# 鹏华盛世创新股票型证券投资基金(LOF)招募说明书

(上接C9版)

**五、相关服务机构**

(一)基金份额发售机构

1、场外发售机构

(1)直销机构:

1)鹏华基金管理有限公司

住所:深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心43层

法定代表人:孙枫

办公地址:深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心43层

电话:(0755)82021233

传真:(0755)82021155

联系人:徐丽萍

网址:www.phfund.com.cn

2)鹏华基金管理有限公司北京分公司

办公地址:北京市海淀区三里河路13号中国建筑文化中心北塔楼10层

电话:(010)88082426

传真:(010)88082018

联系人:赵晓蔚

3)鹏华基金管理有限公司上海分公司

办公地址:上海市浦东陆家嘴环路958号华能联和大厦3011室

电话:(021)58825962

传真:(021)68866470

联系人:李化怡

(2)代销机构:

1)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:郭树清

客户服务电话:95533

传真:010-67598409

联系人:王琳

客户服务热线:95533

网站:www.ccb.cn

2)其他代销机构:具体名单详见本基金份额发售公告。

基金管理人可根据有关法律法规要求,根据实情,选择其他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。

2、场内发售机构:具有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位(具体名单见基金份额发售公告)。

(二)注册登记机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司

住所:北京西城区金融大街27号投资广场23层

法定代表人:陈耀先

办公地址:北京西城区金融大街27号投资广场23层

联系电话:0755-25938095

传真:0755-25987538

联系人:任瑞新

(三)律师事务所

名称:北京市德恒律师事务所

住所:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座十二层

负责人:王丽

办公地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座十二层

联系电话:010-65232180 65269781

传真:010-65232181

联系人:徐芳

经办律师:陈静茹、苏文静

(四)会计师事务所

名称:安永华明会计师事务所

住所:北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼(即东三办公楼)16层

法定代表人:葛明

办公地址:北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼(即东三办公楼)16层

电话:010-58153000

传真:010-85188298

联系人:徐佩施

经办注册会计师:张小东、樊淑华

**六、基金的募集**

本基金由基金管理人依照《基金法》和其他有关法律法规,以及基金合同的规定,经中国证监会2008年6月24日证监许可[2008]838号文核准募集。除法律、行政法规或中国证监会另有规定外,任何与基金份额发售有关的当事人不得预留或提前发售基金份额。

具体发售方案以本基金的基金份额发售公告为准,请投资者就发售和购买事宜仔细阅读本基金的基金份额发售公告。

(一)基金运作方式和类型

上市契约型开放式,股票型基金

(二)基金的存续期间

不定期

(三)募集方式

投资者可通过场内认购和场外认购两种方式认购本基金。

通过场内认购的基金份额登记在证券登记结算系统持有人证券账户下;通过场外认购的基金份额登记在注册登记系统持有人开放式基金账户下。

登记在证券登记结算系统中的基金份额既可以在深圳证券交易所上市交易,也可以直接申请场内赎回;登记在注册登记系统中的基金份额可申请场外赎回。投资者也可通过办理跨系统转登记业务实现基金份额在两个登记系统之间的转登记。

(四)募集期限

本基金的设立募集期限自基金份额发售之日起不超过3个月。(具体募集时间详见基金份额发售公告及销售机构相关公告)

(五)募集对象

中华人民共和国境内的个人投资者和机构投资者(法律法规及其他有关规定禁止投资证券投资基金者除外)、合格境外机构投资者,以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

(六)基金份额的场外认购

本节内容仅适用于基金份额的场外认购,通过此种方式认购后基金份额登记在注册登记系统中。

1、募集场所

本基金的场外认购通过基金场外销售机构各网点(包括基金管理人的直销中心及代销机构的代销网点,具体名单见本基金基金份额发售公告)进行。

销售机构办理本基金场外认购业务的城市(网点)的具体情况和联系方法,请参见本基金的基金份额发售公告。

2、基金份额的面值、认购费用、认购价格及计算公式

(1)基金份额发售面值:本基金份额发售面值为1.00元人民币。

(2)认购费率

本基金场外认购费率如下表:

| 认购金额M(元) | 认购费率 |
|---|---|
| M<50万 | 1.2% |
| 50万≤M<250万 | 1.0% |
| 250万≤M<500万 | 0.6% |
| M≥500万 | 每笔1000元 |

