

长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金

开放日常申购、赎回业务公告

公告送出日期：2025 年 6 月 13 日

1、公告基本信息

基金名称	长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	长城中证红利低波 100ETF
基金主代码	159228
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 6 月 5 日
基金管理人名称	长城基金管理有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司
基金注册登记机构名称	中国证券登记结算有限责任公司
公告依据	《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》《长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》《长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
申购起始日	2025 年 6 月 18 日
赎回起始日	2025 年 6 月 18 日

注：场内简称：红利低波 ETF 长城

2、日常申购、赎回业务的办理时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后，若出现新的证券/期货交易市场、证券/期货交易所交易时间变更、其他特殊情况或根据业务需要，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

3、日常申购、赎回业务

3.1 申购与赎回的原则

- (1) 本基金采用份额申购和份额赎回的方式，即申购和赎回均以份额申请。
- (2) 本基金的申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。
- (3) 申购、赎回申请提交后不得撤销。
- (4) 办理申购、赎回业务时，应当遵循基金份额持有人利益优先原则，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。
- (5) 申购、赎回应遵守《业务规则》及其他相关规定。如深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司修改或更新上述规则并适用于本基金的，则按照新的规则执行，并在招募说明书中进行更新。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

3.2 申购和赎回的数额限制

(1) 投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。最小申购、赎回单位请参考届时发布的申购、赎回相关公告以及申购、赎回清单。基金管理人可根据市场情况、市场变化以及投资者需求等因素对其进行调整，并在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。目前，本基金最小申购、赎回单位为 100 万份。

(2) 基金管理人可以规定本基金当日申购份额及当日赎回份额上限，以对当日的申购总规模或赎回总规模进行控制，具体规定详见申购赎回清单。

(3) 基金管理人可以规定投资人每个交易账户的最低基金份额余额，具体规定请参见更新的招募说明书或相关公告。

(4) 基金管理人可以规定本基金的总规模上限、当日申购份额限制、单个投资人累计持有的基金份额上限、单日净申购比例上限、单个投资人单日或单笔申购份额上限，具体规定请参见更新的招募说明书、申购赎回清单或相关公告。

(5) 当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购份额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。

(6) 基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定数量或比例限制，或者新增基金规模控制措施。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上公告。

3.3 申购与赎回的对价和费用

(1) 本基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并按照基金合同约定公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

(2) 申购对价是指投资者申购基金份额时应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。赎回对价是指基金份额持有人赎回基金份额时，基金管理人应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。申购对价、赎回对价根据申购赎回清单和投资者申购、赎回的基金份额数额确定。

(3) 申购赎回清单由基金管理人编制。T 日的申购赎回清单在当日深圳证券交易所开市前公告。

(4) 投资者在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过 0.50% 的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记机构等收取的相关费用。

基金管理人可以在不违反相关法律法规且不影响基金份额持有人实质性利益的情况下，对基金申购赎回业务规则、申购对价、赎回对价组成、基金份额净值、申购赎回清单计算和公告时间进行调整并公告，无须召开基金份额持有人大会。

4、基金销售机构

本基金的申购赎回代理券商包括：长城证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、甬兴证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、华泰证券股份有限公司。

投资者办理本基金申购、赎回业务的具体流程、规则等以及各销售机构的业务办理状况，请参照各销售机构的规定执行。本公司可新增或调整本基金申购赎回代办证券公司并在官网（www.ccfund.com.cn）公示，投资者可登录查询。

5、基金份额净值公告/基金收益公告的披露安排

在开始办理基金份额申购或者赎回或基金上市交易后，基金管理人应当在不晚于每个开放日/交易日的次日，通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日/交易日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在规定网站披露半年度和年度最后一日的基金份额净值和基金份额累计净值。

6、其他需要提示的事项

(1) 投资者欲了解本基金的详细情况,请登录本公司网站(www.ccfund.com.cn)查阅本基金基金合同、招募说明书及基金产品资料概要等法律文件,也可拨打本公司客户服务热线(400-8868-666)了解本基金日常申购、赎回事宜。

(2) 本基金将自 2025 年 6 月 18 日起在深圳证券交易所上市交易,投资者可通过本公司网站查阅本公司于 2025 年 6 月 13 日发布的《长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》了解相关信息。

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。投资本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的系统性风险,投资对象或对手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,ETF 运作的风险等。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。

本基金可投资国内依法发行上市的存托凭证,基金净值可能受到存托凭证的境外基础证券价格波动影响,与存托凭证的境外基础证券、境外基础证券的发行人及境内外交易机制相关的风险可能直接或间接成为本基金风险。

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临的信用风险、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中证红利低波动 100 指数。

1、样本空间

同中证全指指数的样本空间

2、选样方法

(1) 对样本空间内证券按照过去一年的日均成交金额由高到低排名，剔除排名后 20% 的证券；

(2) 选取过去三年连续现金分红且每年现金股息率均大于 0 的证券；

(3) 对 (2) 中选取的证券，计算每只证券的股息率和过去一年波动率，其中股息率的计算方法如下：

$$\text{股息率} = \frac{\text{过去三个会计年度分红总额}/3}{\text{调整日总市值}}$$

(4) 对 (3) 中证券，首先按照股息率进行降序排名，选取排名靠前的 300 只证券；再根据过去一年波动率升序排名，选取排名靠前的 100 只证券作为指数样本。

投资人可以通过中证指数有限公司官网 (www.csindex.com.cn) 免费查询指数信息。

在现有结算规则下，当日竞价买入的基金份额，当日可以赎回；当日申购的基金份额，当日可以竞价卖出，次一交易日可以赎回。

投资者投资于本基金前请认真阅读证券交易所及登记机构的相关业务规则及其不时的更新，确保具备相关专业知识、清楚了解相关规则流程后方可参与本基金的认购、申购、赎回及交易。投资者一旦认购、申购或赎回本基金，即表示对基金认购、申购和赎回所涉及的基金份额的证券变更登记方式以及申购赎回所涉及组合证券、现金替代、现金差额及其他对价等相关的交收方式已经认可。

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。

特此公告

长城基金管理有限公司

2025 年 6 月 13 日