真执行董事会确定的内部控制战略,为了有效贯彻公司董事会制定的经营方针及发展战略,设立了总经理办公会、投资策略委员会、内部控制与风险管理委员会等委员会,分别负责公司经营、基金投资、风险管理的重大决策。

此外,公司设有督察长,全权负责公司的监察与稽核工作,对公司和基金运作的合法性、合规性及合理性进行全面检查与监督,参与公司风险控制工作,发生重大风险事件时向公司董事长和中国证监会报告。

(2)风险评估

公司内部稽核人员定期评估公司及基金的风险状况,包括所有能对经营目标、投资目标产生负面影响的内部和外部因素,对公司总体经营目标产生影响的可能性及影响程度,并将评估报告报总经理办公会和内部控制与风险管理委员会。

(3)操作控制

公司内部组织结构的设计方面,体现部门之间职责有分工,但部门之间又相互合作与制衡的原则。基金投资管理、基金运作、市场等业务部门有明确的授权分工,各部门的操作相互独立,并且有独立的报告系统。各业务部门之间相互核对、相互牵制。

各业务部门内部工作岗位分工合理、职责明确,形成相互检查、相互制约的关系,以减少舞弊或差错发生的风险,各工作岗位均制定有相应的书面管理制度。

在明确的岗位责任制度基础上,设置科学、合理、标准化的业务操作流程,每项业务操作有清晰、书面化的操作手册,同时,规定完备的处理手续,保存完整的业务记录,制定严格的检查、复核标准。

(4)信息与沟通

公司建立了内部办公自动化信息系统与业务汇报体系,通过建立有效的信息交流渠道,保证公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息,保证信息及时送达适当的人员进行处理。

(5)监督与内部稽核

基金管理人设立了独立于各业务部门的监察稽核部,履行内部稽核职能,检查、评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性,监督公司内部控制制度的执行情况,揭示公司内部管理及基金运作中的风险,及时提出改进意见,促进公司内部管理制度有效地执行。内部稽核人员具有相对的独立性,监察稽核报告提交全体董事审阅并报送中国证监会。

四、基金托管人

(一)基金托管人基本情况

1、基本情况

名称:招商银行股份有限公司(以下简称"招商银行")

设立日期:1987年4月8日

注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦

注册资本:252.20亿元

法定代表人:李建红

行长:田惠宇

资产托管业务批准文号:证监基金字[2002]83号

电话:0755—83199084

传真:0755—83195201

资产托管部信息披露负责人:张燕

2、发展概况

招商银行成立于1987年4月8日,是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行,总行设在深圳。自成立以来,招商银行先后进行了三次增资扩股,并于2002年3月成功地发行了15亿A股,4月9日在上交所挂牌(股票代码:600036),是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股,9月22日在香港联交所挂牌交易(股票代码:3968),10月5日行使H股超额配售,共发行了24.2亿H股。截至2016年6月30日,本集团总资产5.5373万亿元人民币,高级法下资本充足率13.91%,权重法下资本充足率13.90%。

2002年8月,招商银行成立基金托管部;2005年8月,经报中国证监会同意,更名为资产托管部,下设业务管理室、产品管理室、业务营运室、稽核监察室、基金外包业务室5个职能处室,现有员工60人。2002年11月,经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格,成为国内第一家获得该项业务资格上市银行;2003年4月,正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行,拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管(QFII)、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管等业务资格。

招商银行确立"因势而变、先您所想"的托管理念和"财富所托、信守承诺"的托管核心价值,独创"6S托管银行"品牌体系,以"保护您的业务、保护您的财富"为历史使命,不断创新托管系统、服务和产品:在业内率先推出"网上托管银行系统"、托管业务综合系统和"6心"托管服务标准,首家发布私募基金绩效分析报告,开办国内首个托管银行网站,成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金T+1到账、第一只境外银行QDII基金、第一只红利ETF基金、第一只"1+N"基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单TOT保管,实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变,得到了同业认可。

