

景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金

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	景顺长城中证 500 行业中性低波动指数	基金代码	003318
下属基金简称	景顺长城中证 500 行业中性低波动指数 A	下属基金交易代码	003318
下属基金简称	景顺长城中证 500 行业中性低波动指数 C	下属基金交易代码	019359
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司	基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
基金合同生效日	2017 年 3 月 3 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	曾理	开始担任本基金基金经理的日期	2019 年 7 月 16 日
		证券从业日期	2014 年 8 月 6 日

二、基金投资与净值表现

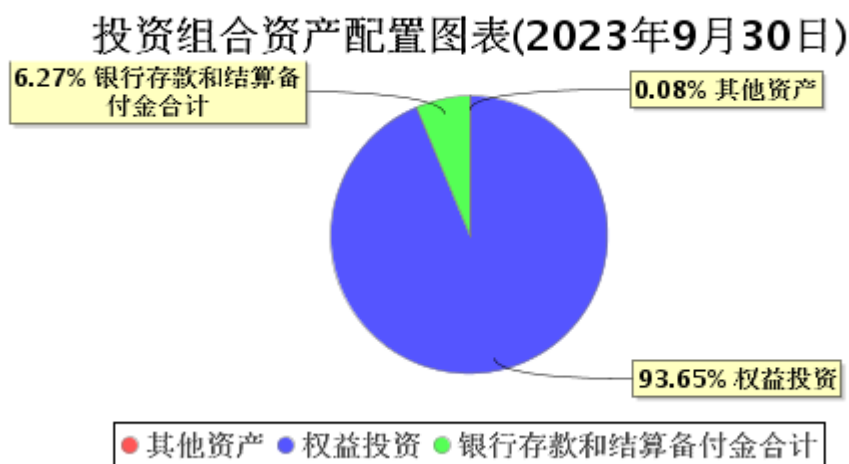
（一）投资目标与投资策略

投资目标	本基金采用指数化投资方式，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资范围	<p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以标的指数成份股及其备选成份股为主要投资对象。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于国内依法上市的非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票及存托凭证）、银行存款、同业存单、债券、债券回购、权证、股指期货、中小企业私募债券、资产支持证券、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。</p> <p>本基金的股票资产投资比例不得低于基金资产的 90%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产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后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p> <p>本基金标的指数：中证 500 行业中性低波动指数</p>
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、权证、股指期货投资策略；

	5、中小企业私募债券的投资策略；6、资产支持证券投资策略；7、融资与转融通投资策略。
业绩比较基准	95%×中证 500 行业中性低波动指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期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，通过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，属于证券投资基金中预期风险较高、预期收益较高的品种。

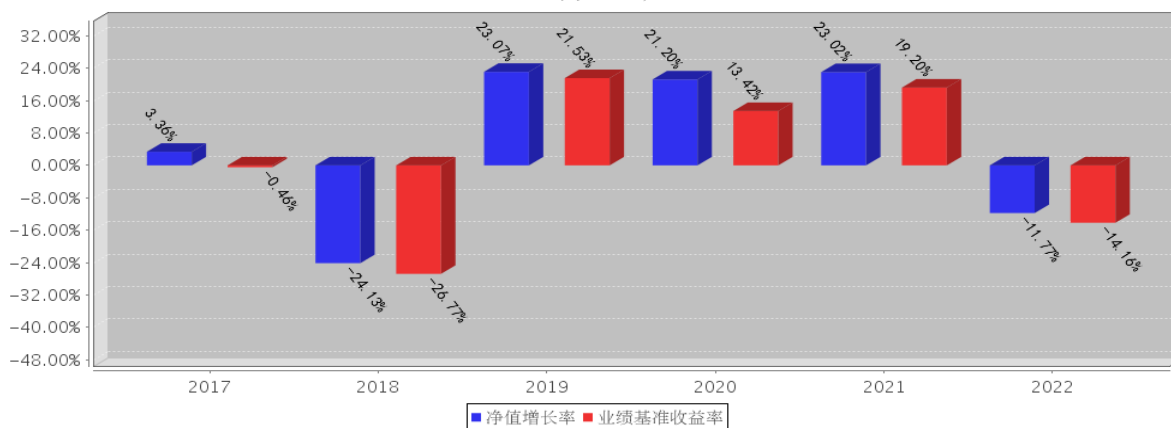
注：了解详细情况请阅读基金合同及招募说明书“基金的投资”部分。

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表



(三) 自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

景顺长城中证500行业中性低波动指数A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（2022年12月31日）



注：1、基金合同生效日为 2017 年 03 月 03 日，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。基金的过往业绩不代表未来表现。

