

**泓德战略转型股票型证券投资基金
招募说明书(更新)摘要
(2016 年第 2 号)**

基金管理人：泓德基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

重要提示

泓德战略转型股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2015 年 7 月 7 日证监许可[2015]1582 号文注册募集。

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。

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，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。投资人在投资本基金前，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，并承担基金投资中出现的各类风险。本基金投资中的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场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，由于基金份额持有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积极管理风险，本基金的特定风险等。

投资有风险，投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同，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。

本基金为股票型基金，属于高风险、高收益的品种，其长期风险与收益特征高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。

本招募说明书所载内容截止日为 2016 年 11 月 10 日，有关财务数据和净值表现截止日 2016 年 9 月 30 日（未经审计）。

本基金托管人中国建设银行股份有限公司已于 2016 年 12 月 6 日复核了本次更新的招募说明。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：泓德基金管理有限公司

住所：西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦 1206 室

办公地址：北京市西城区德胜门外大街 125 号 3 层

设立日期：2015 年 3 月 3 日

法定代表人：王德晓

联系人：童贤达

客户服务电话：4009-100-888

传真：010-59322130

泓德基金管理有限公司注册资本为 12,000 万元，公司股权结构如下：

序号	股东名称	出资金额 (万元)	出资方式	占注册资本比例
1	王德晓	3,120	货币	26%
2	阳光保险集团股份有限公司	3,000	货币	25%
3	珠海市基业长青股权投资基金（有限合伙）	2,000	货币	16.667%
4	南京民生租赁股份有限公司	1,665	货币	13.875%
5	江苏岛村实业发展有限公司	1,665	货币	13.875%
6	上海捷朔信息技术有限公司	550	货币	4.583%
合计		12,000	--	100%

（二）主要人员情况

1、基金管理人董事、监事及高级管理人员基本情况

胡康宁先生，董事长，硕士。现任北京美尔目医院行政院长。曾任易程科技股份有限公司广电事业部总经理、亿品科技有限公司运营副总裁、搜房资讯有限公司执行副总裁、西班牙 MQM 公司北京代表处商务经理。

王德晓先生，副董事长，总经理，硕士。曾任阳光保险集团股份有限公司副董事长兼副总裁、阳光资产管理股份有限公司董事长兼总经理、华泰资产管理有限公司总经理。

张文雯女士，董事，大学本科。现任阳光保险集团股份有限公司董事会办公室协理。曾任阳光保险集团股份有限公司财务部财务管理处负责人、毕马威华振会计师事务所审计部助理经理。

陈学锋先生，独立董事，硕士。现任北京东方金鹰信息科技股份有限公司副总经理。曾任北京盈泰房地产开发有限公司副总经理、华夏证券有限公司财务部总经理、中信国际合作公司计财处副处长。

梅慎实先生，独立董事，博士。现任中国政法大学证券与期货法律研究所所长，研究员。曾任国泰君安证券股份公司任法律事务总部副总经理、企业融资总部首席律师、中国社会科学院法学所副研究员。

宋国良先生，独立董事，博士。现任对外经济贸易大学金融学院副教授、金融产品与投资研究中心主任。曾任瑞士信贷第一波士顿投资银行中国业务副总裁、中国律师事务中心国际融资部主任。

秦毅先生，监事，博士。现任研究部总监助理。曾任阳光资产管理股份有限公司行业研究部研究员、泓德基金管理有限公司研究部行业研究员、特定客户资产投资部投资经理。

李晓春先生，督察长，硕士。曾任瑞银证券有限责任公司投资银行部董事总经理、西藏同信证券有限责任公司副总裁、国泰君安证券股份有限公司收购兼并总部总经理。

温永鹏先生，副总经理兼市场部总监，博士。曾任深圳市大富科技股份有限公司副总裁兼董事会秘书、阳光保险集团股份有限公司资产管理中心宏观经济研究处处长、安信证券股份有限公司研究所宏观经济分析师。

郭传雁先生，副总经理，事业二部负责人，基金经理，硕士。现任泓德泓富灵活配置混合型证券投资基金基金经理、泓德远见回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理、泓德泓业灵活配置混合型证券投资基金基金经理、泓德裕泰债券型证券投资基金基金经理、泓德泓利货币市场基金基金经理，曾任幸福人寿保险股份有限公司总裁助理兼投资管理中心总经理、阳光保险集团股份有限公司资产管理中心投资负责人、阳光财产保险股份有限公司资金运用部总经理助理。

