

# 大成元合双利债券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：2022年9月9日

送出日期：2022年9月10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    | 大成元合双利债券发起式                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | 基金代码           | 015898      |
| 下属基金简称  | 大成元合双利债券发起式C                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | 下属基金交易代码       | 015899      |
| 基金管理人   | 大成基金管理有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | 基金托管人          | 上海银行股份有限公司  |
| 基金合同生效日 | 2022年09月08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           | 每个开放日       |
| 基金经理    | 岳苗                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2022年09月08日 |
|         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                | 证券从业日期         | 2012年9月1日   |
| 其他      | <p>《基金合同》生效之日起满三年后的对应日，若基金资产净值低于2亿元，《基金合同》自动终止并按其约定程序进行清算，无需召开基金份额持有人大会审议，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续《基金合同》期限。如届时有效的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、更改或补充的，则本基金按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《大成元合双利债券型发起式证券投资基金招募说明书》第九部分“基金的投资”。

|      |                                                                                                                                                                                              |
|------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 在严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳健增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。                                                                                                                                     |
| 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（包括主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、存托凭证、港股通标的股票、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、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、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的 |

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>债券)、资产支持证券、债券回购、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、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,但须符合中国证监会的相关规定。</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> <p>基金的投资组合比例为:本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%,投资于股票、存托凭证、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券的比例合计不超过基金资产的 20%;投资于港股通标的股票占本基金股票资产的比例为 0%-50%。本基金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,持有现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。</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>本基金运用自上而下的宏观分析和自下而上的市场分析相结合的方法实现大类资产配置,把握不同的经济发展阶段各类资产的投资机会,根据宏观经济、基准利率水平等因素,预测债券类资产、货币市场工具等大类资产的预期收益率水平,结合各类别资产的波动性以及流动性状况分析,进行大类资产配置。</p> <p>1、债券投资策略</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>本基金对不同类型固定收益品种的信用风险、税赋水平、市场流动性、市场风险等因素进行分析,研究同期限的国债、金融债、企业债、交易所和银行间市场投资品种的利差和变化趋势,制定债券类属配置策略,以获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。</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、资产支持证券)。</p> <p>(4) 可转债投资策略</p> <p>可转换债券在分析基础股票的基本面、转债条款和市场面三方面因素的前提下,将敏感度指标(Delta、Vega 等)作为市场风险控制的主要技术指标,利用可转换债券溢价率来判断转债的股性,运用转换套利、溢折价、一级市场申购、纯债券价值及期权价值管理来积极投资,获取超额收益。</p> <p>2、国债期货投资策略</p> <p>为有效控制债券投资的系统性风险,本基金根据风险管理的原则,以套期保值为目的,适度运用国债期货,提高投资组合的运作效率。</p> <p>3、信用衍生品投资策略</p> <p>4、股票投资策略</p> <p>(1) A 股投资策略</p> <p>(2) 港股投资策略</p> |

|        |                                                                                                     |
|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | 5、存托凭证投资策略                                                                                          |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率*10%+恒生指数收益率（使用估值汇率调整）*5%+中债综合全价指数收益率×80%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）*5%                        |
| 风险收益特征 | 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。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

截至本报告编制日，本基金尚未披露季度报告。

## （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

截至本报告编制日，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）<br>/持有期限（N） | 收费方式/费率 |
|------|-------------------------|---------|
| 赎回费  | N<7 天                   | 1.5%    |
|      | N≥7 天                   | 0%      |

注：本基金份额不收取认购费、申购费。按持有时间收取赎回费。

### （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   | 0.3%                                                                                                                                                                                                                               |
| 托管费   | 0.05%                                                                                                                                                                                                                              |
| 销售服务费 | 0.1%                                                                                                                                                                                                                               |
| 其他费用  | 基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；基金份额持有人大会费用；基金的证券/期货/期权交易、结算费用；基金的银行汇划费用、账户开户及维护费用；基金收益分配中发生的费用；基金登记费用；基金投资其他基金份额产生的费用（包括但不限于申购费、赎回费以及销售服务费用等），但法律法规禁止从基金财产中列支的除外；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：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）期货投资风险

本基金参与国债期货交易。期货作为一种金融衍生品，具备自身特有的风险点。投资期货所面临的主要

风险是市场风险、流动性风险、基差风险、保证金风险、信用风险、和操作风险。

(2) 基金进入清算期的相关风险

基金进入清算程序后,基金管理人将及时变现资产,但由于变现过程中的市场波动、流动受限证券无法及时变现而可能面临的进一步损失、清算费用等原因,基金份额持有人将可能面临最终收到的全部清算款偏离该基金最后运作日公告的净值信息的风险。

(3) 本基金投资于资产支持证券的风险

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) 信用衍生品投资风险

本基金可投资于信用衍生品,信用衍生品作为一种金融衍生品,具备一些特有的风险点。

(5) 基金合同终止的风险

由于本基金为发起式基金,根据相关法规规定,基金合同生效之日起三年后的对应日,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。本基金将根据基金合同的约定进行基金财产清算并终止,投资人将面临基金终止清盘的风险。

## (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。

大成元合双利债券型发起式证券投资基金招募说明书(以下简称“本基金”)经中国证监会【2022】1003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. 大成元合双利债券型发起式证券投资基金基金合同、大成元合双利债券型发起式证券投资基金托管协议、大成元合双利债券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