

景顺长城北交所精选两年定期开放混合型证券投资基金

基金产品资料概要更新

编制日期：2024年8月25日

送出日期：2024年8月27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	景顺长城北交所精选两年定期混合	基金代码	016307
下属基金简称	景顺长城北交所精选两年定期混合 A	下属基金交易代码	016307
下属基金简称	景顺长城北交所精选两年定期混合 C	下属基金交易代码	016308
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	2022年8月23日	上市交易所及上市日期	-
基金类型	混合型	交易币种	人民币
运作方式	开放式（定期开放式）	开放频率	每两年开放一次，每个开放期原则上不少于5个工作日且最长不超过20个工作日
基金经理	农冰立	开始担任本基金基金经理的日期	2024年8月24日
		证券从业日期	2014年7月1日
其他	基金合同生效后，在任一开放期结束后的下一个工作日日终，如发生以下情形之一的，基金管理人应当终止基金合同，而无需召开基金份额持有人大会： 1、基金份额持有人数量不满200人的； 2、基金资产净值低于5000万元的。		

注：本基金以封闭期和开放期滚动的方式运作，每两年开放一次。本基金的第一个封闭期为自基金合同生效之日起至两年后的年度对日的前一日为止，首个封闭期结束之后第一个工作日起进入首个开放期。首个开放期结束之日的次日起进入第二个封闭期，第二个封闭期为第二个封闭期起始日起至第二个封闭期起始日所对应的两年年度对日的前一日，以此类推。年度对日不存在的，则该年度对日为该年度对应月度的最后一日。年度对日为非工作日的，则顺延至下一个工作日。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务。基金投资与净值表现

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

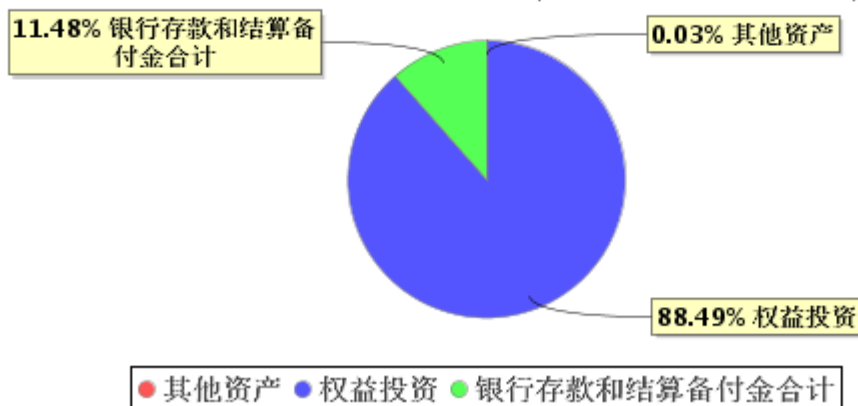
投资目标	本基金在严格控制风险并保持良好流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期增值。
------	---

<p>投资范围</p>	<p>本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包含创业板、北京证券交易所股票及其他经中国证监会核准或注册上市的股票及存托凭证)、港股通标的股票、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、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。本基金可以根据法律法规的规定参与融资业务和转融通证券出借业务。</p> <p>基金的投资组合比例为:封闭期内本基金股票资产占基金资产的比例为60%-100%(其中港股通标的股票不超过股票资产的20%),本基金投资于北京证券交易所股票的比例不低于非现金基金资产的80%,每个封闭期结束前的两个月至开放期结束后两个月内不受上述比例下限制。在开放期内,每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。在封闭期内,本基金不受上述5%的限制,但每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金。其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。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。</p>
<p>主要投资策略</p>	<p>(一)资产配置策略;(二)股票投资策略;(三)存托凭证投资策略;(四)债券投资策略;(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;(十)信用衍生品投资策略。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>中证1000指数收益率*70%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)*10%+中债综合指数收益率*20%</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本基金为混合型基金,其预期收益和风险高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。</p> <p>本基金主要投资北京证券交易所股票,除了需要承担市场波动风险等一般投资风险之外,本基金还面临投资北京证券交易所的特殊风险,本基金投资北京证券交易所的风险详见招募说明书。</p> <p>本基金还可能投资港股通标的股票,如果投资,除了需要承担与内地证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外,本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>

