

大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金(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 | 大成沪深 300 增强发起式 | 基金代码 | 010908 |
| 下属基金简称 | 大成沪深 300 增强发起式 C | 下属基金交易代码 | 010909 |
| 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 | 2021 年 02 月 23 日 | | |
| 基金类型 | 股票型 | 交易币种 | 人民币 |
| 运作方式 | 契约型开放式 | 开放频率 | 每个开放日开放申购、赎回。 |
| 基金经理 | 夏高 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2021 年 02 月 23 日 |
| | | 证券从业日期 | 2011 年 1 月 1 日 |
| 基金经理 | 刘旺 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2024 年 1 月 2 日 |
| | | 证券从业日期 | 2018 年 5 月 18 日 |
| 其他 | <p>基金合同生效之日起 3 年后的对应日，若基金资产净值低于 2 亿元，基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。若届时法律法规或中国证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充时，则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。</p> <p>《基金合同》生效满 3 年后继续存续的，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，基金管理人应当在 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会。</p> <p>法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。</p> | | |

二、基金投资与净值表现

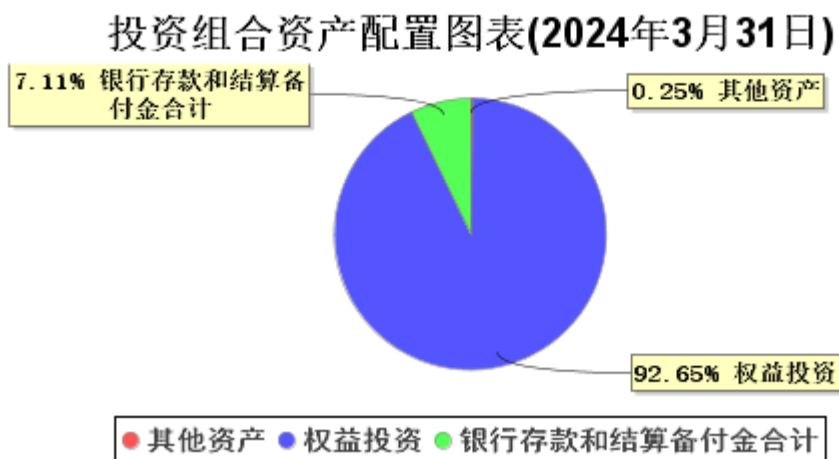
(一) 投资目标与投资策略

详见《大成沪深 300 指数增强型发起式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 | 本基金为增强型股票指数基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8.0%。 |
| 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 |

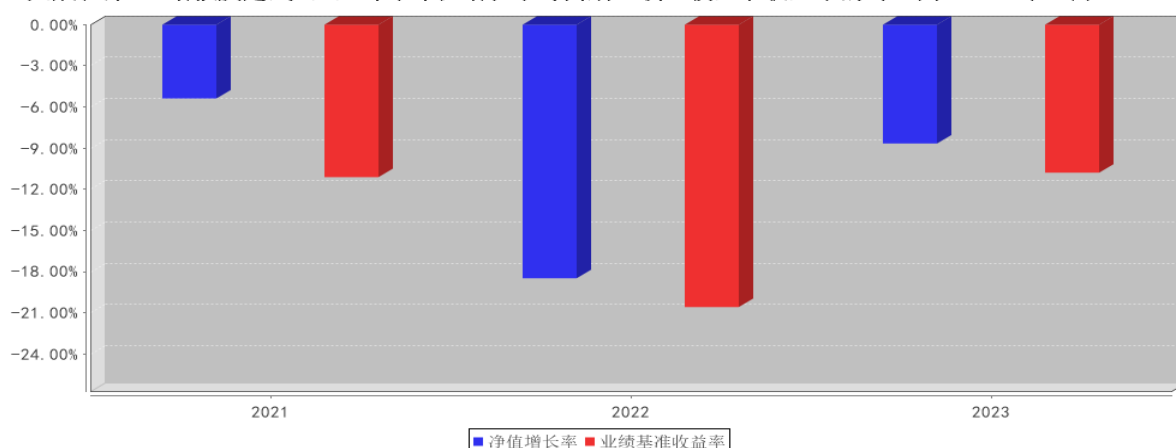
| | |
|--------|---|
| | <p>中小板、创业板及其他依法发行上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、衍生工具(包括股指期货、国债期货、股票期权等)、货币市场工具、同业存单、债券回购、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。</p> <p>基金的投资组合比例为：股票资产投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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>本基金在指数化投资的基础上通过数量化模型进行投资组合优化，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益。</p> <p>(一) 股票投资策略。1、指数化投资策略；2、指数增强型策略；3、股票组合调整；(二) 债券投资策略。(三) 资产支持证券投资策略。(四) 股指期货的投资策略。(五) 国债期货投资策略。(六) 股票期权投资策略。(七) 融资及转融通证券出借业务投资策略。</p> |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5% |
| 风险收益特征 | 本基金是股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 |

(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

大成沪深300增强发起式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% |
| | N ≥ 7 天 | 0% |

注：本基金份额不收取申购费。按照持有期限收取赎回费。

(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 | 0.8% | | 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 | 60,000.00 元 | | 会计师事务所 |
| 信息披露费 | 120,000.00 元 | | 规定披露报刊 |
| 指数许可使用费 | 0.016% | 年下限金额： 40,000.00 元 | 指数编制公司 |
| 其他费用 | 《基金合同》生效后的律师费、仲裁费和诉讼费，基金份额持有人大会费用，基金的证券、期货交易费用，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、标的指数使用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：

大成沪深 300 增强发起式 C

| 基金运作综合费率（年化） |
|--------------|
| 1.43% |

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。

本基金特有风险

1、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险。2、标的指数波动的风险。3、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险。4、标的指数变更的风险。5、主动增强投资的风险。6、股指期货与国债期货投资风险。7、参与融资、转融通证券出借业务的风险。8、资产支持证券的投资风险

(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。

大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2020 年 11 月 20 日证监许可【2020】3164 号文予以注册。

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. 大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同、大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金托管协议、大成沪深 300 指数增强型发起式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