

景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金

2022 年第 4 季度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 1 月 20 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 1 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 10 月 01 日起至 2022 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	景顺长城中证 500 指数增强
场内简称	无
基金主代码	006682
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 3 月 25 日
报告期末基金份额总额	1,239,871,872.18 份
投资目标	本基金为增强型指数基金，在力求有效跟踪标的指数，控制本基金的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%的基础上，结合量化方法追求超越标的指数的业绩水平。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金为指数基金，股票投资比例范围为基金资产的 90%—95%，大类资产配置不作为本基金的核心策略。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金作为增强型的指数基金，一方面采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数，另一方面采用量化模型调整投资组合力求超越标的指数表现。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量，</p>

	<p>本基金适时对债券进行投资。通过研究国内外宏观经济、货币和财政政策、市场结构变化、资金流动情况，采取自上而下的策略判断未来利率变化和收益率曲线变动的趋势及幅度，确定组合久期。进而根据各类资产的预期收益率，确定债券资产配置。</p> <p>4、权证、股指期货投资策略</p> <p>本基金可投资权证、股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。</p> <p>本基金对权证的分析判断主要从市场环境、时机、权证定价、市场供求、发行人资质、交易冲击等方面综合考量，运用权证定价模型计算权证当前的合理价格。本基金适时选择具有相对优势的权证并制定相应的投资计划。</p> <p>本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位调整的频率、交易成本和带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。</p> <p>5、中小企业私募债券的投资策略</p> <p>对单个券种的分析判断与其它信用类固定收益品种的方法类似。在信用研究方面，本基金加强自下而上的分析，将机构评级与内部评级相结合，着重通过发行方的财务状况、信用背景、经营能力、行业前景、个体竞争力等方面判断其在期限内的偿付能力，尽可能对发行人进行充分详尽地调研和分析。</p>
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	景顺长城中证 500 指数增强 A 景顺长城中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	006682 016935
报告期末下属分级基金的份额总额	1,239,748,206.90 份 123,665.28 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2022 年 10 月 1 日-2022 年 12 月 31 日）	报告期（2022 年 10 月 28 日-2022 年 12 月 31 日）
		景顺长城中证 500 指数增强 A

1. 本期已实现收益	-91,327,279.30	-149.24
2. 本期利润	-36,677,189.06	-2,317.25
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0322	-0.0566
4. 期末基金资产净值	1,701,516,308.00	169,665.10
5. 期末基金份额净值	1.3724	1.3719

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、本基金于 2022 年 10 月 27 日增设 C 类份额，并于 2022 年 10 月 28 日开始对 C 类份额进行估值。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

景顺长城中证 500 指数增强 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.84%	0.99%	2.52%	0.97%	-4.36%	0.02%
过去六个月	-11.07%	1.06%	-8.66%	1.04%	-2.41%	0.02%
过去一年	-15.91%	1.30%	-19.30%	1.31%	3.39%	-0.01%
过去三年	38.22%	1.32%	11.15%	1.28%	27.07%	0.04%
自基金合同生效起至今	37.24%	1.30%	4.59%	1.29%	32.65%	0.01%

景顺长城中证 500 指数增强 C

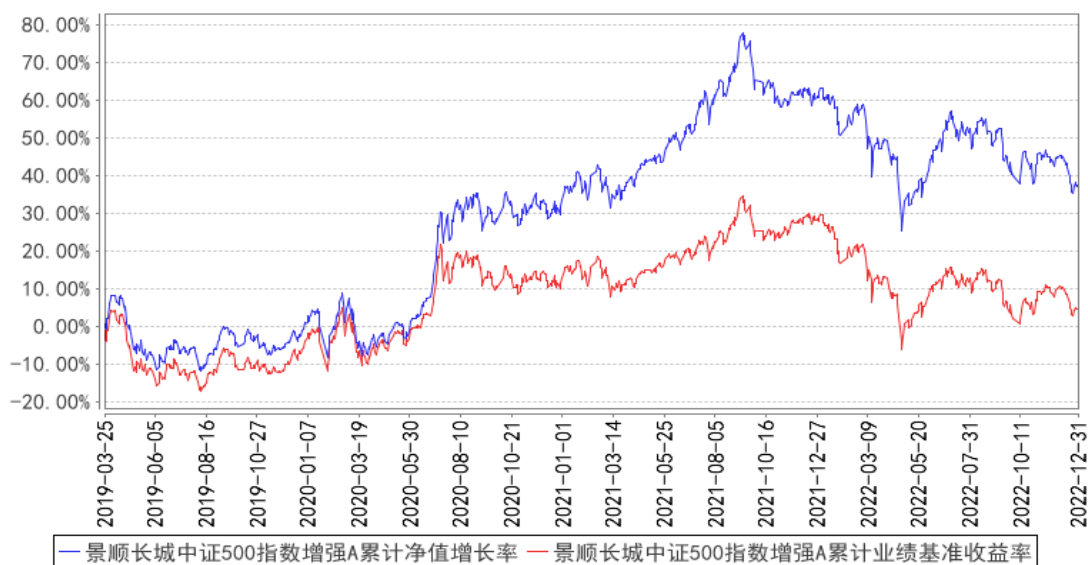
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同	-4.08%	0.95%	-1.56%	0.91%	-2.52%	0.04%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

