

新华大盘成长量化选股混合型发起式证券投资基金 (新华大盘成长量化选股混合发起A) 基金产品资料

概要

编制日期：2026年1月22日

送出日期：2026年1月23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	新华大盘成长量化选股混合发起	基金代码	026699
下属基金简称	新华大盘成长量化选股混合发起 A	下属基金代码	026699
基金管理人	新华基金管理股份有限公司	基金托管人	北京银行股份有限公司
基金合同生效日			
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	林翟	开始担任本基金基金经理的日期	
		证券从业日期	2009-09-01

注：1、《基金合同》生效之日起三年后的对应日（若无对应日则顺延至下一日），若基金资产规模低于2亿元，本基金应当按照基金合同约定的程序进行清算并终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。若届时法律法规或证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充时，则本基金可以参照届时有效的法律法规或证监会规定执行。

2、《基金合同》生效三年后继续存续的，自基金合同生效满三年后的基金存续期内，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50个工作日出现前述情形的，本基金将终止基金合同，无需召开基金份额持有人大会审议。

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

投资者可阅读《招募说明书》第九章了解详细情况。

投资目标	本基金重点关注大盘成长风格相关上市公司股票的投资机会，主要通过量化模型精选个股，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（包含主板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、地方政府债、政府支持债券、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债

券（含分离交易可转债）、可交换债券、公开发行的次级债等）、资产支持证券、债券回购、股指期货、国债期货、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、现金等，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）。

本基金可根据法律法规的规定参与融资业务。

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：本基金的股票投资比例为基金资产的60%-95%（其中港股通标的股票投资比例不超过股票资产的50%），投资于大盘股的比例不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会允许，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 本基金的主要投资策略包括：资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、可转换债券、可交换债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货、国债期货交易策略、参与融资业务策略。

业绩比较基准 中证800指数收益率×70%+中证港股通中国100(人民币)收益率*10%+中债综合全价指数收益率×20%

风险收益特征 本基金为混合型证券投资基金，预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。本基金若投资港股通标的的股票，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

(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

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	备注
认购费	M < 50 万元	0.80%	
	50 万元 ≤ M < 200 万元	0.50%	
	200 万元 ≤ M < 500 万元	0.30%	
	M ≥ 500 万元	按笔收取，1,000 元/笔	
申购费（前收费）	M < 50 万元	0.80%	
	50 万元 ≤ M < 200 万元	0.50%	
	200 万元 ≤ M < 500 万元	0.30%	

	M \geq 500 万元	按笔收取，1,000 元/笔
赎回费	N $<$ 7 日	1.50%
	7 日 \leq N $<$ 30 日	1.00%
	30 日 \leq N $<$ 180 日	0.50%
	N \geq 180 日	0.00%

注：1、通过直销机构认购、申购本基金 A 类基金份额的，不收取前端认购、申购费用；

2、上表中的认购/申购费率适用于通过其他销售机构认购、申购本基金 A 类基金份额的情形，投资人在认购、申购时支付认购、申购费用；

3、赎回费用由赎回相应类别基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回相应类别的基金份额时收取。投资者赎回基金份额产生的赎回费全额计入基金财产。

（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	收费方
管理费	1.20%	基金管理人、销售机构
托管费	0.20%	基金托管人
审计费用	-	会计师事务所
信息披露费	-	规定披露报刊
其他费用	《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、公证费、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、结算等费用；基金的银行汇划费用；基金的证券/期货账户开户费用、账户维护费；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	相关服务机构

注：本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。以上费用年金额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。

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、本基金的主要风险

本基金的主要风险包括：市场风险、管理风险、流动性风险、操作或技术风险、本基金的特有风险及其他风险。

2、本基金的特有风险

（1）本基金为混合型基金，本基金的股票投资比例为基金资产的 60%-95%（其中港股通标的股票投资比例不超过股票资产的 50%），投资于大盘股的比例不低于非现金基金资产

的 80%。因此，国内和港股通标的股票市场、债券市场的变化均会影响到基金业绩表现，基金净值表现因此可能受到影响。基金管理人对于大盘股相关股票的界定、筛选、研究能力将影响到基金业绩表现，基金净值表现因此可能受到影响。

本基金采用量化模型构建投资组合，量化模型仅是选股模型，本基金不采用量化模型进行高频交易。在实际运作过程中，本基金采用量化模型选择股票并构建投资组合，存在失效并导致基金亏损的风险；同时，宏观经济环境、股票市场环境、交易规则等重大变化也可能影响模型的有效性，无法达到预期投资效果。

（2）港股通标的股票的投资风险

1) 本基金可通过“内地与香港股票市场交易互联互通机制”投资于香港市场，在市场进入、投资额度、可投资对象、税务政策等方面都有一定的限制，而且此类限制可能会不断调整，这些限制因素的变化可能对本基金进入或退出当地市场造成障碍，从而对投资收益以及正常的申购赎回产生直接或间接的影响。

