长城三个月滚动持有债券型证券投资基金基金产品资料概要更新

编制日期：2026 年 9 月 18 日

送出日期：2026 年 9 月 21 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	长城三个月滚动持有债券	基金代码	023586
下属基金简称	长城三个月滚动持有债券 A	下属基金代码	023586
下属基金简称	长城三个月滚动持有债券 B	下属基金代码	023587
下属基金简称	长城三个月滚动持有债券 C	下属基金代码	023588
基金管理人	长城基金管理有限公司	基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金合同生效日	2025 年 3 月 12 日		
基金类型	债券型	交易币种	人民币
运作方式	其他开放式	开放频率	A 类、C 类基金份额每个开放日开放申购业务，但设置 3 个月滚动运作期，每个运作期到期日方可提出赎回申请。B 类基金份额只开放赎回，不开放申购，不设置滚动运作期，可在开放赎回业务后任一开放日办理赎回。
基金经理	张棪	开始担任本基金基金经理的日期	2025 年 3 月 27 日
		证券从业日期	2014 年 7 月 11 日
基金经理	华吉昶	开始担任本基金基金经理的日期	2025 年 3 月 12 日
		证券从业日期	2015 年 7 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 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，解决方案包括持续运作、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。

注：本基金由长城证券三个月滚动持有债券型集合资产管理计划变更而来。

二、基金投资与净值表现

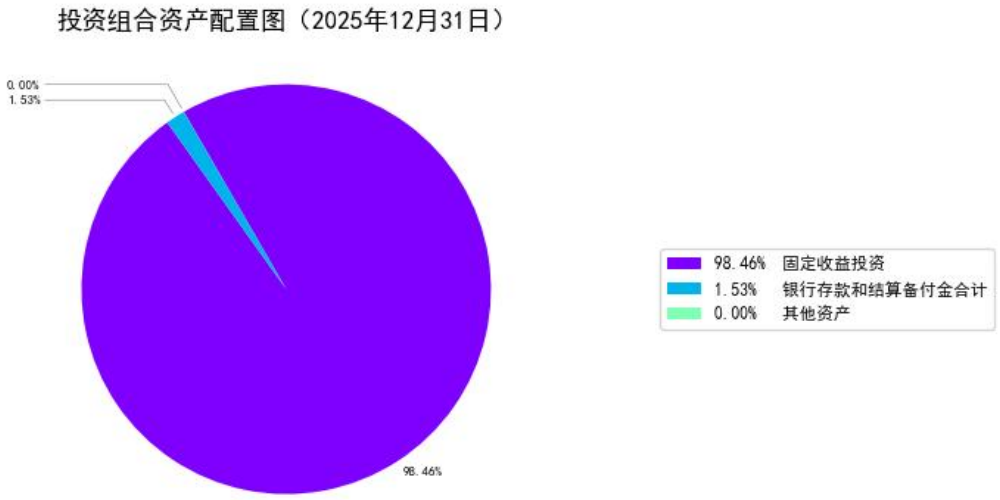
（一） 投资目标与投资策略

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	在追求资产安全性的基础上，力争实现资产的长期稳健增值。
投资范围	本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（含国债、央行票据、金融债券、政府支持机构债、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、可转换债券（含可分离交易可转债）、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、同业存单、债券回购、银行存款、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相关规定）。 本基金不参与新股申购或增发新股，也不直接买入股票等权益类资产，但可持有因可转换债券转股和可交换债券换股形成的股票。因上述原因持有的股票应在其可交易之日起的 10 个交易日内卖出。 本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；本基金投资于可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券的比例不超过基金资产的 20%;每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
主要投资策略	（一）固定收益品种投资策略 根据对未来债券市场的判断，组合采用战略性配置与战术性交易结合的方法，重点持有核心资产，并结合市场上出现的机会进行战术配置调整。 “核心存量资产”为组合的主要部分，买入并战略性持有中短期限的国债、金融债、信用债等，以期总体组合取得一定的收益。核心资产投资主要采取买入持有策略，在稳定投资组合收益率、锁定下行风险方面起到重要作用。在核心存量资产保证投资策略稳定的同时，根据市场和风险情况，灵活配置一部分为战术交易资产，采用多种固定收益投资策略，对流动性较高的债券资产进行交易，力争在严格控制下行风险的基础上获得增值收益。 债券组合管理的多元化策略主要包括： 1、买入持有策略 2、债券类属配置策略 3、期限配置策略 4、久期偏离策略 5、信用债（含资产支持证券）投资策略

