

长江中证全指指数增强型发起式证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要

编制日期：2025 年 11 月 26 日

送出日期：2025 年 11 月 27 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    | 长江中证全指指数增强发起                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | 基金代码           | 026183           |
| 下属基金简称  | 长江中证全指指数增强发起 C                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | 下属基金代码         | 026184           |
| 基金管理人   | 长江证券（上海）资产管理有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | 基金托管人          | 平安银行股份有限公司       |
| 基金合同生效日 | —                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 上市交易所及上市日期     | —                |
| 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    | 张帅                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | 开始担任本基金基金经理的日期 | —                |
|         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | 证券从业日期         | 2017 年 02 月 27 日 |
| 基金经理    | 秦昌贵                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                | 开始担任本基金基金经理的日期 | —                |
|         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | 证券从业日期         | 2005 年 06 月 01 日 |
| 其他      | <p>《基金合同》生效日起 3 年后的对应日，若基金资产净值低于 2 亿元的，基金合同自动终止，同时不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。若届时法律法规或中国证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充时，则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。</p> <p>《基金合同》生效满 3 年后继续存续的，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 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会。</p> <p>法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。</p> |                |                  |

注：长江中证全指指数增强型发起式证券投资基金简称“本基金”。

二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

具体请查阅本基金的《招募说明书》“基金的投资”部分了解详细情况。

|               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|---------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <b>投资目标</b>   | 本基金为指数增强型基金,在力求对中证全指指数进行有效跟踪的基础上,通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制,力争实现超越目标指数的投资收益,谋求基金资产的长期增值。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| <b>投资范围</b>   | <p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,以标的指数(即中证全指指数)的成份股及其备选成份股(含存托凭证)为主要投资对象。为更好地实现投资目标,本基金也可少量投资于其他股票(非标的指数成份股及其备选成份股,含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证)、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、可交换债券、公开发行的次级债、地方政府债、政府支持机构债、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货,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的相关规定)。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。</p> <p>本基金投资于股票(含存托凭证)资产占基金资产的比例不低于 80%,其中投资于标的指数成份股及备选成份股(含存托凭证)的资产比例不低于非现金基金资产的 80%;其中,投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 20%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券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>如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。</p> |
| <b>主要投资策略</b> | <p>本基金的主要投资策略包括:</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、股票投资策略;</li> <li>2、债券投资策略;</li> <li>3、衍生品投资策略;</li> <li>4、资产支持证券投资策略;</li> <li>5、可转换债券、可交换债券投资策略。</li> </ol>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| <b>业绩比较基准</b> | 中证全指指数收益率 $\times$ 95%+银行人民币活期存款利率(税后) $\times$ 5%。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| <b>风险收益特征</b> | <p>本基金为股票指数增强型基金,其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数增强型基金,具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。</p> <p>本基金如果投资港股通标的股票,需承担汇率风险以及港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |

### 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 |
|------|---------------------|---------|----|
| 赎回费  | N<7 天               | 1.50%   |    |
|      | N $\geq$ 7 天        | 0.00%   |    |

**认购费：**

本基金 C 类基金份额不收取认购费用。

**申购费：**

本基金 C 类基金份额不收取申购费用。

**赎回费：**

持有时间是指投资者基金份额登记日（基金合同生效日或申购、转换转入确认日）到基金份额赎回或转换转出确认日（不含当日）的自然天数，红利再投资所获得的基金份额，持有时间按原对应持有基金份额的持有期计算。

**（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   | 0.80%                                     | 基金管理人和销售机构 |
| 托管费   | 0.10%                                     | 基金托管人      |
| 销售服务费 | 0.40%                                     | 销售机构       |
| 其他费用  | 基金运作过程中可能发生的其他费用详见本基金的《招募说明书》“基金费用与税收”部分。 | 相关服务机构     |

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。**

本基金在投资运作过程中可能面临各种风险，包括市场风险、管理风险、流动性风险、策略风险、其它风险及特有风险等。

**1、特有风险****（1）指数化投资的风险**

本基金以标的指数（即中证全指指数）的成份股及其备选成份股（含存托凭证）为主要投资对象，股票（含存托凭证）资产的比例不低于基金资产的 80%，其中，投资于标的指数成份股及其备选成份股（含存托凭证）的资产比例不低于非现金基金资产的 80%，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 20%，业绩表现将会随着标的指数的波动而波动；同时本基金在多数情况下将维持较高的股票仓位，在股票市场下跌的过程中，可能面临基金净值与标的指数同步下跌的风险。