2、本基金基金经理

郭堃先生，基金经理，硕士。现任泓德战略转型股票型证券投资基金基金经理、泓德泓益量化混合型证券投资基金基金经理、泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金基金经理。曾任阳

光资产管理股份有限公司行业研究部新能源和家电行业分析师、制造业研究组组长。

3、基金管理人投资决策委员会

主任：王德晓先生，副董事长，总经理，硕士。曾任阳光保险集团股份有限公司副董事长兼副总裁、阳光资产管理股份有限公司董事长兼总经理、华泰资产管理有限公司总经理。

成员：邬传雁先生，副总经理，事业二部负责人，基金经理，硕士。现任泓德泓富灵活配置混合型证券投资基金基金经理、泓德远见回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理、泓德泓业灵活配置混合型证券投资基金基金经理、泓德裕泰债券型证券投资基金基金经理、泓德泓利货币市场基金基金经理，曾任幸福人寿保险股份有限公司总裁助理兼投资管理中心总经理、阳光保险集团股份有限公司资产管理中心投资负责人、阳光财产保险股份有限公司资金运用部总经理助理。

王克玉先生，事业一部负责人，硕士。现任泓德优选成长混合型证券投资基金基金经理，曾任元大京华证券上海代表处研究员、天相投资顾问有限公司分析师、国都证券有限公司分析师、长盛基金管理有限公司基金经理及权益投资部副总监。

王明德先生，总经理助理，研究部总监，特定客户资产投资部总监，硕士。曾任东兴证券股份有限公司研究所所长、国都证券有限责任公司研究所所长、北京国际信托投资有限公司证券部研究员。

郭堃先生，基金经理，硕士。现任泓德战略转型股票型证券投资基金基金经理、泓德泓益量化混合型证券投资基金基金经理、泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金基金经理，曾任阳光资产管理股份有限公司行业研究部新能源和家电行业分析师、制造业研究组组长。

列席人员：李晓春先生，督察长，硕士。曾任瑞银证券有限责任公司投资银行部董事总经理、西藏同信证券有限责任公司副总裁、国泰君安证券股份有限公司收购兼并总部总经理。

4、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）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。

（二）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工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

（三）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”。

（四）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。资产托管业务部专门设置了监督稽核处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

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。

（五）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“托管业务综合系统——基金监督子系统”，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，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。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） 每工作日按时通过基金监督子系统，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，并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） 根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性和投资独立性等方面进行评价，报送中国证监会。

