

景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金 2019 年第 3 号更新招募说明书摘要

重要提示

(一) 景顺长城中证500行业中性低波动指数型证券投资基金(以下简称“基金”或“本基金”)由基金管理人依照《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)、《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》(以下简称“基金合同”)及其他有关规定募集,并经中国证监会2016年8月9日证监许可【2016】1781号文准予募集注册。本基金基金合同于2017年3月3日正式生效。

(二) 基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会注册,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。

(三) 投资有风险,投资人认购(或申购)本基金时应认真阅读本基金招募说明书、基金产品资料概要。招募说明书约定的基金产品资料概要编制、披露及更新等内容,将不晚于2020年9月1日起执行。

(四) 基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负责。

(五) 基金合同是约定基金合同当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人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,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

(六) 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。

(七) 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,请认真阅读本招募说明书和基金合同等信息披露文件,全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策,获得基金投资收益,亦自行承担基金投资中出现的各类风险。投资本基金可能遇到的风险包括:证券市场整体环境引发的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,大量赎回或暴跌导致的流动性风险,基金投资过程中产生的操作风险,因交收违约和投资债券引发的信用风险,基金投资对象与投资策略引致的特有风险,等等。

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。根据2017年7月1日施行的《证券期货投资者适当性管理办法》,基金管理人和销售机构已对本基金重新进行风险评级,风险评级行为不改变本基金的实质性风险收益特征,但由于风险等级分类标准的变化,本基金的风险等级表述可能有相应变化,具体风险评级结果应以基金管理人和销售机构提供的评级结果为准。

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。中小企业私募债券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。

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。

（八）基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

（九）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2019年9月30日，有关财务数据和净值表现截止日为2019年9月30日。如本基金发生重大期后事项的，本招募说明书也对相应内容进行了更新。本更新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：上海浦东发展银行股份有限公司

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

设立日期：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：杨崑阳

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；华能资本服务有限公司董事长、党组书记。现任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，高级管理人工商管理硕士。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，副总经理兼首席信息官，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，现任公司副总经理兼首席信息官。

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；2014 年 4 月至 2019 年 1 月管理上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金；2014 年 12 月至 2019 年 7 月管理景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金；2015 年 6 月至 2019 年 7 月管理景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金；2018 年 5 月至 2019 年 11 月管理景顺长城 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；2018 年 8 月至 2019 年 11 月管理景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金；2018 年 8 月至 2019 年 11 月管理景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

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、景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金、景顺长城量化先锋混合型证券投资基金和景顺长城中证沪港深红利成长低波动指数型证券投资基金基金经理。

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、景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金、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、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、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和景顺长城中证沪港深红利成长低波动指数型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（陈文宇），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；

彭成军先生，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）基金托管人概况

本基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司，基本信息如下：

名称：上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路 12 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：高国富

成立时间：1992 年 10 月 19 日

经营范围：经中国人民银行和中国银行业监督管理委员会批准，公司主营业务主要包括：

吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱业务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；资信调查、咨询、见证业务；离岸银行业务；证券投资基金托管业务；全国社会保障基金托管业务；经中国人民银行和中国银行业监督管理委员会批准经营的其他业务。

组织形式： 股份有限公司

注册资本： 293.52 亿元人民币

存续期间： 持续经营

基金托管资格批文及文号： 中国证监会证监基金字[2003]105 号

联系人： 胡波

联系电话： (021) 61618888

上海浦东发展银行自 2003 年开展资产托管业务，是较早开展银行资产托管服务的股份制商业银行之一。经过二十年来的稳健经营和业务开拓，各项业务发展一直保持较快增长，各项经营指标在股份制商业银行中处于较好水平。

上海浦东发展银行总行于 2003 年设立基金托管部，2005 年更名为资产托管部，2013 年更名为资产托管与养老金业务部，2016 年进行组织架构优化调整，并更名为资产托管部，目前下设证券托管处、客户资产托管处、内控管理处、业务保障处、总行资产托管运营中心（含合肥分中心）五个职能处室。

目前，上海浦东发展银行已拥有客户资金托管、资金信托保管、证券投资基金托管、全球资产托管、保险资金托管、基金专户理财托管、证券公司客户资产托管、期货公司客户资产托管、私募证券投资基金托管、私募股权托管、银行理财产品托管、企业年金托管等多项托管产品，形成完备的产品体系，可满足多领域客户、境内外市场的资产托管需求。