本基金的认购费用应在投资人认购基金份额时收取,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

(3)场外认购份额的计算

净认购金额=认购金额/(1+认购费率)

认购费用=认购金额-净认购金额

认购份额=(净认购金额+认购金额利息)/基金份额面值

认购份额计算结果保留到小数点后两位,小数点后两位以后部分四舍五入,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。认购资金募集期间的利息,在基金合同生效后折算成基金份额,归投资人所有。利息折算的份额保留到小数点后两位,小数点后两位以后部分四舍五入,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例如:某投资者认购本基金10,000元,所对应的认购费率为1.2%。假定该笔认购金额产生利息5.20元。则认购份额为:

净认购金额=认购金额/(1+认购费率)=10,000/(1+1.2%)=9,881.42元

认购费用=认购金额-净认购金额=10,000-9,881.42=118.58元

认购份额=(净认购金额+认购金额利息)/基金份额面值=(9,881.42+5.20)/1.00=9,886.62份

即:投资者投资10,000元认购本基金份额,在基金合同生效时,投资者账户登记有本基金9,886.62份。

3、投资人对基金份额的场外认购

(1)认购时间安排

投资者可在募集期内前往本基金销售机构的网点办理基金份额认购手续,具体的业务办理时间详见本基金的基金份额发售公告或各代销机构相关业务办理规则。

(2)投资者认购应提交的文件和办理的手续

投资者认购本基金所应提交的文件和具体办理手续详见本基金的基金份额发售公告或各代销机构相关业务办理规则。

(3)认购的方式及确认

1)投资者认购时,需按销售机构规定的方式备足认购的金额。

2)基金募集期内,投资者可多次认购基金份额,但已申请的认购不允许撤销。

3)投资者在T日规定时间内提交的认购申请,通常应在T+2日到原认购网点查询认购申请的受理情况。

4)销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以基金合同生效后注册登记机构的确认结果为准。

(4)认购的限额

本基金代销网点每个基金账户单笔最低认购金额为1,000元。直销中心的首次最低认购金额为50万元,追加认购单笔最低认购金额为1万元,不设级差限制(通过本基金管理人基金网上交易系统认购本基金暂不受此限制)。本基金募集期间对单个基金份额持有人最高累计认购份额不设限制。

4、认购期利息的处理方式

若本基金的基金合同生效,则认购款项在基金合同生效前产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有,其中利息及利息折算的基金份额以注册登记机构的记录为准。利息折算的份额保留到小数点后两位,小数点后两位以后部分四舍五入,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

(七)基金分额的场内认购

本节内容仅适用于基金份额的场内认购,通过此种方式认购后基金份额登记在证券登记结算系统中。

1、募集场所

本基金通过深圳证券交易所(以下简称“深交所”)上网定价发售,销售渠道为具有基金代销资格的深交所场内会员单位(具体名单见基金份额发售公告)。

本基金募集期结束前获得基金代销资格的证券公司也可代理场内基金份额的发售。尚未取得基金代销资格,但属于深交所会员的其他机构,可在本基金上市后,代理投资者通过深交所开放式基金交易系统参与本基金的买卖。

2、基金份额的面值、认购费用、认购价格及计算公式

(1)本基金份额的发售面值为人民币1.00元,挂牌价格为基金面值。投资者认购采用全额缴款的认购方式。

(2)投资者场内认购需缴纳认购费用。本基金的认购费用应在投资人认购基金份额时收取,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

(3)场内销售机构应按照本基金招募说明书约定的场外认购费率设定场内发售费率。

(4)场内认购金额和利息折算的份额的计算

本基金场内认购采用份额认购的方式。认购金额和利息折算的份额的计算如下:

认购金额=挂牌价格×(1+发售费率)×认购份额

发售费用=挂牌价格×认购份额×发售费率

净认购金额=挂牌价格×认购份额

利息折算的份额=利息/挂牌价格

认购金额计算结果保留到小数点后两位,小数点后两位以后部分四舍五入。认购资金募集期间的利息,在基金合同生效后折算成基金份额,归投资人所有。利息折算的份额保留至整数位(最小单位为1份),余额计入基金财产。

例如:某投资者认购本基金10,000份,若会员单位设定发售费率为1.2%,假定该笔认购产生利息5.20元。则认购金额和利息折算的份额为:

