

# 长城沪深 300 自由现金流指数型证券投资基金基金产品资料概要

编制日期：2025 年 10 月 15 日

送出日期：2025 年 10 月 16 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    | 长城沪深 300 自由现金流指数                                                                                                       | 基金代码           | 024225         |
| 下属基金简称  | 长城沪深 300 自由现金流指数 A                                                                                                     | 下属基金代码         | 024225         |
| 下属基金简称  | 长城沪深 300 自由现金流指数 C                                                                                                     | 下属基金代码         | 024226         |
| 基金管理人   | 长城基金管理有限公司                                                                                                             | 基金托管人          | 中国农业银行股份有限公司   |
| 基金合同生效日 |                                                                                                                        |                |                |
| 基金类型    | 股票型                                                                                                                    | 交易币种           | 人民币            |
| 运作方式    | 普通开放式                                                                                                                  | 开放频率           | 每个开放日          |
| 基金经理    | 陶曙斌                                                                                                                    | 开始担任本基金基金经理的日期 |                |
|         |                                                                                                                        | 证券从业日期         | 2008 年 4 月 9 日 |
| 其他      | 《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露。连续 50 个工作日出现前述情形的，基金合同终止，不需召开基金份额持有人大会。 |                |                |

## 二、基金投资与净值表现

### （一）投资目标与投资策略

详情请见本基金《招募说明书》“基金的投资”章节内容。

|      |                                                                                                                                                               |
|------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪沪深 300 自由现金流指数，追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。                                                                                                              |
| 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，包括沪深 300 自由现金流指数的成份股（含存托凭证）及备选成份股（含存托凭证）、其他股票（含创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（含国债、央行票据、金融债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、可转换债券 |

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|--------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>(含可分离交易可转换债券)、可交换公司债券、次级债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、货币市场工具、债券回购、同业存单、银行存款(含协议存款、定期存款及其他银行存款)、股指期货以及法律法规或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相关规定)。</p> <p>基金的投资组合比例为:本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的 90%,投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于非现金资产的 80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计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、应收申购款等。</p> <p>本基金的标的指数为沪深 300 自由现金流指数。</p>                                                                                                                                     |
| 主要投资策略 | <p>本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数,实现基金投资目标。在正常市场情况下,力争控制本基金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%。</p> <p>1、股票投资策略</p> <p>(1) 组合复制策略</p> <p>本基金主要采取完全复制法,即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。</p> <p>(2) 替代性策略</p> <p>对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况,导致本基金无法获得足够数量的股票时,基金管理人将通过投资成份股、非成份股等进行替代。</p> <p>(3) 本基金运作过程中,当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险,且指数编制机构暂未作出调整的,基金管理人应当按照持有人利益优先的原则,履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>3、股指期货投资策略</p> <p>4、资产支持证券投资策略</p> <p>5、存托凭证投资策略</p> |

|        |                                                                                          |
|--------|------------------------------------------------------------------------------------------|
| 业绩比较基准 | 沪深 300 自由现金流指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%                                                      |
| 风险收益特征 | 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。 |

（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

### 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：

长城沪深 300 自由现金流指数 A

| 费用类型     | 份额(S)或金额(M)<br>/持有期限(N) | 收费方式/费率  | 备注     |
|----------|-------------------------|----------|--------|
| 认购费      | M<100 万元                | 1%       | 非养老金客户 |
|          | 100 万元≤M<300 万元         | 0.6%     | 非养老金客户 |
|          | 300 万元≤M<500 万元         | 0.3%     | 非养老金客户 |
|          | 500 万元≤M                | 1000 元/笔 | 非养老金客户 |
|          | M<100 万元                | 0.2%     | 养老金客户  |
|          | 100 万元≤M<300 万元         | 0.12%    | 养老金客户  |
|          | 300 万元≤M<500 万元         | 0.06%    | 养老金客户  |
|          | 500 万元≤M                | 1000 元/笔 | 养老金客户  |
| 申购费（前收费） | M<100 万元                | 1.2%     | 非养老金客户 |
|          | 100 万元≤M<300 万元         | 0.8%     | 非养老金客户 |
|          | 300 万元≤M<500 万元         | 0.4%     | 非养老金客户 |
|          | 500 万元≤M                | 1000 元/笔 | 非养老金客户 |
|          | M<100 万元                | 0.24%    | 养老金客户  |
|          | 100 万元≤M<300 万元         | 0.16%    | 养老金客户  |
|          | 300 万元≤M<500 万元         | 0.08%    | 养老金客户  |
|          | 500 万元≤M                | 1000 元/笔 | 养老金客户  |
| 赎回费      | N<7 天                   | 1.5%     | 场外份额   |
|          | 7 天≤N                   | 0%       | 场外份额   |

长城沪深 300 自由现金流指数 C

| 费用类型     | 份额(S)或金额(M)<br>/持有期限(N) | 收费方式/费率 | 备注   |
|----------|-------------------------|---------|------|
| 认购费      | 本基金C类份额不收取认购费用          |         | -    |
| 申购费(前收费) | 本基金C类份额不收取申购费用          |         | -    |
| 赎回费      | N < 7 天                 | 1.5%    | 场外份额 |
|          | 7 天 ≤ N                 | 0%      | 场外份额 |

注：投资者多次认/申购，认/申购费率按每笔认/申购申请单独计算。

## (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                      | 0.50%                                                           | 基金管理人和销售机构 |
| 托管费                      | 0.1%                                                            | 基金托管人      |
| 长城沪深 300 自由现金流指数 A 销售服务费 | 0.00%                                                           | 销售机构       |
| 长城沪深 300 自由现金流指数 C 销售服务费 | 0.25%                                                           | 销售机构       |
| 审计费用                     | -                                                               | 会计师事务所     |
| 信息披露费                    | -                                                               | 规定披露报刊     |
| 其他费用                     | 按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。详情请见本基金《招募说明书》“基金的费用与税收”章节内容。 | -          |

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。

## (三) 基金运作综合费用测算

## 四、风险揭示与重要提示

### (一) 风险揭示

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。

#### 1、市场风险

(1) 政策风险；(2) 经济周期风险；(3) 利率风险；(4) 证券发行人经营风险；(5) 购买力风险；(6) 再投资风险

#### 2、管理风险

#### 3、流动性风险

#### 4、信用风险

#### 5、本基金特有风险

(1) 本基金为股票型基金，股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%，因投资权益类资产而面临权益类资产市场的系统性风险和个股风险。

(2) 标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

标的指数并不能完全代表整个股票市场。标的指数成份股的平均回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。

(3) 标的指数波动的风险

标的指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资人心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。

(4) 基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

(5) 标的指数变更的风险

(6) 跟踪误差控制未达约定目标的风险

(7) 指数编制机构停止服务的风险

(8) 成份股停牌的风险

(9) 基金合同提前终止风险

《基金合同》生效后，连续 50 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金合同终止，不需召开基金份额持有人大会。因此，投资者可能面临基金合同提前终止的风险。

(10) 科创板股票投资风险

(11) 股指期货投资风险

(12) 资产支持证券投资风险

(13) 存托凭证投资风险

6、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

7、其他风险

注：详情请见本基金《招募说明书》“风险揭示”章节内容。

## (二) 重要提示

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。

基金投资者请认真阅读基金合同中争议的处理相关章节，充分了解本基金争议处理的相关事项。

基金产品资料概要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。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[www.ccfund.com.cn][客服电话：400-8868-666]

基金合同、托管协议、招募说明书

定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告

基金份额净值

基金销售机构及联系方式

其他重要资料

## 六、其他情况说明

暂无。