

# 景顺长城中证 500 交易型开放式 指数证券投资基金联接基金 2019 年第 1 号更新招募说明书摘要

## 重要提示

本基金于2015年5月14日经中国证监会证监许可[2015]899号文准予募集注册。本基金合同已于2015年6月29日正式生效。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。

本招募说明书经中国证监会注册，但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。

投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书。

基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。

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。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等。

本基金为景顺长城中证500交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“景顺长城中证500ETF”）的联接基金，预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为股票型指数基金，主要投资于景顺长城中证500ETF，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。本基金与景顺长城中证500ETF在投资方法、交易方式和业绩表现等方面存在着联系和区别。本基金对景顺长城中证500ETF的投资比例不低于本基金资产净值的90%，投资标的单一且过分集中有可能会给本基金带来风险。投资者在进行投资决策前，应仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

投资有风险，投资人拟认购（或申购）基金时应认真阅读本基金《招募说明书》与《基金合同》，全面认识本基金产品的风险收益特征，充分考虑投资人自身的风险承受能

力，并对于认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资人基金投资要承担相应风险。

基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成本基金业绩表现的保证。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2018年12月29日，有关财务数据和净值表现截止日为2018年9月30日。本招募说明书中财务数据未经审计。

**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**

## 一、基金管理人

### （一）基金管理人概况

名称：景顺长城基金管理有限公司

住所：深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第 1 座 21 层

成立日期：2003 年 6 月 12 日

法定代表人：丁益

注册资本：1.3 亿元人民币

批准设立文号：证监基金字 [2003] 76 号

办公地址：深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第 1 座 21 层

电话：0755-82370388

客户服务电话：400 8888 606

传真：0755-22381339

联系人：杨皞阳

股东名称及出资比例：

序号	股东名称	出资比例
1	长城证券股份有限公司	49%
2	景顺资产管理有限公司	49%
3	开滦（集团）有限责任公司	1%
4	大连实德集团有限公司	1%
	合计	100%

### （二）主要人员情况

#### 1、基金管理人董事会成员

丁益女士，董事长，经济学博士。曾担任中国人民大学财政金融学院讲师；华能国际

电力股份有限公司证券融资部干部，证券融资部投资关系处副处长、处长，证券融资部副经理兼投资关系处处长；中国人民保险公司投资管理部副总经理；中国人保资产管理有限公司党委委员、董事、总裁助理；华能资本常务副总经理（主持工作）、党组副书记；华能资本总经理、党组副书记。现任华能资本服务有限公司董事长、党组书记，长城证券股份有限公司董事长，景顺长城基金管理有限公司董事长。

康乐先生，董事，总经理，经济学硕士。曾先后担任中国人寿资产管理有限公司研究部研究员、组合管理部投资经理、国际业务部投资经理，景顺投资管理有限公司市场销售部经理、北京代表处首席代表，中国国际金融有限公司销售交易部副总经理。2011年7月加入本公司，现任公司董事兼总经理。

罗德城先生，董事，工商管理硕士。曾任大通银行信用分析师、花旗银行投资管理部副总裁、Capital House亚洲分公司的董事总经理。1992至1996年间出任香港投资基金公会管理委员会成员，并于1996至1997年间担任公会主席。1997至2000年间，担任香港联交所委员会成员，并在1997至2001年间担任香港证监会顾问委员会成员。现任景顺集团亚太区首席执行官。

李翔先生，董事，高级管理工商管理硕士。曾任长城证券股份有限公司人事部副总经理、人事监察部总经理、营业部总经理、公司营销总监、营销管理部总经理。现任长城证券股份有限公司副总裁、党委委员。

伍同明先生，独立董事，文学学士。香港会计师公会会员（HKICPA）、英国特许公认会计师（ACCA）、香港执业会计师（CPA）、加拿大公认管理会计师（CMA）。拥有超过二十年以上的会计、审核、管治税务的专业经验及知识，1972-1977受训于国际知名会计师楼“毕马威会计师行”[KPMG]。现为“伍同明会计师行”所有者。

靳庆军先生，独立董事，法学硕士。曾担任中信律师事务所涉外专职律师，在香港马士打律师行、英国律师行Clyde&Co. 从事律师工作，1993年发起设立信达律师事务所，担任执行合伙人。现任金杜律师事务所合伙人。

闵路浩先生，独立董事，经济学硕士。曾担任中国人民银行金融管理公司科员、主任科员；中国人民银行非银行金融机构监管司副处长、处长；中国银行业监督管理委员会非银行金融机构监管部处长、副巡视员、巡视员；中国小额贷款公司协会会长；重庆富民银行行长。现担任北京中泰创汇股权投资基金管理有限公司总裁。

## 2、基金管理人监事会成员

阮惠仙女士，监事，会计学硕士。现任长城证券股份有限公司财务部总经理。

郭慧娜女士，监事，管理理学硕士。曾任伦敦安永会计师事务所核数师，历任景顺投资管理有限公司项目主管、业务发展部副经理、企业发展部经理、亚太区监察总监。现任景顺投资管理有限公司亚太区首席行政官。

邵媛媛女士，监事，管理学硕士。曾任职于深圳市天健（信德）会计师事务所、福建兴业银行深圳分行计财部。现任景顺长城基金管理有限公司基金事务部总监。

杨波先生，监事，工商管理硕士。曾任职于长城证券经纪业务管理部。现任景顺长城基金管理有限公司交易管理部总监。

### 3、高级管理人员

丁益女士，董事长，简历同上。

康乐先生，总经理，简历同上。

CHEN WENYU（陈文字），副总经理，工商管理硕士。曾担任中国海口电视台每日新闻记者及每周金融新闻节目制作人，安盛罗森堡投资管理公司（美国加州）美洲区副首席投资官、以及研究、投资组合管理和策略等其他多个职位，安盛投资管理亚洲有限公司（新加坡）泛亚地区首席投资官，主要负责投资组合管理、研究、交易等相关业务。2018年9月加入本公司，现任公司副总经理。

毛从容女士，副总经理，经济学硕士。曾任职于交通银行深圳市分行国际业务部，担任长城证券金融研究所高级分析师、债券小组组长。2003年3月加入本公司，现任公司副总经理。

黎海威先生，副总经理，经济学硕士。曾担任美国穆迪 KMV 公司研究员，美国贝莱德集团（原巴克莱国际投资管理有限公司）基金经理、主动股票部副总裁，香港海通国际资产管理有限公司（海通国际投资管理有限公司）量化总监。2012年8月加入本公司，现任公司副总经理。

赵代中先生，副总经理，理学硕士。曾担任深圳发展银行北京分行金融同业部投资经理、宁夏嘉川集团项目部项目负责人、全国社会保障基金理事会境外投资部全球股票处处长、浙江大钧资产管理有限公司合伙人兼副总经理。2016年3月加入本公司，现任公司副总经理。

