

# 大成多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（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    | 大成多策略混合（LOF）  | 基金代码           | 160921      |
| 下属基金简称  | 大成多策略混合（LOF）C   | 下属基金交易代码       | 016062      |
| 基金管理人   | 大成基金管理有限公司  | 基金托管人          | 中国银行股份有限公司  |
| 基金合同生效日 | 2018年8月18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    | 邹建  | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2021年12月29日 |
|         |   | 证券从业日期         | 2016年7月13日  |
| 其他      | 基金合同生效后，连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续六十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、与其他基金合并或者终止基金合同等，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

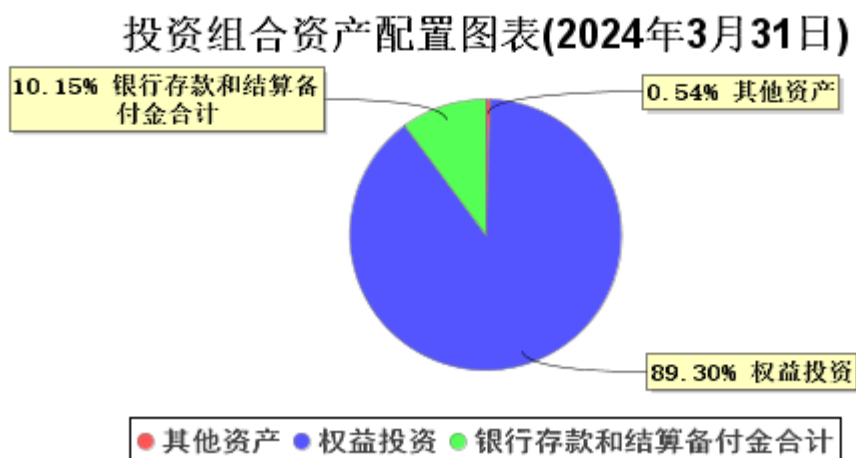
#### （一）投资目标与投资策略

详见《大成多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）更新招募说明书》第八部分“基金的投资”。

|      |  |
|------|--|
| 投资目标 | 在封闭期内，本基金主要参与上市公司股票定向增发，基金管理人在控制风险的前提下，追求基金资产长期稳健增值。<br>转为上市开放式基金（LOF）后，基金管理人在控制风险和保持资产流动性的基础上，主要采用多策略投资于股票，追求基金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、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、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）。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。<br>基金的投资组合比例为：封闭期内股票、存托凭证占基金资产的比例为0%—100%，其中投资于上市公司定向增发股票、存托凭证占基金非现金资产的比例不低于80%；转为上 |

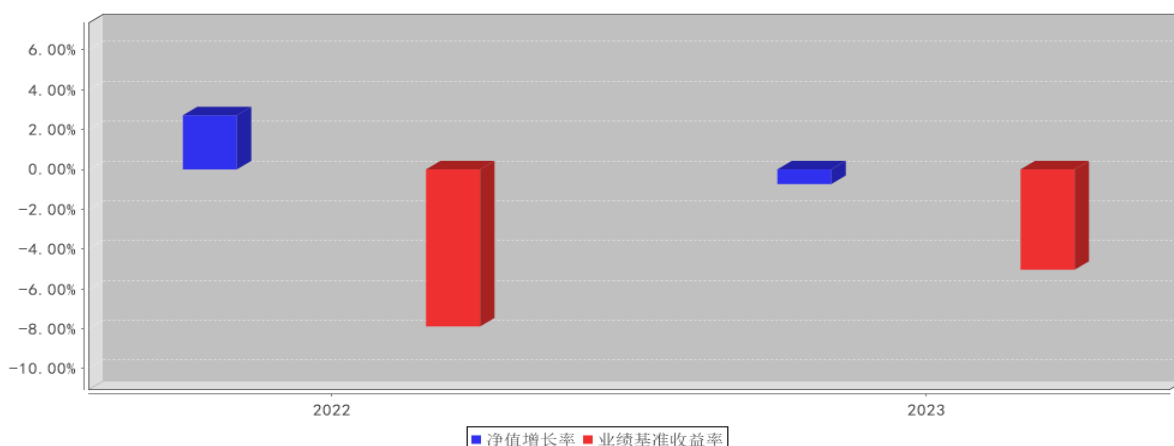
|        |  |
|--------|--|
|        | <p>市开放式基金（LOF）后，股票、存托凭证占基金资产的比例为0-95%。封闭期内每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；转为上市开放式基金（LOF）后，每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。</p>   |
| 主要投资策略 | <p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金通过对宏观经济、市场面、政策面等因素的分析研究，结合与定增事件相关的情绪指标确定股票、债券及其他金融工具的比例。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>（1）定向增发投资策略</p> <p>在封闭期内，本基金股票资产将主要参与上市公司定向增发，并辅以其他股票投资策略。基金经理在参与定向增发项目时，将根据定向增发折价率、定向增发类别、市场氛围判断（牛市/熊市）、所处行业、公司自身价值判断、定增项目前景等因素精选优质标的，采用分散投资方式，降低组合风险。对于解除锁定的增发股份，基金管理人将基于市场环境、公司估值水平、同类行业估值水平、公司近期的经营管理状况等作出是否售出的判断。项目退出策略更注重本金和盈利的安全。</p> <p>（2）股票投资策略</p> <p>本基金转为上市开放式基金后，主要采用多策略投资于股票，包括基本面选股策略和与定增事件相关的投资策略。一般不参与上市公司定向增发，但基金经理可以根据相关法律法规的规定及考虑流动性安排后将部分资产投资于上市公司定向增发。</p> <p>3、债券投资策略；4、权证投资策略；5、中小企业私募债投资策略；6、资产支持证券投资策略；7、股指期货的投资策略；8、国债期货投资策略；9、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*60%+中债综合指数收益率*40%   |
| 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，属于风险水平中高的基金。  |