（4） 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，并及时报告中国证监会。

三、相关服务机构

（一）销售机构

1、直销机构：泓德基金管理有限公司

住所：西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦 1206 室

办公地址：北京市西城区德胜门外大街 125 号 3 层

法定代表人：王德晓

客户服务电话：4009-100-888

传真：010-59322130

联系人：童贤达

网址：www.hongdefund.com

2、其他销售机构

（1）兴业银行股份有限公司

注册地址：福建省福州市湖东路154号中山大厦

办公地址：上海市江宁路168号兴业银行大厦

法定代表人：高建平

电话：021-52629999

传真：021-62569070

联系人：曾鸣

网址：www.cib.com.cn

客户服务电话：95561

（2）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：北京市金融大街丙17号北京银行大厦

法定代表人：闫冰竹

传真：010-66225309

联系人：孔超

网址：www.bankofbeijing.com.cn

客户服务电话：95526

（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：上海市中山东一路12号

法定代表人：吉晓辉

电话：021-61618888

传真：021-63604199

联系人：吴斌

网址：www.spdb.com.cn

客户服务电话：95528

（4）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

办公地址：北京市东城区朝内大街188号

法定代表人：王常青

电话：400-8888-108

传真：010—65182261

联系人：许梦园

网址：www.csc108.com

客户服务电话：400-8888-108

（5）中国银河证券股份有限公司

注册地址：中国北京西城区金融大街35号国际企业大厦C座

办公地址：中国北京西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人：陈有安

电话：010-83574627

传真：010-66568536

联系人：刘舒扬

网址：www.chinastock.com.cn/

客户服务电话：010-83574627

（6）西藏东方财富证券股份有限公司

注册地址：西藏拉萨市北京中路101号

办公地址：上海市闸北区永和路118弄24号

法定代表人：陈宏

电话：021-36537945

传真：(86-21)36533452

联系人：周艳琼

网址：www.xzsec.com/

客户服务电话：40088-11177

（7）中国国际金融有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸写字楼2座27-28层

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸写字楼2座27-28层

法定代表人：丁学东

电话：010-65051166

传真：010-65058065

联系人：王帅

网址：www.cicc.com.cn

客户服务电话：400-910-1166

（8）国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路618号

办公地址：上海市浦东新区银城中路168号

法定代表人：杨德红

电话：021-38676666

传真：021-38670666

联系人：芮敏祺

网址：www.gtja.com

客户服务电话：95521

（9）首创证券有限责任公司

注册地址：北京市西城区德胜门外大街 115 号

办公地址：北京市西城区德胜门外大街 115 号

法定代表人：吴涛

电话：010-59366070

传真：010-59366055

联系人：刘宇

网址：www.sczq.com.cn

客户服务电话：400-620-0620

（10）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

联系人：奚博宇

电话：027-65799999

传真：027-85481900

网址：www.95579.com

客服电话：95579

（11）申万宏源证券有限公司

客服电话：95523 或 4008895523

网址：www.swhysc.com

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

传真：021-33388224

联系人：黄莹

（12）申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼

法定代表人：李季

联系人：黄莹

网址：www.hysec.com

客户服务电话：400-800-0562

（13）平安证券有限责任公司

注册地址：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：谢永林

联系人：周一涵

电话：021-386374376

传真：0755-82435367

网址：www.stock.pingan.com

客户服务电话：95511-8

（14）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

传真：010-84183311-3389

联系人：黄静

网址：www.guodu.com

客户服务电话：400-818-8118

（15）阳光人寿保险股份有限公司

注册地址：海南省三亚市河东区三亚河东路海康商务12、13层

办公地址：北京市朝阳区朝外大街乙12号1号楼昆泰国际大厦12层

法定代表人：李科

电话：010-010-59053779

传真：010-59053700

联系人：龙尧

网址：fund.sinosig.com

（16）上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号

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室

法定代表人：杨文斌

电话：021-20613999

传真：021-68596916

联系人：张茹

网址：www.ehowbuy.com

客户服务电话：400-700-9665

（17）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

办公地址：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

电话：021-20835787

传真：010-85657357

联系人：吴卫东

网址：licaikexun.com

客户服务电话：400-920-0022

（18）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190号2号楼

办公地址：上海市徐汇区龙田路195号3C座7楼

法定代表人：其实

电话：021-54509998-7019

传真：021-64385308

联系人：丁珊珊

网址：www.1234567.com.cn

客户服务电话：400-181-8188

（19）北京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：北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层

法定代表人：梁越

电话：010-56810307

传真：010-56810628

联系人：张晔

网址：www.chtfund.com

客户服务电话：4008980618

（20）中期资产管理有限公司

注册地址：中国北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢11层1103号

办公地址：中国北京市朝阳区建国门外光华路14号A座8层

法定代表人：姜新

电话：010-65807865

传真：010-65807864

联系人：侯英健

网址：www.cifcofund.com

客户服务电话：95162-2

(21)上海汇付金融服务有限公司

注册地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

办公地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

法定代表人：冯修敏

联系人：周丹

电话：021-33323999*8318

传真：021-33323830

网址：www.chinapnr.com

(22)浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：杭州市文二西路 1 号 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 2 楼

法定代表人：凌顺平

电话：0571-88911818

传真：0571-86800423

联系人：吴强

网址：www.5ifund.com

客户服务电话：4008-773-772

(23)上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

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

电话：021-20665952

传真：021-22066653

客户服务电话：4008219031

网址：www.lufunds.com

(24)北京乐融多源投资咨询有限公司

注册地址：北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 16 层 1603

办公地址：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

法定代表人：董浩

传真：010-65951887

电话：010-65951887

联系人：姜颖

网址：www.hongdianfund.com

客户服务电话：400-068-1176

（25）上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

法定代表人：张跃伟

传真：021-20691861

联系人：徐骋骁

网址：www.erichfund.com

客户服务电话：400-820-2899

（26）北京钱景财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区丹棱街丹棱 SOHO 1008-1012

