

(上接A26版)
执行事务合伙人:李丹
联系电话: 021-22338888
传真:021-22338000
联系人:李一
经办注册会计师:李谦、李一

一、基金募集的依据
本基金基金管理人依据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定,并经中国证监会核准【可【2015】1300号文】《关于准予国泰智能装备股票型证券投资基金备案的批复》》准予注册,并依据中国证监会机构部函【2017】938号文《关于国泰智能装备股票型证券投资基金募集备案的回函》》进行募集。

二、基金类型和存续期限
1.基金类型:股票型证券投资基金
2.基金运作方式:契约开放式
3.基金存续期限:不定期

三、基金份额的发售时间、发售方式、发售对象
1.发售时间
自基金份额发售之日起最长不得超过3个月,具体发售时间见基金份额发售公告。
2.发售方式
通过各销售机构公开发售,各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的调整销售机构的相关公告。
3.发售对象
符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币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人。

四、最低募集份额总额
本基金的最低募集份额总额为2亿份。
五、基金份额的认购
1.本基金的基金份额初始面值为人民币1.00元,按初始面值发售。
2.认购费率
募集期间投资人可多次认购本基金,认购费用按每笔认购申请单独计算。本基金基金份额的认购费率如下:

认购金额(M)	认购费率
M≤0-00元	1.20%
100元≤M<300元	1.00%
300元≤M<500元?	0.60%
M≥500元?	按笔收取,1000元/笔?

基金认购费用不列入基金财产,主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的相关费用。

六、基金份额的认购
基金认购采用金额认购的方式。基金的认购金额包括认购费用和净认购金额。计算公式为:
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+认购资金利息)/基金份额初始面值
基金认购采用金额认购,计算公式为:
认购费用=固定金额
净认购金额=认购金额-认购费用
认购份额=(净认购金额+认购资金利息)/基金份额初始面值
认购份额的计算保留到小数点后2位,小数点后第3位四舍五入,由此误差产生的收益或损失归基金财产所有。

例:某投资者投资10,000.00元认购本基金,认购费率为1.20%,假定募集期间认购资金所得利息为3.00元,则认购基金份额计算如下:
净认购金额=10,000.00/(1+1.20%)=9,881.42元
认购费用=10,000.00-9,881.42=118.58元
认购份额=(9,881.42+3.00)/1.00=9,884.42份
即:投资者投资10,000.00元认购本基金,假定募集期间认购资金所得利息为3.00元,可得到9,884.42份基金份额。

七、认购安排
1.认购时间
投资人认购本基金份额的基金业务办理时间由基金管理人和基金销售机构确定,请参见本基金的基金份额发售公告或基金销售机构的相关公告。
2.投资人认购本基金份额应提交的文件和办理的手续
投资人认购本基金份额应提交的文件和基金办理手续详见本基金的基金份额发售公告或基金销售机构相关业务办理规则。
3.基金份额的认购采用金额认购方式,投资人认购时,需按销售机构规定的方式全额缴款。若基金未全额到账则认购失败,基金管理人将认购及款项退款。
投资人应在募集期间内可以多次认购基金份额,认购费按每笔认购申请单独计算,认购申请一经受理不得撤销。基金管理人可对募集期间的单个投资人的累计认购金额进行限制,具体限制和处理方法请参见基金份额发售公告或相关公告。
4.认购的确认
当日(T日)在规定时间内提交的认购申请,投资人通常应在T+2日到原销售机构查询认购申请的受理情况。
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。认购的确认以注册登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况,投资人应及时与销售机构行使合法权利,否则,由于投资人怠于查询而产生的任何损失由投资人自行承担。

八、基金申购和赎回
投资者单笔认购最低金额为100.00元(含认购费)。各销售机构对本基金最低认购金额及交易级差有具体规定的,以各销售机构的业务规定为准。
九、募集资金利息的处理方式
有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有,其中利息转份额的数额以注册登记机构的记录为准。
十、基金申购和赎回的资金留存人专门账户,在基金募集行为结束后,任何人不得动用。

