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年第2号更新招募说明书摘要

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

重要提示

(一)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(以下简称"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》)、《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》)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称《信息披露办法》)、《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2012年1月21日证监许可[2012]103号文核准募集,本基金基金合同已于2012年6月25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核准,但中国证监会对本基金募集的核准,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。

(三)投资有风险,投资人认购、申购基金时应认真阅读本招募说明书。

(四)基金的过往业绩并不预示其未来表现。

(五)基金合同是约定基金当事人之间权利、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)本基金是上证180等权重ETF的联接基金,主要通过投资于上证180等权重ETF以求达到投资目标,两者的标的指数一致,投资目标相似。

两者在投资方法、交易方式、申购赎回方式等方面存在如下差异:

在投资方法方面,本基金属于契约型开放式证券投资基金,将不低于90%的基金资产投资于上证180等权重ETF,并且保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,以备支付基金份额持有人的赎回款项。本基金可以以成份股实物形式申购及赎回上证180等权重ETF基金份额,也可以在二级市场上买卖上证180等权重ETF基金份额;而上证180等权重ETF属于交易型开放式指数证券投资基金,将不低于95%的基金资产投资于指数成份股、备选成份股,投资策略主要采取完全复制法紧密跟踪标的指数,按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,进行被动式指数化投资。

在交易方式方面,投资者可以通过本基金的销售机构申购赎回本基金的基金份额;而上证180等权重ETF属于交易型开放式指数证券投资基金,投资者可以通过上证180等权重ETF的申购赎回代理券商申购赎回基金份额。此外,上证180等权重ETF符合上市条件申请上市成功后,投资者还可通过上海证券交易所的交易系统在二级市场买卖上证180等权重ETF的基金份额。

在申购赎回方式方面,本基金与其他契约型开放式证券投资基金一样,不安排上市交易,因此投资者只能用现金方式申购及赎回本基金,申购以金额申请,赎回以份额申请,申购与赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基础;而上证180等权重ETF属于交易型开放式证券投资基金,投资者申购赎回上证180等权重ETF基金份额均采用实物申购赎回方式,申购和赎回均以份额申请,申购、赎回对价根据申购赎回清单和投资者申购、赎回的基金份额数额确定。

由于本基金与上证180等权重ETF在投资范围、投资策略及申购赎回方式等方面均存在一定差别,因此不能保证本基金的表现与上证180等权重ETF的表现完全一致,两者的业绩表现可能会出现一定的差异。产生业绩表现差异的原因包括以下几个方面:

①本基金基金份额的赎回采用现金方式,为支付现金赎回款,相比上证180等权重ETF,本基金需要保留更多的现金资产;

②本基金基金份额的申购采用现金方式,在利用到账的申购资金投资上证180等权重ETF过程中,市场波动等原因会造成本基金与上证180等权重ETF表现的差异;

③本基金为应对投资者以现金方式申购赎回本基金基金份额而进行的证券交易需支付一定的手续费,此等费用将影响本基金相对于上证180等权重ETF的表现。

(八)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,投资者根据所持有的基金份额享受基金收益,同时承担相应的投资风险。投资者在投资本基金前,请认真阅读本招募说明书,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,对认购和/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但不限于: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。本基金为ETF联接基金,其风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合基金。本基金在股票基金中属于指数基金,紧密跟踪标的指数,属于股票基金中风险较高、收益与标的指数所代表的股票市场水平大致相近的产品。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。

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。

(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2014年6月25日,有关财务数据和净值表现截止日为2014年3月30日。本招募说明书中财务数据未经审计。

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号嘉里建设广场第一座21层

法定代表人:赵如冰

批准设立文号:证监基金字[2003]76号

设立日期:2003年6月12日

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

电　话:0755-82370388

客户服务电话:4008888606

传　真:0755-22381339

联系人:杨绰昭

(二)基金管理人基本情况

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司(以下简称"公司"或"本公司")是经中国证监会证监基金字[2003]76号文批准设立的证券投资基金管理公司,由长城证券有限责任公司、景顺资产管理有限公司、开滦(集团)有限责任公司、大连实德集团有限公司共同发起设立,并于2003年6月9日获得开业批文,注册资本1.3亿元人民币,目前各家出资比例分别为49%、49%、1%。