2、本基金自 2023 年 9 月 11 日起增设 C 类基金份额。

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：

景顺长城中证 500 行业中性低波动指数 A

费用类型	份额 (S) 或金额 (M) /持有期限 (N)	收费方式/费率
认购费	$M < 500,000.00$	1.00%
	$500,000.00 \leq M < 2,500,000.00$	0.60%
	$2,500,000.00 \leq M < 5,000,000.00$	0.30%
	$M \geq 5,000,000.00$	1,000.00 元/笔
申购费 (前收费)	$M < 500,000.00$	1.20%
	$500,000.00 \leq M < 2,500,000.00$	0.80%
	$2,500,000.00 \leq M < 5,000,000.00$	0.40%
	$M \geq 5,000,000.00$	1,000.00 元/笔
赎回费	$N < 7$ 天	1.50%
	$7 \text{ 天} \leq N < 1$ 年	0.50%
	$1 \text{ 年} \leq N < 2$ 年	0.25%
	$N \geq 2$ 年	0.00%

景顺长城中证 500 行业中性低波动指数 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%
	$N \geq 7$ 天	0%

注:就赎回费而言,每1个月为30天,每1年为365天。

(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	0.50%		基金管理人和销售机构
托管费	0.10%		基金托管人
销售服务费	景顺长城中证 500 行业中性低波动指 数 C	0.20%	销售机构
审计费用	90,000.00 元		会计师事务所
信息披露费	120,000.00 元		规定披露报刊
指数许可使用费	0.02%	年下限金额: 200,000.00 元	指数编制公司

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。

（三）基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

景顺长城中证 500 行业中性低波动指数 A

基金运作综合费率（年化）
0.64%

景顺长城中证 500 行业中性低波动指数 C

基金运作综合费率（年化）
0.84%

注：基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

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

基于投资范围的规定，本基金投资于股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产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、指数化投资风险

（1）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。

（2）基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

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：

- 1) 由于标的指数调整成份股或变更编制方法，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪误差。
- 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，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪误差。
- 3) 成份股派发现金红利、新股收益将导致基金收益率超过标的指数收益率，产生跟踪误差。
- 4) 由于成份股停牌、摘牌或流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合或承担冲击成本而产生跟踪误差。

5) 由于基金应对日常赎回保留的少量现金、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误差。

6) 其他因素产生的跟踪误差。如未来法规允许的情况下的卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪误差；因基金申购与赎回带来的现金变动。

（3）标的指数的流动性风险

本基金持有的股票可能因重大事项等原因停牌，在某些市场环境下，成份股中停牌股票的比例可能比较大。由于停牌股票在停牌期间的流动性受限，无法立即变现，可能会导致本基金的流动性风险增加以及跟踪误差扩大。

（4）跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%，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，但根据基金合同规定，如出现变更标的指数的情形，本基金将变更标的指数。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，基金的风险收益特征将与新的标的指数保持一致，投资者必须承担此项调整带来的风险与成本。

(6) 指数编制机构停止服务风险

指数编制机构因市场结构变化、产品定义调整，或其他原因导致标的指数不再对其衡量的标的具有代表性等极端情况可能导致指数终止并终止发布对应指数；指数编制机构因指数数据信息异常或因异常情况造成指数数据传递中断的风险。指数编制机构因经营情况的变化，存在停止指数维护和指数编制服务的风险。

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。

(7) 成份股停牌或违约的风险。

标的指数成份股可能因各种原因临时或长期停牌，发生成份股停牌时可能面临风险。

2、本基金的投资范围包括中小企业私募债券，该券种具有较高的流动性风险和信用风险。中小企业私募债的信用风险是指中小企业私募债券发行人可能由于规模小、经营历史短、业绩不稳定、内部治理规范性不够、信息透明度低等因素导致其不能履行还本付息的责任而使预期收益与实际收益发生偏离的可能性，从而使基金投资收益下降。基金可通过多样化投资来分散这种非系统性风险，但不能完全规避。流动性风险是指中小企业私募债券由于其转让方式及其投资持有人数的限制，存在变现困难或无法在适当或期望时变现引起损失的可能性。

3、本基金投资资产支持证券，资产支持证券是一种债券性质的金融工具。资产支持证券的风险主要包括资产风险及证券化风险。资产风险源于资产本身，包括价格波动风险、流动性风险等。证券化风险主要表现为信用评级风险、法律风险等。

4、股指期货投资风险。包含市场风险、市场流动性风险、结算流动性风险、基差风险、信用风险、作业风险等。

5、基金参与融资与转融通业务的风险

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业务，可能存在杠杆投资风险和对手方交易风险等融资及转融通业务特有风险。

6、科创板股票投资风险

本基金可以投资科创板股票，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。

7、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，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。

8、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，本基金将在后续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单位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。

(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 500 行业中性低波动指数型证券投资基金经中国证监会 2016 年 8 月 9 日证监许可【2016】1781 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投资价值、收益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。

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。如经友好协商未能解决的，各方当事人任何一方均有权将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会，按照上海国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为上海市。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。

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.igwfmc.com][客服电话：400-8888-606]

1、《景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金基金合同》、《景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金托管协议》、《景顺长城中证 500 行业中性低波动指数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。