

长城久泰沪深 300 指数证券投资基金(C 类份额)

基金产品资料概要更新

编制日期：2022 年 3 月 18 日

送出日期：2022 年 3 月 30 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 | 长城久泰沪深 300 指数 | 基金代码 | 200002 |
| 下属基金简称 | 长城久泰沪深 300 指数 C | 下属基金交易代码 | 006912 |
| 基金管理人 | 长城基金管理有限公司 | 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | 2004 年 5 月 21 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 | 杨建华 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2004 年 5 月 21 日 |
| | | 证券从业日期 | 2000 年 5 月 8 日 |
| 基金经理 | 雷俊 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2018 年 11 月 30 日 |
| | | 证券从业日期 | 2008 年 7 月 8 日 |
| 其他 | 存续期间内，基金持有人数量连续 60 个工作日达不到 100 人，或连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金管理人将依照法律法规规定的程序宣布本基金终止。出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，基金合同终止。 | | |

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

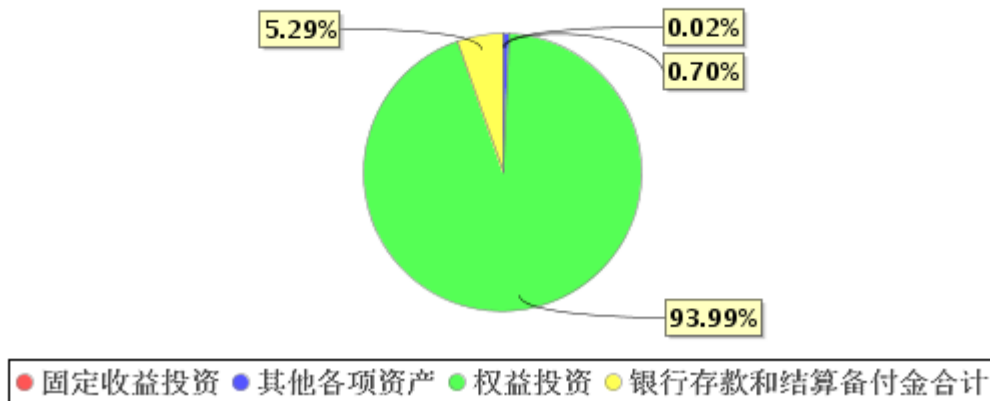
详见《长城久泰沪深 300 指数证券投资基金招募说明书》第八部分“基金的投资管理”。

| | |
|------|--|
| 投资目标 | 以增强指数化投资方法跟踪目标指数，分享中国经济的长期增长，在严格控制与目标指数偏离风险的前提下，力争获得超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。 |
| 投资范围 | 本基金为增强型指数基金，本基金所跟踪的标的指数为沪深 300 指数。 在正常情况下，本基金投资于股票的比例为基金净资产的 90~95%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金净资产的 5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。 本基金的股票投资部分主要投资于目标指数的成份股票（含存托凭证），包括沪深 300 |

| | |
|---------------|--|
| | 指数的成份股（投资组合中持有的沪深 300 指数成份股的数量不低于 240 只）；因增强性投资而选择的其他投资品种（含存托凭证）；在不增加额外风险的前提下，还可适当投资一级市场申购的股票（包括新股与增发、存托凭证），以提高收益水平。 本基金债券投资部分主要投资于国债、政策性金融债。 本基金以沪深 300 指数为目标指数。 |
| 主要投资策略 | （1）资产配置策略：本基金为增强型指数基金，股票投资以沪深 300 指数作为目标指数。在正常情况下，本基金投资于股票的比例为基金净资产的 90~95%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金净资产的 5%。（2）股票投资策略：本基金的指数化投资采用分层抽样法，实现对沪深 300 指数的跟踪，即按照沪深 300 指数的行业配置比例构建投资组合，投资组合中具体股票的投资比重将以流通市值权重为基础进行调整。股票投资范围以沪深 300 指数的成份股为主，少量补充流动性好、可能成为成份股的其他股票，并基于基本面研究进行有限度的优化调整。（3）债券投资策略：本基金债券投资部分以保证基金资产流动性、提高基金投资收益为主要目标，主要投资于到期日一年以内的政府债券等。 |
| 业绩比较基准 | 95%×沪深 300 指数收益率+5%×银行同业存款利率。 |
| 风险收益特征 | 承担市场平均风险，获取市场平均收益。 |