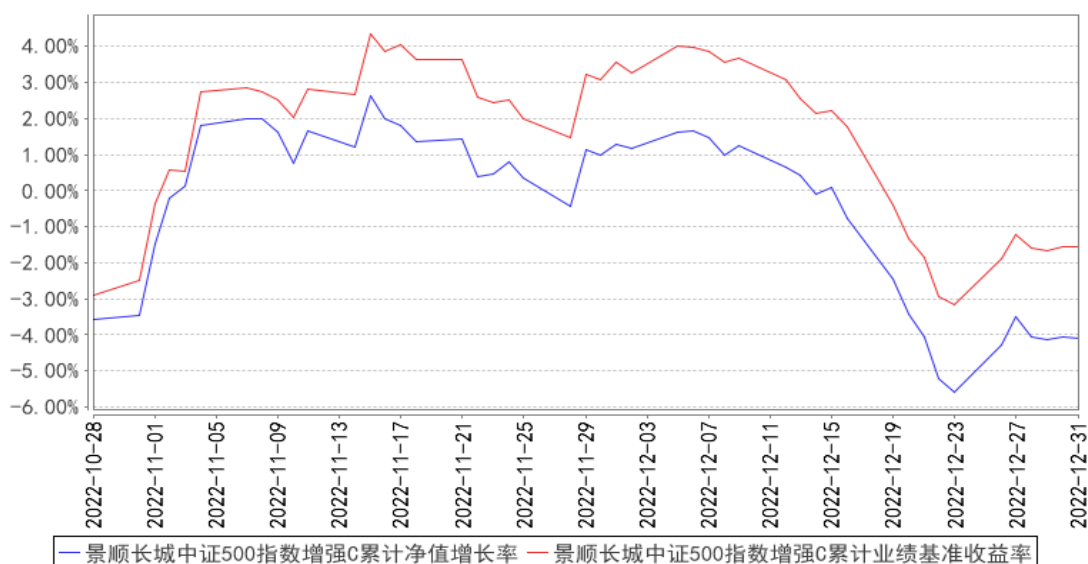
注：本基金于 2022 年 10 月 27 日增设 C 类份额，并于 2022 年 10 月 28 日开始对 C 类份额进行估值。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

景顺长城中证500指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



景顺长城中证500指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：基金的投资组合比例为：股票投资比例范围为基金资产的 90%—95%，投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%，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以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资

产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的建仓期为自 2019 年 3 月 25 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。本基金自 2022 年 10 月 27 日起增设 C 类基金份额。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
黎海威	本基金的基金经理	2019 年 3 月 25 日	-	19 年	经济学硕士，CFA。曾任美国穆迪 KMV 公司研究员，美国贝莱德集团（原巴克莱国际投资管理有限公司）基金经理、主动股票部副总裁，香港海通国际资产管理有限公司（海通国际投资管理有限公司）量化总监。2012 年 8 月加入本公司，自 2013 年 10 月起担任量化及指数投资部基金经理，现任公司副总经理、量化及指数投资部总经理、基金经理。具有 19 年证券、基金行业从业经验。
徐喻军	本基金的基金经理	2019 年 3 月 25 日	-	12 年	理学硕士，CFA。曾任安信证券风险管理部风险管理专员。2012 年 3 月加入本公司，担任量化及 ETF 投资部 ETF 专员，自 2014 年 4 月起担任量化及指数投资部基金经理。具有 12 年证券、基金行业从业经验。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离任日期”为根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；对此后的非首任基金经理，“任职日期”指根据公司决定聘任后的公告日期，“离任日期”指根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资