吴建军先生，副总经理，经济学硕士。曾担任海南汇通国际信托投资公司证券部副经理，长城证券股份有限公司机构管理部总经理、公司总裁助理。2003年3月加入本公司，现任公司副总经理。

刘焕喜先生，副总经理，投资与金融系博士。曾担任武汉大学教师工作处副科长、武

汉大学成人教育学院讲师，《证券时报》社编辑记者，长城证券研发中心研究员、总裁办副主任、行政部副总经理。2003 年 3 月加入本公司，现任公司副总经理。

杨皦阳先生，督察长，法学硕士。曾担任黑龙江省大庆市红岗区人民法院助理审判员，南方基金管理有限公司监察稽核部监察稽核经理、监察稽核高级经理、总监助理。2008 年 10 月加入本公司，现任公司督察长。

#### 4、本基金现任基金经理简历

徐喻军先生，理学硕士。曾担任安信证券风险管理部风险管理专员。2012 年 3 月加入本公司，担任量化及 ETF 投资部 ETF 专员；自 2014 年 4 月起担任量化及指数投资部基金经理。具有 9 年证券、基金行业从业经验。

曾理先生，工学硕士。曾任职于腾讯计算机系统有限公司信息安全部产品策略岗位。2014 年 8 月加入本公司，历任量化及 ETF 投资部量化程序员、量化及指数投资部基金经理助理，自 2018 年 10 月起担任量化及指数投资部基金经理。具有 5 年证券、基金行业从业经验。

#### 5、本基金现任基金经理曾管理的基金名称及管理时间

本基金现任基金经理徐喻军先生曾于 2014 年 4 月至 2018 年 5 月管理景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数证券投资基金；2014 年 4 月至 2018 年 7 月管理景顺长城上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

#### 6、本基金现任基金经理兼任其他基金基金经理的情况

本基金现任基金经理徐喻军先生兼任上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城公司治理混合型证券投资基金、景顺长城支柱产业混合型证券投资基金、景顺长城研究精选股票型证券投资基金、景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金、景顺长城领先回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城优质成长股票型证券投资基金、景顺长城睿成灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城泰恒回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金和景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。

本基金现任基金经理曾理先生兼任景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

7、本基金历任基金经理姓名及管理时间

无。

8、投资决策委员会委员名单

本公司的投资决策委员会由公司总经理、分管投资的副总经理、各投资总监、研究总监、基金经理代表等组成。

公司的投资决策委员会成员姓名及职务如下：

康乐先生，总经理；

CHEN WENYU（陈文字），副总经理；

毛从容女士，副总经理；

黎海威先生，副总经理兼量化及指数投资部投资总监；

余广先生，总经理助理兼股票投资部投资总监；

刘彦春先生，总经理助理兼研究部总监；

陈文鹏先生，固定收益部投资总监。

9、上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### （一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

首次注册登记日期：1983 年 10 月 31 日

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：陈四清

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

托管部门信息披露联系人：王永民

传真：（010）66594942

中国银行客服电话：95566

### （二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于 1998 年，现有员工 110 余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60% 以上的员工具有硕

士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

### （三）证券投资基金托管情况

截至 2018 年 9 月 30 日，中国银行已托管 679 只证券投资基金，其中境内基金 642 只，QDII 基金 37 只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF 等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

### （四）托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007 年起，中国银行连续聘请外部会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2017 年，中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

### （五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、《运作办法》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，及时通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当及时通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。



### 三、相关服务机构

#### (一) 基金份额销售机构

##### 1. 直销机构

名称：景顺长城基金管理有限公司

住所：深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第 1 座 21 层

办公地址：深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第 1 座 21 层

法定代表人：丁益

批准设立文号：证监基金字 [2003] 76 号

电话：0755-82370388-1663

传真：0755-22381325

联系人：周婷

客户服务电话：0755-82370688、4008888606

网址：www.igwfm.com

注：直销机构包括本公司深圳直销中心及直销网上交易系统/电子交易直销前置式自助前台（具体以本公司官网列示为准）

##### 2. 其他销售机构

序号	全称	销售机构信息
1	中国银行股份有限公司	注册（办公）地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号 法定代表人：陈四清 联系人：宋亚平 客户服务电话：95566（全国） 网址：www.boc.cn
2	交通银行股份有限公司	住所（办公）地址：上海市浦东新区银城中路 188 号 法定代表人：彭纯 联系人：王菁 电话：021-58781234-1601 传真：021-58408483 客户服务电话：95559 网址：www.bankcomm.com

3	广发银行股份有限公司	注册（办公）地址：广州市越秀区东风东路 713 号 法定代表人：杨明生 客户服务电话：400 830 8003 网址：www.cgbchina.com.cn
4	上海浦东发展银行股份有限公司	注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号 办公地址：上海市中山东一路 12 号 法定代表人：吉晓辉 联系人：高天、于慧 电话：（021）61618888 传真：（021）63604199 客户服务热线：95528 公司网站：www.spdb.com.cn
5	兴业银行股份有限公司	注册地址：福州市湖东路 154 号中山大厦 法定代表人：高建平 联系人：陈丹 电话：（0591）87844211 客户服务电话：95561 网址：www.cib.com.cn
6	中国民生银行股份有限公司	注册（办公）地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号 法定代表人：洪崎 联系人：穆婷 联系电话：010-58560666 传真：010-57092611 客户服务热线：95568 网址：www.cmbc.com.cn
7	平安银行股份有限公司	注册（办公）地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 法定代表人：孙建一 联系人：张莉 电话：021-38637673 传真：021-50979507 客户服务电话：95511-3 网址：www.bank.pingan.com

8	渤海银行股份有限公司	注册地址：天津市河西区马场道 201-205 号 办公地址：天津市河东区海河东路 218 号渤海银行大厦 法定代表人：李伏安 联系人：王宏 联系电话：022-58316666 传真：022-58316259 客户服务热线：95541 网址：www.cbhb.com.cn
9	嘉兴银行股份有限公司	注册（办公）地址：嘉兴市建国南路 409 号 法定代表人：许洪明 联系人：陈兢 电话：0573-82082676 传真：0573-82062161 客户服务电话：057396528 银行网址：www.bojx.com
10	包商银行股份有限公司	注册（办公）地址：内蒙古包头市钢铁大街 6 号 办公地址：内蒙古包头市钢铁大街 6 号 法定代表人：李镇西 联系人：张建鑫 电话：010-64816038 传真：010-84596546 客服电话：95352 网站：www.bsb.com.cn
11	苏州银行股份有限公司	注册（办公）地址：苏州工业园区钟园路 728 号 法定代表人：王兰凤 联系人：葛晓亮 传真：0512-69868370 客户服务电话：0512-96067 网址：www.suzhoubank.com
12	江苏江南农村商业银行股份有限公司	注册（办公）地址：常州和平中路 413 号 法定代表人：陆向阳 联系人：蒋姣 电话：0519-80585939 传真：0519-89995017 客户服务电话：96005 网址：www.jnbank.com.cn

