

兴业中证国有企业改革指数增强型证券投资基金清算报告

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

清算报告公告日：2020 年 09 月 28 日

兴业中证国有企业改革指数增强型证券投资基金清算报告

兴业中证国有企业改革指数增强型证券投资基金经 2017 年 11 月 01 日中国证监会证监许可[2017]1962 号文准予募集，募集期为 2018 年 4 月 27 日至 2018 年 7 月 23 日。募集结束后，该产品于 2018 年 7 月 26 日获中国证监会机构部函[2018]1751 号文备案后正式成立，基金托管人为招商银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。

一、重要提示

根据相关法律法规和《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》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，基金份额持有人大会决定终止《基金合同》的，《基金合同》应当终止。本基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，于 2020 年 9 月 7 日表决通过了《关于终止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有关事项的议案》。本基金管理人于 2020 年 9 月 9 日发布了《兴业基金管理有限公司关于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持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。本基金最后运作日为 2020 年 9 月 9 日，自 2020 年 9 月 10 日起，本基金进入清算期。

由基金管理人、基金托管人、德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）和通力律师事务所于 2020 年 9 月 10 日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

1、基金基本情况

二、基金概况

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

基金简称：兴业中证国有企业改革指数增强

基金主代码：005339

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2018 年 7 月 26 日

基金管理人名称：兴业基金管理有限公司

基金托管人名称：招商银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称 兴业中证国有企业改革指数增强 A

兴业中证国有企业改革指数增

强 C

下属分级基金的交易代码 005339 008220

2、基金产品说明

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。

投资策略

本基金的投资策略包括资产配置策略、股票投资组合策略、债券投资策略、股指期货投资策略、权证投资策略、中小企业私募债券投资策略、资产支持证券投资策略。

业绩比较基准 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% 兴业中证国有企业改革指数增强型证券投资基金清算报告

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。

资产负债表（经审计）

三、财务会计报告

会计主体：兴业中证国有企业改革指数增强型证券投资基金

单位：人民币元

最后运作日

2020 年 9 月 9 日

清算结束日

2020 年 9 月 14 日

资 产：

银行存款 18,111,115.72 2,135,032.04

存出保证金 4,114.02 4,114.02

应收利息 11,185.60 11,673.23

资产总计 18,126,415.34 2,150,819.29

负 债：

应付赎回款 15,932,650.03

应付管理人报酬 4,090.15

应付托管费 613.51

应付交易费用 3,715.04

应付指数使用费 551.66 551.66

其他负债 103,001.11 103,316.11

负债合计 16,044,621.50 103,867.77

所有者权益:

实收基金 1,481,782.49 1,456,805.15

未分配利润 600,011.35 590,146.37

所有者权益合计 2,081,793.84 2,046,951.52

负债和所有者权益总计 18,126,415.34 2,150,819.29

注: 1、本基金最后运作日 2020 年 9 月 9 日, 基金份额净值人民币 1.4049 元, 基金份额总额 1,481,782.49 份。其中下属 A 类基金份额净值 1.4049 元, 基金份额总额 1,481,773.77 份, 下属 C 类基金份额净值 1.4312 元, 基金份额总额 8.72 份。

2、本基金的清算报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》及《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制的。由于报告性质所致, 本清算报表并无比较期间的相关数据列示。德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)已对财务报表进行了审计并出具了无保留意见的兴业中证国有企业改革指数增强型证券投资基金清算报告审计报告。

1、基金基本情况

四、清算报表附注

兴业中证国有企业改革指数增强型证券投资基金经 2017 年 11 月 01 日中国证监会证监许可[2017]1962 号文准予募集, 募集期为 2018 年 4 月 27 日至 2018 年 7 月 23 日。募集结束后, 该产品于 2018 年 7 月 26 日获中国证监会机构部函[2018]1751 号文备案后正式成立, 基金托管人为招商银行股份有限公司。自 2018 年 7 月 26 日起至 2020 年 9 月 9 日止期间, 本基金按《基金合同》约定正常运作。

2、清算原因

根据相关法律法规和《基金合同》的有关规定, 基金份额持有人大会决定终止《基金合同》的, 《基金合同》应当终止。本基金以通讯方式召开基金份额持有人大会, 于 2020 年 9 月 7 日表决通过了《关于终止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有关事项的议案》。本基金管理人于 2020 年 9 月 9 日发布了《兴业基金管理有限公司关于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持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。本基金最后运作日为 2020 年 9 月 9 日, 自 2020 年 9 月 10 日起, 本基金进入清算期。

3、清算期间

本基金的清算期间为 2020 年 9 月 10 日(清算开始日)起至 2020 年 9 月 14 日(清算结束日)止期间。

4、清算报表编制基础

本清算报表以非持续经营为基础编制。因此, 本清算报表列示资产和负债时不再区分流动资产和非流动资产、流动负债和非流动负债, 期末资产项目以预计可收回金额列报, 负债项目按照需要偿付的金额列报; 实收基金和未分配利润以所有者权益项目进行列报。本清算报表仅列示了 2020 年 9 月 9 日(最后运作日)及 2020 年 9 月 14 日(清算结束日)的清算资产负债表和 2020 年 9 月 10 日(清算开始日)至 2020 年 9 月 14 日(清算结束日)止清算期间的清算损益表及重要报表项目说明, 除上述内容外, 本基金遵循《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《兴业基金管理有限公司关于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持有人大会表决结果暨决议生效的公告》及《基金合同》的有关规定。

