

**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  
2017年第1期**

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

二〇一七年五月

## 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。

本招募说明书中与托管业务相关的更新信息已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2017 年 4 月 14 日，所载财务数据和净值表现截至 2016 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：

于帆先生，董事长，毕业于厦门大学法律系。1987 年 7 月至 1988 年 10 月任化工部管理干部学院经济系法学教师，1988 年 10 月至 1999 年 6 月任中国信达信托投

资公司部门副总经理、部门总经理，1999年6月至2000年9月任中国信达资产管理公司债权管理部高级经理，2000年9月至2007年9月任宏源证券股份有限公司董事会秘书、副总经理，2007年9月至2011年10月任信达证券股份有限公司党委委员、董事会秘书、副总经理、常务副总经理，2011年10月至2013年8月任中国信达资产管理公司投融资业务部总经理，2013年8月至今任信达证券股份有限公司董事、总经理。2014年9月16日起兼任信达澳银基金管理有限公司董事长。

施普敦 (Michael Stapleton) 先生，副董事长，澳大利亚墨尔本 Monash 大学经济学学士。1996年至1998年担任 JP 摩根投资管理有限公司（澳大利亚）机构客户经理，1998年加入康联首域投资有限公司机构业务开发部门，负责澳大利亚机构客户销售和关系管理，2002年加入首域投资国际（伦敦），历任机构销售总监、机构业务开发主管，2009年6月起担任首域投资有限公司（香港）亚洲及日本区域董事总经理。

于建伟先生，董事，中央财政金融学院金融专业学士，东北财经大学 EMBA。28年证券从业经历，具有证券与基金从业资格、基金业高管人员任职资格。1989年至1996年在中国建设银行信托投资公司工作，历任证券部副总经理、深圳证券业务部总经理、资产中介部负责人；1996年至2000年任中国科技国际信托投资有限公司天津赤峰道证券营业部总经理；2000年至2004年任宏源证券有限公司北京北洼路营业部总经理；2004年至2008年任宏源证券有限公司营销经纪总部总经理；2008年至2013年5月任世纪证券有限公司副总裁；2013年7月加入信达澳银基金管理有限公司，2013年8月9日起任信达澳银基金管理有限公司总经理兼任信达新兴财富资产管理有限公司执行董事。

潘广建先生，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。潘广建先生于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公司监事至2016年5月13日，自2016年5月14日起，潘广建先生兼任信达澳银基金管理公司董事。

孙志新先生，独立董事，山西财经学院财政金融学学士，高级经济师。历任中国建设银行总行人事教育部副处长，总行教育部副主任，总行监察室主任，广东省分行党组副书记、副行长，广西区分行党委书记、行长，总行人力资源部总经理（党委组织部部长），总行个人业务管理委员会副主任，总行党校（高级研修院）常务副校长，总行人力资源部总经理（党委组织部部长），总行工会常务副主席，总行监事会监事，于2011年1月退休。

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。

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干部，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。

执行监事：

郑妍女士，中国农业大学管理学硕士，现任监察稽核部副总监。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：

于建伟先生，总经理，中央财政金融学院金融专业学士，东北财经大学 EMBA。28年证券从业经历，具有证券与基金从业资格、基金业高管人员任职资格。1989年至1996年在中国建设银行信托投资公司工作，历任证券部副总经理、深圳证券业务部总经理、资产中介部负责人；1996年至2000年任中国科技国际信托投资有限公司天津赤峰道证券营业部总经理；2000年至2004年任宏源证券有限公司北京北洼路营业部总经理；2004年至2008年任宏源证券有限公司营销经纪总部总经理；

2008年至2013年5月任世纪证券有限公司副总裁；2013年7月加入信达澳银基金管理有限公司，2013年8月9日起任信达澳银基金管理有限公司总经理兼任信达新兴财富资产管理有限公司执行董事。

黄晖女士，督察长，中南财经大学经济学学士，加拿大 Concordia University 经济学硕士。19年证券、基金从业经历，具有证券与基金从业资格、基金业高管人员任职资格。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，其间两次借调到中国证监会基金部工作，参与老基金重组、首批开放式基金评审等工作。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。

于鹏先生，副总经理，中国人民大学经济学学士。22年证券、基金从业经历，具有证券与基金从业资格、基金业高管人员任职资格。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划部经理；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。