公司设立了两个专门机构:风险管理委员会和投资决策委员会。风险管理委员会负责公司整体运营风险的控制。投资决策委员会负责指导基金财产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。

公司设置如下部门:股票投资部、固定收益部、国际投资部、量化及ETF投资部、专户投资部、研究部、渠道销售部、机构客户部、ETF销售部、市场服务部、产品开发部、交易管理部、基金事务部、信息技术部、人力资源部、财务行政部、法律监察稽核部、总经理办公室。各部门的职责如下:

1、股票投资部:负责根据投资决策委员会制定的投资原则进行国内股票选择和组合的投资管理。

2、固定收益部:负责根据投资决策委员会制定的投资原则进行国内债券选择和组合的投资管理并完成固定收益的研究。

3、国际投资部:主要负责QDII等国际业务相关的投资管理、国际合作和跟训等业务。

4、量化及ETF投资部:负责根据投资决策委员会制定的投资原则,以严谨的量化投资流程为依托,负责各类主动和被动量化产品的投资管理。

5、专户投资部:负责完成一对一、一对多等特定客户资产管理产品的投资管理。

6、研究部:负责对宏观经济、行业公司及市场的研究。

7、渠道销售部:负责公司产品在各银行、券商等渠道的销售。

8、机构客户部:负责开发机构客户,并使其认识并了解我公司在企业年金、社保等方面所提供的基金产品及服务。

9、ETF销售部:负责公司ETF类产品的销售及服务。

10、市场服务部:负责公司市场营销策略、计划制定及推广,电子商务和客户服务管理等工作。

11、产品开发部:负责基金产品及其他投资产品的设计、开发、报批等工作。

12、基金事务部:负责公司产品的注册登记、清算和估值核算等工作。

13、信息技术部:负责公司的计算机设备维护、系统开发及网络运行和维护。

14、交易管理部:负责完成投资部下达的交易指令,并进行事前的风险控制。

15、人力资源部:负责公司各项人力资源管理工作,包括招聘、薪资福利、绩效管理、培训、员工关系、从业资格管理、高管及基金经理资格管理等。

16、财务行政部:负责公司财务管理及日常行政事务管理。

17、法律监察稽核部:负责对公司管理和基金运作合规性进行全方位的监察稽核,并向公司管理层和监管机关提供独立、客观、公正的法律监察稽核报告。

18、总经理办公室:主要受总经理委托,协调各部门的工作,并负责公司日常办公秩序监督、工作项目管理跟进等,并负责基金风险的评估、控制及管理。

公司已经建立了健全的内部风险控制制度、内部稽核制度、财务管理制度、人事管理制度、信息披露制度和员工行为准则等公司管理制度体系。

(三)主要人员情况

1、基金管理人董事会成员

赵如冰先生,董事长、经济学硕士。曾任葛洲坝水力发电厂主任、研究员级高级工程师、葛洲坝至上海超高压直流输电葛洲坝站站长、书记、葛洲坝水力发电厂办公室主任兼外办主任、华能南方开发公司党组书记、总经理、华能房地产开发公司党组书记、总经理、中住地产开发公司总经理、党组书记、长城证券有限责任公司董事、副董事长、党委副书记等职。2009年加入本公司,现任公司董事长。

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2011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。

黄海洲先生,董事,工商管理硕士。1992年9月起,历任招商银行股份有限公司深圳蛇口支行会计、工程管理部员工、人力资源部部干部,新汇闽投资公司副总经理。2005年5月起担任长城证券副总经理,现任长城证券副总经理、党委委员。

许文明先生,董事,总经理,金融工程学硕士。曾先后就职于前美国大通银行香港、台湾及伦敦分行财资部,汇丰银行中国区财资部;也曾担任台湾景顺证券投资信托股份有限公司董事兼总经理、香港景顺资产管理有限公司大中华区业务拓展总监等职务。2009年加入本公司,现任公司董事兼总经理。

伍润明先生,独立董事,文学学士(1972年毕业)。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"伍润明会计师行"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。

李晓西先生,独立董事。曾任国务院研究室宏观经济研究司司长。现任北京师范大学校学术委员会副主任,教授,博士生导师;中国社会科学院研究生院教授、博士生导师;教育部社会科学委员会经济学部召集人。

