



**金鹰转型动力灵活配置混合型
证券投资基金更新招募说明书摘要
2018 年第 2 号**

基金管理人：金鹰基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司



重要提示

本基金经 2016 年 11 月 29 日中国证券监督管理委员会证监许可[2016]2904 号文注册募集。

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作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

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，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资有风险。投资者在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主作出投资决策，自行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、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、基金投资过程中产生的操作风险、因交收违约和投资债券引发的信用风险、基金投资对象与投资策略引致的特有风险等等。

本基金主要投资于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、债券、货币市场工具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的相关规定），在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。在特殊市场条件下，如证券市场的成交量发生急剧萎缩、基金发生巨额赎回以及其他未能预见的特殊情形下，可能导致基金资产变现困难或变现对证券资产价格造成较大冲击，发生基金份额净值波动幅度较大、无法进行正常赎回业务、基金不能实现既定的投资决策等风险。

本基金投资中小企业私募债券，该债券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。本基金的特定风险详见招募说明书“风险揭示”章节。

本基金为混合型证券投资基金，属于证券投资基金中预期较高风险、较高收益的品种，其预期收益和风险水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

投资者应充分考虑自身的风险承受能力，并对于认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。

基金的过往业绩并不预示其未来表现，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。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本招募说明书中基金投资组合报告和基金业绩中的数据已经本基金托管人复核。除非另有说明，本招募说明书所载内容截止日为 2018 年 11 月 16 日，有关财务数据截止日为 2018 年 9 月 30 日，净值表现截止日为 2018 年 9 月 30 日，本报告中财务数据未经审计。



一、基金管理人

（一）基金管理人简况：

名称：金鹰基金管理有限公司

注册地址：广东省广州市南沙区海滨路 171 号 11 楼自编 1101 之一 J79

办公地址：广东省广州市天河区珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 楼

成立日期：2002 年 12 月 25 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会、证监基金字[2002]97 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：5.102 亿元人民币

存续期限：持续经营

联系电话：020-83936180

股权结构：

| 股东名称 | 出资额(万元) | 出资比例 |
|-----------------|---------|--------|
| 东旭集团有限公司 | 33770 | 66.19% |
| 广州证券股份有限公司 | 12250 | 24.01% |
| 广州白云山医药集团股份有限公司 | 5000 | 9.8% |
| 总计 | 51020 | 100% |

（二）主要人员情况

1、董事会成员

李兆廷先生，董事长，北京交通大学软件工程硕士。曾任石家庄市柴油机厂技术员、车间主任、总经理助理、副总经理等职务。现任东旭集团有限公司董事长、西藏金融租赁有限公司董事长、中国生产力学会副会长。自 2018 年 12 月 5 日起，代行总经理（法定代表人）职责。

李佳女士，董事，清华大学工商管理硕士，历任新华都特种电器股份有限公司副总经理、董事会秘书等职务。现任东旭集团有限公司副总裁。经公司第六届董事会第二十三次会议决议通过，自 2018 年 11 月起，担任金鹰基金管理有限公司董事。

刘岩先生，董事，金融学博士，历任中国光大银行总行投行业务部业务主管，



中国光大银行总行财富管理中心业务副经理，广州证券有限责任公司资产管理总部总经理等职。经公司第四届董事会第三十九次会议审议通过，并报经中国证监会核准，自 2014 年 8 月至今，担任金鹰基金管理有限公司总经理。

苏丹先生，董事，管理学硕士，历任华为技术有限公司人力资源部绩效考核岗、韬睿惠悦咨询有限公司咨询顾问、德勤咨询公司咨询经理、越秀集团人力资源部高级主管、广州证券股份有限公司人力资源部副总经理，现任广州证券股份有限公司战略管理部总经理。

王毅先生，董事，工商管理硕士、经济师，历任广州证券有限责任公司营业部经理、营业部总经理助理、营业部副总经理，办公室副主任（主持全面工作）、合规总监、董事会秘书。现任广州证券股份有限公司副总裁兼任董事会秘书、首席风险官、合规总监。

黄雪贞女士，董事，英语语言文学硕士，历任深圳高速公路股份有限公司董事会秘书助理和证券事务代表、广州药业股份有限公司董事会秘书处副主任、主任、证券事务代表。现任广州白云山医药集团股份有限公司董事会秘书室主任、证券事务代表、董事会秘书。

刘金全先生，独立董事，数量经济学博士。历任吉林大学经济管理学院讲师、商学院教授、院长，现任广州大学经济与统计学院特聘教授。

杨之曙先生，独立董事，数量经济学博士。历任云南航天工业总公司财务处助理经济师，现任清华大学经济管理学院教授。

王克玉先生，独立董事，法学博士。历任山东威海高技术开发区进出口公司法务、山东宏安律师事务所律师、北京市重光律师事务所律师，现中央财经大学法学院副院长、博士生导师。

（2）监事会成员

姚志智女士，监事，党校本科学历、会计师、经济师。历任郴州电厂职员、郴州市农业银行储蓄代办员、飞虹营业所副主任、国北所主任、广州天河保德交通物资公司主管会计、广州珠江啤酒集团财务部主管会计、广州荣鑫容器有限公司财务部经理、总经理助理、广州白云山侨光制药有限公司财务部副部长、广州白云山制药有限公司财务部副部长、广州白云山化学制药创新中心财务负责人、广州白云医药集团股份有限公司财务部高级经理、财务部部长、广州医药海马品



