

景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

基金产品资料概要更新

编制日期：2024 年 8 月 21 日

送出日期：2024 年 8 月 22 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 增强策略 ETF	基金代码	159610
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	2021 年 12 月 13 日	上市交易所及上市日期	深圳证券交易所 2022 年 1 月 10 日
基金类型	股票型	交易币种	人民币
运作方式	开放式（其他开放式）	开放频率	每个开放日
基金经理	张晓南	开始担任本基金基金经理的日期	2024 年 5 月 30 日
		证券从业日期	2010 年 7 月 1 日
基金经理	郭琳	开始担任本基金基金经理的日期	2024 年 7 月 20 日
		证券从业日期	2014 年 3 月 19 日
其他	1、景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金场内简称：500ETF 增强 2、当本基金发生深圳证券交易所相关规定所规定的因不再具备上市条件而应当终止上市的情形时，本基金可由跟踪标的指数的增强策略交易型开放式指数证券投资基金变更为跟踪标的指数的非上市的开放式增强型指数基金，而无需召开基金份额持有人大会审议。届时，基金管理人需制定基金终止上市后场内份额的处理规则并提前公告。基金管理人需按照非上市的开放式增强型指数基金调整相应的业务规则（包括可变更本基金的登记机构并相应调整申购赎回业务规则等），基金变更的具体安排见基金管理人届时发布的相关公告。		

二、基金投资与净值表现

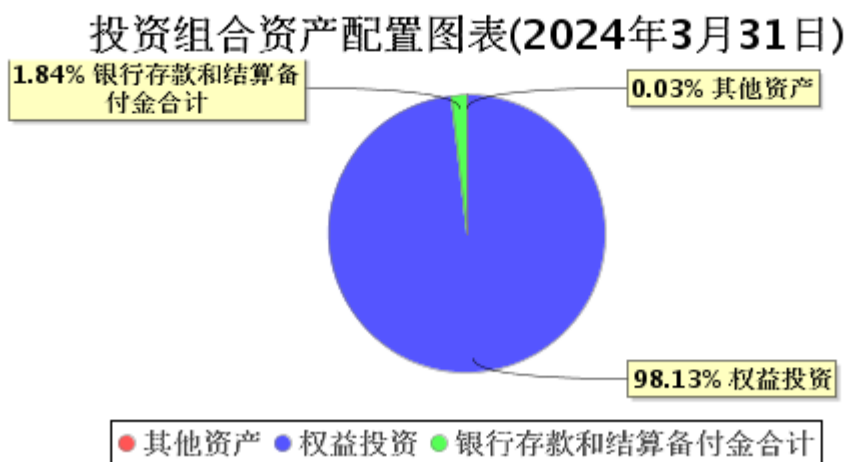
（一）投资目标与投资策略

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的基础上，通过主动化投资管理，力争获取超越指数表现的投资收益。
投资范围	本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证，下同），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份股（包含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票及存托凭证）、衍生工具（股指期货、股票期权等）、债券（包

	<p>括国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、公开发行的次级债、可交换债券、可转换债券、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券)、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)。</p> <p>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。</p> <p>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,并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。</p> <p>基金的投资组合比例为:基金所持有的股票资产占基金资产的比例不低于 80%,投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%,因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、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。</p> <p>本基金的标的指数:中证 500 指数。</p>
<p>主要投资策略</p>	<p>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,另一方面采用主动量化模型调整投资组合力求超越标的指数表现。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>中证 500 指数收益率</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>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。</p>

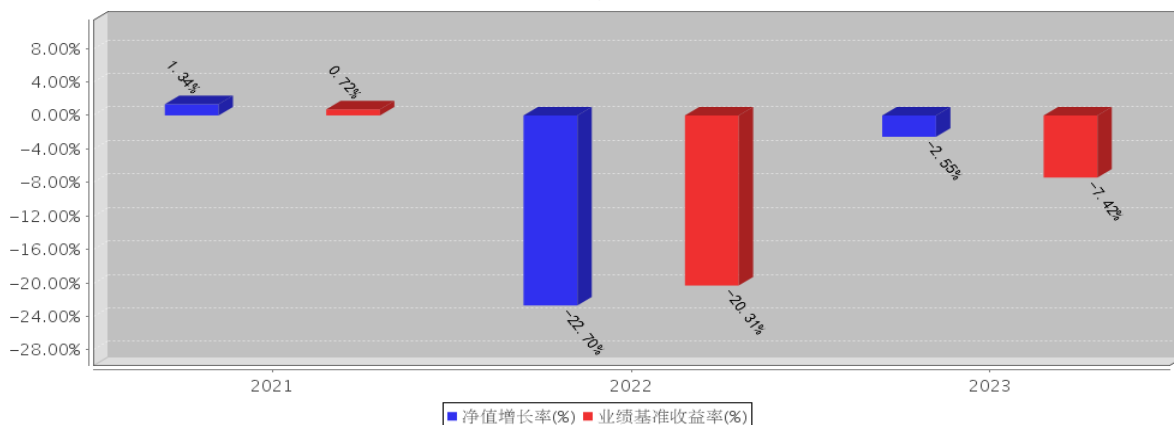
注:了解详细情况请阅读基金合同及招募说明书“基金的投资”部分。

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表



(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增强策略ETF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：

费用类型	份额 (S) 或金额 (M) /持有期限 (N)	收费方式/费率
认购费	0 份 < S < 500000 份	0.80%
	500000 份 ≤ S < 1000000 份	0.50%
	S ≥ 1000000 份	500 元/笔

申购费

1、投资人在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过申购或赎回份额 0.5% 的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记机构等收取的相关费用。

2、场内交易费用以证券公司实际收取为准。

(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	0.5%	基金管理人和销售机构
托管费	0.1%	基金托管人
审计费用	60,000.00 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：

基金运作综合费率（年化）
0.67%

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、本基金特有的风险：

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，另一方面采用主动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，基金所持有的股票资产占基金资产的比例不低于 80%，投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%，故无法完全规避股票市场的投资风险，尤其是系统性风险。

1、与指数化投资相关的特定风险

- （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。
- （2）标的指数波动的风险。
- （3）标的指数变更的风险。
- （4）跟踪误差控制未达约定目标的风险。
- （5）增强投资组合证券停牌的风险。

2、被抢先交易降低基金投资收益风险

3、指数编制机构停止服务风险

4、增强策略失效风险

5、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

6、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险

7、投资者申购失败的风险

8、投资者赎回失败的风险

9、基金份额赎回对价的变现风险

10、现金替代标志的风险

11、基金收益分配后基金份额净值低于面值的风险

12、退市风险

13、第三方机构服务的风险

14、衍生品投资风险

15、资产支持证券风险

16、基金参与融资与转融通证券出借业务的风险

17、存托凭证投资风险

18、可转换债券（可交换债券）投资风险

三、其他风险

1、市场风险； 2、流动性风险； 3、管理风险与操作风险； 4、技术风险； 5、政策变更风险； 6、投

合规风险；7、税负增加风险；8、不可抗力风险；9、招募说明书中指数编制方案简述未及时更新的风险；10、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；11、其他风险等。

（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 增强策略交易型开放式指数证券投资基金经中国证监会 2021 年 11 月 9 日证监许可【2021】3579 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

以下资料详见基金管理人网站[www.igwfm.com][客服电话：400-8888-606]

1、《景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金托管协议》、《景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数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。