2、基金管理人监事会成员

王天广先生,监事,金融学学士,注册会计师,律师。1996年7月至1997年8月分别在万科财务顾问公司、中国证监会上市公司监管部工作;1998年起历任中国证监会深圳监管局任副处长、中国银河证券股份有限公司深圳投行部总经理、西南证券股份有限公司总裁助理兼投行总部总经理等职务。2012年2月进入长城证券担任公司副总经理兼投资银行事业部总经理,现任长城证券副总经理,党委委员。

郭慧娟女士,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、业务发展部副总经理、企业发展部总经理、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。

邵筱婕女士,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。

3、高级管理人员

赵如冰先生,董事长,简历同上。

许文明先生,总经理,简历同上。

周伟达先生,副总经理,工商管理硕士。曾担任联博香港有限公司分析员、中国研究总监兼上海代表处首席代表、亚洲(除日本外)增长型股票投资负责人、高级副总裁,友邦保险有限公司上海分公司资产管理中心副总裁。2014年加入本公司,现任公司副总经理。

王鹏辉先生,副总经理,经济学硕士。曾先后担任深圳市农村商业银行资金部债券交易员、长城证券研究部研究员,融通基金研究策划部行业研究员。2007年加入本公司,现任公司副总经理。

Xie Sheng(谢生)先生,副总经理,工商管理硕士。曾担任加拿大丰业银行商业信贷经理,加拿大道明资产管理公司亚洲市场部总经理,富实基金渠道总监,湘财荷银基金首席市场官,富国基金总经理助理,民生证券副总裁、执行委员会委员兼资产管理事业部总裁职务。2013年加入本公司,现任公司副总经理。

吴建军先生,副总经理,经济学硕士。曾任海南汇通国际信托投资公司证券部副经理,长城证券有限责任公司机构管理部总经理、公司总裁助理。2003年加入本公司,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。历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年加入本公司,曾担任公司督察长,现任公司副总经理。

黄卫明先生,督察长,法学硕士。历任国家工商局市场司主任科员,国泰君安证券公司总裁助理兼人力资源部总经理,中国证监会期货部、非上市公众公司部等主任科员、副处长、处长。2010年加入本公司,现任公司督察长。

4、本基金基金经理简历

本公司采用团队投资方式,即通过整个投资部门全体人员的共同努力,争取良好投资业绩。本基金聘任基金经理如下:

徐瑜军先生,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专员职务;自2014年4月起担任基金经理。具有4年证券、基金行业从业经验。

5、本基金现任基金经理管理的基金名称及管理时间

无。

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瑜军先生目前兼任上证180等权重交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城沪深300等权重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

基金经理姓名	管理时间
江科宏	2012年6月25日-2014年4月18日
徐瑜军	2014年4月19日-至今

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:

许文明先生,总经理;

周伟达先生,副总经理;

王鹏辉先生,副总经理;

RU PING(茹平)先生,固定收益部投资总监兼国际投资部投资总监;

黎海威先生,量化及ETF投资部投资总监;

陈辉先生,专户投资部投资总监;

唐威德先生,研究部研究总监;

余广先生,股票投资部投资副总监兼基金经理;

陈嘉平先生,股票投资部基金经理。

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:人民币贰仟柒佰玖拾叁亿陆仟肆佰陆拾万陆仟叁佰叁拾元整

法定代表人:田国立

基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字[1998]24号

托管业务部总经理:李爱华

托管部门信息披露联系人:王永民

客服电话:95566

传真:010-66594942

(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、境外三类机构银行间债券、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、产品丰富的托管产品体系。在国内,中国银行是首家开展绩效评估、风险管理等增值服务,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2014年6月30日,中国银行已托管276只证券投资基金,其中境内基金251只,QDII基金25只,覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金,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,包括风险识别、风险评估、工作程序设计与制度建设、风险检视、工作程序与制度的执行、工作程序与制度执行情况的内部监督、稽核以及风险控制工作的后评价。

2007年起,中国银行连续聘请外部会计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。2013年,中国银行同时获得了基于"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《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》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,立即通知基金管理人,并及时向国务院证券监督管理机构报告。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,应当立即通知基金管理人,并及时向国务院证券监督管理机构报告。