经过十四年发展,招商银行资产托管规模快速壮大。2016年招商银行加大高收益托管产品营销力度,截至9月末新增托管公募开放式基金64只,新增首发公募开放式基金托管规模464.83亿元。克服国内证券市场震荡的不利形势,托管费收入、托管资产均创出历史新高,实现托管费收入36.29亿元,同比增长30.06%,托管资产余额9.42万亿元,同比增长59.41%。作为公益慈善基金的首个独立第三方托管人,成功签约"壹基金"公益资金托管,为我国公益慈善资金监管、信息披露进行有益探索,该项目荣获2012中国金融品牌「金象奖」"十大公益项目"奖;四度蝉联获《财资》"中国最佳托管专业银行"。2016年6月招商银行荣膺《财资》"中国最佳托管银行奖",成为国内唯一获奖项国内托管银行,该行"托管通"获得国内《银行家》2016中国金融创新"十佳金融产品创新奖";7月荣膺2016年中国资产管理【金贝奖】"最佳资产托管银行"。

(二)主要人员情况

李建红先生,本行董事长、非执行董事,2014年7月起担任本行董事、董事长。英国东伦敦大学工商管理硕士、吉林大学经济管理专业硕士,高级经济师。招商局集团有限公司董事长,兼任招商局国际有限公司董事会主席、招商局能源运输股份有限公司董事长、中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司董事长、招商局华建公路投资有限公司董事长和招商局资本投资有限责任公司董事长。曾任中国远洋运输(集团)总公司总裁助理、总经济师、副总裁,招商局集团有限公司董事、总裁。

田惠宇先生,本行行长、执行董事,2013年5月起担任本行行长、本行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位,高级经济师。曾于2003年7月至2013年5月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

丁伟先生,本行副行长。大学本科毕业,副研究员。1996年12月加入本行,历任杭州分行办公室主任兼营业部总经理,杭州分行行长助理、副行长,南昌支行行长,南昌分行行长,总行人力资源部总经理,总行行长助理,2008年4月起任本行副行长。兼任招银国际金融有限公司董事长。

姜然女士,招商银行资产托管部总经理,大学本科毕业,具有基金托管人高级管理人员任职资格。先后供职于中国农业银行黑龙江省分行,华商银行,中国农业银行深圳市分行,从事信贷管理、托管工作。2002年9月加盟招商银行至今,历任招商银行总行资产托管部经理、高级经理、总经理助理等职。是国内首家推出的网上托管银行的主要设计、开发者之一,具有20余年银行信贷及托管专业从业经验。在托管产品创新、服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领域具有深入的研究和丰富的实务经验。

(三)基金托管业务经营情况

截至2016年9月30日,招商银行股份有限公司累计托管215只开放式基金及其它托管资产,托管资产为9.42万亿元人民币。

(四)基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

确保托管业务严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则,自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念;形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制,防范和化解经营风险,确保托管业务的稳健运行和托管资产的安全完整;建立有利于查错防弊、堵塞漏洞、消除隐患,保证业务稳健运行的风险控制制度,确保托管业务信息真实、准确、完整、及时;确保内控机制、体制的不断改进和各项业务制度、流程的不断完善。

2、内部控制组织结构

招商银行资产托管业务建立三级内控风险防范体系:

一级风险防范是在总行层面对风险进行预防和控制。

二级防范是总行资产托管部设立稽核监察室,负责部门内部风险预防和控制。稽核监察室在总经理室直接领

(下转A26版)

兴业中证国有企业改革指数增强型证券投资基金基金份额发售公告

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

重要提示

1、兴业中证国有企业改革指数增强型证券投资基金(以下简称"本基金")的募集已获中国证监会2017年11月1日证监许可【2017】1962号文准予注册。中国证监会对本基金募集的注册并不代表其对本基金的投资价值和市场前景作出实质性判断、推荐或者保证,也不表明投资于本基金没有风险。

2、本基金是契约型开放式股票型证券投资基金。

3、本基金的基金管理人和登记机构为兴业基金管理有限公司(以下简称"本公司"、"兴业基金"),基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称"招商银行")。

4、本基金募集对象包括符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

5、本基金自2018年4月27日起至2018年7月23日止通过基金管理人指定的销售机构公开发售。自基金份额发售之日起,最长不得超过3个月。本公司也可根据基金销售情况在募集期限内适当延长或缩短基金发售时间,并及时公告。本基金不设募集规模上限。

6、本基金通过兴业基金管理有限公司直销机构及其他销售机构进行公开发售,基金管理人可根据情况变更或增减销售机构,并予以公告。基金份额发售机构办理本基金开户、认购等业务的网点、日期、时间和程序等事项参照各基金份额发售机构的具体规定。

7、本基金自基金份额发售之日起3个月内,在基金募集份额总额不少于2亿份,基金募集金额不少于2亿元人民币且基金认购人数不少于200人的条件下,基金募集期届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售,并在10日内聘请法定验资机构验资,自收到验资报告之日起10日内,向中国证监会办理基金备案手续。