法定代表人：赵荣春

传真：010-57569671

联系人：高静

网址：www.qianjing.com

客户服务电话：400-893-6885

（27）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

网址：www.fund123.cn

客户服务电话：4000-766-123

（28）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

办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼

法定代表人：陈继武

联系人：李晓明

网址：www.lingxianfund.com

客户服务电话：4000 178 000

（29）诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路 32 号 c 栋

法定代表人：汪静波

客服电话：021-38509735

传真：021-38509777

联系人：李娟

网址：www.noah-fund.com

客户服务电话：400-821-5399

（30）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#

办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 A 座 7 层

法定代表人：杨懿

电话：010-83363101

传真：010-83363072

联系人：文雯

网址：<http://8.jrj.com.cn/>

客户服务电话：400-166-1188

（31）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：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号新华社第三工作区 5F

法定代表人：钱昊旻

电话：010-59336533

传真：010-59336500

联系人：孙雯

网址：www.jnlc.com

客户服务电话：4008909998

（32）珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址：广州海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203

法定代表人：肖雯

电话：020-89629099

传真：020-89629011

联系人：黄敏嫦

网址：www.yingmi.cn

客户服务电话：020-89629066

（33）北京创金启富投资管理有限公司

注册地址：北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A

办公地址：北京市西城区白纸坊东街 2 号经济日报社 A 楼 712 室

法定代表人：梁蓉

电话：010-66154828-801

传真：010-63583991

联系人：李婷婷

网址：www.5irich.com

客户服务电话：400-6262-818

（34）北京新浪仓石基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区北四环西路 58 号理想国际大厦 906 室

法定代表人：张琪

电话：010-62676405

客服邮箱：fund@staff.sina.com.cn

联系人：付文红

网址：www.xincai.com

客户服务电话：010-62675369

（35）泰诚财富基金销售（大连）有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海公园 3 号

办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中路3号

法定代表人：林卓

联系人：姜焕洋

电话：0411-88891212

传真：0411-84396536

网址：www.taichengcaifu.com

客户服务电话：400-6411-999

（36）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SOHO现代城C座18层1809

法定代表人：戎兵

联系人：宋欣晔

电话：010-52361860

传真：010-85894285

网址：<http://www.yixinfund.com/>

客户服务电话：400-6099-200

（37）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

法定代表人：陈超

电话：4000988511/4000888816

传真：010-89188000

网址：<http://fund.jd.com>

客户服务电话：95118

（38）深圳众禄金融控股股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼801

办公地址：深圳市罗湖区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：0755-33227951

网址：www.zlfund.cn

客户服务电话：4006-788-887

(39)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：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法定代表人：沈继伟

联系人：刘阳坤

电话：021-50583533

传真：021-50583633

网址：www.leadbank.com.cn

客户服务电话：400-033-7933

(40)乾道金融信息服务（北京）有限公司

注册地址：北京市海淀区东北旺村南 1 号楼 7 层 7117 室

办公地址：北京市西城区德胜门外大街 13 号院 1 号楼 1302

法定代表人：王兴吉

联系人：高雪超

电话：01062062880

传真：01082057741

网址：www.qiandaojr.com

客户服务电话：400-088-8080

(41) 大泰金石投资管理有限公司

注册地址：南京建邺区江东中路 222 号南京奥体中心现代五项馆 2105 室

办公地址：上海市浦东新区峨山路 505 号东方纯一大厦 15 楼

法定代表人：袁顾明

联系人：朱海涛

电话：15921264785

传真：021-20324199

网址：www.dtfunds.com

客户服务电话：400-928-2266

（二）登记机构

名称：泓德基金管理有限公司

住所：西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦 1206 室

办公地址：北京市西城区德胜门外大街 125 号 3 层

法定代表人：王德晓

客户服务电话：4009-100-888

传真：010-59322130

（三）律师事务所

名称：北京市天元律师事务所

住所：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 10 层

办公地址：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 10 层

法定代表人：朱小辉

联系电话：010-57763888

传真：010-57763777

联系人：李晗

经办律师：吴冠雄、李晗

（四）会计师事务所

本公司聘请的法定验资机构为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 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