自 2020 年 9 月 10 日至 2020 年 9 月 14 日止清算期间，基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

五、清算情况

1、清算费用 兴业中证国有企业改革指数增强型证券投资基金清算报告

按照《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》第十九部分“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的规定，清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

2、最后运作日资产处置情况

(1) 本基金最后运作日活期存款人民币 18,111,115.72 元，是存储于基金托管人招商银行股份有限公司的活期银行存款。

(2) 本基金最后运作日应收利息人民币 11,185.60 元，其中包括活期银行存款利息人民币 10,829.91 元、应收清算备付金利息人民币 287.35 元、应收存出保证金利息人民币 68.34 元。应收利息一般于每季度 3 月、6 月、9 月、12 月 21 日（节假日顺延）结息。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，若于基金剩余财产划出日尚未收到结息，基金管理人将以自有资金先行垫付该笔款项，该金额可能与实际结息金额存在略微差异，结息尾差由基金管理人承担。

(3) 本基金最后运作日结算保证金为人民币 4,114.02 元，将根据中国证券登记结算公司关于结算保证金调整规则，于期后划入托管账户。

3、最后运作日负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 4,090.15 元，该款项已于 2020 年 9 月 10 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 613.51 元，该款项已于 2020 年 9 月 10 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 3,715.04，为券商佣金费用，该款项已于 2020 年 9 月 10 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 15,932,650.03 元，该款项已于 2020 年 9 月 10 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付指数使用费为人民币 551.66 元。

(5) 本基金最后运作日其他负债为人民币 103,001.11 元，包括预提审计费、信息披露费、运作期汇划手续费。其中预提审计费为人民币 20,000.00 元；预提信息披露费为 82,951.11 元；运作期汇划手续费为人民币 50.00 元。

4、最后运作日赎回申请及赎回款支付情况

本基金管理人于 2020 年 9 月 9 日确认的最后运作日赎回申请共计 24,977.34 份，应付赎回款金额为人民币 35,090.66 元，扣除赎回费 75.71 元后，应付赎回款 35,014.95 元，已于 2020 年 9 月 14 日支付。

5、清算期间的损益情况

单位：人民币元

项目 自 2020 年 9 月 10 日（清算开始日）至
2020 年 9 月 14 日（清算结束日）

一、清算收入 563.34

利息收入（注 1） 487.63

差价收入

公允价值变动损益

其他收入（注 2） 75.71

二、清算费用 315.00 兴业中证国有企业改革指数增强型证券投资基金清算报告
管理人报酬（注 3）

基金托管费（注 3）

交易费用

利息支出

税金及附加

其他费用（注 4） 315.00

三、清算净收益 248.34

注：

1、利息收入系以当前适用利率预估计提的自 2020 年 9 月 10 日(清算开始日)至 2020 年 9 月 14 日(清算结束日)期间的银行存款利息收入人民币 468.68 元和存出保证金利息收入人民币 0.95 元，共计人民币 487.63 元。

2、其他收入系自 2020 年 9 月 10 日(清算开始日)至 2020 年 9 月 14 日(清算结束日)期间确认的赎回费收入。

3、根据《兴业基金管理有限公司关于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持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金自 2020 年 9 月 10 日起，停止收取基金管理费、基金托管费、指数使用费。

4、其他费用系自 2020 年 9 月 10 日(清算开始日)至 2020 年 9 月 14 日(清算结束日)止清算期间计提的托管账户扣缴的汇划手续费。

6、资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目 自 2020 年 9 月 10 日（清算开始日）至
2020 年 9 月 14 日（清算结束日）

一、最后运作日 2020 年 9 月 9 日基金净资产 2,081,793.84

加：清算期间净收益 248.34

减：最后运作日有效赎回申请对应赎回款 35,090.66

二、2020 年 9 月 14 日基金净资产 2,046,951.52

资产处置及负债清偿后，2020 年 9 月 14 日本基金剩余财产为人民币 2,046,951.52 元，根据本基金的《基金合同》约定，依据基金从财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、缴纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

2020 年 9 月 14 日至清算款划出日前一日的银行存款产生的利息亦属份额持有人所有。

为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，若于基金剩余财产划出日尚未收到应收利息结息，基金管理人将以自有资金先行垫付该笔款项（该金额可能与实际结息金额存在略微差异），供清盘分配使用。结息尾差由基金管理人承担。基金管理人垫付的资金以及垫付资金到账日起孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。

7、基金财产清算报告的告知安排

清算报告已经基金托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案后向基金份额持有人公告。

兴业中证国有企业改革指数增强型证券投资基金清算报告

1、备查文件目录

六、备查文件目录

（1）《兴业中证国有企业改革指数增强型证券投资基金清算审计报告》；

（2）《兴业中证国有企业改革指数增强型证券投资基金清算报告》的法律意见。

2、存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所，投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在

合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（www.cib-fund.com）查阅。

3、查阅方式

本报告存放在本基金管理人及托管人住所，供公众查阅、复制。

兴业中证国有企业改革指数增强型证券投资基金
基金财产清算小组

2020 年 9 月 28 日