

# 建信中债湖北省地方政府债指数发起式证券投资基金

## 基金产品资料概要更新

编制日期：2021年7月23日

送出日期：2021年7月30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	建信中债湖北省政府债指数	基金代码	009528
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	基金托管人	兴业银行股份有限公司
基金合同生效日	2020年6月15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	普通开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	闫晗	开始担任本基金基金经理的日期	2020年6月15日
		证券从业日期	2012年10月23日
其他	《基金合同》生效满3年后的对应日，若基金资产净值低于2亿元，《基金合同》应当终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。		

### 二、基金投资与净值表现

#### (一) 投资目标与投资策略

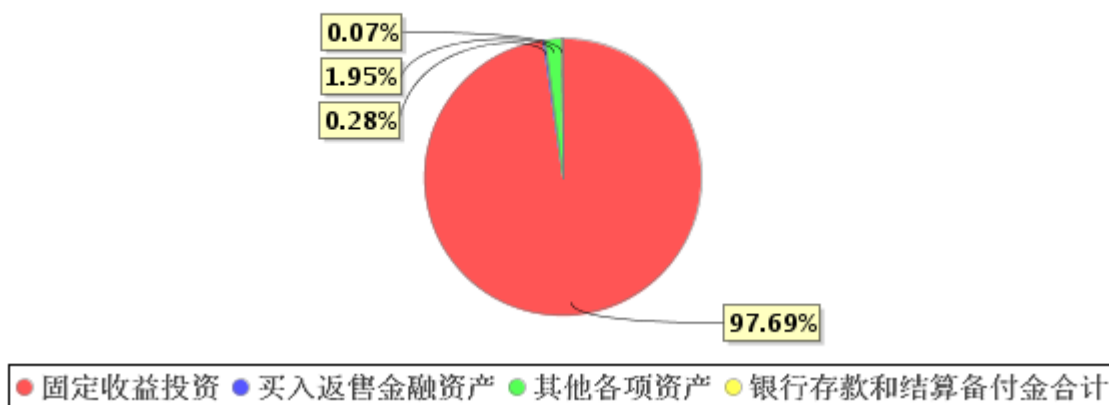
请投资者阅读《招募说明书》第九部分了解详细情况

投资目标	本基金通过指数化投资，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资范围	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，包括国债、政策性金融债、地方政府债、银行存款以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。 本基金不投资除国债、政策性金融债、地方政府债以外的其他债券。 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。 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%，其中投资于标的指数的成份券及其备选成份券的比例不低于非现金基金资产的80%；本基金持有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。 如果法律法规对该比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，本基金的投资范围相应调整。
主要投资策略	本基金为指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法，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，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标指数的有效跟踪。

	在正常市场情况下，本基金力争追求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%。如因指数编制规则调整或其他因素导致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误差进一步扩大。
业绩比较基准	中债-湖北省地方政府债指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金为债券型指数基金，其预期风险和预期收益低于股票基金、混合基金，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。

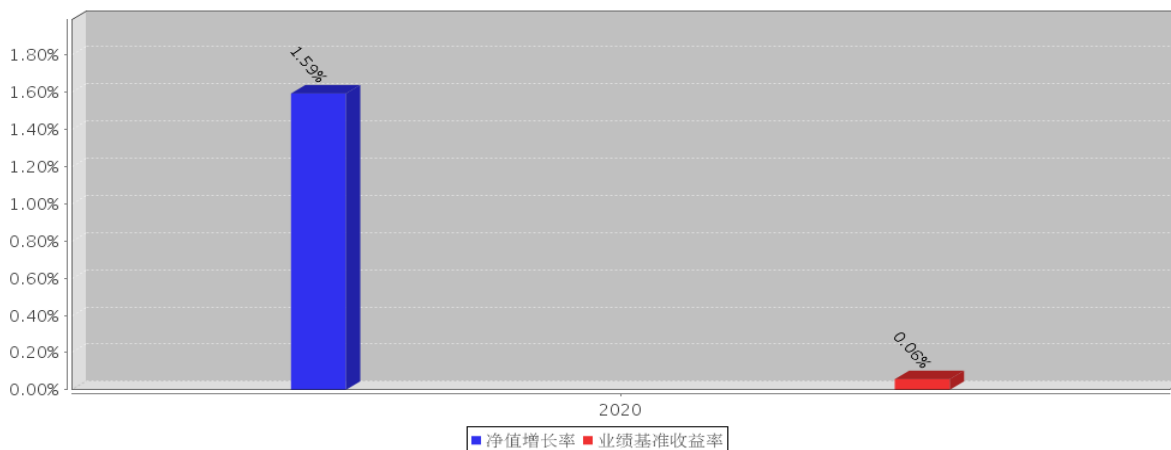
## (二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

### 投资组合资产配置图表(2021年6月30日)



## (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

### 建信中债湖北省政府债指数基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图(2020年12月31日)



注：基金的过往业绩不代表未来表现。

基金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。

## 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
------	-----------------------------	---------

申购费 (前收费)	0 万元 $\leq$ M<100 万元	0.50%
	100 万元 $\leq$ M<200 万元	0.30%
	200 万元 $\leq$ M<500 万元	0.15%
	M $\geq$ 500 万元	1,000.00 元/笔
赎回费	0 天 $\leq$ N<7 天	1.50%
	7 天 $\leq$ N<30 天	0.10%
	N $\geq$ 30 天	0.00%

注:本基金暂不向个人投资者公开销售

## (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	0.15%
托管费	0.05%
其他费用	基金合同生效后与基金相关的信息披露费用,基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费,基金份额持有人大会费用,基金的证券交易、结算费用,基金的银行汇划费用,基金的账户开户费用、账户维护费用,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。指数许可使用费率为0.015%,季度收取下限为人民币5万元。

注: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。

#### 1、指数化投资相关的风险

##### (1) 标的指数的风险

##### 1) 标的指数下跌的风险

标的指数成份券的价格可能受到政治因素、经济因素、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而波动,导致指数值波动,从而使基金收益水平发生变化,产生风险。

##### 2) 标的指数计算出错的风险

指数编制方法的缺陷可能导致标的指数的表现与总体市场表现产生差异,从而使基金收益发生变化。同时,中债金融估值中心有限公司不对指数的实时性、完整性和准确性做出任何承诺。标的指数值可能出现错误,投资者若参考指数值进行投资决策可能导致损失。

##### 3) 标的指数变更的风险

根据基金合同的规定,如果指数发布机构变更或停止该标的指数的编制及发布,或者该标的指数由其他指数代替,或由于指数编制方法等重大变更导致该指数不宜继续作为标的指数,或证券市场有其他更权威的、代表性更强、更适合投资的指数推出时,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,在履行适当程序后变更本基金的标的指数。如前述标的指数调整导致投资范围等发生实质变更,则基金投资组合将随之调整,基金的风险收益特征将与新标的指数一致,投资者须承担此项调整带来的风险与成本。

(2) 本基金可能遇到的风险还包括指数编制机构停止服务风险、成份券违约风险、跟踪误差控制未达约定目标风险等。

#### 2、本基金主要投资于湖北省地方政府债,可能面临湖北省地方政府债流动性风险、投资集中度风险等。

##### (1) 政策性金融债流动性风险

地方政府债市场投资者行为具有一定趋同性，在极端市场环境下，可能集中买入或卖出，存在流动性风险。

## (2) 投资集中度风险

湖北省地方政府债发行人较为单一，若单一主体发生重大事项变化，可能对基金净值表现产生较大影响。

## (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。

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官方网站 [www.ccbfund.cn] [客服电话：400-81-95533]

- 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