长盛中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金

基金产品资料概要更新

编制日期：2026 年 11 月 18 日

送出日期：2026 年 11 月 19 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	长盛中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期	**基金代码**	017136
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	2022 年 12 月 23 日	**上市交易所及上市日期**	-
基金类型	混合型	**交易币种**	人民币
运作方式	其他开放式	**开放频率**	每个开放日开放申购，但对每份基金份额设置 7 天的最短持有期限。
基金经理	段鹏	**开始担任本基金基金经理的日期**	2022 年 12 月 23 日
		证券从业日期	2007 年 8 月 1 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 个工作日出现上述情形的，基金管理人可直接终止《基金合同》，且无需召开基金份额持有人大会。		

注：本基金基金类型为混合型（固定收益类）

二、基金投资与净值表现

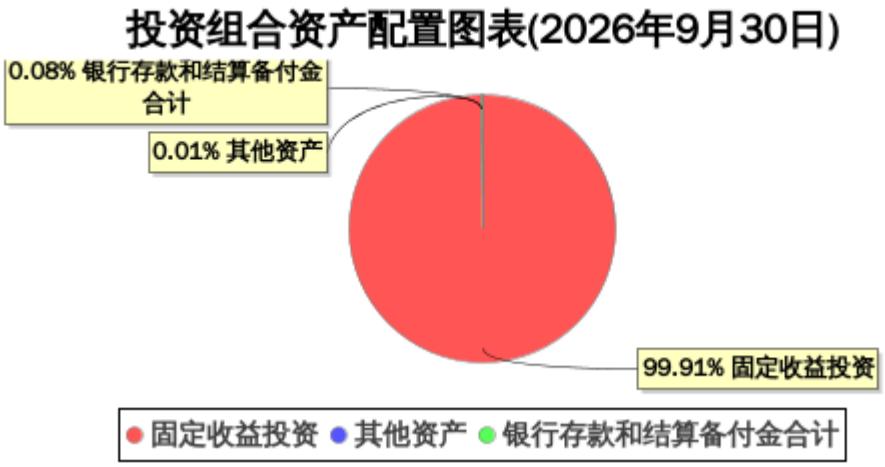
(一) 投资目标与投资策略

（投资者阅读《招募说明书》中“基金的投资”章节了解详细情况）

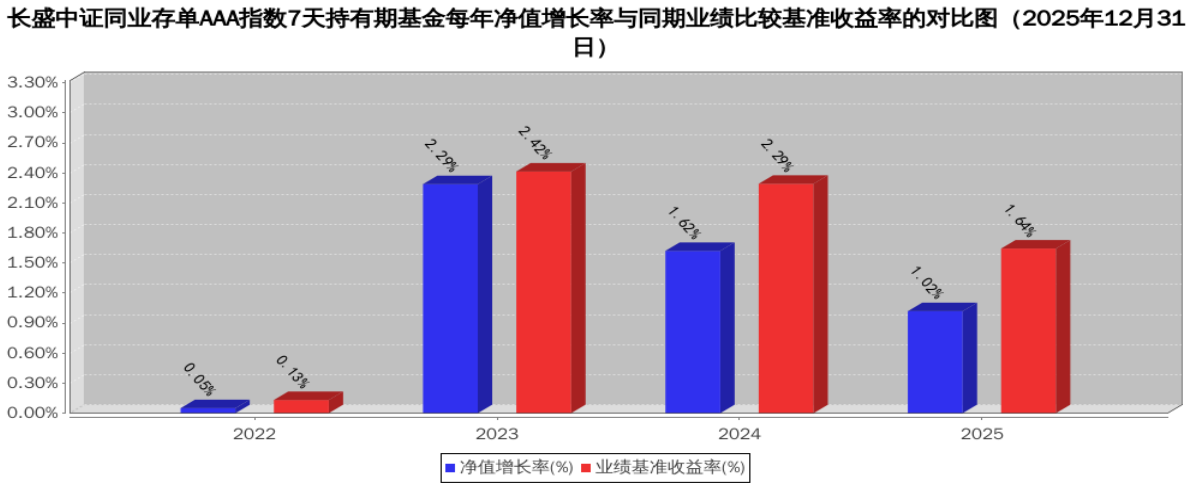
投资目标	本基金通过指数化投资，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资范围	本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券。为更好地实现投资目标，本基金还可以投资于非属成份券及备选成份券的其他同业存单、债券（含国债、地方政府债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、政府支持债券、政府支持机构债券、可分离交易可转债的纯债部分及其他经中国证监会允许投资的债券）、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等非金融企业债务融资工具、资产支持证券、债券回购、银行存款（包含协议存款、定期存款、通知存款等）、现金等货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。 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。

