大成智选量化选股股票型证券投资基金(A 类份额)

基金产品资料概要更新

编制日期：2026 年 11 月 4 日

送出日期：2026 年 11 月 5 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	大成智选量化选股股票	**基金代码**	029061
下属基金简称	大成智选量化选股股票 A	**下属基金交易代码**	029061
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	2026 年 11 月 3 日		
基金类型	股票型	**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	夏高	**开始担任本基金基金经理的日期**	2026 年 11 月 3 日
		证券从业日期	2011 年 1 月 1 日
其他	《基金合同》生效后，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。 法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。		

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

详见《大成智选量化选股股票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	本基金通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资范围	本基金的投资范围主要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（包括主板、创业板、科创板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、存托凭证、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（简称“港股通标的股票”）、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、政府支持债券、地方政府债、可交换债券、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、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款等)、货币市场工具、股指期货、国债期货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。 本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定参与融资业务。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。 基金的投资组合比例为：本基金投资于股票、存托凭证的比例为基金资产的 80%-95%（港股通标的股票投资比例不超过本基金股票资产的 50%）。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当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；股指期货、国债期货的投资比例遵循国家相关法律法规。 如法律法规或监管机构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。
主要投资策略	（一）大类资产配置策略 （二）股票投资策略 （三）债券投资策略 （四）资产支持证券投资策略 （五）可转换债券投资策略 （六）可交换债券投资策略 （七）股指期货的交易策略 （八）国债期货交易策略 （九）融资买入股票策略 （十）存托凭证投资策略
业绩比较基准	中证全指指数收益率×90%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×5%+活期存款基准利率×5%
风险收益特征	本基金是股票型证券投资基金，预期风险和预期收益高于混合型、债券型基金和货币市场基金。本基金若投资港股通标的股票，则需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

截至本文件编制日，本基金尚未披露季度报告。

(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

截至本文件编制日，本基金尚未披露年度报告。

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＜500 万元	0.8%
	M≥500 万元	1,000 元/笔
赎回费	N＜7 天	1.5%
	7 天≤N＜30 天	1.0%
	30 天≤N＜180 天	0.5%
	N≥180 天	0.0

注：投资者在申购 A 类基金份额时需交纳申购费，费率按申购金额递减，但通过管理人直销渠道申购的不收取申购费。

(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
信息披露费	10,000.00 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、仲裁费和诉讼费；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、期货等交易费用；基金的银行汇划费用；基金的开户费用、账户维护费用，以及与账户相关的网银等费用；因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；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

截至本文件编制日，本基金尚未披露年度报告。

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。

投资于本基金主要面临以下风险：

（一）市场风险

1、政策风险；2、经济周期风险；3、利率风险；4、购买力风险；5、国际竞争风险；6、上市公司经营风险。

（二）流动性风险

（三）信用风险

（四）本基金特有风险

1、量化选股模型失效的风险

2、衍生品投资风险

(1) 参与股指期货交易的风险

本基金参与股指期货交易，股指期货交易需承受市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险和法律风险等。由于股指期货通常具有杠杆效应，价格波动比标的工具更为剧烈，有时候比投资标的资产要承担更高的风险，并且由于股指期货定价复杂，不适当的估值有可能使基金资产面临损失风险。股指期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，股价指数微小的变动就可能会使投资者权益遭受较大损失。股指期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来重大损失。

(2) 参与国债期货交易的风险

国债期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当相应期限国债收益率出现不利变动时，可能会导致投资人权益遭受较大损失。国债期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来重大损失。

3、参与融资业务的风险

4、资产支持证券投资风险

5、科创板股票投资风险

6、存托凭证投资风险
7、基金进入清算期的相关风险
8、基金投资者实际收到的赎回款项或清算款项的金额可能与按披露的基金份额净值计算的结果存在差异。投资者的实际赎回金额和清算资金以登记机构确认数据为准。
（五）操作或技术风险
（六）不可抗力风险
（七）本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险
八、港股通每日额度限制
九、汇率风险
十、境外投资风险
十一、启用侧袋机制的风险
十二、其他风险

(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。

大成智选量化选股股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2026 年 8 月 25 日证监许可【2026】2299 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. 大成智选量化选股股票型证券投资基金基金合同、大成智选量化选股股票型证券投资基金托管协议、大成智选量化选股股票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