

信达澳银转型创新股票型证券投资基金 招募说明书（更新）摘要

基金管理人：信达澳银基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

二〇二〇年三月

重要提示

信达澳银转型创新股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会2015年1月23日证监许可【2015】119号文准予注册募集。根据相关法律法规，本基金基金合同已于2015年4月15日生效，基金管理人于该日起正式开始对基金财产进行运作管理。

基金管理人保证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。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦承担基金投资中出现的各类风险，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，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特有风险等。

本基金投资中小企业私募债券，中小企业私募债是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。由于不能公开交易，一般情况下，交易不活跃，潜在较大流动性风险。当发债主体信用质量恶化时，受市场流动性所限，本基金可能无法卖出所持有的中小企业私募债，由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。

本基金为股票型基金，长期预期风险与收益高于混合型基金、债券基金、货币市场基金，属于风险较高、收益较高的证券投资基金产品。投资有风险，投资者认（申）购基金份额时应认真阅读本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，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出

投资决策。

投资者应当通过本基金管理人或代销机构购买和赎回基金。本基金在募集期内按 1.00 元面值发售并不改变基金的风险收益特征。投资者按 1.00 元面值购买基金份额以后，有可能面临基金份额净值跌破 1.00 元、从而遭受损失的风险。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不向投资者保证基金一定盈利，也不向投资者保证最低收益。

本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，由投资者自行承担。

本基金本次招募说明书所载内容截止日为 2020 年 2 月 14 日，所载财务数据和净值表现截至 2019 年 12 月 31 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：信达澳银基金管理有限公司

住所：广东省深圳市南山区科苑南路（深圳湾段）3331 号阿里巴巴大厦 N1 座第 8 层和第 9 层

办公地址：广东省深圳市南山区科苑南路（深圳湾段）3331 号阿里巴巴大厦 T1 栋 8、9 层

邮政编码：518054

成立日期：2006 年 6 月 5 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字【2006】071 号

法定代表人：于建伟

电话：0755-83172666

传真：0755-83199091

联系人：郑妍

经营范围：基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务

组织形式：有限责任公司

注册资本：壹亿元

股本结构：信达证券股份有限公司出资 5400 万元，占公司总股本的 54%；康联首域集团有限公司（Colonial First State Group Limited）出资 4600 万元，占公司总股本的 46%

存续期间：持续经营

（二）主要人员情况

1、董事、监事、高级管理人员

董事：

祝瑞敏，董事长，中国人民大学管理学博士，高级会计师。2008 年 7 月至 2012

年4月历任东兴证券股份有限公司财务部总经理、公司助理总经理、公司副总经理，2012年4月至2019年4月任中国银河证券股份有限公司首席财务官。2019年4月任信达证券股份有限公司党委副书记，2019年9月任信达证券股份有限公司党委副书记、董事、总经理。2019年12月15日起兼任信达澳银基金管理有限公司董事长。

潘广建先生，副董事长，英国伯明翰大学工商管理硕士，加拿大注册会计师。曾任职于德勤会计师事务所稽核部、香港期货交易所监察部，1997年起历任山一证券分析员、香港证券及期货事务监察委员会助理经理、香港强制性公积金计划管理局经理、景顺亚洲业务发展经理、景顺长城基金管理公司财务总监、AXA 国卫市场部助理总经理、银联信托有限公司市场及产品部主管。2007年5月起任首域投资（香港）有限公司中国业务开发董事并于同年兼任信达澳银基金管理有限公司监事至2016年5月13日。2016年5月14日起兼任信达澳银基金管理有限公司董事。2019年起任澳大利亚联邦银行信达澳银董事，2019年12月5日兼任信达澳银基金管理有限公司副董事长。

朱永强先生，董事，浙江大学工学硕士，长江商学院高级管理工商管理硕士。2004年12月至2010年1月历任华泰联合证券有限责任公司总裁助理、副总裁，2010年1月至2012年11月任中信证券股份有限公司经纪业务发展管理委员会董事总经理，2012年11月至2016年10月任中国银河证券股份有限公司经纪业务线业务总监，兼任经纪管理总部总经理。2016年10月至2019年10月任前海开源基金管理有限公司执行董事长兼首席执行官。2019年12月5日起任信达澳银基金管理有限公司董事，2019年12月31日起任信达澳银基金管理有限公司总经理。

刘治海先生，独立董事，全国律师协会公司法专业委员会委员，北京市人大立法咨询专家，中国政法大学法学硕士，历任江苏省盐城市政法干校教师，首都经贸大学经济系讲师，自1993年2月起担任北京金诚同达律师事务所高级合伙人。2015年5月8日起兼任信达澳银基金管理有限公司独立董事。

张宏先生，独立董事，北京大学光华管理学院工商管理硕士，高级经济师。1987年9月至1997年1月历任中国建设银行总行信托投资公司证券部副总经理、国际业务部副总经理，1997年1月至2009年5月任北京国利能源投资有限公司副总经

理，2009年5月起历任华澳国际信托有限公司总裁、董事长、监事长。2019年4月9日起兼任信达澳银基金管理有限公司独立董事。

刘颂兴先生，独立董事，香港中文大学工商管理硕士。历任 W.I.Carr（远东）有限公司投资分析师，霸菱国际资产管理有限公司投资分析师、投资经理，纽约摩根担保信托公司 Intl 投资管理副经理，景顺亚洲有限公司投资董事，汇丰资产管理（香港）有限公司（2005年5月起改组为汇丰卓誉投资管理公司）股票董事，中银保诚资产管理有限公司投资董事，新鸿基地产有限公司企业策划总经理，中国平安资产管理（香港）有限公司高级副总裁兼股票投资董事，中国国际金融（香港）有限公司资产管理部执行董事，Seekers Advisors（香港）有限公司执行董事兼投资总监。2012年6月19日起担任广发资产管理（香港）有限公司董事总经理。2011年12月起兼任信达澳银基金管理有限公司独立董事。

执行监事：

郑妍女士，中国农业大学管理学硕士，现任监察稽核部总监。2007年5月加入信达澳银基金管理有限公司，历任客户服务部副总经理、监察稽核部副总经理、监察稽核总监助理。自2015年1月起兼任信达澳银基金管理有限公司职工监事。

