

景顺长城量化精选股票型证券投资基金2016年第1号更新招募说明书摘要

重要提示

(一) 景顺长城量化精选股票型证券投资基金(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》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”),《景顺长城量化精选股票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2014年12月15日证监许可[2014]1366号文准予募集注册,本基金基金合同于2015年2月4日正式生效。

(二) 基金管理人依据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。中国证监会不对本基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者认证。

(三) 投资有风险,投资人认购(或申购)本基金时应认真阅读本招募说明书。

(四) 基金管理人提示投资人购买基金的风险。

(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,自主判断基金的投资价值,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、数量及申购行为作出独立决策,获得基金投资收益,亦自行承担基金投资中出现的各项风险。投资基金可能遇到的风险包括:股市整体环境引发的系统性风险,个别股票特有的非系统性风险,大盘暴跌或单暴跌导致的流动性风险,基金投资对象与投资策略引致的有关风险等。本基金是股票型基金,属于高风险收益的理财产品,其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金、混合型基金。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和风险特征。中小企业私募债券的信用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有限的限制,存在变现困难或无法在适当时期变现引起损失的可能性。基金管理人提醒投资人投资基金的“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起的政策风险,由投资人自行负责。

(八) 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2016年2月4日,有关财务数据和净值表现截止日为2015年12月31日。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:中国建设银行股份有限公司
一、基金管理人概况
(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:赵如冰
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:0755-22881339
联系人:杨柳阳
(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,由长城证券股份有限公司、景顺资产管理有限公司、开泰(集团)有限公司组成,大成实德集团有限公司共同发起设立,并于2003年9月获证监开业批文,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,确定基金的投资策略和投资组合的原则。

公司设置如下部门:股权投资部、固定收益部、国际投资部、量化及ETF投资部、专户投资部、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、基金事业部、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. 股权投资部: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:主要负责与QDII、QFII等国际业务相关的投资管理、国际合作和培训等。

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:负责公司产品在机构客户等渠道的销售。

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. 基金事业部: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:负责对公司管理及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。曾任葛洲坝火力发电厂主任、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,葛洲坝火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,长城证券股份有限公司董事、副董事长、党委副书记等。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总裁、Capital House亚洲分公司的董事总经理。

1992年至1996年间担任香港投资基金管理委员会成员,并于1996年至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。

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、人力资源部干部,新江南投资公司副总经理。2005年6月起担任长城证券副总裁,现任长城证券副总经理、党委委员。

许义明先生,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,现任公司董事总经理。

伍同明先生,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“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,在香港马士打律师事务所、英国律师事务所Clyde & Co.从事律师工作,1993年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。

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5月分别在万科物业顾问公司、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副处长,中国银河证券股份有限公司深圳投行部总经理,西藏证券股份有限公司总裁助理兼投行部总经理等职务。

2012年2月进入长城证券担任公司副总经理兼投资银行业务部总经

理。同年12月被聘为公司监事长。

郭慧娜女士,监事,管理学硕士。曾任伦敦安永安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划部。现任景顺长城基金管理有限公司最佳托管银行。

3、基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金管理业务的商业银行,中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念,不断加强风险管理及内部控制,严格执行托管人的各项职责,切实维护资产持有人的合法权益,为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展,中国建设银行托管资产规模不断扩大,托管业务品种不断增加,已形成包括证券投资基金管理、社保基金、企业年金、基本养老金账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系,是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2015年末,中国建设银行已托管556只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力及服务水平,赢得了业内高度认同。中国建设银行自2009年至今连续五年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”。

(二) 基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

作为基金托管人,中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律

法规、行业监管规章和本行内有关风险管理规定,守法经营、规范运作、严格监

察,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的

真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会,负责健全风险管理与内

部控制工作,对托管业务风险管理进行检查指导。投资托管业务部专门

设置了监督稽核处,配备了专职内控监督员负责监督托管业务的内控

监督工作,具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

3、内部控制制度及措施

投资托管业务部具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、

控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺

利进行;业务人员具备从业资格;业务管理严格实行复核、审核、检查制

度,授权工作实行集中控制,印章使用按规程保管、存放、使用,账户资料

严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音

像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操

作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

(三) 基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

1、监管方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定,监督所托管基金

的投资运作。利用自行开发的“托管业务综合系统—基金监督子系

统”,严格执行法律法规以及基金合同规定,对基金管理人运作基金的

投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督,并定期编写基金投

资运作监督报告,报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基

金清算和核算服务环节中,对基金管理人发送的投资指令,基金管理人对

各基金费用的收取与开支情况进行监督检查。

2、监督流程

(1) 每个工作日按时通过基金监督子系统,对各基金投资运作比例控

制指标进行例行监控,发现投资比例超标等异常情况,向基金管理人发

出书面通知,与基金管理人进行情况核实,督促其纠正,并及时报告中国

证监会。

(2) 收到基金管理人的划款指令后,对涉及各基金的投资范围、投

资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

(3) 根据基金投资运作监督情况,定期编写基金投资运作监督报

告,对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面

进行评价,报送中国证监会。

(4) 通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易,电话或书面求

基金管理人进行解释或举证,并及时报告中国证监会。

3、相关服务机构

(一) 基金份额发售机构

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

设立日期:2003年6月12日

法定代表人:赵如冰

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:0755-22881339

联系人:杨柳阳

(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,由长城证券股份有限公司、景顺资产管理有限公司、开泰(集团)有限公司组成,大成实德集团有限公司共同发起设立,并于2003年9月获证监开业批文,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,确定基金的投资策略和投资组合的原则。

公司设置如下部门:股权投资部、固定收益部、国际投资部、量化及ETF投资部、专户投资部、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、基金事业部、公司总裁办、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. 股权投资部: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完成固定收益的研究。

3. 国际投资部:主要负责与QDII、QFII等国际业务相关的投资管理、国际合作和培训等。

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。

<p