（二）主要人员情况

高国富，男，1956 年出生，研究生学历，博士学位，高级经济师职称。曾任上海外高桥保税区开发（控股）公司总经理；上海外高桥保税区管委会副主任；上海万国证券公司代总裁；上海久事公司总经理；上海市城市建设投资开发总公司总经理；中国太平洋保险（集团）股份有限公司党委书记、董事长。现任上海浦东发展银行股份有限公司党委书记、董事长。

第十二届全国政协委员。伦敦金融城中国事务顾问委员会委员，中欧国际工商学院理事会成员、国际顾问委员会委员，上海交通大学安泰经济管理学院顾问委员会委员。

刘信义，男，1965 年出生，硕士研究生，高级经济师。曾任上海浦东发展银行上海地区总部副总经理，上海市金融服务办挂职任机构处处长、市金融服务办主任助理，上海浦东发展银行党委委员、副行长、财务总监，上海国盛集团有限公司总裁。现任上海浦东发展银行党委副书记、副董事长、行长。

孔建，男，1968 年出生，博士研究生。历任工商银行山东省分行资金营运处副处长，上海浦东发展银行济南分行信管处总经理，上海浦东发展银行济南分行行长助理、副行长、党委书记、行长。现任上海浦东发展银行总行金融市场业务工作党委委员，资产托管部总经理。

（三）基金托管业务经营情况

截止 2019 年 9 月 30 日，上海浦东发展银行证券投资基金托管规模为 4532.46 亿元，比去年末增加 7.58%。托管证券投资基金共一百六十七只，分别为国泰金龙行业精选基金、国泰金龙债券基金、天治财富增长基金、广发小盘成长基金、汇添富货币基金、长信金利趋势基金、嘉实优质企业基金、国联安货币基金、长信利众债券基金（LOF）、博时安丰 18 个月基金（LOF）、易方达裕丰回报基金、鹏华丰泰定期开放基金、汇添富双利增强债券基金、华富恒财定开债券基金、汇添富和聚宝货币基金、工银目标收益一年定开债券基金、北信瑞丰宜投宝货币基金、中海医药健康产业基金、华富国泰民安灵活配置混合基金、安信动态策略灵活配置基金、东方红稳健精选基金、国联安鑫享混合基金、长安鑫利优选混合基金、工银瑞信生态环境基金、天弘新价值混合基金、嘉实机构快线货币基金、鹏华 REITs 封闭式基金、华富健康文娱基金、金鹰改革红利基金、易方达裕祥回报债券基金、中银瑞利灵活配置混合基金、华夏新活力混合基金、鑫元汇利债券型基金、南方转型驱动灵活配置基金、银华远景债券基金、富安达长盈灵活配置混合型基金、中信建投睿溢混合型证券投资基金、工银瑞信恒享纯债基金、长信利发债券基金、博时景发纯债基金、鑫元得利债券型基金、东方红战略沪港深混合基金、博时富发纯债基金、博时利发纯债基金、银河君信混合基金、汇添富保鑫保本混合基金、兴业启元一年定开债券基金、工银瑞信瑞盈 18 个月定开债券基金、中信建投稳裕定开债券基金、招商招怡纯债债券基金、中加丰享纯债债券基金、长安泓泽纯债债券基金、银河君耀灵活配置混合基金、广发汇瑞 3 个月定期开放债券发起式证券投资基金、汇安嘉汇纯债债券基金、南方宣利定开债券基金、招商兴福灵活配置混合基金、博时鑫润灵活配置混合基金、兴业裕华债券基金、易方达瑞通灵活配置混合基金、招商招祥纯债债券基金、