牌整合传播有限公司监事，现任广州白云山医药集团股份有限公司财务副总监。

陈家雄先生，监事，硕士研究生，历任东莞证券资产管理部投资经理、广州证券资产管理部产品总监，现任金鹰基金管理有限公司产品研发部总监。

姜慧斌先生，监事，管理学硕士。曾任宇龙计算机通信科技（深圳）有限公司人力资源部组织发展经理，现任金鹰基金管理有限公司综合管理部总监。

2、公司高级管理人员

刘岩先生，总经理，金融学博士，历任中国光大银行总行投行业务部业务主管，中国光大银行总行财富管理中心业务副经理，广州证券有限责任公司资产管理总部总经理等职。经公司第四届董事会第三十九次会议审议通过，并报经中国证监会核准，2014 年 8 月 7 日起担任公司总经理。

曾长兴先生，督察长，金融学博士，历任广东证券公司（原）研究员、安信证券股份有限公司分析师、国联安基金管理有限公司产品开发部总监、金鹰基金管理有限公司产品研发部总监、总经理助理、副总经理等职。经公司第六届董事会第二十次会议审议通过，并已按规定报中国证券投资基金业协会及广东证监局备案。现任金鹰基金管理有限公司督察长。

满黎先生，副总经理，商业发展专业硕士，历任华安基金管理有限公司任北京总部高级董事总经理，国联安基金管理有限公司首席市场官、副总理等职务。2018 年 8 月加入金鹰基金管理有限公司，经公司第六届董事会第二十次会议审议通过，并已按规定报中国证券投资基金业协会备案。现任金鹰基金管理有限公司副总经理。

刘志刚先生，副总经理，数量经济学博士，历任工银瑞信基金管理有限公司产品开发经理，安信基金管理有限责任公司产品部总监，东方基金管理有限责任公司量化投资部总经理、基金经理等职务，2018 年 10 月加入金鹰基金管理有限公司，经公司第六届董事会第二十四次会议审议通过，并已按规定报中国证券投资基金业协会备案。现任金鹰基金管理有限公司副总经理。

3、基金经理

王喆先生，王喆先生，工商管理学硕士，历任沈阳商品交易所分析员、宏源研究发展中心高级行业研究员、宏源证券资产管理部高级投资经理。2010 年加入广州证券，担任投资管理部助理投资总监、广州证券红棉 1 号投资主办等职。



2014 年 11 月加入金鹰基金管理有限公司，现任权益投资部总监，2015 年 1 月起任金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015 年 3 月起任金鹰成份股优选证券投资基金基金经理。2015 年 6 月至 2016 年 7 月担任金鹰产业整合灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015 年 6 月起任金鹰民族新兴灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015 年 8 月至 2018 年 1 月担任金鹰技术领先灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015 年 12 月至 2018 年 7 月担任金鹰改革红利灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 11 月起担任金鹰转型动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018 年 1 月起担任金鹰周期优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

4、投资决策委员会成员

本公司采取集体投资决策制度，相关投资决策委员会成员有：

（1）公司投资决策委员会

刘岩先生，投资决策委员会主席，总经理；

刘丽娟女士，投资决策委员会委员，固定收益部总监，基金经理；

王喆先生，投资决策委员会委员，权益投资部总监，基金经理；

于利强先生，投资决策委员会委员，研究部总监，基金经理；

林龙军先生，投资决策委员会委员，绝对收益投资部总监，基金经理。

（2）权益投资决策委员会

刘岩先生，权益投资决策委员会主席，总经理；

周国兴先生，权益投资决策委员会委员，总经理助理；

王喆先生，权益投资决策委员会委员，权益投资部总监，基金经理；

于利强先生，权益投资决策委员会委员，研究部总监，基金经理。

（3）固定收益投资决策委员会

刘丽娟女士，固定收益投资决策委员会主席，固定收益部总监，基金经理；

林龙军先生，固定收益投资决策委员会委员，绝对收益投资部总监，基金经理；

汪伟先生，固定收益投资决策委员会委员，基金经理；

上述人员之间均不存在近亲属关系。



二、基金托管人

（一）基金托管人概况

名称：兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）

注册地址：福州市湖东路 154 号

办公地址：上海市江宁路 168 号

法定代表人：高建平

成立时间：1988 年 8 月 22 日

注册资本：207.74 亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2005]74 号

托管部门联系人：张小燕

电话：021-52629999

传真：021-62159217



三、相关服务机构

(一) 基金份额发售机构

1、直销机构

1、直销机构

名称：金鹰基金管理有限公司

注册地址：广东省广州市南沙区海滨路 171 号 11 楼自编 1101 之一 J79

办公地址：广州市天河区珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

成立时间：2002 年 12 月 25 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2002] 97 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：5.102 亿元人民币

存续期间：持续经营

联系人：符薇薇

联系电话：020-83282950

传真电话：020-83283445

客户服务及投诉电话：4006-135-888

电子邮箱：csmail@gefund.com.cn

公司网址：www.gefund.com.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销售本基金，并及时公告。

2、代销机构：

(1) 兴业银行股份有限公司

注册（办公）地址：福建省福州市湖东路 154 号中山大厦

法定代表人：高建平

联系人：卞晷煜

电话：4008895561

客服电话：95561

公司网址：www.cib.com.cn



(2) 交通银行股份有限公司

注册（办公）地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

联系人：张作伟

客服电话：95559

公司网址：www.bankcomm.com

(3) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路 12 号

办公地址：上海市北京东路 689 号东银大厦 17 楼

法定代表人：吉晓辉

联系人：施晓俊

客服电话：95528

公司网址：www.spdb.com.cn

(4) 招商银行股份有限公司

注册（办公）地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：李建红

联系人：李卓凡

电话：0755-83195690

客服电话：95555（全国）

公司网址：www.cmbchina.com

(5) 平安银行股份有限公司

注册（办公）地址：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号

法定代表人：谢永林

联系人：张莉

电话：021-38637673

客服电话：95511



公司网址: <http://www.pingan.com/>

(6) 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

办公地址: 北京东城区朝阳门北大街 9 号东方文化大厦

法定代表人: 李庆萍

联系人: 王晓琳

联系电话: 010-89937325

客服电话: 95558

公司网址: <http://www.citicbank.com>

(7) 中国光大银行股份有限公司

注册(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: 唐双宁

联系人: 沙牧楠

联系电话: 010-63636179

客服电话: 95595

公司网址: www.cebbank.com

(8) 中泰证券股份有限公司

注册(办公)地址: 山东省济南市市中区经七路 86 号

办公地址: 上海市花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 18 层

法定代表人: 李玮

联系人: 许曼华

电话: 021-20315290

客服电话: 95538 (全国)