一、基金备案的条件
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2亿元人民币且基金认购人数不少于200人的条件下,基金管理人依据法律法规及招募说明书可以自募集结束之日起10个工作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,向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的,自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起,(基金合同)生效;否则,(基金合同)不生效。基金管理人应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。基金管理人应将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。
基金合同生效后,基金管理人应履行下列责任:

- 1.以基金份额持有人利益最大化为原则,并依法履行信息披露义务;
 - 2.在基金募集期间届满30日内返还投资者已缴纳的款项,并加计银行同期活期存款利息;
 - 3.如基金募集失败,基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付的一切费用应由各方各自承担。
- 《基金合同》生效后,连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或基金资产净值低于5000万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露。连续60个工作日出现前述情形的,基金管理人按照基金合同的约定进入清算程序并终止,无需召开基金份额持有人大会审议。
- 法律法规或中国证监会另有规定时,从其规定。

第十部分 基金合同的生效

一、申购和赎回的确认
本基金的申购和赎回将通过销售机构进行。具体的销售机构将由基金管理人在相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更销售机构,并予以公告。若基金管理人或其指定的销售机构开通电话、传真或网上等交易方式,投资人可以通过上述方式自行申购与赎回,具体参见各销售机构相关业务公告。投资人应在各销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金的申购和赎回。
二、申购和赎回的开放及开放时间
1.开放日及开放时间
投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回,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,但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的约定公告暂停申购、赎回除外。
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,基金管理人有权视具体情况对申购和赎回时间进行适当调整,但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。
2.申购、赎回开始时间及业务办理时间
基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理申购,具体业务办理时间在申购开始公告中规定。
基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理赎回,具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。
在确定申购开始与赎回开始时间后,基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。
基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购或者赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且注册登记机构确认接受的,其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

三、申购和赎回的价格
1.“未知价”原则,即申购、赎回价格以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,即申购以金额申购,赎回以份额申购;
3.当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销;
4.赎回遵循“先进先出”原则,即按照投资人认购、申购的先后顺序进行顺序赎回。
基金管理人可以在法律法规允许的范围内,对上述申购和赎回价格的计算方法进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

四、申购与赎回的程序
1.申购和赎回的申购方式
投资人必须根据销售机构规定的程序,在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。
2.申购和赎回的款项支付
投资人申购基金份额时,必须全额交付申购款项,投资人交付申购款项时,申购成立;注册登记机构确认基金份额时,申购生效。若资金在规定时间内未全额到账则申购不成立,申购款项将自动退还投资人,基金管理人、基金托管人和销售机构等不承担由此产生的利息等任何损失。
基金份额持有人有变更赎回资金账户,赎回成立;注册登记机构确认赎回时,赎回生效。基金份额持有人赎回时请事先告知,基金管理人将在T+1个工作日内对赎回资金账户进行核对。在发生巨额赎回时,款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。
3.申购和赎回申请的确认
基金管理人应在收到申购赎回申请有效申购和赎回申请的数据作为申购或赎回申请日(T日),在正常情况下,本基金注册登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请,投资人应在T+2日后(包括该日)及时到销售机构柜台或与销售机构规定的其他销售渠道申请的确认情况。若申购或赎回失败,则申购款项退还给投资人。
销售机构对申购、赎回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申请。申购、赎回的确认以注册登记机构的确认结果为准。对于申购的确认情况,投资人应及时与销售机构联系并依法行使权利。由于投资人怠于查询而产生的任何损失由投资人自行承担。
基金管理人可以在法律法规允许的范围内,依法对上述申购和赎回申请的确认时间进行调整,并必须在调整实施日前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

五、申购和赎回的数量限制
1.申购金额的限制
投资人单笔最低认购金额为100.00元(含申购费)。各销售机构对本基金最低申购金额及交易级差有具体规定的,以各销售机构的业务规定为准。
2.赎回份额的限制
基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回。单笔赎回申请最低份额为100.00份,若某基金份额持有人赎回时销售机构保留的基金份额不足100.00份,则该次赎回可一并全部赎回。
3.基金管理人不对投资人每个交易账户内的最低基金份额余额进行限制,但各销售机构对交易账户最低份额余额有其他规定的,以各销售机构的业务规定为准。
4.除招募说明书另有规定外,本基金可对单个投资人累计持有的基金份额上限进行限制。
5.基金管理人可在法律法规允许的情况下,调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