包括：1）标的指数的风险；

**2）跟踪误差控制未达约定目标的风险**

在正常市场情况下，本基金力求控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.50%，年化跟踪误差不超过 7.75%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过正常范围的，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度和跟踪误差进一

步扩大。由于标的指数调整成份股或变更编制方法等因素可能使基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离；

### 3) 成份股停牌的风险

标的指数成份股可能因各种原因临时或长期停牌，当成份股发生停牌等流动性约束情形时，本基金可能面临基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大等风险；

### 4) 指数编制机构停止服务的风险等。

(2) 本基金为发起式基金，《基金合同》生效日起3年后的对应日，若基金资产净值低于2亿元的，基金合同自动终止，同时不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。若届时法律法规或中国证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充时，则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。投资者将面临基金合同可能终止的不确定性风险。

(3) 本基金可投资资产支持证券，资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险，基金管理人将本着谨慎和控制风险的原则进行资产支持证券投资。

### (4) 港股通机制下，港股投资风险

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括港股通标的股票，除与其他投资于内地市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金基金资产若投资于港股通标的股票，还面临港股通机制下因投资环境、投资者结构、投资标的、市场制度以及交易规则等差异所带来的特有风险，包括但不限于：1) 市场联动的风险；2) 股价波动的风险；3) 汇率风险；4) 港股通交易额度限制；5) 港股通可投资标的范围调整带来的风险；6) 港股通交易日设定的风险；7) 交收制度带来的基金流动性风险；8) 港股通下对公司行为的处理规则带来的风险；9) 香港联合交易所停牌、退市等制度性差异带来的风险；10) 港股通规则变动带来的风险；11) 其他可能的风险。

本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票，基金资产并非必然投资港股通标的股票。

(5) 本基金将股指期货和国债期货纳入到投资范围中，股指期货和国债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，微小的变动就可能会使投资人权益遭受较大损失。同时，股指期货和国债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，可能给基金净值带来重大损失。

### (6) 存托凭证投资风险

本基金如投资存托凭证的，在承担境内上市交易股票投资的共同风险外，还将承担与存托凭证、创新企业发行、境外发行人以及交易机制相关的特有风险，具体包括但不限于以下风险：

1) 与存托凭证相关的风险；2) 与创新企业发行相关的风险创新企业证券首次公开发行的价格可能高于公司每股净资产账面值，或者高于公司在境外其他市场公开发行的股票或者存托凭证的发行价格或者二级市场交易价格；3) 与境外发行人相关的风险；4) 与交易机制相关的风险等。

### (7) 科创板股票投资风险

1) 股价波动风险；2) 流动性风险；3) 退市风险；4) 投资集中风险。

### (8) 北交所股票投资风险

本基金投资北交所股票，可能面临投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险、流动性风险、上市公司经营风险、上市公司退市风险等。

### （9）本基金采用增强策略的风险

本基金为增强型的指数基金，以“指数化投资为主、主动性投资为辅”，采用主动管理策略选股，可能存在策略失效，无法战胜指数收益的风险。本基金因主动增强策略调整、标的指数定期调样等原因发生大幅调仓时，由于难以在一个交易日内完成调整，可能出现股票调仓方向暴露，被其他投资者抢先建仓，抬高股价，进而造成基金建仓成本升高，投资收益下降的风险。

### （10）其他特有风险

本基金的特有投资风格和决策过程决定了本基金具有许多其它的特有风险。

## 2、流动性风险

### （1）基金申购、赎回安排

本基金采用开放方式运作，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（若本基金参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日时，则基金管理人可根据实际情况决定本基金是否开放申购、赎回及转换业务，具体以届时发布的公告为准），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。基金管理人办理申购和赎回业务的具体办理时间在相关公告中规定。提示投资者注意本基金的申购赎回安排和相应流动性风险，合理安排投资计划。

### （2）投资市场、行业及资产的流动性风险评估

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》的相关要求，基金管理人对本基金所投资或持有的基金资产实施流动性风险管理，也会审慎评估所投资资产的流动性，并针对性制定流动性风险管理措施，因此本基金流动性风险也可以得到有效控制。

本基金为股票指数增强型基金，拟投资市场主要为中国上海证券交易所、中国深圳证券交易所、中国北京证券交易所以及中国银行间市场，所投资资产为具有良好流动性的金融工具，包括以标的指数（即中证全指指数）的成份股及其备选成份股（含存托凭证）为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债券、公开发行的次级债、地方政府债、政府支持机构债、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货，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的相关规定）。上述市场均属于发展成熟、交易活跃的交易场所，上述金融工具也具有较强的流动性，标的资产大部分为标准化金融工具，一般情况下具有较好的流动性。