投资人欲购买本基金,需开立本公司基金账户。基金募集期内本公司直销机构为投资人办理开立基金账户的手续。投资人的开户和认购申请可同时办理,但若开户无效,认购申请也同时无效。

8、在本基金销售机构的销售网点进行认购时,投资人以金额申请,每个基金账户首次认购最低金额为人民币1元(含认购费),通过基金管理人的直销机构首次认购单笔最低限额为人民币1元(含认购费)。投资者通过本基金销售机构的销售网点每笔追加认购的最低金额为人民币1元(含认购费),通过基金管理人的直销机构每笔追加认购的最低金额为人民币1元(含认购费)。

各销售机构对最低认购限额及交易级差有其他规定的,以各销售机构的业务规定为准。本基金募集期间对单个基金份额持有人最高累计认购金额不设限制,但如本基金单个投资人累计认购的基金份额数达到或者超过基金总份额的50%,基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的认购申请进行限制。基金管理人接受某笔或者某些认购申请有可能导致投资者变相规避前述50%比例要求的,基金管理人有权拒绝该等全部或者部分认购申请。投资人认购的基金份额数以基金合同生效后登记机构的确认为准。

基金管理人可根据市场情况,调整本基金认购和追加认购的最低金额或累计认购金额。

9、基金销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况,投资人应及时查询并妥善行使合法权利,否则,由此产生的投资人任何损失由投资人自行承担。

10、本公告仅对"兴业中证国有企业改革指数增强型证券投资基金"发售的有关事项和规定予以说明。投资人欲了解"兴业中证国有企业改革指数增强型证券投资基金"的详细情况,请详细阅读2018年4月24日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上的《兴业中证国有企业改革指数增强型证券投资基金招募说明书》(以下简称"《招募说明书》")。

11、本基金的招募说明书及基金份额发售公告将同时发布在本公司网站(www.cib-fund.com.cn)。投资人亦可通过本公司网站下载基金申请表格和了解基金份额发售相关事宜。

12、投资人可以拨打本公司的客户服务电话(40000-95561)咨询购买事宜。

13、本公司可综合各种情况对募集安排做适当调整。

14、风险提示

投资有风险,投资者拟认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书及基金合同等信息披露文件,全面认识本基金产品的风险收益特征,并承担基金投资中出现的各类风险,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,基金流动性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险,本基金的特定风险等等。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,投资人在投资本基金前,应全面了解本基金的产品特性,自主判断基金的投资价值,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的"买者自负"原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负责。

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。

本基金流动性风险主要包括以下两个方面:一方面是指在市场或个股流动性不足的情况下,基金管理人可能无法迅速、低成本地变现或调整基金投资组合的风险。另一方面是指本基金面临大量赎回而无法及时变现其资产而造成的风险。

本基金可投资中小企业私募债,中小企业私募债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,由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。

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。

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。

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。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%,但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。

一、本次基金份额发售基本情况

1、基金名称:兴业中证国有企业改革指数增强型证券投资基金

2、基金简称:兴业中证国有企业改革指数增强(基金代码:005339)

3、基金类别:股票型证券投资基金

4、基金的运作方式:契约型开放式

5、基金份额发售面值:每份基金份额发售面值为人民币1.00元

6、基金的存续期限:不定期

7、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%,以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。

8、风险收益特征: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。

9、销售机构

直销机构

(1)名称:兴业基金管理有限公司直销中心

住所:福建省福州市鼓楼区五四路137号信和广场25楼

法定代表人:卓新章

办公地址:上海市浦东新区浦明路198号财富金融广场7号楼

联系人:徐湘芸

电话:021-22211975

传真:021-22211997

网址:www.cib-fund.com.cn

(2)名称:网上直销系统

网址:https://trade.cib-fund.com.cn/etrading/

(3)名称:兴业基金微信公众号

微信号:"兴业基金"或者"cibfund"

