大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
二〇一九年十二月

重要提示

大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金（以下简称"本基金"）经中国证监会2015年12月21日证监许可【2015】3006号文注册募集,本基金基金合同于2016年3月22日生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册,但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做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

证券投资基金（以下简称"基金"）是一种长期投资工具,其主要功能是分散投资,降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具,投资者购买基金,既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益,也可能承担基金投资所带来的损失。

基金分为股票基金、混合基金、债券基金、货币市场基金等不同类型,投资者投资不同类型的基金将获得不同的收益预期,也将承担不同程度的风险。一般来说,基金的收益预期越高,投资者承担的风险也越大。本基金为混合型基金,其预期风险与预期收益高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。

本基金投资于证券市场,基金净值会因证券市场波动等因素产生波动。投资者在投资本基金前,应仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同,全面认识本基金的风险收益特征和产品特性,并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对申购基金的意愿、时机、数量等投资行为做出独立、谨慎决策,获得基金投资收益,亦承担基金投资中出现的各类风险。基金管理人在基金管理实施过程中产生的操作或技术风险、本基金的特有风险等。

基金在投资运作过程中可能面临各种风险,既包括因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、也包括基金自身的管理风险、技术风险和合规风险等。巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险,即当单个开放日基金的净赎回申请份额超过上一开放日基金总份额的10%时,投资者将可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

基金资产投资于科创板股票,会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险,包括但不限于流动性风险、退市风险、投资集中度风险、市场风险、系统性风险、股价波动风险、政策风险等。基金可根据投资策略需要或市场环境的变化,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。基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现,基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。投资有风险,投资人认购（或申购）基金时,请仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同。基金管理人提醒投资者基金投资的"买者自负"原则,在做出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负担。

本更新招募说明书已经本基金托管人复核。本更新招募说明书所载内容截至日为2019年9月22日（其中人员变动内容的更新以公告日期为准）,有关基金投资组合及财务数据截止日为2019年6月30日（财务数据未经审计）。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况
名称:大成基金管理有限公司
住所:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
办公地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
设立日期:1999年4月12日
注册资本:贰亿元人民币
股权结构:公司股东为中泰信托有限责任公司（持股比例50%）、中国银河投资管理有限公司（持股比例25%）、光大证券股份有限公司（持股比例25%）三家公司。
法定代表人:吴庆斌
电话:0755-83183388
传真:0755-83199588
联系人:肖剑

（二）主要人员情况
1. 董事会成员

吴庆斌先生,董事长,清华大学法学及工学双学士。先后任职于西南证券飞虎网、北京国际信托有限责任公司、广联（南宁）投资股份有限公司等机构。2012年7月至今,任广联（南宁）投资股份有限公司董事长;2012年任职于中泰信托有限责任公司,2013年6月至今,任中泰信托有限责任公司董事长。2019年11月3日起任大成基金管理有限公司董事长。

翟斌先生,副董事长,北京大学经济学硕士。曾在深圳市建材集团、君安证券、新华信托、招商证券股份有限公司等多家机构任职,2017年8月加入光大证券股份有限公司,历任机构业务总部董事总经理、机构业务总部总经理兼私募业务部总经理,现任光大证券股份有限公司机构业务总部总经理。2019年11月3日起任大成基金管理有限公司副董事长。

谭晓冈先生,董事、总经理,哈佛大学公共管理硕士。曾在财政部、世界银行、全国社保基金理事会任职。2016年7月加入大成基金管理有限公司,2016年12月至2019年8月任大成国际资产管理有限公司总经理, 2017年2月至2019年6月任大成基金管理有限公司副总经理,2019年7月起任大成基金管理有限公司总经理,2019年8月起任大成国际资产管理有限公司董事长。

李超女士,董事,华中科技大学管理学学士。2007年6月至2008年5月,任职于深圳晨星咨询有限责任公司;2008年7月至2011年8月, 任德勤华永会计师事务所高级审计员;2011年8月至2018年5月,任平安信托有限责任公司稽核监察部模型团队团队经理;2018年5月至今,任中泰信托有限责任公司稽核审计部总经理。

郭向东先生,董事,中国人民大学金融学在职研究生。1996年至1998年在中国新技术创业投资公司负责法律事务;1998年至2000年在中国华融信托投资公司负责法律事务;2000年至2006年任职于中国银河证券有限责任公司法律部;2007年1月加入中国银河投资管理有限公司,任职于负债处置部;2007年7月至2013年2月,历任人力资源部负责人、风险控制部总经理、监事会办公室主任、审计部负责人,曾兼任北京银河吉星创业投资有限责任公司监事;2013年2月起任资产管理部总经理兼行政负责人。

杨晓帆先生,独立董事,香港浸会大学工商管理学士。2006年至2011年,任惠理集团有限公司高级投资分析师兼投资组合经理;2012年至2016年, 任FALCON EDGE CAPITAL LP 合伙人和大中华区负责人;2016年至今, 任晨曦投资管理公司(ANATOLE INVESTMENT MANAGEMENT) 主要创始人。

胡维翊先生,独立董事,波士顿大学国际银行与金融法硕士。1991年7月至1994年4月,任全国人大常委会办公厅研究室政治组主任科员;1994年5月至1998年8月,任北京乾坤律师事务所合伙人;2000年2月至2001年4月任北京市中凯律师事务所律师;2001年5月至今,历任北京市天铎律师事务所副主任、主任,现任北京市天铎律师事务所合伙人。

金李先生,独立董事,美国麻省理工学院金融学博士。现任北京大学光华管理学院副院长,九三学社中央常委,全国政协委员,经济委员会委员。曾在美国哈佛大学商学院任教十多年,并兼任哈佛大学费正清东亚研究中心执行理事。

黄隽女士,独立董事,中国人民大学经济学博士。现任中国人民大学应用经济学院教授、副院长。研究方向为货币政策、商业银行理论与政策、艺术品金融,出版多本专著,在经济、金融类学术核心期刊上发票多篇学术论文,具有丰富的教学和科研经验。

