长城转型成长灵活配置混合型证券投资基金更新的招募说明书摘要

(2019年第1号)

基金管理人:长城基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
二〇一九年六月

长城转型成长灵活配置混合型证券投资基金经2015年4月24日中国证券监督管理委员会证监许可[2015]740号文注册募集。基金合同于2017年4月26日生效。

重要提示

投资有风险,投资人申购基金时应认真阅读本招募说明书;基金的过往业绩并不预示其未来表现,本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。

本摘要根据本基金的基金合同和基金招募说明书编写,基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

本招募说明书所载内容截止日为2019年4月25日,有关财务数据和净值表现截止日为2019年3月31日(财务数据未经审计)。

本基金托管人中国银行股份有限公司已对本次更新的招募说明书中的投资组合报告和业绩表现进行了复核确认。

一、基金管理人
(一)基金管理人情况
1.名称:长城基金管理有限公司
2.住所:深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层
3.办公地址:深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心40-41层
4.法定代表人:王军
5.组织形式:有限责任公司
6.设立日期:2001年12月27日
7.电话:0755-23982338 传真:0755-23982328
8.联系人:袁柳生
9.管理基金情况:

目前管理长城久恒灵活配置混合型证券投资基金、长城久泰沪深300指数证券投资基金、长城货币市场证券投资基金、长城消费增值混合型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、长城久富核心成长混合型证券投资基金(LOF)、长城品牌优选混合型证券投资基金、长城稳健增利债券型证券投资基金、长城双动力混合型证券投资基金、长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金、长城中小盘成长混合型证券投资基金、长城积极增利债券型证券投资基金、长城优化升级混合型证券投资基金、长城稳健成长灵活配置混合型证券投资基金、长城核心优选灵活配置混合型证券投资基金、长城增强收益定期开放债券型证券投资基金、长城医疗保健混合型证券投资基金、长城工资宝货币市场基金、长城久盈纯债债券型证券投资基金、长城稳固收益债券型证券投资基金、长城新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、长城环保主题灵活配置混合型证券投资基金、长城改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长城久祥灵活配置混合型证券投资基金、长城行业轮动灵活配置混合型证券投资基金、长城新优选混合型证券投资基金、长城久润保本混合型证券投资基金、长城久益灵活配置混合型证券投资基金、长城久源保本混合型证券投资基金、长城久鼎保本混合型证券投资基金、长城久稳债券型证券投资基金、长城久信债券型证券投资基金、长城中国智造灵活配置混合型证券投资基金、长城转型成长灵活配置混合型证券投资基金、长城创业板指数增强型发起式证券投资基金、长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金、长城收益宝货币市场基金、长城智能产业灵活配置混合型证券投资基金、长城久鑫灵活配置混合型证券投资基金、长城久荣纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、长城中证500指数增强型证券投资基金、长城久惠灵活配置混合型证券投资基金、长城久悦债券型证券投资基金、长城核心优势混合型证券投资基金、长城量化精选股票型证券投资基金等四十五只基金。

10.客户服务电话:400-8868-666
11.注册资本:壹亿伍仟万元
12.股权结构:

持股单位	占总股本比例
长城证券有限责任公司	47.059%
东方证券股份有限公司	17.647%
中原信托有限公司	17.647%
北方国际信托股份有限公司	17.647%
合计	100%

(二)基金管理人主要人员情况
1.董事、监事及高管人员介绍
(1)董事

王军先生,董事长,学士。曾任中国华能集团有限公司财务部副主任,1999年7月进入中国华能集团工作,历任主管、副处长、处长,副主任等职务。

熊科金先生,董事,总经理,硕士。曾任中国银行江西信托投资公司证券业务部负责人,中国东方信托投资公司南昌证券营业部总经理、公司证券总部负责人,华夏证券有限公司江西管理总部总经理,中国银河证券有限责任公司基金部负责人、银河基金管理有限公司筹备组负责人,银河基金管理有限公司副总经理、总经理。

何伟先生,董事,硕士。曾任职于北京兵器工业部计算机所、深圳蛇口工业区电子开发公司、深圳蛇口百佳超市有限公司等公司,1993年2月起历任君安证券有限公司投资二部经理、总裁办主任、公司总裁助理兼资产管理公司常务副总经理、营业部总经理,国泰君安证券股份有限公司总裁助理,华富基金管理有限公司(筹)拟任总经理,国泰君安证券股份有限公司总裁助理、公司副总裁,长城证券股份有限公司总裁、党委副书记,长城基金管理有限公司董事长。

杨超先生,董事,博士。现任长城证券股份有限公司金融研究所所长助理(主持工作),首席研究员。曾任职于安徽省冶金科学研究所、天津港集团财务公司、鹏华基金管理有限公司。2012年4月起加入长城证券股份有限公司,历任长城证券金融研究所行业三部经理、新兴产业部经理。

杨玉成先生,董事,硕士。现任东方证券股份有限公司副总裁、董事会秘书,东方金融控股(香港)有限公司董事长,上海东方证券资产管理有限公司董事。曾任上海财经大学财政系教师,君安证券有限公司证券投资部总经理助理,上海大众科技创业(集团)股份有限公司董事、董事会秘书、副总经理,上海申能资产管理有限公司董事、副总经理,东方证券股份有限公司财务总监、副总经理,申能集团财务有限公司董事、总经理。

姬宏俊先生,董事,硕士。现任中原信托有限公司副总裁。曾任河南省计划委员会老干部处副处长、投资处副处长,发展计划委员会财政金融处副处长,国家开发银行河南省分行信贷一处副处长。

金树良先生,董事,硕士。现任北方国际信托股份有限公司总经济师。曾任职于北京大学经济学院国际经济系。1992年7月起历任海南省证券公司副总裁、北京华宇世纪投资有限公司副总裁、昆仑证券有限责任公司总裁、北方国际信托股份有限公司资产管理部总经理及公司总经理助理兼资产管理部总经理、渤海财产保险股份有限公司常务副总经理及总经理、北方国际信托股份有限公司总经理助理。

万建华先生,独立董事,硕士。现任上海市互联网金融行业协会会长,通联支付网络股份有限公司董事。曾任中国人民银行资金管理司处长,招商银行总行常务副行长兼上海分行行长(期间兼任长城证券股份有限公司董事长、国通证券有限责任公司(现招商证券股份有限公司)董事长),中国银联股份有限公司党委书记、总裁,上海国际集团党委副书记、副董事长、总经理,国泰君安证券股份有限公司党委书记、董事长,证通股份有限公司董事长。