易方达瑞程混合基金、中欧骏泰货币基金、招商招华纯债债券基金、汇安丰融灵活配置混合基金、汇安嘉源纯债债券基金、国泰普益混合基金、汇添富鑫瑞债券基金、鑫元合丰纯债债券基金、博时鑫惠混合基金、国泰润利纯债基金、华富天益货币基金、汇安丰华混合基金、汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金、汇安丰恒混合基金、景顺长城中证 500 指数基金、鹏华丰康债券基金、兴业安润货币基金、兴业瑞丰 6 个月定开债券基金、兴业裕丰债券基金、易方达瑞弘混合基金、长安鑫富领先混合基金、万家现金增利货币基金、上银慧增利货币市场基金、易方达瑞富灵活配置证券投资基金、博时富腾纯债债券型证券投资基金、安信工业 4.0 主题沪港深精选混合基金、万家天添宝货币基金、中欧瑾泰债券型证券投资基金、中银证券安弘债券基金、鑫元鑫趋势灵活配置混合基金、泰康年年红纯债一年定期开放债券基金、广发高端制造股票型发起式基金、永赢永益债券基金、南方安福混合基金、中银证券聚瑞混合基金、太平改革红利精选灵活配置混合基金、富荣富乾债券型证券投资基金、国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金、前海开源景鑫灵活配置混合型证券投资基金、前海开源润鑫灵活配置混合型证券投资基金、中海沪港深多策略灵活配置混合型基金基金、中银证券祥瑞混合型证券投资基金、前海开源盛鑫灵活配置混合型证券投资基金、鑫元行业轮动灵活配置混合型证券投资基金、兴业 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、富国颐利纯债债券型证券投资基金、华安安浦债券型证券投资基金、南方泽元债券型证券投资基金、鹏扬淳利定期开放债券型证券投资基金、万家鑫悦纯债债券型基金、新疆前海联合泳祺纯债债券型证券投资基金、永赢盈益债券型证券投资基金、中加颐合纯债债券型证券投资基金、中信保诚稳达债券型证券投资基金、中银中债 3-5 年期农发行债券指数证券投资基金、东方红核心优选一年定期开放混合型证券投资基金、平安惠锦纯债债券型证券投资基金、华夏鼎通债券型证券投资基金、鑫元全利债券型发起式证券投资基金、中融恒裕纯债债券型证券投资基金、嘉实致盈债券型证券投资基金、永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信瑞福纯债债券型证券投资基金、广发景智纯债债券型证券投资基金、东兴品牌精选灵活配置混合型证券投资基金、广发中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、融通通捷债券型证券投资基金、华富恒盛纯债债券型证券投资基金、建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金、国寿安保安丰纯债债券型证券投资基金、海富通聚丰纯债债券型证券投资基金、博时中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、银河家盈纯债债券型证券投资基金、博时富永纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、南方畅利定期开放债券型发起式证券投资基金、中加瑞利纯债债券型证券投资基金、华安安泰定期开放

债券型发起式证券投资基金、华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金、永赢合益债券型证券投资基金、嘉实中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、广发港股通优质增长混合型证券投资基金、长安泓沅中短债债券型证券投资基金、中海信息产业精选混合型证券投资基金、民生加银恒裕债券型证券投资基金、国寿安保尊益信用纯债债券型证券投资基金、平安惠泰纯债债券型证券投资基金、中信建投景和中短债债券型证券投资基金、工银瑞信添慧债券型证券投资基金、华富安鑫债券型证券投资基金、汇添富中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、南方旭元债券型发起式证券投资基金、大成中债 3-5 年国开行债券指数基金、永赢众利债券型证券投资基金、华夏中债 3-5 年政策性金融债指数证券投资基金、中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金、新疆前海联合科技先锋混合型证券投资基金、银华尊尚稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、博时颐泽平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、农银养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、汇添富汇鑫浮动净值货币市场基金、泰康安欣纯债债券型证券投资基金、恒生前海港股通精选混合型证券投资基金、鹏华丰鑫债券型证券投资基金、中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金等。

（四）基金托管人的内部控制制度

1、本行内部控制目标为：确保经营活动中严格遵守国家有关法律法规、监管部门监管规则和本行规章制度，形成守法经营、规范运作的经营思想。确保经营业务的稳健运行，保证基金资产的安全和完整，确保业务活动信息的真实、准确、完整，保护基金份额持有人的合法权益。

2、本行内部控制组织架构为：总行法律合规部是全行内部控制的牵头管理部门，指导业务部门建立并维护资产托管业务的内部控制体系。总行风险监控部是全行操作风险的牵头管理部门。指导业务部门开展资产托管业务的操作风险管控工作。总行资产托管部下设内控管理处。内控管理处是全行托管业务条线的内部控制具体管理实施机构，并配备专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，独立行使监督稽核职责。