六、申购和赎回的费用及用途
基金管理人本基金的申购费率如下:

申购金额(M)	申购费率
M≤0-00元	1.50%
100元≤M<300元	1.20%
300元≤M<500元?	0.80%
M≥500元?	按笔收取,1000元/笔

申购费用计入基金份额的申购人承担,不列入基金财产,主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

七、赎回费用
赎回费用归基金份额赎回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。赎回费用计入基金财产,不低于20%计入基金财产,用于支付销售机构佣金,并将不低于赎回费总额的75%计入基金财产;对持续持有期少于90天但少于180日的基金份额持有人收取的赎回费,将不低于赎回费总额的50%计入基金财产;对持续持有期长于等于90天但少于180日的基金份额持有人,将不低于赎回费总额的25%计入基金财产。未计入基金财产的赎回费用用于支付注册登记费及其他必要的手续费。
本基金基金份额的赎回费率如下:

赎回申请份额持有时间(Y)	赎回费率
Y<7日	1.50%
7日≤Y<30日	0.75%
30日≤Y<180日	0.50%
180日≤Y<365日	0.10%
365日≤Y<730日	0.05%
Y≥730日	0.00%

(注:赎回份额持有时间的计算,以该份额在注册登记机构的登记日开始计算。)

3.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,并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。
七、申购费用与赎回费用的计算
1.申购份额的计算
基金申购采用金额申购的方式。基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。
申购费用=申购金额×申购费率
净申购金额=申购金额/(1+申购费率)
申购份额=净申购金额/基金份额净值
(2)本基金基金份额的申购费用适用固定金额时,申购份额的计算方法如下:申购费用=固定金额
净申购金额=申购金额-申购费用
申购份额=(净申购金额+T日基金份额净值)/T日基金份额净值
例:某投资者投资10,000.00元申购本基金,对应申购费率为1.50%,假设有效申购当日本基金的基金份额净值为1.040元,则其可得到的申购份额为:
净申购金额=10,000.00/(1+1.50%)=9,852.22元
申购费用=10,000.00-9,852.22=147.78元
申购份额=9,852.22/1.040=9,473.29份
即:投资者投资10,000.00元申购本基金,对应申购费率为1.50%,假设有效申购当日基金份额净值为1.040元,则可得到9,473.29份基金份额。
八、赎回金额的计算
赎回费用归基金份额持有人赎回金额时扣除,赎回金额的计算方法如下:
赎回费用=赎回份额×T日基金份额净值×赎回费率
赎回金额=赎回份额×T日基金份额净值-赎回费用
例:某基金份额持有人赎回10,000份基金份额,假设该份额的持有时间为40日,对应的赎回费率为50%,假设赎回当日基金份额净值是1.020元,则其可获得的赎回金额为:
赎回费用=10,000×1.020×0.50%=510.00元
赎回金额=10,000×1.020-510.00=10,490.00元
赎回金额持有时间为180日,赎回费率为1.00%,假设该份额的持有时间为40日,对应的赎回费率为50%,假设赎回当日基金份额净值是1.020元,则其可获得的赎回金额为:
1.本基金的基金份额净值,保留到小数点后4位,小数点后第4位四舍五入,由此产生的收益或损失由基金财产承担。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,经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。
2.申购份额的计算及处理方式:申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值,有效份额单位为份,上述计算结果均按四舍五入方法,保留到小数点后2位,由此产生的收益或损失由基金财产承担。
3.赎回金额的计算及处理方式:赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用,赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法,保留到小数点后2位,由此产生的收益或损失由基金财产承担。

