

长盛全债指数增强型债券投资基金（长盛全债指数增强债券 D 份额）

基金产品资料概要更新

编制日期：2024 年 02 月 06 日

送出日期：2024 年 02 月 07 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 | 长盛全债指数增强债券 | 基金代码 | 510080 |
| 下属基金简称 | 长盛全债指数增强债券 D | 下属基金交易代码 | 019203 |
| 基金管理人 | 长盛基金管理有限公司 | 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | 2003 年 10 月 25 日 | 上市交易所及上市日期 | - |
| 基金类型 | 债券型 | 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 | 王贵君 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2021 年 9 月 23 日 |
| | | 证券从业日期 | 2012 年 7 月 1 日 |

注：本基金自 2023 年 10 月 20 日起增加 D 类基金份额。

二、基金投资与净值表现

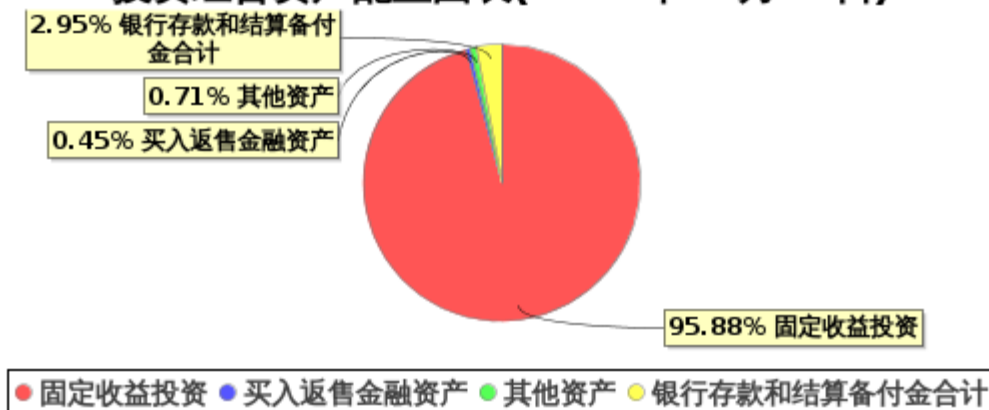
(一) 投资目标与投资策略

（投资者阅读《招募说明书》中“基金的投资”章节了解详细情况）

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 本基金为开放式债券型基金，将运用增强的指数化投资策略，在力求本金安全的基础上，追求基金资产当期收益和超过比较基准的长期稳定增值。 |
| 投资范围 | 本基金以标普中国全债指数收益率作为标的指数，基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行、上市或拟上市的各种债券、股票及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。作为债券型基金，本基金主要投资于各类债券品种，品种主要包括：国债、金融债、企业债与可转换债券。本基金对目标指数的投资在资产配置中的比例最低为 64%，股票投资在资产配置中的比例不超过 16%。 |
| 主要投资策略 | 本基金采用“自上而下”的投资策略对各类资产进行合理配置。通过指数化债券投资策略确保债券资产的长期稳定增值，同时运用一些积极的、低风险的投资策略来提高债券投资组合的收益。 |
| 业绩比较基准 | 标普中国全债指数收益率×92%+沪深 300 指数收益率×8% |
| 风险收益特征 | 本基金属于证券投资基金中的低风险品种，其长期平均风险和预期收益均低于股票型基金。 |

(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(2023年12月31日)



(三) 最近十年基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

注：本基金自2023年10月20日起增加D类基金份额，暂无相关数据。

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 |
|--------------|-------------------------|----------|
| 申购费 (前收费) | M < 50万 | 0.3% |
| | 50万 ≤ M < 200万 | 0.2% |
| | 200万 ≤ M < 500万 | 0.1% |
| | M ≥ 500万 | 1,000元/笔 |
| 赎回费 | N < 7天 | 1.5% |
| | 7天 ≤ N < 180天 | 0.5% |
| | 180天 ≤ N < 270天 | 0.3% |
| | 270天 ≤ N < 1年 | 0.1% |
| | N ≥ 1年 | 0% |

注：养老金费率等相关内容详见本基金招募说明书。

(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 | 0.75% |
| 托管费 | 0.20% |
| 其他费用 | 会计师费、律师费、信息披露费等 |

注：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。本基金的其他费用详见招募说明书。

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。

本基金主要面临的常规风险有：市场风险、管理风险、流动性风险（包括但不限于特定投资标的流动性较差风险、巨额赎回风险、启用侧袋机制等流动性风险管理工具带来的风险等）、技术风险、操作风险等。

本基金面临的特定风险为：跟踪指数的被动投资风险、标的指数变更的风险、指数编制机构停止服务的风险、成份券停牌或违约的风险、增强性投资的积极投资风险等。

（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。

关于本基金争议解决方式详见本基金基金合同，请投资者务必仔细阅读相关内容。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[网址：www.csfunds.com.cn][客服电话：400-888-2666]

1. 基金合同、托管协议、招募说明书；2. 定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告；3. 基金份额净值；4. 基金销售机构及联系方式；5. 其他重要资料。