

大成稳益 90 天滚动持有债券型证券投资基金 (A 类份额)

基金产品资料概要更新

编制日期：2022 年 12 月 05 日

送出日期：2022 年 12 月 07 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 | 大成稳益 90 天滚动持有债券 | 基金代码 | 013399 |
| 下属基金简称 | 大成稳益 90 天滚动持有债券 A | 下属基金交易代码 | 013399 |
| 基金管理人 | 大成基金管理有限公司 | 基金托管人 | 兴业银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | 2022 年 03 月 28 日 | | |
| 基金类型 | 债券型 | 交易币种 | 人民币 |
| 运作方式 | 契约型、开放式 | 开放频率 | 基金份额每个运作期到期日，基金份额持有人方可就该基金份额提出赎回申请。基金管理人自基金合同生效日后的第 90 天（如该日为非工作日，则顺延到下一工作日）开始办理赎回，具体日期在赎回开始公告中规定。 |
| 基金经理 | 汪伟 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2022 年 03 月 28 日 |
| | | 证券从业日期 | 2013 年 6 月 1 日 |
| 基金经理 | 方锐 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2022 年 12 月 04 日 |
| | | 证券从业日期 | 2016 年 11 月 10 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五千万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 50 个工作日出现前述情形的，《基金合同》自动终止，无需召开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

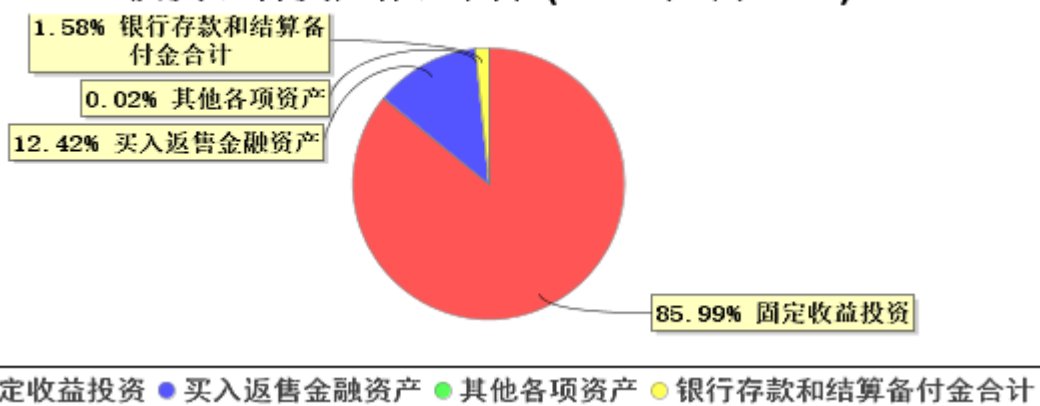
详见《大成稳益 90 天滚动持有债券型证券投资基金招募说明书》第九部分“基金的投资”。

| | |
|------|--|
| 投资目标 | 以保持基金资产的安全性和适当流动性为首要目标，追求高于业绩比较基准的稳定收益。 |
| 投资范围 | 本基金的投资范围主要包括国内依法发行、上市的债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债券、企业债券、公司债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据、公开 |

| | |
|---------------|--|
| | <p>发行的次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、可分离交易可转债的纯债部分)、资产支持证券、现金、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、债券回购、货币市场工具、国债期货、信用衍生品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,但需符合中国证监会的相关规定。</p> <p>本基金不参与股票、可转换债券(可分离交易可转债中的纯债部分除外)、可交换债券的投资。</p> <p>如果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> <p>本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%;每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金应当保持不低于基金资产净值的 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。</p> <p>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。</p> |
| 主要投资策略 | <p>本基金以利率趋势分析为基础,结合经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析,实施积极的债券投资组合管理,以获取较高的债券组合投资收益。</p> <p>1、久期配置</p> <p>本基金通过对宏观经济变量(包括国内生产总值、工业增长、货币信贷、固定资产投资、消费、外贸差额、财政收支、价格指数和汇率等)和宏观经济政策(包括货币政策、财政政策、产业政策、外贸和汇率政策等)进行分析,对未来较长的一段时间内的市场利率变化趋势进行预测,决定组合的久期。</p> <p>2、类属配置</p> <p>3、信用债投资策略</p> <p>本基金将投资信用评级不低于 AA 的信用债(包括企业债券、公司债券、金融债(不包含政策性金融债)、公开发行的次级债、政府支持机构债、中期票据、短期融资券、超短期融资券)。</p> <p>4、资产支持证券投资策略</p> <p>5、国债期货投资策略</p> <p>6、信用衍生品投资策略</p> |
| 业绩比较基准 | <p>本基金业绩比较基准为中债-新综合全价(1 年以下)指数收益率*80%+银行活期存款利率(税后)*20%。</p> |
| 风险收益特征 | <p>本基金为债券型基金,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。</p> |

(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(2022年9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
截止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 |
|--------------|-------------------------|-----------|
| 认购费 | M<100 万元 | 0.2% |
| | 100 万元≤M<500 万元 | 0.1% |
| | M≥500 万元 | 1,000 元/笔 |
| 申购费 (前收费) | M<100 万元 | 0.2% |
| | 100 万元≤M<500 万元 | 0.1% |
| | M≥500 万元 | 1,000 元/笔 |

注:本基金份额收取认购费、申购费。不收取赎回费。

(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 |
|------|---|
| 管理费 | 0.25% |
| 托管费 | 0.05% |
| 其他费用 | 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;《基金合同》生效后与基金相关的会计师事务所费、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、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: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。

本基金特有风险:

1、滚动持有运作方式的风险

(1) 每个运作期到期日前, 基金份额持有人不能赎回基金份额的风险

对于每份基金份额, 基金管理人仅在该基金份额的每个运作期到期日为基金份额持有人办理赎回, 在非运作期到期日, 基金管理人不能为基金份额持有人办理赎回, 且本基金不上市交易, 基金份额持有人面临流动性风险。

(2) 运作期到期日, 基金份额持有人未申请赎回或赎回被确认失败, 到期的基金份额自动进入下一个运作期风险。如果基金份额持有人在每份基金份额的当期运作期到期日未申请赎回或赎回被确认失败, 则该基金份额将在该运作期到期后自动进入下一个运作期。在下一个运作期到期日前, 基金份额持有人不能赎回基金份额, 基金份额持有人持有的基金份额将面临滚动运作的风险。

(3) 每份基金份额每个实际运作期可能长于或短于 90 天的风险

2、本基金为债券型基金, 债券的投资比例不低于基金资产的 80%, 该类债券的特定风险即成为本基金及投资者主要面对的特定投资风险。

3、本基金投资资产支持证券, 资产支持证券是一种债券性质的金融工具。资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险。

4、本基金投资范围包括国债期货等金融衍生品, 国债期货等金融衍生品投资可能给本基金带来额外风险。

5、信用衍生品投资风险

本基金可投资于信用衍生品, 信用衍生品的投资可能面临流动性风险、偿付风险以及价格波动风险等。

6、基金合同终止的风险

《基金合同》生效后, 连续 50 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人民币 5000 万元情形的, 基金合同应当终止, 无需召开基金份额持有人大会。

(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。

大成稳益 90 天滚动持有债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会 2021 年 8 月 6 日证监许可【2021】2608 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. 大成稳益 90 天滚动持有债券型证券投资基金基金合同、大成稳益 90 天滚动持有债券型证券投资基金托管协议、大成稳益 90 天滚动持有债券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