

大成可转债增强债券型证券投资基金(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	大成可转债增强债券	基金代码	090017
下属基金简称	大成可转债增强债券C	下属基金交易代码	019152
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	2011年11月30日		
基金类型	债券型	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	成琦	开始担任本基金基金经理的日期	2023年1月3日
		证券从业日期	2017年8月21日
其他	《基金合同》生效后，基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5,000万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续20个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案。		

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

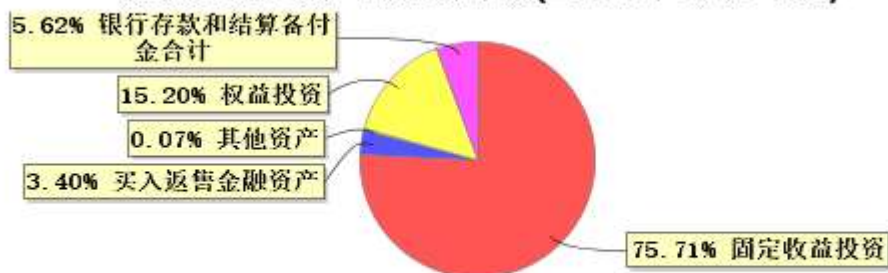
详见《大成可转债增强债券型证券投资基金更新招募说明书》第八部分“基金的投资”。

投资目标	在严格控制投资风险、保持资产流动性的前提下，采取自上而下的资产配置策略和自下而上的个券选择策略，通过主动投资组合管理，充分把握可转债兼具股性和债性的风险收益特征，追求投资资金的长期保值增值。
投资范围	本基金的投资对象为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行或上市交易的股票（包含中小板，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、货币市场工具、权证、资产支持证券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）。 本基金为债券基金，重点投资于固定收益类资产，包括国债、央行票据、中期票据、公司债、企业债、资产支持证券、短期融资券、政府机构债、金融债、次级债、可转债（含可分离交易可转债）、债券回购、银行存款，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%，其中对可转债（含可分离交易可转债）的投资比例不低于基金固定收益类资产的80%；股票（含一级市场新股申购和二级市场股票投资）、存托凭证、权证等权益类资产投资比例不高于基金资产的20%；持有现金（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%。

	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。
主要投资策略	1、大类资产配置策略 2、固定收益类资产投资策略（1）可转债投资策略包括：1）可转债套利策略 2）相对价值分析策略 3）可转债条款价值发现策略 4）可分离交易可转债投资策略（2）普通债券投资策略包括：1）利率预期策略 2）类属配置策略 3）信用债券投资策略 4）套利交易策略 3、权益类资产投资策略（1）新股申购投资策略（2）股票二级市场投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、权证投资策略；6、存托凭证投资策略；
业绩比较基准	中信标普可转债指数收益率*60%+中债综合指数收益率*40%
风险收益特征	本基金为债券型基金产品，属证券投资基金中的低风险收益品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金主要投资于可转换债券（含可分离交易可转债），在债券型基金中属于风险水平相对较高的投资产品。

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

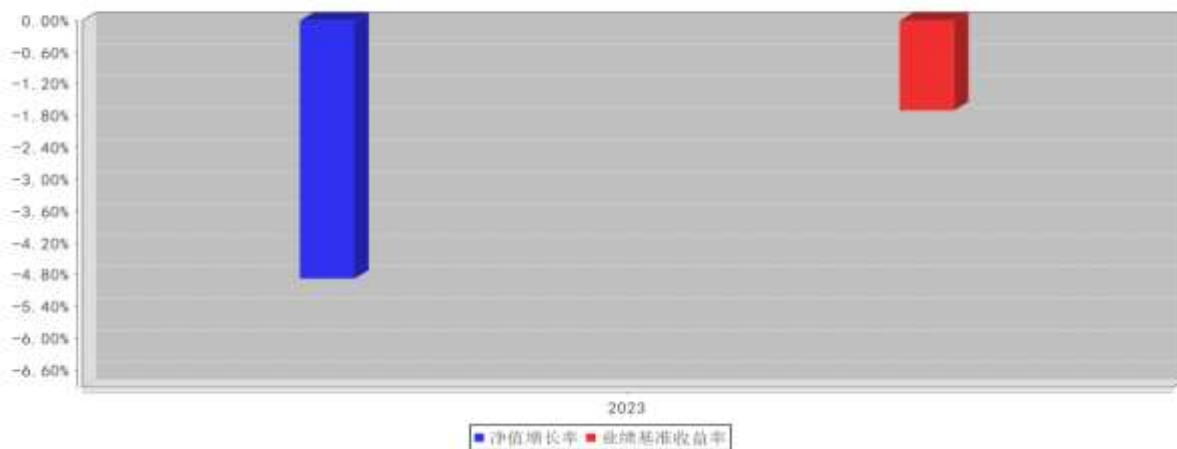
投资组合资产配置图表(2024年3月31日)



● 固定收益投资 ● 买入返售金融资产 ● 其他资产 ● 权益投资
● 银行存款和结算备付金合计

(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

大成可转债增强债券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) /持有期限(N)	收费方式/费率
赎回费	N<7天	1.5%
	7天≤N<30天	0.1%
	N≥30天	0.0

注：投资人申购C类基金份额时，不收取申购费用。

(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%	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	0.1%	销售机构
审计费用	30,000.00元	会计师事务所
信息披露费	80,000.00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、期货交易费用，基金的银行汇划费用，基金相关账户的开户及维护费用，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：

大成可转债增强债券C

基金运作综合费率（年化）
1.47%

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）基于投资范围的规定，本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%，其中对可转

债(含可分离交易可转债)的投资比例不低于固定收益类资产的 80%,无法完全规避发债主体特别是可转债、企业债和公司债的发债主体的信用质量变化造成的信用风险;如果债券市场出现整体下跌,本基金将无法完全避免债券市场系统性风险。

(2) 本基金主要投资于可转债品种,可转债的条款相对于普通债券而言更为复杂,对条款的忽视或研究不足可能为本基金带来损失。未来可转债类基金增多或债券市场上可转债类资产规模减小,可能导致本基金无法配足额比例的可转债或以较高昂代价持有可转债,则可产生不必要的损失。

(3) 本基金股票资产的投资比例最高可达基金资产的 20%,股票资产与债券资产相比具有更高的预期收益与风险。本基金在具体投资管理中,可能面临特定类型股票所具有的特有风险,也可能由于股票投资比例较高而带来较高的系统性风险。

(4) 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。

2、开放式基金共有的风险,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。

大成可转债增强债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会 2011 年 9 月 15 日证监许可(2011)1473 号文核准募集。

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. 大成可转债增强债券型证券投资基金基金合同、大成可转债增强债券型证券投资基金托管协议、大成可转债增强债券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