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号嘉里建设广场第一座21层

法定代表人:赵如冰

批准设立文号:证监基金字[2003]76号

电　话:0755-82370388-1661

传　真:0755-22381325

联系人:严丽娟

2、代销机构:

①中国农业银行股份有限公司

注册地址:北京市东城区建国门内大街69号

办公地址:北京西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9

法定代表人:蒋超良

联系人:刘一宁

电话:010-85108227

传真:010-85109219

客户服务电话:95599

网址:www.abchina.com

②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:田国立

联系人:宋亚平

客户服务电话:95566(免国)

网址:www.boc.cn

③中国工商银行股份有限公司

注册(办公)地址:北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人:姜建清

客户服务电话:95588(免国)

网址:www.icbc.com.cn

④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:牛锦明

联系人:曹榕

电话:021-58781234

传真:021-58408483

客户服务电话:95559

网址:www.bankcomm.com

⑤招商银行股份有限公司

注册(办公)地址:深圳市福田区深南大道7088号

法定代表人:傅育宁

联系人:邓炳鹏

客户服务电话:95555

网址:www.cmbchina.com

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:董文标

联系人:董云巍

联系电话:010-58560666

传真:010-57092611

客户服务热线:95568

网址:www.cmbc.com.cn

⑦渤海银行股份有限公司

注册(办公)地址:天津市河西区马场道201-205号

法定代表人:刘宝凤

联系人:王宏

联系电话:022-58316666

传真:022-58316259

客户服务热线:400-888-8811

网址:www.cbhb.com.cn

⑧温州银行股份有限公司

注册(办公)地址:温州市车站大道华海广场1号楼

法定代表人:夏瑞洲

客户服务电话:0577-96699

网址:www.wzbank.cn

⑨浙商银行股份有限公司

注册(办公)地址:中国杭州市庆春路288号

法定代表人:张达洋

电话:0571-87659546

传真:0571-87659188

联系人:毛真海

客户服务热线:95527

银行网址:www.czbank.com

⑩中国邮政储蓄银行股份有限公司

注册(办公)地址:北京市西城区金融大街3号

法定代表人:李国华

联系人:陈春林

传真:010-68858117

客户服务电话:95580

银行网址:www.psbc.com

⑪业华银行股份有限公司

注册(办公)地址:浙江省金华市光南路668号(邮编:321015)

法定代表人:徐雅清

联系人:徐晓峰

电话:0579-83207775

传真:0579-82178321

客户服务电话:400-711-6668

银行网址:www.jhccb.com.cn

⑫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:刘芳

电话:0472-5189051

传真:0472-5189057

客服电话:内蒙古、北京地区:96016

宁波、深圳地区:967210

成都地区:028-65558555

网站:www.bsb.com.cn

⑬玉溪证券股份有限公司

注册地址:江苏省常州延陵西路23号投资广场18层

办公地址:上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦

法定代表人:刘化军

电话:021-20333333

传真:021-50498825

联系人:王一彦

客服电话:95531;400-8888-588

网址:www.longone.com.cn

⑭东州数米基金销售有限公司

注册地址:杭州市余杭区仓前街道南湖路东2号

办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼

法定代表人:陈柏青

联系人:周臻莹

电话:0571-28829790,021-60897869

传真:0571-26698533

客户服务电话:4000-766-123

网址:www.fund123.cn

⑮诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司

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

⑯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:上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层