公司网址: www.zts.com.cn

(9) 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：北京市西城区华远北街 2 号西单通港大厦 12 层 1212

法定代表人：周斌

联系人：张鼎

电话：18641514414

客服电话：4008980618

公司网址：www.chtwm.com

(10) 中信期货有限公司

注册（办公）地址：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

法定代表人：张皓

联系人：刘宏莹

电话：010-60834022

客服电话：400-9908-826

公司网址：www.citicsf.com

(11) 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

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

联系人：周雪晴

电话：010-60834772

客服电话：95548

公司网址：www.cs.ecitic.com

(12) 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：山东省青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

办公地址：山东省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

联系人：孙秋月

电话：0532-85022026

客服电话：95548

公司网址：www.citicssd.com.

(13) 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

办公地址：北京市东城区朝内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：刘畅

电话：010-65608231

客服电话：95587/4008-888-108

公司网址：www.csc108.com

(14) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册（办公）地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园四栋 10 层 1006

法定代表人：马勇

联系人：文雯

电话：010-83363101

客服电话：0755-88394689

公司网址：www.xinlande.com.cn

(15) 大同证券有限责任公司

注册地址：山西省大同市城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层

办公地址：山西省太原市长治路 111 号世贸中心 A 座 13 层

法定代表人：董祥

联系人：薛津

电话：0351-4130322



客服电话：4007121212

公司网址：www.dtsbc.com.cn

(16) 宏信证券有限责任公司

注册（办公）地址：四川省成都市人民南路二段十八号川信大厦 10 楼

法定代表人：吴玉明

联系人：杨磊

电话：028-86199041

客服电话：4008-366-366

公司网址：www.hxzq.cn

(17) 华龙证券股份有限公司

注册（办公）地址：兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心 21 楼

法定代表人：李晓安

联系人：范坤

电话：0931-4890208

客服电话：400-6898888

公司网址：www.hlzq.com

(18) 一路财富（北京）信息科技股份有限公司

注册（办公）地址：北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座
2208

法定代表人：吴雪秀

联系人：徐越

电话：86(10)88312877 ext.8032

客服电话：400-001-1566

公司网址：www.yilucaifu.com

(19) 浙商证券股份有限公司



注册地址：浙江省杭州市西湖区杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座

办公地址：杭州市江干区五星路 201 号浙商证券大楼 8 楼

法定代表人：吴承根

联系人：陈姗姗

电话：021-80108643

客服电话：95345

公司网址：www.stocke.com.cn

(20) 信达证券股份有限公司

注册（办公）地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

联系人：尹旭航

电话：010-63081493

客服电话：95321

公司网址：www.cindasc.com

(21) 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

办公地址：北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号中国人保寿险大厦 12 层

法定代表人：祝献忠

联系人：李慧灵

电话：010-85556100

客服电话：95390；400-898-9999

公司网址：www.hrsec.com.