唐纹女士,独立董事,学士,现已退休。曾任电力部科学研究院系统所工程师,中国国际贸易促进委员会经济信息部副处长、处长,中国华能集团香港公司副总经理、党委书记。

徐英女士,独立董事,学士。现已退休。曾任北京财贸学院金融系助教、讲师,海南汇通国际信托投资公司副总经理、常务副总经理,长城证券股份有限公司总经理、董事长、党委书记,景顺长城基金管理有限公司董事长、中国证券业协会理事,新华资产管理股份有限公司副董事长。

鄢维民先生,独立董事,学士。现任深圳市证券业协会常务副会长兼秘书长、深圳上市公司协会副会长兼秘书长。曾任江西省社会科学院经济研究所发展室副主任、深圳市体改委宏观调控处、企业处副处长,深圳市证券管理办公室公司审查处处长,招银证券公司副总经理。

(2)监事

吴礼信先生,监事会主席,会计师,中国注册会计师(非执业)。现任长城证券股份有限公司董事会秘书、财务总监。曾任安徽省地矿局三二六地质队会计主管,深圳中达信会计师事务所审计一部部长,大鹏证券有限责任公司计财综合部经理,大鹏证券有限责任公司资金结算部副总经理,第一创业证券有限责任公司计划财务部副总经理。2003年进入长城证券股份有限公司,任财务部总经理。

曾广炜先生,监事,高级会计师。现任北方国际信托股份有限公司总经理助理兼风险控制部总经理。曾任职于中国燕兴天津公司、天津开发区总公司、天津滨海新兴产业公司,2003年1月起历任北方国际信托股份有限公司信托业务四部副总经理、证券投资部副总经理、财务中心总经理、风险控制部总经理。

杨斌先生,监事,硕士。现任东方证券股份有限公司首席风险官、合规总监。曾就职于中国人民银行上海分行非银行金融机构管理处,自1998年7月至2015年5月先后于上海证监局稽查处、案件审理处、案件调查一处、机构监管一处、期货监管处、法制工作处等部门任职,历任科员、副主任科员、主任科员、副处长、处长。

黄魁粉女士,监事,硕士。现任中原信托有限公司固有业务部总经理。2002 年 7 月进入中原信托有限公司。曾在信托投资部、信托综合部、风险与合规管理部、信托理财服务中心工作。

何小乐女士,监事,硕士。现任长城基金管理有限公司董事会秘书。2003年7月起先后任职于中国农业银行四川省分行、花旗银行(中国)有限公司成都分行任客户经理,2010年10月至2018年2月就职于成都弘投投资管理有限公司历任投资经理、总经理。

袁柳生先生,监事,硕士。现任长城基金管理有限公司综合管理部总经理。2008年6月至2014年2月任职于长城基金管理有限公司综合管理部,2014年3月至2018年4月任长城嘉信资产管理有限公司综合运营部总监。

王燕女士,监事,硕士。现任长城基金管理有限公司财务经理,综合管理部副总经理。2007年5月进入长城基金管理有限公司, 曾在运行保障部登记结算室从事基金清算工作,2010年8月进入综合管理部从事财务会计工作。

张静女士,监事,硕士。现任长城基金管理有限公司监察稽核部法务主管。曾任摩根士丹利华鑫基金管理有限公司监察稽核部监察稽核员。

(3)高级管理人员

王军先生,董事长,简历同上。

熊科金先生,董事、总经理,简历同上。

彭洪波先生,副总经理兼国际业务部总经理,硕士。曾就职于长城证券股份有限公司,历任深圳东园路营业部电脑部经理,公司电子商务筹备组项目经理,公司审计部主审。2002年3月进入长城基金管理有限公司,历任监察稽核部业务主管、部门副总经理、部门总经理、公司督察长兼监察稽核部总经理、公司总经理助理兼运行保障部总经理、信息技术部总经理。

杨建华先生,副总经理、投资总监兼基金管理部总经理、投资决策委员会委员,基金经理,硕士。曾就职于大庆石油管理局、华为技术有限公司、深圳和君创业有限公司、长城证券股份有限公司。2001年10月进入长城基金管理有限公司,曾任公司总经理助理、研究部总经理。

沈阳女士,副总经理兼机构理财部总经理,硕士。曾就职于广发证券股份有限公司、中国证券报、恒生投资管理有限公司、博时基金管理有限公司、浙商基金管理有限公司。2019年1月加入长城基金管理有限公司。

车君女士,督察长兼监察稽核部总经理,硕士。曾任职于深圳本鲁克斯实业股份有限公司,1993年起先后在中国证监会深圳监管局市场处、机构监管处、审查执行处、稽查一处、机构监管二处、党办等部门工作,历任副主任科员、主任科员、副处长、正处级调研员等职务。

2.本基金基金经理简历

赵波先生, 伦敦大学皇家霍洛威学院学士、伦敦城市大学卡斯商学院硕士、中国社会科学院博士。曾就职于中银国际证券有限责任公司。2011年进入长城基金管理有限公司,曾任行业研究员、"长城品牌优选股票型证券投资基金"基金经理助理。自2016年1月至2019年3月任"长城改革红利灵活配置混合型证券投资基金"基金经理,自2017年6月至2019年1月任"长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金"基金经理,自2017年8月至2018年12月任"长城双动力混合型证券投资基金"基金经理。自2014年4月至今任"长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金"基金经理,自2017年4月至今任"长城转型成长灵活配置混合型证券投资基金",自2018年6月至今任"长城久鑫灵活配置混合型证券投资基金"基金经理。

3.本公司公募基金投资决策委员会成员的姓名和职务如下:
熊科金先生,投资决策委员会主任,公司董事、总经理。
杨建华先生,投资决策委员会委员,公司副总经理、投资总监兼基金管理部总经理、基金经理。
何以广先生,投资决策委员会委员,公司研究部总经理、基金经理。
马强先生,投资决策委员会委员,公司固定收益部总经理、基金经理。
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:中国银行股份有限公司(简称"中国银行")
住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记日期:1983年10月31日
注册资本:人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整
法定代表人:陈四清
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【1998】24 号
托管部门信息披露联系人:王永民
传真:(010)66594942
中国银行客服电话:95566

(二)基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年,现有员工110余人,大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验,且具有海外工作、学习或培训经历,60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务,中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行,中国银行拥有证券投资基金、基金(一对多、一对一)、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内,中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务,为各类客户提供个性化的托管增值服务,是国内领先的大型中资托管银行。

(三)证券投资基金托管情况

截至2019年3月31日,中国银行已托管710只证券投资基金,其中境内基金670只,QDII基金40只,覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF等多种类型的基金,满足了不同客户多元化的投资理财需求,基金托管规模位居同业前列。