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。

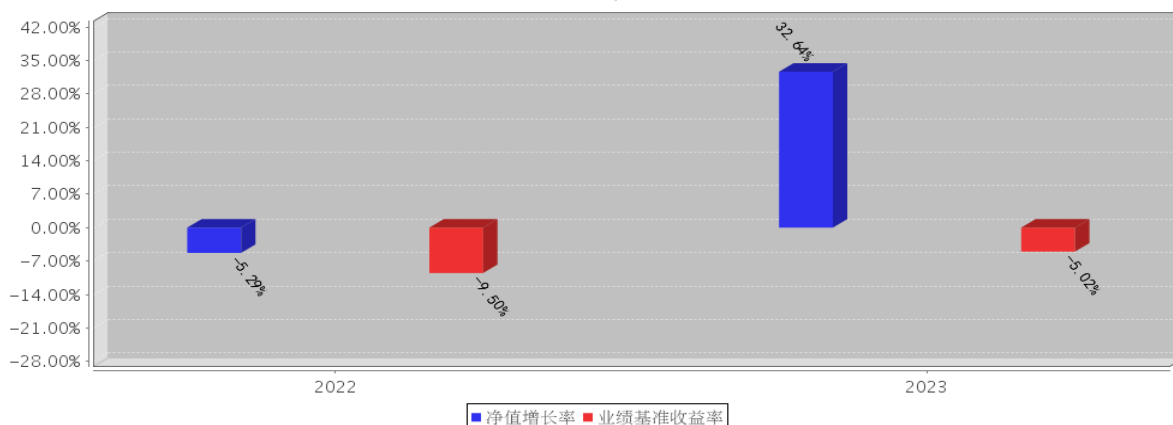
(二)投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表(2024年3月31日)

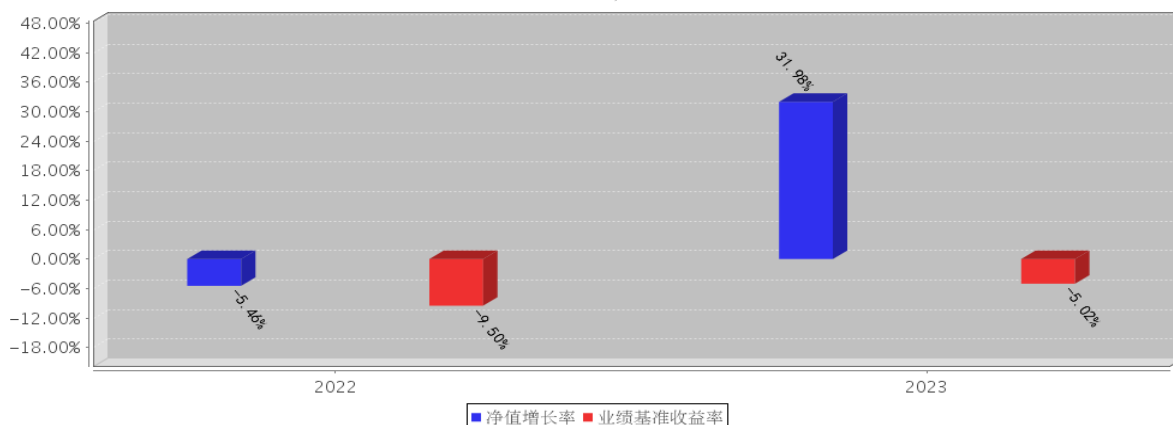


(三) 自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

景顺长城北交所精选两年定开混合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 (2023年12月31日)



景顺长城北交所精选两年定开混合C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 (2023年12月31日)



注：如基金合同生效当年/基金份额增设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。

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：

景顺长城北交所精选两年定开混合 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	1.20%	普通投资群体
	1,000,000≤M<5,000,000	0.80%	普通投资群体
	M≥5,000,000	1,000.00 元/笔	普通投资群体
	M<1,000,000	0.12%	养老金客户
	1,000,000≤M<5,000,000	0.08%	养老金客户
	M≥5,000,000	1,000.00 元/笔	养老金客户
申购费 (前收费)	M<1,000,000	1.50%	普通投资群体
	1,000,000≤M<5,000,000	1.20%	普通投资群体
	M≥5,000,000	1,000.00 元/笔	普通投资群体
	M<1,000,000	0.15%	养老金客户
	1,000,000≤M<5,000,000	0.12%	养老金客户
	M≥5,000,000	1,000.00 元/笔	养老金客户
赎回费	N<7 天	1.50%	-
	7 天≤N<30 天	0.75%	-
	30 天≤N<180 天	0.50%	-
	N≥180 天	0	-

景顺长城北交所精选两年定开混合 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≤N<30 天	0.50%
	N≥30 天	0

注：C 类基金份额不收取认购费/申购费。

(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	1.2%	基金管理人和销售机构
托管费	0.2%	基金托管人
销售服务费	景顺长城北交所精选两年定开混合 C 0.5%	销售机构
审计费用	55,000.00 元	会计师事务所
信息披露费	120,000.00 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。

（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：

景顺长城北交所精选两年定开混合 A

基金运作综合费率（年化）
1.49%

景顺长城北交所精选两年定开混合 C

基金运作综合费率（年化）
1.99%

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

1、本基金封闭期内股票资产占基金资产的比例为 60%-100%，投资于北京证券交易所股票的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金股票仓位偏高，受股票市场风险影响较大，如果股票市场出现整体下跌，本基金的净值表现将受到影响。