挂牌价格=1.00元

认购金额=1.00×10,000×(1+1.2%)=10,120元

利息折算的份额=5.20/1.00=5份

即:投资者认购10,000份基金份额,需缴纳10,120元,若利息折算的份额为5份,则总共可得到10,005份基金份额。

3、投资人对基金份额的场内认购

(1)认购时间安排

投资者可在募集期内前往具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位(具体名单见基金份额发售公告)办理基金份额的场内认购手续,具体的业务办理时间详见本基金的基金份额发售公告或各代销机构相关业务办理规则。

(2)投资者认购应提交的文件和办理的手续

投资者认购本基金所应提交的文件和具体办理手续详见本基金的基金份额发售公告或各代销机构相关业务办理规则。

(3)认购的方式及确认

1)本基金场内认购采用份额认购的方式。投资者认购前,需按办理场内认购业务相关机构规定的方式备足认购的金额。

2)基金募集期内,投资者可多次认购基金份额,但已申请的认购不允许撤销。

3)投资者在T日规定时间内提交的认购申请,通常应在T+2日到原认购网点查询认购申请的受理情况。

4)办理场内认购业务的机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以基金合同生效后注册登记机构的确认结果为准。

(4)认购的限额

场内认购单笔最低认购份额为1000份,超过1000份的须为1000份的整数倍,且每笔认购最大不超过99,999,000份基金份额。本基金募集期间对单个基金份额持有人最高累计认购份额不设限制。

4、认购期利息的处理方式

认购资金在募集期形成的利息在本基金合同生效后折成投资人认购的基金份额,归投资人所有。利息及利息转份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。利息及利息折算的份额保留至整数位(最小单位为1份),余额计入基金资产。

(八)募集资金的存放

本基金募集期间募集的资金存入专门账户,在基金募集行为结束前,任何人不得动用。

**七、基金合同的生效**

(一)基金备案的条件

1、本基金自基金份额发售之日起3个月内,在基金募集份额总额不少于2亿份,基金募集金额不少于2亿元人民币,并且基金份额持有人的人数不少于200人的条件下,基金管理人在募集期届满并达到基金合同的备案条件,应当自基金募集结束之日起10日内聘请法定验资机构验资,自收到验资报告之日起10日内,向中国证监会提交验资报告,办理基金备案手续。自中国证监会确认之日起,基金备案手续办理完毕,基金合同生效。

2、基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。

3、本基金合同生效前,投资人的认购款项只能存入专用账户,任何人不得动用。认购资金在募集期形成的利息在本基金合同生效后折成投资人认购的基金份额,归投资人所有。利息转份额的具体数额以登记结算机构的记录为准。

(二)基金募集失败

1、基金募集期届满,未达到基金合同的生效条件,或基金募集期内发生不可抗力使基金合同无法生效,则基金募集失败。

2、如基金募集失败,基金管理人应以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用,在基金募集期限届满后30日内返还投资人已缴纳的认购款项,并加计银行同期存款利息。

(三)基金存续期内的基金份额持有人数量和资金数额

基金合同生效后的存续期内,基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元,基金管理人应当及时报告中国证监会;基金份额持有人数量连续20个工作日达不到200人,或连续20个工作日基金资产净值低于5000万元,基金管理人应当向中国证监会说明出现上述情况的原因并提出解决方案。

**八、基金份额的上市交易**

基金合同生效后,基金管理人可以根据有关规定,申请本基金的基金份额上市交易。基金上市后,登记在证券登记结算系统中的基金份额可直接在深圳证券交易所上市交易;登记在注册登记系统中的基金份额可通过办理跨系统转登记业务将基金份额转登记在证券登记结算系统中,再上市交易。

(一)上市交易的地点

深圳证券交易所。

(二)上市交易的时间

本基金合同生效后三个月内开始在深圳证券交易所上市交易。

在确定上市交易的时间后,基金管理人最迟在上市前3个工作日在至少一种指定报刊和网站上刊登公告。

(三)上市交易的规则

1、本基金上市首日的开盘参考价为前一交易日基金份额净值;

2、本基金实行价格涨跌幅限制,涨跌幅比例为10%,自上市首日起实行;

3、本基金买入申报数量为100份或其整数倍;

4、本基金申报价格最小变动单位为0.001元人民币;

5、本基金上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》及相关规定。

(四)上市交易的费用

本基金上市交易的费用比照封闭式基金的有关规定办理。

(五)上市交易的行情揭示

本基金在深圳证券交易所挂牌交易,交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示基金前一交易日的基金份额净值。