(22) 光大证券股份有限公司

注册（办公）地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

联系人：李晓哲



电话：021-22169111

客服电话：95525（全国）、4008888788

公司网址：www.ebscn.com

（23）华安证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号财智中心 B1 座

法定代表人：李工

联系人：范超

电话：0551-65161821

客服电话：95318

公司网址：www.hazq.com.cn

（24）国联证券股份有限公司

注册（办公）地址：江苏省无锡滨湖区太湖新城金融一街 8 号 7-9 层

法定代表人：姚志勇

联系人：祁昊

联系电话：0510-82831662

客服电话：95570

公司网址：www.glsc.com.cn

（25）湘财证券股份有限公司

注册（办公）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

法定代表人：林俊波

联系人：李欣

电话：021-38784580

客服电话：4008881551

公司网址：www.xcsc.com



(26) 申万宏源证券有限公司

注册（办公）地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

联系人：李玉婷

电话：021-33388229

客服电话：021-96250500

公司网址：www.swhysc.com

(27) 申万宏源西部证券有限公司

注册（办公）地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

法定代表人：韩志谦

联系人：王怀春

电话：0991-2307105

客服电话：4008000562

公司网址：www.swhysc.com

(28) 东吴证券股份有限公司

注册（办公）地址：苏州工业园区星阳街 5 号

法定代表人：范力

联系人：陆晓

电话：0512-62938521

客服电话：95330

公司网址：www.dwzq.com.cn

(29) 北京钱景基金销售有限公司

注册（办公）地址：北京市海淀区中关村西区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012



法定代表人：赵荣春

联系人：申泽灏

电话：010-57418813

客服电话：400-893-6885

公司网址：www.qianjing.com

(30) 西南证券股份有限公司

注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号

办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

法定代表人：吴坚

联系人：周青

电话：023-67616310

客服电话：4008096096

公司网址：www.swsc.com.cn

(31) 世纪证券有限责任公司

注册（办公）地址：深圳市福田区深南大道招商银行大厦 40-42 层

法定代表人：姜昧军

联系人：王雯

电话：0755-83199511

客服电话：400-8323-000

公司网址：www.csc.com.cn

(32) 西部证券股份有限公司

注册（办公）地址：西安市东大街 232 号信托大厦 16-17 层

法定代表人：刘建武

联系人：梁承华

电话：029-87406168

客服电话：95582



公司网址: www.westsecu.com.cn

(33) 江苏汇林保大基金销售有限公司

注册(办公)地址: 南京市新街口中山东路 9 号天时国际商贸大厦 11 楼 E 座

法定代表人: 吴言林

联系人: 李跃

电话: 021-53086966

客服电话: 025-56663409

公司网址: www.huilinbd.com

(34) 东海证券股份有限公司

注册(办公)地址: 上海浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦 5 楼

法定代表人: 赵俊

联系人: 王一彦

电话: 021-20333910

客服电话: 95531 或 400-8888-588

公司网址: www.longone.com.cn

(35) 宜信普泽投资顾问(北京)有限公司

注册地址: 北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

办公地址: 北京市朝阳区建国路 88 号楼 soho 现代城 C 座 18 层 1809

法定代表人: 戎兵

联系人: 魏晨

联系电话: 010-52413385

客服电话: 400-6099-200

公司网址: www.yixinfund.com

(36) 上海华信证券有限责任公司



注册地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼

办公地址：上海市黄浦区南京西路 399 号明天广场 20 楼

法定代表人：郭林

联系人：徐璐

电话：021-63898427

客服电话：400-820-5999

公司网址：www.shhxzq.com

(37) 国都证券股份有限公司

注册(办公)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

联系人：李弢

电话：010-84183333

客服电话：400-818-8118

公司网址：www.guodu.com

(38) 华鑫证券有限责任公司

注册(办公)地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01

(b) 单元

法定代表人：俞洋

联系人：杨莉娟

电话：021-54967552

客服电话：4008-888-999

公司网址：www.cfsc.com.cn

(39) 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楼

办公地址：深圳市福田区深南中路 2002 号中广核大厦北楼 10 楼



法定代表人：徐刚

联系人：彭莲

电话：0755-83331195

客服电话：95564

公司网址：www.lxsec.com

(40) 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 4 楼

办公地址：湖北省武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 37 楼

法定代表人：余磊

联系人：夏旻

电话：027-87618676

客服电话：95391/4008005000

公司网址：www.tfzq.com

(41) 首创证券有限责任公司

注册（办公）地址：北京市西城区德胜门外大街 115 号德胜尚城 E 座

法定代表人：吴涛

联系人：刘宇

电话：010-59366070

客服电话：4006200620

公司网址：www.sczq.com.cn

(42) 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 号国际企业大厦 2-6 层

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈共炎

联系人：辛国政

电话：010-66568292



客服电话：4008888888

公司网址：www.chinastock.com.cn

(43) 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

办公地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 505 室

法定代表人：林义相

联系人：谭磊

电话：010-66045182

客服电话：010-66045678

公司网址：www.jjm.com.cn

(44) 渤海证券股份有限公司

注册地址：天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址：津市南开区宾水西道 8 号

法定代表人：王春峰

联系人：张彤

电话：022-28451955

客服电话：400-651-5988

公司网址：www.ewww.com.cn

(45) 太平洋证券股份有限公司

注册（办公）地址：云南省昆明市北京路 926 号同德广场写字楼 31 楼

法定代表人：李长伟

联系人：王婧

电话：010-88321967

客服电话：0871-68898130

公司网址：www.tpyzq.com



(46) 平安证券股份有限公司

注册（办公）地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人：曹实凡

联系人：周一涵

电话：021-38637436

客服电话：95511 转 8

公司网址：www.stock.pingan.com

(47) 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

联系人：庞晓芸

电话：0755-82492193

客服电话：95597

公司网址：www.htsc.com.cn

(48) 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

联系人：朱雅崑

电话：021-38676666

客服电话：95521

公司网址：www.gtja.com

(49) 华福证券有限责任公司

注册（办公）地址：福州市鼓楼区温泉街道五四路 157 号 7-8 层

法定代表人：黄金琳



联系人：王虹

电话：021-20655183

客服电话：96326（福建省外加拨 0591）

公司网址：www.hfzq.com.cn

（50）中银国际证券股份有限公司

注册地址：上海浦东银城中路 200 号中银大厦 39 层

办公地址：中国上海浦东银城中路 200 号中银大厦 39-40 层

法定代表人：宁敏

联系人：王炜哲

电话：021-20328309

客服电话：400-6208-888

公司网址：www.bocichina.com

（51）江海证券有限公司

注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址：哈尔滨市松北区创新三路 833 号

法定代表人：孙名扬

联系人：姜志伟

电话：0451-87765732

客服电话：400-666-2288

公司网址：www.jhzq.com.cn

（52）东兴证券股份有限公司

注册（办公）地址：北京市西城区金融大街 5 号（新盛大厦）12、15 层

法定代表人：魏庆华

联系人：汤漫川

电话：010-66555316

客服电话：95309



公司网址: www.dxzq.net

(53) 国信证券股份有限公司

注册(办公)地址: 深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人: 何如

联系人: 周杨

联系电话: 0755-82130833

客服电话: 95536

公司网址: www.guosen.com

(54) 新时代证券股份有限公司

注册(办公)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: 叶顺德

联系人: 田芳芳

电话: 010-83561146

客服电话: 4006-989-898

公司网址: www.xsdzq.cn

(55) 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 号君泰国际 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 6 楼