八、暂停赎回的情形及处理方式
1.因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。
2.发生基金合同约定的暂停赎回基金资产估值情况时,基金管理人可暂停接受基金赎回申请。
3.证券/期货交易所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
4.基金管理人认为接受某笔或某些赎回申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。
5.基金资产规模过大,使基金管理人无法找到合适的投资品种,或其他可能导致基金业绩产生负面效应,或出现其他损害基金持有人利益的情形。
6.基金管理人、基金托管人、基金销售机构或注册登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。
7.基金管理人接受某笔或者某些赎回申请可能会影响导致下一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%,或者变相规避50%集中度的情形时。
8.法律法规规定中国证监会认定的其他情形。
发生上述情形之一且基金管理人决定暂停赎回申请或延缓支付赎回款项时,基金管理人应在当日报中国证监会备案,已确认的赎回申请,基金管理人应足额支付,对未确认的赎回申请,应由基金管理人按照其未确认比例将赎回申请量占赎回总量的比例分配给赎回申请人,未确认部分可延期支付。若出现上述情形时,基金管理人应在基金管理人网站刊登暂停赎回公告,并在暂停赎回期间及时采取适当措施保护基金份额持有人的利益,直至正常办理赎回业务后,基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。
九、暂停赎回的情形及处理方式
1.巨额赎回的认定
当基金份额持有人开放日的基金份额赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一开放日的基金总份额的10%,即认为发生了巨额赎回。
2.巨额赎回的处理方式
当基金出现巨额赎回时,基金管理人应根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。
(1)全额赎回:当基金管理人认为有能力支付基金份额持有人的全部赎回申请时,按正常赎回程序执行。
(2)部分延期赎回:当基金管理人认为支付基金份额持有人的赎回申请有困难或因支付基金份额持有人的赎回申请而进行资产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时,基金管理人应在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的10%的前提下,可对其他赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请,应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例,确定当日受理的赎回份额;对于未能赎回部分,基金份额持有人有权在提交赎回申请时选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的,将自动转入下一个开放日继续赎回,直到全部赎回为止;选择取消赎回的,当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。下一开放日如发生延期赎回并予以处理,无赎回份额持有人以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额,以此类推,直到全部赎回为止。如基金份额持有人有在提交赎回申请时未明确选择,基金份额持有人未赎回部分自动延期赎回处理。
(3)暂停赎回:连续2个开放日以上(含本数)发生巨额赎回,如基金管理人认为有必要,可暂停接受基金的赎回申请;已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项,但不得超过20个工作日,并应在指定媒介上进行公告。
十、巨额赎回的公告
当发生上述延期赎回并延期办理时,基金管理人应当通过短信、传真或者基金管理人网站在3个工作日内通知基金份额持有人,说明有关事宜,同时在规定媒介上刊登公告。
十一、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告
1.发生上述申购或赎回暂停公告,基金管理人当日应即向中国证监会备案,并在规定期限内刊登相关公告,同时刊登暂停公告。
2.如发生暂停的时间为1日,基金管理人应在下一开放日,在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告,并公告最近1个开放日的基金资产净值。
3.如发生暂停的时间超过1日,基金管理人应以根据暂停申购或赎回的公告,依照《信息披露办法》的有关规定,最迟于重新开放日在指定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告;也可以根据实际情况在暂停公告中明确说明重新开放申购或赎回的时间,届时不再另行发布重新开放的公告。

十一、基金转换
基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务,基金转换可以收取一定的转换费,相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的约定制定并公告,并提前告知基金托管人及与相关机构。
十二、基金的非交易过户
基金的非交易过户是指基金份额注册登记机构受理,捐赠人司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及基金份额持有人可以依法将基金份额赠与他人,无论在此何种情况下,基金份额的受让主体均须是依法持有合法基金份额的自然人。
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法律文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他当事人,司法人或其授权机构。办理非交易过户时申请人须提供经基金注册登记机构要求提供的真实材料,对于符合规定的非交易过户业务,基金管理人应根据其业务办理规定,并开具基金过户登记确认书,标准收费。
十四、基金的转托管
基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管,基金销售机构可按照规定的标准收取转托管费。
十五、定期定额投资计划
基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划,具体规则由基金管理人另行规定。投资人在办理定期定额投资计划时,可自行约定其扣款金额,基金管理人承诺,不以投资人未全额扣款而在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。
十六、基金收益的分配和原则
基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻,以及注册登记机构认可,符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。
基金份额持有人所获得的红利,被冻结部分份额产生的权益一并冻结,被冻结部分份额仍然参与收益分配。法律法规或监管机构另有规定的除外。
十七、基金的费用
在法律法规及基金合同约定的范围内,基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的证券交易场所等方式进行份额转让的申请并由注册登记机构办理基金份额的过户手续登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的,将提前公告,基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。
十八、相关法律法规允许基金管理人办理基金份额的质押业务或其他基金业务,基金管理人将制定和实施相应的业务规则。