3、内部控制制度及措施：本行已建立完善的内部控制制度。内控制度贯穿资产托管业务的决策、执行、监督全过程，渗透到各业务流程和各操作环节，覆盖到从事资产托管各级组织结构、岗位及人员。内部控制以防范风险、合规经营为出发点，各项业务流程体现“内控优先”要求。

具体内控措施包括：培育员工树立内控优先、制度先行、全员化风险控制的风险管理理

念，营造浓厚的内控文化氛围，使风险意识贯穿到组织架构、业务岗位、人员的各个环节。制定权责清晰的业务授权管理制度、明确岗位职责和各项操作规程、员工职业道德规范、业务数据备份和保密等在内的各项业务管理制度；建立严格完善的资产隔离和资产保管制度，托管资产与托管人资产及不同托管资产之间实行独立运作、分别核算；对各类突发事件或故障，建立完备有效的应急方案，定期组织灾备演练，建立重大事项报告制度；在基金运作办公区域建立健全安全监控系统，利用录音、录像等技术手段实现风险控制；定期对业务情况进行自查、内部稽核等措施进行监控，通过专项/全面审计等措施实施业务监控，排查风险隐患。

（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

1、监督依据

托管人严格按照有关政策法规、以及基金合同、托管协议等进行监督。监督依据具体包括：

- （1）《中华人民共和国证券法》；
- （2）《中华人民共和国证券投资基金法》；
- （3）《公开募集证券投资基金运作管理办法》；；
- （4）《证券投资基金销售管理办法》
- （5）《基金合同》、《基金托管协议》；
- （6）法律、法规、政策的其他规定。

2、监督内容

我行根据基金合同及托管协议约定，对基金合同生效之后所托管基金的投资范围、投资比例、投资限制等进行严格监督，及时提示基金管理人违规风险。

3、监督方法

（1）资产托管部设置核算监督岗位，配备相应的业务人员，在授权范围内独立行使对基金管理人投资交易行为的监督职责，规范基金运作，维护基金投资人的合法权益，不受任何外界力量的干预；

（2）在日常运作中，凡可量化的监督指标，由核算监督岗通过托管业务的自动处理程序进行监督，实现系统的自动跟踪和预警；

（3）对非量化指标、投资指令、管理人提供的各种报表和报告等，采取人工监督的方法。

4、监督结果的处理方式

(1) 基金托管人对基金管理人的投资运作监督结果, 采取定期和不定期报告形式向基金管理人和中国证监会报告。定期报告包括基金监控周报等。不定期报告包括提示函、临时日报、其他临时报告等;

(2) 若基金托管人发现基金管理人违规违法操作, 以电话、邮件、书面提示函的方式通知基金管理人, 指明违规事项, 明确纠正期限。在规定期限内基金托管人再对基金管理人违规事项进行复查, 如果基金管理人未予纠正, 基金托管人将报告中国证监会。如果发现基金管理人投资运作有重大违规行为时, 基金托管人应立即报告中国证监会, 同时通知基金管理人限期纠正;

(3) 针对中国证监会、中国人民银行对基金投资运作监督情况的检查, 应及时提供有关情况和资料。

三、相关服务机构

(一) 基金份额发售机构

1、直销中心

名称: 景顺长城基金管理有限公司

注册地址: 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

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: 直销中心包括本公司直销柜台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	销售机构全称	销售机构信息
----	--------	--------

1	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
2	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
3	中信建投证券股份有限公司	注册（办公）地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼 法定代表人：王常青 联系人：许梦园 电话：（010）85156398 传真：（010）65182261 客户服务电话：4008888108/95587 网址：www.csc108.com
4	申万宏源证券有限公司	注册（办公）地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层 法定代表人：李梅 联系人：曹晔 电话：021-33389888 传真：021-33388224 客户服务电话：95523 或 4008895523 网址：www.swhysc.com
5	申万宏源西部证券有限公司	注册（办公）地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室 法定代表人：李季 联系人：王君 电话：0991-7885083 传真：0991-2310927 客户服务电话：400-800-0562 网址：www.hysec.com