法定代表人: 林立

联系人: 胡倩

联系电话: 0755-83255199

客服电话: 400-188-3888

公司网址: www.chinalin.com



(56) 华西证券股份有限公司

注册（办公）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

联系人：谢国梅

电话：010-52723273

客服电话：95584

公司网址：www.hx168.com.cn

(57) 广州证券股份有限公司

注册（办公）地址：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

法定代表人：胡伏云

联系人：梁微

联系电话：020-88836999

客服电话：95396

公司网址：www.gzs.com.cn

(58) 国金证券股份有限公司

注册（办公）地址：成都市东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

联系人：贾鹏

电话：028-86690058

客服电话：95310

公司网址：www.gjzq.com.cn

(59) 联储证券有限责任公司

注册地址：广东省深圳市福田区华强北路圣廷苑酒店 B 座 26 楼

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 333 号金砖大厦 8 楼

法定代表人：沙常明



联系人：丁倩云

联系方式：010-56177851

客服电话：400-620-6868

公司网址：www.lczq.com

(60) 北京电盈基金销售有限公司

注册（办公）地址：北京市朝阳区呼家楼(京广中心)1 号楼 36 层 3603 室

法定代表人：程刚

联系人：李丹

电话：010-56176115

客服电话：400-100-3391

公司网址：www.bjdycfund.com

(61) 北京坤元基金销售有限公司

注册（办公）地址：北京市东城区建国门内大街 8 号 B 座 501

法定代表人：李雪松

联系人：崔炜

联系方式：010-85264512

客服电话：400-818-5585

公司网址：www.kunyuanfund.com

(62) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：浦东新区峨山路 613 号 6 幢 551 室

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼

法定代表人：其实

联系人：潘世友

电话：021-54509998

客服电话：400-1818-188

公司网址：天天基金网（www.1234567.com.cn）



(63) 上海好买基金销售有限公司

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

法定代表人：杨文斌

联系人：张茹

电话：021-20613600

客服电话：400-700-9665

公司网址：好买基金网（www.ehowbuy.com）

(64) 深圳众禄金融控股股份有限公司

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

电话：0755- 33227950

客服电话：4006-788-887

公司网址：众禄基金网（www.zlfund.cn）、基金买卖网（www.jjmmw.com）

(65) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册（办公）地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903