第九部分 基金的投资

一、投资目标
本基金主要投资于智能装备主题股票,在严格控制风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报。
二、投资范围
本基金投资于国内依法发行或上市的资金工具,包括国内依法发行或上市的股票、债券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的金融工具。具体包括:国内发行或上市股票(包含中小创、创业板及其他依法发行、上市的股票)、股指期货、权证等权益类基金工具,债券(包括国债、金融债、企业债、可转债、中小企业私募债、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券、资产支持证券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债、短期融资券、超短期融资券、央行票据)、中期票据、定向发行、银行承兑、货币市场工具等固定收益类金融工具,以及法律法规和中国证监会允许基金投资的金融工具,但须符合中国证监会相关规定。
三、投资比例
基金的投资组合比例为:本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的80%,投资于《基金合同》界定的智能装备主题证券资产中非现金资产的比例不低于80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后,应当保持不低于基金资产净值的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。
四、投资策略
本基金将重点对宏观经济、行业景气度、公司盈利能力、估值水平等指标综合研判,基金管理人可在履行适当程序后,适当扩大基金资产的投资范围及投资比例范围。
五、投资管理
1.股票投资策略
在宏观制造升级的过程中,智能装备的发展不可忽视。首先,制造业升级需要智能装备帮助一般制造业从传统的、人力劳动密集型,向生产自动化、智能化的方向发展,并逐渐建立新的发展模式。其次,实现装备的智能化及制造过程的自动化,将使得生产效率、产品技术水平和质量得到显著提高,能源、资源消耗和污染物的排放明显降低。最后,国内劳动力成本上逐渐提升,人口红利正逐渐衰竭,劳动力成本的上涨将很大程度上拉动智能装备发展。有理由相信,在未来相对较长的一段时间内,智能装备将保持产业升级得到长足发展。
(1)智能装备主题的定义
智能装备是指具有智能化、感知、分析、推理、决策、控制等能力,可实现生产效率提升和降低能耗的装备。智能装备是智能制造技术、信息技术和人工智能技术在装备产品上的集成和融合,它不仅局限于装备,还包括基于装备所构建的产业链和商业模式。
本基金界定的智能装备主题涵盖范围包括但不限于智能数控机床与智能制造装备,自动化成型生产线,智能控制装置、精密和智能仪器仪表与试验设备,关键基础零部件、元器件及通用部件,智能伺服装置、智能专用装备、机器人、3D打印等。智能装备的概念将随着科技进步而不断创新发展,基金管理人将持续跟踪科技进步及商业模式发展,对智能装备主题界定或进行适当调整。
2.资产配置策略
本基金界定的智能装备主题股票至少符合以下标准之一:(1)上市公司目前主营业务属于上述智能装备主题涵盖范围的;(2)上市公司目前非主营业务属于上述智能装备主题涵盖范围,但重点发展业务有可能转变为主营业务并构成公司主要利润来源的;(3)上市公司未来转型方向或重点发展业务属于上述智能装备主题涵盖范围。
(2)个股投资策略
本基金根据上市公司获利能力、成长性、估值水平等指标综合研判,运用定性和定量相结合的方法,综合分析其投资价值及成长性,确定投资标的股票,构建投资组合。
3.固定收益类投资工具投资策略
本基金密切关注国内外宏观经济走势与财政货币政策、货币政策动向、预测未来利率变动走势,自上而下地确定投资组合久期,并结合信用分析等自下而上的个券选择方法构建债券投资组合,配置能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合,保证基金资产流动性。
六、股指期货投资策略
本基金投资股指期货以套期保值为主要目的,将主要选择流动性好、交易活跃的股票期货合约。本基金在运用股指期货时,将严格执行基金管理人关于股指期货交易的风险管理制度,并严格控制交易规模,降低股指期货的系统性风险。
七、中小企业私募债投资策略
本基金在严格控制风险的前提下,综合考虑中小企业私募债的安全性、收益性和流动性等特点,选择具有良好投资价值的品种,在严格遵守法律法规和《基金合同》基础上,谨慎进行中小企业私募债投资。
八、资产支持证券投资策略
本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券的因素进行分析,并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型,评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