2. 监事会成员

许国平先生,监事会主席,中国人民大学国民经济学博士。1987年至2004年先后任中国人民银行国际司处长,东京代表处代表,研究局调研员,金融稳定局体改处处长;2005年6月至2008年1月任中央汇金投资有限责任公司建行股权管理部主任;2005年8月至2016年11月任中国建银投资有限责任公司董事、副总经理、党委委员;2007年2月至2016年11月任中国银河投资管理有限公司董事长、总裁、党委书记;2010年6月至2014年3月兼任北京银河吉星创业投资有限责任公司董事长;2007年1月至2015年6月任中国银河证券股份有限公司董事;2014年1月至2017年6月任银河基金管理有限公司党委书记;2014年3月至2018年1月任银河基金管理有限公司董事长（至2017年11月）及法定代表人;2018年3月加入大成基金管理有限公司,任监事会主席。

邓金煌先生,职工监事,上海财经大学管理学硕士。2001年9月至2003年9月任职于株洲电力局;2003年9月至2006年1月攻读硕士学位;2006年4月至2010年5月任华为三康技术有限公司人力资源专员;2010年5月至2011年9月任招商证券人力资源部高级经理;2011年9月至2016年8月任融通基金管理有限公司综合管理部总监助理;2016年8月加入大成基金管理有限公司,任人力资源部副总监;现任大成基金管理有限公司人力资源部总监。

陈焓女士,职工监事,吉林大学法学硕士。2005年8月至2008年3月任金杜律师事务所深圳分所公司证券部律师;2008年3月加入大成基金管理有限公司, 历任监察稽核部律师、总监助理;现任大成基金管理有限公司监察稽核部副总监。

3. 高级管理人员情况

吴庆斌先生,董事长。简历同上。

谭晓冈先生,总经理。简历同上。

肖剑先生,副总经理,哈佛大学公共管理硕士。曾任深圳市南山区委（政府）办公室副主任, 深圳市广聚能源股份有限公司副总经理兼广聚投资控股公司执行董事、总经理,深圳市人民政府国有资产监督管理委员会副处长、处长。2014年11月加入大成基金管理有限公司,2015年1月起任公司副总经理,2019年8月起任大成国际资产管理有限公司总经理。

温智敏先生,副总经理,哈佛大学法学博士。曾任职于美国Hunton & Williams国际律师事务所纽约州执业律师、中银国际投行业务副总裁,香港三山投资公司董事总经理,标准银行亚洲有限公司董事总经理兼中国投行业务主管。2015年4月加入大成基金管理有限公司,任首席战略官,2015年8月起任公司副总经理。

周立新先生,副总经理兼首席信息官,中央党校经济管理本科。曾任新疆精河县党委办公室机要员、新疆精河县团委副书记、新疆精河县人民政府体改委副主任、新疆精河县八家户农场党委书记、新疆博尔塔拉蒙古自治州团委副书记及少工委主任、江苏省铁路发展股份有限公司办公室主任、江苏省铁路发展股份有限公司控股企业及江苏省铁路实业集团有限公司控股企业负责人、中国华闻投资控股有限公司燃气战略管理部项目经理。2005年1月加入大成基金管理有限公司,历任客户服务中心总监助理、市场部副总经理、上海分公司副总经理、客户服务部总监兼上海分公司总经理、公司助理总经理,2015年8月起任公司副总经理,2019年5月起兼任首席信息官。

姚余栋先生,副总经理,英国剑桥大学经济学博士。曾任职于原国家经贸委企业司、美国花旗银行伦敦分行。曾任世界银行咨询顾问,国际货币基金组织国际资本市场部和非洲部经济学家,原黑龙江省招商局副局长,黑龙江省商务厅副厅长,中国人民银行货币政策二司副巡视员, 中国人民银行货币政策司副司长,中国人民银行金融研究所所长。2016年9月加入大成基金管理有限公司,任首席经济学家,2017年2月起任公司副总经理。

赵冰女士,督察长,清华大学工商管理硕士。曾供职于中国证券业协会资格管理部、专业联络部、基金公司会员部,曾任中国证券业协会分析师委员会委员、基金销售专业委员会委员。曾参与基金业协会筹备组的筹备工作。曾先后任中国证券投资基金业协会投教与媒介公关部负责人、理财及服务机构部负责人。2017年7月加入大成基金管理有限公司,2017年8月起任公司督察长。

4. 基金经理

魏庆国:经济学硕士。证券从业年限9年。2010年至2012年任职于华夏基金管理有限公司研究部研究员。2012年至2013年任职于平安大华基金研究部。2013年5月加入大成基金管理有限公司,曾担任大成财富管理2020生命周期证券投资基金基金经理助理。2015年4月7日起任大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）基金经理（更名前为大成中小盘股票型证券投资基金（LOF））。2015年4月7日至2016年8月19日任大成精选增值混合型证券投资基金基金经理。2015年7月28日至2016年8月19日任大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）基金经理。2016年3月22日起任大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍:中国

5. 公司投资决策委员会

公司股票投资决策委员会由9名成员组成,设股票投资决策委员会主席1名,其他委员8名,名单如下:

温智敏,公司副总经理,股票投资决策委员会主席;徐彦,股票投资部总监,股票投资决策委员会委员;李本刚,基金经理,大类资产配置部首席权益配置投资官,股票投资决策委员会委员;苏秉毅,基金经理,数量与指数投资部副总监,股票投资决策委员会委员;戴军,基金经理,研究部副总监,股票投资决策委员会委员;李博,基金经理,股票投资部副总监,股票投资决策委员会委员;刘旭,基金经理,股票投资部副总监,股票投资决策委员会委员;于雷,交易管理部总监,股票投资决策委员会委员;郑刚,风险管理部总监,股票投资决策委员会委员。

