

大成策略回报混合型证券投资基金

基金产品资料概要更新

编制日期：2021年8月25日

送出日期：2021年8月27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 | 大成策略回报混合 | 基金代码 | 090007 |
| 基金管理人 | 大成基金管理有限公司 | 基金托管人 | 中国光大银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | 2008年11月26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 | 徐彦 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2020年3月20日 |
| | | 证券从业日期 | 2006年7月3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

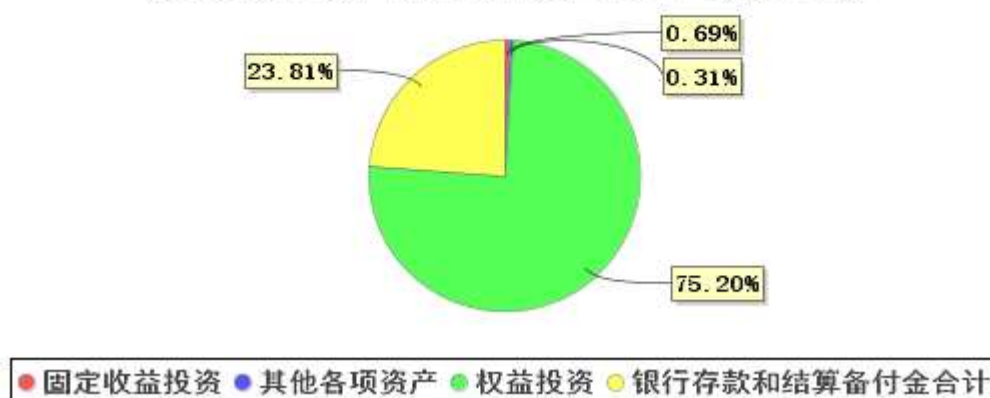
详见《大成策略回报混合型证券投资基金招募说明书》第九部分“基金的投资”。

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 追求基金资产的长期稳健增值，兼顾当期收益；同时，实施积极的分红政策，回报投资者。 |
| 投资范围 | 追求基金资产的长期稳健增值，兼顾当期收益；同时，实施积极的分红政策，回报投资者。 1. 本基金投资于国内依法公开发行的股票、存托凭证、权证、债券、资产支持证券及法律法规或监管机构允许基金投资的其他金融工具。 2. 本基金的股票、存托凭证投资比例范围为基金资产的60%—95%；权证投资比例范围为基金资产的0%—3%；债券投资比例范围为基金资产的0%—35%；资产支持证券投资比例范围为基金资产的0%—20%；现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券比例不低于基金资产净值的5%。 3. 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他证券市场或者其他品种或变更权证、资产支持证券等投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以相应调整本基金的投资范围、投资比例规定。 |
| 主要投资策略 | 本基金在控制风险的前提下，采取趋势投资策略进行总体资产配置；在行业配置、个股投资上分别实施行业轮动投资策略、核心-卫星策略、价值投资策略、买入并持有策 |

| | |
|--------|---|
| | 略，以期在承担中高风险的前提下获取尽可能高的投资收益；同时，强调收益管理，实施收益管理策略，以期在增长期及时锁定收益，制度性的减少未来可能的下跌风险，增加投资总收益。 1. 总体资产配置策略，2. 行业配置策略，3. 个股选择策略，4. 债券投资策略，5. 其他金融工具投资策略，6. 收益管理策略，7. 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。 |
| 业绩比较基准 | 80%×沪深 300 指数收益率+20%×中债综合指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金属于风险收益水平适中的混合型基金品种，其长期平均的预期收益和风险低于股票基金，高于债券基金和货币市场基金。 |

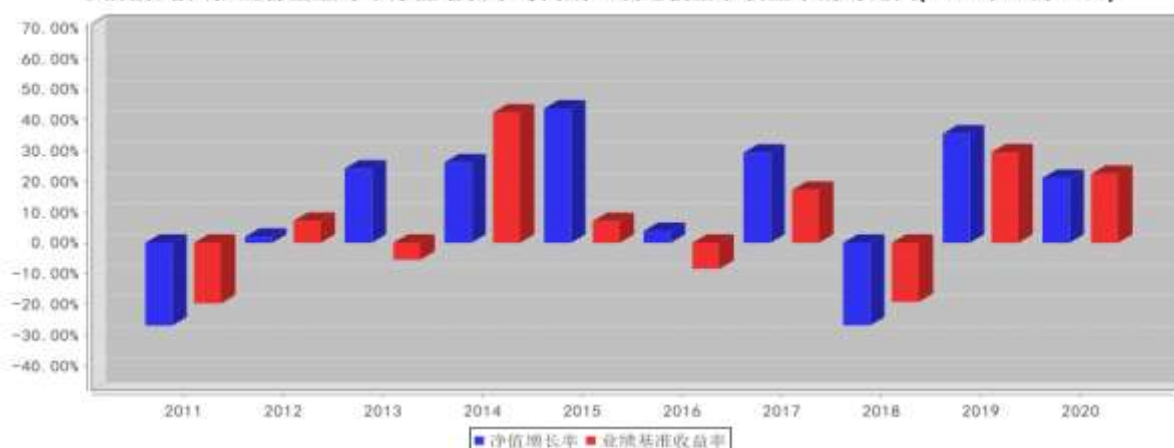
(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表(2021年6月30日)



(三) 自基金合同生效以来/最近十年（孰短）基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

大成策略回报混合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(2020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 |
|--------------|-----------------------------|-----------|
| 认购费 | M<50 万元 | 1.2% |
| | 50 万元≤M<200 万元 | 0.8% |
| | 200 万元≤M<500 万元 | 0.5% |
| | M≥500 万元 | 1,000 元/笔 |
| 申购费 (前收费) | M<50 万元 | 1.5% |
| | 50 万元≤M<200 万元 | 1% |
| | 200 万元≤M<500 万元 | 0.6% |
| | M≥500 万元 | 1,000 元/笔 |
| 赎回费 | N<7 天 | 1.5% |
| | 7 天≤N<1 年 | 0.5% |
| | 1 年≤N<2 年 | 0.25% |
| | N≥2 年 | 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 |
|------|--|
| 管理费 | 1.5% |
| 托管费 | 0.25% |
| 其他费用 | 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用、会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费、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：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。

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：在本基金投资运作过程中，将重视趋势预测模型、风险分解模型等数量化模型的运用，以优化本基金的资产配置效率。但是在极端市况下，个别模型因子的非理性波动可能造成模型信号失真，得出不恰当的资产配置结论，从而影响基金的收益水平。

本基金以价值型投资理念为基础，重视股票投资风险的防范。但是作为混合型基金，正常情况下，本基金股票投资比例将保持在 60%以上，无法完全规避股票市场的下跌风险。

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。

基金管理人将控制单一投资者持有基金份额的比例低于 50%，并防止投资者以其他方式变相规避 50%集中度限制的情形发生（运作过程中，因基金份额赎回等情形导致被动超标的除外）。如基金管理人认为接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者基金管理人认为可能存在变相规避 50%集中度限制的情形时，基金管理人有权拒绝该单一投资者的全部或部分的认/申购申请或确认失败。

2、投资存托凭证的相关风险。

3、本基金还面临证券投资基金投资共有的风险，如信用风险、科创板股票投资风险、市场风险、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。

大成策略回报混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2008 年 9 月 5 日证监许可【2008】1103 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. 大成策略回报混合型证券投资基金基金合同、大成策略回报混合型证券投资基金托管协议、大成策略回报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