

大成蓝筹稳健证券投资基金(A类份额)

基金产品资料概要更新

编制日期：2023年9月1日

送出日期：2023年9月7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 | 大成蓝筹稳健混合 | 基金代码 | 090003 |
| 下属基金简称 | 大成蓝筹稳健混合 A | 下属基金交易代码 | 090003 |
| 下属基金前端交易代码 | 090003 | 下属基金后端交易代码 | 091003 |
| 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 | 2004年6月3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 | 齐炜中 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2021年6月21日 |
| | | 证券从业日期 | 2012年7月4日 |
| 基金经理 | 张家旺 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2021年11月29日 |
| | | 证券从业日期 | 2016年7月14日 |
| 基金经理 | 赵蓬 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2023年8月4日 |
| | | 证券从业日期 | 2016年2月1日 |
| 其他 | 基金合同生效后的存续期间内，有效基金份额持有人数量连续 20 个工作日达不到 100 人，或连续 20 个工作日基金财产净值低于 5000 万元人民币，基金管理人应及时向中国证监会报告，说明出现上述情况的原因及解决方案。若有效基金份额持有人数量连续 60 个工作日达不到 100 人，或连续 60 个工作日基金财产净值低于人民币 5000 万元，基金管理人可宣布本基金终止。 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。 | | |

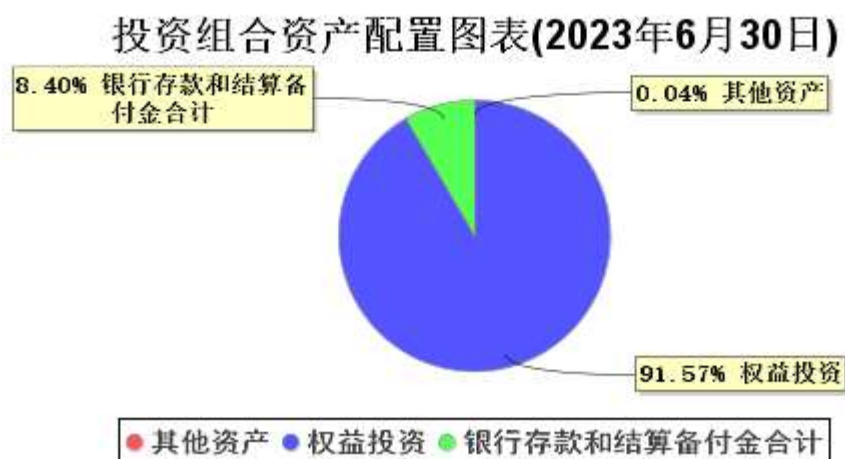
二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