6	光大证券股份有限公司	注册（办公）地址：上海市静安区新闻路 1508 号 法定代表人：周健男 联系人：郁疆 电话：021-22169999 传真：021-22169134 客户服务电话：95525、4008888788、10108998 网址：www.ebscn.com
7	中银国际证券股份有限公司	注册（办公）地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 31 楼 法定代表人：宁敏 联系人：许慧琳 电话：021-20328531 客户服务电话：4006208888 网址：www.bocichina.com
8	安信证券股份有限公司	注册（办公）地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元 法定代表人：王连志 联系人：郑向溢 电话：0755-82558038 传真：0755-82558355 客户服务电话：4008001001 网址：www.essence.com.cn
9	国金证券股份有限公司	注册地址：成都市东城根上街 95 号 办公地址：成都市东城根上街 95 号 法定代表人：冉云 联系人：刘婧漪、贾鹏 电话：028-86690057、02886690058 传真：028-86690126 客服电话：95310 公司网站：www.gjzq.com.cn
10	中信证券股份有限公司	注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 法定代表人：张佑君 联系人：王一通 电话：010-60838888 传真：010-60833739 客服电话：95548 网址：www.cs.ecitic.com

11	中信证券（山东）有限责任公司	注册（办公）地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001 法定代表人：姜晓林 联系人：刘晓明 联系电话：0531—89606165 传真：0532-85022605 客户服务电话：95548 网址：www.zxwt.com.cn
12	中信期货有限公司	注册（办公）地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层 法定代表人：张皓 联系人：洪诚 电话：0755-23953913 传真：0755-83217421 客户服务电话：400-990-8826 网址：www.citicsf.com
13	联储证券有限责任公司	注册地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧金地中心大厦 9 楼 办公地址：北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 27 层 法定代表人：吕春卫 联系人：丁倩云 电话：010-86499427 传真：010-86499401 客户服务电话：400-620-6868 网址：www.lczq.com
14	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
15	蚂蚁（杭州）基金销售有限公司	注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 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：祖国明 联系人：韩爱彬 客服电话：4000-766-123

		公司网址： www.fund123.cn
16	诺亚正行基金销售有限公司	<p>注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室</p> <p>办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路 32 号东码头园区 C 栋</p> <p>法定代表人：汪静波</p> <p>联系人：李娟</p> <p>电话：021-80358236</p> <p>传真：021-80358749</p> <p>客户服务电话：400-821-5399</p> <p>网址：www.noah-fund.com</p>
17	上海长量基金销售有限公司	<p>注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室</p> <p>办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层</p> <p>法定代表人：张跃伟</p> <p>联系人：单丙焱</p> <p>电话：021-20691832</p> <p>传真：021-20691861</p> <p>客服电话：400-820-2899</p> <p>公司网站：www.erichfund.com</p>
18	上海好买基金销售有限公司	<p>注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 4494</p> <p>办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 9 楼</p> <p>法定代表人：杨文斌</p> <p>联系人：张茹</p> <p>电话：021-58870011</p> <p>传真：021-68596916</p> <p>客户服务电话：400 700 9665</p> <p>网址：www.ehowbuy.com</p>
19	上海天天基金销售有限公司	<p>注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号东方财富大厦 2 楼</p> <p>办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座（北楼）25 层</p> <p>法定代表人：其实</p> <p>联系人：潘世友</p> <p>电话：021-54509977-8400</p> <p>传真：021-54509953</p> <p>客服电话：400-1818-188</p>

		网址: http://www.1234567.com.cn
20	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: www.5ifund.com
21	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: 戎兵 联系人: 魏晨 电话: 010-52858244 传真: 010-59644496 客户服务电话: 400-609-9200 网址: www.yixinfund.com
22	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/
23	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

		<p>客户服务电话：400-8980-618 网址：www.chtwm.com</p>
24	北京创金启富投资管理有限公司	<p>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：www.5irich.com</p>
25	上海利得基金销售有限公司	<p>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：www.leadfund.com.cn</p>
26	北京新浪仓石基金销售有限公司	<p>注册地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期（西扩）N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室 办公地址：北京市海淀区西北旺东路 10 号院东区 3 号楼为明大厦 C 座 法定代表人：赵芯蕊 联系人：赵芯蕊 电话：010-62675768 传真：010-62676582 客户服务电话：010-62675369 网址：www.xincai.com</p>
27	上海陆金所基金销售有限公司	<p>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</p>

		<p>客户服务电话：4008219031 网址：www.lufunds.com</p>
28	珠海盈米基金销售有限公司	<p>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：www.yingmi.cn</p>
29	奕丰基金销售有限公司	<p>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：TEO WEE HOWE 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</p>
30	深圳市金斧子基金销售有限公司	<p>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</p>
31	北京汇成基金销售有限公司	<p>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</p>