联系电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：赵钰

经办会计师：薛竞、赵钰

四、基金名称

泓德战略转型股票型证券投资基金

五、基金的类型

股票型

六、基金的运作方式

开放式

七、基金的投资

（一）投资目标

本基金在有效控制风险的前提下，通过积极主动的资产组合配置，追求超越业绩比较基准的投资回报和资产长期稳健增值。

（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交易的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会准予投资的股票）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、可转换债券等）、银行存款（包括通知存款、定期存款、协议存款等）、资产支持证券、权证、货币市场工具、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：股票投资比例为基金资产的 80%—95%；每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

（三）投资策略

1、资产配置策略

本基金采用自上而下的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、政策、市场等因素进行分析，确定资产组合中股票、债券、货币及其他金融工具的比例分配。研判的主要指标和因素包括：

- （1）宏观经济指标：GDP、CPI、PPI、工业增加值、市场利率水平等；
- （2）政策因素：财政政策、货币政策、行业扶持政策以及资本市场相关政策等；
- （3）市场指标：市场整体估值水平以及横向、纵向对比，市场资金供求变化等。

基金管理人将综合考虑上述因素，研判国内、外经济发展趋势，在控制投资组合风险的前提下，对大类资产配置进行主动管理。

2、股票投资策略

当前，中国经济处于战略转型期，经济运行和发展模式正面临着全新的变化：产业变迁，

各类战略新兴产业孕育而生；技术革新，带来全社会生产能力和效率的提升；商业模式创新，互联网思维衍生出愈发多元化的盈利和变现模式；新一轮国际化，国家战略推动企业扩张边界的放大。本基金将重点关注中国经济转型背景下带来的上述各类投资机会。在此基础上，进一步精选出成长空间大、公司治理完善、具有做大做强潜质的优质企业。

（1）主题配置策略

第一，发展战略新兴产业是经济转型期调结构、稳增长的重要手段，也是本轮经济发展模式变革中最大的投资机会所在。本基金将重点关注节能环保和新能源、高端装备制造、新一代信息技术、文化传媒、生物医药等代表未来方向的高成长性领域。随着时间的推移和经济转型的深化，战略新兴产业也将随之动态调整，本基金将持续跟踪并在股票投资组合中随之变化。

第二，技术革新推动全社会生产能力和效率的提升，是中国经济战略转型的重要引擎。信息通讯技术和信息物联系统相结合，将充分提升传统制造业的智能化、数据化水平，最终实现大规模的定制化生产和销售。技术革新对传统产业的升级是本基金关注领域之一。

第三，在移动互联网、大数据、云计算等科技不断发展的背景下，越来越多的企业开始重构其商业生态和盈利模式。本基金将密切关注商业模式创新带来的投资机会。

第四，中国正开启新一轮国际化进程，其核心在于通过资本输出带动高端装备及商品输出，实现国内的产业结构升级。国内相关企业的扩张边界和成长空间由此放大，亦是中国经济战略转型背景下的重点投资领域之一。

（2）个股精选策略

在挖掘经济转型期成长性产业的基础上，本基金将采取定性与定量结合的方法，重点对上市公司的发展战略、竞争优势、公司治理、估值水平等进行研判，精选投资标的。

1）发展战略：公司战略选择决定了其成长的可持续性、长期空间以及风险收益预期，对于成长型企业而言至关重要。

2）竞争优势：公司所处行业的竞争格局，以及公司在该行业内是否具有竞争优势，定性而言包括行业壁垒，产品差异化，技术、渠道或成本领先等，定量指标可以体现在市场份额、成长能力及同业比较（主营收入增长率、净利润增长率等）、盈利能力及同业比较（毛利率、净利率、ROE等）。