三、相关服务机构
(一)基金份额发售机构
1、直销机构
名称:长城基金管理有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层
办公地址:深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心40-41层
法定代表人:王军
成立时间:2001年12月27日
电话:0755-23982338
传真:0755-23982328
联系人:黄念英
客户服务电话:400-8868-666
网站:www.ccfund.com.cn

2、代销机构
(1)中国银行股份有限公司
住所:北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人:陈四清
联系人:刘文霞
客服电话:95566
网址:www.boc.cn
(2)中国建设银行股份有限公司
注册地址: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
联系人:张静
电话:010-66275654
客户服务电话:95533
网址:www.ccb.com
(3)招商银行股份有限公司
注册地址:深圳市深南大道7088 号招商银行大厦
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
电话:0755-83198888
传真:0755-83195109
联系人:邓炯鹏
客户服务电话:95555
网址:www.cmbchina.com
(4)交通银行股份有限公司
注册地址:上海市银城中路188号
办公地址:上海市银城中路188号
法定代表人:牛锡明
电话:021-58781234
传真:021-58408842
联系人:张宏革
客户服务电话:95559
网址:www.bankcomm.com
(5)中信银行股份有限公司
住所:北京市东城区朝阳门北大街9号
办公地址:北京市东城区朝阳门北大街9号
法定代表人:李庆萍
联系人:丰靖
电话:010-65550827
传真:010-65541230
客户服务电话:95558
网站:www.bank.ecitic.com
(6)上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区浦东南路500号
办公地址:上海市中山东一路12号
法定代表人:吉晓辉
联系人:周志杰
电话:021-61614934
网址:www.spdb.com.cn
客户服务电话:95528
(7)中国民生银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人:董文标
电话:010-56367136
传真:010-57092611
联系人:穆婷
客户服务电话:95568
网址:www.cmbc.com.cn
(8)泉州银行股份有限公司
注册地址:福建省泉州市丰泽区云鹿路3号
法定代表人:傅子能
联系人:谢婷枫
联系电话:0595-22551071
客服电话:400-8896-312
公司网站:www.qzccbank.com
(9)宁波银行股份有限公司
注册地址:宁波市鄞州区宁南南路700号
法定代表人:陆华裕
联系人:邱艇
电话:0574-87050397
客服电话:95574
公司网站:www.nbcb.com
(10)东莞农村商业银行股份有限公司
注册地址:东莞市南城路2号
办公地址:东莞市南城路2号
法定代表人:何沛良
联系人:杨亢
电话:0769-22866270
传真:0769-22320896
客服电话:0769-961122
网址:www.drcbank.com
(11)武汉农村商业银行股份有限公司
住所:武汉市江岸区建设大道618号
法定代表人:徐小建
电话:027-85497270
联系人:邹君
客服电话:96555
公司网站:www.whrcbank.com
(12)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:北京市西城区金融大街丙17号
法定代表人:张东宁
联系人: 周黎
电话:010-66224815
传真:010-66226045
客服电话:95526
网址:www.bankofbeijing.com.cn
(13)中国农业银行股份有限公司
注册地址:北京市海淀区复兴路甲23号
法定代表人:周慕冰
联系人:马秀艳
电话:010-85108206
传真:010-85109230
客户服务电话:95599
公司网址:www.abchina.com
(14)江苏银行股份有限公司
注册地址:江苏省南京市中华路 26 号
办公地址:江苏省南京市中华路 26 号
法定代表人:夏平
联系人:张洪玮
客服电话:95319
网址:www.jsbchina.cn
(15)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号上海银行大厦29楼
法定代表人:杨德红
联系人:钟伟镇
电话:021-38676798
传真:021-38670798
客户服务电话:95521
网站:www.gtja.com
(16)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:北京市朝阳门内大街188号
法定代表人:王常青
电话:010-85130577
联系人:权唐
客户服务电话:4008888108
网站:www.csc108.com
(17)国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26层
办公地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26层
法人代表人:何如
联系人:李颖
电话:0755-82130833
传真:0755-82133952
客户服务电话:95536
网址:www.guosen.com.cn
(18)中信证券股份有限公司
住所: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
法定代表人:张佑君
联系人:马静懿
电话:010-60833889
客户服务电话:95548
网站:www.cs.ecitic.com
(19)海通证券股份有限公司
注册地址:上海市淮海中路98号
法定代表人:王开国
电话:021-23219991
联系人:程丽辉
客户服务电话:95553、4008888001
网站:www.htsec.com
(20)申万宏源证券股份有限公司
注册地址:上海市徐汇区长乐路989号45层
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:曹晔
电话:021-33388215
传真:021-33388224
客服电话:95523/4008895523/4008000562
网址:www.swhysc.com
(21)兴业证券股份有限公司
住所:福州市湖东路268号
办公地址:上海市浦东新区长柳路36号
法定代表人:杨华辉
联系人:乔琳雪
电话: 021-38565547
客户服务电话:95562
网址: www.xyzq.com.cn
(22)长江证券股份有限公司
地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人:胡运钊
联系人:李良
电话:027-65799999
传真:027-85481900
客服热线:4008-888-999或95579
网址:www.95579.com
(23)西南证券股份有限公司
办公地址:重庆市江北区桥北苑8号
法定代表人:余维佳
联系人:张煜
电话:023-63786141
客服电话:4008096096
公司网址:www.swsc.com.cn
(24)渤海证券股份有限公司
住所:天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
办公地址:天津市南开区宾水西道8号
法定代表人:王春峰
联系人:蔡霆
电话:022-28451991
传真:022-28451892
客户服务电话:400-651-5988
网址:www.ewww.com.cn
(25)中信证券(山东)有限责任公司
注册地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层
办公地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层
法定代表人:杨宝林
联系电话:0532-85022326
传真:0532-85022605
联系人:吴忠超
客户服务电话:95548
公司网址:www.citicssd.com
(26)信达证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址:北京市西城区宣武门西大街甲127号大成大厦6层
法定代表人:张志刚
联系人:唐静
联系电话:010-83252182
传真:010-63080978
客服电话:95321
公司网址:www.cindasc.com
(27)方正证券股份有限公司
住所:长沙市天心区湘江中路二段36号华远华中心4、5号楼3701-3717
法定代表人:何其聪
联系人:高洋
联系电话:010-59355546
客服电话:95571
网址:www.foundersc.com
(28)长城证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人:黄耀华
联系人:刘阳
电话:0755-83516289
传真:0755-83515567
客户服务电话:0755-33680000,4006666888
网站:www.cgws.com
(29)光大证券股份有限公司
注册地址:上海市静安区新闸路1508号
办公地址:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:薛峰
电话:021-22169999
传真:021-22169134
联系人:李芳芳
客服电话:4008888788、10108998
公司网址:www.ebscn.com
(30)广州证券股份有限公司
注册地址:广州市先烈中路69号东山广场主楼17楼
办公地址:广州市天河区珠江新城珠江西路5号广州国际金融中心19、20楼
法定代表人:邱三发
联系人:林洁茹
电话:020-88836999
传真:020-88836654
客户服务电话:020-961303
网站:www.gzs.com.cn
(31)大同证券有限责任公司
注册地址: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
客户服务热线:400-7121-212
网址:www.dtsbc.com.cn
(32)平安证券有限责任公司
办公地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
法定代表人:杨宇翔
联系人:周一涵
电话:021-38637436
传真:021-33830395
客户服务电话:4008816168
网站:www.pingan.com