其他销售机构

(1)浙江同花顺基金销售有限公司

住所:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室

法定代表人:凌顺平

办公地址:浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2号楼2楼

邮政编码:310012

联系人:董一锋

电话:4008-773-772

网址:http://www.5ifund.com

(2)蚂蚁(杭州)基金销售有限公司

住所:浙江省杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1幢202室

法定代表人:陈柏青

办公地址:上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼27F

邮政编码:200135

联系人:韩爱彬

电话:4000-766-123

网址:http://www.fund123.cn/

(3)上海天天基金销售有限公司

住所:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层

法定代表人:其实

办公地址:上海市徐汇区宛平南路88号26层

邮政编码:200235

联系人:王超

电话:4001818188

网站:http://www.1234567.com.cn

(4)深圳众禄基金销售股份有限公司

住所:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼

法定代表人:薛峰

办公地址:深圳市罗湖区梨园路8号HALO广场4楼

邮政编码:518028

联系人:童彩平

电话:4006-788-887

网站:http://www.zlfund.cn

(5)珠海盈米财富管理有限公司

住所:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

法定代表人:肖雯

办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼

邮政编码:510308

联系人:吴煜浩

电话:020-89629066

网站:http://www.yingmi.cn

(6)北京虹点基金销售有限公司

住所:北京市朝阳区工人体育馆北路甲2号裙房2层222单元

法定代表人:胡伟

办公地址:北京市朝阳区工人体育馆北路甲2号盈科中心B座裙楼二层

邮政编码:100026

联系人:陈铭洲

电话:400-618-0707

网站:https://www.hongdianfund.com/

(7)上海陆金所基金销售有限公司

住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元

法定代表人:郭坚

办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼

邮政编码:200120

联系人:程晨

电话:4008219031

网址:http://www.lufunds.com

(8)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司

住所:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室

法定代表人:汪静波

办公地址:上海市杨浦区昆明路508号北美广场B座12楼

邮政编码:200082

联系人:张裕

电话:400-821-5399

网址:http://www.noah-fund.com

(9)上海凯石财富基金销售有限公司

住所:上海市黄浦区西藏南路765号602-115室

法定代表人:陈继武

办公地址:上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼

邮政编码:200001

联系人:王哲宇

电话:4006-433-389

网址:www.vstonewealth.com

(10)武汉市伯嘉基金销售有限公司

住所:武汉市江汉区泛海国际SOHO7栋23层01、04号

法定代表人:陶捷

办公地址:武汉市江汉区泛海国际SOHO7栋23层01、04号

邮政编码:430000

联系人:陆锋

电话:027-87006003

网址:http://www.buyfunds.cn/

(11)上海好买基金销售有限公司

住所:上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号

法定代表人:杨文斌

办公地址:上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903~906室

邮政编码:200120

联系人:张茹

电话:400-700-9665

网址:http://www.ehowbuy.com

(12)上海联泰资产管理有限公司

住所:中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室

法定代表人:燕斌

办公地址:上海市长宁区福泉北路518号8座3层

邮政编码:200335

联系人:兰敏

电话:4000-466-788

网址:http://www.66zichan.com

(13)上海长量基金销售投资顾问有限公司

住所:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

法定代表人:张跃伟

办公地址:上海市浦东新区东方路1267号11层

邮政编码:200120

联系人:张佳琳

电话:400-820-2899

网站:http://www.erichfund.com

(14)北京汇成基金销售有限公司

住所:北京市海淀区中关村大街11号11层1108室

法定代表人:王伟刚

办公地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108室

邮政编码:100190

联系人:熊小满

电话:400-619-9059

网址:http://www.hcjijin.com

(15)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

住所:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006室

法定代表人:张彦

办公地址:北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦7层

邮政编码:100032

联系人:文雯

电话:400-166-1188

网址:http://www.jrj.com.cn

(16)上海万得基金销售有限公司

住所:中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座

法定代表人:王廷富

办公地址:上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼

邮政编码:200120

联系人:徐亚丹

电话:400-821-0203

网址:http://www.520fund.com.cn

(17)上海利得基金销售有限公司

住所:上海市宝山区蕴川路5475号1033室

法定代表人:李兴春

办公地址:上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼14楼

邮政编码:200127

联系人:曹怡晨

电话:400-921-7755

网址:http://www.leadfund.com.cn

(18)北京肯特瑞基金销售有限公司

住所:北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15

法定代表人:江卉

办公地址:北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院京东A座4层

邮政编码:100176

联系人:赵德赛

电话:400-098-8511

网址:http://kenterui.jd.com

(19)上海华夏财富投资管理有限公司

住所:上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室

法定代表人:李一梅

办公地址:北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层

邮政编码:100032

联系人:仲秋玥

电话:400-817-5666

网址:http://www.amcfortune.com

(20)上海基煜基金销售有限公司

住所:上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室

法定代表人:王翔

办公地址:上海市杨浦区昆明路518号A1002室

邮政编码:200120

(下转A26版)