(六)上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市

本基金的停复牌、暂停上市、恢复上市按照深圳证券交易所的相关规定执行。

(七)终止上市的情形和处理方式

发生下列情况之一时,本基金应终止上市交易:

(1)自暂停上市之日起半年内未能消除暂停上市原因的;

(2)基金合同终止;

(3)基金份额持有人大会决定终止上市;

(4)深圳证券交易所认为须终止上市的其他情况。

发生上述终止上市情形时,由证券交易所终止其上市交易,基金管理人报经中国证监会备案后终止本基金的上市,并在至少一种指定报刊和网站上刊登终止上市公告。

(八)相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的,本基金基金合同相应予以修改,且此项修改无须召开基金份额持有人大会,并在本基金更新的招募说明书中列示。

**九、基金份额的场外申购、转换与赎回**

本章内容仅适用于本基金的场外申购、转换和赎回业务。登记在注册登记系统中的基金份额可直接办理场外申购、转换与赎回等场外基金业务;登记在证券登记结算系统中的基金份额可通过办理跨系统转登记业务将基金份额转登记到注册登记系统中,再办理场外申购、转换与赎回等场外基金业务。

(一)场外申购、转换和赎回业务办理的场所

1、本基金管理人设在深圳、北京和上海的直销中心;

2、中国建设银行的指定网点以及基金管理人指定的其他代销机构营业网点;

3、本基金管理人的基金网上交易系统(具体业务规则与说明参见相关公告)。

具体销售网点由基金管理人在本招募说明书或基金份额发售公告等公告中列明。基金管理人可根据情况变更增减基金销售机构或办理本基金申购、转换与赎回的场所,并予以公告。

(二)场外申购、转换和赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

投资人可在开放日办理基金份额的场外申购、转换和赎回,具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间。基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定公告暂停申购、转换或赎回时除外。

基金管理人不在开放日之外的日期或者时间办理基金份额的申购、转换或赎回,投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、转换或者赎回申请的,其基金份额申购、转换或赎回价格为下次办理基金份额申购、转换或赎回时间所在开放日的价格。

基金合同生效后,若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况,基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整,但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒体上公告。

2、申购的开始时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过90天开始办理申购,具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

3、转换的开始时间

基金管理人可以开放本基金与本基金管理人管理的其他开放式基金之间的转换业务。具体转换业务开始时间由基金管理人根据相关法律法规及本基金基金合同的约定提前三日予以公告,并及时告知基金托管人与相关基金代销机构。

4、赎回的开始时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过90天开始办理赎回,具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

5、在确定申购开始与赎回开始时间后,由基金管理人最迟于开始日前3个工作日在指定媒体上公告。

6、基金管理人不在开放日之外的日期或者时间办理基金份额的场内申购、赎回或者转换。投资人在上述公告约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的,其基金份额申购、赎回或转换价格为下一开放日基金份额申购、赎回或转换的价格。

7、基金管理人如果对申购、转换或赎回时间进行调整,应报中国证监会备案,在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒体上公告。

(三)场外申购限制

1、本基金对单个基金份额持有人不设置最高申购金额限制。

2、投资者通过代销机构场外申购本基金,单笔最低申购金额为1,000元。通过我公司直销中心场外申购本基金,首次最低金额为50万元,追加申购单笔最低金额为1万元(通过本基金管理人基金网上交易系统申购本基金暂不受此限制)。

3、转换的最低份额为200份基金份额,基金份额持有人可将其全部或部分基金份额转换。

4、场外账户最低余额为30份基金份额,若某笔转换或赎回将导致投资者在销售机构托管的单只基金份额余额不足30份时,该笔转换或赎回业务应包括账户内全部基金份额,否则,剩余部分的基金份额将被强制赎回。

5、基金管理人可根据市场情况,调整场外申购、转换、赎回份额的数量限制及相关业务规则,应报中国证监会备案,并在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒体上公告。

(四)场外申购、转换和赎回的原则

1、本基金采用“未知价”原则,即申购、转换和赎回价格以受理申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算;

2、“金额申购、份额赎回”原则,即基金份额的申购以金额申报,申报单位为一元人民币;赎回以份额申报,申报单位为一份基金份额;

3、当日的申购与赎回申请可以在当日交易结束时间前撤销,在当日的交易时间结束后不得撤销。

(六)场内申购和赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

基金投资者需遵循深交所场内申购赎回相关业务规则,在开放日的业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资者在申购本基金时须按业务办理单位规定的方式备足申购资金。