九、投资管理
1.股票投资策略
在宏观制造升级的过程中,智能装备的发展不可忽视。首先,制造业升级需要智能装备帮助一般制造业从传统的、人力劳动密集型,向生产自动化、智能化的方向发展,并逐渐建立新的发展模式。其次,实现装备的智能化及制造过程的自动化,将使得生产效率、产品技术水平和质量得到显著提高,能源、资源消耗和污染物的排放明显降低。最后,国内劳动力成本上逐渐提升,人口红利正逐渐衰竭,劳动力成本的上涨将很大程度上拉动智能装备发展。有理由相信,在未来相对较长的一段时间内,智能装备将保持产业升级得到长足发展。
(1)智能装备主题的定义
智能装备是指具有智能化、感知、分析、推理、决策、控制等能力,可实现生产效率提升和降低能耗的装备。智能装备是智能制造技术、信息技术和人工智能技术在装备产品上的集成和融合,它不仅局限于装备,还包括基于装备所构建的产业链和商业模式。
本基金界定的智能装备主题涵盖范围包括但不限于智能数控机床与智能制造装备,自动化成型生产线,智能控制装置、精密和智能仪器仪表与试验设备,关键基础零部件、元器件及通用部件,智能伺服装置、智能专用装备、机器人、3D打印等。智能装备的概念将随着科技进步而不断创新发展,基金管理人将持续跟踪科技进步及商业模式发展,对智能装备主题界定或进行适当调整。
2.资产配置策略
本基金界定的智能装备主题股票至少符合以下标准之一:(1)上市公司目前主营业务属于上述智能装备主题涵盖范围的;(2)上市公司目前非主营业务属于上述智能装备主题涵盖范围,但重点发展业务有可能转变为主营业务并构成公司主要利润来源的;(3)上市公司未来转型方向或重点发展业务属于上述智能装备主题涵盖范围。
(2)个股投资策略
本基金根据上市公司获利能力、成长性、估值水平等指标综合研判,运用定性和定量相结合的方法,综合分析其投资价值及成长性,确定投资标的股票,构建投资组合。
3.固定收益类投资工具投资策略
本基金密切关注国内外宏观经济走势与财政货币政策、货币政策动向、预测未来利率变动走势,自上而下地确定投资组合久期,并结合信用分析等自下而上的个券选择方法构建债券投资组合,配置能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合,保证基金资产流动性。
六、股指期货投资策略
本基金投资股指期货以套期保值为主要目的,将主要选择流动性好、交易活跃的股票期货合约。本基金在运用股指期货时,将严格执行基金管理人关于股指期货交易的风险管理制度,并严格控制交易规模,降低股指期货的系统性风险。
七、中小企业私募债投资策略
本基金在严格控制风险的前提下,综合考虑中小企业私募债的安全性、收益性和流动性等特点,选择具有良好投资价值的品种,在严格遵守法律法规和《基金合同》基础上,谨慎进行中小企业私募债投资。
八、资产支持证券投资策略
本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券的因素进行分析,并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型,评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