13	四川天府银行股份有限公司	注册地址：四川省南充市涪江路 1 号 办公地址：四川省成都市锦江区下东大街 258 号 法定代表人：邢敏 联系人：樊海波 电话：028-67676033 客户服务电话：4001696869 网址：www.tf.cn
14	中国国际金融股份有限公司	注册（办公）地址：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 28 层 法定代表人：丁学东 联系人：杨涵宇 电话：010-65051166 客户服务电话：400 910 1166 网址：www.cicc.com.cn
15	上海华信证券有限责任公司	注册地址：上海浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼 办公地址：上海市黄浦区南京西路 399 号明天广场 22 楼 法定代表人：陈灿辉 联系人：徐璐 电话：021-63898952 传真：021-68776977 转 8952 客户服务电话：4008205999 网址：www.shhxzq.com
16	深圳众禄基金销售股份有限公司	注册（办公）地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼 法定代表人：薛峰 联系人：童彩平 电话：0755-33227950 传真：0755-33227951 客户服务电话：4006-788-887 网址：众禄基金网 www.zlfund.cn 基金买卖网 www.jjmmw.com
17	蚂蚁（杭州）基金销售有限公司	注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室 办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F 法定代表人：陈柏青 联系人：韩爱彬 电话：021-60897840 传真：0571-26697013 客户服务电话：4000-766-123 网址：www.fund123.cn

18	诺亚正行基金销售有限公司	注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室 办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路 32 号东码头园区 C 栋 法定代表人：汪静波 联系人：方成 电话：021-38602377 传真：021-38509777 客户服务电话：400-821-5399 网址：www.noah-fund.com
19	上海长量基金销售投资顾问有限公司	注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室 办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层 法定代表人：张跃伟 联系人：单丙焯 电话：021-20691832 传真：021-20691861 客服电话：400-820-2899 公司网站：www.erichfund.com
20	上海好买基金销售有限公司	注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 4494 办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂 尔多斯国际大厦 9 楼 法定代表人：杨文斌 联系人：张茹 电话：021-58870011 传真：021-68596916 客户服务电话：400 700 9665 网址：www.ehowbuy.com
21	北京展恒基金销售股份有限公司	注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富 街 6 号 办公地址：北京市朝阳区安苑路 15- 1 号邮电新闻大厦 6 层 法定代表人：闫振杰 联系人：李晓芳 联系电话：010-59601366 转 7167 客服电话：400-818-8000 公司网站：www.myfund.com

22	和讯信息科技有限公司	注册（办公）地址：北京市朝外大街 22 号泛利大厦 10 层 法定代表人：王莉 联系人：习甜 联系电话：010-85650920 传真号码：010-85657357 全国统一客服热线：400-920-0022/ 021-20835588 公司网址：licaikexun.com
23	上海天天基金销售有限公司	注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号东方财富大厦 2 楼 办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座（北楼）25 层 法定代表人：其实 联系人：潘世友 电话：021-54509977-8400 传真：021-54509953 客服电话：400-1818-188 网址： <a href="http://www.1234567.com.cn">http://www.1234567.com.cn</a>
24	浙江同花顺基金销售有限公司	注册地址：浙江省杭州市文二西路一号 元茂大厦 903 室 办公地址：浙江省杭州市翠柏路 7 号杭 州电子商务产业园 2 楼 法定代表人：凌顺平 联系人：杨翼 联系电话：0571-88911818-8565 传真：0571-86800423 客服电话：4008-773-772 网址： <a href="http://www.5ifund.com">www.5ifund.com</a>
25	众升财富（北京）基金销售有限公司	注册地址：北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼 A 座 9 层 908 室 办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 9 层 04-08 法定代表人：李招弟 联系人：高晓芳 电话：010-59393923 传真：010-64788105 客户服务电话：400-059-8888 网址： <a href="http://www.zscffund.com">www.zscffund.com</a>

26	宜信普泽（北京）基金销售有限公司	注册地址：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809 办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C 座 1809 室 法定代表人：沈伟桦 联系人：王巨明 电话：010-52855713 传真：010-85894285 客户服务电话：400-609-9200 网址：www.yixinfund.com
27	北京增财基金销售有限公司	注册地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208 室 办公地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208-1209 室 法定代表人：罗细安 联系人：孙晋峰 电话：010-67000988 传真：010-67000988-6000 客户服务电话：400-001-8811 网址：www.zcvc.com.cn
28	厦门市鑫鼎盛控股有限公司	注册（办公）地址：厦门市思明区鹭江道 2 号厦门第一广场西座 1501-1504 室 法定代表人：陈洪生 联系人：梁云波 联系电话：0592-3122757 客服电话：400-9180808 公司网站：www.xds.com.cn
29	北京晟视天下基金销售有限公司	注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室 办公地址：北京市朝阳区朝外大街甲 6 号万通中心 D 座 28 层 法定代表人：蒋煜 联系人：徐长征、林凌 电话：010-58170943, 010-58170918 传真：010-58170800 客户服务电话：400-818-8866 网址：www.shengshiview.com

30	嘉实财富管理有限公司	注册（办公）地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号国金中心二期 4606-10 单元 法定代表人：赵学军 联系人：景琪 电话：021-20289890 传真：010-85097308 客户服务电话：400-021-8850 网址：www.harvestwm.cn
31	深圳市新兰德证券投资咨询有限公司	注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006# 办公地址：北京市西城区宣武门外大街 10 号庄胜广场中央办公楼东翼 7 层 法定代表人：马勇 电话：0755-88394666 传真：0755-88394677 客户服务电话：400-166-1188 网址：http://8.jrj.com.cn/
32	一路财富（北京）信息科技有限公司	注册地址：北京市西城区车公庄大街 9 号五栋大楼 C 座 702 办公地址：北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208 法定代表人：吴雪秀 联系人：段京璐 电话：010-88312877 传真：010-88312885 客户服务电话：400-001-1566 网址：www.yilucaifu.com
33	北京恒天明泽基金销售有限公司	注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室 办公地址：北京市朝阳区东三环北路甲 19 号 SOHO 嘉盛中心 30 层 3001 室 法定代表人：周斌 电话：010-59313555 传真：010-53509643 客户服务电话：400-8980-618 网址：www.chtwm.com
34	北京钱景基金销售有限公司	注册（办公）地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012 法定代表人：赵荣春 联系人：陈剑炜 电话：010-57418813 传真：010-57569671 客户服务电话：400-875-9885