上述人员之间不存在亲属关系。

二、基金托管人

（一）基本情况
名称:中国银行股份有限公司（简称"中国银行"）
住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记日期:1983年10月31日
注册资本:人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整
法定代表人:刘连舸
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【1998】24 号
托管部门信息披露联系人:王永民
传真:（010）66594942
中国银行客服电话:95566

（二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年,现有员工110余人,大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验,且具有海外工作、学习或培训经历,60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务,中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行, 中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内,中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务,为各类客户提供个性化的托管增值服务,是国内领先的大型中资托管银行。

（三）证券投资基金托管情况

截至2019年6月30日,中国银行已托管716只证券投资基金,其中境内基金676只,QDII基金40只,覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF等多种类型的基金,满足了不同客户多元化的投资理财需求,基金托管规模位居同业前列。

（四）托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分,秉承中国银行风险控制理念,坚持"规范运作、稳健经营"的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节,通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007年起,中国银行连续聘请外部会计会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于 "SAS70"、"AAF01/06" "ISAE3402"和"SSAE16"等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2017年, 中国银行继续获得了基于"ISAE3402"和"SSAE16"双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善,内控措施严密,能够有效保证托管资产的安全。

（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定,基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当拒绝执行,及时通知基金管理人,并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当及时通知基金管理人,并及时向国务院证券监督管理机构报告。

三、相关服务机构

（一）销售机构及联系人

一. 直销机构
大成基金管理有限公司
住所:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
办公地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
法定代表人:吴庆斌
电话:0755-83183388
传真:0755-83199588
联系人:敖姣
公司网址:www.dcfund.com.cn
大成基金客户服务热线: 400-888-5558（免长途固话费）
大成基金深圳投资理财中心
地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
联系人:吴海灵、关志玲、白小雪
电话:0755-22223556/22223177/22223555
传真:0755-83195235/83195242/83195232
邮编:518040

二. 代销机构

1、中国银行股份有限公司
注册地址:北京西城区复兴门内大街1号
办公地址:北京西城区复兴门内大街1号
法定代表人:刘连舸
客服电话:95566
联系人:王永民
电话:010-66594896
传真:010-66594942
网址:www.boc.cn

2、中国农业银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区建国门内大街69号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
法定代表人:周慕冰
联系人:贺倩
联系电话:010-66060069
传真:010-68121816
客服电话:95599
网址:www.abchina.com

3、交通银行股份有限公司
注册地址:中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
办公地址:中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
法定代表人:彭纯
客服电话:95559
联系人:曹榕
电话:021-58781234
传真:021-58408483
网址:www.bankcomm.com

4、招商银行股份有限公司
注册地址:深圳市福田区深南大道7088号
办公地址:深圳市福田区深南大道7088号
法定代表人:李建红
客服电话:95555
联系人:邓炯鹏
电话:0755-83077278
传真:0755-83195049
网址:www.cmbchina.com

5、中信银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
法定代表人:李庆萍
电话:010-89937369
客服电话:95558
联系人:王晓琳
联系电话:010-89937325
传真:010-65550827
网址:www.citicbank.com

6、上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区浦东南路500号
办公地址:上海市中山东一路12号
法定代表人:吉晓辉
联系人:高天、虞谷云
客服热线:95528
电话:021-61618888
传真:021-63604199
网址:www.spdb.com.cn

7、兴业银行股份有限公司
办公地址:福州市五一中路元洪大厦25层
法定代表人:高建平
电话:021-52629999
传真:021-62569070
联系人:刘玲
客服电话:95561
网址:www.cib.com.cn

8、平安银行股份有限公司
注册地址:中国深圳市深南中路1099号
法定代表人:谢永林
电话:021-38637673
传真:0755-22197701
联系人:张莉
客户服务热线:95511-3
网址:http://bank.pingan.com

9、北京农村商业银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区月坛南街1号院2号楼
办公地址:北京市西城区月坛南街1号院2号楼
法定代表人:王金山
联系人:董汇
联系电话:010-85605588
传真:010-66506163
客服电话:96198
网址:www.bjrcb.com

10、青岛银行股份有限公司
地址:青岛市市南区香港中路68号华普大厦
法定代表人:张广鸿
联系人:滕克、李佳程
联系电话:0532-68629926
客服电话:96588（青岛）、400-66-96588（全国）
网址:www.qdccb.com

11、东莞银行股份有限公司
注册地址:东莞市莞城区体育路21号
法定代表人:卢国锋
联系人:林柳阳
电话:0769-22865177
传真:0769-23156406
客服电话:400-119-6228
网址:www.dongguanbank.cn

12、渤海银行股份有限公司
注册地址:天津市河东区海河东路218号
法人代表: 李伏安
客服电话:95541
联系人:王宏
电话:022-58316666
传真:022-58316259
网址:http://www.cbhb.com.cn

13、江苏江南农村商业银行股份有限公司
注册地址:常州市和平中路413号
办公地址:常州市和平中路413号
法人代表: 陆向阳
公告联系人:李仙
联系电话:0519-89995939
公告传真:0519-89995170
客服电话:0519-96005
网址:www.jnbank.com.cn

14、四川天府银行股份有限公司
注册地址:四川省南充市涪江路 1 号
法定代表人:邢敏
办公地址:四川省南充市涪江路 1 号
客服热线:40016-96869
公司网址:www.tf.cn

15、恒丰银行股份有限公司
注册地址:山东省烟台市芝罘区南大街248号
法定代表人:蔡国华
联系人:蒋悦
电话:021-20501975
传真:012-20501978
客服电话:95395
网址:www.hfbank.com.cn

16、晋城银行股份有限公司
注册地址:山西省晋城市文昌西街1669号
办公地址:山西省太原市高新区高新街联合大厦
法定代表人:贾沁林
联系人:朱丹
联系电话:18734835708
客服电话:95105757
网址:www.jccbank.com.cn

