(上接79版)

第十二部分基金的投资

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(包括主板、中小板、创业板及其他中国证监会批准上市的股票)、债券、资产支持证券、货币市场工具、衍生工具(权证、股指期货等)以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具(但需符合中国证监会的相关规定)。

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,投资于本基金合同界定的高新技术产业股票资产占非现金基金资产的比例不低于80%;投资于债券、银行存款、货币市场工具、现金、权证、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证券品种占基金资产的比例为5%-20%。

(2)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的5%的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或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)本基金管理人管理的全部开放式基金包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金持有一家上市公司发行的可流通股票,不超过该上市公司可流通股票的15%;本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不超过该上市公司可流通股票的30%;

(6)本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的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该条款规定的,基金管理人将在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。

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,基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金管理人对基金的投资组合与组合限制也应当进行监控,并在基金合同生效之日起开始。

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:

(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;

(7)法律、行政法规和国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

五、业绩比较基准

中证700指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%

本基金择中证700指数和中证综合债指数分别做为基金股票资产和债券、货币市场工具等其他资产的业绩比较基准。本基金的效产主要投资于高新技术产业股票,此类股票以中小市值为主,中证700指数能够反映沪深市场中小市值公司的整体表现。中证综合债指数的选择债券的信用类别覆盖全面,期限构成宽泛。选用上述业绩比较基准能够忠实反映本基金的风险收益特征。

如果今后法律法规发生变化,或证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时,本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则,根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整,调整业绩比较基准应经基金托管人同意,并报中国证监会备案。基金管理人应在调整前2个工作日在至少一种指定媒介上予以公告。

六、风险收益特征

本基金是股票型基金,其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金与混合型基金。本基金主要投资于高新技术产业股票,其风险高于全市场范围内投资的股票型基金。

七、基金管理人代表基金行使股投资决策权的原则及方法

基金管理人将按照国家有关规定代表基金独立行使股东或债权人权利,保护基金份额持有人的利益:

1.基金管理人应当在基金份额发售的当日披露基金份额发售公告,并在披露招募说明书的当日登载于指定媒介上。

(三)《基金合同》生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定媒介上登载《基金合同》生效公告。

(四)基金净值信息

《基金合同》生效后,在开始办理基金份额申购或者赎回前,基金管理人应当至少每周在指定网站按第一次各类基金份额净值和基金份额累计净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后,基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日,通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点按第开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日,在指定网站披露半年度和年度最后一日的基金份额净值和基金份额累计净值。

(六)基金定期报告,包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内,编制完成基金年度报告,将年度报告登载在规定网站上,并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内,编制完成基金中期报告,将中期报告登载在指定网站上,并将中期报告提示性公告登载在规定报刊上。

基金管理人应当在季度结束之日起15个工作日内,编制完成基金季度报告,将季度报告登载在规定网站上,并将季度报告提示性公告登载在规定报刊上。

如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额20%的情形,为保障其他投资者的权益,基金管理人至少应当在定期报告"影响投资者决策的其他重要信息"项下披露该投资者的类别,报告期末持有份额及占比,报告期内持有份额变化情况及基金的特有风险,中国证监会认定的特殊情形除外。

(七)临时报告

本基金发生重大事件,有关信息披露义务人应当在2日内编制临时报告书,并登载在指定报刊和指定网站上。

前款所称重大事件,是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件:

2.基金合同生效以来,连续二个工作日所发生的基金份额申购、赎回的合计数量,或者上一个工作日所发生的基金份额申购、赎回的数量达到当时基金份额总数的10%;

3.基金份额持有人大会决议;

4.基金管理人的董事会、董事发生变动;

5.基金管理人或基金托管人的法定代表人、负责人发生变动;

6.基金管理人或基金托管人的主要业务部门负责人发生变动;

7.基金管理人或基金托管人的高级管理人员一名以上(含本数)发生变动;

8.基金管理人或基金托管人的股东、实际控制人发生变动,或者其所持有的基金管理人或基金托管人股份达到或超过其各自资产的5%以上(含本数)的股东,其所持有的基金管理人或基金托管人股份发生变动的,应当不少于5个工作日内通知基金管理人或基金托管人,基金管理人或基金托管人应当在2个工作日内通知基金份额持有人;

9.基金管理人或基金托管人的分支机构发生重大变动;

10.基金管理人或基金托管人的重大诉讼事项;

11.基金管理人或基金托管人的重大违法违规事项;

12.基金管理人或基金托管人的重大关联交易事项;

13.基金管理人或基金托管人的重大财务状况;

14.基金管理人或基金托管人的重大人事变动;

15.基金管理人或基金托管人的重大业务变动;

16.基金管理人或基金托管人的重大合规风险事件;

17.基金管理人或基金托管人的重大内部风险事件;

18.基金管理人或基金托管人的重大信息技术系统风险事件;

19.基金管理人或基金托管人的重大舆情事件;

20.基金管理人或基金托管人的重大投资风险事件;

21.基金管理人或基金托管人的重大操作风险事件;

22.基金管理人或基金托管人的重大流动性风险事件;

23.基金管理人或基金托管人的重大市场风险事件;

24.基金管理人或基金托管人的重大信用风险事件;

25.基金管理人或基金托管人的重大内控风险事件;

26.基金管理人或基金托管人的重大外部风险事件;

27.基金管理人或基金托管人的重大其他风险事件;

28.基金管理人或基金托管人的重大其他事件;

29.基金管理人或基金托管人的重大其他事件;

30.基金管理人或基金托管人的重大其他事件;

31.基金管理人或基金托管人的重大其他事件;

32.基金管理人或基金托管人的重大其他事件;

33.基金管理人或基金托管人的重大其他事件;

34.基金管理人或基金托管人的重大其他事件;

35.基金管理人或基金托管人的重大其他事件;

36.基金管理人或基金托管人的重大其他事件;

37.基金管理人或基金托管人的重大其他事件;

38.基金管理人或基金托管人的重大其他事件;

39.基金管理人或基金托管人的重大其他事件;

40.基金管理人或基金托管人的重大其他事件;

41.基金管理人或基金托管人的重大其他事件;

42.基金管理人或基金托管人的重大其他事件;

43.基金管理人或基金托管人的重大其他事件;

44.基金管理人或基金托管人的重大其他事件;

45.基金管理人或基金托管人的重大其他事件;

46.基金管理人或基金托管人的重大其他事件;

47.基金管理人或基金托管人的重大其他事件;

48.基金管理人或基金托管人的重大其他事件;

49.基金管理人或基金托管人的重大其他事件;

50.基金管理人或基金托管人的重大其他事件;

51.基金管理人或基金托管人的重大其他事件;

52.基金管理人或基金托管人的重大其他事件;

53.基金管理人或基金托管人的重大其他事件;

54.基金管理人或基金托管人的重大其他事件;

55.基金管理人或基金托管人的重大其他事件;

56.基金管理人或基金托管人的重大其他事件;

57.基金管理人或基金托管人的重大其他事件;

58.基金管理人或基金托管人的重大其他事件;

59.基金管理人或基金托管人的重大其他事件;

60.基金管理人或基金托管人的重大其他事件;

61.基金管理人或基金托管人的重大其他事件;

62.基金管理人或基金托管人的重大其他事件;

63.基金管理人或基金托管人的重大其他事件;

64.基金管理人或基金托管人的重大其他事件;

65.基金管理人或基金托管人的重大其他事件;

66.基金管理人或基金托管人的重大其他事件;

67.基金管理人或基金托管人的重大其他事件;