

景顺长城中证上海环交所碳中和指数证券投资基金

基金产品资料概要

编制日期：2023 年 12 月 4 日

送出日期：2023 年 12 月 5 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	景顺长城环交所碳中和指数	基金代码	016543
下属基金简称	景顺长城环交所碳中和指数 A	下属基金交易代码	016543
下属基金简称	景顺长城环交所碳中和指数 C	下属基金交易代码	016544
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
基金合同生效日	-	上市交易所及上市日期	-
基金类型	股票型	交易币种	人民币
运作方式	开放式（普通开放式）	开放频率	每个开放日
基金经理	张晓南	开始担任本基金基金经理的日期	-
		证券从业日期	2010 年 7 月 1 日
其他	《基金合同》存续期内，如果存在连续 50 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形，基金管理人应当终止《基金合同》，无需召开基金份额持有人大会。 未来若出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人应当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，本基金合同终止。		

二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资范围	本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证，下同），此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票及存托凭证）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、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、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、

	可交换公司债)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。本基金将根据法律法规的规定参与转融通证券出借及融资业务。 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。 本基金标的指数:中证上海环交所碳中和指数。
主要投资策略	(一)资产配置策略;(二)股票(含存托凭证)投资策略;(三)债券投资策略;(四)可转换债券和可交换公司债投资策略;(五)股指期货投资策略;(六)国债期货投资策略;(七)股票期权投资策略;(八)资产支持证券投资策略;(九)参与融资及转融通证券出借业务的投资策略
业绩比较基准	中证上海环交所碳中和指数收益率×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,本基金为指数型基金,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。

注:

了解详细情况请阅读基金合同及招募说明书“基金的投资”部分。

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:

景顺长城环交所碳中和指数 A

费用类型	份额(S)或金额(M) /持有期限(N)	收费方式/费率	备注
认购费	M<100万元	0.10%	养老金客户
	100万元≤M<200万元	0.06%	养老金客户
	200万元≤M<500万元	0.03%	养老金客户
	M≥500万元	1,000元/笔	养老金客户
	M<100万元	1%	普通投资群体
	100万元≤M<200万元	0.60%	普通投资群体
	200万元≤M<500万元	0.30%	普通投资群体
	M≥500万元	1,000元/笔	普通投资群体
申购费 (前收费)	M<100万元	0.12%	养老金客户
	100万元≤M<200万元	0.08%	养老金客户
	200万元≤M<500万元	0.05%	养老金客户
	M≥500万元	1,000元/笔	养老金客户
	M<100万元	1.20%	普通投资群体
	100万元≤M<200万元	0.80%	普通投资群体
	200万元≤M<500万元	0.50%	普通投资群体
	M≥500万元	1,000元/笔	普通投资群体
赎回费	N<7天	1.50%	-
	N≥7天	0%	-

景顺长城环交所碳中和指数 C

费用类型	份额(S)或金额(M)	收费方式/费率
------	-------------	---------

	/持有期限 (N)	
赎回费	N < 7 天	1.50%
	N ≥ 7 天	0%

(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	0.50%	
托管费	0.10%	
销售服务费	景顺长城环交所碳中和指数 A	-
	景顺长城环交所碳中和指数 C	0.40%

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

一、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。

二、本基金的特定风险

基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动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股票市场相似的风险收益特征。

1、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

标的指数并不能完全代表整个股票市场。标的指数成份股的平均回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。

2、标的指数波动的风险

标的指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、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。

3、基金投资组合回报与标的指数回报偏离及跟踪误差控制未达约定的风险

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，亦可能使本基金跟踪误差控制未达约定：

(1) 由于标的指数调整成份股或变更编制方法，使基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度与跟踪误差。

(2) 由于标的指数成份股发生配股、增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化，使基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差。