基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 12 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易，按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2022 年四季度，海外经济基本面继续走弱，国内经济下行的压力仍在持续发酵。国内来看，11 月工业增加值同比增长 2.2%，10-12 月国内制造业 PMI 依次为 49.2、48、47，工业生产放缓，经济基本面供需均进一步下行。11 月 CPI 同比上升 1.6%，环比下降 0.2%，PPI 同比下降 1.3%，环比上涨 0.10%，CPI 维持低位、PPI 同比延续负增长，反映出内需仍然不足、经济动能较差。11 月 M2 同比增速 12.40%，M1 同比增速 4.60%，企业投资意愿的修复仍需时间。11 月末外汇储备 3.1 万亿美元，人民币汇率波动有所放大。整体来看，国内货币政策总体保持稳健，流动性合理适度，疫情影响下经济基本面有所下行。四季度以来 A 股市场也呈现出较大的波动，风格方面价值相对占优。上证指数、沪深 300 指数以及创业板指数分别上涨 2.14%、1.75% 和 2.53%。

展望 2023 年一季度，海外方面，美国加息周期进入后半场，全球流动性压力减小。国内方面，随着疫情防控政策的不断优化和完善，国内经济或将企稳复苏。宏观场景判断短期内倾向于“宽货币、宽信用”，随着稳增长政策的不断推出，企业盈利水平或将触底回升。长期来看，改革创新是保持经济增长的根本动力，在科学技术带动产业升级的大背景下，我们对经济的长期健康发展持较为乐观的态度。目前 A 股市场整体估值已进入长期价值配置区间，具有较高成长性的行业

和较强竞争力的公司，将具备较高的投资价值。

本基金是以中证 500 指数为基准的指数增强基金，我们的投资组合主要以基本面量化选股为主，风格上维持价值和成长之间的平衡，同时关注现金流良好和内生长稳健的公司，在股市波动中以自下而上选股为主以期产生持续稳定的超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2022 年 4 季度，景顺长城中证 500 指数增强 A 份额净值增长率为-1.84%，业绩比较基准收益率为 2.52%。

2022 年 10 月 28 日（C 类份额首个估值日）至 2022 年 12 月 31 日，景顺长城中证 500 指数增强 C 份额净值增长率为-4.08%，业绩比较基准收益率为-1.56%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,594,850,044.43	93.03
	其中：股票	1,594,850,044.43	93.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	117,393,076.46	6.85
8	其他资产	2,057,857.24	0.12
9	合计	1,714,300,978.13	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	12,708,529.60	0.75
B	采矿业	43,210,786.99	2.54

C	制造业	774,144,776.12	45.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	60,197,679.00	3.54
E	建筑业	28,668,000.40	1.68
F	批发和零售业	80,301,934.15	4.72
G	交通运输、仓储和邮政业	25,253,751.00	1.48
H	住宿和餐饮业	1,785,600.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	38,952,719.94	2.29
J	金融业	137,787,608.22	8.10
K	房地产业	46,086,186.97	2.71
L	租赁和商务服务业	29,635,369.88	1.74
M	科学研究和技术服务业	10,836,924.12	0.64
N	水利、环境和公共设施管理业	6,554,025.17	0.39
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	14,474,440.00	0.85
S	综合	-	-
	合计	1,310,598,331.56	77.02

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,589,462.00	0.15
B	采矿业	12,418,725.00	0.73
C	制造业	223,368,327.61	13.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	28,565,721.21	1.68
J	金融业	251,698.00	0.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	12,233,951.35	0.72
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	106,663.20	0.01
R	文化、体育和娱乐业	4,717,164.50	0.28
S	综合	-	-

合计	284,251,712.87	16.70
----	----------------	-------

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601555	东吴证券	6,149,862	40,158,598.86	2.36
2	601128	常熟银行	5,268,700	39,778,685.00	2.34
3	600967	内蒙一机	4,331,100	35,774,886.00	2.10
4	600567	山鹰国际	13,962,555	34,627,136.40	2.03
5	601108	财通证券	4,512,333	32,127,810.96	1.89
6	600998	九州通	2,426,300	31,638,952.00	1.86
7	300861	美畅股份	638,500	31,388,660.00	1.84
8	603026	胜华新材	339,007	31,290,346.10	1.84
9	002273	水晶光电	2,451,239	28,900,107.81	1.70
10	600170	上海建工	11,026,154	28,668,000.40	1.68