投资者在提交赎回申请时,应确保账户内有足够基金份额余额,否则赎回申请无效。

2、申购和赎回申请的确认

基金注册登记机构以交易时间结束前收到申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日),并在T+1日内对该交易的有效性进行确认。通常情况下,T日提交的有效申请,投资人应在T+2日到场内申购、赎回业务办理单位或以其规定的其他方式查询申购、赎回申请的确认情况。

3、申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式,若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效,申购款项本金将退回投资者账户,由此产生的利息等损失由投资者自行承担。

投资者赎回申请成功后,基金托管人按有关规定将在T+7日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回的情况下,当日未获受理的场内赎回将自动撤销。

(七)场内申购和赎回的数额限制

1、投资者通过代销机构场内申购本基金,单笔最低申购金额为1,000元。

2、基金管理人、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司可根据市场情况,在不违反相关法律法规规定的前提下,调整上述限制。基金管理人要求予以调整的,必须在调整前3个工作日至少在一种中国证监会指定的媒体上刊登公告并报中国证监会备案。

3、申购份额、余额的处理方式:申购的基金份额份数保留到整数位,小数点后部分将以现金形式直接退还给投资人。

4、赎回金额的处理方式:本基金的赎回金额由赎回份额乘以赎回申请当日的基金份额净值扣除赎回费用后确定。赎回金额计量单位为人民币元,赎回金额保留到小数点后两位,小数点后两位以后的部分四舍五入,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

(八)场内申购份额和赎回金额的计算方式

1、基金申购份额的计算

净申购金额=申购金额/(1+申购费率)

申购手续费=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/T日基金份额净值

场内申购份额保留到整数位,计算所得整数位后小数部分的份额对应的资金返还至投资者资金账户。

例1:某投资者通过场内投资10,000元申购本基金,对应的申购费率为1.5%,假设申购当日基金份额净值为1.025元,则其申购手续费、可得到的申购份额及返还的资金余额为:

净申购金额=10,000/(1+1.5%)=9,852.22元

申购手续费=10,000-9,852.22=147.78元

申购份额=9,852.22/1.025=9,611.92份

因场内申购份额保留至整数份,故投资者申购所得份额为9,611份,整数位后小数部分的申购份额对应的资金返还给投资者。具体计算公式为:

实际净申购金额=9,611×1.025=9,851.28元

退款金额=10,000-9,851.28-147.78=0.94元

即:投资者投资10,000元从场内申购本基金,假设申购当日基金份额净值为1.025元,则其可得到基金份额9,611份,退款0.94元。

2、基金赎回金额的计算

赎回总金额=赎回份额×T日基金份额净值

赎回费用=赎回总金额×赎回费率

净赎回金额=赎回总金额-赎回费用

赎回总金额,净赎回金额按四舍五入的原则保留到小数点后两位,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例:某投资者从深交所场内赎回本基金10,000份基金份额,赎回费率为0.5%,假设赎回当日基金份额净值为1.148元,则其可得净赎回金额为:

赎回总金额=10,000×1.148=11,480元

赎回费用=11,480×0.5%=57.40元

净赎回金额=11,480-57.40=11,422.60元

即:投资者从深交所场内赎回本基金10,000份基金份额,假设赎回当日基金份额净值为1.148元,则可得到的净赎回金额为11,422.60元。

3、T日的基金份额净值在当天收市后计算,并在T+1日内公告。遇特殊情况,基金份额净值可以适当延迟计算或公告,并报中国证监会备案。

4、基金份额净值的计算公式

基金份额净值=计算日基金资产净值/计算日发行在外的基金份额总数

(九)场内申购与赎回的登记结算

本基金场内申购和赎回的注册与过户登记业务,按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

(十)办理本基金份额场内申购、赎回业务应遵守深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定,将按新规定执行。

(十一)有关拒绝或暂停基金场内申购和赎回业务的情形及处理方式参见本招募说明书第九章中关于“拒绝或暂停基金申购、赎回业务”的相关内容以及深交所有关规定,并据此执行。

**十一、基金的非交易过户和基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转登记**

(一)基金的非交易过户

指基金注册登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行而产生的非交易过户。无论在上述何种情况下,接受划转的主体必须是合格的个人投资者或机构投资者。