法定代表人：凌顺平

联系人：吴强

电话：0571 - 88911818

客服电话：4008-773-772

公司网址：同花顺基金销售网（www.5ifund.com）

(66) 上海陆金所资产管理有限公司

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：郭坚

联系人：宁博宇



联系电话：021-20665952

客服电话：400-8219-031

公司网址：www.lufunds.com

(67) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区海淀东三街 2 号 4 层 401-15

办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院 a 座 17 层

法定代表人：江卉

联系人：徐伯宇

电话：010-89181356

客服电话：95118

公司网址：<http://fund.jd.com>

(68) 上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发展区）

办公地址：上海市昆明路 518 号北美广场 A1002

法定代表人：王翔

联系人：吴笛

联系电话：021-6537-0077

客服电话：021-6537-0077

公司网址：www.jiyufund.com.cn

(69) 凤凰金信（银川）投资管理有限公司

注册地址：宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路 142 号 14 层 1402

办公地址：北京市朝阳区紫月路 18 号院 朝来高科技产业园 18 号楼

法定代表人：程刚

联系人：张旭



联系电话：010-58160168

客服电话：400-810-5919

公司网址：www.fengfd.com

(70) 中证金牛（北京）投资咨询有限公司

注册地址：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

办公地址：北京市宣武门外大街甲一号新华社第三工作区 A 座 5 层

法定代表人：钱昊旻

联系人：仲甜甜

联系电话：010-59336492

客服电话：4008-909-998

公司网址：www.jnlc.com

(71) 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

办公地址：北京市朝阳区望京 SOHO 塔 2, B 座 2507

法定代表人：钟斐斐

联系人：戚晓强

联系电话：010-61840688

客服电话：400-0618-518

公司网址：www.danjuanapp.com

(72) 四川天府银行股份有限公司

注册（办公）地址：四川省南充市顺庆区滨江中路一段 97 号

法定代表人：高国富

联系人：樊海波

联系电话：028-67676033

客服电话：4001696869

公司网址：www.tf.cn



(73) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室

办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F

法定代表人：陈柏青

联系人：韩爱彬

电话：0571-26888888-37494

客服电话：4000-766-123

公司网址：www.fund123.cn

(74) 苏州财路基金销售有限公司

注册地址：苏州市高新区华佗路 99 弄 6 幢 1008 室

办公地址：苏州市姑苏区苏站路 1599 号 7 号楼 1101 室

法定代表人：高志华

联系人：张君

联系电话：0512-68603767

客服电话：400-0512-800

公司网址：www.cai6.com

(75) 上海挖财金融信息服务有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

法定代表人：胡燕亮

联系人：樊晴晴

联系电话：021-50810687

客服电话：4000256569

公司网址：www.wacai.com



(76) 南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：南京玄武区苏宁大道 1-5 号

办公地址：南京玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人：王锋

联系人：张慧

联系电话：025-66996699

客服电话：95177

公司网址：www.snjijin.com

(77) 济安财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307

办公地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307

法定代表人：杨健

联系人：李海燕

联系电话：010-65309516

客服电话：400-673-7010

公司网址：www.jianfortune.com

(78) 扬州国信嘉利基金销售有限公司

注册地址：江苏省扬州市广陵新城信息产业基地 3 期 20B 栋

办公地址：江苏省扬州市邗江区文昌西路 56 号公元国际大厦 320

法定代表人：刘晓光

联系人：苏曦

联系电话：0514-82099618

客服电话：4000216088

公司网址：www.gxjlc.cn

(79) 泰信财富基金销售有限公司



注册地址：北京市石景山区实兴大街 30 号院，3 号楼 8 层 8995 房间

办公地址：北京市朝阳区建国路甲 92 号世茂大厦 C 座 12 层

法定代表人：张虎

联系人：李丹

联系电话：010-53579751

客服电话：400-004-8821

公司网址：www.hxlc.com

(80) 深圳信诚基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室

办公地址：深圳市福田区中心区东南部时代财富大厦 49A

法定代表人：周文

联系人：殷浩然

联系电话：010-84865370

客服电话：0755-23946579

公司网址：www.ecpefund.com

(81) 民商基金销售（上海）有限公司

注册地址：上海黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 A31 室

办公地址：上海市浦东新区张杨路 707 号生命人寿大厦 32 楼

法定代表人：贲惠琴

联系人：杨一新

联系电话：021-50206003

客服电话：021-50206003

公司网址：www.msftec.com

(82) 西藏东方财富证券股份有限公司

注册地址：拉萨市北京中路 101 号

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座东方财富大厦



法定代表人：陈宏

联系人：付佳

联系电话：021-23586603

客服电话：95357

公司网址：www.18.cn

(83) 大连网金基金销售有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

办公地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

法定代表人：樊怀东

联系人：贾伟刚

联系电话：0411-39027808

客服电话：4000-899-100

公司网址：www.yibaijin.com

(84) 北京加和基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 11 号 7 层 703 室

办公地址：北京市西城区金融大街 11 号 7 层 703 室

法定代表人：曲阳

联系人：王晨

联系电话：010-50866170

客服电话：400-803-1188

公司网址：www.bzfunds.com

如本次募集期间，新增代销机构，本基金管理人将另行公告。

(二) 登记机构

名称：金鹰基金管理有限公司

注册地址：广东省广州市南沙区海滨路 171 号 11 楼自编 1101 之一 J79

办公地址：广州市天河区珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

电话：020-38283037



传真：020-83282856

联系人：张盛

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：广东岭南律师事务所

办公地址：广州市新港西路 135 号中山大学西门科技园 601-605 室

法定代表人：黄添顺

电话：020-84035397

传真：020-84113152

经办律师：欧阳兵、马晓灵、马振涛

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼

法定代表人：曾顺福

电话：86-020-83969228

传真：86-020-38880119

邮编：200002

经办注册会计师：洪锐明、江丽雅



四、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定募集，经 2016 年 11 月 29 日中国证监会证监许可[2016]2904 号文件准予募集注册。

（一）基金的类型及存续期间

- 1、基金类型：混合型证券投资基金
- 2、基金运作方式：契约型开放式
- 3、存续期间：不定期

（二）募集方式和募集场所

通过各销售机构的基金销售网点公开发售，各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的调整销售机构的相关公告。

（三）募集期限

募集期间为 2017 年 10 月 13 日至 2017 年 11 月 10 日，募集规模为 856,847,786.23 份。符合有关本基金募集的相关法规和基金合同、招募说明书等法律文件的约定。



五、基金的投资

（一）投资目标

在严格控制投资组合风险的前提下，积极优选受益于中国经济的转型升级而获取增长动力的优势行业及上市公司，力求实现基金资产的长期稳定增值。

（二）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（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含国债、地方政府债、金融债、公司债、企业债、央行票据、中小企业私募债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、股指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。

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。

本基金投资组合中股票资产占基金资产的比例为 0-95%；本基金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，持有现金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%，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、股指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。本基金投资于转型动力相关主题证券的比例不低于非现金基金资产的 80%。

当法律法规的相关规定变更时，基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。

（三）投资策略

1、资产配置策略

本基金将从宏观经济、财政货币政策、经济景气度和货币资金供求等多个维度进行综合分析，主动判断市场时机，在严格控制投资组合风险的前提下，进行积极灵活的资产配置，合理确定基金在股票类、债券类、现金类等大类资产上的投资比例，最大限度地提高基金资产的收益。

2、股票投资策略

（1）本基金将以“转型动力”作为行业配置和个股挖掘的主要线索。具体



而言，本基金股票投资组合构建具体包括三个层次：首先挖掘受益于转型动力的相关行业，其次在此基础上的进行行业分析与配置；最后自下而上在行业内部精选个股。

本基金所指的“转型动力”，是指在经济和产业结构等转型的进程中，推动企业成长、经济发展、社会进步等各种力量。

转型事关未来经济社会的发展走向，是中国经济持续发展的动力。在全面深化改革与转型的经济背景下，中国经济转型进入的深水区与攻坚阶段，转型触及经济结构、产业结构、产业模式、发展方式、技术结构等方面。在转型推进的过程中，转型动力的释放将带来巨大的投资空间和丰富的投资机会。

本基金重点关注因转型而获得增长与发展动力的相关行业，主要包括：

1) 受益于经济结构转型升级而迎来发展机遇的新兴消费及服务行业。在经济转型及经济结构调整中，消费结构和消费主体的变迁会推动新兴消费及服务行业大量涌现，并获得充足的增长和发展动力。本基金重点关注受益于转型动力的医药生物、文化传媒、休闲服务、电子、金融保险、智能家居等新兴消费及服务行业；

2) 受益于产业结构转型升级而获取增长动力的新兴产业。新兴产业受益于国家政策的推动、经济转型中的重大技术突破和人们环保意识的日益增强，发展空间和活动将进一步释放，有望在经济转型中获得长足的发展动力，并显著提升经济效益。本基金重点关注受益于转型动力的节能环保、信息技术、生物技术、高端装备制造、新能源、新材料、新能源汽车等新兴产业；

3) 受益于企业内部积极进行技术改革创新、流程优化重组、产品转型升级等以提升企业生产效率和企业的价值，从而获得发展动力，提升市场竞争力和盈利能力的优势企业。

同时，本基金将对受益于转型动力的相关行业领域进行密切跟踪，随着转型的持续深入，转型的范围和受益行业领域也会相应扩展。本基金将根据实际情况更新调整转型动力获益行业领域的范畴。

