长城上证科创板100指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新

编制日期：2026年2月13日

送出日期：2026年3月11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	长城上证科创板100指数增强	基金代码	023446
下属基金简称	长城上证科创板100指数增强A	下属基金代码	023446
下属基金简称	长城上证科创板100指数增强C	下属基金代码	023447
基金管理人	长城基金管理有限公司	基金托管人	平安银行股份有限公司
基金合同生效日	2025年4月29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	向晨	开始担任本基金基金经理的日期	2025年10月9日
		证券从业日期	2019年8月20日
基金经理	雷俊	开始担任本基金基金经理的日期	2025年4月29日
		证券从业日期	2008年7月8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	以增强指数化投资方法跟踪标的指数，在严格控制与标的指数偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年化跟踪误差不超过8%。
投资范围	本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（含主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、

	债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、地方政府债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货、国债期货、股票期权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)。 本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。 基金的投资组合比例为：本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的80%，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%，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0%-50%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权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的投资比例合计不低于基金资产净值的5%，其中现金不得包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等；股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。 本基金的标的指数为上证科创板100指数。
主要投资策略	1、股票投资策略 本基金属于指数增强型股票基金，指数化被动投资策略以标的指数的构成为基础，通过对各成份股权重偏离的控制，实现对标的指数的跟踪。同时，利用数量化投资分析方法（包括多因子模型、人工智能模型等）智能筛选优质上市公司，优化投资组合的构成及权重，以争取实现指数增强型的目标。 2、债券投资策略 本基金将根据“自上而下”对宏观经济形势、财政与货币政策，以及债券市场资金供求等因素的分析，重点参考基金的流动性管理需要，运用久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属配置策略、骑乘策略等多种积极管理策略，选取收益稳定、流动性较好的债券进行配置。 3、可转换债券和可交换债券投资策略 本基金将对可转换债券、可交换债券对应的基础股票进行深入分析与研究，重点选择有较好盈利能力或成长前景的上市公司的可转换债券、可交换债券，并在对应可转换债券、可交换债券估值合理的前提下进行投资。 4、股指期货投资策略 本基金可以参与股指期货交易，但必须根据风险管理的原则，以套期保值为目的。本基金将根据对现货和期货市场的分析，采取多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。 5、国债期货投资策略 本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则参与国债期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

	6、股票期权投资策略 股票期权为本基金辅助性投资工具。本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的参与股票期权交易。 7、资产支持证券投资策略 8、融资业务策略 9、转融通证券出借业务策略
业绩比较基准	上证科创板 100 指数收益率×95%＋银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于股票型指数增强基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金可投资港股通标的股票，需承担因港股市场投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

（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：

长城上证科创板 100 指数增强 A

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< 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

长城上证科创板100指数增强C

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
	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	0.80%	基金管理人和销售机构
托管费	0.15%	基金托管人
长城上证科创板100指数增强A销售服务费	0.00%	销售机构
长城上证科创板100指数增强C销售服务费	0.40%	销售机构
审计费用	3,157.44	会计师事务所
信息披露费	50,526.84	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：1.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。

2.审计费用、信息披露费为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

（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80%，其中投资于上证科创板100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

（3）标的指数波动的风险

（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

本基金力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年跟踪误差不超过8%。但因标的指数编制规则调整或其他因素可能导致跟踪误差超过上述范围，本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

（7）指数编制机构停止服务的风险

（8）成份股停牌的风险

（9）主动增强投资的风险

根据本基金的投资策略，为了获得超越指数的投资回报，可以在被动跟踪指数的基础上进行一些优化调整，如在一定幅度内减少或增强成份股的权重、替换或者增加一些非成份股。调整投资组合的决策存在一定的不确定性，其投资收益率可能高于指数收益率但也有可能低于指数收益率。

（10）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。

（11）科创板股票投资风险

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

（12）股指期货投资风险

（13）国债期货投资风险

（14）股票期权投资风险

（15）资产支持证券投资风险

（16）存托凭证投资风险

（17）投资港股通标的股票的风险

1）港股交易失败风险；2）汇率风险；3）境外市场的风险；4）交收制度带来的流动性风险；5）港股通下对公司行为的处理规则带来的风险；6）香港联合交易所停牌、退市等制度性差异带来的风险；7）港股通规则变动带来的风险；8）本基金会根据市场环境的变化以及投资策略的需要进行调整，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，因此本基金存在不对港股进行投资的可能。

（18）参与融资和转融通证券出借业务的风险

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。