## （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

大成多策略混合（LOF）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：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）<br>/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%      |

#### （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   | 1.2%  | 基金管理人和销售机构 |
| 托管费   | 0.2%  | 基金托管人      |
| 销售服务费 | 0.6%  | 销售机构       |
| 审计费用  | 90,000.00 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、诉讼费和仲裁费，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，基金上市费及年费，基金相关账户的开户及维护费用，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：

大成多策略混合（LOF）C

| 基金运作综合费率（年化） |
|--------------|
| 2.02%        |

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：

（1）折价风险：在本基金封闭期内，持有人只能通过证券市场二级市场交易卖出基金份额变现。在证券市场持续下跌、基金二级市场交易不活跃等情形下，有可能出现基金份额二级市场交易价格低于基金份额净值的情形，即基金折价交易，从而影响持有人收益或产生损失

（2）投资定向增发股票风险：本基金将会参与上市公司定向增发，定向增发股票一般具有锁定期，在锁定期内基金管理人不能在二级市场卖出增发所取得的股份。此外，如果估值日非公开发行有明确锁定期的股票的初始取得成本低于在证券交易所上市交易的同一股票的市价，将按照监管机构或行业协会有关规定确定股票公允价值，本基金基金净值可能由于估值方法的原因偏离所持有股票的收盘价所对应的净值，投资者在二级市场交易时，需考虑该估值方式对基金净值的影响。

（3）基金投资中小企业私募债券的风险：本基金可投资中小企业私募债券，中小企业私募债券是指中小微型企业在中国境内以非公开方式发行和转让，约定在一定期限还本付息的公司债券，其发行人是非上市中小微企业，发行方式为面向特定对象的私募发行。因此，中小企业私募债券较传统企业债的信用风险及流动性风险更大，从而增加了本基金整体的债券投资风险。

#### （4）股指期货、国债期货等金融衍生品投资风险

（5）单一投资者集中度较高的风险：由于投资者的申购赎回行为可能导致本基金的单一投资者持有的份额占本基金总份额的比例较高，该单一投资者的申购赎回行为可能影响本基金的投资运作，从而对基金收益产生不利影响。

#### （6）投资存托凭证的相关风险。

2、本基金还面临其他风险，如市场风险、信用风险、科创板股票投资风险、管理风险、流动性风险、其他风险等。

### （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。

大成定增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5月26日证监许可【2016】1124号文予以注册。基金合同于2016年8月19日正式生效。基金合同生效后，本基金封闭期为2016年8月19日至2018年8月17日。自2018年8月18日起，大成定增灵活配置混合型证券投资基金转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“大成多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”。

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](http://www.dcfund.com.cn)]客服电话[4008885558]

1. 大成多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同、大成多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）托管协议、大成多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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