		网址: <a href="http://www.qianjing.com">www.qianjing.com</a>
35	深圳腾元基金销售有限公司	注册地址: 深圳市福田区金田路 2028 号卓越世纪中心 1 号楼 1806 单 元 办公地址: 深圳市福田区深南中路 4026 号田面城市大厦 18A 法定代表人: 曾革 联系人: 叶健 电话: 0755-33376853 传真: 0755-33065516 客户服务电话: 400-990-8600 网址: <a href="http://www.tenyuanfund.com">www.tenyuanfund.com</a>
36	北京创金启富投资管理有限公司	注册地址: 北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A 办公地址: 北京市西城区民白纸坊东街 2 号经济日报社综合楼 A 座 712 室 法定代表人: 梁蓉 联系人: 魏素清 电话: 010-66154828 传真: 010-63583991 客户服务电话: 400-6262-1818 网址: <a href="http://www.5irich.com">www.5irich.com</a>
37	上海联泰资产管理有限公司	注册地址: 上海自由贸易区富特北路 277 号 3 层 310 室 办公地址: 上海市长宁区金钟路 658 号 2 号楼 B 座 6 楼法定代表人: 燕斌 联系人: 凌秋艳 电话: 13636316950 传真: 021-62990063 客户服务电话: 400-046-6788 网址: <a href="http://www.66zichan.com">www.66zichan.com</a>

38	上海汇付基金销售有限公司	注册地址：上海市黄浦区西藏中路 336 号 1807-5 室 办公地址：上海市黄浦区中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼 法定代表人：张晶 联系人：周丹 电话：021-33323999 传真：021-33323993 客户服务电话：400-820-2819 手机客户端：天天盈基金
39	上海利得基金销售有限公司	注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室 办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼 法定代表人：李兴春 联系人：徐鹏 电话：021-50583533 传真：021-50583633 客户服务电话：400-921-7755 公司网址： <a href="http://www.leadfund.com.cn">www.leadfund.com.cn</a>
40	北京新浪仓石基金销售有限公司	注册（办公）地址：北京市海淀区北四环西路 58 号 906 室 法定代表人：张欢行 联系人：李昭琛 电话：010-82244185 客户服务电话：010-62675369 网址： <a href="http://www.xincai.com/">http://www.xincai.com/</a>
41	泰诚财富基金销售（大连）有限公司	注册（办公）地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号 法定代表人：李春光 联系人：张晓辉 电话：0411-88891212 传真：0411-84396536 客户服务电话：4000411001 网址： <a href="http://www.taichengcaifu.com">www.taichengcaifu.com</a>
42	上海陆金所基金销售有限公司	注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元 办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 法定代表人：王之光 联系人：宁博宇 电话：021-20665952 传真：021-22066653 客户服务电话：4008219031

		网址: <a href="http://www.lufunds.com">www.lufunds.com</a>
43	深圳富济基金销售有限公司	注册(办公)地址: 深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦 35 层 01B、02、03、04 单位 法定代表人: 刘鹏宇 联系人: 刘勇 电话: 0755-83999907-8814 传真: 0755-83999926 客户服务电话: 0755-83999907 网址: <a href="http://www.fujifund.cn">www.fujifund.cn</a>
44	北京虹点基金销售有限公司	注册地址: 北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 1603 办公地址: 北京市朝阳区西大望路 1 号温特莱中心 A 座 16 层 法定代表人: 郑毓栋 联系人: 姜颖 电话: 010-56409010 客户服务电话: 400-068-1176 网址: <a href="http://www.hongdianfund.com">www.hongdianfund.com</a>
45	珠海盈米基金销售有限公司	注册地址: 珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491 办公地址: 广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203 法定代表人: 肖雯 联系人: 黄敏嫦 电话: 020-89629099 传真: 020-89629011 客户服务电话: 020-89629066 网址: <a href="http://www.yingmi.cn">www.yingmi.cn</a>

46	大泰金石基金销售有限公司	注册地址：南京市建邺区江东中路 359 号国睿大厦一号楼 B 区 4 楼 A506 室 办公地址：上海市长宁区虹桥路 1386 号文广大厦 15 楼 法定代表人：袁顾明 联系人：何庭宇 电话：13917225742 传真：021-22268089 客户服务电话：400-928-2266/021- 22267995 网址：www.dtfunds.com
47	中证金牛（北京）投资咨询有限公司	注册地址：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室 办公地址：北京市西城区宣武门外大街 甲 1 号环球财讯中心 A 座 5 层 法定代表人：钱昊旻 联系人：孙雯 电话：010-59336519 传真：010-59336500 客户服务电话：4008-909-998 网址：www.jnlc.com
48	奕丰基金销售有限公司	注册地址：深圳市前海深港合作区前湾 一路 1 号 A 栋 201 室（入住深圳市前 海商务秘书有限公司） 办公地址：深圳市南山区海德三道航天 科技广场 A 座 17 楼 1704 室 法定代表人：TAN YIK KUAN 联系人：叶健 电话：0755-89460500 传真：0755-21674453 客户服务电话：400-684-0500 网址：www.ifastps.com.cn
49	和耕传承基金销售有限公司	注册(办公)地址：河南省郑州市郑东新 区心怡路西广场路南升龙广场 2 号楼 701 法定代表人：李淑慧 联系人：裴小龙 电话：0371-55213196 传真：0371-85518397 客户服务电话：400-0555-671 网址：www.hgccpb.com

50	上海凯石财富基金销售有限公司	注册地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室 办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号 凯石大厦 4 楼 法定代表人：陈继武 联系人：李晓明 电话：021-63333319 传真：021-63332523 客户服务电话：4006433389 网址：www.vstonewealth.com
51	深圳市金斧子基金销售有限公司	注册地址：深圳市南山区粤海街道科技园 中区科苑路 15 号科兴科学园 B 栋 3 单元 11 层 1108 办公地址：深圳市南山区粤海街道科技园 中区科苑路 15 号科兴科学园 B 栋 3 单元 11 层 1108 法人代表：赖任军 联系人：刘昕霞 电话：0755-29330513 传真：0755-26920530 客服电话：400-930-0660 公司网址：www.jfzinv.com
52	武汉市伯嘉基金销售有限公司	注册（办公）地址：湖北省武汉市江汉 区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城 （一期）第 7 栋 23 层 1 号、4 号 法定代表人：陶捷 联系人：孔繁 电话：18672739925 客户服务电话：027-87006003 网址：www.buyfunds.cn
53	北京汇成基金销售有限公司	注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界财富中心 A 座 11 层 1108 号 办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界财富中心 A 座 11 层 法定代表人：王伟刚 客服电话：400-619-9059 公司网址：www.hcjijin.com