		公司网址: www.hcjijin.com
32	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.snjijin.com
33	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: https://www.wg.com.cn
34	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: www.fundhaiyin.com
35	深圳前海微众银行股份有限公司	注册地址: 深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 (入驻深圳市前海商务秘书有限公司) 办公地址: 广东省深圳市南山区沙河西路 1819 号深圳湾科技生态园 7 栋 A 座 法定代表人: 顾敏 联系人: 赵云 电话: 0755-84007736 传真: 0755-86700688 客户服务电话: 95384 网址: http://www.webank.com/

36	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
37	北京蛋卷基金销售有限公司	注册地址：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：侯芳芳 电话：010-61840688 传真：010-84997571 客服电话：400-159-9288 官网： https://danjuanapp.com
38	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
39	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： www.fengfd.com
40	北京肯特瑞基金销售有限公司	注册地址：注册地址：北京市海淀区显龙山路 19 号 1 幢 4 层 1 座 401 法定代表人：江卉 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

41	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
42	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：杨雅琴 联系人：李慧慧 电话：010-66162800 传真：0532-66728591 客户服务电话：4006706863 网址：www.hongtaiwealth.com
43	腾安基金销售（深圳）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：深圳市南山区海天二路 33 号腾讯滨海大厦 15 楼 法定代表人：刘明军 联系人：谭广锋 电话：95017 转 1 转 8 客户服务电话：95017 转 1 转 8 网址：www.tenganxinxi.com
44	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：www.baiyingfund.com

45	上海陆享基金销售有限公司	注册地址：上海市浦东新区南汇新城镇环湖西二路 888 号 1 幢 1 区 14032 室 办公地址：上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇广场 2 座 16 楼 法定代表人：陈志英 联系人：韦巍 电话：400-168-1235 传真：021-53398801 客户服务电话：400-168-1235 网址： http://www.luxxfund.com/
46	江苏汇林保大基金销售有限公司	注册地址：南京市高淳区经济开发区古檀大道 47 号 办公地址：南京市鼓楼区中山北路 2 号绿地紫峰大厦 2005 室 法定代表人：吴言林 联系人：林伊灵 电话：025-66046166 传真：025-56878016 客户服务电话：025-66046166 网址： http://www.huilinbd.com

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销售本基金，并及时履行公告义务。

（二）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

办公地址：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：0755-82370388-1646

传真：0755-22381325

联系人：邹昱

（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、陈颖华

联系人：陈颖华

（四）审计基金资产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

办公地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

执行事务合伙人：毛鞍宁

电话：(010) 58153000

传真：(010) 85188298

经办注册会计师：吴翠蓉、高鹤

联系人：吴翠蓉

四、基金的名称

景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金。

五、基金的类型

契约型开放式。

六、基金的投资目标

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。

七、基金的投资方向

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）、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）。

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。

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。

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

本基金采用被动式指数化投资方法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。

当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或者因法律法规限制时，或其他原因导致无法有效负责和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，对投资组合管理进行适当性变更和调整，力争降低跟踪误差。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

本基金管理人主要按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。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。

2、股票投资策略

(1) 股票投资组合构建

本基金原则上将采用完全复制法构建股票投资组合，以拟合、跟踪标的指数的收益表现。

(2) 股票投资组合调整

本基金所构建的股票投资组合原则上根据标的指数成份股组成及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规和基金合同中的投资比例限制、申购赎回变动情况、股票增发因素等变化，在考虑跟踪误差风险的基础上，对股票投资组合进行实时调整。基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使得本基金的股票投资组合比例符合《基金合同》

的约定。

1) 定期调整

根据标的指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。中证指数有限公司原则上每半年审核标的指数的成份股。本基金将按照标的指数对成份股及其权重的调整方案，对股票投资组合进行相应调整。

2) 不定期调整

① 当上市公司发生增发、配股等影响成份股在指数中权重的行为时，本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合；

② 根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数；

③ 根据法律、法规的规定，成份股在标的指数中的权重因其它原因发生相应变化的，本基金将做相应调整，以保持基金资产中该成份股的权重同指数一致。

3、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。

4、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。

5、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。

6、资产支持证券投资策略

本基金将通过分析宏观经济、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。

7、融资与转融通投资策略

本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上，审慎参与融资及转融通交易。本基金将基于对市场行情和组合风险收益的分析，确定投资时机、标的证券以及投资比例。若相关融资及转融通业务法律法规发生变化，本基金将从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。