高级管理人员：

朱永强先生，总经理，浙江大学工学硕士，长江商学院高级管理人员工商管理硕士，27年证券、基金从业经验，具有证券与基金从业资格、基金业高级管理人员任职资格。2004年12月至2010年1月历任华泰联合证券有限责任公司总裁助理、副总裁，2010年1月至2012年11月任中信证券股份有限公司经纪业务发展管理委员会董事总经理，2012年11月至2016年10月任中国银河证券股份有限公司经纪业务线业务总监，兼任经纪管理总部总经理。2016年10月至2019年10月任前海开源基金管理有限公司执行董事长兼首席执行官。2019年12月5日起任信达澳银基金管理有限公司董事，2019年12月31日起任信达澳银基金管理有限公司总经理。

黄晖女士，副总经理兼董事会秘书，中南财经大学经济学学士，加拿大 Concordia University 经济学硕士。23年证券、基金从业经验，具有证券与基金从业资格、基金业高级管理人员任职资格。1999年起历任大成基金管理有限公司研究部分析师、市场部副总监、规划发展部副总监、机构理财部总监等职务。2000-2001

年参与英国政府“中国金融人才培养计划”(FIST 项目),任职于东方汇理证券公司(伦敦)。2005年8月加入信达澳银基金管理有限公司,任督察长兼董事会秘书。2019年4月30日起任信达澳银基金管理有限公司副总经理。

于鹏先生,副总经理,中国人民大学经济学学士。26年证券、基金从业经验,具有证券与基金从业资格、基金业高级管理人员任职资格。历任中国建设银行总行信托投资公司证券总部驻武汉证券交易中心交易员、计划财务部会计、深圳证券营业部计划财务部副经理、经理;中国信达信托投资公司北京证券营业部总经理助理兼计财部经理;宏源证券股份有限公司北京营业部副总经理、机构管理总部业务监控部经理兼清算中心经理、资金财务总部副总经理、资金管理总部总经理兼客户资金存管中心总经理等职务。2005年10月加入信达澳银基金管理有限公司,历任财务总监、总经理助理兼财务总监、副总经理。

段皓静女士,督察长,西南财经大学经济学硕士。20年证券、基金行业监管经验,具有CPA注册会计师资格、基金从业资格、基金业高级管理人员任职资格。1996年加入深圳发展银行总行工作;2000年10月加入中国证券监督管理委员会深圳监管局,历任副主任科员、主任科员、副处级调研员、副处长、处长。2019年4月30日起任信达澳银基金管理有限公司督察长。

王咏辉先生,副总经理,英国牛津大学工程专业本科和牛津大学计算机专业硕士,22年证券、基金从业经验,具备基金从业资格、基金业高级管理人员任职资格、英国基金经理从业资格(IMC)、英国IET颁发的特许工程师(CEng)认证资格。曾任伦敦摩根大通(JPMorgan)投资基金管理公司分析员、高级分析师,汇丰投资基金管理公司(HSBC)高级分析师,伦敦巴克莱国际投资基金管理公司基金经理、部门负责人,巴克莱资本公司(Barclays Capital)部门负责人,泰达宏利基金管理公司(Manulife Teda)国际投资部负责人、量化投资与金融工程部负责人、基金经理,鹏华基金管理有限公司量化及衍生品投资部总经理、资产配置与基金投资部总监、基金经理兼投资决策委员会委员等职务。2017年10月加入信达澳银基金管理有限公司,任总经理助理、基金经理,分管权益投资总部、智能量化与资产配置总部。2019年8月16日起任信达澳银基金管理有限公司副总经理。

阳先伟先生,副总经理,西南财经大学金融学本科和西南财经大学金融学硕士,18年证券、基金从业经验,具有证券与基金从业资格、基金业高级管理人员任职资

格。2002年7月至2003年5月任民生证券有限公司业务经理、债券研究员；2003年5月至2004年6月任国海证券有限公司固定收益部高级经理；2004年6月至2016年10月任鹏华基金管理有限公司研究员、基金经理、公司投资决策委员会成员、固定收益部总经理；2016年10月至2018年8月任东吴证券股份有限公司董事总经理，资管八部总经理；2018年8月加入信达澳银基金管理有限公司，任总经理助理，分管固定收益总部。2019年5月17日起任信达澳银基金管理有限公司副总经理。

徐伟文先生，首席信息官，湖南大学工业自动化专业学士，25年证券、基金从业经验，具有证券与基金从业资格、基金业高级管理人员任职资格。1990年7月至1993年7月任长沙二机床厂数控机床控制系统技术员；1993年7月至1995年8月任《证券时报》证券信息数据库工程师；1995年9月至1998年9月任湘财证券公司经纪业务总部交易监控组主管；1999年1月至2004年8月历任广发证券深圳营业部电脑部经理、总部稽核部业务主管、IT审计主管；2004年8月至2008年9月任景顺长城基金管理有限公司法律稽核部稽核经理；2008年9月加入信达澳银基金管理有限公司，历任交易部经理、运营总监。2019年5月17日起任信达澳银基金管理有限公司首席信息官。

冯明远先生，联席投资总监，浙江大学计算机科学与技术专业硕士。10年证券、基金从业经验，具有证券与基金从业资格。2010年9月至2013年12月，就职于平安证券综合研究所，任行业研究员，2014年1月加入信达澳银基金公司，历任行业研究员、基金经理助理、基金经理、权益投资总部副总监。2020年1月16日起任信达澳银基金管理有限公司联席投资总监。2、基金经理

(1) 现任基金经理：

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王咏辉	本基金的基金经理、信达澳银领先增长混合基金、信达澳	2018-06-06	-	21年	英国牛津大学工程专业本科和牛津大学计算机专业硕士。1998年至2001年任伦敦摩根大通（JPMorgan）投资基金管理公司分析员、高级分析师，