	6、收益率曲线策略 7、可转换债券、可交换债券投资策略 （二）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，充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。
业绩比较基准	中债-综合全价（1-3 年）指数收益率×90%+中证可转换债券指数收益率×5%+活期存款基准利率×5%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益低于混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。

（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：

长城三个月滚动持有债券 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	0.3%	非养老金客户
	100 万元≤M< 500 万元	0.2%	非养老金客户
	500 万元≤M< 1000 万元	0.1%	非养老金客户
	1000 万元≤M	1000 元/笔	非养老金客户
	M< 100 万元	0.06%	养老金客户
	100 万元≤M< 500 万元	0.04%	养老金客户

	500 万元≤M< 1000 万元	0.02%	养老金客户
	1000 万元≤M	1000 元/笔	养老金客户
赎回费	本基金 A 类份额不收取赎回费		-

长城三个月滚动持有债券 B

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 B 类份额不开放申购		-
赎回费	本基金 B 类份额不收取赎回费		-

长城三个月滚动持有债券 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		-
赎回费	本基金 C 类份额不收取赎回费		-

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	0.30%	基金管理人和销售机构
托管费	0.1%	基金托管人
长城三个月滚动持有债券 A 销售服务费	0.00%	销售机构
长城三个月滚动持有债券 B 销售服务费	0.00%	销售机构
长城三个月滚动持有债券 C 销售服务费	0.30%	销售机构
审计费用	30,000.00	会计师事务所
信息披露费	120,000.00	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

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：

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

（1）政策风险；（2）利率风险；（3）再投资风险；（4）购买力风险；（5）信用风险；（6）公司经营风险；（7）经济周期风险。

2、流动性风险

3、管理风险

4、本基金的特有风险

（1）本基金投资于债券资产不低于基金资产的80%。因此，本基金需要承担由于市场利率波动造成的利率风险以及如企业债、公司债等信用品种的发债主体信用恶化造成的信用风险；如果债券市场出现整体下跌，将无法完全避免债券市场系统性风险。本基金可投资于可转换债券和可交换债券，本基金需要承担可转换债券和可交换债券的流动性风险、利率风险、对应的正股价格波动风险，可转换债券转股或可交换债券换股所得的股票在卖出前也会承受股价波动风险。

（2）资产支持证券的投资风险

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。

（3）国债期货的投资风险

本基金可投资国债期货，国债期货的投资可能面临市场风险、基差风险、流动性风险。市场风险是因期货市场价格波动使所持有的期货合约价值发生变化的风险。基差风险是期货市场的特有风险之一，是指由于期货与现货间的价差的波动，影响套期保值或套利效果，使之发生意外损益的风险。流动性风险可分为两类：一类为流通量风险，是指期货合约无法及时以所希望的价格建立或了结头寸的风险，此类风险往往是由市场缺乏广度或深度导致的；另一类为资金量风险，是指资金量无法满足保证金要求，使得所持有的头寸面临被强制平仓的风险。

（4）本基金对每份A类、C类基金份额设置3个月滚动运作期。每个运作期到期日前，基金份额持有人不能提出赎回申请。每个运作期到期日，基金份额持有人可提出赎回申请。如果基金份额持有人在当期运作期到期日未申请赎回，则自该运作期到期日下一日起该基金份额进入下一个运作期。因此基金份额持有人面临在滚动运作期内不能赎回基金份额的风险。

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

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。