(33)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
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
法定代表人:常喆
联系人:黄静
电话:010-84183333
传真:010-84183311
客户服务电话:400-818-8118
网址:www.guodu.com
(34)国盛证券有限责任公司
住所:江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道1115号北京银行南昌分行营业大楼
法定代表人:徐丽峰
联系人:占文驰
联系电话:0791-86283372
客户服务电话:4008222111
网站:www.gsstock.com
(35)华西证券股份有限责任公司
注册地址:四川省成都市陕西街239号
办公地址:深圳市深南大道4001号时代金融中心18楼(深圳总部)
法定代表人:张慎修
联系人:张曼
电话:010-52723273
客户服务电话:4008-888-818
网站:www.hx168.com.cn
(36)申万宏源西部证券有限公司
住所: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
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:李季
联系人: 李巍
传真:010-88085195
客户服务电话:4008-000-562
网址:www.hysec.com
(37)中泰证券有限责任公司
注册地址:山东省济南市市中区经七路86号
办公地址:山东省济南市市中区经七路86号
法定代表人:李玮
联系人:吴阳
电话:0531-68889155
传真:0531-68889752
客服电话:95538
网址:www.zts.com.cn
(38)西部证券股份有限公司
住所:西安市东新街232号陕西信托大厦16-17层
地址:西安市东新街232号陕西信托大厦16-17层
法定代表人:刘建武
联系人:梁承华
电话:029-87406168
传真:029-87406387
客服热线:95582
网址:www.westsecu.com.cn
(39)中国国际金融股份有限公司
注册地址:北京市建国门外大街1号国贸写字楼2座27层及28层
法定代表人:李学东
电话:010-85679888
传真:010-85679535
联系人:秦朗
客服电话:400-910-1166
网址:www.cicc.com.cn
(40)中国中投证券有限责任公司
注册地址: 深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元
办公地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层
法定代表人:龙增来
联系人:刘毅
电话:0755-82023442
传真:0755-82026539
客服电话:400-600-8008、95532
网址:www.china-invs.cn
(41)国金证券股份有限公司
注册地址: 四川省成都市东城根上街95号
办公地址: 四川省成都市东城根上街95号
法定代表人:冉云
联系人:刘婧漪
电话:028-86690057
客户服务电话: 95310
网址:www.gjzq.com.cn
(42)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:北京市西城区金融大街8号A座3层
法定代表人:祝献忠
联系人:李慧灵
联系电话:010-58315221
传真:010-58568062
客服电话:010-58568118
公司网站:www.hrsec.com.cn
(43)中信期货有限公司
注册地址: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:张磊
联系人:洪成
电话:0755-23953913
传真:0755-83217421
客服电话:400-990-8826
公司网站:www.citicsf.com
(44)招商证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人:宫少林
联系人:黄婵君
电话:0755-82960167
传真:0755-82943636
客户服务热线:95565
网址:www.newone.com.cn
(45)华鑫证券有限责任公司
住所: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
电话:021-64339000
传真:021-54967032
联系人:丁晨
客服电话:95323
公司网站:www.cfsc.com.cn
(46)南京证券股份有限公司
住所: 南京市江东中路389号
法定代表人: 步国旬
联系人:王万君
客服电话:95386
公司网站:www.njzq.com.cn
(47)东海证券股份有限公司
注册地址:江苏省常州延陵西路23号投资广场18层
办公地址:上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦
法定代表人:赵俊
电话:021-20333333
传真:021-50498825
联系人:王一彦
客服电话:95531;400-8888-588
网址:www.longone.com.cn
(48)深圳众禄基金销售股份有限公司
住所:深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦8楼
地址:深圳市罗湖区梨园路8号HALO广场4楼
法定代表人:薛峰
联系人:童彩平
电话:0755-33227950
传真:0755-33227951
客服电话:4006-788-887
公司网址:www.zlfund.cn及www.jjmmw.com
(49)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幢202室
法定代表人:陈柏青
联系人:顾祥柏
电话:13918979642
客服电话:95188
公司网址:www.fund123.cn
(50)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
住所:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心8楼801室
办公地址:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心8楼801室
法定代表人:汪静波
联系人:徐诚
联系电话:021-38509636
客服电话:400-821-5399
公司网站:www.noah-fund.com
(51)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2层
办公地址:上海市徐汇区宛平南路88号东方财富大厦
法定代表人:其实
联系人:黄妮娟
联系电话:021-54509998
客服电话:400-1818-188
公司网站:www.1234567.com.cn
(52)众升财富(北京)基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区望京东园四区13号楼A座9层908室
办公地址:北京市朝阳区望京浦项中心A座9层04-08
法定代表人:李招弟
联系人:李艳
联系电话:010-59497361
传真:010-64788016
客服电话:400-876-9988
公司网站:www.zscffund.com
(53)北京增财基金销售有限公司
办公地址:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208-1209室
法定代表人:王昌庆
联系人:张蕾
联系电话:010-67000988
客服电话:400-001-8811
公司网站:www.zcvc.com.cn
(54)和讯信息科技有限公司
住所: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
联系人:吴阿婷
联系电话:0755-82721106
客服电话:400-9200-022
公司网站:licaike.hexun.com
(55)上海好买基金销售有限公司
住所:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
法定代表人:杨文斌
联系人:胡锴隽
联系电话: 021-20613635
客服电话:400-700-9665
公司网站:www.ehowbuy.com
(56)上海联泰基金销售有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址:上海市长宁区福泉北路518号8座3层
法定代表人:尹彬彬
联系人:兰敏
联系电话:021-62828102-8102
客服电话:400-118-1188
公司网站:www.66liantai.com
(57)珠海盈米财富管理有限公司
住所:珠海市横琴新区宝华路6号
法定代表人:肖雯
联系电话:020-89629099
传真:020-89629011
客服电话:020-89629066
公司网站:www.yingmi.cn
(58)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
电话:021-20665952
客户服务热线:4008219031
公司网站:www.lufunds.com
(59)上海中正达广基金销售有限公司
住所:上海市徐汇区龙腾大道2815号3楼
法定代表人:黄欣
联系人:戴珉微
联系电话:021-33768132
客服电话:4006767523
网址: www.zhongzhengfund.com
(60)上海利得基金销售有限公司
住所:上海市宝山区蕴川路5475号1033室
法定代表人:李兴春
联系人:徐雪吟
联系电话:021-50583533-3011
客服电话:400-921-7755
网址:http://a.leadfund.com.cn/
(61)深圳富济财富管理有限公司
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: 深圳市南山区科苑南路高新南七道惠恒大厦二期418室
法定代表人:齐小贺
联系人:陈勇军
电话:0755-83999913
传真:0755-83999926
客服电话:0755-83999907
网址:www.jinqianwo.cn
(62)深圳金斧子投资咨询有限公司
注册地址:深圳市南山区粤海街道科苑路16号东方科技大厦18楼
办公地址:深圳市南山区粤海街道科苑路科兴科学园B3单元7楼
法定代表人:赖任军
联系人:张烨
电话:0755-66892301
传真:0755-66892399
客服电话:400-9500-888
网址:www.jfzinv.com
(63)北京汇成基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108
办公地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108
