

大成智惠量化多策略灵活配置混合型证券投资基金(C类份额)

基金产品资料概要更新

编制日期：2024年6月3日

送出日期：2024年6月28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	大成智惠量化多策略混合	基金代码	004209
下属基金简称	大成智惠量化多策略混合C	下属基金交易代码	018694
基金管理人	大成基金管理有限公司	基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金合同生效日	2017年3月21日		
基金类型	混合型	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	郑少芳	开始担任本基金基金经理的日期	2023年7月5日
		证券从业日期	2010年10月27日
其他	本基金合同生效后的存续期内，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，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式或与其他基金合并等，并召开基金份额持有人大会进行表决。		

二、基金投资与净值表现

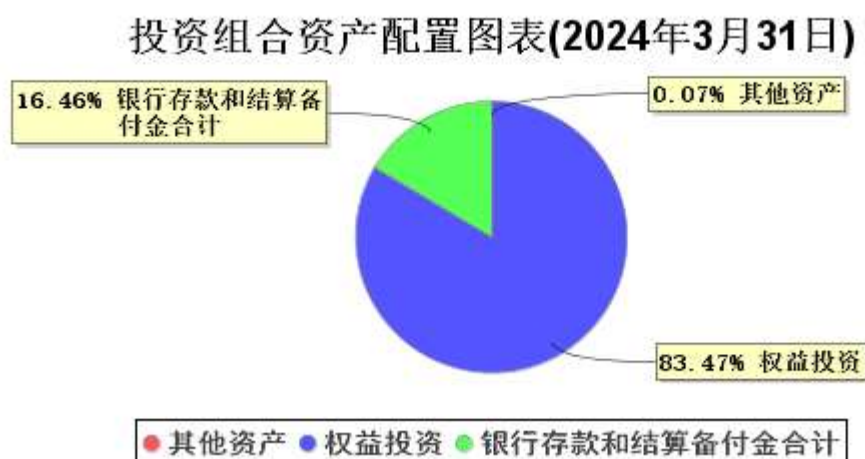
(一) 投资目标与投资策略

详见《大成智惠量化多策略灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书》第八部分“基金的投资”。

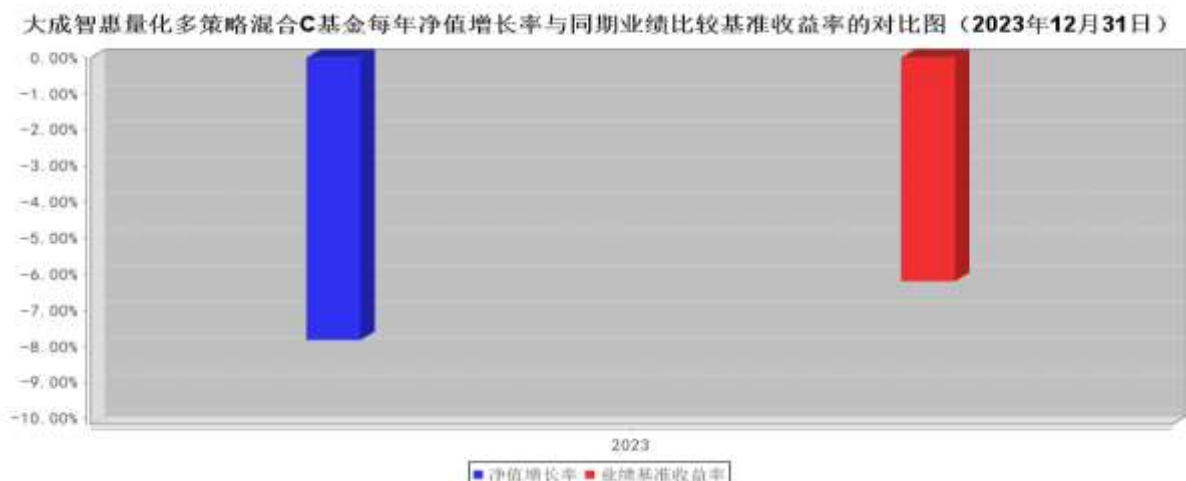
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，本基金通过大类资产的灵活配置，以及通过多种量化投资策略，力求实现基金资产的持续稳定增值。
投资范围	<p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购等）、货币市场工具、银行存款、同业存单、权证、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。</p> <p>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。</p> <p>基金的投资组合比例为： 股票、存托凭证等权益类资产占基金资产的比例为0%—95%；每个交易日日终在扣除</p>

	<p>股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。</p> <p>如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。</p>
主要投资策略	<p>本基金在大类资产配置层面，采用大成基金成熟的量化择时模型结合定性分析，配置权益类资产和固定收益类资产的比例，严格控制基金的下行风险。在个股选择层面，本基金采用多因子模型精选具有超额收益的股票组合。</p> <p>1、大类资产配置和择时策略。2、股票投资策略。3、融资买入股票策略。4、债券投资策略。5、中小企业私募债投资策略。6、资产支持证券投资策略。7、权证投资策略。8、股指期货的投资策略。9、国债期货投资策略。10、在控制风险的前提下，本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p>
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，高于货币市场基金与债券型基金。

(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



注：1、基金的过往业绩不代表未来表现。
2、如合同生效当年不满完整自然年度的，按实际期限计算净值增长率。

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
赎回费	N < 7 天	1.5%
	7 天 ≤ N < 30 天	0.5%
	N ≥ 30 天	0.0

（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	0.6%	基金管理人和销售机构
托管费	0.15%	基金托管人
销售服务费	0.4%	销售机构
审计费用	20,000.00 元	会计师事务所
信息披露费	0.00 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和诉讼费、基金份额持有人大会费用（包括但不限于场地费、会计师费、律师费和公证费）、基金的证券交易费用、基金的银行汇划费用、基金的开户费用、账户维护费用。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。	

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：

大成智惠量化多策略混合 C

基金运作综合费率（年化）
1.51%

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、本基金特有风险：基金管理人主动量化模型存在失效导致基金表现不佳的风险

基金管理人通过主动量化模型进行大类资产配置与个股选择，虽然以上量化模型都经过了严密的逻辑推导，以及经历大量的测试与投资检验，然而在极端条件下，基金管理人的主动量化模型存在失效导致基金业绩表现不佳的风险。

2、本基金还面临证券投资基金投资共有的风险，如市场风险、管理风险、流动性风险、其他风险等。

3、投资存托凭证的相关风险。

(二) 重要提示

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。

大成智惠量化多策略灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2016 年 8 月 23 日证监许可【2016】1915 号文注册募集。

中国证监会对本基金募集的注册或核准，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。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[www.dcfund.com.cn]客服电话[4008885558]

1. 大成智惠量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同、大成智惠量化多策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议、大成智惠量化多策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书

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