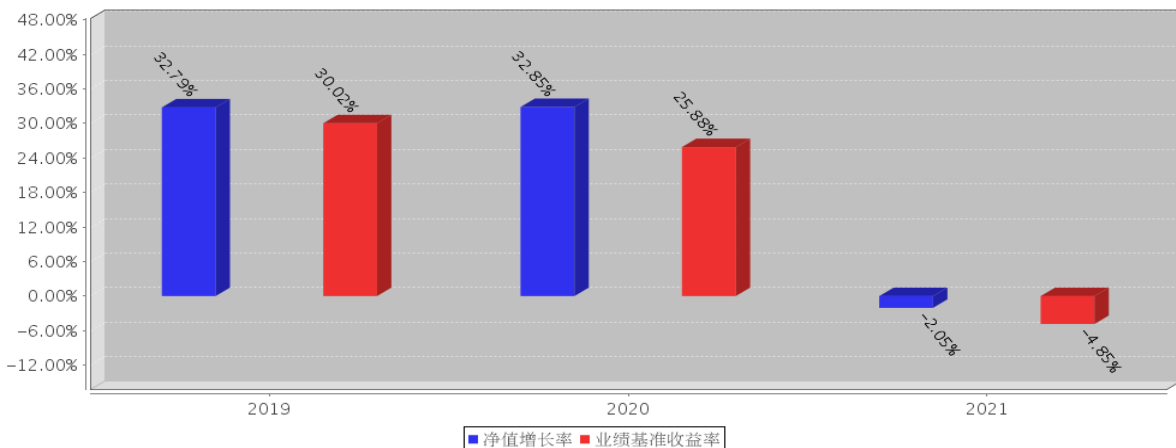
(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表(2021年12月31日)



(三) 自基金合同生效以来/最近十年（孰短）基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

长城久泰沪深300指数C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(2021年12月31日)



注:基金过往业绩不代表未来表现。基金合同生效当年按实际存续期计算净值增长率,不按整个自然年度进行折算。

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 | 备注 |
|--------------|-------------------------|---------|----------------|
| 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 |
| | N≥7天 | 0% | 场外份额 |

(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 |
|-------|---|
| 管理费 | 0.98% |
| 托管费 | 0.20% |
| 销售服务费 | 0.30% |
| 其他费用 | 证券交易费用、基金法定信息披露费用、基金持有人大会费用、与基金相关的会计师费和律师费、按照国家有关规定可以列入的其他费用,根据有关法规及相应协议的规定,按费用实际支出金额支付,列入当期基金费用。 |

注:本基金交易证券等产生的费用和税负,按实际发生额从基金资产扣除。

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

证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响,导致基金收益水平变化,

产生风险，主要包括：（1）政策风险；（2）经济周期风险；（3）利率风险；（4）上市公司经营风险；（5）购买力风险

2、管理风险

3、流动性风险

4、技术风险

5、其他风险

6、科创板投资风险

本基金有可能投资于科创板股票。基金投资科创板股票的风险包括但不限于：（1）科创板企业退市风险；（2）市场风险；（3）流动性风险；（4）集中度风险；（5）监管规则变化的风险

7、存托凭证投资风险

本基金的投资范围包括存托凭证，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的风险。

8、指数编制机构停止服务的风险

9、成份股停牌的风险

10、跟踪误差控制未达约定目标的风险

注：详情请见《长城久泰沪深 300 指数证券投资基金招募说明书》第十六部分“风险揭示”。

（二）重要提示

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。

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