大成动态量化配置策略混合型证券投资基金(C 类份额)

基金产品资料概要更新

编制日期：2022 年 10 月 18 日

送出日期：2022 年 10 月 19 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	大成动态量化配置策略混合	**基金代码**	003147
下属基金简称	大成动态量化配置策略混合 C	**下属基金交易代码**	015526
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	2016 年 9 月 20 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	刘淼	**开始担任本基金基金经理的日期**	2022 年 10 月 13 日
		证券从业日期	2008 年 04 月 01 日
其他	基金合同生效后，连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百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；连续六十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、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。法律法规、基金合同另有规定时，从其规定。		

二、基金投资与净值表现

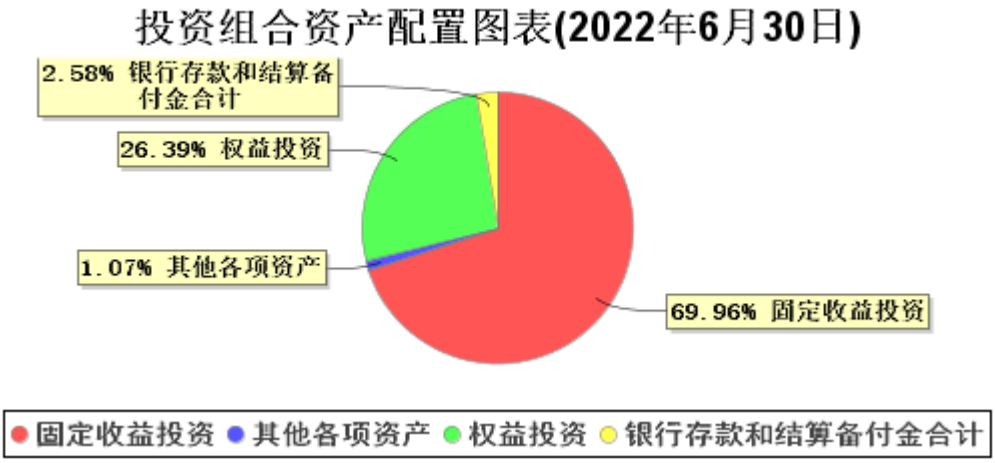
(一) 投资目标与投资策略

详见《大成动态量化配置策略混合型证券投资基金招募说明书》第八部分“基金的投资”。

投资目标	本基金运用量化投资策略进行资产配置和股票投资，并通过数学建模的方式根据宏观经济变量以及风险预警指标动态调整资产配置的比例，在有效控制风险的前提下追求基金资产长期稳定增长。
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）、存托凭证等权益类金融工具、债券等固定收益类金融工具(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、超级短期融资券、资产支持证券、债券回购等)、货币市场工具、银行存款、国债期货、权证、股指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相关规定)。 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：股票、存托凭证等权益类资产占基金资产的比例不低于 10%；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%，权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。
主要投资策略	1、大类资产配置策略 本基金通过动态资产配置模型进行资产配置。动态资产配置模型包括量化资产配置和动态调整两个层次。 2、股票投资策略：（1）动态多因子模型选股。本基金采用动态多因子模型进行量化选股，动态多因子选股模型是在传统多因子模型上引入机器学习等人工智能算法，自适应地根据宏观经济环境的变化动态筛选有效选股因子，构建和优化投资组合。（2）择时对冲。本基金在运作过程中，将采用择时对冲的策略，根据期货基差情况确定是否进行对冲以及对冲的比例，充分考虑对冲的效果以及对冲的成本，以达到择时对冲，最大化投资收益的目标。3、风险预警监控。4、权证投资策略；5、债券投资策略；6、可转换债券投资策略；7、中小企业私募债投资策略；8、股指期货投资策略。9、国债期货投资策略。10、资产支持证券投资策略。11、存托凭证投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*50%+中债综合指数收益率*50%
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，高于货币市场基金与债券型基金，属于风险水平中高的基金。

(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/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
赎回费	N＜7 天	1.5%
	7 天≤N＜30 天	0.5%

	N≥30 天	0%

(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	0.6%
托管费	0.15%
销售服务费	0.4%
其他费用	《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用、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、期货交易费用，基金的银行汇划费用，基金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: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。

1、本基金特有风险

（1）股指期货与国债期货投资风险

本基金参与股指期货与国债期货交易。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、开放式基金共有的风险，如市场风险、管理风险、流动性风险、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。

大成动态量化配置策略混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2016 年 7 月 19 日证监许可【2016】1630 号文注册募集。

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. 大成动态量化配置策略混合型证券投资基金基金合同、大成动态量化配置策略混合型证券投资基金托管协议、大成动态量化配置策略混合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