(2) 行业配置

本基金通过持续关注国家经济转型的推进情况，深度挖掘受益转型动力的相关行业与主题。在此基础上，本基金将根据行业景气度情况、行业竞争格局以及



行业内发展潜力等因素，对行业配置不断进行调整和优化。

1) 景气度分析：对行业的既有格局、上下游的相对力量以及行业景气阶段等方面判断具体行业的市场前景与容量并精选投资行业；

2) 竞争格局分析：主要分析行业的产品研发能力和行业进入壁垒，重点关注具有较强技术研发能力和较高的行业进入壁垒的行业；

3) 内在发展潜力分析：对行业生命周期、行业核心竞争力等进行分析，据此判断行业发展所处的阶段和行业内发展潜力，优选发展前景好的行业。

(3) 个股选择

本基金在行业配置的基础上，依靠定量与定性相结合的方法进行个股精选。基金管理人将按投资决策程序，权衡风险与收益，组建并动态调整组合。

1) 竞争优势。本基金管理人将根据企业的市场布局、客户定位、研发实力、优势资源、核心竞争力等要素评判企业的竞争优势，在此基础上精选个股；

2) 治理状况。本基金管理人将结合企业的法人结构、激励机制、管理架构、发展战略、决策效率等层面评估企业的治理状况，在此基础上优选个股；

3) 财务估值。本基金管理人将兼顾企业主营业务收入、利润率、净资产回报率、资本成本等财务指标，以及企业市盈率（P/E）、市净率(P/B)、市盈增长率（PEG）等估值指标，在此基础上甄选优质个股。

3、债券投资策略

基金管理人将秉承稳健优先的原则，在保证投资低风险的基础上，积极配置“转型动力”相关主题债券，力图获得良好的收益。

本基金以长期利率趋势分析为基础，结合经济变化趋势、货币政策、投资主题及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，运用久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属配置策略等多种积极管理策略，深入研究挖掘价值被低估的债券和市场投资机会，构建收益稳定、流动性良好的债券组合。

4、中小企业私募债券投资策略

本基金将运用基本面研究结合公司财务分析方法，对债券发行人信用风险进行分析和度量，选择风险与收益相匹配的更优品种进行投资。深入研究债券发行人基本面信息，分析企业的长期运作风险；对债券发行人进行财务风险评估；利



用历史数据、市场价格以及资产质量等信息，估算中小企业私募债券发行人的违约率及违约损失率并考察债券发行人的增信措施。综合上述分析结果，确定信用利差的合理水平，利用市场的相对失衡，确定具有投资价值的债券品种。

5、股指期货投资策略

本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。

本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素，结合定性和定量方法，确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模，以及中国证监会的相关限定和要求，确定参与股指期货交易的投资比例。

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

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。

6、权证投资策略

本基金将权证看作是辅助性投资工具，其投资原则为优化基金资产的风险收益特征，有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。本基金将在权证理论定价模型的基础上，综合考虑权证标的证券的基本面趋势、权证的市场供求关系以及交易制度设计等多种因素，对权证进行合理定价。本基金权证主要投资策略为低成本避险和合理杠杆操作。

7、资产支持证券投资策略

本基金将分析资产支持证券的资产特征，估计违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

（四）投资决策依据及程序

1、投资决策依据

- （1）有关法律、法规和基金合同的有关规定。
- （2）经济运行状况和证券市场走势。



(3) 各类资产的风险收益配比。

2、投资决策程序

(1) 投资决策委员会：确定本基金总体资产配置和投资策略。投资决策委员会定期召开会议，如需做出及时重大决策或基金经理提议，可临时召开投资决策委员会会议。

(2) 基金经理：设计和调整投资组合。设计和调整投资组合需要考虑的基本因素包括：每日基金申购和赎回净现金流量；基金合同的投资限制和比例限制；研究员的投资建议；基金经理的独立判断等。

(3) 集中交易部：基金经理向集中交易部下达投资指令，集中交易部负责人收到投资指令后分发予交易员，交易员收到基金投资指令后准确执行。

(4) 绩效与风险评估：对基金投资组合进行评估，向基金经理提出绩效或风险建议。

(5) 合规风控部：对投资流程等进行合法合规审核、监督和检查。

(五) 业绩比较基准

本基金业绩比较基准：

沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%

沪深 300 指数是上海证券交易所和深圳证券交易所共同推出的沪深两个市场第一个统一指数，该指数编制合理、透明，有一定市场覆盖率，抗操纵性强，并且有较高的知名度和市场影响力。中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数，具有很高的代表性。综合考虑基金资产配置与市场指数代表性等因素，本基金选用沪深 300 指数和中证全债指数加权作为本基金的投资业绩比较基准。

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，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准，或者本基金的业绩比较基准停止发布时，本基金可以经基金管理人和基金托管人协商一致后变更业绩比较基准并及时公告，无需召开基金份额持有人大会。

本基金的业绩比较基准仅作为衡量本基金业绩的参照，不决定也不必然反映本基金的投资策略。

(六) 风险收益特征



本基金为混合型基金，属于证券投资基金中较高预期收益、较高预期风险的品种，其预期风险收益水平高于债券型基金及货币市场基金、低于股票型基金。

（七）投资限制与禁止行为

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金投资组合中股票资产占基金资产的 0%-95%；投资于转型动力相关主题证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；

（2）本基金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，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

（3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

（4）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

（5）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

（6）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

（7）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

（8）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

（9）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

（10）本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

（11）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

（12）本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

（13）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总



资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(14) 基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

(15) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%，本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(16) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；

(17) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

(18) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；

(19) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

(20) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

(21) 本基金持有单只中小企业私募债，其市值不得超过本基金资产净值的 10%；

(22) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；

(23) 本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

(24) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 15%；

因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。

(25) 基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手



开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

(26) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，除上述第(2)、(12)、(24)、(25)项规定的情况外，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。期间，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

