

景顺长城中证 500 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：2025 年 3 月 20 日

送出日期：2025 年 3 月 21 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 指数增强   | 基金代码           | 006682          |
| 下属基金简称  | 景顺长城中证 500 指数增强 A | 下属基金交易代码       | 006682          |
| 下属基金简称  | 景顺长城中证 500 指数增强 C | 下属基金交易代码       | 016935          |
| 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 | 2019 年 3 月 25 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 | 2019 年 3 月 25 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 | 2019 年 3 月 25 日 |
|         |                   | 证券从业日期         | 2010 年 7 月 21 日 |

二、基金投资与净值表现

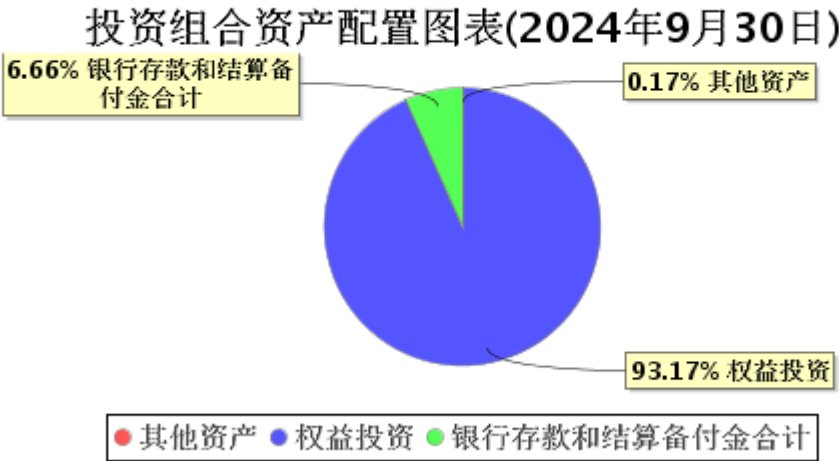
(一) 投资目标与投资策略

|      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
|------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 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分股及备选成分股。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分股（包含创业板及其他经中国证监会核准发行的股票及存托凭证）、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、中小企业私募债券等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款，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）。<br>本基金可以根据有关法律法规的规定进行融资及转融通证券出借业务交易。<br>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。<br>本基金标的指数：中证 500 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、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、融资及转融通证券出借业务投资策略                 |
| 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。               |