法定代表人:王伟刚
联系人:马怡
电话: 010-56282140
客服电话:400-619-9059
网址:www.fundzone.cn
(64)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:北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15
法定代表人:陈超
联系人:徐伯宇
电话: 010 8918 9285
传真: 010-89188000
客服电话:4000988511/ 4000888816
网址:kenterui.jd.com
(65)南京苏宁基金销售有限公司
注册地址:南京市玄武区苏宁大道1-5号
办公地址:南京市玄武区苏宁大道1-5号
法定代表人:钱燕飞
联系人:王峰
电话: 025-66996699-887226
客服电话:955177
网址:www.snjijin.com
(66)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#
法定代表人:张彦
联系人:文雯
电话:010-83363101
客服电话:400-166-1188
公司网站: 8.jrj.com.cn
(67)上海挖财金融信息服务有限公司
住所: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:李娟
电话:15002933896
客服电话:021-50810687
网址:www.wacaijijin.com
(68)江苏汇林保大基金销售有限公司
住所:江苏省南京市中山东路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:176 1215 4686
传真:021-53086809
客服电话:025-56663409
网址: www.huilinbd.com
(69)上海云湾基金销售有限公司
住所:上海市浦东新区锦康路308号世纪金融广场6号楼6楼
法定代表人:戴新装
联系人:范泽杰
客服电话:400-820-1515
公司网站:www.zhengtongfunds.com
(70)北京唐鼎耀华投资咨询有限公司
注册地址:北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路38号院1号泰康金融中心38层
法定代表人:张冠宇
联系人:刘美薇
电话:010-85870662
传真:4008875666-129666
客服电话:400-819-9868
网址: www.tdyhfund.com
(71)一路财富(北京)信息科技股份有限公司
住所:北京西城区阜成门大街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
客服电话:400-001-1566
公司网站:www.yilucaifu.com
(72)奕丰金融服务(深圳)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(入住深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址:深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室
法定代表人: TAN YIK KUAN
联系人:叶健
电话:0755-89460500
传真:0755-21674453
客服电话:400-684-0500
网址: www.ifastps.com.cn
(73)杭州科地瑞富基金销售有限公司
注册地址: 杭州市下城区武林时代商务中心1604室
办公地址: 杭州市下城区上塘路15号武林时代20楼
法定代表人:陈刚
联系人:张岩
电话:0571-86655920
传真:0571-85269200
客服电话:0571-86915761
网址:www.cd121.com
(74)北京植信基金销售有限公司
注册地址:北京市密云县兴盛南路8号院2号楼106室-67
办公地址: 北京市朝阳区惠河南路盛世龙源10号
法定代表人: 于龙
联系人:吴鹏
电话:010-56075718
传真:010-67767615
客服电话:400-6802-123
网址:www.zhixin-inv.com
(75)上海有鱼基金销售有限公司
注册地址:上海自由贸易试验区浦东大道2123号3层3E-2655室
办公地址:上海市徐汇区桂平路391号A座五层
法定代表人:林琼
联系人:徐海峥
电话:021-64389188
传真:021-64389188-102
客服电话:4007676298
网址:http://www.youyufund.com/
(76)天津万家财富资产管理有限公司
注册地址:天津自贸区(中心商务区)迎宾大道1988号滨海浙商大厦公寓2-2413室
办公地址: 北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦5层
法定代表人: 李修辞
联系人:王茜蕊
电话:15321711533
客户电话:010-59013842
网址:www.wanjiawealth.com
(77)浙江同花顺基金销售有限公司
住所:杭州市余杭区五常街道同顺路18号同花顺大楼
法定代表人:凌顺平
联系人:刘宁
电话:18668036160
客服电话:4008-773-772
公司网站:http://www.5ifund.com
(78)上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址:浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区东方路1267号11层
法定代表人:张跃伟
联系人:党敏
电话:021-2069-1935
传真:021-2069-1861
客服电话:400-820-2899
网址:www.erichfund.com
(79)大泰金石基金销售有限公司
住所: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
法定代表人:袁顾明
联系人:赵明
电话:021-2032-4155
传真:021-2032-4199
客服电话:400-928-2266
公司网站:www.dtfunds.com
(80)民商基金销售(上海)有限公司
住所:上海黄浦区北京东路666号H区东座6楼A31室
法定代表人:贲惠琴
联系人:邱爽
客服电话:021-5020-6003
公司网站: www.msftec.com
(81)永鑫保险销售服务有限公司
注册地址:上海自由贸易试验区世博馆路200号3层A区
办公地址:上海自由贸易试验区世博馆路200号3层A区
法定代表人:单开
联系人:曹楠
电话:13961025188
传真:021-51105888
客服电话:13961025188
网址:www.all-share.com.cn
(82)上海万得投资顾问有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座
法定代表人:王廷富
联系人:徐亚丹
电话: 13818306630
客服电话:400-821-0203
网址:www.520fund.com.cn
(83)北京坤元基金销售有限公司
注册地址:北京市东城区建国门内8号中粮广场B座501
办公地址:北京市东城区建国门内8号中粮广场B座501
法定代表人:李雪松
联系人:崔炜
电话:18510774953
传真:010-8526 4540
客服电话:400-818-5585
网址:http://www.kunyuanfund.com
(84)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:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
法定代表人:钟斐斐
联系人:戚晓强
电话:010-61840688
传真:010-61840699(每日划款)
客服电话:4000-618-518
网址:www.danjuanapp.com
(85)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路潘园公路1800号2号楼6153室(上海泰和经济发展区)
办公地址:上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室
法定代表人:王翔
联系人:张巍婧
电话:021-65370077-255
传真:021-55085991
客服电话:400-820-5369
网址:www.jiyufund.com.cn
(86)北京新浪仓石基金销售有限公司
注册地址: 北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期 (西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室
办公地址: 北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期 (西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室
法定代表人:李昭琛
联系人:吴翠
电话:010-62675657
传真:8610-62676582
客服电话:010-62675369
网址:www.xincai.com
(87)大河财富基金销售有限公司
注册地址:贵州省贵阳市南明区新华路110-134号富中国际广场1栋20层1.2号
办公地址:贵州省贵阳市南明区新华路110-134号富中国际广场1栋20层1.2号
法人代表:王荻
联系人:潘建
电话:0851-88405605
传真:0851-88405602
客服电话:0851-88235678
网址:www.urainf.com
(88)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:高皓辉
电话:21 6333 3389-230
传真:21 6333 3390
客服电话:4006-433-3389
网址:http://www.vstonewealth.com
(89)上海大智慧基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102、1103单元
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102、1103单元
法定代表人:申健
电话:021-20219988
传真:021-20219923
联系人:胡旦
客服电话:021-20292031
网址:https://www.wg.com.cn/
(90)晋商银行股份有限公司
注册地址:山西省太原市万柏林区长风西街1号丽华大厦
办公地址:山西省太原市万柏林区长风西街1号丽华大厦
法定代表人:阎俊生
联系人:杨瑞
电话:0351-6819579
传真:0351-6819926
客服电话:95105588
网址:www.jshbank.com