3）公司治理：治理结构决定了公司激励、约束和利益分配机制的有效性，以及和投资人沟通渠道畅通与否。

4）估值水平：本基金通过绝对和相对估值对公司合理价值进行评估，包括自由现金流

贴现（FCFF、FCFE）、市盈率（PE）、市净率（PB）、市盈增长比率（PEG）等。

（3）债券投资策略

本基金采用久期控制下的主动投资策略,包括久期控制、期限结构配置、信用风险评估、相对价值判断等管理手段,对债券市场、收益率曲线以及各债券品种价格的变化进行预测,并主动调整。

1) 久期控制: 本基金根据对宏观经济形势、宏观经济政策等因素进行分析, 预测未来利率走势, 确定组合的整体久期, 有效的控制整体资产风险;

2) 期限结构配置: 确定组合久期后, 本基金将对债券市场收益率曲线的期限结构进行分析, 预测收益率曲线的变化趋势, 制定组合的期限结构配置策略, 包括采用集中策略、两端策略和梯形策略等, 在长期、中期和短期债券间进行动态调整, 从长、中、短期债券的相对价格变化中获利;

3) 信用风险评估: 本基金将利用公司自身和外部研究力量, 根据发债主体的经营状况和现金流等情况对其信用风险进行评估, 以此作为品种选择的基本依据;

4) 相对价值判断: 在现金流特征相近的债券品种之间选取价值相对低估的债券品种, 选择合适的交易时机, 增持相对低估的债券品种, 减持相对高估的债券品种。

（4）权证投资策略

本基金将基于审慎原则利用权证及其他金融工具对基金投资组合进行管理, 以控制并降低投资组合风险, 提高投资效率。主要策略为:

1) 运用权证与标的资产可能形成的风险对冲功能, 构建权证与标的股票的组合, 主要通过波幅套利及风险对冲策略实现相对收益;

2) 构建权证与债券的组合, 利用债券的固定收益特征和权证的高杠杆特性, 形成保本投资组合;

3) 本基金进行权证投资时, 将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上, 结合股价波动率等参数, 运用数量化期权定价模型, 确定其合理内在价值, 谨慎参与以杠杆放大为目标的权证投资。

（5）股指期货投资策略

本基金将在风险可控的前提下, 本着谨慎原则, 适度参与股指期货投资。通过对现货市场和期货市场运行趋势的研究, 结合基金股票组合的实际情况及对股指期货的估值水平、基差水平、流动性等因素的分析, 选择合适的期货合约构建相应的头寸, 以调整投资组合的风险暴露, 降低系统性风险。

（6）国债期货投资策略

本基金本着谨慎原则，从风险管理角度出发，适度参与国债期货投资。

（7）资产支持证券投资策略

通过对资产支持证券的发行条款、支持资产的构成及质量等基本面研究，结合相关定价模型评估其内在价值，谨慎参与资产支持证券投资。

（四）投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- （1）股票投资比例为基金资产的 80%—95%；
- （2）每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后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；
- （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）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%；本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

（15）本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

（16）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%；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%；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）占基金资产的比例为 80%-95%；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%；

（17）基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债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 30%；

（18）基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

（19）本基金投资流通受限证券，基金管理人应根据中国证监会相关规定，与基金托管人在基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应制定严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险；

（20）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、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

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。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取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

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，但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外；
- （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。

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。

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。

（五）风险收益特征

本基金为股票型基金，属于高风险、高收益的品种，其长期风险与收益特征高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金。

