

长城精选进取 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金产品资料概要更新

编制日期：2024 年 10 月 10 日

送出日期：2024 年 11 月 1 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	长城精选进取 3 个月持有混合发起式（FOF）	基金代码	019678
下属基金简称	长城精选进取 3 个月持有混合发起式（FOF） A	下属基金代码	019678
下属基金简称	长城精选进取 3 个月持有混合发起式（FOF） C	下属基金代码	019679
基金管理人	长城基金管理有限公司	基金托管人	华夏银行股份有限公司
基金合同生效日	2023 年 11 月 20 日		
基金类型	基金中基金	交易币种	人民币
运作方式	其他开放式	开放频率	每份基金份额最短持有期限为 3 个月，在最短持有期限内不可赎回，自最短持有期限届满后的下一工作日起（含该日）可赎回。
基金经理	应俊帅	开始担任本基金基金经理的日期	2023 年 11 月 20 日
		证券从业日期	2017 年 6 月 1 日
其他	<p>《基金合同》生效之日起三年后的对应日（若无对应日则顺延至下一日），若基金资产净值低于两亿元的，《基金合同》自动终止，无需召开基金份额持有人大会审议决定，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。</p> <p>《基金合同》生效三年后本基金继续存续的，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 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 6 个月内召集基金份额持有人大会。</p>		

注：本基金基金类型为偏股混合型基金中基金。

二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

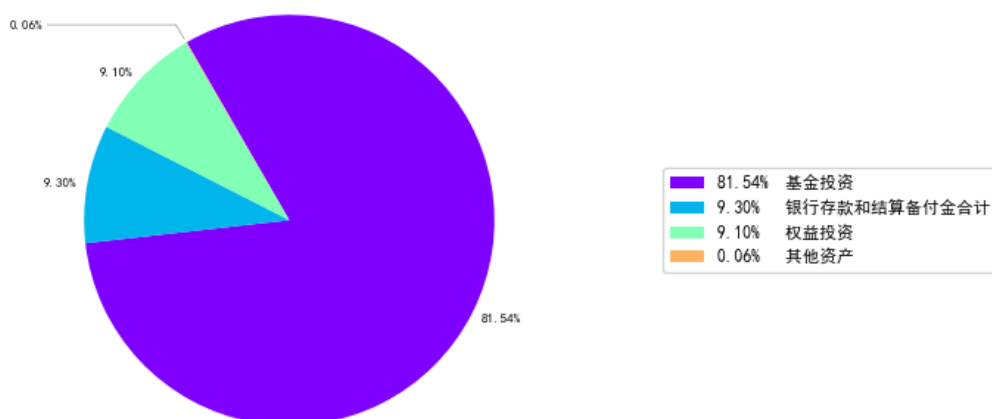
详情请见本基金《招募说明书》“基金的投资”章节内容。

投资目标	<p>在进一步分散投资风险的要求下，本基金通过积极配置各类型资产，以获取长期稳健的投资收益，并力争超越业绩比较基准。</p>
投资范围	<p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金（含 QDII 基金、香港互认基金、商品基金、公开募集基础设施证券投资基金（以下简称“公募 REITs”）、股票（包含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（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可交换债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（包括协议存款、定期存款以及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具，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>基金的投资组合比例为：80%以上基金资产投资于其他经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金（含 QDII 基金、香港互认基金、商品基金、公募 REITs）；本基金对权益类资产的投资合计占基金资产的比例为60%-95%，其中，本基金投资于港股通标的股票不超过股票资产的50%；投资于货币市场基金的比例不得超过基金资产的15%；投资于 QDII 基金和香港互认基金的投资比例合计不得超过基金资产的20%。</p> <p>本基金投资的权益类资产包括股票、股票型基金以及至少满足以下一条标准的混合型基金：（1）基金合同约定的股票资产占基金资产的比例不低于 60%；（2）基金最近 4 期季度报告中披露的股票资产占基金资产的比例均不低于 60%。</p> <p>本基金保留的现金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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p>
主要投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>基金管理人将通过定性分析和定量分析相结合的方式对未来市场环境进行预测和判断，确定基金资产在权益类资产、固定收益类资产间的分配比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，动态调整组合中各类资产的配置比例。同时，综合分析对经济增长、市场流动性、宏观政策等方面因素对各类资产的影响，对各类资产进行动态优化调整，在力争实现收益风险目标的前提下，进一步提升投资组合的整体性价比。</p> <p>（1）战略资产配置策略 （2）战术资产配置策略 （3）纪律性再平衡策略</p> <p>2、基金投资策略</p> <p>在大类资产配置决策下，本基金运用多维度的基金评价体系，结合定性调研和定量分析，优选各个资产类别下的基金产品。本基金将以“核心”策略自下而上优选基金争取相对收益，以“卫星”策略捕捉各类资产中期维</p>