17、中原银行股份有限公司
注册地址: 中国河南省郑州郑东新区商务外环路23号中科金座大厦
办公地址:总行地址:郑州市郑东新区CBD商务外环23号中科金座大厦
法定代表人:窦荣兴
联系电话:（86）0371-85517898
传真:（86）0371-85517555
客服电话:95186
网址:http://www.zybank.com.cn

18、九江银行股份有限公司
注册地址:江西省九江市濂溪区长虹大道619号
法定代表人:刘羡庭
办公地址:江西省九江市长虹大道619号
客服热线:95316
公司网址:www.jjccb.com

19、中信期货有限公司
注册地址:深圳市福田区中信三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层
办公地址:深圳市福田区中信三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层
法定代表人:张皓
联系人:刘宏莹
联系电话:010-60833754
传真:0755-83217421
客服电话:400-990-8826
网址:www.citicsf.com

20、国泰君安证券股份有限公司
注册地址:中国（上海）自由贸易试验区商城路618号
办公地址:上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼
法定代表人:杨德红
客服电话:95521
联系人:芮敏祺、朱雅崴
联系电话:021-38676666
传真:021-38670161
网址:www.gtja.com

21、中信建投证券股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
法定代表人:王常青
客服电话:4008888108
联系人:权唐
电话:010-85130577
传真:010-65182261
网址:www.csc108.com

22、招商证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人:宫少林
客服电话: 95565
联系人:黄婵君
电话:0755-82960167
传真:0755-82943636
网址:www.newone.com.cn

23、中信证券股份有限公司
注册地址:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座
法定代表人:张佑君
客服电话:010-84588888
联系人:顾凌
电话:010-60838696
传真:010-84865560
网址:www.cs.ecitic.com

24、中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街35号2-6层
法定代表人:陈共炎
客服电话:4008-888-888
联系人:辛国政
联系电话:010-83574507
传真:010-83574807
网址:www.chinastock.com.cn

25、申万宏源证券有限公司
通讯地址:上海市徐汇区长乐路989号40层
法定代表人:李梅
客服电话:95523或4008895523
联系人:曹晔
电话:021-54033888
传真:021-54038844
网址:www.sywg.com

26、长江证券股份有限公司
注册地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人:杨泽柱
客户服务热线:95579、4008-888-999
联系人:奚博宇
电话:027-65799999
传真:027-85481900
网址:www.95579.com

27、湘财证券股份有限公司
注册地址:湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼
办公地点:湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼
法定代表人:孙永祥
电话:021-38784580-8918
传真:021-68865680
联系人:李欣
邮编:410004
客服电话:95351
公司网址:www.xcsc.com

28、万联证券股份有限责任公司
注册地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
法定代表人:张建军
联系人:王鑫
联系电话:020-38286651
客服电话:400-8888-133
网址:www.wlzq.com.cn

29、民生证券股份有限公司
地址:北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座
法定代表人:余政
客服电话:4006198888
联系人:赵明
联系电话:010-85127622
联系传真:010-85127917
公司网址:www.mszq.com

30、渤海证券股份有限公司
注册地址:天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
法定代表人:王春峰
联系人:蔡霆
电话:022-28451991
传真:022-28451892
客服电话:4006515988
网址:www.ewww.com.cn

31、中信证券（山东）有限责任公司
注册地址:青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001
办公地址:青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层
法定代表人:姜晓林
客服电话:95548
联系人:焦刚
电话:0531-89606166
传真:0532-85022605
网址:http://sd.citics.com/

32、方正证券股份有限公司
注册地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
法定代表人:雷杰
客服电话:95571
联系人:徐锦福
电话:010-57398062
传真:010-57398058
网址:www.foundersc.com

33、长城证券股份有限公司
注册地址:广东省深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦16-17层
法定代表人:曹宏
联系人:金夏
电话:0755-83516289
传真:-83515567
客户服务热线:400-666-6888
网址:www.cgws.com

34、光大证券股份有限公司
办公地址:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:周健男
客服电话: 95525
联系人:龚俊涛
电话:021-22169999
传真:021-22169134
网址:www.ebscn.com

35、广州证券股份有限公司
注册地址:广州市先烈中路69号东山广场主楼十七楼
法定代表人:邱三发
客服电话:95396
联系人:林洁茹
联系电话:020-87322668
传真:020-87325036
网址:www.gzs.com.cn

36、南京证券股份有限公司
办公地址:南京市玄武区大钟亭8号
法定代表人:步国旬
客服电话:95386
联系人:石健
电话:025-83367888
传真:025-83364032
网址:www.njzq.com.cn

37、上海证券有限责任公司
注册地址:上海市黄浦区四川中路213号久事商务大厦7楼
法定代表人:李俊杰
客服电话:021-962518,4008918918
联系人:许曼华
电话:021-53519888
传真:021-63608830
网址:www.962518.com

38、平安证券股份有限公司
办注册地址:深圳市福田区益田路5033号平安金融中心61层-64层
法定代表人:何之江
客户服务热线:95511-8
联系人: 王阳
电话:021-38632136
传真:021-58991896
网址:http://stock.pingan.com

39、华安证券股份有限责任公司
注册地址:安徽省合肥市长江中路357号
法定代表人:李工
客服电话:0551-96518、400-80-96518
联系人:甘霖
电话:0551-5161821
传真:0551-5161672
网址:www.hazq.com

40、财富证券有限责任公司
办公地址:湖南长沙芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26层
法人代表:蔡一兵
客户服务热线:0731－84403333、400-88-35316
联系人:郭磊
传真:0731-84403439
网址:www.cfzq.com

41、国都证券股份有限公司
注册地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
法定代表人:王少华
客服电话:400-818-8118
联系人:黄静
电话:010-84183333
传真:010-84183311-3389
网址:www.guodu.com

42、东海证券股份有限公司
注册地址:江苏省常州延陵西路23号投资广场18层
办公地址:上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦
法定代表人:赵俊
电话:021-20333333
传真:021-50498825
联系人:王一彦
客服电话:95531;400-8888-588
网址:www.longone.com.cn

