大成多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)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

二〇二〇年九月

重要提示

大成定增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2016年5月26日证监许可【2016】1124号文予以注册。基金合同于2016年8月19日正式生效。基金合同生效后,本基金封闭期为2016年8月19日至2018年8月17日。自2018年8月18日起,大成定增灵活配置混合型证券投资基金转换为上市开放式基金(LOF),基金名称变更为“大成多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)”,场外基金简称变更为“大成多策略混合(LOF)”,场内基金简称变更为“多策略”,基金代码不变。

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, 并不表明中国证监会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。

本更新招募说明书根据基金合同编写,并经中国证监会注册。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。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,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责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。

投资有风险,投资者申购本基金时应认真阅读招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本更新的招募说明书所载内容截止日为2020年9月19日(其中人员变动信息以公告日为准),有关财务数据和基金净值表现截止日为2020年6月30日,所列财务数据未经审计。

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、商议银行理论与政策、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月任中国银河金融控股有限责任公司董事、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国际律师事务所组约州执业律师。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、新疆精河县人家户农场党委书记、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、中国华润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体公关部负责人、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

(1)现任基金经理

戴军:金融学硕士。证券从业年限9年。2011年6月加入大成基金管理有限公司,曾担任研究部研究员、行业研究主管、基金经理助理,现任研究部副总监。2015年5月21日起任大成优选混合型证券投资基金(LOF)(更名前为大成优选股票型证券投资基金)基金经理。2016年8月19日至2018年8月17日任大成定增灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017年6月2日起任大成一带一路灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018年8月18日任大成多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理。具有基金从业资格。国籍:中国

(2)历任基金经理

历任基金经理姓名	管理本基金时间
石国武	2016年8月19日至2017年9月12日

5.公司投资决策委员会(股票投资)

公司股票投资决策委员会由8名成员组成,设股票投资决策委员会主席1名,其他委员7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,基金经理,股票投资部总监,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:许俊

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2020年6月30日,中国银行已托管830只证券投资基金,其中境内基金783只,QDII基金47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

1. 直销机构

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32层

法定代表人:吴庆斌

电话:0755-83183388

传真:0755-83199588

联系人:教姣

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

2. 场外代销机构

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

联系人:王永民

客服电话:95566

电话:010-66594896

传真:010-66594942

网址:www.boc.cn

2、中国工商银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号

办公地址:北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人:陈四清

客服电话:95588

联系人:洪渊

联系电话:010-66105799

传真:010-66107914

网址:www.icbc.com.cn

3、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

4、中国光大银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心

办公地址:北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心

法定代表人:李晓鹏

客服电话:95595

联系人:石立平

电话:010-63639180

传真:010-68560312

网址:www.cebbank.com

5、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

6、北京银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区金融大街甲17号首层

办公地址:北京市西城区金融大街丙17号

法定代表人:张东宁

联系人:周黎

电话:010-66224815

传真:010-66226045

客服电话:95526

网址:www.bankofbeijing.com.cn

7、中国民生银行股份有限公司

注册地址:北京市东城区正义路4号

办公地址:北京市西城区复兴门内大街2号

法定代表人:洪崎

客服电话:95568

联系人:穆婷

电话:010-58560666

传真:010-83914283

网址:www.cmbc.com.cn

8、洛阳银行股份有限公司

注册地址:洛阳市洛龙区开元大道256号

办公地址:洛阳市洛龙区开元大道256号

客服电话:0379-96699

法定代表人:王建甫

联系人:胡艳丽

电话:0379-65921977

传真:0379-65921851

网址:www.bankoffuoyang.com.cn

9、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

10、江苏银行股份有限公司

地址:南京市洪武北路55号

法定代表人:夏平

联系人:田春慧

客服电话:96098、400-86-96098

电话:025-58587018

传真:025-58588164

网址:www.jsbchina.cn

11、上海农村商业银行股份有限公司

注册地址:上海市浦东新区浦东大道981号

办公地址:上海市黄浦区中山东二路70号

法定代表人:窦光恒

客服电话:021-962999、400-696-2999

电话:021-61899999

传真:021-50105124

联系人:施传荣

网址:www.shrcb.com

12、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

13、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/

14、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

15、华西证券股份有限公司

注册地址:四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦

法定代表人:杨炯洋

客户服务热线:4008888818

联系人:金达勇

电话:0755-83025723

传真:0755-83025991

网址:www.hx168.com.cn

16、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

17、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

18、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

19、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

20、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

21、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

22、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.q1zq.com.cn

23、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

24、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

25、中国国际金融有限公司

注册地址:北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

办公地址:北京市建国门外大街甲6号SK大厦

法定代表人:丁学东

联系人:杨涵宇

电话:010-65051166

网址:www.ciccs.com.cn

26、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

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、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

29、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

30、万联证券有限责任公司

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

31、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

32、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

33、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

34、爱建证券有限责任公司

注册地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1600号1幢32楼

法定代表人:钱华

客服电话:4001-962-502

联系人:陈敏

电话:021-32229888

传真:021-62878783

网址:www.ajzq.com

35、华泰证券股份有限公司

注册地址:南京市江东中路228号

办公地址:南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场

法定代表人:周易

客服电话:4008-888-168、95597

联系人:庞晓芸

电话:0755-82492193

传真:0755-82492962

网址:www.htsc.com.cn

36、中山证券有限责任公司

公司名称:中山证券有限责任公司

注册地址:深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼7层、8层

办公地址:深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼7层、8层

法定代表人:林炳城

电话:0755-82943755

传真:0755-82960582

客户服务电话:95329

网址:www.zszq.com

37、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

38、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

39、诺亚正行基金销售有限公司

注册地址:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室

法定代表人:汪静波

办公地址:上海市杨浦区昆明路508号北美广场B座12楼

联系人:徐诚

联系电话:021-38509639

网站:www.noah-fund.com

客服电话:400-821-5399

40、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

41、上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址:上海市黄浦区西藏南路765号602-115室

法定代表人:陈继武

客服电话:400-643-3389

联系人:葛佳蕊

电话:021-63333319

传真:021-63332523

网址:www.vstonewealth.com

42、天相投资顾问有限公司

注册地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701

法定代表人:林义相

客服电话:010-66045678

联系人:尹伶

传真:010-66045527

网址:www.txsec.com

43、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006号

法定代表人:杨懿

办公地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006号

联系人:张燕

联系电话:010-58325388*1588

网站:www.new-rand.cn

客服电话:400-166-1188

44、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

45、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

46、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

47、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

48、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

49、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

50、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/

51、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

52、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

53、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

54、上海万得基金销售有限公司

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:上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼

法定代表人:黄祎

联系人:徐亚丹

联系电话:021-50712782

传真:021-50710161

客服电话:400-799-1888

网址:www.520fund.com.cn

55、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

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:中国证券登记结算有限责任公司

地址:北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人:周明

联系人:赵亦清

电话:(010)50938782

传真:(010)50938907

(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:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址:上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼

执行事务合伙人:李丹

电话:021-23238888

传真:021-23238800

联系人:陈薇瑶

经办注册会计师:张振波、陈薇瑶

四、基金的名称

本基金名称:大成多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)。

五、基金的类型

本基金类型:混合型基金

六、基金的运作方式

本基金运作方式:上市开放式

七、基金的投资目标

在封闭期内,本基金主要参与上市公司股票定向增发,基金管理人在控制风险的前提下,追求基金资产长期稳健增值。

转为上市开放式基金(LOF)后,基金管理人在控制风险和保持资产流动性的基础上,主要采用多策略投资于股票,追求基金资产的长期稳健增值。

八、基金的投资范围

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)、债券(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、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、银行存款、同业存单、权证、股指期货、国债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:封闭期内股票占基金资产的比例为0%一100%,其中投资于上市公司定向增发股票占基金非现金资产的比例不低于80%;转为上市开放式基金(LOF)后,股票占基金资产的比例为0-95%。封闭期内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,应当保持不低于交易保证金一倍的现金;转为上市开放式基金(LOF)后,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,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、股指期货、国债期货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。

九、基金的投资策略

1、大类资产配置策略

本基金通过对宏观经济、市场面、政策面等因素的分析研究,结合与定增事件相关的情绪指标确定股票、债券及其他金融工具的比例。

2、股票投资策略

(1)定向增发投资策略

在封闭期内,本基金股票资产将主要参与上市公司定向增发,并辅以其他股票投资策略。基金经理在参与定向增发项目时,将根据定向增发折价率、定向增发类别、市场氛围判断(牛市/熊市)、所处行业、公司自身价值判断、定增项目前景等因素精选优质标的,采用分散投资方式,降低组合风险。对于解除锁定的增发股份,基金管理人将基于市场环境、公司估值水平、同类行业估值水平、公司近期的经营管理状况等作出是否售出的判断。项目退出策略更注重本金和盈利的安全。

(2)股票投资策略

本基金转为上市开放式基金后,主要采用多策略投资于股票,包括基本面选股策略和与定增事件相关的投资策略。一般不参与上市公司定向增发,但基金经理可以根据相关法律法规的规定及考虑流动性安排后将部分资产投资于上市公司定向增发。

1)基本面选股策略

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与成长能力,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。

在对公司基本情况分析的基础上,本基金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,从中选择估值水平相对合理的公司。

本基金将结合公司状况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。基金经理将按照公司的投资决策程序,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。

2)与定增事件相关的投资策略

基金管理人采用“自上而下”和“自下而上”相结合的投资策略,筛选定增事件相关的股票,重点关注自定增预案公告至增发股份锁定期结束后6个月内的上市公司, 通过分析上市公司所处行业、主营业务、同行业竞争水平、公司内部管理水平、盈利能力、资本负债结构、商誉等,评估上市公司的“内在价值”,结合上市公司的定增行为对上市公司估值重构、盈利提升的影响、上市公司市值管理需要、市场情绪特征、宏观经济环境等多方面的因素综合判断,把握定增事件的联动效应,审慎制定参与股票投资交易的投资方案。与定增事件相关的投资策略主要包括:

a)定增倒挂策略

定增倒挂是指定增发行价格高于届时股票交易价格的情形。基金管理人将关注并择机参与定增倒挂发行的公司,获取超额收益。

b)定增破发策略

定增破发是指股票交易价格跌破之前定增发行价格的情形。基金管理人将择机参与定增破发上市公司,获取超额收益。

c)事件驱动策略

定向增发项目自预案公告开始至成功实施历经董事会、股东大会、发审委、证监会等几个环节的审议批准。基金管理人基于对定增事件的分析,重点关注自定增预案公告至增发股份锁定期结束后6个