焦巍先生，副总经理，上海社会科学院世界经济博士。18年证券从业经历，具有基金从业资格、基金业高管人员任职资格。1994年至1998年，任中国银行海南分行国际结算部职员；1998年至2002年，历任汉唐证券有限责任公司宏观研究员、债券首席交易员；2009年至2014年，历任平安大华基金管理有限公司宏观研究员、基金经理、投资总监；2014年至2015年，历任大成基金管理有限公司投资总监、首席投资官、基金经理。2015年10月加入信达信达澳银基金管理有限公司，2015年12月10日起任总经理助理，2016年3月17日起任投资总监，2016年4月11日起任信达澳银基金管理有限公司副总经理。

## 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		
冯士祯	本基金的基金经理、领先增长混合基金的基金经理、中小盘混合基金的基金经理、消费优选混合基金的基金经理、新目标混合基金的基金经理、新财富混合基金的基金经理	2016-9-14	-	5年	北京大学金融学硕士。2011年7月加入信达澳银基金公司，历任研究咨询部研究员、信达澳银精华灵活配置混合基金基金经理助理、信达澳银消费优选混合基金基金经理助理，现任领先增长混合基金基金经理（2015年5月9日起至今）、信达澳银中小盘混合基金基金经理（2015年7月1日起至今）、信达澳银消费优选混合基金基金经理（2015年8月19日起至今）、信达澳银转型创新股票基金基金经理（2016年9月14日起至今）、信达澳银新目标混合基金基金经理（2016年10月19日起至今）、信达澳银新财富混合基金基金经理（2016年11月10日起至今）。

(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6名成员组成，设主席1名，委员6名。名单如下：

主席：于建伟，总经理

委员：



焦巍，副总经理、投资总监

曾国富，公募投资总部副总监、基金经理

孔学峰，公募投资总部副总监、基金经理

张培培，投委会秘书、基金经理

刘涛，产品创新部副总监

上述人员之间不存在亲属关系。

## 二、基金托管人

### 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：王洪章

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)。

2015 年末，本集团资产总额 18.35 万亿元，较上年增长 9.59%；客户贷款和垫款总额 10.49 万亿元，增长 10.67%；客户存款总额 13.67 万亿元，增长 5.96%。净利润 2,289 亿元，增长 0.28%；营业收入 6,052 亿元，增长 6.09%，其中，利息净收入增长 4.65%，手续费及佣金净收入增长 4.62%。平均资产回报率 1.30%，加权平均净资产收益率 17.27%，成本收入比 26.98%，资本充足率 15.39%，主要财务指标

领先同业。

物理与电子渠道协同发展。营业网点“三综合”建设取得新进展，综合性网点数量达 1.45 万个，综合营销团队 2.15 万个，综合柜员占比达到 88%。启动深圳等 8 家分行物理渠道全面转型创新试点，智慧网点、旗舰型、综合型和轻型网点建设有序推进。电子银行主渠道作用进一步凸显，电子银行和自助渠道账务性交易量占比达 95.58%，较上年提升 7.55 个百分点；同时推广账号支付、手机支付、跨行付、龙卡云支付、快捷付等五种在线支付方式，成功实现绝大多数主要快捷支付业务的全行集中处理。

转型业务快速增长。信用卡累计发卡量 8,074 万张，消费交易额 2.22 万亿元，多项核心指标继续保持同业领先。金融资产 1,000 万以上的私人银行客户数量增长 23.08%，客户金融资产总量增长 32.94%。非金融企业债务融资工具累计承销 5,316 亿元，承销额市场领先。资产托管业务规模 7.17 万亿元，增长 67.36%；托管证券投资基金数量和新增只数均为市场第一。人民币国际清算网络建设再获突破，继伦敦之后，再获任瑞士、智利人民币清算行资格；上海自贸区、新疆霍尔果斯特殊经济区主要业务指标居同业首位。

2015 年，本集团先后获得国内外各类荣誉总计 122 项，并独家荣获美国《环球金融》杂志“中国最佳银行”、香港《财资》杂志“中国最佳银行”及香港《企业财资》杂志“中国最佳银行”等大奖。本集团在英国《银行家》杂志 2015 年“世界银行品牌 1000 强”中，以一级资本总额位列全球第二；在美国《福布斯》杂志 2015 年度全球企业 2000 强中位列第二。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII 托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等 10 个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工 220 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