（六）投资决策

基金投资组合的管理采用投资决策委员会领导下的基金经理负责制。

（七）投资程序与交易机制

1、研究策划

研究部在自身研究及外部研究机构研究成果的基础上，形成投资策略报告和研究报告，为本基金的投资管理提供决策依据。

2、资产配置

投资决策委员会定期不定期召开会议，依据基金投资部、研究部的报告确定基金资产配置。

3、构建投资组合

基金经理根据投资决策委员会的投资战略，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。

4、组合的监控和调整

研究部协同基金经理对投资组合进行跟踪。研究员应保持对个股和个券的定期跟踪，并及时向基金经理反馈个股和个券的最新信息，以利于基金经理作出相应的调整。

5、投资指令下达

基金经理根据投资组合方案制订具体的操作计划，并以投资指令的形式下达至交易部。

6、指令执行及反馈

交易部依据投资指令进行操作，并将指令的执行情况反馈给基金经理。

7、风险控制

监察稽核部对投资组合计划的执行过程进行日常监督和实施风险控制，基金经理依据基金申购赎回的情况控制投资组合的流动性风险。

8、业绩评价

监察稽核部将定期对基金的业绩进行归因分析，找出基金投资管理的长处和不足，为日后的管理提供客观的依据。

（八）禁止行为

本基金禁止从事下列行为：

- 1、投资于其他基金；
- 2、进行内幕交易、操纵市场，通过关联交易损害基金份额持有人的利益；
- 3、以基金的名义使用不属于基金名下的资金；
- 4、从事证券信用交易；
- 5、以基金资产进行房地产投资；
- 6、从事可能使基金资产承担无限责任的投资；
- 7、从事任何形式的证券承销业务；
- 8、中国证监会及有关法律法规规定禁止从事的其他行为；
- 9、基金管理人承诺的禁止从事的其他投资。

（九）业绩评价基准及选择理由：

本基金的业绩比较基准是：

沪深 300 指数收益率×90%+中证综合债券指数×10%

业绩比较基准选择理由：

1、沪深 300 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国 A 股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映 A 股市场总体发展趋势。

2、中证综合债券指数是中国全市场债券指数，以 2001 年 12 月 31 日为基期，基点为 100 点，并于 2002 年 12 月 31 日起发布。中债综合指数的样本具有广泛的市场代表性，其样本范围涵盖银行间市场和交易所市场，成分债券包括国债、企业债券、央行票据等所有主要债券种类。

3、作为股票型基金，选择该业绩比较基准能够真实反映本基金长期动态的资产配置目标和风险收益特征。

如果今后上述基准指数停止计算编制或更改名称，或法律法规发生变化，或有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或市场中出现更适用于本基金的比较基准指数，本基金可以在征得基金托管人同意后报中国证监会备案后变更业绩比较基准，并及时公告。

（十）基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

- 1、不谋求对所投资公司的控股，不参与所投资公司的经营管理；
- 2、有利于基金资产的安全与增值；
- 3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金投资者的利益。

（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根据本基金合同规定，于 2016 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本投资组合报告所载数据截至 2016 年 9 月 30 日（未经审计）。

1 报告期末基金资产组合情况

金额单位：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	725,254,126.25	81.65

	其中：股票	725,254,126.25	81.65
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
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	155,813,806.11	17.54
8	其他资产	7,180,683.21	0.81
9	合计	888,248,615.57	100.00

2 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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	40,512,950.26	4.61
C	制造业	490,329,915.01	55.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,164,440.48	1.38
E	建筑业	218,985.90	0.02
F	批发和零售业	54,766,745.13	6.23
G	交通运输、仓储和邮政业	11,597,886.58	1.32
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	30,974,095.09	3.52
J	金融业	56,561,945.17	6.43
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	4,690,380.65	0.53
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	23,436,781.98	2.67
S	综合	—	—
	合计	725,254,126.25	82.48

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	002518	科士达	2,050,863	42,883,545.33	4.88
2	300360	炬华科技	1,710,665	35,034,419.20	3.98
3	002554	惠博普	4,877,714	32,144,135.26	3.66
4	600566	济川药业	1,028,438	30,740,011.82	3.50
5	603338	浙江鼎力	597,642	27,491,532.00	3.13
6	002502	骅威文化	2,066,600	27,299,786.00	3.10
7	002214	大立科技	2,099,060	24,705,936.20	2.81
8	000028	国药一致	333,062	23,897,198.50	2.72
9	601169	北京银行	2,504,522	22,791,150.20	2.59
10	000333	美的集团	738,950	19,959,039.50	2.27

4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

11 投资组合报告附注

11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现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。

11.2 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。

11.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	97,050.26
2	应收证券清算款	6,973,844.51
3	应收股利	—
4	应收利息	31,936.73
5	应收申购款	77,851.71
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	7,180,683.21