基金管理人可根据有关法律、法规的要求,选择符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

(二)基金注册登记机构
名称:长城基金管理有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层
法定代表人:王军
成立时间:2001年12月27日
电话:0755-23982338
传真:0755-23982328
联系人:张真珍
客户服务电话:400-8868-666

(三)律师事务所与经办律师
律师事务所名称:北京市中伦律师事务所
注册地址:北京市朝阳区建国门外大街甲6号SK大厦36-37层
负责人:张学兵
电话:0755-33256666
传真:0755-33206888
联系人:李伟健

(四)会计师事务所和经办注册会计师
会计师事务所名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
住所(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
执行事务合伙人:Tony Mao 毛鞍宁
电话:0755-25028023
传真:0755-25026023
联系人:昌华

四、基金的名称
本基金名称:长城转型成长灵活配置混合型证券投资基金

五、基金的类型
基金类型:混合型
基金运作方式:契约型开放式

六、基金的投资目标
本基金通过积极灵活的资产配置,充分把握我国经济转型过程中产生的投资机遇,在控制风险的前提下,力求实现超越业绩比较基准的表现。

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)、债券(含国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、中期票据、短期融资券、可转换债券、分离交易可转债纯债、资产支持证券等)、权证、货币市场工具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)。

本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的0%-95%,其中投资受益于我国经济转型、具有持续成长能力的上市公司不低于非现金基金资产的80%;本基金现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的5%,其中,现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。

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。

八、基金的投资策略
1、大类资产配置策略
本基金为灵活配置混合型证券投资基金,将依据市场情况灵活进行基金的大类资产配置。

本基金采用"自上而下"和"自下而上"相结合的方法进行大类资产配置。自上而下地综合分析宏观经济、政策环境、流动性指标等因素,在此基础上综合考虑决定股票市场、债券市场走向的关键因素,如对股票市场影响较大的市场流动性水平和市场波动水平等;对债券市场走势具有重大影响的未来利率变动趋势和债券的需求等。自下而上地根据可投资股票的基本面和构成情况,对自上而下大类资产配置进行进一步修正。在资本市场深入分析的基础上,本基金将参考基金流动性要求,以使基金资产的风险和收益在股票、债券及短期金融工具中实现最佳匹配。

2、股票投资策略
(1)转型成长的界定
本基金主要投资受益于经济转型的相关行业与上市公司,本基金定义的转型成长包括以下几个方面:

新兴产业:新兴产业是以重大技术突破和重大发展需求为基础,对经济社会全局和长远发展具有重大引领带动作用,知识技术密集、物质资源消耗少、成长潜力大、综合效益好的产业。新兴产业在经济转型过程中存在广阔的机遇,同时也将是经济继续发展的主要动力,主要包括:节能环保、信息技术、生物医药、高端装备制造、新能源、新材料等产业。

消费服务领域:在经济转型过程中,消费服务领域有较大的发展空间和投资机会,例如,医疗、金融保险、娱乐等产业的需求会大增;食品、衣着、日用品消费将呈现品牌化、集中化的趋势;服务业也将进入大发展阶段,成为经济增长的支柱。

传统行业:在经济转型过程中,总需求放缓导致传统行业竞争趋于激烈,这对传统企业竞争力提出了更高要求,迫切需要向智能、环保和高效的方向转型。目前影响传统企业的政策包括但不限于:国企改革、户籍改革、土地改革、金融改革、养老改革和创新等。一批有竞争的传统产业的企业将脱颖而出,进入又一个高成长的阶段,龙头公司、优势企业在这个过程中将持续受益。

转型成长是一个长期动态的概念,本基金将持续密切关注相关政策,加强跟踪新技术、新产品和新模式等研发应用,寻找受益于我国经济转型、具有持续成长能力的上市公司,动态调整转型成长投资主题的范畴界定。

(2)个股投资策略
本基金将依据转型成长投资主题的定义确定备选股票池,并依据定性分析和定量分析相结合的方法,进行综合评估筛选,构建本基金的各级股票池。

1)定性分析
本基金通过传统的定性分析手段,关注上市公司的主营业务可持续发展能力、竞争优势、管理能力三个方面:

主营业务可持续发展能力:主要考察上市公司在细分行业中所处的竞争地位、产品定价能力,是否具有相对成本优势、从事主营业务的历史,以及主营业务在市场不同经济周期中的发展状况。

竞争优势:主要考察上市公司在商业模式、科技创新能力、品牌、经营效率等方面是否具有竞争对手在中长期时间内难以模仿的相对优势。

管理能力:主要考察上市公司经营独立性、管理层对股东的责任感、管理层长效约束与激励机制的建立、管理层长远眼光和战略能力,以及能够对外部环境变化迅速作出反应。

通过对上市公司及其业务的分析,判断其受益于我国经济结构转型的程度、成长潜力和成长的可持续性,从中挑选出具有持续成长能力的上市公司。

2)定量分析
在定量分析中,本基金将结合PE、PB、PS、PEG等相对估值指标以及自由现金流贴现等绝对估值方法来考察企业的估值水平,以判断当前股价高估或低估。转型成长投资主题的股票因其高成长性一般估值较高,因此,本基金在关注估值指标的同时,还会关注营业收入增长率、盈利增长率、现金流量增长率、及净资产收益率等指标,来评估企业的成长性。在考察其科技创新能力可持续性方面,将重点关注研发费用与营业收入的占比,及获得财政补贴的情况。而在业务结构分布上,通过其收入的地区占比及业务占比,并结合对于不同地区不同业务的发展空间研判,来综合评估。