	<p>银中证沪港深指数基金、信达澳银新起点定期开放混合基金、信达澳银转型创新股票型基金、信达澳银量化多因子混合型基金（LOF）、信达澳银量化先锋混合型基金（LOF）的基金经理，副总经理、权益投资总部总监、智能量化与资产配置总部总监</p>			<p>2001年至2002年任汇丰投资基金管理公司（HSBC）高级分析师，2002年至2004年任伦敦巴克莱国际投资基金管理公司基金经理、部门负责人，2004年至2008年巴克莱资本公司（Barclays Capital）部门负责人，2008年3月至2012年8月任泰达宏利基金管理公司（ManulifeTeda）国际投资部负责人、量化投资与金融工程部负责人、基金经理，2012年8月至2017年7月历任鹏华基金管理有限公司量化及衍生品投资部总经理、资产配置与基金投资部总监、基金经理兼投资决策委员会委员等职务。2017年10月加入信达澳银基金管理有限公司，任副总经理、权益投资总部总监、智能量化与资产配置总部总监。现任信达澳银新起点混合基金基金经理（2018年6月6日起至今）、信达澳银领先增长混合基金基金经理（2018年12月3日起至今）、信达澳银转型创新股票基金基金经理（2019年4月26日起至今）、信达澳银中证沪港深指数基金基金经理（2019年4月26日起至今）、信达澳银量化多因子混合型基金（LOF）基金经理（2019年11月6日起至今）、信达澳银量化先锋混合型基金（LOF）基金经理（2020年2月4日起至今）。</p>
--	---	--	--	---

(2) 曾任基金经理：

姓名	任本基金的基金经理期限	
	任职日期	离任日期
尹哲	2015年04月15日	2015年09月08日
杜蜀鹏	2015年04月15日	2016年01月22日
柴妍	2015年08月19日	2016年10月27日

3、公司公募基金投资审议委员会

公司公募基金投资审议委员会由7名成员组成，设主席1名，委员6名。名单如下：

主席：朱永强，总经理

委员：

黄晖，副总经理兼董事会秘书

阳先伟，副总经理、固定收益总部总监

王咏辉，副总经理、权益投资总部总监、智能量化与资产配置总部总监

曾国富，权益投资总部副总监、基金经理

孔学峰，固定收益总部副总监、基金经理

刘威，权益投资总部副总监

上述人员之间不存在亲属关系。

二、基金托管人

(一) 基金托管人情况

1、基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：田 青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于 1954 年 10 月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于 2005 年 10 月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码 939)，于 2007 年 9 月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码 601939)。

2018 年末，集团资产规模 23.22 万亿元，较上年增长 4.96%。2018 年度，集团实现净利润 2,556.26 亿元，较上年增长 4.93%；平均资产回报率和加权平均净资产收益率分别为 1.13%和 14.04%；不良贷款率 1.46%，保持稳中有降；资本充足率 17.19%，保持领先同业。

2018 年，本集团先后荣获新加坡《亚洲银行家》“2018 年中国最佳大型零售银行奖”、“2018 年中国全面风险管理成就奖”；美国《环球金融》“全球贸易金融最具创新力银行”、《银行家》“2018 最佳金融创新奖”、《金融时报》“2018 年金龙奖—年度最佳普惠金融服务银行”等多项重要奖项。本集团同时获得英国《银行家》、香港《亚洲货币》杂志“2018 年中国最佳银行”称号，并在中国银行业协会 2018 年“陀螺”评价中排名全国性商业银行第一。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合与合规管理处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、养老金托管处、全球托管处、新兴业务处、运营管理处、托管应用系统支持处、跨境托管运营处、合规监督处等 11 个职能处室，在安徽合肥设有托管运营中心，在上海设有托管运营中心上海分中心，共有员工 300 余人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

2、主要人员情况

蔡亚蓉，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行总行资金计划部、信贷经营部、公司业务部以及中国建设银行重组改制办公室任职，并在总行公司业务

部担任领导职务。长期从事公司业务，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原玘，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

3、基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金、存托业务等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2019年二季度末，中国建设银行已托管924只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行先后9次获得《全球托管人》“中国最佳托管银行”、4次获得《财资》“中国最佳次托管银行”、连续5年获得中债登“优秀资产托管机构”等奖项，并在2016年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”、在2017年荣获《亚洲银行家》“最佳托管系统实施奖”。

（二）基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳

健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作，具有独立行使内控合规工作职权和能力。

3、内部控制制度及措施

资产托管业务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

（三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

1、监督方法 依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“新一代托管应用监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

2、监督流程

（1）每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统，对各基金投资运作比例控制等情况进行监控，如发现投资异常情况，向基金管理人进行风险提示，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，如有重大异常事项及时报告中国证监会。

（2）收到基金管理人的划款指令后，对指令要素等内容进行核查。

（3）通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，如有必要将及时报告中国证监会。

三、相关服务机构

(一) 销售机构及联系人

1、直销机构

名称：信达澳银基金管理有限公司

住所：广东省深圳市南山区科苑南路（深圳湾段）3331 号阿里巴巴大厦 N1 座第 8 层和第 9 层

办公地址：广东省深圳市南山区科苑南路（深圳湾段）3331 号阿里巴巴大厦 T1 栋 8、9 层

法定代表人：于建伟

电话：0755-82858168/0755-83077068

传真：0755-83077038

联系人：王丽燕

公司网址：www.fscinda.com

邮政编码：518054

2、代销机构

序号	名称	注册地址	法定代表人	办公地址	客服电话	联系人	网站
1	中国建设银行股份有限公司	北京市西城区金融大街 25 号	田国立	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼	95533	吴寒冰	www.ccb.com
3	交通银行股份有限公司	上海市浦东新区自由贸易试验区银城中路 188 号	彭纯	同“注册地址”	95559	胡佳敏	www.bankcomm.com
4	中信银行股份有限公司	北京东城区朝阳门北大街 9 号东方文化大厦中	李庆萍	同“注册地址”	95558	王晓琳	www.citicbank.com

		信银行总 行 12 层					
7	平安银行股 份有限公司	深圳市罗 湖区深南 东路 5047 号	谢永 林	同“注册 地址”	95511-3	汤俊 劫、 赵杨	www.bank.pinga n.com
9	渤海银行股 份有限公司	天津市河 东区海河 东路 218 号	李伏 安	天津市河 东区海河 东路 218 号渤海 银行大厦	95541/40088 88811	王宏	www.cbhb.com.c n
12	南洋商业银 行（中国） 有限公司	上海市浦 东新区世 纪大道 800 号三 层、六层至 九层	陈孝 周	上海市浦 东新区世 纪大道 800 号南 洋商业银 行大厦	4008302066	繆佳 莹	www.ncbchina.c n/cn/index.htm 1
13	恒丰银行股 份有限公司	山东省烟 台市芝罘 区南大街 248 号	蔡国 华	同“注册 地址”	95395	顾于 斌	www.hfbank.com .cn
14	江苏江南农 村商业银行 股份有限公 司	江苏省常 州市和平 中路 413 号	陆向 阳	同“注册 地址”	0519-96005	李仙、 蒋姣	www.jnbank.com .cn
16	信达证券股 份有限公司	北京市西 城区闹市 口大街 9 号院 1 号 楼	张志 刚	同“注册 地址”	95321	付婷、 任立 秋	www.cindasc.co m
17	中国银河证 券股份有限 公司	北京市西 城区金融 大街 35 号 国际企业 大厦 C 座 2-6 层	陈共 炎	同“注册 地址”	95551/40088 88888	辛国 政	www.chinastock .com.cn
19	申万宏源证 券有限公司	上海市徐 汇区长乐 路 989 号 45 层	李梅	上海市徐 汇区长乐 路 989 号 45 层	95523/40088 95523	余敏	www.swhysc.com
20	申万宏源西 部证券有限 公司	新疆乌鲁 木齐市高 新区（新市 区）北京南	韩志 谦	新疆乌鲁 木齐市高 新区（新市 区）北京南	4008000562	黄莹	www.hysec.com

