

(上接B020版)

82	北京创金财富投资管理有限公司	中国农业银行股份有限公司 注册地址:北京市东城区建国门内大街69号 法定代表人:董巍 客服电话:400-6262-818 网址:www.abchina.com
83	乾道盈泰基金销售(北京)有限公司	深圳市新兰德证券投资咨询有限公司 注册地址:深圳市福田区福华路100号 法定代表人:杨懿 客服电话:400-166-1188 网址:www.bnichina.com
84	交通银行股份有限公司	上海长量基金销售投资顾问有限公司 注册地址:上海市浦东新区东方路1267号11层 法定代表人:张跃伟 客服电话:400-820-2899 网址:www.ezefund.com
85	上海天天基金销售有限公司	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103室 法定代表人:李兴春 客服电话:400-921-7765 网址:www.ezefund.com
86	众升财富(北京)基金销售有限公司	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室 法定代表人:王伟刚 客服电话:400-619-9095 网址:www.zscfund.com
87	浙江同花顺基金销售有限公司	北京微动力基金销售有限公司 注册地址:北京市石景山区古城西路113号一层101室 法定代表人:凌顺平 客服电话:4008-773-772 网址:www.buyfunds.com.cn
88	上海有鱼基金销售有限公司	中衍期货有限公司 注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1000号23层 法定代表人:李宏波 客服电话:4007-7628 网址:www.youyufund.com
89	深圳市前海排排网基金销售有限公司	深圳市前海排排网基金销售有限公司 注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司) 办公地址:深圳市福田区深南大道7006号万豪富春东方大厦22楼 法定代表人:王兆华 联系人:任福利 电话:(0755)8318010 传真:(0755)83181121 (三)律师事务所和经办律师 名称:广东信达律师事务所 注册地址:深圳市福田区益田路6001号平安金融大厦12楼 负责人:麻云燕 经办律师:杨杨,胡云云 电话:(0755)82652588 传真:(0755)8265537 (四)会计师事务所和经办注册会计师 名称:瑞华会计师事务所(特殊普通合伙) 注册地址:北京市海淀区西四环中路16号院2号楼4层 办公地址:北京市东城区永定门西滨河路8号7号楼中海地产广场西塔5-11层 法定代表人:杨剑青 联系人:郭红霞 经办会计师:张富根、郭红霞 电话:(010)88095688 传真:(010)88091199 四、基金名称 前海开源沪港深智慧生活优选灵活配置型证券投资基金 五、基金的类型 混合型 六、基金的运作方式 开放式 七、基金的投资 (一)投资目标 本基金主要通过精选投资于智慧生活主题相关证券,挖掘“互联网+”全面渗透和居民消费结构升级过程中的投资机会,在合理控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下,力争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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、沪港股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”),债券(包括国内依法发行和在上交市的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债,可转换债券及其他中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、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(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。 本基金的投资组合比例为:本基金股票投资占基金资产的比例为0~95%,其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的0~95%,投资于港股通标的股票的比例不超过非现金基金资产的95%;本基金投资于智慧生活主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的90%。本基金每个交易日终扣除港股通费后的净额或者到期日在一年以内中国政府债券,其中现金不包括结算备付金,存出保证金和应收申购款等。 如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。 本基金参与港股通投资,应符合法律法规的规定和基金合同约定的投资限制及遵守相关港股交易所的业务规则。

112	中国农业银行股份有限公司 注册地址:北京市东城区建国门内大街69号 法定代表人:周巍冰 客服电话:95599 网址:www.abchina.com
113	深圳市新兰德证券投资咨询有限公司 注册地址:深圳市福田区福华路100号 法定代表人:杨懿 客服电话:400-166-1188 网址:www.bnichina.com
114	上海长量基金销售投资顾问有限公司 注册地址:上海市浦东新区东方路1267号11层 法定代表人:张跃伟 客服电话:400-820-2899 网址:www.ezefund.com
115	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103室 法定代表人:李兴春 客服电话:400-921-7765 网址:www.ezefund.com
116	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室 法定代表人:王伟刚 客服电话:400-619-9095 网址:www.hcjinc.com
117	北京微动力基金销售有限公司 注册地址:北京市石景山区古城西路113号一层101室 法定代表人:凌顺平 客服电话:4008-196-665 网址:www.buyfunds.com.cn
118	中衍期货有限公司 注册地址:北京市朝阳区东四环中路82号金泰国际B座3层 法定代表人:李宏波 客服电话:4007-7628 网址:www.ezefund.com

(二)登记机构名称:前海开源基金管理有限公司

注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)

办公地址:深圳市福田区深南大道7006号万豪富春东方大厦22楼

法定代表人:王兆华

联系人:任福利

电话:(0755)8318010

传真:(0755)83181121

(三)律师事务所和经办律师

名称:广东信达律师事务所

注册地址:深圳市福田区益田路6001号平安金融大厦12楼

负责人:麻云燕

经办律师:杨杨,胡云云

电话:(0755)82652588

传真:(0755)8265537

(四)会计师事务所和经办注册会计师

名称:瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)

注册地址:北京市海淀区西四环中路16号院2号楼4层

办公地址:北京市东城区永定门西滨河路8号7号楼中海地产广场西塔5-11层

法定代表人:杨剑青

联系人:郭红霞

经办会计师:张富根、郭红霞

电话:(010)88095688

传真:(010)88091199

四、基金名称

前海开源沪港深智慧生活优选灵活配置型证券投资基金

五、基金的类型

混合型

六、基金的运作方式

开放式

七、基金的投资

(一)投资目标

本基金主要通过精选投资于智慧生活主题相关证券,挖掘“互联网+”全面渗透和居民消费结构升级过程中的投资机会,在合理控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下,力争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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、沪港股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”),债券(包括国内依法发行和在上交市的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债,可转换债券及其他中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、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(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。