43、国盛证券有限责任公司
注册地址:江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦
办公地址:江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦4楼
法定代表人:徐丽峰
联系人:周欣玲
电话:0791-86281305;13803512671
传真:0791-86281305
网址:www.gsstock.com

44、中泰证券股份有限公司
办公地址:山东省济南市经十路20518号
法定代表人:李玮
客服电话:95538
联系人:吴阳
电话:0531-81283938
传真:0531-81283900
网址:www.qlzq.com.cn

45、第一创业证券股份有限公司
地址:深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25F
法人代表:刘学民
电话:95358
网址:www.firstcapital.com.cn

46、中航证券有限公司
注册地址:南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼
办公地址:南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼
法人代表:王宜四
客户服务热线:4008866567
联系人:戴蕾
电话:0791-86768681
传真:0791-86770178
网址:www.avicsec.com

47、华林证券股份有限公司
注册地址:西藏自治区拉萨市柳梧新区察古大道1-1君泰国际B栋一层3号
办公地址:深圳市福田区民田路178号华融大厦5、6楼
法定代表人:林立
客服电话:400-188-3888
联系人:李琳
电话:0755-82707857
传真:0755-23613751
网址:www.chinalions.com

48、华福证券有限责任公司
注册地址:福州市五四路157号新天地大厦7、8层
法定代表人:黄金琳
客服电话:0591-96326
联系人:张宗锐
电话:0591-87383600
传真:0591-87841150
网址:www.gfhfzq.com.cn

49、中国中投证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元
办公地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层
法定代表人:高涛
联系人:刘毅
客户电话:400 600 8008
电话:0755-82023442
传真:0755-82026539
网址:www.china-invs.cn

50、联讯证券股份有限公司
注册地址:广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼
法人代表:徐刚
联系人:郭晴
联系电话:0752-2119391
客服电话:95564
网址:www.lxzq.com.cn

51、华宝证券有限责任公司
地址:上海市浦东新区环球金融中心57楼
法定代表人:陈林
客服电话:400-820-9898
联系人:刘闻川
电话:021-68778075
传真:021-68868117
网址:www.cnhbstock.com

52、华融证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街8号
法定代表人:祝献忠
联系人:李慧灵
联系电话:010-58315221
传真:010-58568062
客服电话:010-58568118 、400-898-9999
网址:www.hrsec.com.cn

53、天风证券股份有限公司
注册地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼
法定代表人:余磊
联系人:翟璟
联系电话:（027）87618882/(028) 86711410
传真:（027）87618863
网址:www.tfzq.com

54、和讯信息科技有限公司
注册地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人:王莉
联系人:刘洋
联系电话:021-20835785
传真:021-20835879
客服电话:400-920-0022
网址:http://licaike.hexun.com

55、上海挖财基金销售有限公司
注册地址:中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5楼01、02、03室
法定代表人:冷飞
客服电话:021-50810673
网址:www.wacaijijin.com

56、阳光人寿保险股份有限公司
注册地址:海南省三亚市迎宾路360-1号三亚阳光金融广场16层
办公地址:北京市朝阳区朝阳门外大街乙12号院1号昆泰国际大厦12层
法定代表人:李科
电话:010-85632771
传真:010-85632773
联系人:王超
客服热线:95510
公司网站:http://fund.sinosig.com/

57、深圳前海微众银行股份有限公司
注册地址:深圳市南山区桃园路田厦国际中心A36楼
法定代表人:顾敏
客服电话:400-999-8877
联系人: 罗曦
电话:0755－89462447
网址:http://www.webank.com

58、北京百度百盈基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区上地十街10号1幢1层101
办公地址:北京市海淀区信息路甲9号奎科大厦
法人代表:张旭阳
公告联系人:杨琳
公告电话:010-61952702
公告传真:010-61951007
客服电话:95055-9
网址:www.baiyingfund.com

59、深圳众禄基金销售股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦8楼801
法定代表人:薛峰
联系人:童彩平
电话:0755-33227950
传真:0755-82080798
网址:www.zlfund.cn
客服电话:4006-788-887

60、上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路195号3C座9楼
法人代表:其实
联系人:潘世友
电话:021-54509998
传真:021-64383798
客服电话:400-1818-188
网址:www.1234567.com.cn

61、上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
办公地址: 上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903～906
法定代表人: 杨文斌
客服电话: 400-700-9665
联系人: 张茹
联系电话: 021-58870011
传真: 021-68596916
网址: www.ehowbuy.com

62、蚂蚁(杭州)基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F
法人代表:陈柏青
联系人:韩爱彬
电话:021-60897840
传真:0571-26697013
客服电话:4000-766-123
网址: www.fund123.cn

63、上海长量基金销售有限公司
办公地址:上海市浦东新区东方路1267号11层
法定代表人:张跃伟
客服电话:4008202899
联系人:邱燕芳
电话:021-20691931
传真:021-20691861
网址:www.erichfund.com

64、浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址:杭州市西湖区文二西路1号元茂大厦903室
办公地址:浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼
法人代表:凌顺平
联系人:林海明
电话:0571-88911818-8580
传真:0571-88911818-8002
客服电话:4008-773-772
网站地址:www.5ifund.com

65、上海利得基金销售有限公司
注册地址:上海市宝山区蕴川路5475号1033室
办公地址:上海市浦东新区峨山路91弄61号1幢14层
法定代表人:李兴春
传真:021-50583633
电话:021-50583533
客服电话:400-921-7755
网址:www.leadfund.com.cn

66、嘉实财富管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期53层5312-15单元
法定代表人:赵学军
电话: 010-65215588
传真: 010-85712195
联系人: 李雯
联系人邮箱: liwen@harvestwm.cn
客服电话: 400-021-8850
网址: www.harvestwm.cn

67、南京苏宁基金销售有限公司
注册地址:南京市玄武区苏宁大道1-5号
办公地址:南京市玄武区苏宁大道1-5号
法定代表人:王锋
客服电话:95177
网址:https://www.snjijin.com/