		路 358 号 大成国际 大厦 20 楼 2005 室		358 号大成 国际大厦 20 楼 2005 室			
21	华龙证券股 份有限公司	甘肃省兰 州市城关 区东岗西 路 638 号 兰州财富 中心 21 楼	李 晓 安	同“注册地 址”	95368/40068 98888	范坤、杨 力	www.hlzqgs.com
22	中信证券股 份有限公司	广东省深 圳市福田 区中心 3 路 8 号卓 越时代广 场（二期） 北座	张 佑 君	北京市朝 阳区亮马 桥路 48 号中信 证券大厦 18 层	95558	杜 杰	www.cs.ecitic. com
23	中信证券 （山东）有 限责任公司	青岛市崂 山区深圳 路 222 号 青岛国际 金融广场 1 号楼 20 层 2001	姜 晓 林	同“注册地 址”	95548	孙秋月	www.zxzqsd.com .cn
24	国泰君安证 券股份有限 公司	中国（上 海）自由 贸易试验 区商城路 618 号	杨 德 红	上海市浦 东新区银 城中路 168 号上 海银行大 厦 29 层	95521	钟伟镇	www.gtja.com
26	光大证券股 份有限公司	上海市静 安区新闻 路 1508 号	周 健 男	同“注册地 址”	95525	代小燕、 姚崑	www.ebscn.com
28	海通证券股 份有限公司	上海市黄 浦区广东 路 689 号	周 杰	上海市广 东路 689 号海通 证券大厦	95553/40088 88001	王立群	www.htsec.com
29	招商证券股 份有限公司	深圳市福 田区益田 路江苏大 厦 A 座 38-45 层	霍 达	同“注册地 址”	95565	黄婵君	www.newone.com .cn
30	国信证券股 份有限公司	深圳市罗 湖区红岭 中路 1012 号国信证	何 如	深圳市罗 湖区红岭 中路 1012 号国 信证券大 厦	95536	李颖	www.guosen.com .cn

		券大厦 16-26层		16层至26 层			
32	安信证券股 份有限公司	深圳市福 田区金田 路4018号 安联大厦 35层、28 层A02单 元	王连志	同“注册地 址”	95517	刘志斌	www.essence.co m.cn
33	平安证券股 份有限公司	深圳市福 田中心区 金田路 4036号荣 超大厦 16-20层	刘世安	同“注册地 址”	95511	王阳	stock.pingan.c om
34	东兴证券股 份有限公司	北京市西 城区金融 大街5号 新盛大厦 B座12-15 层	魏庆华	同“注册地 址”	95309/40088 88993	和志鹏	www.dxzq.net
35	世纪证券有 限责任公司	深圳市前 海深港合 作区南山 街道桂湾 五路128 号前海深 港基金小 镇对冲基 金中心 406	李强	深圳市福田区深南大道 7088号招商银行大厦 40-42层	4008323000	王雯、陈 玮	www.csc.com.c n
36	华福证券有 限责任公司	福州市鼓 楼区温泉 街道五四 路157号 新天地大 厦7-9层	黄金琳	福州市五四 路157号新 天地大厦7 至10层	95547	王虹,刘 蕴祺	www.hfzq.com.c n
38	广州证券股 份有限公司	广州市天 河区珠江 西路5号 广州国际 金融中心 主塔19	邱三发	同“注册地 址”	95396	梁微	www.gzs.com.cn

		层、20层					
39	新时代证券股份有限公司	北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501	叶顺德	同“注册地址”	95399	田芳芳	www.xsdzq.cn
40	长江证券股份有限公司	武汉市新华路特8号长江证券大厦	尤习贵	同“注册地址”	95579/4008888999	奚博宇	www.95579.com
43	中泰证券股份有限公司	济南市市中区经七路86号	李玮	同“注册地址”	95538	朱琴	www.zts.com.cn
44	粤开证券股份有限公司	惠州市江北东江三路55号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层	严亦斌	深圳市福田区深南中路2002号中广核大厦北楼10层	95564	彭莲	www.ykzq.com
45	长城证券有限责任公司	深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层	丁益	深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14层	4006666888	王涛	www.cgws.com
46	恒泰证券股份有限公司	内蒙古呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座D座光大银行办公楼14-18楼	庞介民	同“注册地址”	4001966188	熊丽	www.cnht.com.cn
47	太平洋证券股份有限公司	云南省昆明市北京路926号同德广场	李长伟	北京市西城区北展北街9号华远企业号D座3	95397	王婧	www.tpyzq.com

		写字楼 31 楼		单元			
48	国金证券股份有限公司	四川省成都市青羊区东城根上街 95 号	冉云	同“注册地址”	95310	杜晶、贾鹏	www.gjq.com.cn
50	首创证券有限责任公司	北京市西城区德胜门外大街 115 号德胜尚城 E 座	吴涛	同“注册地址”	4006200620	刘宇	www.sczq.com.cn
51	华西证券股份有限公司	四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦	杨炯洋	同“注册地址”	95584	谢国梅	www.hx168.com.cn
52	山西证券股份有限公司	山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼	侯巍	同“注册地址”	95573/4006661618	郭熠	www.i618.com.cn
53	五矿证券有限公司	深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心办公楼 47 层 01 单元	赵立功	同“注册地址”	4001840028	濮耘瑶	www.wkzq.com.cn/
54	联储证券有限责任公司	广东省深圳市福田区华强北路圣廷苑酒店 B 座 26 楼	沙常明	北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 27 层联储证券	4006206868	丁倩云	www.lczq.com
55	西藏东方财富证券股份有限公司	拉萨市北京中路 101 号	陈宏	上海市徐汇区宛平南路 88 号金座东方财富大厦	95357	付佳	http://www.18.cn