	<p>度的超配低配机会追求收益增强，再结合纪律性再平衡和适时仓位管理，争取实现超越业绩比较基准的投资目标。</p> <p>（1）主动权益类基金投资策略</p> <p>对于主动权益类基金，本基金通过基金评价研究机构推荐、量化指标筛选打分等一种或多种方法进行初步分析，获得候选基金池。在候选基金池范围内，从多维度对待选投资标的进行定性分析，并做出最终的投资决策。</p> <p>（2）固定收益类基金投资策略</p> <p>1) 债券型基金投资策略</p> <p>2) 货币市场基金投资策略</p> <p>（3）被动指数类基金投资策略</p> <p>对于指数基金、ETF、大宗商品基金等被动管理的公募基金，本基金主要通过其配合市场、行业板块轮动等进行优选配置，增强投资回报。本基金使用日最大跟踪偏离度、累计跟踪偏离度、日均跟踪偏离度、跟踪误差等指标评估其投资风格、收益情况、波动性以及回撤等并考虑子基金的基金规模、是否是市场基准指数、是否开放申购赎回等因素，选择优质标的进行投资。</p> <p>（4）本基金可投资公募 REITs</p> <p>本基金将综合考量宏观经济运行情况、基金资产配置策略、底层资产运营情况、流动性及估值水平等因素，对公募 REITs 的投资价值进行深入研究，精选出具有较高投资价值的公募 REITs 进行投资。本基金根据投资策略需要或市场环境变化，可选择将部分基金资产投资于公募 REITs，但本基金并非必然投资公募 REITs。</p> <p>3、股票投资策略</p> <p>（1）A 股投资策略</p> <p>（2）港股通标的股票的投资策略</p> <p>（3）存托凭证的投资策略</p> <p>4、债券投资策略</p> <p>5、可转换债券及可交换债券投资策略</p> <p>6、资产支持证券投资策略</p>
业绩比较基准	<p>中证偏股型基金指数收益率×75%+中债综合财富指数收益率×25%</p>
风险收益特征	<p>本基金为混合型基金中基金，在通常情况下其预期收益及预期风险水平高于债券型基金、货币市场基金、债券型基金中基金和货币型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。</p> <p>本基金除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。</p>

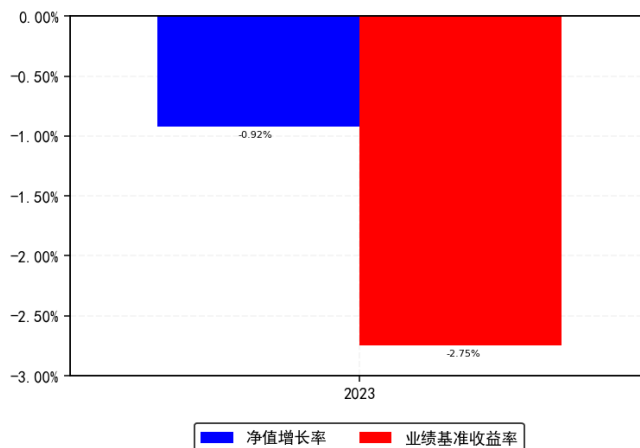
（二）投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图（2024年6月30日）

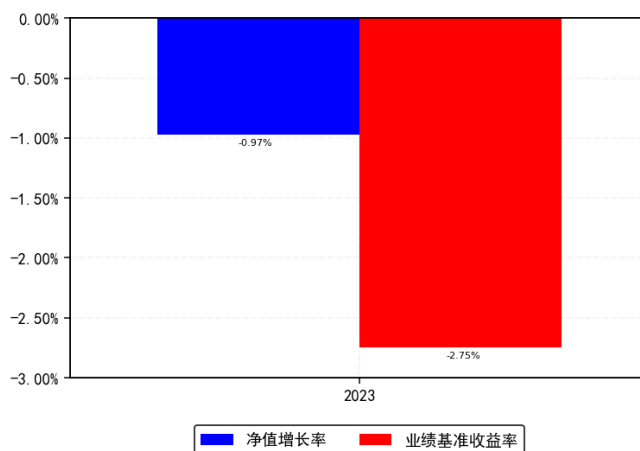


（三）自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

长城精选进取3个月持有混合发起式（FOF）A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（2023年12月31日）



长城精选进取3个月持有混合发起式（FOF）C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（2023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：

长城精选进取 3 个月持有混合发起式（FOF）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	1%	非养老金客户
	300 万元 ≤ M < 500 万元	0.8%	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	0.2%	养老金客户
	300 万元 ≤ M < 500 万元	0.16%	养老金客户
	500 万元 ≤ M	1000 元/笔	养老金客户
赎回费	N < 184 天	0.5%	场外份额
	184 天 ≤ N < 365 天	0.25%	场外份额
	365 天 ≤ N	0%	场外份额