(3) 成份股派发现金红利、新股市值配售收益将导致基金收益率超过标的指数收益率，产生正的跟踪偏离度。

(4) 由于成份股停牌、摘牌或流动性差等原因使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。

(5) 由于基金投资过程中的证券交易成本，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。

(6) 在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，都会对基金的收益产生影响，从而影响基金对标的指数的跟踪程度。

(7) 其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制，基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不完全相同；因缺乏卖空及其他机制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。

4、跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金力争相对于业绩比较基准的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%。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。

5、标的指数变更的风险

尽管可能性很小，根据基金合同规定，如出现变更标的指数的情形，基金将变更标的指数。如变更的标的指数和原标的指数的编制方法发生实质性变更的，则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。

6、招募说明书中指数编制方案简述未及时更新的风险

如指数编制方案发生了修订，本基金将在定期的更新招募说明书中更新指数编制方案简述。本基金存在着招募说明书中所载的指数编制方案简述与指数编制方的最新指数编制方案不一致的风险。

7、本基金存在指数成份股停牌的风险

标的指数成份股可能因各种原因临时或长期停牌，发生成份股停牌时，基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

8、指数编制方停止服务的风险

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。

9、本基金可按照基金合同的约定投资流通受限证券。但由于投资流通受限证券在锁定期内无法变现，处于锁定期内的证券可能因为市场调整的影响而出现价格波动的风险。

10、衍生品投资风险

本基金可投资于股指期货、国债期货和股票期权等金融衍生品。投资股指期货、国债期货和股票期权主要存在以下风险：市场风险、市场流动性风险、基差风险、结算流动性风险、保证金风险、信用风险、作业风险。

11、资产支持证券投资风险

本基金将资产支持证券纳入到投资范围当中，可能带来以下风险：信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、操作风险、法律风险。

12、科创板股票投资风险：本基金如投资国内上市的科创板股票，会面临因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于流动性风险、退市风险、投资集中的风险、股价大幅波动的风险和科创板法律法规修改的风险等。

13、可转换债券(可交换公司债)投资风险

包括利息损失风险、公司经营风险(信用风险)、提前赎回风险。

14、基金参与融资与转融通证券出借业务的风险

本基金可根据法律法规和基金合同的约定参与融资及转融通证券出借业务，可能存在杠杆投资风险、流动性风险以及对对手方交易风险等融资及转融通业务特有风险。

15、存托凭证投资风险

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险。

以上所述因素可能会给本基金投资带来特殊交易风险。

三、其他风险

1、市场风险；2、流动性风险；3、管理风险；4、信用风险；5、操作和技术风险；6、合规性风险；7、提前终止的风险；8、其他风险；9、税负增加风险；10、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险。

(二) 重要提示

基金合同生效后，基金产品资料概要的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。

景顺长城中证上海环交所碳中和指数证券投资基金经中国证监会证监许可【2022】1775号文准予募集注册，并经中国证监会《关于景顺长城中证上海环交所碳中和指数证券投资基金延期募集备案的回函》（机构部函【2023】779号）准予延期募集。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，但不保证投资本基金一定盈利，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。

因基金合同产生或与之相关的争议，各方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费由败诉方承担。

基金管理人深知个人信息对投资者的重要性，致力于投资者个人信息的保护。基金管理人承诺按照法律法规和相关监管要求的规定处理投资者的个人信息，包括通过基金管理人直销、销售机构或场内经纪机构购买景顺长城基金管理有限公司旗下基金产品的所有个人投资者。基金管理人需处理的机构投资者信息中可能涉及其法定代表人、受益所有人、经办人等个人信息，也将遵守上述承诺进行处理。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[www.igwfm.com][客服电话：400-8888-606]

1、《景顺长城中证上海环交所碳中和指数证券投资基金基金合同》、《景顺长城中证上海环交所碳中和指数证券投资基金托管协议》、《景顺长城中证上海环交所碳中和指数证券投资基金\招募说明书》

2、定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告

3、基金份额净值

4、基金销售机构及联系方式

5、其他重要资料

六、其他情况说明

无。