54	南京苏宁基金销售有限公司	注册地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号 法定代表人：钱燕飞 联系人：王锋 电话：025-66996699-887226 传真：025-66996699 客户服务电话：95177 网址：www.snjjin.com
55	上海大智慧基金销售有限公司	注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102、1103 单元 法定代表人：申健 联系人：印强明 电话：021-20219988 传真：021-20219988 客户服务电话：021-20292031 网址： <a href="https://www.wg.com.cn">https://www.wg.com.cn</a>
56	北京广源达信基金销售有限公司	注册地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座六层 605 室 办公地址：北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼浦项中心 B 座 19 层 法定代表人：齐剑辉 联系人：王英俊 电话：010-57298634 客服电话：4006236060 传真：010-82055860 网址：www.niuniufund.com
57	上海中正达广基金销售有限公司	注册（办公）地址：上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室 法定代表人：黄欣 联系人：戴珉微 电话：021-33768132 传真：021-33768132-802 客户服务电话：400-6767-523 网址：www.zhongzhengfund.com
58	海银基金销售有限公司	注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 8 号 402 室 办公地址：上海市浦东新区银城中路 8 号 4 楼 法定代表人：刘惠 联系人：毛林 电话：021-80133597 传真：021-80133413 客户服务电话：400-808-1016

		网址: <a href="http://www.fundhaiyin.com">www.fundhaiyin.com</a>
59	上海万得基金销售有限公司	注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座 办公地址: 上海市浦东新区福山路 33 号 8 楼 法定代表人: 王廷富 联系人: 姜吉灵 电话: 021-5132 7185 传真: 021-5071 0161 客户服务电话: 400-821-0203
60	深圳前海凯恩斯基金销售有限公司	注册地址: 深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司) 办公地址: 深圳市福田区深南大道 6019 号金润大厦 23A 法定代表人: 高锋 联系人: 廖苑兰 电话: 0755-83655588 传真: 0755-83655518 客户服务电话: 4008048688 网址: <a href="http://www.keynesasset.com">www.keynesasset.com</a>
61	中民财富基金销售(上海)	注册地址: 上海市黄浦区中山南路 100 号 7 层 05 单元 办公地址: 上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 27 层 法定代表人: 弭洪军 联系人: 郭斯捷 电话: 021-33357030 传真: 021-63353736 客户服务电话: 400-876-5716 网址: <a href="http://www.cmiwm.com">www.cmiwm.com</a>

62	天津国美基金销售有限公司	注册地址：天津经济技术开发区南港工业 区综合服务区办公楼 D 座二层 202- 124 室 办公地址：北京市朝阳区霄云路 26 号 鹏润大厦 B 座 19 层 法定代表人：丁东华 联系人：郭宝亮 电话：010-59287984 传真：010-59287825 客户服务电话：4001110889 网址：www.gomefund.com
63	北京蛋卷基金销售有限公司	注册（办公）地址：北京市朝阳区阜通 东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507 法定代表人：钟斐斐 联系人：翟相彬 电话：010-61840688 传真：010-61840699 客户服务电话：400 0618 518 网址：http://danjuanapp.com/
64	上海基煜基金销售有限公司	注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园 公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰 和经济发展区） 办公地址：上海市杨浦区昆明路 518 号 A1002 室 法定代表人：王翔 联系人：蓝杰 电话：021-65370077 传真：021-55085991 客户服务电话：4008205369 网址：www.jiyufund.com.cn
65	南京途牛基金销售有限公司	注册地址：南京市玄武区玄武大道 699-1 号 办公地址：南京市玄武区玄武大道 699-1 号 法定代表人：宋时琳 联系人：王旋 电话：025—86853969 传真：025—86853960 客服电话：4007-999-999 网址：http://jr.tuniu.com



66	上海钜派钰茂基金销售有限公司	注册地址：上海市浦东新区泥城镇新城路 2 号 24 幢 N3187 室 办公地址：上海市浦东新区浦东南路 379 号金穗大厦 14 楼 C 座 法定代表人：胡天翔 联系人：卢奕 电话：021-50793059 传真：021-68413161 客户服务电话：4006889967 网址： <a href="http://www.jp-fund.com/">http://www.jp-fund.com/</a>
67	凤凰金信（银川）基金销售有限公司	注册地址：宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路 142 号 14 层 1402 办公地址：北京市朝阳区紫月路 18 号院 朝来高科技产业园 18 号楼 法定代表人：张旭 联系人：陈旭 电话：010-58160168 传真：010-58160173 客户服务电话：400-810-5919 网址： <a href="http://www.fengfd.com">www.fengfd.com</a>
68	北京微动利基金销售有限公司	注册地址：北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心金融商业楼 341 室 办公地址：北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心金融商业楼 341 室 法定代表人：季长军 联系人：季长军 电话：010-52609551 传真：010-51957430 客户服务电话：400-819-6665 网址： <a href="http://www.buyforyou.com.cn">www.buyforyou.com.cn</a>
69	北京格上富信基金销售有限公司	注册地址：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室 办公地址：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室 法定代表人：李悦章 联系人：曹庆展 电话：010-65983311 传真：010-65983333 客户服务电话：400-066-8586 网址： <a href="http://www.igesafe.com">www.igesafe.com</a>

70	北京肯特瑞财富投资管理有限公司	注册地址：北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06 办公地址：北京市亦庄经济开发区科 创十一街 18 号院 A 座 17 层 法定代表人：陈超 联系人：江卉 电话：4000988511/ 4000888816 传真：010-89188000 客户服务电话：95118 网址：www.fund.jd.com
71	上海朝阳永续基金销售有限公司	注册地址：上海市浦东新区上封路 977 号 1 幢 B 座 812 室 法定代表人：廖冰 联系人：陆纪青 电话：15902135304 客户服务电话：4009987172 网址：www.998fund.com
72	泛华普益基金销售有限公司	注册地址：成都市成华区建设路 9 号 高地中心 1101 室 办公地址：四川省成都市锦江区东大街 99 号平安金融中心 1501 单元 法定代表人：于海锋 联系人：王峰 电话：028-84252474 传真：028-84252474 客户服务电话：4008-588-588 网址：https://www.puyifund.com/
73	上海华夏财富投资管理有限公司	注册地址：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室 办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层 法定代表人：李一梅 联系人：仲秋玥 电话：010-88066632 传真：010-88066214 客户服务电话：400-817-5666 网址：www.amcfortune.com