如果法律法规或监管部门对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制，但须提前公告，不需经基金份额持有人大会审议。

2、禁止行为为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以



上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

如法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

（八）基金投资组合报告（未经审计）

本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。

本基金的托管人根据本基金合同的规定，已复核了本报告中的内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告有关数据截止日为 2018 年 9 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 331,453,452.59 | 79.83 |
| | 其中：股票 | 331,453,452.59 | 79.83 |
| 2 | 固定收益投资 | 32,400,332.00 | 7.80 |
| | 其中：债券 | 32,400,332.00 | 7.80 |
| | 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 | 10,000,000.00 | 2.41 |
| | 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 | 41,036,553.90 | 9.88 |
| 7 | 其他各项资产 | 305,269.78 | 0.07 |
| 8 | 合计 | 415,195,608.27 | 100.00 |

注：其他资产包括：交易保证金、应收利息、应收证券清算款、其他应收款、应收申购款。



2、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

| 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 | 5,760,000.00 | 1.43 |
| C | 制造业 | 284,002,412.91 | 70.30 |
| 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 | 36,700,344.20 | 9.09 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | - | - |
| 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 | 4,990,695.48 | 1.24 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 331,453,452.59 | 82.05 |

(2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期内未通过港股通投资股票。

3、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(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 600019 | 宝钢股份 | 4,031,289 | 31,645,618.65 | 7.83 |



| | | | | | |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 2 | 600782 | 新钢股份 | 5,000,000 | 29,500,000.00 | 7.30 |
| 3 | 000717 | 韶钢松山 | 4,220,000 | 27,345,600.00 | 6.77 |
| 4 | 600507 | 方大特钢 | 2,333,506 | 25,341,875.16 | 6.27 |
| 5 | 600808 | 马钢股份 | 5,288,600 | 21,683,260.00 | 5.37 |
| 6 | 000932 | 华菱钢铁 | 2,130,000 | 17,870,700.00 | 4.42 |
| 7 | 600231 | 凌钢股份 | 4,922,770 | 17,278,922.70 | 4.28 |
| 8 | 002110 | 三钢闽光 | 973,500 | 17,123,865.00 | 4.24 |
| 9 | 000581 | 威孚高科 | 808,086 | 15,798,081.30 | 3.91 |
| 10 | 300473 | 德尔股份 | 458,900 | 15,281,370.00 | 3.78 |

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 32,400,332.00 | 8.02 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 32,400,332.00 | 8.02 |

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投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|----------|------------|---------------|--------------|
| 1 | 132013 | 17 宝武 EB | 318,650.00 | 32,400,332.00 | 8.02 |

注：本基金本报告期末仅持有1只债券。



6、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

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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期内未投资贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期内未投资权证。

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

本基金本报告期内未投资股指期货。

(2) 本基金投资股指期货的投资政策

无。

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

无。

(2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资国债期货。

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之一的三钢闽光因定期报告中关于一致行动人的披露依据不足,于 2018 年 9 月 19 日被中国证券监督管理委员会福建监管局采取出具警示函的监管措施。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策的程序。

(2) 报告期内基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

(3) 其他各项资产构成



| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 54,141.77 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 232,133.08 |
| 5 | 应收申购款 | 18,994.93 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 305,269.78 |

(4) 报告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) 报告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，分项之和与合计项之间可能存在尾差。



六、基金的业绩

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。

自本基金合同生效以来（截至 2018 年 9 月 30 日）的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示：

1、金鹰转型动力灵活配置混合型证券投资基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

| 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 |
|-----------------------|------------|-----------|----------------|-------------------|--------|--------|
| 2017.11.16-2017.12.31 | -0.35% | 0.59% | -0.60% | 0.60% | 0.25% | -0.01% |
| 2018.1.1-2018.6.30 | -10.71% | 1.45% | -6.18% | 0.69% | -4.53% | 0.76% |
| 2017.11.16-2018.9.30 | -13.61% | 1.39% | -7.27% | 0.71% | -6.34% | 0.68% |

2、自基金合同生效以来基金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

金鹰转型动力灵活配置混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2017 年 11 月 16 日至 2018 年 9 月 30 日)



注：1、本基金合同于 2017 年 11 月 16 日生效，截止报告期末本基金合同生效未
满一年；

2、按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时
各项资产配置比例符合基金合同的有关约定；

3、本基金的业绩比较基准是：沪深 300 指数收益率*60%+中证全债指数收益率
*40%。



七、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、仲裁费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券/期货交易及结算费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金的相关账户的开户及维护费用；
- 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 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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 5 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

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 5 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。

上述“一、基金费用的种类”中第 3—9 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。基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。



八、本基金更新的招募说明书修改说明

根据金鹰转型动力灵活配置混合型证券投资基金的相关法律文件规定,我对前期披露的《金鹰转型动力灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》(简称原招募说明书)进行了更新。此次对原招募说明书的更新,主要修改内容如下:

- 1、在“三、基金管理人”部分,更新了我司相关人员及其它相关的信息;
- 2、在“四、基金托管人”部分,更新了有关基金托管人的相关资料信息;
- 3、在“五、相关服务机构”部分,对代销机构与人员的信息按照最新变动情况进行了更新;
- 4、在“九、基金的投资”更新了第(八)部分—基金投资组合报告,按照最新季报展示投资组合报告的内容;
- 5、“十、基金的业绩”部分,更新到最新的投资业绩;
- 6、对“二十二、其他应披露事项”部分,补充了本基金在本报告期内公开披露的信息内容并对重要信息进行了提示。

金鹰基金管理有限公司

2018 年 12 月 28 日