赵观甫，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务、个人银行业务

和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张力铮，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部，并在总行集团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务，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，资产托管业务部副总经理，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。

### 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、QFII、企业年金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 2016 年一季度末，中国建设银行已托管 584 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。中国建设银行自 2009 年至今连续六年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”。

## 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：0755-83077068

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	王洪章	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼	95533	王琳	www.ccb.com
2	交通银行股份有限公司	上海市浦东新区银城中路 188 号	牛锡明	同“注册地址”	95559	胡迪锋	www.bankcomm.com
3	平安银行股份有限公司	深圳市深南中路 1099 号平安大厦	孙建一	同“注册地址”	95511-3	张莉	www.bank.pingan.com
4	渤海银行股份有限公司	天津市河西区马场道 201-205 号	刘宝凤	天津市河东区海河东路 218 号渤海银行大厦	95541	王宏	www.cbhb.com.cn
5	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	岳毅	上海市浦东新区世纪大道 800 号南洋商业银行大厦	8008302066/ 4008302066	王晓明	www.ncbchina.cn/cn/index.html
6	信达证券股份有限公司	北京市西城区闹市	张志	同“注册地址”	95321	唐静	www.cindasc.com

		口大街9 号院1号 楼	刚				
7	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	陈有 安	同“注册地 址”	4008888888	宋明	www.chinastock .com.cn
8	中信建投证 券股份有限 公司	北京市朝 阳区安立 路66号4 号楼	王常 青	北京市朝 阳门内大 街188号	4008888108	权唐	www.csc108.com
9	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	曹晔	www.swhysc.com
10	申万宏源西 部证券有限 公司	新疆乌鲁 木齐市新 区(新市 区)北京南 路358号 大成国际 大厦20楼 2005室	许建 平	新疆乌鲁 木齐市新 区(新市 区)北京南 路358号大成 国际大厦 20楼2005 室	4008000562	王君	www.hysec.com
11	华龙证券股 份有限公司	甘肃省兰 州市静宁 路308号	李 晓安	同“注册地 址”	4006898888/ 0931-96668	李昕田	www.hlzqgs.com
12	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	王东 明	北京市朝 阳区亮马 桥路48号 中信证 券大厦 18层	95558	侯艳红、 刘玉静	www.cs.ecitic. com
13	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	杨宝 林	同“注册地 址”	95548	吴忠超	www.citicssd.c om
14	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	芮敏祺、 钟伟镇	www.gtja.com

15	光大证券股份有限公司	上海市静安区新闸路1508号	薛峰	同“注册地址”	4008888788/ 95525	刘晨	www.ebscn.com
16	海通证券股份有限公司	上海市淮海中路98号	王开国	上海市广东路689号海通证券大厦	4008888001/ 021-95553	王立群	www.htsec.com
17	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	宫少林	同“注册地址”	95565/40088 88111	黄婵君	www.newone.com .cn
18	国信证券股份有限公司	深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16楼	何如	深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16层至26层	95536	周杨	www.guosen.com .cn
19	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	牛冠兴	同“注册地址”	4008001001	郑向溢	www.essence.com.cn
20	平安证券股份有限公司	深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼	杨宇翔	同“注册地址”	95511-8	石静武	stock.pingan.com
21	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”	4008888993	汤漫川	www.dxzq.net
22	世纪证券有限责任公司	深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦41层	卢长才	同“注册地址”	0755-831995 09	雷新东、 袁媛	www.csc.com.cn
23	华福证券有限责任公司	福州市五四路157号新天地大厦7、8层	黄金琳	福州市五四路157号新天地大厦7至10层	0591-96326	郭相兴	www.gfzfzq.com .cn

24	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层、20层	邱三发	同“注册地址”	020-961303	林洁茹	www.gzs.com.cn
25	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	刘汝军	同“注册地址”	4006989898	卢珊	www.xsdzq.cn
26	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	胡运钊	同“注册地址”	95579/4008888999	奚博宇	www.95579.com
27	中泰证券股份有限公司	济南市经七路86号	李玮	同“注册地址”	95538	马晓男	www.qlzq.com.cn
28	联讯证券股份有限公司	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	徐刚	同“注册地址”	95564	彭莲	www.lxsec.com
29	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16-17层	黄耀华	深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14层	4006666888/0755-33680000	刘阳	www.cgws.com
30	恒泰证券股份有限公司	内蒙古呼和浩特市赛罕区新华东街111号	庞介民	内蒙古呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座D座14层	4001966188	魏巍	www.cnht.com.cn
31	太平洋证券股份有限公司	云南省昆明市青年路389号志远大厦18层	李长伟	北京市西城区北展北街9号华远企业号D座3单元	400-665-0999	唐昌田	www.tpyzq.com