11.4 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。

11.5 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不存在流通受限情况。

11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

八、基金的业绩

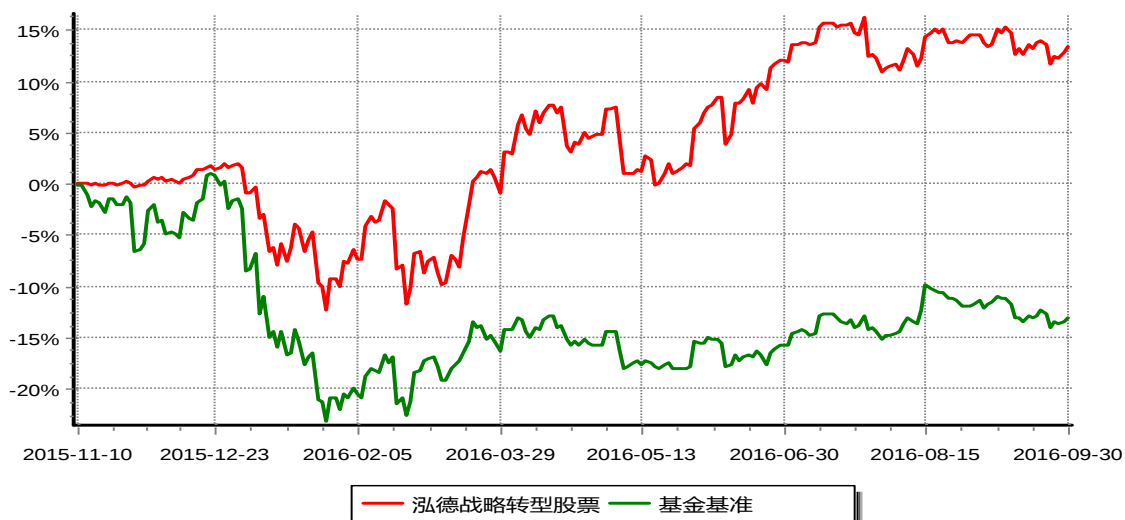
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

（一）本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准率的比较

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
2015年11月10日(基金合同生效)至2015年12月31日	1.50%	0.25%	-2.37%	1.39%	3.87%	-1.14%
2016年1月1日至2016年9月30日	11.63%	1.54%	-11.11%	1.41%	22.74%	0.13%
自基金合同生效之日起至今（2015年11月10日至2016年9月30日）	13.30%	1.41%	-13.21%	1.40%	26.51%	0.01%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×90%+中证综合债券指数×10%

（二）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



注：

- (1) 本基金的基金合同于2015年11月10日生效,截至2016年9月30日止,本基金成立未满1年。
- (2) 根据基金合同的约定,本基金建仓期为6个月,建仓期结束时,本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围及投资限制规定。

九、基金的费用与税收

（一）基金运作费用

1、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。

2、基金费用的费率、计提标准、计提方式与支付方式

（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

基金管理费每日计提，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动于次月前 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

基金托管费每日计提，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动于

次月前 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“1、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。

3、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。

4、基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前在指定媒介上刊登公告。

（二）基金销售费用

本基金认购费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书“六、基金的募集”中“（八）认购费用”以及“（十）认购份额的计算”中的相关规定。

本基金申购费、赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书“八、基金份额的申购、赎回与转换”中的“（六）申购费与赎回费”与“（七）申购份额与赎回金额的计算方式”中的相关规定。

（三）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。

十、备查文件

（一）备查文件目录

- 1、中国证监会准予注册泓德战略转型股票型证券投资基金募集的文件。
- 2、《泓德战略转型股票型证券投资基金基金合同》。
- 3、《泓德战略转型股票型证券投资基金托管协议》。
- 4、法律意见书。
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照。
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

（二）存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人处。

（三）查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅备查文件。在支付工本费后，可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

十一、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《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》及其他有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对本基金的原招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

- 1、 在“重要提示”部分，明确了更新招募说明书内容的截止日期、有关财务数据和基金业绩的截止日期。
- 2、 对“基金管理人”相关信息进行了更新。
- 3、 对“相关服务机构”相关信息进行了更新。
- 4、 对“基金份额的申购、赎回和转换”相关信息进行了更新。
- 5、 对“基金的投资组合报告”相关信息进行了更新。
- 6、 对“基金的业绩”相关信息进行了更新。
- 7、 对“其他应披露的事项”相关信息进行了更新。
- 8、 对部分表述进行了更新。

泓德基金管理有限公司

2016 年 12 月 10 日