56	中银国际证券股份有限公司	上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层	宁敏	同“注册地址”	4006208888	初晓、王炜哲	www.bocichina.com
57	诺亚正行基金销售有限公司	上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室	汪静波	同“注册地址”	4008215399	李娟	www.noah-fund.com
58	深圳众禄基金销售股份有限公司	深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼801	薛峰	深圳市罗湖区梨园路8号HALO广场4楼	4006788887	童彩平、徐丽平	www.zlfund.cn/ www.jjmmw.com
59	上海天天基金销售有限公司	上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层	其实	上海市徐汇区龙田路195号3C座7楼	95021/4001818188	马茜玲	www.1234567.com.cn
60	上海好买基金销售有限公司	上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号	杨文斌	同“注册地址”	4007009665	高源	www.howbuy.com
61	蚂蚁(杭州)基金销售有限公司	杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1幢202室	陈柏青	杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼	4000766123	徐丽玲、铄金	www.fund123.cn
62	和讯信息科技有限公司	北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦1002室	王莉	同“注册地址”	4009200022	陈慧慧、陈艳琳	licaike.hexun.com
63	浙江同花顺基金销售有限公司	杭州市文二西路一号903室	凌顺平	同“注册地址”	4008773772	朱琼	www.5ifund.com
64	上海联泰基金销售有限公司	中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室	燕斌	上海市长宁区金钟路658弄2号楼B座6楼	4001181188	兰敏	www.66zichan.com

65	北京展恒基金销售股份有限公司	北京市顺义区后沙峪镇安富街6号	闫振杰	山西省太原市迎泽区劲松北路31号哈伯大厦9层	4008188000	李晓芳	www.myfund.com
66	浦领基金销售有限公司	北京市朝阳区望京东园四区13号楼A座9层908室	聂婉君	北京市朝阳区望京浦项中心A座9层04-08	4008769988	徐微	www.zscffund.com
67	中信期货有限公司	深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层	张皓	深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层	4009908826	刘宏莹	www.citicsf.com
68	上海长量基金销售有限公司	上海市浦东新区高翔路526号2幢220室	张跃伟	上海市浦东新区东方路1267号11层	4008202899	詹慧萌	www.erichfund.com
69	北京虹点基金销售有限公司	北京市朝阳区工人体育场北路甲2号盈科中心B座裙房2层	郑毓栋	北京市朝阳区工人体育馆北路甲2号盈科中心B座裙楼二层	4006180707	陈铭洲	www.hongdianfund.com
70	上海陆金所基金销售有限公司	上海市自由贸易试验区陆家嘴环路1333号14楼09单元	王之光	同“注册地址”	4008219031	程晨	www.lufunds.com
71	上海利得基金销售有限公司	上海市宝山区蕴川路5475号1033室	李兴春	上海虹口区东大名路1098号浦江国际金融广场53楼	95733	陈洁	www.leadfund.com.cn

72	深圳市金斧子基金销售有限公司	深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元11层1108	赖任军	同“注册地址”	4009300660	刘昕霞	www.jfzinv.com
73	珠海盈米基金销售有限公司	珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491	肖雯	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	89629066	梁文燕、邱湘湘	www.yingmi.cn
74	北京创金启富基金销售有限公司	北京西城区白纸坊东街2号院6号楼712室	梁蓉	同“注册地址”	4006262818	王瑶	www.5irich.com
75	北京钱景基金销售有限公司	北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012	赵荣春	同“注册地址”	4008936885	田伟静	www.qianjing.com
76	中证金牛(北京)投资咨询有限公司	北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室	钱昊旻	北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层	4008909998	孙雯	www.jnlc.com
77	北京广源达信基金销售有限公司	北京市西城区新街口外大街28号C座六层605室	齐剑辉	北京市朝阳区望京宏泰东街浦项中心B座19层	4006236060	王永霞	www.niuniufund.com
78	上海万得基金销售有限公司	中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座	王廷富	上海市浦东新区福山路33号8楼	4008210203	徐亚丹	www.520fund.com.cn

79	北京富国大通资产管理有限公司	北京市东城区北三环东路36号1号楼A2501室	宋宝峰	同“注册地址”	4000880088	方芳	www.fuguowealth.com
80	上海基煜基金销售有限公司	上海市崇明县长兴镇潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济展发展区）	王翔	上海市杨浦区昆明路518号A1002室	4008205369	居晓菲	www.jiyufund.com.cn
81	北京汇成基金销售有限公司	北京市海淀区中关村大街11号E世界财富中心A座11层1108号	王伟刚	北京市海淀区中关村大街11号E世界财富中心A座11层	4006199059	王骁骁	www.hcjijin.com
82	中民财富基金销售（上海）有限公司	上海市黄浦区中山南路100号7层05单元	弭洪军	上海市黄浦区中山南路100号17层	4008765716	黄鹏	www.cmiwm.com
83	北京植信基金销售有限公司	北京市密云县兴盛南路8号院2号楼106室-67	王军辉	北京市朝阳区惠河南路盛世龙源10号	4006802123	吴鹏	www.zhixin-inv.com
84	北京肯特瑞基金销售有限公司	北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15	江卉	北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街十八号院京东集团总部	95118/4000988511	黄立影	kenterui.jd.com/fund.jd.com/
85	喜鹊财富基金销售有限公司	西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1513室	陈皓	同“注册地址”	4006997719	曹砚财	www.xiquefund.com
86	一路财富（北京）基金销售股份	北京市西城区阜成门大街2	吴雪秀	同“注册地址”	4000011566	吕晓歌	www.yilucaifu.com

	有限公司	号万通新世界广场 A座2208					
87	南京苏宁基金销售有限公司	南京市玄武区苏宁大道1号	王锋	同“注册地址”	95177	张云飞	www.snjijin.com
88	济安财富(北京)基金销售有限公司	北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307	杨健	同“注册地址”	4006737010	李海燕	www.jianfortune.com
89	北京蛋卷基金销售有限公司	北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507	钟斐斐	北京市朝阳区创远路34号院融新科技中心C座17层	4005199288	王悦	www.danjuanapp.com