32	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
33	天相投资顾问有限公司	北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701	林义相	北京市西城区新街口外大街28号C座5层	010-66045678	尹伶	www.txsec.com/ www.jjm.com.cn
34	诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司	上海市浦东新区银城中路68号8楼	汪静波	同“注册地址”	4008215399	徐成	www.noah-fund.com
35	深圳众禄金融控股股份有限公司	深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼	薛峰	同“注册地址”	4006788887	童彩平	www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com
36	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	4001818188	刘之菁	www.1234567.com.cn
37	上海好买基金销售有限公司	上海市浦东新区东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903~906室	杨文斌	同“注册地址”	4007009665	戴稽汉	www.ehowbuy.com
38	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	冷烽	www.fund123.cn
39	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	刘英、魏亚斐	licaike.hexun.com



40	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
41	上海联泰资产管理有限公司	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	4000466788	陈东	www.66money.com
42	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	北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦2层	4008188000	马林、翟文	www.myfund.com
43	众升财富（北京）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	李招娣	北京市朝阳区望京浦项中心A座9层04-08	4000598888	李艳	www.zscffund.com
44	北京增财基金销售有限公司	北京市西城区南礼士路66号1号楼12层1208号	罗细安	北京市西城区南礼士路66号1号楼12层1208号	4000018811	李皓	www.zcvc.com.cn
45	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	洪诚	www.citicsf.com
46	上海长量基金销售投资顾问有限公司	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	毛林	www.erichfund.com
47	嘉实财富管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办	赵学军	北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层	4000218850	余永键	www.harvestwm.cn

		公楼二期 46层 4609-10 单元					
48	北京乐融多源投资咨询有限公司	北京市朝阳区西大望路1号1号楼1603	董浩	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	4000681176	牛亚楠	www.hongdianfund.com
49	上海陆金所资产管理有限公司	上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元	郭坚	同“注册地址”	4008219031	宁博宇	www.lufunds.com
50	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	上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼	4009217755	曹怡晨	a.leadfund.com.cn
51	深圳市金斧子投资咨询有限公司	深圳市南山区粤海街道科苑路16号东方科技大厦18楼	赖任军	深圳市南山区粤海街道科苑路科兴科学园B3单元7楼	4009500888	张烨	www.jfzinv.com
52	珠海盈米财富管理有限公司	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	020-89629066	李孟军	www.yingmi.cn
53	北京创金启富投资管理有限公司	北京市西城区西单民丰胡同31号中水大厦215A室	梁蓉	北京西城区白纸坊东街2号经济日报社A综合楼712室	010-66154828	李婷婷	www.5irich.com
54	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	陈剑炜	www.qianjing.com

55	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
56	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	王英俊	www.niuniufund.com
57	北京晟视天下投资管理有限公司	北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室	蒋煜	北京市朝阳区朝外大街甲6号万通中心D座28层	4008188866	殷雯	www.shengshiview.com
58	上海万得投资顾问有限公司	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	姜吉灵	www.windmoney.com.cn
59	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	高鹏、张玥	www.fuguowealth.com
60	上海基煜基金销售有限公司	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)	王翔	上海市杨浦区昆明路518号A1002室	4008205369	吴鸿飞	www.jiyufund.com.cn
61	上海国金通用财富资产管理有限公司	上海市浦东新区芳甸路1088号601室	纪路	上海市浦东新区芳甸路1088号紫竹国际大厦6楼	4000221008	盛涛	www.gfund.com/gjcf/
62	北京唐鼎耀华投资咨询有限公司	北京市延庆县延庆经济开发区	张冠宇	北京市朝阳区东三环北路38号院1	4008199868	刘美薇	www.tdyhfund.com