兴业中证国有企业改革指数增强型证券投资基金基金合同摘要

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

一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务

(一)基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的权利包括但不限于:

(1)依法募集资金;

(2)自《基金合同》生效之日起,根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产;

(3)依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用;

(4)销售基金份额;

(5)按照规定召集基金份额持有人大会;

(6)依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人,如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定,应呈报中国证监会和其他监管部门,并采取必要措施保护基金投资者的利益;

(7)在基金托管人更换时,提名新的基金托管人;

(8)选择、委托、更换基金销售机构,对基金销售机构的相关行为进行监督和处理;

(9)担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用;

(10)依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案;

(11)在《基金合同》约定的范围内,拒绝或暂停受理申购与赎回申请;

(12)依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利,为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利;

(13)在法律法规允许的前提下,为基金的利益依法为基金进行融资;

(14)以基金管理人的名义,代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;

(15)选择、委托、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商、期货经纪机构或其他为基金提供服务的外部机构;

(16)在符合有关法律、法规的前提下,制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户等的业务规则;

(17)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的义务包括但不限于:

(1)依法募集资金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;

(2)办理基金备案手续;

(3)自《基金合同》生效之日起,以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产;

(4)配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;

(5)建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;

(6)除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;

(7)依法接受基金托管人的监督;

(8)采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回的价格;

(9)进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

(10)编制季度、半年度和年度基金报告;

(11)严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;

(12)保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不向他人泄露,但向审计、法律等外部专业顾问提供的除外;

(13)按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配基金收益;

(14)按规定受理申购与赎回申请,及时、足额支付赎回款项;

(15)依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;

(16)按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上;

(17)确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出,并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件;

(18)组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

(19)面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;

(20)因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

(21)监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时,基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;

(22)当基金管理人将其义务委托第三方处理时,应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任;

(23)以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;

(24)基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件,《基金合同》不能生效,基金管理人承担全部募集费用,将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人;

(25)执行生效的基金份额持有人大会的决议;

(26)建立并保存基金份额持有人名册;

(27)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(二)基金托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金托管人的权利包括但不限于:

(1)自《基金合同》生效之日起,依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产;

(2)依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用;

(3)监督基金管理人对本基金的投资运作,如发现基金管理人有违反《基金合同》及国家法律法规行为,对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形,应呈报中国证监会,并采取必要措施保护基金投资者的利益;

(4)根据相关市场规则,为基金开设资金账户、证券账户、期货结算账户等投资所需账户,为基金办理证券交易资金清算;

(5)提议召开或召集基金份额持有人大会;

(6)在基金管理人更换时,提名新的基金管理人;

(7)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金托管人的义务包括但不限于:

(1)以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产;

(2)设立专门的基金托管部门,具有符合要求的营业场所,配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员,负责基金财产托管事宜;

(3)建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,确保基金财产的安全,保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立;对所托管的不同的基金分别设置账户,独立核算,分账管理,保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立;

(4)除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人托管基金财产;

(5)保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证;

(6)按规定开设基金财产的资金账户、证券账户、期货结算账户等投资所需账户,按照《基金合同》的约定,根据基金管理人的投资指令,及时办理清算、交割事宜;

(7)保守基金商业秘密,除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前予以保密,不得向他人泄露;

(8)复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格;

(9)办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;

(10)对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见,说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行;如果基金管理人有未执行《基金合同》规定的行为,还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施;

(11)保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料15年以上;

(12)保存基金份额持有人名册;

(13)按规定制作相关账册并与基金管理人核对;

(14)依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项;

(15)依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定,召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;

(16)按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作;

(17)参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

(18)面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会和银行监督机构,并通知基金管理人;

(19)因违反《基金合同》导致基金财产损失时,应承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

(20)按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时,应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿;

(21)执行生效的基金份额持有人大会的决议;

(22)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(三)基金份额持有人的权利与义务

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受,基金投资者自依据《基金合同》取得基金份额,即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人,直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

每份基金份额具有同等的合法权益。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的权利包括但不限于:

(1)分享基金财产收益;

(2)参与分配清算后的剩余基金财产;

(3)依法申请赎回或转让其持有的基金份额;

(4)按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会;

(5)出席或者委派代表出席基金份额持有人大会,对基金份额持有人大会审议事项行使表决权;

(6)查阅或者复制公开披露的基金信息资料;

(7)监督基金管理人的投资运作;