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002074	国轩高科	652,700	18,817,341.00	1.11
2	002258	利尔化学	924,009	16,595,201.64	0.98
3	300207	欣旺达	744,375	15,743,531.25	0.93
4	600211	西藏药业	399,700	14,357,224.00	0.84
5	002594	比亚迪	49,500	12,720,015.00	0.75

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动 (元)	风险说明
IC2306	中证 500 股指期货 2306 合约	5	5,809,400.00	-247,421.42	根据公募基金相关法规和本基金合同,我们可以使用股指期货进行加减仓位的投资操作。本报告期间,股指期货贴水,我们选择保持一定比例的股指期货多头,获取比较确定的超额收益。
公允价值变动总额合计 (元)					-247,421.42
股指期货投资本期收益 (元)					-834,874.38
股指期货投资本期公允价值变动 (元)					-247,421.42

注: 买入持仓以正数表示, 卖出持仓以负数表示。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则, 以套期保值为目的, 主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用, 降低股票仓位调整的频率、交易成本和带来的跟踪误差, 达到有效跟踪标的指数的目的。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定, 本基金投资范围不包括国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同约定, 本基金投资范围不包括国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

江苏常熟农村商业银行股份有限公司（以下简称“常熟银行”）于 2022 年 12 月 28 日收到人民银行南京分行出具的行政处罚决定书（南银罚决字〔2022〕13 号），其因未按规定履行客户身份识别义务、未按规定报送大额交易或者可疑交易报告等多项违法违规行为，被处以罚款。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对常熟银行进行了投资。

财通证券股份有限公司（以下简称“财通证券”，股票代码：601108）于 2022 年 11 月 30 日收到国家外汇管理局浙江省分局出具的行政处罚决定书，其因违反外汇账户管理规定，被罚款人民币 14 万元。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对财通证券进行了投资。

上海建工集团股份有限公司（以下简称“上海建工”，股票代码：600170）于 2022 年 4 月 15 日收到上海市生态环境局出具的行政处罚决定书，其因违反水污染防治管理制度，被罚款人民币 192,000.00 元。

上海建工于 2022 年 11 月 7 日收到南京市浦口区城乡建设局出具的行政处罚决定书，其因未按要求履行文明施工要求、造成现场扬尘污染，被罚款人民币 10,000.00 元。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对上海建工进行了投资。

本基金投资前十名证券的其余发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,069,210.85
2	应收证券清算款	175,795.29
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	812,851.10
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,057,857.24

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	景顺长城中证 500 指数增强 A	景顺长城中证 500 指数增强 C
报告期期初基金份额总额	1,113,894,083.68	-
报告期期间基金总申购份额	170,969,191.27	196,368.52
减：报告期期间基金总赎回份额	45,115,068.05	72,703.24
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	1,239,748,206.90	123,665.28

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人本期末运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人本期末运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20221001-20221231	256, 558, 803. 05	104, 336, 184. 10	-	360, 894, 987. 15	29. 11

产品特有风险

本基金由于存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%的情况，可能会出现如下风险：

1、大额申购风险

在出现投资者大额申购时，如本基金所投资的标的资产未及时准备，则可能降低基金净值涨幅。

2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险：

(1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；

(2) 如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

(3) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；

(4) 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；

(5) 基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；

(6) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

本基金管理人将建立完善的风险管理机制，以有效防止和化解上述风险，最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。投资者在投资本基金前，请认真阅读本风险提示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，亦自行承担基金投资中出现的各类风险。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

为了更好地满足投资者的理财需求，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《开放式证券投资基金销售费用管理规定》等法律法规的规定和《景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》的约定，经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，景顺长城基金管理有限公司决定自 2022 年 10 月 27 日起对景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金在现有基金份额的基础上增设 C 类基金份额，原基金份额转为 A 类基金份额，并相应修改基金合同和其他法律文件相关内容。详情请参阅本基金管理人于 2022 年 10 月 27 日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城中证 500 指数增强型证券

投资基金增设 C 类基金份额并相应修改基金合同、托管协议部分条款的公告》。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
- 6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

9.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2023 年 1 月 20 日