九、基金的业绩比较基准

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

如果指数发布机构变更或者停止上述标的指数编制及发布，或者上述标的指数由其他指数代替，或由于指数编制方法等重大变更导致上述指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，通过适当的程序变更本基金的标的指数，并同时更换本基金的基金名称与业绩比较基准。其中，若变更标的指数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标的指数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。若变更标的指数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单位变更、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。

根据 2017 年 7 月 1 日施行的《证券期货投资者适当性管理办法》，基金管理人和销售机构已对本基金重新进行风险评级，风险评级行为不改变本基金的实质性风险收益特征，但由于风险等级分类标准的变化，本基金的风险等级表述可能有相应变化，具体风险评级结果应以基金管理人和销售机构提供的评级结果为准。

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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据基金合同规定，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。本投资组合报告所载数据截至 2019 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	1,480,330,739.80	93.41
	其中：股票	1,480,330,739.80	93.41
2	基金投资	-	-
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	99,353,517.61	6.27
8	其他资产	5,052,082.31	0.32
9	合计	1,584,736,339.72	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	12,066,957.00	0.76
B	采矿业	72,546,064.00	4.59
C	制造业	820,583,185.77	51.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	46,553,934.75	2.94
E	建筑业	41,611,672.80	2.63
F	批发和零售业	87,505,402.13	5.54
G	交通运输、仓储和邮政业	52,177,152.03	3.30
H	住宿和餐饮业	6,674,145.00	0.42
I	信息传输、软件和信息技术服务业	108,267,664.51	6.85
J	金融业	62,386,327.00	3.95
K	房地产业	71,233,627.91	4.51
L	租赁和商务服务业	26,022,302.40	1.65
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	9,621,018.60	0.61
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	15,654,537.00	0.99
R	文化、体育和娱乐业	44,588,687.12	2.82
S	综合	-	-
	合计	1,477,492,678.02	93.46

2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,614,932.38	0.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	223,129.40	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,838,061.78	0.18

2.3 报告期末按行业分类的港股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

3.1 报告期末指数投资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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600171	上海贝岭	1,900,536	28,698,093.60	1.82
2	600183	生益科技	840,500	20,962,070.00	1.33
3	300315	掌趣科技	3,639,700	17,252,178.00	1.09
4	600811	东方集团	4,632,030	15,656,261.40	0.99
5	300244	迪安诊断	638,700	15,654,537.00	0.99
6	600597	光明乳业	1,476,038	15,424,597.10	0.98
7	300088	长信科技	2,056,300	15,298,872.00	0.97
8	600545	卓郎智能	1,975,500	14,638,455.00	0.93
9	600909	华安证券	2,282,500	14,060,200.00	0.89
10	002439	启明星辰	439,000	14,039,220.00	0.89

3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688012	中微公司	23,850	1,288,615.50	0.08
2	688003	天准科技	25,775	819,902.75	0.05
3	688122	西部超导	15,715	453,377.75	0.03
4	688368	晶丰明源	2,557	144,930.76	0.01
5	603927	中科软	884	78,198.64	0.00

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1 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。

9.2 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。

10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 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。

10.2 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。

10.3 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。

11 投资组合报告附注

11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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。

11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

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。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	245,843.83
2	应收证券清算款	1,434,782.39
3	应收股利	-
4	应收利息	38,180.69
5	应收申购款	3,333,275.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,052,082.31

11.4 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。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688012	中微公司	1,288,615.50	0.08	新股锁定
2	688003	天准科技	819,902.75	0.05	新股锁定
3	688122	西部超导	453,377.75	0.03	新股锁定

4	688368	晶丰明源	144,930.76	0.01	新股流通受限
---	--------	------	------------	------	--------