详见《大成蓝筹稳健证券投资基金更新招募说明书》第九部分“基金投资”。

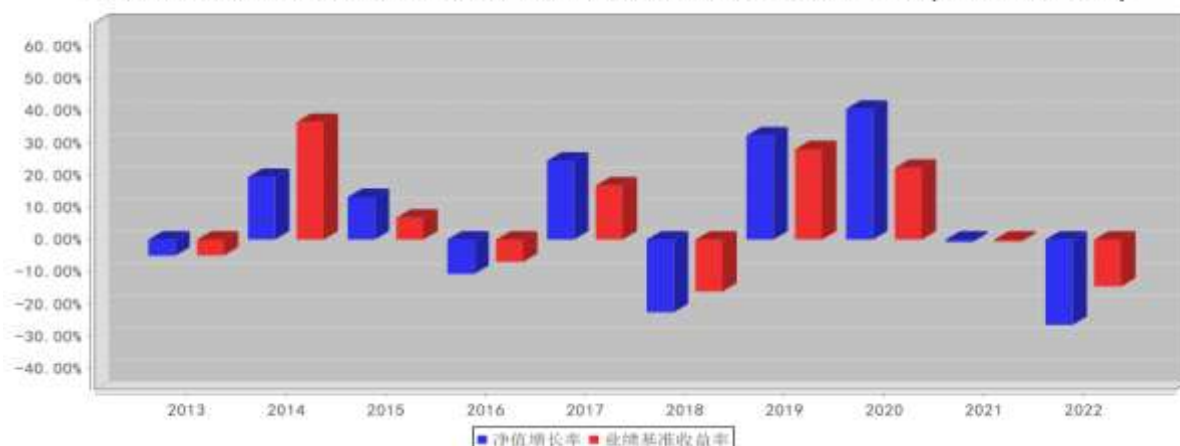
| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 通过精选符合本基金投资理念、流动性良好的证券，在控制非系统风险的前提下获取投资收益，同时辅助运用一系列数量分析方法，有效控制系统性风险，实现基金财产的中长期稳定增值。 |
| 投资范围 | 本基金主要投资于上证 180 指数成份股、深证 100 指数成份股以及未来可能入选成份股的股票、存托凭证，并适度投资于新股申购、股票、存托凭证增发申购等。债券投资以国债投资为主，并适度投资于国内依法公开发行、上市的金融债、企业（公司）债（包括可转债）等债券及中国证监会允许投资的其他金融工具。本基金投资股票、存托凭证比例为基金资产净值的 30%~95%，投资债券比例为基金资产净值的 0%~65%，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不低于基金资产净值的 5%。法律法规另有规定时从其规定。 |
| 主要投资策略 | <p>1、资产配置策略：本基金利用修正的恒定比例投资组合保险策略（CPPI）来动态调基金中股票、债券和现金的配置比例。</p> <p>2、行业配置策略：本基金的行业配置采取较为积极的策略，以投资基准的行业权重为基础，以行业研究及比较分析为核心，通过适时增大或降低相应行业的投资权重，使整体投资表现跟上或超越投资基准。</p> <p>3、个股选择策略：个股选择策略采用蓝筹成分股优选策略，运用“价值—势头”选股方法，优选出被市场低估并有良好市场表现，处于价值回归阶段的天相 280 指数成分股投资，并采用积极的资产管理方式，以期获得资本的稳健增值。</p> <p>4、债券投资策略：本基金的债券投资采用完全积极的投资策略，采用利率预测、久期管理、收益率曲线移动策略、相对价值评估、收益率利差策略、套利交易策略以及利用正逆回购进行杠杆操作等积极的投资策略，力求获得超过债券市场的收益。5、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 | $70\% \times \text{天相 280 指数收益率} + 30\% \times \text{中债综合指数收益率}$ |
| 风险收益特征 | 本基金属于较低风险证券投资基金，适于能承受一定风险，追求当期收益和长期资本增值的基金投资者投资。 |

(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/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

大成蓝筹稳健混合A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(2022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 |
|--------------|-------------------------|-----------|
| 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 |
| 申购费 (后收费) | N < 1 年 | 2% |
| | 1 年 ≤ N < 2 年 | 1.5% |
| | 2 年 ≤ N < 3 年 | 1% |
| | 3 年 ≤ N < 5 年 | 0.5% |
| | N ≥ 5 年 | 0.0 |
| 赎回费 | N < 7 天 | 1.5% |
| | 7 天 ≤ N < 1 年 | 0.5% |
| | N ≥ 1 年 | 0.25% |

注:养老金账户在基金管理人直销中心办理账户认证手续后,可享受申购费率优惠,具体情况可详见公司相关公告。

(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 | 1.2% |
| 托管费 | 0.2% |
| 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:

(1) CPPI 投资策略风险

本基金根据理论分析和实证研究的结果,采用修正的 CPPI 策略进行资产配置。但 CPPI 投资策略的有效性是建立在一系列假定条件基础上的,如参与主体可以无限度融入资金的假定,市场具有足够流动性的假定等,这些假定目前我国证券市场并不完全具备。另外,CPPI 投资策略在中国市场还是新生事物,实际效果尚未得到实践检验。所有这些因素都可能给基金的投资收益产生不利影响。

(2) 价值投机风险

本基金坚持价值投资理念,主要投资于上证 180 和深证 100 指数成分股等蓝筹绩优股票。自 2002 年底以来,价值投资理念受到了市场的追捧,上证 180 指数和深证 100 指数的涨幅明显超过大盘,部分大盘蓝筹股票涨幅超过 100%,媒介惊呼蓝筹时代来临。这一方面说明蓝筹绩优股票受到了市场广大投资者的青睐和追捧,价值投资有一个很好的市场前景,另一方面也反映了市场中可能存在的一种趋势:对某些绩优股票的过度追捧,最后使价值投资演变成价值投机,给基金投资带来风险。

(3) 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。

(4) 投资存托凭证的相关风险。

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。

(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。

大成蓝筹稳健证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会证监基金字【2004】36 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. 大成蓝筹稳健证券投资基金基金合同、大成蓝筹稳健证券投资基金托管协议、大成蓝筹稳健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