本基金的投资组合比例为:本基金管理人可与基金托管人协商一致后,调整或变更本基金的业绩比较基准并及时公告。若变更基准指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响(包括但不限于指数编制单位变更、指数组更等事项),则无需召开基金份额持有人大会,基金管理人应与基金托管人协商一致后,报中国证监会备案并及时公告。若变更基准指数涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更,则基金管理人就变更基准指数召开基金份额持有人大会,并报中国证监会备案。

(三)风险收益特征

本基金为混合型基金,属于中高风险收益的投资品种,其预期风险和预期收益率水平高于货币基金型基金,低于股票型基金。本基金如果投资港股通标的股票,需承担汇率风险以及境外市场的风险。

(四)投资限制

本基金的投资组合比例为:本基金股票投资占基金资产的比例为0~95%,其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的0~95%,投资于港股通标的股票的比例不超过非现金基金资产的95%;本基金投资于智慧生活主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的90%。本基金每个交易日终扣除港股通费后的净额或者到期日在一年以内中国政府债券,其中现金不包括结算备付金,存出保证金和应收申购款等。

(五)本基金持有的同一权证,其市值不得超过基金资产净值的10%;

(六)本基金持有的同一权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;

(七)本基金持有的同一权证,其市值不得超过基金资产净值的10%;

(八)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5%;

(九)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%;

(十)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3%;

(十一)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%;

(十二)本基金投资于信用级别评级为BBB以上(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;

(十三)本基金参与股票发行,本基金所申报的金额不得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;

(十四)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%;债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得摊还,更高级别债券除外。

(十五)本基金将“智慧生活”主题聚焦于以下几个方面的投资标的:一是衣,包括智能穿戴等,指对日常穿戴进行智能化设计,开发出可以穿戴设备的公司;二是食,包括智能农业等,是集新兴的互联网、移动互联网、云计算和物联网技术为一体的农业提供精准化种植、可视化管理、智能化决策的企业;三是住,包括智能家居等,是以住宅为平台,利用综合布线技术、网络通信技术、自动控制技术、音视频技术将家居生活与各类资产的连接起来,形成一个整体的、全功能的家庭居住系统;四是行,包括智能交通等,指辅助驾驶的智能监管和调控的公司,它综合运用信息技术、电子控制、影像处理等多种技术,能快速准确实现交通信息采集、处理、决策、指挥调度。

智慧生活主题相关行业的范畴会随着技术的进步不断变化,基金管理人将持续关注相关行业最新技术及商业模式的发展,对智慧生活主题相关行业的定义进行动态更新。

(十六)个股投资策略

在个股选择上,除了筛选出与智慧生活主题相关的上市公司外,本基金还将根据上市公司所处行业特点,综合考虑公司质地和业绩弹性等因素,寻找基本面健康、业绩向上弹性大、估值有优势的公司进行投资。在公司质地方面,选择治理结构优良、竞争优势强、管理水平高、资产负债率低的公司,在业绩弹性方面,重点考虑盈利能力相对产能利用率、价格、成本弹性较大的公司,在估值方面,综合考虑市净率、市销率、EV/EBITDA、重置价值、市盈率等估值指标,选择估值具有较好安全边际的公司。通过对比公司以上方面的分析,本基金将优先选择具有综合优势的股票构建投资组合,并根据行业趋势、估值水平等因素进行动态调整。

(十七)港股通股票的投资策略

本基金可通过沪港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场,不使用合格境内机构投资者(ODI)境外投资额度进行境外投资。本基金将遵循智慧生活主题相关股票的投资策略,优先选择基本面健康、业绩向上弹性大、估值有优势的港股纳入本基金的股票投资组合。

(十八)债券投资策略

在债券投资策略方面,本基金将以智慧生活主题相关债券为主线,在综合研究的基础上实施积极主动的组合管理,采用宏观环境分析和微观市场定性分析两个方面进行债券投资的分析。在宏观环境分析方面,结合宏观经济、政策、利率、流动性、信用等要素对债券市场的影响,对投资品种进行综合评价,选择具有较高安全边际的债券品种。具体投资策略有收益曲线策略、骑乘策略、息差策略等积极投资策略。

(十九)权证投资策略

在权证投资方面,本基金根据权证对公司基本面研究结果确定权证的合理估值,发现市场对股票期权的非理性定价,利用权证衍生工具的特性,通过权证与证券的组合投资,来达到改善组合风险收益特征的

目的。
5.资产支持证券投资策略
本基金通过对资产支持证券发行条款的分析、违约概率和提前偿付比率的估计,借用必要的模型来预测资产支持证券的合理定价,在严格控制风险、充分考虑风险补偿收益和市场流动性的条件下,谨慎选择风险调整后收益较高的品种进行投资。

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。

6.股指期货投资策略

本基金将定期对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。

7.法律风险

本基金将定期对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。

8.信用风险

本基金将定期对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。

9.操作风险

本基金将定期对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。

10.合规风险

本基金将定期对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。

11.其他风险

本基金将定期对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。

12.流动性风险

本基金将定期对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。

13.投资组合风险

本基金将定期对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。

14.投资管理风险

本基金将定期对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。

15.投资品种风险

本基金将定期对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。

16.投资工具风险

本基金将定期对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。

17.投资期限风险

本基金将定期对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。

18.投资区域风险

本基金将定期对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。

19.投资品种集中度风险

本基金将定期对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。

20.投资品种信用风险

本基金将定期对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。

21.投资品种流动性风险

本基金将定期对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。

22.投资品种操作风险

本基金将定期对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。