	本基金不投资于股票等资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。 基金的投资组合比例为：本基金投资于同业存单的比例不低于基金资产的 80%；本基金投资于标的指数成份券及备选成份券的比例不低于本基金非现金基金资产的 80%。本基金持有的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、存出保证金和应收申购款等。 如法律法规或监管机构变更上述投资品种的比例限制，在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。
主要投资策略	本基金为指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标的指数的有效跟踪。 在正常市场情况下，本基金力争追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。 1、优化抽样复制策略 本基金将采用抽样复制和动态最优化的方法，主要以标的指数的成份券构成为基础，综合考虑指数成份券流动性、基金日常申购赎回以及银行间和交易所成份券交易特性及交易惯例等情况进行优化，以保证对标的指数的有效跟踪。 2、替代性策略 当由于市场流动性不足或因法规规定等其他原因，导致标的指数成份券和备选成份券无法满足投资需求时，基金管理人可以在成份券和备选成份券外寻找其他证券构建替代组合，对指数进行跟踪复制。替代组合的构建将以流动性为约束条件，按照与被替代成份券久期相近、信用评级相似、到期收益率及剩余期限基本匹配为主要原则，控制替代组合与被替代成份券的跟踪偏离度和跟踪误差最小化。 3、资产支持证券的投资策略 本基金将在综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成和质量等因素的基础上，对资产证券化产品的收益和风险匹配情况等进行定性和定量的全方面分析，评估其相对投资价值并作出相应的投资决策，力求在控制投资风险的前提下尽可能的提高本基金的收益。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。
业绩比较基准	中证同业存单 AAA 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金风险与收益低于股票型基金、偏股混合型基金，高于货币市场基金。主要投资于标的指数成份券及备选成份券，具有与标的指数以及标的指数所代表的市场相似的风险收益特征。

(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



注：基金过往业绩不代表未来表现。

三、投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

①投资者选择申购本基金基金份额的，不收取申购费，从基金资产中计提销售服务费。

②本基金对每份基金份额设置 7 天的最短持有期限，不收取赎回费。

(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	0.20%	基金管理人和销售机构
托管费	0.05%	基金托管人
销售服务费	0.20%	销售机构
审计费用	40,000.00 元	会计师事务所
信息披露费	120,000.00 元	规定披露报刊

其他费用	《基金合同》生效后与基金相关的律师费、基金份额持有人大会费用、基金的证券交易费用、基金的银行汇划费用、基金相关账户的开户及维护费用等费用，以及相关法律法规和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。费用类别详见本基金《基金合同》及《招募说明书》或其更新。	相关服务机构

注：1、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。

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

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：

	基金运作综合费率（年化）
持有期间	0.52%

注：基金运作综合费率=固定管理费率+托管费率+销售服务费率（若有）+其他运作费用合计占基金每日平均资产净值的比例（年化）。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。

本基金面临的常规风险：市场风险、管理风险、信用风险、流动性风险（包括但不限于拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估，巨额赎回情形下的流动性风险管理措施，实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响，实施侧袋机制对投资者的影响等）、操作和技术风险、合规性风险、模型风险、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、其他风险等。

本基金面临的特定风险包括：1、指数化投资相关的风险；2、投资资产支持证券的风险；3、最短持有期限锁定持有的风险；4、基金管理人自基金合同生效之日起不超过 1 个月开始办理赎回，对投资者存在流动性风险；5、基金合同直接终止的风险；6、本基金主要投资同业存单，还可能会面临如下风险：同业存单市场投资者行为具有一定趋同性，在极端市场环境下可能集中买入或卖出，本基金存在流动性风险；由于本基金投资的同业存单集中度较高，银行业内任一银行发生信用风险、流动性风险或声誉风险事件等，均可能会对其他银行形成负面连锁反应，从而对整个同业存单投资造成较大影响，进而影响本基金的净值表现。此外同业存单投资还面临有政策风险，主要指当银行业出台新的监管政策或原有的监管要求出现重大调整时，可能对同业存单的投资价值造成影响，进而影响本基金的投资业绩。

(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，请投资者务必详细阅读相关内容。

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

六、其他情况说明