74	上海云湾基金销售有限公司	注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 27 号 13 号楼 2 层 办公地址：上海市浦东新区锦康路 308 号陆家嘴世纪金融广场 6 号楼 6 层 法定代表人：戴新装 联系人：朱学勇 电话：021-20538888 传真：021-20538999 客户服务电话：400-820-1515 网址：www.zhengtongfunds.com
75	上海挖财金融信息服务有限公司	注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 楼 01、02、03 室 办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 楼 01、02、03 室 法定代表人：胡燕亮 联系人：义雪辉 电话：021 - 50810687 传真：021-58300279 客户服务电话：021-50810673 网址： <a href="http://www.wacaijin.com/">http://www.wacaijin.com/</a>
76	深圳秋实惠智基金销售有限公司	注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室 办公地址：北京市朝阳区东三环北路 2 号南银大厦 2309 法定代表人：张秋林 联系人：张秋林 电话：010-64108876 传真：010-64108875 客户服务电话：010-64108876 网址： <a href="http://fund.qiushicaifu.com">http://fund.qiushicaifu.com</a>
77	大河财富基金销售有限公司	注册地址：贵州省贵阳市南明区新华路 110-134 号富中国际广场 1 栋 20 层 1.2 号 办公地址：贵州省贵阳市南明区新华路 110-134 号富中国际广场 1 栋 20 层 1.2 号 法定代表人：王荻 联系人：方凯鑫 电话：0851-88405606 传真：0851-88405599 客户服务电话：0851-88235678 网址：www.urainf.com

78	天津万家财富资产管理有限公司	注册地址：天津自贸区（中心商务区） 迎宾大道 1988 号滨海浙商大厦公寓 2- 2413 室 办公地址：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 5 层 法定代表人：李修辞 联系人：王芳芳 电话：010-59013842 传真：021- 38909635 客户服务电话：010--59013825 网址：www.wanjiawealth.com
79	北京电盈基金销售有限公司	注册地址：北京市朝阳区呼家楼（京广 中心）1 号楼 36 层 3603 室 办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 F 座 12B 法定代表人：程刚 联系人：李丹 电话：010-56176115 传真：010-56176117 客户服务电话：400-100-3391 网址：www.bjdyfund.com
80	通华财富（上海）基金销售有限公司	注册地址：上海市虹口区同丰路 667 弄 107 号 201 室 办公地址：上海市浦东新区杨高南路 799 号陆家嘴世纪金融广场 3 号楼 9 楼 法定代表人：马刚 联系人：杨徐霆 电话：021-60818249 客户服务电话：95156 网址：www.tonghuafund.com
81	喜鹊财富基金销售有限公司	注册地址：西藏拉萨市柳梧新区柳梧大 厦 1513 室 办公地址：西藏拉萨市柳梧新区柳梧大 厦 1513 室 法定代表人：陈皓 联系人：曹砚财 电话：010-58349088 传真：010-88371180 客户服务电话：0891-6177483 网址：www.xiquefund.com

82	济安财富（北京）基金销售有限公司	注册地址：北京市朝阳区东三环中路 7 号 4 号楼 40 层 4601 室 办公地址：北京市朝阳区东三环中路 7 号北京财富中心 A 座 46 层 法定代表人：杨健 联系人：李海燕 电话：010-65309516 传真：010-65330699 客户服务电话：400-673-7010 网址：www.jianfortune.com
83	洪泰财富（青岛）基金销售有限责任公司	注册地址：山东省青岛市香港东路 195 号 9 号楼 701 室 办公地址：北京市西城区西什库大街 31 号院九思文创园 5 号楼 501 室 法定代表人：任淑楨 联系人：周映筱 电话：010-66162800 传真：0532-66728591 客户服务电话：4006706863 网址：www.hongtaiwealth.com
84	上海有鱼基金销售有限公司	注册地址：上海自由贸易试验区浦东大 道 2123 号 3 层 3E-2655 室 办公地址：上海徐汇区桂平路 391 号 B 座 19 层 法定代表人：林琼 联系人：徐海崢 电话：021-60907379 传真：021-60907397 客户服务电话：021-60907378 网址：www.youyufund.com
85	深圳盈信基金销售有限公司	注册地址：深圳市福田区莲花街道商 报东路英龙商务大厦 8 楼 A-1（811- 812） 办公地址：大连市中山区南山路 155 号南山 1910 小区 A3-1 法定代表人：苗宏升 联系人：王清臣 电话：0411-66889805 传真：0411-66889827 客户服务电话：4007-903-688

86	民商基金销售（上海）有限公司	注册地址：上海黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 A31 室 办公地址：上海市浦东新区张杨路 707 号生命人寿大厦 32 楼 法定代表人：贲惠琴 联系人：钟伟 电话：138-2642-0174 传真：021-50206001 客户服务电话：021-50206003 网址： <a href="http://www.msftec.com/">http://www.msftec.com/</a>
87	北京百度百盈基金销售有限公司	注册地址：北京市海淀区上地十街 10 号 1 幢 1 层 101 办公地址：北京市海淀区上地信 息路甲 9 号奎科科技大厦 法定代表人：张旭阳 联系人：孙博超 电话：010-61952703 传真：010-61951007 客户服务电话：95055 网址： <a href="http://www.baiyingfund.com">www.baiyingfund.com</a>

基金管理人可根据《销售办法》和基金合同等的规定，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时履行公告义务。

## （二）注册登记机构

名称：景顺长城基金管理有限公司

住所：深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层

法定代表人：丁益

电话：0755-82370388-1902

传真：0755-22381325

联系人：曹竞

## （三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

电话：021-31358666

传真：021-31358600

经办律师：黎明、孙睿

联系人：孙睿

#### **(四) 审计基金财产的会计师事务所**

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

经办注册会计师：许康玮、朱宏宇

## **四、基金的名称**

景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

## **五、基金的类型**

指数基金、联接基金。

## **六、基金的投资目标**

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

## **七、基金的投资方向**

本基金以目标 ETF 基金份额、标的指数成份股及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发行上市的非成份股（包括中小板、

创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、银行存款、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、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本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）。

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。

基金的投资组合比例为：本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%，同时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、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

## 八、基金的投资策略

本基金为目标 ETF 的联接基金，主要通过投资于目标 ETF 以达到投资目标。当本基金申购、赎回和买卖目标 ETF，或基金自身的申购、赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，基金管理人会在 10 个工作日内对投资组合进行适当调整，以便实现对跟踪误差的有效控制。

在正常情况下，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%。

### 1、资产配置策略

本基金主要通过投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股来进行被动式指数化投资，达到跟踪标的指数的目标。因此，本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%，同时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、应收申购款等。

### 2、目标 ETF 投资策略

本基金可以通过申购、赎回代理券商申购及赎回目标 ETF 基金份额，也可以通过券商在二级市场上买卖目标 ETF 基金份额。本基金将根据开放日申购、赎回情况，综合考虑流