		区百泉街 10号2栋 236室		号泰康金融 中心38层			
63	上海华信证 券有限责任 公司	上海浦东 新区世纪 大道100 号环球金 融中心9 楼	郭林	上海市黄浦 区399号明 天广场22F	4008205999	陈媛	www.shhxzq.com
64	深圳市新兰 德证券投资 咨询有限公司	深圳市福 田区华强 北路赛格 科技园4 栋10层 1006#	张彦	北京市西城 区宣武门 外大街28 号富卓大 厦A座7层	4001661188	文雯	8.jrj.com.cn/
65	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11层 1108	王伟刚	同“注册地 址”	4006199059	马怡	www.hcjjin.com
66	大泰金石投 资管理有限 公司	南京市建 邺区江东 中路222 号南京奥 体中心现 代五项馆 2105室	袁顾明	同“注册地 址”	4009282266	何庭宇	www.dtfunds.com
67	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
68	中民财富管 理（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	茅旦青	www.cmiwm.com
69	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	杨纪锋	北京市朝阳 区惠河南 路盛世龙 源10号	4006802123	吴鹏	www.zhixin-inv.com

70	北京肯特瑞 财富投资管理 有限公司	北京市海 淀区中关 村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06	陈 超	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	95118/40009 88511	万容	kenterui. jd. co m/ fund. jd. 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，并及时公告。

(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：廖海、刘佳

(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）：吴港平

联系电话：010-58153000

传真：010-85188298

联系人：汤骏

经办注册会计师：汤骏、郭淑仪

#### **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%；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 2016 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

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	578,128,107.65	81.51
	其中：股票	578,128,107.65	81.51
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	123,962,664.10	17.48
7	其他各项资产	7,213,528.46	1.02
8	合计	709,304,300.21	100.00

### 二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	---------------

A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	20,602,000.00	2.93
C	制造业	386,588,607.62	55.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,917.66	0.01
E	建筑业	4,056,000.00	0.58
F	批发和零售业	30,614,233.35	4.36
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	30,097,370.20	4.29
J	金融业	71,438,172.40	10.18
K	房地产业	-	-
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	34,693,806.42	4.94
S	综合	-	-
	合计	578,128,107.65	82.35

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

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	002475	立讯精密	1,900,000	39,425,000.00	5.62
2	600015	华夏银行	3,199,944	34,719,392.40	4.95
3	601628	中国人寿	1,200,000	28,908,000.00	4.12
4	000887	中鼎股份	1,000,000	25,940,000.00	3.69
5	002589	瑞康医药	699,981	22,714,383.45	3.24
6	002519	银河电子	1,012,753	22,685,667.20	3.23
7	002050	三花智控	1,999,946	22,079,403.84	3.15
8	300144	宋城演艺	999,943	20,938,806.42	2.98

9	002384	东山精密	1,049,934	20,589,205.74	2.93
10	002019	亿帆医药	1,200,000	18,348,000.00	2.61

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

注: 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注: 本基金本报告期末未持有股指期货。

2、本基金投资股指期货的投资政策

本基金未参与投资股指期货。

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。

中国人寿（601628）于2016年6月24日发布《中国人寿关于收到《中国保险监督管理委员会行政处罚决定书》的公告》，公告称近日，该公司收到《中国保险监督管理委员会行政处罚决定书》（保监罚〔2016〕13号），该公司因采取退保金直接冲减退保年度保费收入的方式处理长期险非正常退保业务，违反了《中华人民共和国保险法》相关规定，被罚款40万元。

2016年6月30日发布《中国人寿关于国家审计署审计控股股东涉及本公司有关情况的公告》，公告称国家审计署于2015年对该公司控股股东中国人寿保险（集团）公司2014年度资产、负债、损益情况进行了例行审计，该公司作为集团公司控股子公司接受了相关审计。审计情况表明，集团公司能够贯彻落实国家经济金融政策，不断提升经营管理水平，多项业务位居行业前列，但在财务收支、重大决策和执行、风险管控和廉洁从业方面也存在一些薄弱环节。本次审计涉及该公司在业务经营和财务管理方面存在本部超上限缴存住房公积金、部分福利支出未纳入工资总额核算、广告费未按权责发生制进行分摊，个别分支机构通过投保后退保虚增保费、误导销售行为、部分个人违规领取佣金、虚列会议费套取资金用于销售支出等问题；在重大经济决策制度和执行、信息系统建设等方面存在薄弱环节或执行不到位等问题，尚需要进一步改进和完善。