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其它符合要求的机构代理销售本基金或变更上述代销机构，并在基金管理人网站公示。

(二) 注册登记机构

名称：信达澳银基金管理有限公司

住所：广东省深圳市南山区科苑南路（深圳湾段）3331号阿里巴巴大厦N1座第8层和第9层

办公地址：广东省深圳市南山区科苑南路（深圳湾段）3331号阿里巴巴大厦T1栋8、9层

法定代表人：于建伟

电话：0755-83172666

传真：0755-83196151

联系人：刘玉兰

(三) 律师事务所和经办律师

名称：上海源泰律师事务所

办公地址：上海市浦东南路256号华夏银行大厦1405室

负责人：廖海

电话：021-51150298

传真：021-51150398

联系人：刘佳

经办律师：刘佳、徐莘

（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（特殊普通合伙）

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

法定代表人（执行事务合伙人）：毛鞍宁

联系电话：010-58153000

传真：010-85188298

联系人：昌华

经办注册会计师：昌华、高鹤

四、基金的名称

信达澳银转型创新股票型证券投资基金

五、基金的运作方式和类型

运作方式：契约型、开放式

类型：股票型基金

六、基金的投资目标

本基金通过积极主动的管理，在有效控制风险的前提下，深度挖掘企业转型创新过程中产生的各类投资机遇，力争在中长期为投资者获取超越业绩比较基准的投资回报。

七、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等）、债券（含中小企业私募债、可转换债券等）、债券回购、现金、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券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。

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。

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 80%-95%，其中投资于本基金定义的转型创新主题相关的股票资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；债券（含中小企业私募债、可转换债券等）资产、现金、货币市场工具、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例为 5%-20%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计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；权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%；资产支持证券的投资比例不超过基金资产净值的 20%。

八、基金的投资策略

本基金采取自上而下和自下而上相结合的积极主动的投资策略，并对投资组合进行动态调整。由于本基金为股票型基金，核心投资策略为股票精选策略，同时辅以资产配置策略优化投资组合的风险收益，提升投资组合回报。

1、资产配置策略

本基金管理人使用趋势和估值相结合的方式，结合定量和定性分析，从多个角度考虑宏观经济面、政策面、市场面等多种因素，综合分析评判证券市场的特点及其演化趋势。通过分析股票、债券等资产的预期收益风险的匹配关系，在此基础上，在投资比例限制范围内，确定或调整投资组合中股票和债券的比例。

本基金考虑的宏观经济指标包括 GDP 增长率、居民消费价格指数(CPI)、生产者价格指数(PPI)、采购经理人指数 (PMI)、货币供应量(M0, M1, M2)的增长率等

指标。

本基金考虑的市场因素包括但不限于市场的资金供求变化、上市公司的盈利增长情况、市场总体 P/E、P/B 等指标相对于长期均值水平的偏离度、经济增速相近的国家估值水平横向比较等多种指标，通过对上述指标的综合分析和研究实施投资组合的资产配置。

2、股票精选策略

本基金主要的股票投向是通过内生或者外延方式，使得公司的商业模式、主营业务领域实现创新升级或者跨行业转型升级，获得新的核心竞争优势，进而推动企业价值高速成长的企业。

（1）转型创新的涵义

在不同的经济发展阶段，由于特定的社会需求、技术以及当时的政策导向等多种因素的共同作用下，各个产业的发展速度、空间和行业前景存在差异，企业开展业务的具体商业模式也不尽相同。在原有业务发展面临困境，或是新行业面临高速发展的机遇，部分企业通过并购、重组、拓展等策略进入新行业获得竞争优势和新的发展机遇，或者通过内生的技术、组织、机制等创新手段，开拓具有较好发展前景的业务领域，获得新的转折性的发展机遇，称之为转型创新。

本基金转型创新的界定主要包括转型和创新两个方面：

一是转型的界定，主要包括传统行业、产能过剩行业的企业切入新的领域以及由于收购兼并获得新的增长机会。

传统行业企业转型主要是指传统行业的企业切入新的业务领域，例如水泥、钢铁等传统行业的企业，由于掌握了余热发电、污水处理等新的技术，进而切入政府产业政策长期鼓励的节能环保行业，企业实现成功转型；或者企业通过兼并收购那些政府产业政策鼓励、前景良好的中小企业进而获得了全新的增长机会。

二是业务创新的界定，主要包括企业在公司治理结构、新的技术、新的营销渠道、新的产品或者新的管理模式方面实现了创新突破，进而拉动企业进入一个新的增长周期。

公司治理结构方面的创新包括：公司进行混合所有制改革或者股权激励，由于治理结构的优化，使得公司潜力得到更大的释放，进而推动公司业绩进入一个新的增长周期；新的技术是指公司由于长期研发或者专利权购买等原因掌握了国内或者国

际同行业领先的先进技术，进而获得了新的增长机会；新的营销渠道是指公司产品销售渠道获得了实质性突破，例如介入电子商务或者其他新的渠道领域，进而拉动公司销售快速增长；新的产品是指公司开发出更加适合目标客户需求的新产品，实现销售收入的快速增长；新的管理模式是指公司由于在内部管理方面引入激励约束机制更强的管理制度，例如事业部制度等，进而带动公司进入一个新的增长阶段。

（2）转型创新主题股票的挖掘

1）初选股票库的构建

本基金对初选股票库的构建，是在转型创新主题界定的范畴中，过滤掉明显不具备投资价值的股票。剔除的股票包括法律法规和本基金管理人制度明确禁止投资的股票、ST 和*ST 股票、筹码集中度高且流动性差的股票、涉及重大案件和诉讼的股票等。

同时，本基金将密切关注股票市场企业动态，根据实际情况调整初选股票库。

2）风格股票库的构建

在初选股票库的基础上，本基金将结合定量评估、定性分析和估值分析来综合评估备选公司转型创新活动的价值，从中选择通过转型创新实现增长的上市公司。

① 行业配置

本基金将持续跟踪经济发展状况、产业结构升级、技术发展趋势以及国家的相关政策等，评估各行业在社会经济发展中的作用，高度关注具备良好经济效益或社会溢出效应，预期未来一段时间内将保持高增长的行业，确定为主题行业。具体分析时，管理人通过跟踪各行业整体的收入增速、利润增速、毛利率变动幅度、ROIC 变动情况，依此来判断各行业的景气度，再根据行业整体的估值情况，市场的预期，目前机构配置的比例来综合考虑各行业在组合中的配置比例。在操作过程中，本基金将根据宏观经济中期趋势、政策环境变化、各行业景气度情况以及估值区间水平等因素，对行业配置不断进行调整和优化。