动性、成本、效率等因素，决定本基金对目标 ETF 的投资方式。通常情况下，本基金以申购、赎回的投资方式为主：当收到净申购申请时，本基金构建股票组合，并且申购目标 ETF；当收到净赎回申请时，本基金赎回目标 ETF，并且卖出股票组合。对于股票停牌或其他原因导致基金投资组合中出现的剩余成份股，本基金将选择作为后续申购目标 ETF 的基础证券或者择机在二级市场卖出。本基金在二级市场上买卖目标 ETF 基金份额是出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的。

### 3、股票投资策略

本基金对于标的指数成份股和备选成份股部分的投资，采用被动式指数化投资的方法进行日常管理。

### 4、债券投资策略

出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量，本基金适时对债券进行投资。通过研究国内外宏观经济、货币和财政政策、市场结构变化、资金流动情况，采取自上而下的策略判断未来利率变化和收益率曲线变动的趋势及幅度，确定组合久期。进而根据各类资产的预期收益率，确定债券资产配置。

### 5、权证、股指期货投资策略

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如期权、权证以及其他相关的衍生工具。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位调整的频率和交易成本。

### 6、中小企业私募债券的投资策略

对单个券种的分析判断与其它信用类固定收益品种的方法类似。在信用研究方面，本基金将加强自下而上的分析，将机构评级与内部评级相结合，着重通过发行方的财务状况、信用背景、经营能力、行业前景、个体竞争力等方面判断其在期限内的偿付能力，尽可能对发行人进行充分详尽的调研和分析。

### 7、资产支持证券的投资策略

本基金将通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。同时，基金管理人将密切关注流动性对标的证券收益率的影响，综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择以及把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，结合信用研究和流动性管理进行投资，以期获得

长期稳定收益。

## 九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 5\% \times \text{银行活期存款利率(税后)}$ 。

本基金是 ETF 联接基金，追求对标的指数的有效跟踪，因此采用以标的指数为主要构成部分的业绩比较基准较为合理。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时，若变更业绩比较基准涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更业绩比较基准召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案且在指定媒介公告。若变更业绩比较基准对基金投资范围和投资策略无实质性影响（包括但不限于指数编制机构变更、指数更名等事项），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案并及时公告。

## 十、基金的风险收益特征

本基金为 ETF 联接基金，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。本基金为股票型指数基金，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。

## 十一、基金投资组合报告

景顺长城基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行根据基金合同规定，已经复核了本投资组合报告，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。财务数据截至 2018 年 9 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

## 1.报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	250,629,000.00	94.15
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	15,500,501.20	5.82
8	其他资产	74,874.13	0.03
9	合计	266,204,375.33	100.00

## 2.报告期末按行业分类的股票投资组合

### 2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资。

### 2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

## 3.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票投资。

## 4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 5.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

## 6.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 9.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金	股票型指数基金	交易型开放式	景顺长城基金管理有限公司	250,629,000.00	94.27

## 10.报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位调整的频率和交易成本。

## 11.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

### 11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 12.投资组合报告附注

### 12.1

本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在报告编制

日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

## 12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

## 12.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	3,039.62
2	应收证券清算款	19,611.96
3	应收股利	-
4	应收利息	2,778.01
5	应收申购款	49,444.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	74,874.13

## 12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

## 12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

## 12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

# 十二、 基金的业绩

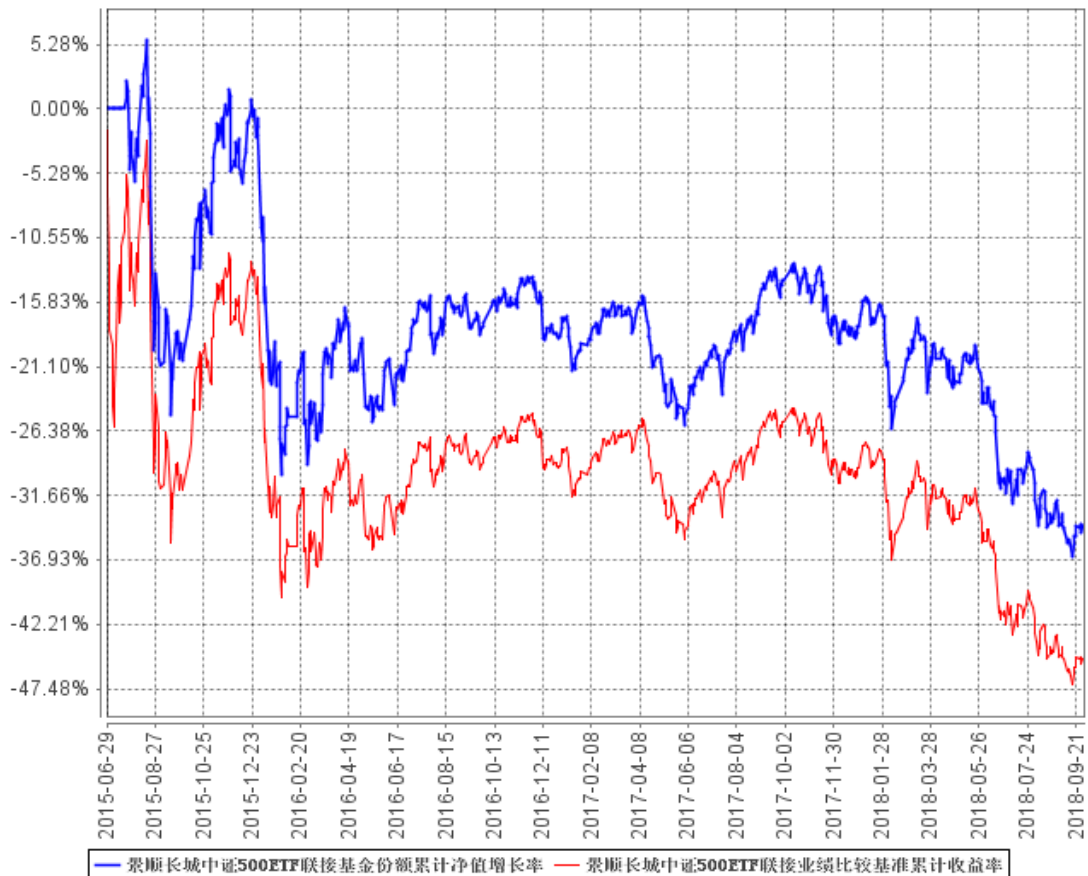
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。基金业绩数据截至 2018 年 9 月 30 日。

### 1、基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
----	------------	---------------	--------------------	-----------------------	-----	-----