法定代表人:张跃伟

联系人:薛沙

电话:021-58788678-8201

传真:021-58787698

客服电话:400-089-1289

公司网站:www.erichfund.com

⑰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:400700 9665

网址:www.ehowbuy.com

⑱天宗展恒基金销售有限公司

注册地址:北京市顺义区后沙峪镇安富街6号

办公地址:北京市朝阳区德胜门外华严北里2号民建大厦6层

法定代表人:闫振杰

联系人:宋丽冉

电话:010-62020088

传真:010-62020355

客户服务电话:400-888-6661

网址:www.myfund.com

⑲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

北京市朝外大街22号泛利大厦10层

法定代表人:王利

联系人:刁甜

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:licaike.hexun.com

⑳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:上海市徐汇区龙田路195号3C座10楼

法定代表人:其实

联系人:潘世友

电话:021-54509998

传真:021-64385308

客户服务电话:400-1818-188

网址:http://www.1234567.com.cn

㉑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　0571-88920897

网址:www.5ifund.com

㉒万银财富(北京)基金销售有限公司

注册(办公)地址:北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观3201

法定代表人:李招弟

联系人:高晓芳

电话:010-59393923

传真:010-59393074

客户服务电话:400-808-0069

网址:www.wy-fund.com

㉓宜信普泽投资顾问(北京)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:程刚

电话:010-85892781

传真:010-57951601

客户服务电话:400-609-9500

网址:www.yixinfund.com

㉔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

㉕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15楼

法定代表人:林松

联系人:袁艳艳

电话:0592-3122703

传真:0592-8060771

客户服务电话:400-6980-777

网址:www.dkhs.com.cn

㉖北京晟视天下投资管理有限公司

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

㉗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

㉘深圳市前海三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:北京市西城区金融大街35号　国际企业大厦C座9层

法定代表人:陈操

联系人:刘宝文

电话:010-58325395

传真:010-58325282

客户服务电话:400-850-7771

网址:https://h.jrj.com

㉙卜一路财富(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

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:赵如冰

电　话:0755-82370388-1668

传　真:0755-22381325

联系人:杨波

(三)律师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:吕红、安冬

联系人:安冬

(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:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

法人代表:杨绍信

电话:021-23238888

传真:021-23238800

经办会计师:单峰、陈熹

四、基金的名称

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。

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、标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象,其中投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%;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%;同时为更好地实现投资目标,本基金也可少量投资于新股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但能符合中国证监会的相关规定,该部分资产比例不高于基金资产净值的5%。

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。

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,本管理人会在10个交易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。

本基金对标的指数的跟踪目标是:在正常情况下,本基金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,达到跟踪指数的目标。因此,本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%;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%;中国证监会允许的其他金融工具的投资比例不高于基金资产净值的5%。

2、基金投资策略

本基金对基金的投资仅限于目标ETF,现时目标ETF是上证180等权重交易型开放式指数证券投资基金。

①股票组合的构建

基金合同生效后,在建仓期内本基金将按照标的指数成份股的基准权重构建股票组合,在目标ETF开放申购赎回后将股票组合换购成目标ETF,使本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%。

②目标ETF的投资方式

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,决定目标ETF的投资方式。通常情况下,本基金以申购和赎回为主;当收到净申购时,本基金构建股票组合、申购目标ETF;当收到净赎回时,本基金赎回目标ETF、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买物申购目标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股票组合的调整

本基金将根据申购和赎回情况,结合基金的现金头寸管理,对基金投资组合进行调整,从而有效跟踪标的指数。

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。针对我国证券市场新股发行制度的特点,本基金将参可与一级市场新股认购。

4、债券投资策略

本基金基于流动性管理及策略性投资的需要,将投资于国债、金融债等期限在一年期以内的债券,债券投资的目的是保证基金资产流动性,有效利用基金资产,提高基金资产的投资收益。

5、权证投资策略

本基金具备权证投资的条件。本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究,结合期权定价模型和我国证券市场的交易制度估计权证价值,主要考虑运用的策略包括:杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、实空有保护的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。

九、基金的业绩比较基准

业绩比较基准=上证180等权重指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%

如果指数编制单位变更或终止标的指数的编制、发布或授权,或标的指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事件导致本基金管理人认为标的指数不宜继续作为跟踪标的、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投资者合法权益的原则,在履行适当程序后变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称。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ETF联接基金,其风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合基金。本基金在股票基金中属于指数基金,紧密跟踪标的指数,属于股票基金中风险较高、收益与标的指数所代表的股票市场水平大致相近的产品。

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2014年3月31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	19,131,000.00	90.06
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	1,616,887.69	7.61
8	其他资产	495,202.57	2.33
9	合计	21,243,090.26	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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。

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	上证180等权重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	19,131,000.00	92.79

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

根据本金基金合同约定,本基金投资范围不包括股指期货。

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	2,510.94
2	应收证券清算款	1,131.20
3	应收股利	-
4	应收利息	449.20
5	应收申购款	486,950.61