

# 大成绝对收益策略混合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    | 大成绝对收益策略混合型发起式  | 基金代码           | 001791       |
| 下属基金简称  | 大成绝对收益混合发起C   | 下属基金交易代码       | 001792       |
| 基金管理人   | 大成基金管理有限公司  | 基金托管人          | 中国农业银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | 2015年9月23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    | 李绍  | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2021年10月21日  |
|         |   | 证券从业日期         | 2000年4月1日    |
| 其他      | 本基金基金合同生效满三年之日，若基金资产净值低于2亿元的，基金合同自动终止，同时不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。法律法规另有规定时，从其规定。基金合同生效3年后的存续期内，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

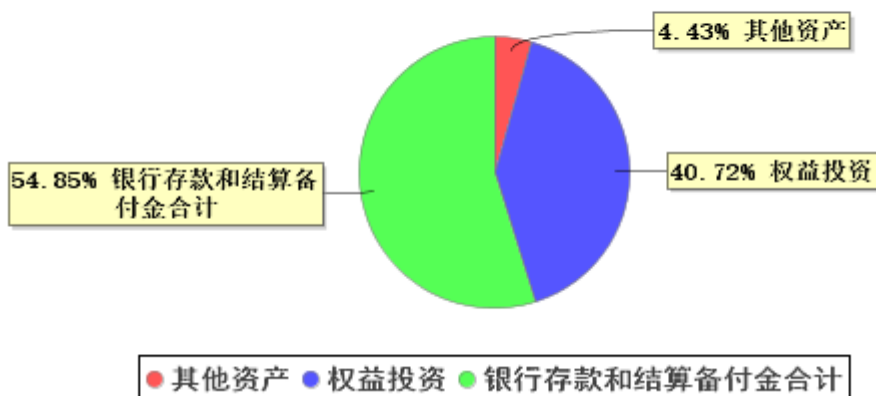
详见《大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金更新招募说明书》第八部分“基金的投资”。

|      |  |
|------|--|
| 投资目标 | 灵活配置股票和债券等各类资产的比例，优选量化投资策略进行投资，在有效控制风险的基础上，运用股指期货等工具对冲市场风险，寻求基金资产的长期稳健增值。  |
| 投资范围 | 本基金投资于依法发行或上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括：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，股指期货、权证，债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、中小企业私募债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等，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的相关规定）。本基金的投资组合比例为：本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的比例范围在80%—120%之间。其中：权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票、存托凭证市值、卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计 |

|        |  |
|--------|--|
|        | <p>值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票、存托凭证市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计值。</p> <p>每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%。</p> <p>在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金（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的比例合计不低于基金资产净值的5%。</p> <p>本基金不受中国证监会《证券投资基金参与股指期货交易指引》第五条第（一）项、第（三）项、第（五）项及第（七）项的限制。</p> <p>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。</p>            |
| 主要投资策略 | <p>本基金采用多种绝对收益策略，剥离系统性风险，力争实现稳定的绝对回报。</p> <p>1、Alpha 对冲策略<br/>本基金通过持续、科学、系统、深入的研究构建多头股票组合，并匹配合适的空头工具，剥离系统性风险。</p> <p>2、其他绝对收益策略<br/>本基金主要采用事件驱动、股指期货套利的对冲策略来捕捉绝对收益机会。同时，本基金根据市场情况的变化，灵活运用其他绝对收益策略（如统计套利策略、定向增发套利策略、大宗交易套利、并购套利策略等）策略提高资本的利用率，从而提高绝对收益，达到投资策略的多元化以进一步降低本基金收益的波动。</p> <p>3、其他投资策略<br/>（1）债券投资策略；（2）衍生品投资策略；（3）中小企业私募债投资策略；（4）存托凭证投资策略。</p> |
| 业绩比较基准 | 一年期定期存款基准利率（税后）  |
| 风险收益特征 | 本基金具有低波动率、低下方风险的特点，并且运用股指期货对冲投资组合的系统性风险，其预期收益及风险水平低于股票型基金，但高于债券型基金，属于中低风险水平的基金。  |

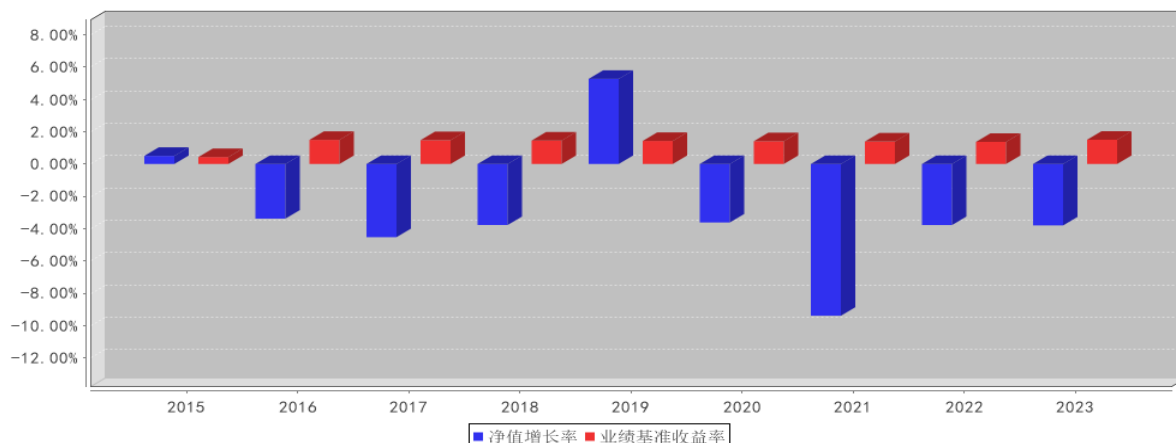
## （二）投资组合资产配置图表/区域配置图表

### 投资组合资产配置图表(2024年3月31日)



## （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

大成绝对收益混合发起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%    |
|      | $7 \text{ 天} \leq N < 30$ 天 | 0.5%    |
|      | $N \geq 30$ 天               | 0.0     |

注：本基金份额不收取申购费。

#### （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   | 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 | 0.8%  | 销售机构       |
| 审计费用  | 20,000.00 元   | 会计师事务所     |
| 信息披露费 | 0.00 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和诉讼费；基金份额持有人大会费用（包括但不限于场地费、会计师费、律师费和公证费）；基金的证券交易费用；基金的银行汇划费用；基金的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：

大成绝对收益混合发起 C

| 基金运作综合费率（年化） |
|--------------|
| 2.40%        |

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、本基金的特定风险

(1) 巨额赎回风险。(2) 绝对收益策略失败风险。(3) 卖空风险。(4) 股票选择风险。(5) 本金损失风险。(6) 基差风险。(7) 杠杆风险。(8) 到期日风险。(9) 对手方风险。(10) 盯市结算风险。(11) 平仓风险。(12) 连带风险。(13) 基金资产投资特定投资对象的其他风险。

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、信用风险、流动性风险、管理风险、投资于中小企业私募债券的风险、操作或技术风险、合规性风险、科创板股票投资相关风险、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。

大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2015 年 5 月 19 日证监许可【2015】938 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. 大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金基金合同、大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金托管协议、大成绝对收益策略混合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