

# 景顺长城量化港股通股票型证券投资基金

## 基金产品资料概要更新

编制日期：2020 年 10 月 25 日

送出日期：2020 年 11 月 4 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    | 景顺长城量化港股通股票     | 基金代码           | 006106          |
| 基金管理人   | 景顺长城基金管理有限公司    | 基金托管人          | 中国工商银行股份有限公司    |
| 基金合同生效日 | 2019 年 6 月 19 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 6 月 19 日 |
|         |                 | 证券从业日期         | 2003 年 9 月 15 日 |

### 二、基金投资与净值表现

#### （一）投资目标与投资策略

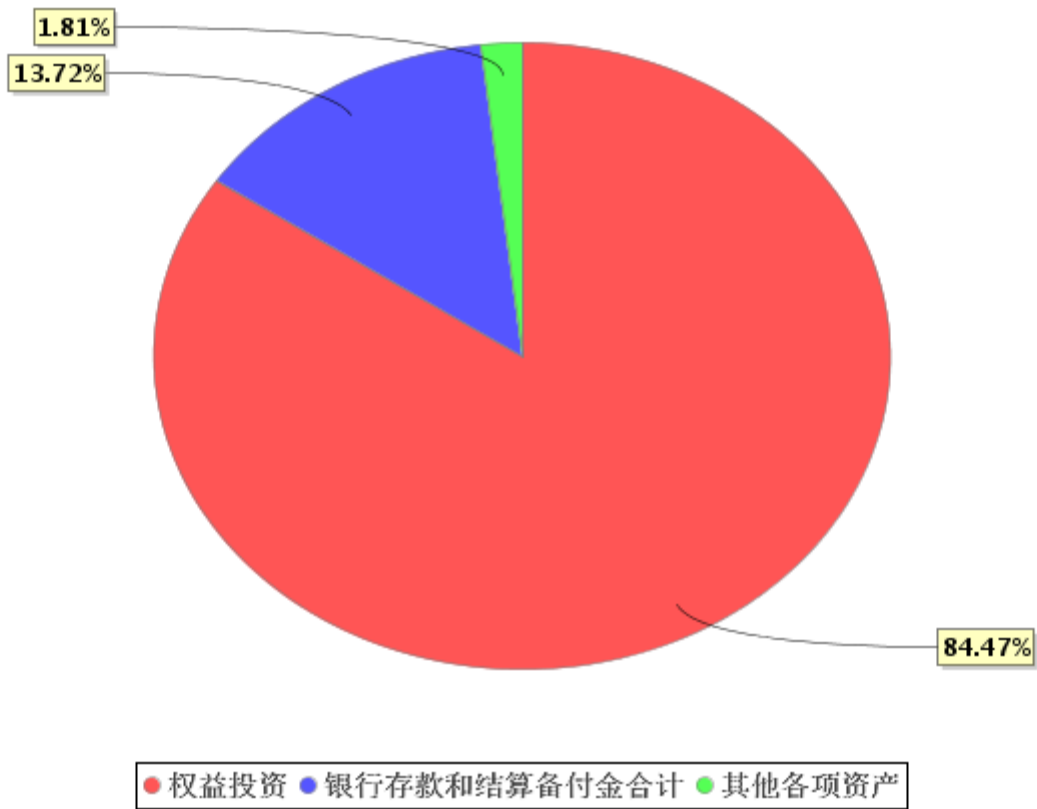
|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金主要通过量化模型精选股票，在严格控制风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 投资范围   | 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括境内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票及存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可交换公司债券、可转换公司债券（含可分离交易可转债）、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债等）、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规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>基金的投资组合比例为：本基金投资组合中投资于港股通标的股票的比例不低于基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；权证、股指期货、国债期货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。 |
| 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、股指期货、国债期货投资策略；5、中小企业私募债券的投资策略；6、资产支持证券的投资策略。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 业绩比较基准 | 中证港股通综合指数收益率*85%+银行活期存款利率(税后)*15%                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，属于证券投资基金中风险程度较高的投资品种，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金和混合型基金。本基金还可在法律法规规定的范围内投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内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。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当以基金管理人和销售机构提供的评级结果为准。 |
|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