基金管理人分析认为，该公司已积极整改解决，不影响公司长期价值。

东山精密(002384)于2016年3月18日发布公告称，2016年3月18日上午7时30分左右，该公司位于苏州市吴中区东山镇石鹤山路8号的LED仓库发生失火事故。该公司及时启动应急预案，成立现场应急领导小组，由于失火事故发生早、处置得当，经该公司和消防部门及时扑救，明火很快被扑灭，失火造成的财产损失得到及时控制。

基金管理人分析认为，仓库失火快速扑灭，不影响该公司的正常经营。

除中国人寿（601628）、东山精密（002384）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

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	375,517.90
2	应收证券清算款	6,812,103.11
3	应收股利	-
4	应收利息	18,474.48
5	应收申购款	7,432.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,213,528.46

#### 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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000887	中鼎股份	25,940,000.00	3.69	重大事项停牌

#### 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 2016 年 12 月 31 日):

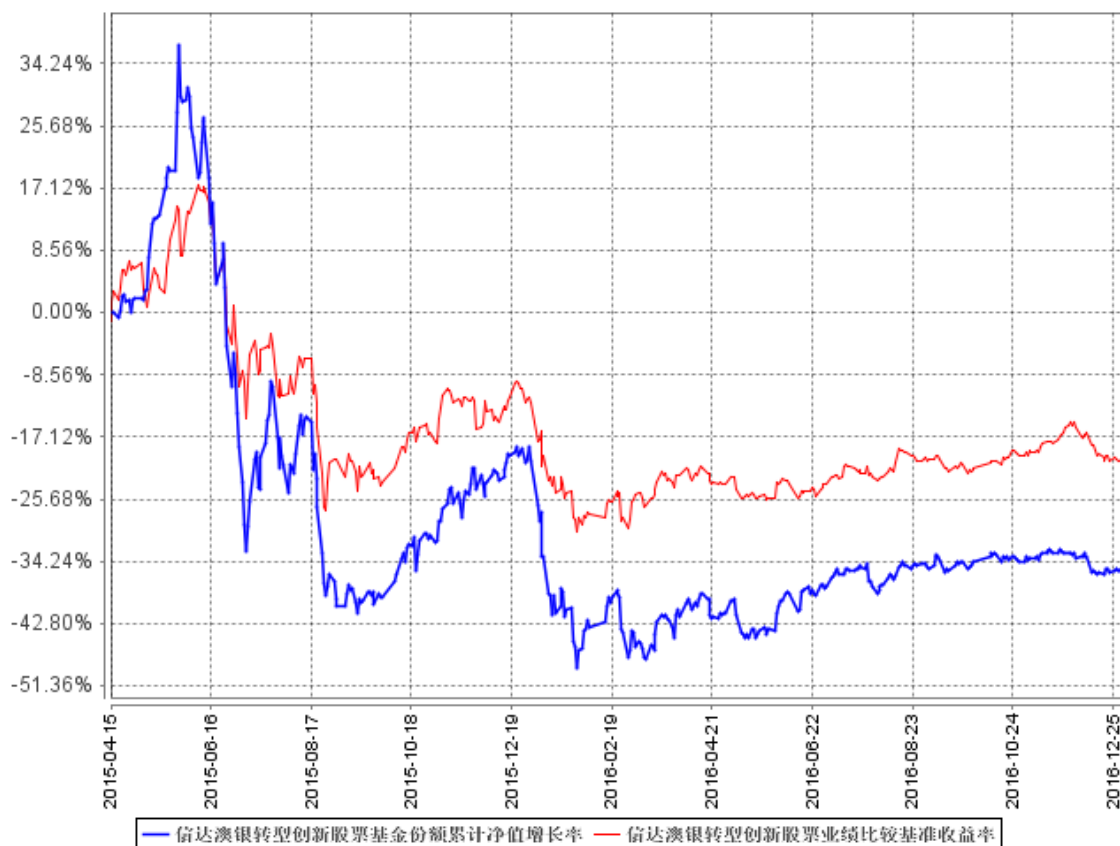
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----



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%
自基金合同 生效日起至 今(2015 年 4 月 15 日至 2016 年 12 月 31 日)	-35.20%	2.53%	-20.28%	1.74%	-14.92%	0.79%

(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基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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、《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2016年11月21日公告的本基金的招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

(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及有关财

务数据的截止日期；

（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；

3、更新了基金管理人董事、监事、高级管理人员的相关信息；

4、更新了基金经理信息。

（三）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2016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2016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

二〇一七年五月十九日