2) 香港市场交易规则有别于内地 A 股市场规则，此外，在“内地与香港股票市场交易互联互通机制”下参与香港股票投资还将面临包括但不限于如下特殊风险：① 港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动；② 只有内地、香港两地均为交易日且能够满足结算安排、开通港股通交易的交易日才为港股通交易日，在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险；③ 香港出现香港联合交易所规定的情形时，香港联合交易所将可能停市，投资者将面临在停市期间无法进行港股通交易的风险；出现内地证券交易服务公司认定的交易异常情况时，内地证券交易服务公司可能暂停提供部分或者全部港股通服务，投资者将面临在暂停服务期间无法进行港股通交易的风险；④ 投资者因港股通股票权益分派、转换、上市公司被收购等情形或者异常情况，所取得的港股通股票以外的香港联合交易所上市证券，可以通过港股通卖出，但不得买入，内地证券交易服务公司另有规定的除外；因港股通股票发行人供股、股票权益分派或者转换等情形取得的香港联合交易所上市股票的认购权利凭证在香港联合交易所上市的，可以通过港股通卖出，但不得买入，其行权等事宜按照中国证监会、中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）的相关规定处理；因港股通股票权益分派、转换或者上市公司被收购等所取得的非香港联合交易所上市证券，可以享有相关权益，但不得通过港股通买入或卖出。⑤ 代理投票。由于中国结算是汇总投资者意愿后再向香港中央结算有限公司（以下简称“香港结算”）提交投票意愿，中国结算对投资者设定的意愿征集期比香港结算的征集期稍早结束；投票没有权益登记日的，以投票截止日的持有作为计算基准；投票数量超出持有数量的，按照比例分配持有基数。以上所述因素可能会给本基金投资带来特殊交易风险。

3) 汇率风险：本基金可投资港股通标的股票，在交易时间内提交订单依据的港币买入参考汇率和卖出参考汇率，并不等于最终结算汇率。港股通交易日日终，中国结算进行净额换汇，将换汇成本按成交金额分摊至每笔交易，确定交易实际适用的结算汇率。故本基金投资面临汇率风险，汇率波动可能对基金的投资收益造成损失。

4) 港股交易失败风险：港股通业务期间存在每日额度限制。在香港联合交易所开市前阶段，当日额度使用完毕的，新增的买单申报将面临失败的风险；在香港联合交易所持续交易时段，当日额度使用完毕的，当日本基金将面临不能通过港股通进行买入交易的风险。

5) 本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票，基金资产并非必然投资港股通标的股票。

（3）股指期货、国债期货交易的风险

1) 本基金的投资范围包括投资股指期货，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人权益遭受较大损失。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。

2) 本基金可参与国债期货交易，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。

(4) 基金投资资产支持证券的风险

本基金投资于资产支持证券。资产支持证券的投资风险主要包括流动性风险、利率风险及评级风险等。由于资产支持证券的投资收益来自于基础资产产生的现金流或剩余权益，因此资产支持证券投资还面临基础资产特定原始权益人的破产风险及现金流预测风险等与基础资产相关的风险。

(5) 本基金可投资科创板股票，可能面临退市风险、市场风险、流动性风险等特有风险，从而可能给基金净值带来不利影响或损失。本基金根据投资策略需要或市场环境变化，可选择将部分基金资产投资于科创板股票或选择不将基金资产投资于科创板股票，基金资产并非必然投资于科创板股票。科创板股票在发行、上市、交易、退市等方面的规则与其他板块存在差异，基金投资科创板股票的风险包括但不限于：科创板企业退市风险、市场风险、流动性风险、监管规则变化的风险。

(6) 基金参与融资业务的风险

本基金可根据法律法规的规定参与融资业务，参与融资交易的风险主要包括流动性风险、信用风险等，这些风险可能会给基金净值带来一定的负面影响和损失。为了更好的防范融资交易所面临的各类风险，基金管理人将遵守审慎经营原则，制定科学合理的投资策略和风险管理制，有效防范和控制风险，切实维护基金财产的安全和基金份额持有人利益。

(7) 基金参与存托凭证投资的风险

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

(8) 《基金合同》自动终止的风险

本基金是发起式基金，本基金的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两亿元的，本基金将根据基金合同的约定进行基金财产清算并终止，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。若届时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、更改或补充时，则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。

基金合同生效后继续存续的，自基金合同生效满三年后的基金存续期内，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 50 个工作日出现前述情形的，本基金将终止基金合同，无需召开基金份额持有人大会审议。故投资者还将面临基金合同自动终止的风险。

(9) 本基金对于投资者通过直销机构认购/申购的 C 类基金份额计提的销售服务费，以及投资者通过其他销售机构认购/申购且持续持有期限超过一年的 C 类基金份额继续计提的

销售服务费采取“先收后返”模式，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该类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。

(二) 重要提示

中国证监会对本基金募集的注册，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。

相关各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商、调解未能解决的，应向中国国际经济贸易仲裁委员会申请仲裁，并适用申请仲裁时该会现行有效的仲裁规则。仲裁的地点为北京市。仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力。除非仲裁裁决另有决定，仲裁费由败诉方承担。

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。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[www.ncfund.com.cn][4008198866]

- 基金合同、托管协议、招募说明书
- 定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 基金份额净值
- 基金销售机构及联系方式
- 其他重要资料

六、其他情况说明

无。