长城精选进取 3 个月持有混合发起式（FOF）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	本基金 C 类份额不收取赎回费用		-

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	1.00%	基金管理人和销售机构
托管费	0.2%	基金托管人
长城精选进取 3 个月持有混合发起式（FOF）A 销售服务费	0.00%	销售机构
长城精选进取 3 个月持有混合发起式（FOF）C 销售服务费	0.40%	销售机构
审计费用	30,000.00	会计师事务所
信息披露费	-	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、信息披露费和指数许可使用费（若有）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

若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

长城精选进取 3 个月持有混合发起式（FOF）A

	基金运作综合费率（年化）
	1.20%

长城精选进取 3 个月持有混合发起式（FOF）C

	基金运作综合费率（年化）
	1.60%

注：基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

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

本基金主要投资于证券市场，市场价格可能会因为国际国内政治环境、宏观和微观经济因素、国家政策、投资者风险收益偏好和市场流动性程度等各种因素的变化而波动，从而产生市场风险，这种风险主要包括：政策风险、经济周期风险、利率风险、信用风险、购买力风险、证券发行人经营风险。

2、管理风险

（1）在基金管理运作过程中，基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有以及对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平；

（2）基金管理人的管理手段和管理技术等因素的变化也会影响基金收益水平。

3、流动性风险

流动性风险是指基金资产不能迅速转变成现金，或者不能应付可能出现的投资者大额赎回的风险。在开放式基金交易过程中，可能会发生巨额赎回的情形。巨额赎回可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，甚至影响基金份额净值。

4、本基金特有的风险

（1）基金投资其他基金的风险

本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金，在选择基金构建组合的时，在很大程度上依靠了基金的过往信息。但基金的过往业绩和表现并不能代表基金的将来业绩和表现，其中存在一定的风险。

本基金可投资于 QDII 基金、香港互认基金，因此将间接承担 QDII 基金、香港互认基金所面临的海外市场风险、汇率风险、政治风险、法律和政府管制风险、会计核算风险及税务风险等境外投资风险。

本基金除了承担投资其他基金的管理费、托管费和销售费用（其中申购本基金基金管理人自身管理的其他基金不收取申购费、赎回费（不包括按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金财产的赎回费用）、销售服务费等）外，还须承担本基金本身的管理费、托管费和销售费用（其中不收取基金财产中持有本基金管理人管理的其他基金部分的管理费、本基金托管人托管的其他基金部分的托管费），因此，本基金最终获取的回报与直接投资于其他基金获取的回报存在差异。

本基金主动管理风险指的是基金经理对基金的主动性操作导致的风险。本基金为主动管理型的基金中基金，在精选基金的操作过程中，基金管理人可能限于知识、技术、经验等因素而影响其对相关信息、经济形势和证券价格走势的判断，其精选出的基金的业绩表现并不一定持续的优于其他基金。

（2）基金投资流通受限资产的风险

本基金可投资于流通受限证券，流通受限证券包括非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，可能面临无法及时变现或无法以公允价格交易而遭受损失的风险。

此外，本基金可投资于流通受限基金、流通受限资产。对于上市封闭式基金而言，当要卖出基金的时候，可能会面临在一定的价格下无法卖出而要降价卖出的风险；对于其他流通受限资产而言，由于流通受限资产的非流通特性，在本基金参与投资后将在一定的期限内无法流通，在本基金需要变现资产时无法变现造成潜在流动性风险。

（3）基金投资资产支持证券的风险

本基金可投资于资产支持证券，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。

（4）基金投资存托凭证的风险

本基金可投资于存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险。

（5）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) 本基金将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。

（6）本基金资产有可能投资于科创板股票。科创板股票在发行、上市、交易、退市等方面的规则与其他板块存在差异，基金投资科创板股票的风险包括但不限于：

- 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

(7) 本基金设置基金份额持有人最短持有期限。基金份额持有人面临在最短持有期限内不能赎回基金份额的风险。

(8) 本基金为发起式基金，《基金合同》生效之日起三年后的对应日（若无对应日则顺延至下一日），若基金资产净值低于两亿元的，基金合同自动终止，无需召开基金份额持有人大会审议决定，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。故基金份额持有人将可能面临基金合同自动终止的风险。

(9) 投资公募 REITs 的特有风险

- 1) 基金价格波动风险
- 2) 基础设施项目运营风险
- 3) 流动性风险
- 4) 终止上市风险
- 5) 税收等政策调整风险

6) 公募 REITs 相关法律法规和交易所业务规则，可能根据市场情况进行修改，或者制定新的法律法规和业务规则，投资者应当及时予以关注和了解。

5、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

6、其他风险

7、声明

(1) 本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。投资者自愿投资于本基金，须自行承担投资风险。

(2) 除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过其他销售机构销售，但是，基金并不是销售机构的存款或负债，也没有经销售机构担保或者背书，销售机构并不能保证其收益或本金安全。

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。