(8)对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁;

(9)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的义务包括但不限于:

(1)认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件;

(2)了解所投资基金产品,了解自身风险承受能力,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,自行承担投资风险;

(3)关注基金信息披露,及时行使权利和履行义务;

(4)缴纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用;

(5)在其持有的基金份额范围内,承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任;

(6)不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动;

(7)执行生效的基金份额持有人大会的决议;

(8)返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利;

(9)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

二、基金份额持有人大会

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成,基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

(一)召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的,应当召开基金份额持有人大会:

(1)终止《基金合同》,但法律法规另有规定的除外;

(2)更换基金管理人;

(3)更换基金托管人;

(4)转换基金运作方式;

(5)调整基金管理人、基金托管人的报酬标准,但法律法规、中国证监会另有规定的除外;

(6)变更基金类别;

(7)本基金与其他基金的合并;

(8)变更基金投资目标、范围或策略;

(9)变更基金份额持有人大会程序;

(10)基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会;

(11)单独或合计持有本基金总份额10%以上(含10%)基金份额的基金份额持有人(以基金管理人收到提议当日的基金份额计算,下同)就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会;

(12)对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项;

(13)法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改,不需召开基金份额持有人大会:

(1)法律法规要求增加的基金费用的收取;

(2)法律法规和《基金合同》规定的范围内,在不影响现有基金份额持有人利益的前提下,调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式;

(3)因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改;

(4)对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化;

(5)按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

(二)会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外,基金份额持有人大会由基金管理人召集。

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时,由基金托管人召集。

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集,并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起60日内召开;基金管理人决定不召集,基金托管人仍认为有必要召开的,应当由基金托管人自行召集,并自出具书面决定之日起60日内召开并告知基金管理人,基金管理人应当配合。

4、代表基金份额10%以上(含10%)的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集,并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起60日内召开;基金管理人决定不召集,代表基金份额10%以上(含10%)的基金份额持有人仍认为有必要召开的,应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集,并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人;基金托管人决定召集的,应当自出具书面决定之日起60日内召开并告知基金管理人,基金管理人应当配合。

5、代表基金份额10%以上(含10%)的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会,而基金管理人、基金托管人都不召集的,单独或合计代表基金份额10%以上(含10%)的基金份额持有人有权自行召集,并至少提前30日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的,基金管理人、基金托管人应当配合,不得阻碍、干扰。

6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

(三)召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会,召集人应于会议召开前30日,在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容:

(1)会议召开的时间、地点和会议形式;

(2)会议拟审议的事项、议事程序和表决方式;

(3)有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日;

(4)授权委托证明的内容要求(包括但不限于代理人身份,代理权限和代理有效期限等)、送达时间和地点;

(5)会务常设联系人姓名及联系电话;

(6)出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续;

(7)召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下,由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人,还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督;如召集人为基金托管人,则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督;如召集人为基金份额持有人,则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的,不影响表决意见的计票效力。

(四)基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式等法律法规或监管机构允许的其他方式召开,会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席,现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会,基金管理人或基金托管人不派代表列席的,不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时,可以进行基金份额持有人大会议程:

(1)亲自出席会议者持有基金份额的凭证及本人身份证件、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定,并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符;

(2)经核对,汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示,有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一(含二分之一)。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一,召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内,就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一(含三分之一)。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时,通讯开会的方式视为有效:

(1)会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后,在2个工作日内连续公布相关提示性公告;

(2)召集人按基金合同约定通知基金托管人(如果基金托管人为召集人,则为基金管理人)到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人(如果基金托管人为召集人,则为基金管理人)和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见;基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的,不影响表决效力;

(3)本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的,基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一(含二分之一);若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一,召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内,就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上(含三分之一)基金份额的持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见;

(4)上述第(3)项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人,同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定,并与基金登记机构记录相符。

3、在法律法规和监管机关允许的情况下,在会议召开方式上,本基金亦可采用网络、电话等其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会,会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。本基金的基金份额持有人亦可采用网络、电话等方式授权其代理人出席基金份额持有人大会并进行表决。

(五)议事内容与程序

1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项,如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后,对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

(1)现场开会

在现场开会的方式下,首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人,然后由大会主持人宣读提案,经讨论后进行表决,并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表,在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下,由基金托管人授权其出席会议的代表主持;如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会,则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会,不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名(或单位名称)、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名(或单位名称)和联系方式等事项。

(2)通讯开会

(下转A26版)