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。

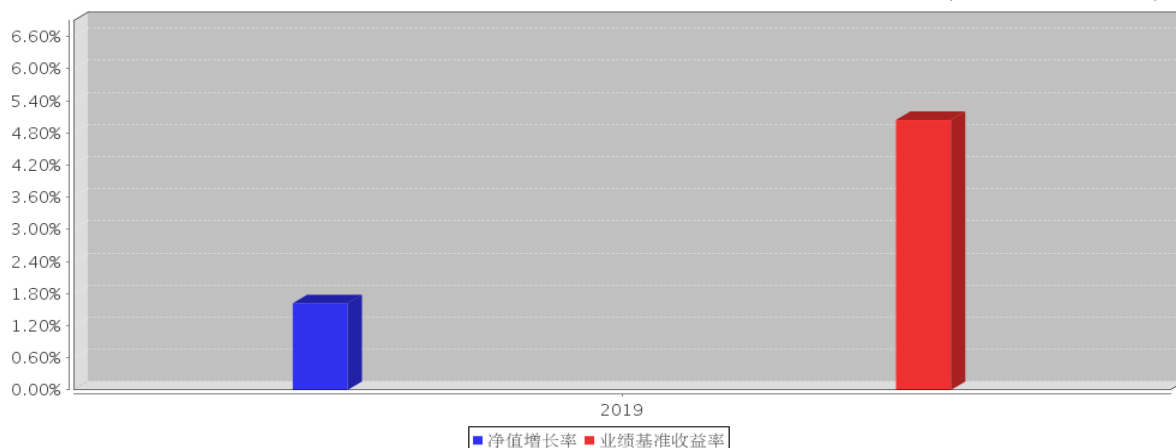
(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表(2020年6月30日)



(三) 自基金合同生效以来/最近十年（孰短）基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

景顺长城量化港股通股票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(2019年12月31日)



注: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:

| 费用类型         | 份额(S)或金额(M)<br>/持有期限(N)              | 收费方式/费率      |
|--------------|--------------------------------------|--------------|
| 认购费          | $M < 1,000,000.00$                   | 1.20%        |
|              | $1,000,000.00 \leq M < 2,000,000.00$ | 0.80%        |
|              | $2,000,000.00 \leq M < 5,000,000.00$ | 0.20%        |
|              | $5,000,000.00 \leq M$                | 1,000.00 元/笔 |
| 申购费<br>(前收费) | $M < 1,000,000.00$                   | 1.50%        |
|              | $1,000,000.00 \leq M < 2,000,000.00$ | 1.00%        |
|              | $2,000,000.00 \leq M < 5,000,000.00$ | 0.30%        |
|              | $5,000,000.00 \leq M$                | 1,000.00 元/笔 |
| 赎回费          | $N < 7$ 天                            | 1.50%        |
|              | $7 \text{ 天} \leq N < 30$ 天          | 0.75%        |
|              | $30 \text{ 天} \leq N < 1$ 年          | 0.50%        |
|              | $1 \text{ 年} \leq N < 2$ 年           | 0.25%        |
|              | $N \geq 2$ 年                         | 0.00%        |

注:就赎回费而言,1年指365日,2年指730日。

#### (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 |
|-------|----------|
| 管理费   | 1.50%    |
| 托管费   | 0.25%    |
| 销售服务费 | -        |

注: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。

### 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

基于投资范围的规定，本基金股票投资比例较高，无法规避股票市场的投资风险，尤其是系统性风险。

1、本基金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。基于模型结果，基金管理人结合市场环境和股票特性，精选个股产出投资组合，以追求超越业绩比较基准表现的业绩水平。本基金的量化投资主要依据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。

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。

3、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。

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

6、资产支持证券投资风险。包含信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、操作风险、法律风险等。

7、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。

8、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。

## 9、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交易风险。

10、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。

## 11、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。

## 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。

景顺长城量化港股通股票型证券投资基金经中国证监会 2018 年 6 月 8 日证监许可【2018】946 号文准予募集注册，经中国证监会证券基金机构监管部 2018 年 12 月 29 日机构部函【2018】3114 号文准予延期募集。

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。

因《基金合同》产生或与之相关的争议，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，对当事人均有约束力。

## 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.igwfm.com](http://www.igwfm.com)][客服电话：400-8888-606]

1、《景顺长城量化港股通股票型证券投资基金基金合同》、《景顺长城量化港股通股票型证券投资基金托管协议》、《景顺长城量化港股通股票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。