继承是指基金份额持有人死亡,其持有的基金份额由其合法的继承人继承;捐赠指受理基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体;司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金注册登记机构要求提供的相关资料,对于符合条件的非交易过户申请自申请受理日起2个月内办理,并按基金注册登记机构规定的标准收费。具体条件、程序及收费标准以《中国证券登记结算有限责任公司开放式证券投资基金登记结算业务指南》为准。

(二)基金份额的登记

1、本基金的份额采用分系统登记的原则。场外认购或申购买入的基金份额登记在中国结算公司注册登记系统下;场内认购、申购或上市交易买入的基金份额登记在中国结算深圳分公司证券登记结算系统下。

2、登记在证券登记结算系统中的基金份额既可在深交所上市交易,也可直接申请场内赎回。

3、登记在注册登记系统中的基金份额可申请场外赎回。

(三)系统内转托管

1、系统内转托管是指持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构(网点)之间或证券登记结算系统内不同会员单位(席位)之间进行转托管的行为。

2、基金份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理基金赎回业务的销售机构(网点)时,可办理已持有基金份额的系统内转托管。

3、基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理上市交易或场内赎回的会员单位(席位)时,可办理已持有基金份额的系统内转托管。

(四)跨系统转登记

1、跨系统转登记是指持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转登记的行为。

2、本基金跨系统转登记的具体业务按照中国证券登记结算有限公司的相关规定办理。

**十二、基金的投资**

(一)投资目标

本基金精选具有竞争力比较优势和持续盈利增长潜力的自主创新类上市公司中价值相对低估的股票,进行积极主动的投资管理,在有效控制投资风险的前提下,为基金份额持有人谋求长期、稳定的资本增值。

(二)投资范围

本基金的投资范围仅限于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行的各类股票、债券、央行票据、权证、资产证券化产品以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如有投资需要可参与有价值的新股配售和增发。其中股票的主要投资方向为具有竞争力比较优势和持续盈利增长潜力的自主创新类上市公司中价值相对低估的股票,该部分股票的投资比例不低于本基金股票资产的80%。

本基金股票资产占基金资产的比例为60%~95%,债券资产占基金资产的比例为0-35%,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%,现金或到期日在1年期以内政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。

法律法规或中国证监会以后允许基金投资的其他金融工具或品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。如法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制的,基金管理人可相应调整本基金的投资比例上限规定,不需经基金份额持有人大会审议。

(三)投资策略

本基金的投资策略分为两个层次:第一层次是“自上而下”的资产配置策略,第二层次是“自下而上”的选股策略,主要投资于具有竞争力比较优势和持续盈利增长潜力的自主创新类上市公司中价值相对低估的股票。在充分控制投资风险的基础上,通过积极主动的投资管理,为基金份额持有人谋求长期、稳定的资本增值。

1、资产配置策略

本基金主要根据宏观经济、政策环境、利率走势、市场技术指标、市场资金构成及流动性情况,运用定性和定量相结合的分析手段,对证券市场现阶段的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估,并据此制定本基金股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。

2、股票投资策略

本基金主要投资于自主创新类上市公司,所投资的自主创新类上市公司包括两类:高新技术产业创新类上市公司和传统产业创新类上市公司。本基金所投资的高新技术产业创新类上市公司主要是指在电子与信息技术、生物医药与农业、新型材料、新能源及高效节能、光机电一体化、医药与医学工程、环境保护、航空航天、地球、空间及海洋工程、核应用等技术领域内主业突出、通过自主创新及技术产业化获得技术优势且能够保持较高利润率水平的上市公司。本基金所投资的传统产业创新类上市公司是指传统产业类中已完成或正在管理制度、商业模式、营销体系、技术开发和生产体系等方面进行创新,具有较好潜在发展前景和经济效益的上市公司。本基金将会致力于发掘那些通过在管理制度、商业模式、营销体系、技术开发和生产体系等方面进行创新而使得竞争力、盈利能力和可持续发展能力得以提升,具有较好潜在发展前景和持续盈利增长能力的传统产业创新类上市公司。

(1)个股选择

本基金坚持“自下而上”的个股选择策略,致力于选择具有竞争力比较优势,未来成长空间大,持续经营能力强的自主创新类上市公司中价值相对低估的股票作为主要的股票投资对象。除此以外,本基金还将高度重视和跟踪那些过去基本面情况差但现在已有明显好转的上市公司股票,深入分析其基本面发生转变的根本性原因,同时采用多种价值评估办法多角度地对其进行投资价值分析,甄选出那些基本面已得到改善,同时具有潜在高盈利增长趋势的个股作为投资对象。