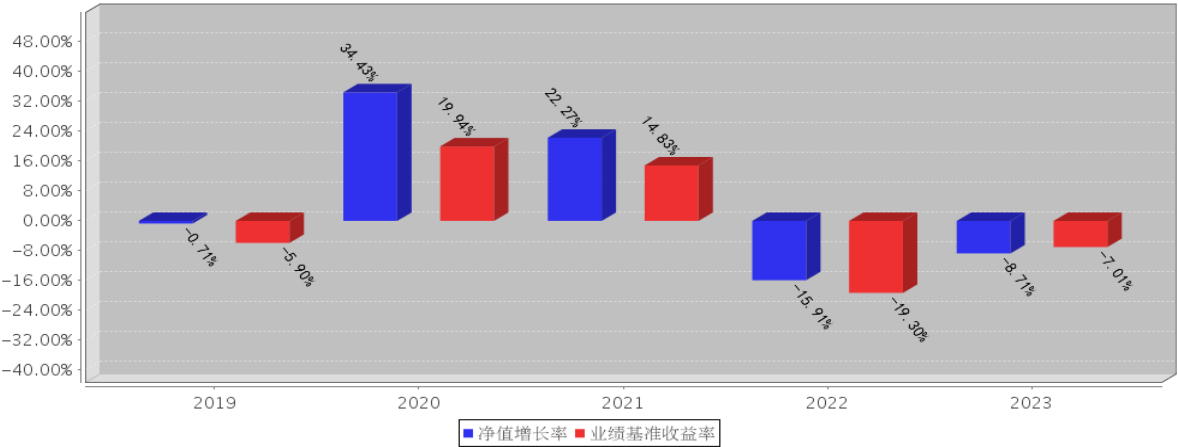
注：了解详细情况请阅读基金合同及招募说明书“基金的投资”部分。

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

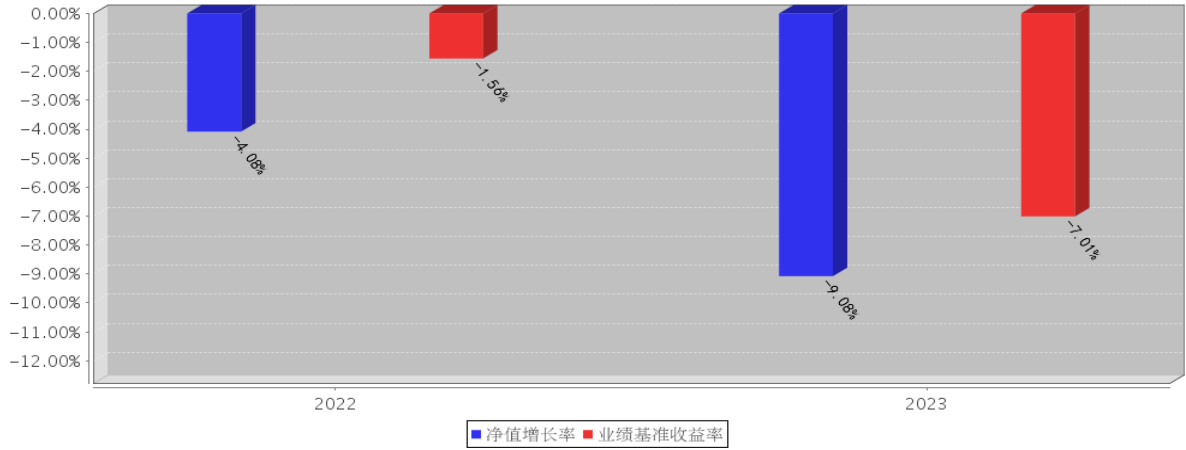


(三) 自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

景顺长城中证500指数增强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（2024年12月31日）



景顺长城中证500指数增强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（2024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：

景顺长城中证 500 指数增强 A

| 费用类型         | 份额（S）或金额（M）<br>/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<2, 000, 000 | 0. 80%         | 普通投资群体 |
|              | 2, 000, 000≤M<5, 000, 000 | 0. 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. 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. 02%         | 养老金客户  |
|              | M≥5, 000, 000             | 1, 000. 00 元/笔 | 养老金客户  |
| 申购费<br>（前收费） | M<1, 000, 000             | 1. 50%         | 普通投资群体 |
|              | 1, 000, 000≤M<2, 000, 000 | 0. 90%         | 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. 00 元/笔 | 普通投资群体 |
|              | M<1, 000, 000             | 0. 15%         | 养老金客户  |
|              | 1, 000, 000≤M<2, 000, 000 | 0. 09%         | 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. 00 元/笔 | 养老金客户  |
| 赎回费          | N<7                       | 1. 50%         | —      |
|              | 7≤N<30                    | 0. 75%         | —      |
|              | 30≤N<365                  | 0. 50%         | —      |
|              | 365≤N<730                 | 0. 25%         | —      |
|              | N≥730                     | 0              | —      |

景顺长城中证 500 指数增强 C

| 费用类型 | 份额 (S) 或金额 (M)<br>/持有期限 (N) | 收费方式/费率 |
|------|-----------------------------|---------|
| 赎回费  | $N < 7$                     | 1.50%   |
|      | $N \geq 7$                  | 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   | 1.20%             |       | 基金管理人和销售机构 |
| 托管费   | 0.20%             |       | 基金托管人      |
| 销售服务费 | 景顺长城中证 500 指数增强 C | 0.40% | 销售机构       |
| 审计费用  | 95,000.00 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:

景顺长城中证 500 指数增强 A

|              |
|--------------|
| 基金运作综合费率(年化) |
| 1.42%        |

景顺长城中证 500 指数增强 C

|              |
|--------------|
| 基金运作综合费率(年化) |
| 1.82%        |

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、本基金的特有风险

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，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%，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分股及备选成分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、本基金的投资范围包括中小企业私募债券，中小企业私募债是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。由于不能公开交易，一般情况下，交易不活跃，存在较大流动性风险。当发债主体信用质量恶化时，受市场流动性所限，本基金可能无法卖出所持有的中小企业私募债，由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。

### 3、流通受限证券投资风险

流通受限证券包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券。由于流通受限证券存在一定期限的锁定期，存在着一定的流动性风险。因基金巨额赎回或市场发生剧烈变动等原因而导致基金现金周转困难时，存在着无法卖出的风险，给基金总体投资组合带来流动性冲击。

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、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、法律风险等。

### 6、追踪标的指数的风险：

（1）基金投资组合回报、标的指数回报与股票市场平均回报之间偏离的风险。

标的指数并不能完全代表整个股票市场，标的指数的回报率与整个股票市场的回报率可能存在偏离。

（2）目标指数波动的风险。

标的指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市经营状况、投资人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）目标指数变更的风险。

根据基金合同的规定，因标的指数的编制与发布等原因，导致原标的指数不宜继续作为本基金的投资标的指数及业绩比较基准，本基金可能变更标的指数，基金的投资组合将随之调整，基金的收益风险特征可能发生变化，投资人还须承担投资组合调整所带来的风险与成本。

（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控制在 0.5% 以内，年跟踪误差控制在 7.75% 以内，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）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。

#### （6）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，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。

#### 7、权证投资风险

本基金的投资范围包括权证，权证是发行人与持有者之间的一种契约，持有人在约定的时间有权以约定的价格购买或卖出标的资产。由于权证是一种带有杠杆效应的证券产品，实行 T+0 交易，存在较大价格波动风险。同时一旦投资权证到期行权不能获利，可能会亏损投资权证金额，由此可能给基金净值带来损失。

#### 8、参与融资及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业务，可能存在杠杆投资风险和对手方交易风险等融资业务特有风险。

9、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。

#### 10、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、提前终止的风险；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、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 指数增强型证券投资基金（以下简称“基金”或“本基金”）经中国证监会 2018 年 11 月 16 日证监许可【2018】1897 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。

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，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。仲裁裁决是终局性的并对各方当事人均具有约束力，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](http://www.igwfmc.com)][客服电话：400-8888-606]

1、《景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》、《景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》、《景顺长城中证 500 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。