2015 年 6 月 29 日至 2015 年 12 月 31 日	-2.20%	2.30%	-15.06%	3.12%	12.86%	-0.82%
2016 年	-16.87%	1.74%	-16.77%	1.81%	-0.10%	-0.07%
2017 年	1.11%	0.86%	-0.13%	0.88%	1.24%	-0.02%
2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	-14.23%	1.33%	-15.71%	1.37%	1.48%	-0.04%
2018 年 1 月 1 日至 2018 年 9 月 30 日	-19.83%	1.28%	-22.10%	1.32%	2.27%	-0.04%
2015 年 6 月 29 日至 2018 年 9 月 30 日	-34.10%	1.53%	-45.00%	1.78%	10.90%	-0.25%

## 2、自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：本基金的投资组合比例为：本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%，同时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。本基金的建仓期为自 2015 年 6 月 29 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

## 十三、基金费用概览

### 一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后的标的指数许可使用费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券、期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、证券、期货账户开户费用和账户维护费；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。本基金管理费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值—前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值，若为负数，则 E 取 0

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的基金托管费

本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。本基金托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：



$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值—前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值，若为负数，则 E 取 0

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起2-5个工作日内从基金财产中一次性支付提取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

### 3、《基金合同》生效后的标的指数许可使用费

本基金《基金合同》生效后的标的指数许可使用费按照基金管理人与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议及其补充协议的约定从基金财产中支付。

自基金合同生效日起，至本基金达到基金合同所规定的投资比例之日止，就本基金收取指数许可使用费。该指数许可使用费按本基金当日持有的股票资产总市值的万分之二（2个基点）的年费率计提，每日计算，逐日累计。本基金达到基金合同所规定的投资比例之日起，不再对本基金收取指数许可使用费。

指数许可使用费的支付方式为每季度支付一次，自基金合同生效日起，于每年1月、4月、7月、10月的前十（10）个工作日内，按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

如与指数编制方的指数使用协议约定的收费标准、支付方式等发生变更，按照变更后的费率、支付方式执行，此项无需召开基金份额持有人大会。

上述“一、基金费用的种类中第4-10项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

## 三、与基金销售有关的费用

### 1、基金认购费用

（1）投资者认购需全额缴纳认购费用。认购费用不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等募集期间发生的各项费用。投资者在一天之内如果有多笔认购，适用费率按单笔分别计算。认购费率表如下：

认购金额（M）	认购费率
M < 50 万	1.00%
50 万 ≤ M < 250 万	0.60%
250 万 ≤ M < 500 万	0.30%
M ≥ 500 万	1000 元/笔



## (2) 计算公式

本基金认购份额的计算如下：

当认购费用适用比例费率时：

净认购金额=认购金额/（1+认购费率）

认购费用=认购金额-净认购金额

认购份额=（净认购金额+认购期间利息）/基金份额发售面值

当认购费用适用固定金额时：

认购费用=固定金额

净认购金额=认购金额-认购费用

认购份额=（净认购金额+认购期间利息）/基金份额发售面值

认购费用以人民币元为单位，计算结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位；认购份额计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍去，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

## 2、基金申购费用

(1) 本基金的申购费用由申购本基金的投资者承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

本基金的申购费率不高于1.2%，随申购金额的增加而递减，适用以下前端收费费率标准：

申购金额 (M)	申购费率
M<50 万	1.20%
50 万≤M<250 万	0.80%
250 万≤M<500 万	0.40%
M≥500 万	1000 元/笔

## (2) 计算公式

本基金申购份额的计算：

基金的申购金额包括申购费用和净申购金额，其中：

当申购费用适用比例费率时：

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额=净申购金额/T 日基金份额净值

当申购费用适用固定金额时：

申购费用=固定金额

净申购金额=申购金额-申购费用

申购份数=净申购金额/T 日基金份额净值

申购费用以人民币元为单位，计算结果按照四舍五入方法，保留至小数点后两位；申购份额计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分尾数舍去，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

### 3、基金赎回费用

(1) 本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。不低于赎回费总额的 25% 应归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。本基金对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。

本基金的赎回费率随持有期限的增加而递减。

持有期限	赎回费率
7 日以内	1.50%
7 日（含）—1 年以内	0.50%
1 年（含）—2 年	0.25%
2 年（含）以上	0

注：就赎回费而言，每 1 年指 365 天。

#### (2) 计算公式

本基金赎回金额的计算：

采用“份额赎回”方式，赎回价格以 T 日的基金份额净值为基准进行计算，基金的赎回金额为赎回总金额扣减赎回费用，其中：

赎回总金额=赎回份额×T 日基金份额净值

赎回费用=赎回总金额×赎回费率

赎回金额=赎回总金额-赎回费用

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额以当日基金份额净值为基准并扣除相应的费用，赎回金额、赎回费用计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

#### 4、基金转换费用

(1) 本基金的转换费用由赎回费和申购补差费组成，转出时收取赎回费，转入时收取申购补差费。其中赎回费的收取标准遵循本招募说明书的约定，申购补差费的收取标准为：申购补差费=MAX【转出净额在转入基金中对应的申购费用—转出净额在转出基金中对应的申购费用，0】。

##### (2) 计算公式

###### ①基金转出时赎回费的计算：

由股票基金转出时：

转出总额=转出份额×转出基金当日基金份额净值

由货币基金转出时：

转出总额=转出份额×转出基金当日基金份额净值+待结转收益（全额转出时）

赎回费用=转出总额×转出基金赎回费率

转出净额=转出总额—赎回费用

###### ②基金转入时申购补差费的计算：

净转入金额=转出净额—申购补差费

其中，申购补差费=MAX【转出净额在转入基金中对应的申购费用—转出净额在转出基金中对应的申购费用，0】

转入份额=净转入金额 / 转入基金当日基金份额净值

#### 四、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

#### 五、基金税收

本基金运作过程中涉及各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

#### 六、费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金

托管费率等相关费率。

调低基金管理费率和基金托管费率等费率，无需召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须于新的费率实施日前 2 日在指定媒介上公告。

## 十四、对招募说明书更新部分的说明

1、在“三、基金管理人”部分，更新了基金管理人法定代表人、董事会成员、监事会成员、高级管理人员、基金经理和投资决策委员会情况的相关信息；

2、在“四、基金托管人”部分，更新了托管人相关情况信息；

3、在“五、相关服务机构”部分，更新了基金份额销售机构的相关信息；

4、在“八、基金份额的申购、赎回与转换及其他注册登记业务”部分，更新基金定期定额投资计划的相关信息；

5、在“九、基金的投资”部分，更新了基金投资组合报告，数据截至 2018 年 9 月 30 日；

6、更新了“十、基金的业绩”部分，数据截至 2018 年 9 月 30 日；

7、在“二十二、其他应披露事项”部分，更新了近期发布的与本基金有关的公告目录，目录更新至 2018 年 12 月 29 日。

景顺长城基金管理有限公司

二〇一九年二月十二日