本基金将通过对行业估值指标的横向、纵向分析,并结合成长性的行业比较,并结合其他量化指标,综合选择估值与成长位于合理区间的转型成长投资主题的企业进行投资,动态构建资产组合。

同时,本基金在进行股票资产配置时,将考察企业的流动性和换手率指标,参考基金的流动性需求,以降低股票资产的流动性风险。

3、债券投资策略
当股票市场投资风险和不确定性增大时,本基金将择机把部分资产转换为债券资产,或通过参与一级债券市场交易获取低风险收益,以此降低基金组合资产风险水平。本投资组合对于债券的投资以久期管理策略为基础,在此基础上结合收益率曲线策略、个券选择策略、跨市场套利策略对债券资产进行动态调整,并择机把握市场低效或失效情况下的交易机会。

4、中小企业私募债券投资策略
基金投资中小企业私募债券,基金管理人将根据审慎原则,制定严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案,并经董事会批准,以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

本基金投资于单只中小企业私募债的比例不得超过本基金资产净值的10%。未来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,本基金投资不再受相关限制。

在中小企业私募债选择时,本基金将采用公司内部债券信用评级系统对信用评级进行持续跟踪,防范信用风险。在此基础上,本基金重点关注中小企业私募债的发行要素、担保机构等发行信息对债项进行增信。

本基金将根据相关法律法规要求披露中小企业私募债的投资情况。

5、权证投资策略
本基金在进行权证投资时将在严格控制风险的前提下谋取最大的收益,以不改变投资组合的风险收益特征为首要条件,运用有关数量模型进行估值和风险评估,谨慎投资。

6、资产支持证券投资策略
对于资产支持证券,本基金将综合考虑市场利率、发行条款、标的资产的构成、质量及提前偿还率等因素,研究资产支持证券的收益和风险匹配情况,在严格控制风险的基础上选择投资对象,追求稳定收益。

九、基金的业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为:50%×中证800指数收益率+50%×中债综合财富指数收益率。

本基金是灵活配置混合型基金,主要投资受益于我国经济转型、具有持续成长能力的上市公司。中证800指数收益率对转型成长类行业股票具有较强的代表性, 适合作为本基金股票部分的业绩比较基准。本基金固定收益部分的业绩比较基准采用了中债综合财富指数。该指数由中央国债登记结算有限责任公司编制和维护,综合反映了债券市场整体价格和回报情况,是目前市场上较为权威的反映债券市场整体走势的基准指数之一。

本基金是灵活配置混合型证券投资基金,股票投资范围为0-95%。本基金对中证800指数和中债综合财富指数分别赋予50%和50%的权重符合本基金的投资特性。

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时,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。本基金由于上述原因变更业绩比较基准,不需召开基金持有人大会通过。

十、基金的风险收益特征
本基金的长期平均风险和预期收益率低于股票型基金,高于债券型基金、货币市场基金,属于中等风险、中等收益的基金产品。

十一、投资组合报告
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。

本基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年5月14日复核了本基金招募说明书更新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。

本投资组合报告数据截至2019年3月31日止,本报告中财务资料未经审计。

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	39,953,065.71	45.62
	其中:股票	39,953,065.71	45.62
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	47,564,067.20	54.31
8	其他资产	54,683.85	0.06
9	合计	87,571,816.76	100.00

2、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	1,218,000.00	1.46
B	采矿业	-	-
C	制造业	16,412,604.71	19.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	837,100.00	1.00
E	建筑业	3,970,900.00	4.77
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	932,250.00	1.12
H	住宿和餐饮业	1,208,900.00	1.45
I	信息传输、软件和信息技术服务业	776,731.00	0.93
J	金融业	7,189,080.00	8.63
K	房地产业	7,407,500.00	8.89
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	39,953,065.71	47.95

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	601155	新城控股	60,000	2,709,000.00	3.25
2	000401	冀东水泥	110,000	1,934,900.00	2.32
3	600325	华发股份	200,000	1,856,000.00	2.23
4	601318	中国平安	21,000	1,619,100.00	1.94
5	601186	中国铁建	140,000	1,611,400.00	1.93
6	600383	金地集团	110,000	1,512,500.00	1.82
7	000876	新希望	110,000	1,463,000.00	1.76
8	600036	招商银行	40,000	1,356,800.00	1.63
9	000961	中南建设	140,000	1,330,000.00	1.60
10	000001	平安银行	100,000	1,282,000.00	1.54

4、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。
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
注: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持有股指期货。
9.2本基金投资股指期货的投资政策
本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等,暂不参与股指期货交易。
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
本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等,暂不参与国债期货交易。
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进行国债期货投资,期末未持有国债期货。
10.3本期国债期货投资评价
本基金本报告期内未投资国债期货。
11、投资组合报告附注
11.1
本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到过公开谴责、处罚。
11.2基金投资的前十名股票中,未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。
11.3其他资产的构成:

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	44,163.20
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	10,510.66
5	应收申购款	9.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	54,683.85

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的情况。
11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十二、基金的业绩
过往一定阶段本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较(截至2019年3月31日)

时间段	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
基金合同生效日(2017年4月26日)至2017年12月31日	7.40%	0.35%	6.80%	0.34%	0.60%	0.01%
2018年1月1日至2018年12月31日	-14.25%	0.75%	-10.84%	0.67%	-3.41%	0.08%
2019年1月1日至2019年3月31日	9.55%	0.77%	14.76%	0.77%	-5.21%	0.00%
基金合同生效日(2017年4月26日)至2019年3月31日	0.90%	0.64%	9.28%	0.59%	-8.38%	0.05%

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。

十三、基金费用概览
(一)与基金运作相关的费用
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)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×1.5%÷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,逐日累计至每个月月末,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起2-5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。
(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%年费率计提。托管费的计算方法如下:
H=E×0.25%÷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,逐日累计至每个月月末,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起2-5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。
上述"一、基金费用的种类中第3-7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。
(二)与基金销售有关的费用
1、申购费用
本基金在申购时收取申购费用,投资者可以多次申购本基金,申购费率按每笔申购申请单独计算。
本基金对通过直销柜台申购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。具体如下:
(1)申购费率