② 个股精选

本基金基于动态静态指标相结合的原则，采用内在价值、相对价值相结合的评估方法，如市盈增长比率（PEG）、市盈率（P/E）、市净率（P/B）、企业价值/息税前利润（EV/EBIT）、企业价值/息税、折旧、摊销前利润（EV/EBITDA）、自由现金流贴现（DCF）等，对企业进行合理性评估。

（3）转型创新的投资决策

转型创新主题投资中，确定转型切入的主题行业所处的发展阶段尤其重要，基金管理人定期召开投资决策委员会会议，由宏观经济研究员、策略研究员、行业研究员和基金经理对主题行业进行评估，综合考虑主题发展阶段、主题催化因素、主题市场容量、主题估值水平等因素，确定每个主题行业的配置权重范围，从而进行相关转型创新主题股票的配置。

3、债券投资策略

本基金的债券投资将坚持价值投资理念，通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类属的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以久期控制和结构分布策略为主，以收益率曲线策略、利差策略等为辅，构造能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合。

中小企业私募债券投资策略：由于中小企业私募债券具有流动性较差、信息披露不公开、风险收益水平较高等特点，因此对该类信用产品的投资主要遵循精选个券、总量控制、分散投资、长期持有的原则。对个券投资前主要采取与股票投资相似的公司分析方式，对中小企业私募债券发行人的公司治理、发展前景、经营管理、财务状况及偿债能力作出综合评价，从而选择收益率水平与信用风险匹配，利差对违约风险和流动性风险构成合理补偿的个券进行投资。投资以后以高于普通信用债的频度对发行人的情况进行密切跟踪，包括且不限于对发行人进行电话和实地调研，与受托人、投行、评级机构等中介机构进行信息沟通等等，以保持对发行人经营状况和偿债能力变化情况的了解。对于组合里的中小企业私募债券暴露，根据本基金的类属配置策略、个券的投资价值和流动性管理要求，进行总量控制、分散投资，降低流动性和信用风险。

4、权证投资策略

本基金将权证作为有效控制基金投资组合风险、提高投资组合收益的辅助工具。本基金在投资权证时，将根据权证对应公司基本面研究成果确定权证的合理估值，发现市场对股票权证的非理性定价，谨慎进行投资，追求较为稳健的当期收益。

5、股指期货投资策略

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制

度并报董事会批准。

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在严格控制风险的前提下，通过参与股指期货投资，管理组合的系统性风险，改善组合的风险收益特征。

（1）时机选择策略

本基金通过对宏观经济运行状况、市场情绪、市场估值指标等的研究分析，判断是否需要投资组合进行套期保值及选择套期保值的期货合约。

（2）期货合约选择和头寸选择策略

本基金根据对需进行套期保值的投资组合的beta值的计算，在考虑期货合约基差、流动性等因素的基础上，选择合适的期货合约作为套期保值工具，并根据数量模型计算所需的期货合约头寸。本基金将对投资组合的beta值进行跟踪，动态调整期货合约的头寸。

（3）展期策略

当套期保值的时间较长时，需要对股指期货合约进行展期。本基金在跟踪不同交割日期期货合约价差的基础上，选择合适的交易时机及期货合约进行展期。

（4）保证金管理策略

本基金将通过数量化模型，根据套期保值的时间、投资组合及期货合约的波动性等参数计算所需的结算准备金，避免因保证金不足被迫平仓导致的套保失败。

若相关法律法规发生变化时，基金管理人期货投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为： $\text{沪深 300 指数收益率} \times 85\% + \text{上证国债指数收益率} \times 15\%$

采用该业绩比较基准主要基于如下考虑：

1、沪深 300 指数是由中证指数有限公司编制的反映 A 股市场整体走势的指数，编制合理、透明、运用广泛，具有较强的代表性与权威性，能够反映 A 股市场总体发展趋势，可以作为本基金股票投资部分的基准。

2、上证国债指数是以上海证券交易所上市的所有固定利率国债为样本，按照国债发行量加权而成，是上证指数系列的第一只债券指数，能够反映债券市场整体

变动状况，具有较强的市场代表性，可以作为本基金债券投资部分的基准。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，经与基金托管人协商一致，本基金可在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，不需要召开基金份额持有人大会。

十、基金的风险收益特征

本基金为股票型基金，属于较高风险、较高预期收益率的基金产品。

十一、基金的投资组合报告

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司复核了本次更新招募说明书中的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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

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

本投资组合报告期所载数据截止至 2019 年 12 月 31 日。本报告中财务资料未经审计。

一) 报告期末基金资产组合情况

单位：人民币元

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	415,985,653.31	84.90
	其中：股票	415,985,653.31	84.90
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,013,000.00	2.04
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	10,013,000.00	2.04
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	46,439,721.03	9.48
8	其他资产	17,519,626.03	3.58
9	合计	489,958,000.37	100.00

二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

1、报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	4,855,836.31	1.00
B	采矿业	4,639,887.54	0.95
C	制造业	199,479,444.62	40.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,616,924.75	1.36
E	建筑业	17,929,007.24	3.68
F	批发和零售业	7,694,304.22	1.58
G	交通运输、仓储和邮政业	4,891,234.71	1.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,966,675.39	3.07
J	金融业	131,022,787.30	26.91
K	房地产业	21,354,981.34	4.39
L	租赁和商务服务业	467,645.24	0.10
M	科学研究和技术服务业	120,144.85	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	6,578.04	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	741,473.08	0.15
R	文化、体育和娱乐业	1,198,728.68	0.25
S	综合	-	-

	合计	415,985,653.31	85.45
--	----	----------------	-------

2、报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本报告期末未持有沪港通股票。

三) 报告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

单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600030	中信证券	863,969	21,858,415.70	4.49
2	002271	东方雨虹	783,386	20,610,885.66	4.23
3	002475	立讯精密	544,600	19,877,900.00	4.08
4	600309	万华化学	335,255	18,831,273.35	3.87
5	601318	中国平安	219,069	18,721,636.74	3.85
6	601012	隆基股份	626,053	15,544,895.99	3.19
7	600332	白云山	352,626	12,557,011.86	2.58
8	000002	万科A	370,428	11,920,373.04	2.45
9	600036	招商银行	289,461	10,877,944.38	2.23
10	600519	贵州茅台	8,420	9,960,860.00	2.05