68、北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址:北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路甲19号SOHO嘉盛中心30层3001室
法定代表人:周斌
客服电话:4008980618
网址:www.chtfund.com

69、北京汇成基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108
法定代表人:王伟刚
联系人:丁向坤
电话:010-56282140
传真:010-62680827
客服电话:400-619-9059
网址:www.fundzone.cn

70、北京钱景基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
办公地址:北京市海淀区丹棱街6号中关村金融大厦（丹棱soho）1008
法定代表人:赵荣春
联系人:魏争
网站:www.qianjing.com
客服电话:400-893-6885

71、上海万得投资顾问有限公司
注册地址: 中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址:上海市浦东新区福山路33号8楼
法定代表人:王廷富
联系人:姜吉灵
联系电话:021-5132 7185
传真:021-5071 0161
客服电话:400-821-0203

72、上海联泰基金销售有限公司
注册地址:中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址:上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层
邮编:200335
法定代表人:燕斌
联系人:兰敏
电话:021-52822063
传真:021-52975270
客服电话:400-166-6788
公司网址: www.66zichan.com

73、上海基煜基金销售有限公司
住所:上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发展区）
办公地址:上海市杨浦区昆明路 518 号 a1002 室
法定代表人:王翔
联系人:安彬
客服电话:400-820-5369
网址:www.jiyufund.com.cn

74、上海中正达广基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙腾大道2815号302室
办公地址:上海市徐汇区龙腾大道2815号3楼
法定代表人:黄欣
公司电话:021-3376 8132
客服电话:400-6767-523
网址:http://www.zhongzhengfund.com

75、北京虹点基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元
办公地址:北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元
法定代表人:胡伟
传真: 010-65951887
电话:010-65951887
客服电话:400-618-0707
网址:www.hongdianfund.com

76、武汉市伯嘉基金销售有限公司
注册地址:湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城（一期）第7栋23层1号、4号
法定代表人:陶捷
联系人:杨帆
电话:027-87006003/87006009
网站:www.buyfunds.cn
公司传真:027-87006010
客服电话:400-027-9899

77、上海陆金所基金销售有限公司
注册地址:中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1333号14楼09单元
法定代表人:王之光
办公地址:中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1333号14楼09单元
联系人:宁博宇
客服电话:4008219031
网站:www.lufunds.com

78、珠海盈米基金销售有限公司
注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
法定代表人:肖雯
办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203
联系人:黄敏嫦
网站:www.yingmi.cn
客服电话:020-89629066

79、和耕传承基金销售有限公司
注册地址:河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北6号楼5楼503房间
办公地址:北京市朝阳区酒仙桥路6号院国际电子城b座
法定代表人:王旋
客服电话:4000-555-671
网址:http://www.hgccpb.com/

80、奕丰基金销售有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）
办公地址:深圳市南山区海德三路航天科技广场A座17楼1704室
法定代表人: TEO WEE HOWE
联系人:叶健
电话:0755-89460507
传真:0755-21674453
客服电话:400-684-0500
网址:www.ifastps.com.cn

81、北京肯特瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06
办公地址: 北京市大兴区亦庄经济技术开发区科创十一街18号院京东集团总部
法定代表人:江卉
电 话:个人业务95118 , 400 098 8511
企业业务:400 088 8816
传 真: 010-8919566
网址:fund.jd.com

82、北京蛋卷基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区阜通东大街 1 号院6 号楼2 单元 21 层222507
法定代表人:钟斐斐
客服电话:4000618518
联系人:袁永娇
电话:010-61840688
传真:010-61840699
网址:https://danjuanapp.com

83、上海华夏财富投资管理有限公司
注册地址:上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室
法定代表人:毛淮平
办公地址:北京市西城区金融大街33号通泰大厦B8层
客服热线:400-817-5666
公司网址:www.amcfortune.com

基金管理人可根据有关法律、法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

（二）注册登记机构
名称:大成基金管理有限公司
住所:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
办公地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦33层
法定代表人:吴庆斌
电话:0755-83183388
传真:0755-83195239
联系人:黄慕平

（三）律师事务所和经办律师
名称:北京市金杜律师事务所
注册地址:北京市朝阳区东三环中路7号财富中心写字楼A座40层
办公地址:北京市朝阳区东三环中路7号财富中心写字楼A座40层
负责人:王玲
电话:0755-22163333
传真:0755-22163390
经办律师:沈娜、冯艾
联系人:冯艾

（四）会计师事务所和经办注册会计师
名称:安永华明会计师事务所
住所:北京市东城区东长安街1 号东方广场安永大楼17层 01-12室
办公地址:北京市东城区东长安街1 号东方广场安永大楼17层01-12室
执行事务合伙人:毛鞍宁
电话:（010）58153000、（0755）25028288
传真:（010）85188298、（0755）25026188
签章注册会计师:昌华、叶锦明
联系人:昌华

四、基金的名称
大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金

五、基金的类型
混合型

六、基金的运作方式
契约型开放式

七、基金的投资目标

本基金通过灵活的资产配置和主动的投资管理,拓展大类资产配置空间,把握市场运行趋势,在控制风险的前提下为投资者谋求资本的长期增值。

八、基金的投资范围

基金的投资对象是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、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券等固定收益类投资工具（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债）、中小企业私募债、短期融资券、资产支持证券、债券回购、货币市场工具等)、股指期货、国债期货、权证、银行存款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:股票等权益类资产占基金资产的比例为0-95%;在任何交易日日终持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和, 不得超过基金资产净值的95%;债券、货币市场工具、银行存款等固定收益类资产占基金资产比例不低于5%;每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,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%。

九、基金的投资策略

本基金的投资策略主要体现在两个方面: 一方面体现在对权益类资产及固定收益类资产等不同类别资产的大类配置上,另一方面体现在对单个投资品种的选择上。

本基金强调趋势投资,具体可以概括为:

本基金根据对宏观趋势的分析实施大类资产的配置, 即本基金从宏观经济发展趋势、相关政策研究的角度出发,把握经济一体化、产业优化升级及经济结构调整等带来的投资机遇,重点分析宏观经济环境、国家经济政策、市场整体风险等宏观因素,确定权益类资产、固定收益类资产等大类资产的配置比例并进行实时动态调整;

在权益类证券投资方面,本基金将对市场趋势进行研判,重点研究市场趋势的形成机制、是否有加速机制、是否有趋势背驰弱化转向的机制,在不同类型的市场趋势下通过灵活的仓位控制和积极的选股策略来把握趋势性机会,同时通过对行业发展趋势、公司成长趋势以及股票价格趋势的研究精选个股进行投资;

在固定收益类证券投资方面, 本基金将通过综合分析市场利率趋势、证券市场走势、资金供求关系、流动性风险、信用风险和有关政策法规等因素,研判各类属固定收益类资产的风险趋势与收益预期,精选个券进行投资。

1、资产配置策略

本基金通过对宏观经济环境、国家经济政策、股票市场风险、债券市场整体收益率曲线变化和资金供求关系等因素的分析, 研判经济周期在美林投资时钟理论所处的阶段,综合评价各类资产的市场趋势、预期风险收益水平和配置时机。在此基础上,本基金将积极、主动地确定权益类资产、固定收益类资产和现金等各类资产的配置比例并进行实时动态调整。

2、股票投资策略

本基金将结合定性与定量分析,充分发挥基金管理人研究团队和投资团队"自下而上"的主动选股能力,选择具有长期持续增长能力的公司。同时本基金将在对市场趋势进行分析的基础上,通过对行业发展趋势、公司成长趋势以及股票价格趋势的研究进行股票筛选:

（1）市场趋势分析

①本基金将对市场中长期趋势进行分析,重点研究市场趋势的形成机制、是否有加速机制、是否有趋势背驰弱化转向的机制,前瞻性地把握市场中存在的趋势性机会,通过灵活的仓位控制与积极的选股策略获取趋势性机会带来的超额收益。

②趋势是分级别的,在任何固定级别上,趋势分为三类:上涨、盘整和下跌,本基金将通过定量和定性相结合的方式对不同级别的趋势进行分析研究。本基金将通过灵活的仓位控制,积极参与上涨和盘整两种行情,并且在以上两种行情中通过积极的选股策略来获得超额收益。对于下跌趋势,本基金将通过对仓位的调整来控制风险。

（2）行业发展趋势

本基金将确定宏观经济及政策等因素对不同行业的潜在影响, 通过行业生命周期分析和行业景气度分析,筛选出处于成长期和处于上升趋势的行业,进行重点配置和动态调整。同时本基金将结合国内经济的结构性变革趋势和产业政策导向,通过对经济结构调整和产业升级方向的前瞻性分析, 把握新兴产业的崛起以及传统产业的升级换代所带来的中长期投资机会。

（3）公司成长趋势

本基金将通过分析上市公司的经营模式、产品研发能力、公司治理等多方面的运营管理能力,判断公司的核心价值、成长能力以及所处的发展阶段,选择具有良好经营状况的上市公司股票。

经营模式方面,选择主营业务鲜明、行业地位突出、产品与服务符合行业发展趋势的上市公司股票;产品研发能力方面,选择具有较强的自主创新和市场拓展能力的上市公司股票;公司治理方面,选择公司治理结构规范,管理水平较高的上市公司股票。

本基金将重点关注上市公司的盈利能力、成长和股本扩张能力以及现金流管理水平,选择优良财务状况的上市公司股票。盈利能力方面,主要考察销售毛利率、净资产收益率（ROE）等指标;成长和股本扩张能力方面,主要考察主营业务收入增速、净资产增速、净利润增速、每股收益（EPS）增速、每股现金流净额增速等指标;现金流管理能力方面,主要考察每股现金流净额等指标。

（4）股票价格趋势

公司的经营业绩成长和公司投资价值的提升具有连续性和延展性, 这决定了公司股票价格的长期趋势。同时,在股票市场上,由于受到当期各种外部因素的影响,股票价格还具有中、短期趋势。中期趋势表现为股价相对长期趋势的估值偏离和估值修复过程,而短期趋势则表现为外部因素影响短期股价偏离和恢复的过程。上市公司的估值水平具有相对合理性的特点, 即在不同状态下的估值水平对价值判断的指导意义是不同的。因此,本基金不苛求股票价格的绝对低估,强调估值水平的合理性。

本基金在趋势研究的基础上,将通过对上市公司内在价值、相对价值、收购价值等方面的研究,考察市盈率（P/E）、市净率（P/B）、企业价值/息税前利润（EV/EBIT）、自由现金流贴现（DCF）等一系列估值指标,给出股票综合评级,通过对股票价格的分析选择估值水平相对合理的公司。

本基金将结合趋势分析以及股票估值分析的基本结论, 选择具有竞争优势且估值具有吸引力的股票,组建动态股票库。基金经理将按照本基金的投资决策程序,审慎精选,权衡风险收益特征后,根据市场波动情况构建股票组合并进行动态调整。

3、融资买入股票策略

本基金将根据融资买入股票成本以及其他投资工具收益率综合评估是否采用融资方式买入股票, 本基金在任何交易日日终持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的95%。

4、债券投资策略

本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式,获得与风险相匹配的投资收益,以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。本基金通过分析未来市场利率趋势及市场信用环境变化方向,综合考虑不同券种收益率水平、信用风险、流动性等因素,构造债券投资组合。在实际的投资运作中,本基金将运用久期控制策略、收益率曲线策略、类别选择策略、个券选择策略等多种策略,获取债券市场的长期稳定收益。

5、资产支持类证券投资策略

本基金将通过对宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究,预测资产池未来现金流变化,并通过研究标的证券发行条款,预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。在严格控制风险的情况下,结合信用研究和流动性管理, 选择风险调整后收益高的品种进行投资, 以期获得长期稳定收益。