11.6 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

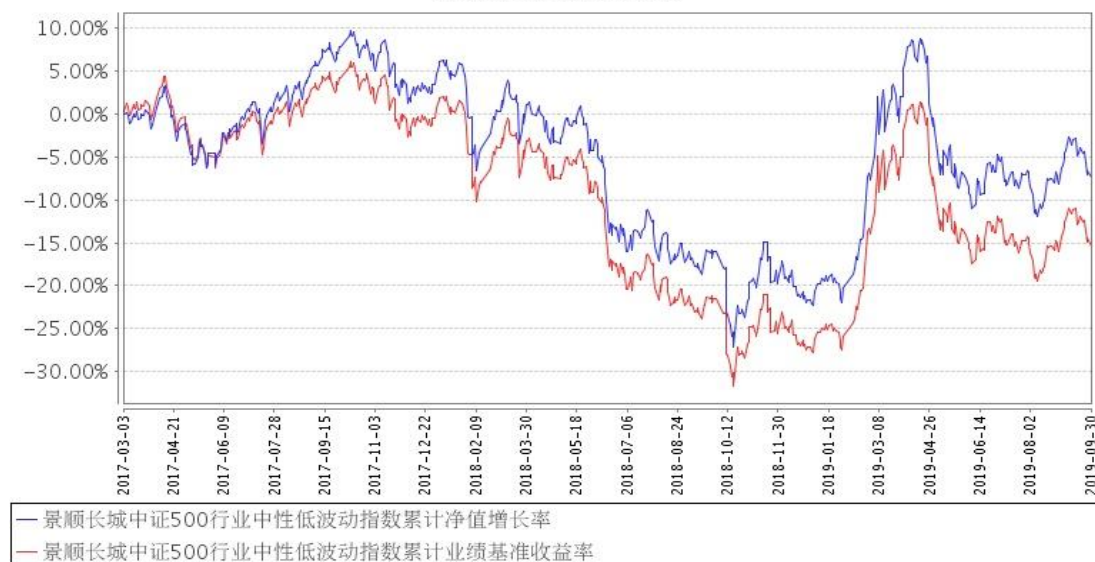
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。基金业绩数据截至 2019 年 9 月 30 日。

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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
2017 年 3 月 3 日 -2017 年 12 月 31 日	3.36%	0.84%	-0.46%	0.84%	3.82%	0.00%
2018 年	-24.13%	1.32%	-26.77%	1.28%	2.64%	0.04%
2019 年 1 月 1 日 -2019 年 6 月 30 日	18.80%	1.64%	18.33%	1.66%	0.47%	-0.02%
2019 年 1 月 1 日 -2019 年 9 月 30 日	17.99%	1.44%	16.17%	1.46%	1.82%	-0.02%
2017 年 3 月 3 日 -2019 年 9 月 30 日	-7.47%	1.23%	-15.32%	1.22%	7.85%	0.01%

2.自基金合同生效以来基金份额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

景顺长城中证500行业中性低波动指数累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的投资组合比例为：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。本基金的建仓期为自 2017 年 3 月 3 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、基金费用与税收

（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、仲裁费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券、期货交易或结算费用；

8、基金的银行汇划费用；

9、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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 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 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，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 3 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、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，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 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。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。标的指数许可使用费按前一日基金资产净值的 0.02% 年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的标的指数许可使用费

E 为前一日的基金资产净值

自《基金合同》生效之日起，标的指数许可使用费每日计算，逐日累计，按季支付，于每年 1 月、4 月、7 月、10 月的前十（10）个工作日内，按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。根据基金管理人与中证指数有限公司签署的指数使用协议的规定，标的指数的许可使用费的收取下限为每季度人民币 5 万元（大写：伍万元），但《基金合同》生效当季，标的指数许可使用费不设下限，根据实际比例天数计算。

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）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。

（四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明

- 1、在“第三部分、基金管理人”部分，更新了基金管理人高级管理人员、基金经理、投资决策委员会委员的相关信息；
- 2、在“第四部分、基金托管人”部分，更新了托管人相关情况信息；
- 3、在“第五部分、相关服务机构”部分，更新了基金份额发售机构、登记机构的相关信息；
- 4、在“第八部分 基金份额的申购、赎回、转换及其他登记业务”部分，更新了基金定期定额投资计划的相关信息；
- 5、在“第九部分、基金的投资”部分，更新了基金投资组合报告，数据截至 2019 年 9 月 30 日；
- 6、更新了“第十部分、基金的业绩”部分，数据截至 2019 年 9 月 30 日；
- 7、在“第二十二部分 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 2019 年 9 月 30 日。

景顺长城基金管理有限公司
二〇一九年十二月三十一日