本基金的个股选择的步骤如下:

1)备选股票的初筛选

首先剔除ST、*ST类股票,然后剔除最近两年中公司有重大违规行为或公司的财务报告有重大问题的股票,剩下的股票构成本基金初选的备选股票库。

2)自主创新型企业的界定和初步筛选

对本基金初选的备选股票所属企业,借助于定性分析和定量分析相结合的方式,通过分析企业的研发(R&D)投入规模及其强度、企业的自主创新行为、企业的研发(R&D)能力、企业的自主创新管理能力以及对企业的自主创新效果进行评价来衡量和识别企业是否具有自主创新型企业属性,同时对自主创新型企业进行初步筛选。

●研发(R&D)投入规模及其强度分析:公司为保证技术领先地位,进而获取超额利润率,在研发资金上应确保资金支持的规模和持续性;同时,确保人力资源投入与经费投入水平适当增长。对企业R&D投入强度的评判,所采用的主要量化指标包括:R&D投入强度、人均研发费用、R&D团队强度、技术引进投入强度等;

●企业的自主创新行为辨识:通过一些可辨识的自主创新行为,对企业的自主创新进行分类和界定,比如:技术创新、产品或服务创新、商业模式创新、流程创新、管理创新(管理方法、制度)等。在辨别企业是否具有自主创新属性时,本基金管理人将从行为的预期效果来进行论证,只有能够达到相关效果、成本与价格的协调,实现成本与创新之间的有效平衡,即价值创新的行为,才能确定为创新性行为,这样的企业才能确定为具有自主创新型企业的属性;

●企业的研发(R&D)能力分析:主要采用的分析指标包括:自主创新产品率、主要产品更新周期、拥有专有技术和专利、对引进技术的消化、吸收和改进能力等;

●企业的自主创新管理能力分析:对有些企业而言,尽管不断有创新活动,却不能产生利润,究其原因,主要在于企业的自主创新管理能力欠缺,无法实现成果的商业价值。因此,本基金将对企业的自主创新管理能力的各方面进行分析,比如:企业的技术前瞻能力、企业的技术管理能力(是否具有科学规范的研发管理体系、激励和人才培养机制)、企业创新与发展战略的匹配能力、企业的资源整合能力以及企业的市场开拓能力等;

●企业的自主创新效果评价:针对具体的创新项目,本基金管理人将采用销售收入边际增长率、毛利率边际增长率、投资本回报率等指标来衡量项目的预期投资回报率,进而对项目的创新效果进行评价;

●初步筛选:通过以上步骤,筛选出具有自主创新型企业属性的股票。

3)股票所属企业的竞争力评估

对按照上述步骤筛选出来的股票,行业研究小组将对股票所属企业的财务健康状况进行评估,以便确保被筛选出来的股票所属企业的财务状况健康。财务健康状况的评估内容以及评估中所采用的量化指标主要包括:

●盈利能力:EBITDA、净利润率、毛利润率、每股收益;

●投资回报率:净资产收益率、总资产回报率;

●成长能力:主营业务收入增长率、主营业务利润增长率、净利润增长率、PEG;

●负债水平:权益负债比率、净债务/EBITDA、EBIT/利息支出;

●现金获取能力:每股现金流量、自由现金流量。

5)股票价值评估

对按上述步骤筛选出来的股票,行业研究小组将进一步地进行价值评估。针对股票所属产业特点的不同,本基金将采取不同的股票估值模型,同时本基金将立足全球视野,在综合考虑股票历史的、国内的、国外的估值水平的基础上,对企业进行相对价值评估,甄选价值相对低估的个股作为本基金的投资对象。

6)备选股票库

本基金的备选股票库由三类股票组成:第一类是按照以上五个步骤筛选出来的具有竞争力比较优势,未来成长空间大,持续经营能力强的自主创新类上市公司中价值相对低估的股票;第二类是那些过去基本面情况差,但现在基本面已得到改善,同时具有潜在高盈利增长趋势的上市公司股票;第三类是新股。

行业研究小组的研究员将会定期或不定期地对该备选股票库中的股票进行维护和更新。

(2)股票投资组合的构建

1)基金管理小组确定拟买入股票名单:基金管理小组在备选股票库的基础上,通过对个股的风险收益特征以及市场状况的分析,再结合对个股的价格趋势和市场时机的判断,从备选股票库中精选拟买入股票名单。

