

长城久荣纯债定期开放债券型发起式证券投资基金

基金产品资料概要更新

编制日期：2022年07月18日

送出日期：2022年07月21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 | 长城久荣定期开放债券型发起式 | 基金代码 | 005845 |
| 基金管理人 | 长城基金管理有限公司 | 基金托管人 | 交通银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | 2018年6月13日 | | |
| 基金类型 | 债券型 | 交易币种 | 人民币 |
| 运作方式 | 定期开放式 | 开放频率 | 每三个月开放一次 |
| 基金经理 | 魏建 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2020年7月20日 |
| | | 证券从业日期 | 2008年7月14日 |
| 基金经理 | 吴冰燕 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2022年7月18日 |
| | | 证券从业日期 | 2016年6月27日 |
| 其他 | 基金合同生效之日起三年后的对应日，若基金资产净值低于2亿元，本基金应当按照本基金合同约定的程序进行清算并终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。基金合同生效三年后继续存续的，自基金合同生效满三年后的基金存续期内，连续60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，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。 | | |

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

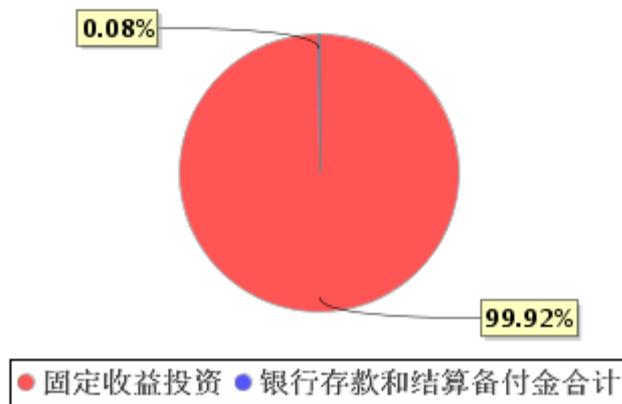
详见本基金《招募说明书》“基金的投资”章节内容。

| | |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金将在控制组合风险和保持资产流动性的前提下，力争获得超越业绩比较基准的收益，实现基金资产的长期增值。 |
| 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，包括国债、金融债、央行票据、公司债、企业债、地方政府债、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款以及其他银行存款）、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。 本基金不投资于股票、权证等权益类资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。 |

| | |
|---------------|--|
| | 本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；但在每个开放期的前 10 个工作日和后 10 个工作日以及开放期间不受前述投资组合比例的限制。本基金在封闭期内持有现金（其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券占资产净值的比例不受限制，但在开放期本基金持有现金（其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或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%。 |
| 主要投资策略 | <p>1、封闭期投资策略</p> <p>本基金通过综合分析国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素，并结合各种固定收益类资产在特定经济形势下的估值水平、预期收益和预期风险特征，在符合本基金相关投资比例规定的前提下，决定组合的久期水平、期限结构和类属配置，并在此基础之上实施积极的债券投资组合管理，以获取较高的投资收益。</p> <p>2、开放期投资策略</p> <p>开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种。</p> |
| 业绩比较基准 | 中债综合指数（总财富）收益率×90%+1 年期定期存款利率（税后）×10% |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金，属于较低预期收益和预期风险水平的投资品种。 |

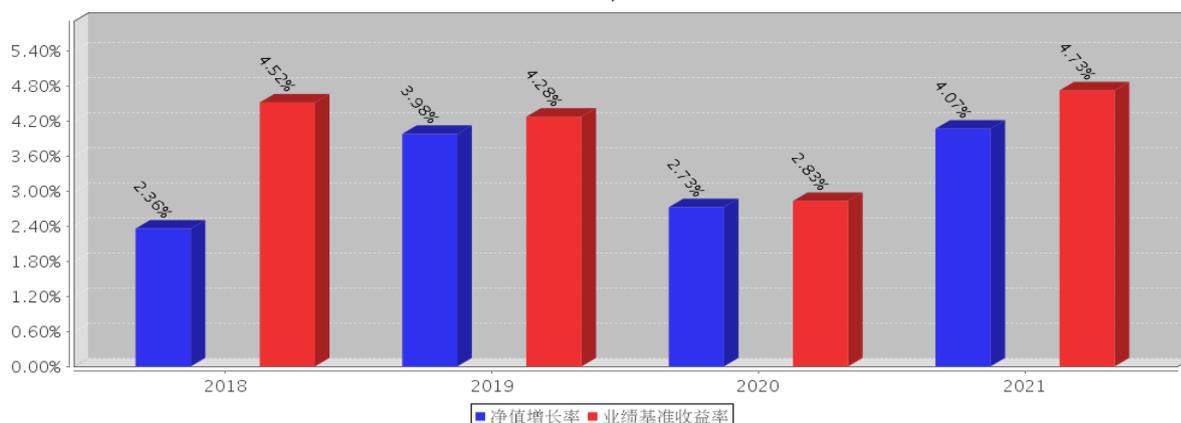
(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表(2022年3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

长城久荣定期开放债券型发起式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) | M<1,000,000 | 0.8% | 非养老金客户 |
| | 1,000,000≤M<3,000,000 | 0.5% | 非养老金客户 |
| | 3,000,000≤M<5,000,000 | 0.3% | 非养老金客户 |
| | M≥5,000,000 | 1,000元/笔 | 非养老金客户 |
| | M<1,000,000 | 0.16% | 养老金客户 |
| | 1,000,000≤M<3,000,000 | 0.1% | 养老金客户 |
| | 3,000,000≤M<5,000,000 | 0.06% | 养老金客户 |
| | M≥5,000,000 | 1,000元/笔 | 养老金客户 |
| 赎回费 | N<7天 | 1.5% | - |
| | 7天≤N<30天 | 0.1% | - |
| | N≥30天 | 0% | - |

注:投资者多次申购,申购费率按每笔申购申请单独计算。

(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 |
|------|--|
| 管理费 | 0.30% |
| 托管费 | 0.10% |
| - | 基金合同生效后与基金相关的信息披露费用、会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费,基金份额持有人大会费用,基金的证券、期货交易费用,基金的银行汇划费用,基金相关账户的开户和维护费用以及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,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人根据基金管理人指令并参照行业惯例从基金财产中支付。 |

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
- 2、信用风险
- 3、基金的流动性风险
- 4、管理风险
- 5、操作风险
- 6、模型风险
- 7、法律、合同风险
- 8、不可抗力风险
- 9、本基金的特有风险

- (1) 封闭期无法赎回风险
- (2) 中小企业私募债投资风险
- (3) 资产支持证券投资风险
- (4) 基金合同终止的风险
- (5) 单一机构投资者大额赎回的风险

- 1) 单一投资者大额赎回导致的基金份额净值波动风险
- 2) 单一投资者大额赎回导致的流动性风险
- 3) 单一投资者大额赎回导致的巨额赎回风险

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

无