6、中小企业私募债投资策略

本基金在控制信用风险的基础上,对中小企业私募债投资,主要采取分散投资,控制个债持有比例。同时,紧密跟踪研究发债企业的基本面情况变化,灵活调整投资策略,控制投资风险。

7、权证投资策略

本基金的权证投资是以权证的市场价值分析为基础, 配以权证定价模型寻求其合理估值水平,以主动式的科学投资管理为手段,充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征,通过资产配置、品种与类属选择,追求基金资产稳定的当期收益。

8、股指期货的投资策略

本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,参与股指期货的投资。此外,本基金还将运用股指期货来管理特殊情况下的流动性风险,如预期大额申购赎回、大量分红等。

9、国债期货的投资策略

国债期货作为利率衍生品的一种, 有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定,结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系,对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控,在最大限度保证基金资产安全的基础上,力求实现所资产的长期稳定增值。

十、基金的业绩比较基准

沪深300指数收益率*50%+中证综合债券指数收益率*50%。

本基金为灵活配置混合型基金,在综合考虑了基金投资组合的构建、投资标的以及市场上各类指数的编制方法后, 本基金选择市场认同度较高并且作为股指期货标的的沪深300指数作为本基金股票组合的业绩比较基准。沪深300指数成份股选自沪深两个证券市场,覆盖了大部分流通市值,为中国A 股市场中代表性强、流动性高的主流投资股票,能够反映A 股市场总体发展趋势。债券组合的业绩基准则采用了中证综合债券指数,中证综合债券指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央行票据及短期融资券整体走势的跨市场债券指数, 该指数旨在更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势,具有较强的市场代表性。

如果今后法律法规发生变化,或上述基准指数停止计算编制或更改名称,或证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时, 本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则, 根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意,并报中国证监会备案。基金管理人应在调整前2个工作日在至少一种指定媒介上予以公告。

十一、基金的风险收益特征

本基金为混合型基金, 基金的风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金低于股票型基金。

十二、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行根据基金合同规定复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

1、报告期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	37,563,779.07	39.82
	其中:股票	37,563,779.07	39.82
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	53,672,239.84	56.89
8	其他资产	3,104,438.34	3.29
9	合计	94,340,457.25	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组

（1）报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	7,463,007.00	9.88
C	制造业	15,992,042.75	21.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	248,363.00	0.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,555,278.40	2.06
J	金融业	6,307,876.92	8.35
K	房地产业	5,997,211.00	7.94
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	37,563,779.07	49.74

（2）报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无

3、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600028	中国石化	1,107,200	6,056,384.00	8.02
2	600887	伊利股份	180,300	6,023,823.00	7.98
3	600383	金地集团	502,700	5,997,211.00	7.94
4	002271	东方雨虹	166,400	3,770,624.00	4.99
5	601318	中国平安	35,700	3,163,377.00	4.19
6	600309	万华化学	68,100	2,913,999.00	3.86
7	601939	建设银行	331,543	2,466,679.92	3.27
8	002851	麦格米特	83,275	1,646,346.75	2.18
9	600079	人福医药	149,900	1,573,950.00	2.08
10	300451	创业慧康	104,032	1,555,278.40	2.06

4、报告期末按券种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

（1）报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

（2）本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

（1）本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

（2）报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

（3）本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

11、投资组合报告附注

（1）本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本期被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

（2）本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

（3）其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	77,843.50
2	应收证券清算款	3,013,165.63
3	应收股利	-
4	应收利息	9,775.41
5	应收申购款	3,653.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,104,438.34

（4）期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

（5）期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

（6）投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

十三、基金业绩

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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

（一）基金合同生效日为2016年3月22日,基金合同生效以来基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2016.03.22-2016.12.31	-8.50%	0.56%	1.63%	0.44%	-10.13%	0.12%
2017.01.01-2017.12.31	3.50%	0.70%	10.65%	0.32%	-7.15%	0.38%
2018.01.01-2018.12.31	-13.20%	1.28%	-9.62%	0.67%	-3.58%	0.61%
2019.01.01-2019.06.30	14.72%	0.81%	14.27%	0.77%	0.45%	0.04%
2016.03.22-2019.06.30	-5.70%	0.91%	16.12%	0.55%	-21.82%	0.36%

（二）自基金合同生效以来基金份额增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较:

（2016年3月22日至2019年6月30日）

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期。截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

十四、费用概览

(一)基金费用的种类
1、基金管理人的管理费;
2、基金托管人的托管费;
3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;
5、基金份额持有人大会费用（包括但不限于会计师费、律师费和公证费）;
6、基金的证券交易费用;
7、基金的银行汇划费用;
8、基金的开户费用、账户维护费用;
9、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。

上述基金费用由基金管理人在法律法规规定的范围内按照公允的市场价格确定,法律法规和基金合同另有规定时从其规定。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下:
H=E×年管理费率÷当年天数,本基金年管理费率为1.50%
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下:
H=E×年托管费率÷当年天数,本基金年托管费率为0.25%
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

3、上述"一、基金费用的种类中第3-8项费用",根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:
1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
3、《基金合同》生效前的相关费用;
4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(四) 基金管理费和基金托管费的调整

经基金管理人和基金托管人协商一致,基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费和基金托管费,此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒介上刊登公告。

（五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十五、对招募说明书更新部分的说明

本更新的招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其他有关法律法规的要求,对2019年5月7日公布的《大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（2019年1期）》进行了更新,并根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新,本更新的招募说明书主要更新的内容如下:

根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》,更新了"二、释义"、"七、基金份额的申购、赎回与转换"、"十三、基金收益与分配"、"十四、基金的会计与审计"、"十五、基金的信息披露"、"十八、基金合同内容摘要"、"十九、基金托管协议内容摘要"。

大成基金管理有限公司
2019年12月17日