申购金额(含申购费)	申购费率
100万元以下	1.5%
100万元(含)-300万元	1.0%
300万元(含)-500万元	0.5%
500万元以上(含)	每笔1000元

注:上述申购费率适用于除通过本公司直销柜台申购的养老金客户以外的其他投资者。
(2)特定申购费率

申购金额(含申购费)	申购费率
100万元以下	0.3%
100万元(含)-300万元	0.2%
300万元(含)-500万元	0.1%
500万元以上(含)	每笔1000元

注:上述特定申购费率适用于通过本公司直销柜台申购本基金份额的养老金客户,包括基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金等,具体包括:全国社会保障基金;可以投资基金的地方社会保障基金;企业年金单一计划以及集合计划;企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划;企业年金养老金产品。
如未来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型,本公司在法律法规允许的前提下可将其纳入养老金客户范围。
本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中,
净申购金额=申购金额/(1+申购费率),对于500万元(含)以上的申购,净申购金额=申购金额-固定申购费金额
申购费用=申购金额-净申购金额
申购份数=净申购金额/T日基金份额净值
例:某投资者投资100,000元申购本基金,对应的申购费率为1.5%,若申购当日基金份额净值为1.0500元,则其可得到的基金份额计算如下:
净申购金额=100,000/(1+1.5%)=98,522.17元
申购费用=100,000-98,522.17=1,477.83元
申购份数=98,522.17/1.0500=93,830.64份
2、赎回费用
本基金的赎回费用按持有时间的增加而递减,费率如下:

持续持有期(天)	赎回费率
1-6	1.5%
7-29	0.75%
30-184	0.5%
185-365	0.25%
366及以上	0

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持续持有期少于30天的基金份额所收取的赎回费全额计入基金财产;对持续持有期长于30天(含)但少于92天的基金份额所收取的赎回费的75%计入基金财产,其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费;对持续持有期长于92天(含)但少于185天的基金份额所收取的赎回费的50%计入基金财产,其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费;对持续持有期长于185天(含)的份额所收取的赎回费的25%计入基金财产,其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。
本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中,
赎回总金额=赎回份数×赎回当日基金份额净值
赎回手续费=赎回总金额×赎回费率
净赎回金额=赎回总金额-赎回手续费
例:某投资者赎回其持有的本基金50,000份,持有期为85天,对应的赎回费率为0.5%,若赎回当日基金份额净值为1.1500元,则其得到的赎回金额计算如下:
赎回总金额=50,000×1.1500=57,500元
赎回手续费=57,500×0.5%=287.50元
净赎回金额=57,500-287.50=57,212.50元
3、转换费用
(1)基金转换费用由转出基金的赎回费和转出与转入基金的申购费补差二部分构成,具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率差异情况和赎回费率而定。基金转换费用由基金份额持有人承担。
转入份额保留到小数点后两位,剩余部分舍去,舍去部分所代表的资产归转入基金财产所有。
① 如转入基金的申购费率)转出基金的申购费率
转出金额=转出基金份额×转出基金当日基金份额净值
转出基金赎回费=转出金额×转出基金赎回费率
转入总金额=转出金额-转出基金赎回费
转入基金申购费补差费率=转入基金适用申购费率-转出基金适用申购费率
转入基金申购费补差=转入总金额-转入总金额/(1+转入基金申购费补差费率)
转入净金额=转入总金额-转入基金申购费补差
转入份额=转入净金额/转入基金当日基金份额净值
基金转换费=转出基金赎回费+转入基金申购费补差
例:某基金份额持有人(非养老金客户)将持有的长城货币市场证券投资基金10万份基金份额转换为本基金,假设转换当日转入基金(本基金)份额净值是1.1500元,转出基金(长城货币市场证券投资基金)对应赎回费率为0,申购补差费率为1.5%,则可得到的转换份额及基金转换费为:
转出金额=100,000×1=100,000 元
转出基金赎回费=0
转入总金额=100,000-0=100,000元
转入基金申购费补差=100,000-100,000/(1+1.5%)=1,477.83元
转入净金额=100,000-1,477.83=98,522.17元
转入份额=98,522.17/1.15=85,671.45份
基金转换费=0+1,477.83=1,477.83元
② 如转出基金的申购费率≥转入基金的申购费率
基金转换费用=转出金额×转出基金赎回费率
例:某投资者持有本基金10万份基金份额,持有期为100天,决定转换为长城货币市场证券投资基金,假设转换当日转出基金(本基金)份额净值是1.2500元,转出基金对应赎回费率为0.5%,申购补差费率为0,则可得到的转换份额及基金转换费为:
转出金额=100,000×1.25=125,000元
转出基金赎回费=125,000×0.5%=625元
转入总金额=125,000-625=124,375元
转入基金申购费补差=0
转入净金额=124,375-0=124,375元
转入份额=124,375/1=124,375份
基金转换费=125,000×0.5%=625元
(2)对于实行级差申购费率(不同申购金额对应不同申购费率的基金),以转入总金额对应的转出基金申购费率、转入基金申购费率计算申购补差费用;如转入总金额对应转出基金申购费或转入基金申购费为固定费用时,申购补差费用视为0。
(3)转出基金赎回费计入转出基金基金资产的标准参照相关基金基金合同、招募说明书。
(4)计算基金转换费用所涉及的申购费率和赎回费率均按基金合同、更新的招募说明书规定费率执行,对于通过本公司网上交易、费率优惠活动期间发生的基金转换业务,按照本公司最新公告的相关费率计算基金转换费用。
4、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式,基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前3个工作日在至少一种指定媒体公告。
5、基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,按相关监管部门要求履行相关手续后基金管理人可以适当调低基金申购费率。
(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
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。

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》等法律法规及《长城转型成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的要求,并结合本基金管理人对基金实施的投资管理活动,对2018年12月8日刊登的本基金的招募说明书进行了更新,更新的主要内容如下:
1、在"重要提示"中,调整了风险提示的相关内容;更新了招募说明书所载内容截止日期与有关财务数据、净值表现截止日期。
2、在第三部分"基金管理人"中,更新了基金管理人情况及主要人员情况。
3、在第四部分"基金托管人"中,更新了基金托管人的信息。
4、在第五部分"相关服务机构"中,更新了代销机构的信息。
5、在第七部分"基金份额的申购与赎回"中,更新了基金的转换、定期定额投资计划的内容。
6、在第八部分"基金的投资管理"中,更新了投资组合报告内容,披露截至2019年3月31日的数据。
7、在第九部分"基金的业绩"中,披露了截至2019年3月31日本基金的业绩数据。
8、在第二十一部分"其他应披露的事项"中,披露了本期已刊登的公告事项。

长城基金管理有限公司
2019年6月6日