

长城国证自由现金流指数型证券投资基金基金份额发售公告

基金管理人: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

二〇二五年七月

重要提示

1、本基金经中国证券监督管理委员会2025年4月7日证监许可[2025]715号文注册公开募集。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。

2、本基金的管理人为长城基金管理有限公司(以下简称“长城基金”或“本公司”或“本基金管理人”),托管人为中国建设银行股份有限公司,基金登记机构为长城基金管理有限公司。

3、本基金自2025年7月14日至2025年8月1日,通过长城基金直销中心和电子交易平台,以及各代销机构的营业网点公开发售。

4、本基金发售对象为符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

5、投资者欲认购本基金,需开立本公司基金账户,已经在本公司开立基金账户的投资者可免于办理开户手续。除法律法规另有规定外,每个投资者仅限开立和使用一个本公司基金账户。在基金募集期间,投资者的开户和认购申请可同时办理。

6、投资者首次认购本基金最低金额为1元,追加认购最低金额为1元。投资者在募集期内可多次认购基金份额,但已受理的认购申请不允许撤销。

7、本基金首次募集规模上限为80亿元人民币(不包括募集期限),基金首次募集规模不得超过募集规模上限,若募集期投资者的认购金额超过募集规模上限,基金管理人将采取末日比例确认的方式对募集规模进行控制,具体办法见本公告“二、(四)募集期销售规模控制”。

8、基金销售网点对申请的受理并不表示对该申请的成功确认,而仅代表该基金销售网点确实接受了认购申请,申请的成功确认应以基金登记机构的确认结果为准。

9、本公司仅对本基金首次募集的有关事项和规定予以说明,投资者欲了解本基金的详细情况,请详细阅读登载在本公司网站(www.ccifund.com.cn)和中国证监会基金电子披露网站(<http://eid.csirc.gov.cn/fund/>)上的《长城国证自由现金流指数型证券投资基金基金合同》《长城国证自由现金流指数型证券投资基金招募说明书》等信息披露文件。

10、本基金通过各销售机构的营业网点为投资者办理基金认购等业务。各销售机构的业务办理网点、办理日期和时间等事项请参照各销售机构的具体规定。本基金销售机构的具体名单详见基金管理人网站公示并不时更新的销售机构名录。

11、本基金募集期间部分销售机构周六、周日仍然受理认购业务,所受理的认购委托与下一交易日合并办理,具体情况可咨询相关销售机构。

12、基金管理人可综合各种情况对发售安排做适当调整。

13、风险提示:本基金为股票型基金,预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数相似的风险收益特征,投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份股停牌或退市等潜在风险,详见本基金招募说明书“风险揭示”章节。本基金投资于证券、期货市场,基金净值会因为证券、期货市场波动等因素产生波动,投资人在投资本基金前,请仔细阅读本基金的招募说明书、基金合同和基金产品资料概要等信息披露文件,全面了解本基金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,谨慎做出投资决策。投资基金可能遇到的风险包括:因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场价格产生影响而形成系统性风险,投资对象或对双方违约引发的信用风险,投资对象流动性不足产生的流动性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的管理风险,本基金的特定风险等。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在做出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行承担。

本基金可投资于存托凭证,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联的风险。

本基金可投资股指期货,期货采用保证金交易制度,由于保证金交易具有杠杆性,当出现不利行情时,相关行情微小的变动就可能会使投资人权益遭受较大损失。期货采用每日无负债结算制度,如果没有在规定的时间内补足保证金,按规定将被强制平仓,可能给投资者带来重大损失。

本基金可投资于资产支持证券,因此除了面临债券所需要面对的信用风险、市场风险和流动性风险外,还面临资产支持证券的特有风险:提前赎回或延期支付风险,可能造成基金财产损失。

本基金的标的指数为国证自由现金流指数。

1.选择空间

满足下列条件的A股和红筹企业发行的存托凭证:

(1)非ST、*ST证券;
(2)科创板证券、北交所证券上市时间超过1年,其他证券上市时间超过6个月;

(3)公司最近一年无重大违规、财务报告无重大问题;

(4)公司最近一年经营无异常、无重大亏损;

(5)考察期内证券价格无异常波动。

2.选择方法

首先,剔除最近半年日均成交金额排名后20%的证券,剔除国证行业分类标准下属于金融或房地产行业的证券,剔除近12个季度ROE稳定性排名后10%的证券;

然后,选取近一年自由现金流、企业价值和近三年经营活动现金流量均为正的证券,并剔除近一年经营活动现金流占营业收入比例排名后30%的证券;

最后,对剩余证券按照近一年自由现金流率从高到低排序,选取前100只证券构成指数样本。其中,自由现金流率=自由现金流/企业价值。

有关标的指数具体编制方案及成份股信息详见深圳证券信息有限公司指数网站,网址:www.cindex.com.cn。

本基金单一投资者持有基金份额不得达到或超过基金份额总数的50%,但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。

当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时,基金管理人履行相应程序后,可以启动侧袋机制,具体详见基金合同和招募说明书“侧袋机制”部分等有关章节。侧袋机制实施期间,基金管理人将对基金简称进行特殊标识,并不办理侧袋账户的申购赎回。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的风险。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。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。

一、本次发售基本情况

(一)基金名称和基金代码
基金名称:长城国证自由现金流指数型证券投资基金

基金代码:024078(A类基金份额)、024079(C类基金份额)

