

景顺长城上证科创板 50 成份指数增强型证券投资基金

基金产品资料概要更新

编制日期：2024 年 6 月 11 日

送出日期：2024 年 6 月 14 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	景顺长城上证科创板 50 成份指数增强	基金代码	019767
下属基金简称	景顺长城上证科创板 50 成份指数增强 A	下属基金交易代码	019767
下属基金简称	景顺长城上证科创板 50 成份指数增强 C	下属基金交易代码	019768
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司	基金托管人	国信证券股份有限公司
基金合同生效日	2024 年 5 月 28 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	黎海威	开始担任本基金基金经理的日期	2024 年 5 月 28 日
		证券从业日期	2003 年 9 月 15 日
基金经理	徐喻军	开始担任本基金基金经理的日期	2024 年 5 月 28 日
		证券从业日期	2010 年 7 月 21 日
其他	如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，基金管理人应当按基金合同约定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相关事项表决未通过的，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	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。
投资范围	本基金投资范围主要为标的指数成份股及其备选成份股（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、科创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、可交换公司债等)、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、信用衍生品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。基金的投资组合比例为:本基金股票资产占基金资产的比例为 90%-95%,投资于标的指数成份股及其备选成份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、国债期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计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。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金标的指数:上证科创板 50 成份指数。
主要投资策略	1、资产配置策略;2、股票投资策略;3、债券投资策略;4、股指期货投资策略;5、国债期货投资策略;6、股票期权投资策略;7、资产支持证券投资策略;8、参与融资及转融通证券出借业务的投资策略;9、信用衍生品投资策略。
业绩比较基准	上证科创板 50 成份指数收益率×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。

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:

景顺长城上证科创板 50 成份指数增强 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<1,000,000	1.00%	普通投资群体
	1,000,000≤M<2,000,000	0.60%	普通投资群体
	2,000,000≤M<5,000,000	0.30%	普通投资群体
	M≥5,000,000	1,000元/笔	普通投资群体
	M<1,000,000	0.10%	养老金客户
	1,000,000≤M<2,000,000	0.06%	养老金客户
	2,000,000≤M<5,000,000	0.03%	养老金客户
	M≥5,000,000	1,000元/笔	养老金客户
申购费 (前收费)	M<1,000,000	1.20%	普通投资群体
	1,000,000≤M<2,000,000	0.80%	普通投资群体
	2,000,000≤M<5,000,000	0.50%	普通投资群体
	M≥5,000,000	1,000元/笔	普通投资群体
	M<1,000,000	0.12%	养老金客户
	1,000,000≤M<2,000,000	0.08%	养老金客户
	2,000,000≤M<5,000,000	0.05%	养老金客户
	M≥5,000,000	1,000元/笔	养老金客户
赎回费	N<7天	1.50%	-

7 天 \leq N<30 天	0.75%	-
30 天 \leq N<180 天	0.50%	-
180 天 \leq N<1 年	0.25%	-
N \geq 1 年	0	-

景顺长城上证科创板 50 成份指数增强 C

费用类型	份额 (S) 或金额 (M) /持有期限 (N)	收费方式/费率
赎回费	N<7 天	1.50%
	7 天 \leq N<30 天	0.50%
	N \geq 30 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/年费率或金额	收取方
管理费	0.80%	基金管理人和销售机构
托管费	0.15%	基金托管人
销售服务费	景顺长城上证科创板 50 成份 指数增强 C 0.25%	销售机构
审计费用	40,000.00 元	会计师事务所
信息披露费	80,000.00 元	规定披露报刊

注：1、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。

2、审计费用、信息披露费用等为由基金整体承担的年费用金额，非单个份额类别费用。年金额为当年度预估年费用金额，非实际产生费用金额，最终实际金额以基金定期报告披露为准。其中，当年度指产品资料概要更新所在年度，预估年费用金额可能因具体更新时点不同存在差异。