本基金严格控制投资于流动受限资产和不存在活跃市场需要采用估值技术确定公允价值的投资品种的比例。除此之外，本基金管理人将根据历史经验和现实条件，制定出现金持有量的上下限计划，在该限制范围内进行现金比例调控或现金与证券的转化。本基金管理人会进行标的的分散化投资并结合对各类标的资产的预期流动性合理进行资产配置，以防范流动性风险。

### （3）巨额赎回情形下的主要流动性风险管理措施

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回、部分延期赎回、暂停赎回或延期办理赎回申请。

1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该类基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

3) 暂停赎回：连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在规定媒介上进行公告。

4) 延期办理赎回申请：若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过前一开放日基金总份额 10%以上的，基金管理人认为支付该基金份额持有人的全部赎回申请有困难或认为因支付该基金份额持有人的全部赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动，可以延期办理赎回申请：

①对于该基金份额持有人当日赎回申请超过前一开放日基金总份额 10%以上的部分，基金管理人可以延期办理赎回申请。基金份额持有人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销；选择延期赎回的，当日未获受理的赎回申请将与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该类基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如基金份额持有人在提交赎回申请时未作明确选择，基金份额持有人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

②对于该基金份额持有人当日赎回申请未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据前述全额赎回或部分延期赎回的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。

#### （4）备用流动性风险管理工具

在确保投资者得到公平对待的前提下，可由基金经理发起，经基金投资决策委员会决策，基金管理人经与基金托管人协商，依照法律法规、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、基金管理人流动性风险管理制度及《基金合同》的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，对赎回申请等进行适度调整，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施，包括但不限于：

- 1) 延期办理巨额赎回申请；
- 2) 暂停接受赎回申请；
- 3) 延缓支付赎回款项；
- 4) 收取短期赎回费；
- 5) 暂停基金估值；
- 6) 摆动定价；
- 7) 实施侧袋机制；

8) 中国证监会认定的其他措施。

由于采取上述除第 6)、7) 项以外的备用流动性风险管理工具，可能造成赎回申请延期办理、增加赎回成本等，从而使基金投资人产生一定资金损失；由于采取上述第 6) 项摆动定价机制，基金投资人需承担基金申购和赎回时基金份额净值被摊薄的成本。

在实际运用各类流动性风险管理工具时，可能对投资人有以下潜在影响：投资人的部分或全部赎回申请可能被拒绝，同时投资人完成基金赎回时的基金份额净值可能与其提交赎回申请时的基金份额净值不同；投资人接收赎回款项的时间将可能比一般正常情形下有所延迟；对持续持有期少于 7 日的投资者收取 1.5% 的赎回费；投资人没有可供参考的基金份额净值，同时赎回申请可能被延期办理或被暂停接受，或被延缓支付赎回款项等。

侧袋机制是一种流动性风险管理工具，是将特定资产分离至专门的侧袋账户进行处置清算，并以处置变现后的款项向基金份额持有人进行支付，目的在于有效隔离并化解风险。但基金启用侧袋机制后，侧袋账户份额将停止披露基金份额净值，并不得办理申购、赎回和转换，仅主袋账户份额正常开放赎回，因此启用侧袋机制时持有基金份额的持有人将在启用侧袋机制后同时持有主袋账户基金份额和侧袋账户基金份额，侧袋账户基金份额不能赎回，其对应特定资产的变现时间具有不确定性，最终变现价格也具有不确定性并且有可能大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，基金份额持有人可能因此面临损失。

实施侧袋机制期间，因本基金不披露侧袋账户份额的基金份额净值，即便基金管理人在基金定期报告中披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的，也不作为特定资产最终变现价格的承诺，因此对于特定资产的公允价值和最终变现价格，基金管理人不承担任何保证和承诺的责任。

基金管理人将根据主袋账户运作情况合理确定申购政策，因此实施侧袋机制后主袋账户份额存在暂停申购等申购受限的可能。

启用侧袋机制后，基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时以主袋账户资产为基准。基金业绩指标应当以主袋账户资产为基准，因此本基金披露的业绩指标不能反映投资人同时持有的主袋账户和侧袋账户基金份额的真实价值及变化情况。

具体风险请查阅本基金《招募说明书》“风险揭示”部分的具体内容。

## （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做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。

《基金合同》生效后，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，基金管理人将至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定滞后，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.cjzcg1.com](http://www.cjzcg1.com)][客服电话 4001-166-866]

● 《长江中证全指指数增强型发起式证券投资基金基金合同》、《长江中证全指指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》、《长江中证全指指数增强型发起式证券投资基金托管协议》

● 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。