四) 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

五) 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投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	123924	首航04	100,000	10,013,000.00	2.06

注：本基金本报告期末仅持有上述资产支持证券。

七) 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

八) 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

九) 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

代码	名称	持仓量 (买/ 卖)	合约市值(元)	公允价值变动 (元)	风险说明
IF2 001	沪深300股 指期货2001 合约	15	18,472,500.0 0	224,220.00	-
公允价值变动总额合计(元)					224,220.00
股指期货投资本期收益(元)					1,498,821.36
股指期货投资本期公允价值变动(元)					427,969.32

注：本基金本报告期末仅持有以上股指期货。

2、本基金投资股指期货的投资政策

本基金在股指期货的投资中主要遵循避险和有效管理权益暴露两项策略和原则。即在市场风险大幅累计时的避险操作，减小基金投资组合因市场下跌而遭受的市场风险；同时利用股指期货流动性好、交易成本低等特点，通过股指期货对投资组合的仓位进行及时调整，提高投资组合的运作效率。在股指期货大幅贴水时，利用股指期货代替部分权益仓位，可以获得股票上涨的收益，还可以获得贴水收敛的收益，所以本基金会在适当的时候持有一定的股指期货。十) 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

注：本基金未参与投资国债期货。

2、报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

3、本期国债期货投资评价

注：本基金未参与投资国债期货。

十一) 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报告期内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、处罚的情形及相关投资决策程序说明。

(1) 中信证券（600030）

中信证券广州番禺万达广场证券营业部于 2019 年 11 月收到广东证监局“关于对中信证券股份有限公司广州番禺万达广场证券营业部采取责令改正措施的决定”，该公司违反了《证券公司分支机构监管规定》第十七条、《证券公司监督管理条例》第二十七条的规定。

该公司已经积极应对处理，并将加强内控，基金管理人经审慎分析，认为该事件对公司基本面不构成实质影响。

(2) 白云山（600332）

广东省药品监督管理局于 2019 年 3 月 26 日发布了《关于依法处理广州白云山医药集团股份有限公司白云山制药总厂盐酸环丙沙星片有关问题的公告》，内容为：原国家食品药品监督管理总局核查中心于 2018 年 11 月 16 日至 20 日组织对广州白云山医药集团股份有限公司（“本公司”）分公司广州白云山医药集团股份有限公司白云山制药总厂（“白云山制药总厂”）申报的盐酸环丙沙星片进行了仿制药一致性评价药学研制和生产现场有因检查，发现盐酸环丙沙星片生产存在不符合《药品质量管理规范（2010 年修订）》的缺陷，并要求省药监局依法处理。

根据省药监局采取的处理措施，该公司积极主动落实整改工作，根据相关要求立即停止生产盐酸环丙沙星片、封存在库产品及半成品、召回流通领域在售产品，主动减轻、消除可能存在的隐患。并将严格按照相关规定，加强产品的质量管理。基金管理人经审慎分析，认为该项事件对该公司基本面不构成实质影响。

除中信证券（600030）、白云山（600332）外，其余的本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查，也没有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，没有投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

3、其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,988,509.04
2	应收证券清算款	15,366,919.44

3	应收股利	-
4	应收利息	157,491.78
5	应收申购款	6,705.77
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	17,519,626.03

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

注：本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

6、投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

十二、基金的业绩

基金管理人承诺以诚实信用、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。基金的过往业绩并不预示其未来表现。投资有风险，投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同。

(一) 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(截至 2019 年 12 月 31 日):

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 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
2015 年 (2015 年 4 月 15 日至 2015 年 12 月 31 日)	-20.40%	3.16%	-12.45%	2.30%	-7.95%	0.86%

2016 年 (2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日)	-18.59%	1.96%	-8.94%	1.19%	-9.65%	0.77%
2017 年 (2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日)	20.22%	0.82%	18.42%	0.54%	1.80%	0.28%
2018 年 (2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日)	-25.29%	1.38%	-21.10%	1.14%	-4.19%	0.24%
2019 年 (2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日)	28.35%	1.17%	31.08%	1.06%	-2.73%	0.11%
自基金合同生效起至今 (2015 年 4 月 15 日至 2019 年 12 月 31 日)	-25.30%	1.78%	-2.36%	1.30%	-22.94%	0.48%

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

信达澳银转型创新股票型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2015 年 4 月 15 日生效，2015 年 5 月 18 日开始办理申购、赎回业务。

2、本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 80%-95%，其中投资于本基金定义的转型创新主题相关的股票资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；债券（含中小企业私募债、可转换债券等）资产、现金、货币市场工具、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例为 5%-20%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%；资产支持证券的投资比例不超过基金资产净值的 20%。本基金按规定在合同生效后六个月内达到上述规定的投资比例。

十三、基金的费用与税收

（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、除法律法规、中国证监会另有规定外，《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；
- 6、基金的证券、期货交易费用；
- 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。

（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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺

延。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

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) 费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率等费率，须召开基金份额持有人大会；调低基金管理费率、基金托管费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2日在至少一种指定媒介上公告。

(五) 基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人根据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的规定，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对本基金管理人于2020年1月6日公告的本基金的招募说明书进行了更新，现就本基金更新招募说明书中有关更新内容汇总如下：

- (一) 在“重要提示”部分，明确了更新招募说明书内容的截止日期；
- (二) 在“三、基金管理人”部分，更新了管理人的相关信息；

1、更新了证券投资基金管理情况；

2、更新了基金管理人董事、监事、高级管理人员的相关信息；

（三）在“四、基金托管人”部分，更新了基金托管人的相关信息；

（四）在“五、相关服务机构”部分，更新了代销机构的相关信息；

（五）在“九、基金的投资”部分，说明了本基金最近一期投资组合报告内容，数据截至 2019 年 12 月 31 日；

（六）在“十、基金的业绩”部分，说明了基金业绩相关数据，数据截至 2019 年 12 月 31 日；

（七）在“二十二、其他应披露事项”部分，更新了本基金的其他应披露事项列表。

信达澳银基金管理有限公司

二〇二〇年三月六日