2)基金管理小组在确定的行业配置权重和个股权重范围内初步构建股票投资组合:基金管理小组在拟买入股票名单的基础上,结合对行业布局(如单个行业的股票集中度、行业配置的分散程度)的考虑、对股票投资基准的考虑(如投资组合的行业配置偏离投资基准过大,则组合的非系统性风险就会过高)以及对投资限制条件(如备选股票库中各类股票的投资比例限制;基金经理设定的关于大、中、小盘股票投资比例的限制条件等)的考虑,在确定的各行业配置比例和个股权重范围内,初步完成股票投资组合的构建。

3)投资组合优化:组合优化是指在一定的限制条件下,将组合调整到具有最优风险收益特征的状态。基金管理小组在一些事先设定的投资限制条件下,利用Barra Aegis系统,进行组合优化。基金管理小组根据由该系统得出的优化结果,再结合对基本面、政策面以及市场状况的分析,对组合中的个股权重进行适当地调整,然后再利用Barra Aegis系统进行优化,多次反复,直至得到自己满意的投资组合为止。

3、债券投资策略

本基金的债券投资采用久期控制下的主动投资策略,本着风险收益匹配最优、兼顾流动性的原则确定债券各类属资产的配置比例。在个券选择上,本基金综合运用利率预期、收益率曲线估值、信用等级分析、流动性评估等方法来评估个券的投资价值。

4、权证投资策略

本基金将权证看作是辅助性投资工具,权证的投资原则为有利于基金资产增值,有利于加强基金风险控制。

本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究,同时综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素对权证进行定价,主要运用的投资策略为:杠杆交易策略、对冲保底组合投资策略、保底套利组合投资策略、买入跨式投资策略、DELTA对冲策略等。

(四)投资决策程序

1、决策依据

(1)国家有关法律、法规和本基金合同的有关规定;

(2)国家宏观经济环境及其对证券市场的影响;

(3)货币政策的变化;

(4)利率走势与通货膨胀预期;

(5)地区及行业发展状况;

(6)上市公司价值发现;

(7)国内及国际著名研究机构的研究报告。

2、决策程序

本基金的投资主要参照以下流程进行运作,在有效控制投资风险的前提下,为基金份额持有人谋求长期、稳定的资本增值:

(1)行业研究小组的研究员通过自身研究以及借助外部研究机构的研究成果,形成宏观、策略方面的研究报告,为基金资产配置提供决策支持。

(2)投资决策委员会依照基金管理小组提供的投资组合建议审定投资原则与方向,即确定股票、债券以及现金等大类资产之间的配置比例,确定基金资产分散的程度和各类资产投资的比重。

(3)基金管理小组根据投资决策委员会制定的投资原则和方向,再结合行业研究小组的投资建议报告以及自己对市场时机的判断,确定行业配置比例以及个股权重,构建股票投资组合,再通过Barra Aegis风险管理系统的优化分析以及基金管理小组的判断对组合作进一步的调整优化。

(4)基金管理小组在充分考虑基金投资的安全性和基金资产的流动性的基础上,构建债券组合。

(5)交易室按有关交易规则执行交易指令,并将有关信息反馈给基金经理。

(6)金融工程研究部负责对基金持仓的品种进行风险监控、风险预警以及投资业绩评估。

(7)金融工程研究部风险绩效评估研究员定期为投资决策委员会、投资总监、基金管理小组提供基金业绩评估报告,基金管理小组对于投资决策委员会和风险管理人员认为具有较大风险的投资品种拟定改进方案,并必须在规定的时间内调整投资组合。

(8)监察稽核部对投资流程的合法合规性进行监控。

(五)业绩比较基准

沪深300指数×75%+新华雷曼中国综合债券指数×25%

本基金的股票投资部分以沪深300指数作为业绩比较基准。沪深300指数选择我国A股市场规模较大、流动性较强、基本面良好的300家上市公司的股票作为样本股,充分反映了A股市场的行业代表性,描述了沪深A股市场的总体趋势,同时该指数还具有指数编制方法透明、样本股调整规则清晰等特征,是目前市场上较有影响力的股票投资业绩比较基准。

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基准的股票指数时,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

(六)风险收益特征

本基金属于股票型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金,为证券投资基金中的较高风险、较高收益