2、主要投资于北京证券交易所股票所带来的风险

本基金投资于北京证券交易所股票的比例不低于非现金基金资产的 80%，北京证券交易所主要服务于创新型中小企业，在发行、上市、交易、退市等方面的规则与其他交易场所存在差异，本基金须承受与之相关的特定风险。主要包括：（1）中小企业经营风险；（2）股价大幅波动风险；（3）企业退市风险；（4）流动性风险；（5）监管规则变化的风险；

3、封闭期内无法赎回基金份额的风险。本基金以封闭期和开放期滚动的方式运作，每两年开放一次，基金份额持有人仅可在开放期申赎基金份额。若基金份额持有人在开放期末赎回基金份额，则需继续持有至下一封闭期结束才能赎回，基金份额持有人面临封闭期内无法赎回基金份额的流动性风险以及基金净值可能发生较大波动的风险。投资者应当根据自身投资目标、投资期限等情况审慎作出投资决策。

4、通过战略配售方式参与股票投资的风险

本基金在封闭期间可通过战略配售方式参与股票的投资，战略配售股票在发行时明确了一定期限锁定期，当股票价格出现大幅波动时，本基金持有的在锁定期内的战略配售股票将无法及时卖出，可能给本基金带来损失。

此外，本基金资产并非必然参与战略配售，本基金可根据市场环境和投资策略需要，选择通过或不通过战略配售方式参与股票投资。

5、策略风险。本基金根据市场环境的变化，选取相应的投资策略。此分析过程主要是建立在一系列的假设基础和定性及定量指标之上的，评估的结果可能与市场变化的实际发展情况、市场对股票的认知和理解存在差异。

6、模型风险。本基金采用“自下而上”的投资策略，运用景顺长城“股票研究数据库(SRD)”等分

析系统作为股票选择的依据，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。

7、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。

8、股指期货投资风险。包括流动性风险、基差风险、合约展期风险、国债期货保证金不足风险、杠杆风险。

9、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。

10、港股交易失败风险：港股通业务试点期间存在每日额度。在香港联合交易所有限公司开市前阶段，当日额度使用完毕的，新增的买单申报将面临失败的风险；在联交所持续交易时段，当日额度使用完毕的，当日本基金将面临不能通过港股通进行买入交易的风险。

11、汇率风险：本基金将投资港股通标的股票，在交易时间内提交订单依据的港币买入参考汇率和卖出参考汇率，并不等于最终结算汇率。港股通交易日日终，中国证券登记结算有限责任公司进行净额换汇，将换汇成本按成交金额分摊至每笔交易，确定交易实际适用的结算汇率。故本基金投资面临汇率风险，汇率波动可能对基金的投资收益造成损失。

12、境外市场的风险。

(1) 本基金将通过港股通机制投资于香港市场，在市场环境、市场进入、投资额度、可投资对象、税务政策、市场制度等方面都有一定的限制，而且此类限制可能会不断调整，这些限制因素的变化可能对本基金进入或退出当地市场造成障碍，从而对投资收益以及正常的申购赎回产生直接或间接的影响。

(2) 香港市场交易规则有别于内地A股市场规则，此外，在港股通机制下参与香港股票投资还将面临其他特殊风险。

13、可转换债券（可交换公司债）投资风险

公司经营风险（信用风险）：可转换债券（可交换公司债）的发行主体是上市公司（上市公司股东）本身。如果可转换债券（可交换公司债）在存续期间，上市公司或其股东存在较大的经营风险或偿债能力风险时，对可转换债券（可交换公司债）的价格冲击较大。

提前赎回风险：可转换债券（可交换公司债）都规定了发行人可以在满足特定条件后，以某一价格强制赎回债券。当发行人发布强制赎回公告后，投资者未在规定时间内申请转股，将被以赎回价强制赎回，可能遭受损失。

14、国债期货投资风险。包括流动性风险、基差风险、合约展期风险、国债期货保证金不足风险、杠杆风险。

15、股票期权投资风险

本基金的投资范围包括股票期权，股票期权的风险主要包括市场风险、管理风险、流动性风险、操作风险等，这些风险可能会给基金净值带来一定的负面影响和损失。

16、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。

17、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，包括不限于如下特殊风险：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、科创

板法律法规修改的风险等。

18、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。

19、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、流动性风险以及对手方交易风险等融资及转融通业务特有风险。

20、基金合同自动终止风险

基金合同生效后，在任一开放期结束后的下一个工作日日终，如发生以下情形之一的，基金管理人应当终止基金合同，而无需召开基金份额持有人大会：

1) 基金份额持有人数量不满 200 人的；2) 基金资产净值低于 5000 万元的。基金份额持有人将可能面临基金合同自动终止的风险。

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、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。

(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。

景顺长城北交所精选两年定期开放混合型证券投资基金经中国证监会 2022 年 7 月 15 日证监许可【2022】1505 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、《景顺长城北交所精选两年定期开放混合型证券投资基金合同》、《景顺长城北交所精选两年定期开放混合型证券投资基金托管协议》、《景顺长城北交所精选两年定期开放混合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。