3、管理费、托管费为最新合同费率。

4、销售服务费（如有）为最新合同费率，不含费率优惠。

5、其他费用详见本基金基金合同、招募说明书及其更新、基金定期报告等信息披露文件。

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

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。基于投资范围的规定，本基金股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%，无法完全规避股票市场的投资风险，尤其是系统性风险。

1、策略风险。本基金的投资策略中非常重要的一部分是量化增强策略，量化增强策略主要采用三大类量化模型分别用以评估资产定价、控制风险和优化交易。可能因为模型计算的误差或模型中变量因子不完善而导致判断结论的失误，从而导致投资损失。

本基金的量化增强策略主要依据标的指数成份股及备选成份股的基本面投资原则构建投资组合，控制对市场的冲击，而非单一趋势性交易或程序化交易。

由于本基金基于量化增强策略模型进行股票投资决策，有别于传统的价值分析投资方法，可能会面临以下特有投资风险：

(1) 面对不断变换的市场环境，量化增强策略所遵循的模型理论均处于不断发展和完善的过程中，当前依据的理论和工具有可能存在适用性的问题；

(2) 定量模型存在对历史数据的依赖。在实际运用过程中，遵循量化增强策略模型构建的投资组合在一定程度上可能无法达到预期的投资效果；

(3) 量化增强策略模型中变量因子不完善可能导致判断结论的失误，从而导致投资损失；

(4) 在量化增强策略模型的实际运用中，核心参数假定的变动可能影响整体效果的稳定性；

(5) 建立量化增强策略模型需要财务数据、交易行情数据以及各类宏观数据等大量数据，在数据搜集、采集、预处理等过程中可能出现错误，从而对最终结果造成影响。

2、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。

3、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、信用风险和作业风险。

4、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。

5、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，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有投资风险，包括但不限于市场风险、流动性风险、退市风险、集中度风险、系统性风险、政策风险等。基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于科创板股票或选择不将基金资产投资于科创板股票，基金资产并非必然投资于科创板股票。

6、可转换债券投资风险。包括利息损失风险、公司经营风险、提前赎回风险。

7、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，可能存在流动性风险、信用风险、市场风险以及政策风险等融资及转融通业务特有风险。

8、存托凭证投资风险。本基金的投资范围包括存托凭证，若投资，除与其他仅投资于境内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，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外证券交易机制、法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

9、信用衍生品投资风险

为对冲信用风险，本基金可能投资于信用衍生品，信用衍生品的投资可能面临流动性风险、偿付风险以及价格波动风险等。流动性风险是指信用衍生品在交易转让过程中，因无法找到交易对手或交易对手较少，导致难以将其以合理价格变现的风险。偿付风险是在信用衍生品的存续期内，由于不可控制的市场及环境变化，创设机构可能出现经营情况不佳，或创设机构的现金流与预期出现一定的偏差，从而影响信用衍生品结算的风险。价格波动风险是由于创设机构或所受保护债券主体，经营情况或利率环境出现变化，引起信用衍生品交易价格波动的风险。

10、追踪标的指数的风险：

包括标的指数回报与股票市场平均回报之间偏离的风险，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，标的指数波动的风险，标的指数变更的风险。

11、跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金力争追求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%，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。

12、指数编制机构停止服务风险

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。

13、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。

14、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，本基金将在年度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。

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、其他风险；8、税负增加风险；9、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；10、政策变更风险。

(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。

景顺长城上证科创板 50 成份指数增强型证券投资基金经中国证监会证监许可【2023】2266 号文准予募集注册。

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。

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，基金合同各方当事人应尽量通过协商、调解途径解决。如经友好协商、调解未能解决的，任何一方均有权将争议提交深圳国际仲裁院，按照深圳国际仲裁院届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为深圳市。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，仲裁费用由败诉方承担。

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

以下资料详见景顺长城基金官方网站[www.igwfm.com][客服电话：400-8888-606]

1、《景顺长城上证科创板 50 成份指数增强型证券投资基金基金合同》、《景顺长城上证科创板 50 成份指数增强型证券投资基金托管协议》、《景顺长城上证科创板 50 成份指数增强型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。