(二)基金的类别与运作方式

基金的类别:股票型证券投资基金

基金的运作方式:契约型开放式

(三)基金存续期限

不定期

(四)基金份额发售面值

本基金基金份额发售面值为人民币1.00元,按面值发售。

(五)发售对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

(六)认购申请的确认

投资者对本基金的认购申请成功与否及其确认情况应以本基金《基金合同》生效后基金登记机构的确认为准。投资者可在《基金合同》生效后第2个工作日起到各销售网点查询确认情况和认购的基金份额。

(七)发售时间安排与基金合同生效

1.发售时间安排

本基金的募集期限为自基金份额发售之日起不超过3个月。

本基金的募集期为2025年7月14日至2025年8月1日。

基金管理人可根据基金销售情况在募集期限内适当延长或缩短基金份额发售时间,并及时公告。

2.基金备案的条件

本基金自基金份额发售之日起3个月内,在基金募集份额总额不少于2亿份,基金募集金额不少于2亿元人民币且基金认购人数不少于200人的条件下,基金募集期届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售,并在10日内聘请法定验资机构验资,自收到验资报告之日起10日内,向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的,自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起,《基金合同》生效;否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集资金存入专门账户,在基金募集行为结束前,任何人不得动用。

3.基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果募集期限届满,未满足基金备案条件,基金管理人应当承担下列责任:

(1)以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用;

(2)在基金募集期限届满后30日内返还投资者已缴纳的款项,并加计银行同期存款利息;

(3)如基金募集失败,基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

(八)销售渠道与销售地点

1、直销机构

(1)长城基金管理有限公司直销中心
住所:深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路9号广电金融中心36层DEF单元、38层、39层

办公地址:深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路9号广电金融中心36层DEF单元、38层、39层

法定代表人:王军

电话:0755-29279128

传真:0755-29279124

联系人:余伟维

客户服务电话:400-8868-666

网址:www.ccifund.com.cn

(2)长城基金管理有限公司电子交易平台

移动客户端:长城基金APP

微信服务号:长城基金

2、代销机构

本基金销售机构及联系方式请查阅本基金管理人网站上的公示信息。

基金管理人可根据有关法律、法规的要求,选择符合要求的机构代理销售本基金,并及时在网站上公示。

二、发售方式及相关规定

(一)认购方式与认购费用

1、认购方式

(1)本基金认购以金额申请。

(2)本基金认购采取全额缴款认购的方式。若资金未全额到账则认购不成功,基金管理人将认购不成功或认购无效的款项退回。基金投资人可在募集期内可多次认购,认购申请一经受理不得撤销。

(3)销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表销售机构已经接收到认购申请。认购的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况,投资人应及时查询并妥善行使合法权利,否则由此产生的投资人任何损失由投资人自行承担。

(4)本基金基金份额发售面值为人民币1.00元,按面值发售。

2、认购费用

本基金A类基金份额在认购时收取认购费用,投资者可以多次认购本基金,A类基金份额认购费率按每笔认购申请单独计算。本基金C类基金份额不收取认购费用。

本基金对通过直销柜台认购A类基金份额的养老金客户与除此以外的其他认购A类基金份额的投资者实施差别的认购费率。本基金A类基金份额的认购费率具体如下:

(1) A类基金份额认购费率

认购金额(含认购费)	认购费率
100万元以下	1.00%
100万元(含)-300万元	0.60%
300万元(含)-500万元	0.30%
500万元(含)以上	每笔1000元

注:上述认购费率适用于除通过本公司直销柜台认购本基金A类基金份额的养老金客户以外的其他投资人。

(2) A类基金份额特定认购费率

认购金额(含认购费)	认购费率
100万元以下	0.20%
100万元(含)-300万元	0.12%
300万元(含)-500万元	0.06%
500万元(含)以上	每笔1000元

注:上述特定认购费率适用于通过本公司直销柜台认购本基金A类基金份额的养老金客户,包括基本养老保险基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老保险基金等,具体包括:全国社会保障基金;可以投资基金的地方社会保障基金;企业年金单一计划以及集合计划;企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划;企业年金养老金产品。

如未来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型,本公司在法律法规允许的前提下可将其纳入养老金客户范围。

本基金A类基金份额认购费由A类基金份额的认购者承担,不列入基金财产。A类基金份额认购费用用于本基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用。

(二)认购金额限制

1、首次认购最低金额为1元,追加认购最低金额为1元。

2、认购期间单个投资者的累计认购金额没有限制。

3、如本基金单个投资人累计认购的基金份额数达到或者超过基金总份额的50%,基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的认购申请进行限制。基金管理人接受某笔或者某些认购申请有可能导致单个投资人持有基金份额的比例达到或者超过50%,或者投资者变相规避前述50%比例要求的,基金管理人有权拒绝该等全部或者部分认购申请。投资人认购的基金份额数以基金合同生效后登记机构

的确认结果为准。

4、基金管理人可根据市场情况,在法律法规允许的情况下,调整上述对认购的金额限制,基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

(三)认购份额的计算

1、认购本基金A类基金份额的计算公式

$$\text{净认购金额} = \text{认购金额} / (1 + \text{认购费率})$$

$$\text{认购费用} = \text{认购金额} - \text{净认购金额}$$

$$\text{认购份额} = (\text{净认购金额} + \text{认购资金利息}) / \text{基金份额发售面值}$$

认购费用为固定金额时:

$$\text{认购费用} = \text{固定金额}$$

$$\text{净认购金额} = \text{认购金额} - \text{认购费用}$$

$$\text{认购份额} = (\text{净认购金额} + \text{认购资金利息}) / \text{基金份额发售面值}$$

认购费用为固定金额时: