

大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金(A类份额)

基金产品资料概要更新

编制日期：2023年8月24日

送出日期：2023年9月5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	大成趋势回报灵活配置混合	基金代码	002383
下属基金简称	大成趋势回报灵活配置混合A	下属基金交易代码	002383
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
基金合同生效日	2016年3月22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	徐雄晖	开始担任本基金基金经理的日期	2022年12月4日
		证券从业日期	2008年7月8日
其他	《基金合同》生效后，连续20个工作日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。		

二、基金投资与净值表现

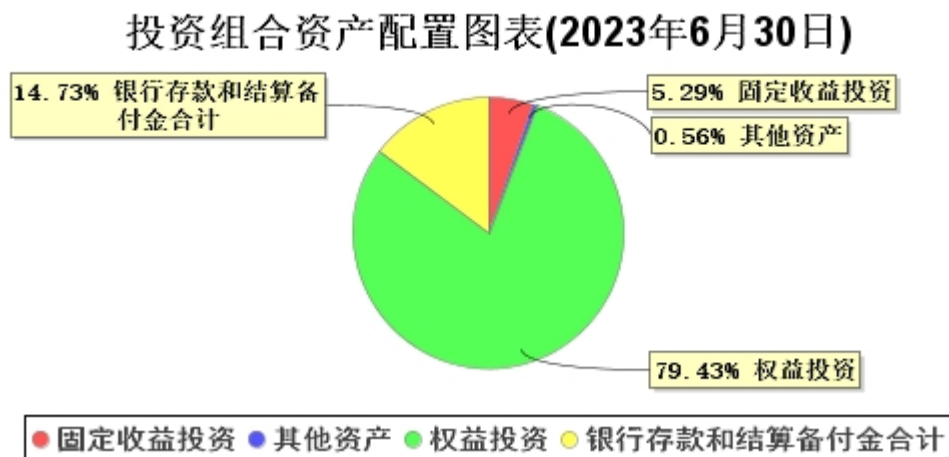
(一) 投资目标与投资策略

详见《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》第八部分“基金的投资”。

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。
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）、存托凭证、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、存托凭证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

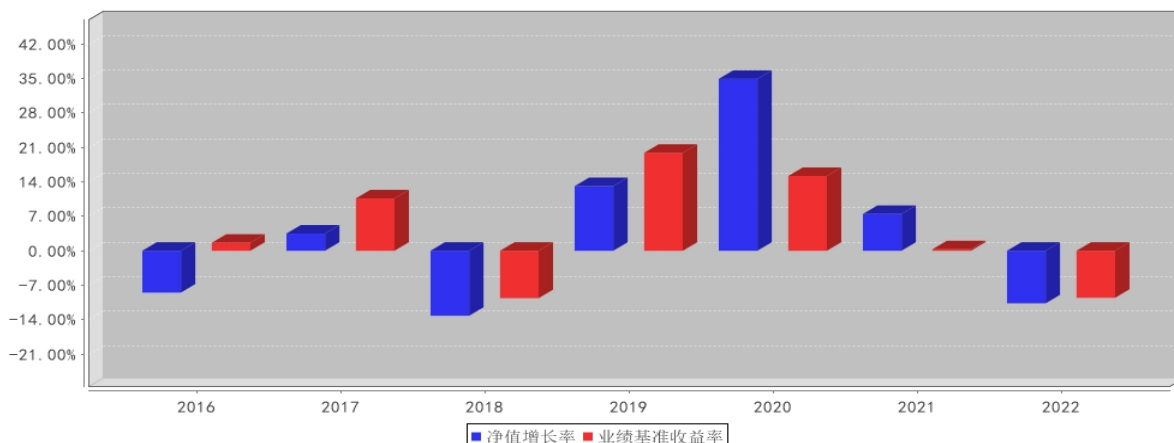
	易保证金后，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。
主要投资策略	<p>本基金的投资策略主要体现在两个方面：一方面体现在对权益类资产及固定收益类资产等不同类别资产的大类配置上，另一方面体现在对单个投资品种的选择上。</p> <p>本基金强调趋势投资，具体可以概括为：</p> <p>本基金根据对宏观趋势的分析实施大类资产的配置，即本基金从宏观经济发展趋势、相关政策研究的角度出发，把握经济一体化、产业优化升级及经济结构调整等带来的投资机遇，重点分析宏观经济环境、国家经济政策、市场整体风险等宏观因素，确定权益类资产、固定收益类资产等大类资产的配置比例并进行实时动态调整；</p> <p>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；</p> <p>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。在控制风险的前提下，本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p>
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%
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。

(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

大成趋势回报灵活配置混合A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图(2022年12月31日)



- 注:1、基金的过往业绩不代表未来表现。
2、如合同生效当年不满完整自然年度的,按实际期限计算净值增长率。

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
申购费 (前收费)	M<100万元	1.5%
	100万元≤M<300万元	1%
	300万元≤M<500万元	0.6%
	M≥500万元	1,000元/笔
赎回费	N<7天	1.5%
	7天≤N<30天	0.75%
	30天≤N<180天	0.5%
	180天≤N<1年	0.1%
	1年≤N<2年	0.05%
	N≥2年	0.0

注:养老金账户在基金管理人直销中心办理账户认证手续后,可享受申购费率优惠,具体情况可详见公司相关公告。

(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%
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、律师费和诉讼费、基金份额持有人大会费用(包括但不限于场地费、会计师费、律师费和公证费)、基金的证券交易费用、基金的银行汇划费用、基金的开户费用、账户维护费用。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:本基金作为混合型基金,具有对相关市场的系统性风险,不能完全规避市场下跌的风险和个券风险,在市场大幅上涨时也不能保证基金净值能够完全跟随或超越市场上涨幅度。

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。具体为:

(1) 市场风险是指由于期货价格变动而给投资人带来的风险。市场风险是期货投资中最主要的风险。

(2) 流动性风险是指由于期货合约无法及时变现所带来的风险。

(3) 基差风险是指期货合约价格和标的指数价格之间价格差的波动所造成的风险,以及不同期货合约价格之间价格差的波动所造成的期限价差风险。

(4) 保证金风险是指由于无法及时筹措资金满足建立或维持期货合约头寸所要求的保证金而带来的风险。

(5) 信用风险是指期货经纪公司违约而产生损失的风险。

(6) 操作风险是指由于内部流程的不完善,业务人员出现差错或者疏漏,或者系统出现故障等原因造成损失的风险。

(7) 投资存托凭证的相关风险。

2、本基金还面临其他投资风险,如科创板股票投资风险、市场风险、管理风险、流动性风险、其他风险等。

(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。

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. 大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同、大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金托管协议、大成趋势回报灵活配置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