十、投资管理
1.股票投资策略
在宏观制造升级的过程中,智能装备的发展不可忽视。首先,制造业升级需要智能装备帮助一般制造业从传统的、人力劳动密集型,向生产自动化、智能化的方向发展,并逐渐建立新的发展模式。其次,实现装备的智能化及制造过程的自动化,将使得生产效率、产品技术水平和质量得到显著提高,能源、资源消耗和污染物的排放明显降低。最后,国内劳动力成本上逐渐提升,人口红利正逐渐衰竭,劳动力成本的上涨将很大程度上拉动智能装备发展。有理由相信,在未来相对较长的一段时间内,智能装备将保持产业升级得到长足发展。
(1)智能装备主题的定义
智能装备是指具有智能化、感知、分析、推理、决策、控制等能力,可实现生产效率提升和降低能耗的装备。智能装备是智能制造技术、信息技术和人工智能技术在装备产品上的集成和融合,它不仅局限于装备,还包括基于装备所构建的产业链和商业模式。
本基金界定的智能装备主题涵盖范围包括但不限于智能数控机床与智能制造装备,自动化成型生产线,智能控制装置、精密和智能仪器仪表与试验设备,关键基础零部件、元器件及通用部件,智能伺服装置、智能专用装备、机器人、3D打印等。智能装备的概念将随着科技进步而不断创新发展,基金管理人将持续跟踪科技进步及商业模式发展,对智能装备主题界定或进行适当调整。
2.资产配置策略
本基金界定的智能装备主题股票至少符合以下标准之一:(1)上市公司目前主营业务属于上述智能装备主题涵盖范围的;(2)上市公司目前非主营业务属于上述智能装备主题涵盖范围,但重点发展业务有可能转变为主营业务并构成公司主要利润来源的;(3)上市公司未来转型方向或重点发展业务属于上述智能装备主题涵盖范围。
(2)个股投资策略
本基金根据上市公司获利能力、成长性、估值水平等指标综合研判,运用定性和定量相结合的方法,综合分析其投资价值及成长性,确定投资标的股票,构建投资组合。
3.固定收益类投资工具投资策略
本基金密切关注国内外宏观经济走势与财政货币政策、货币政策动向、预测未来利率变动走势,自上而下地确定投资组合久期,并结合信用分析等自下而上的个券选择方法构建债券投资组合,配置能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合,保证基金资产流动性。
六、股指期货投资策略
本基金投资股指期货以套期保值为主要目的,将主要选择流动性好、交易活跃的股票期货合约。本基金在运用股指期货时,将严格执行基金管理人关于股指期货交易的风险管理制度,并严格控制交易规模,降低股指期货的系统性风险。
七、中小企业私募债投资策略
本基金在严格控制风险的前提下,综合考虑中小企业私募债的安全性、收益性和流动性等特点,选择具有良好投资价值的品种,在严格遵守法律法规和《基金合同》基础上,谨慎进行中小企业私募债投资。
八、资产支持证券投资策略
本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券的因素进行分析,并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型,评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

基金的投资组合应遵循以下限制:
(1)本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的80%,投资于《基金合同》界定的智能装备主题证券资产中非现金资产的比例不低于80%;
(2)每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券;
(3)本基金持有一家上市公司发行的证券,其市值不得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上市公司发行的证券,不得超过该证券的10%;
(5)本基金投资于权证的投资限制如下:
(1)本基金持有的权证投资,其市值不得超过基金资产净值的3%;
(2)本基金持有的权证投资,其市值不得超过基金资产净值的10%;
(3)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%;
(4)本基金投资于资产支持证券的投资限制如下:
(1)本基金投资于同一原始权益人的各资产支持证券的比例,不得超过基金资产净值的10%;
(2)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%;
(3)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%;
(4)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%;
(5)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;
(6)基金管理人参与股票发行申购,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发行公告所确定的本基金本次发行股票的总量;
(7)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%,本基金在全国银行间同业市场的债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期;
(8)本基金投资于股指期货的投资限制如下:
(1)本基金在任何交易日终,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%;在任何交易日终,持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的95%,其中,有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产等(不含质押式回购)等;
(2)本基金在任何交易日终,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%;
(3)本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)应当符合《基金合同》中关于投资比例的相关规定;
(4)本基金在任何交易日终,持有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%;
(5)本基金投资于同一企业、债券品种的市值不得超过基金资产净值的20%,本基金持有单只中小企业私募债券,其市值不得超过基金资产净值的10%;
(1)本基金资产净值不得超过基金资产净值的140%;
(2)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(3)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(4)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(5)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(6)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(7)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(8)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(9)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(10)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(11)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(12)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(13)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(14)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(15)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(16)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(17)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(18)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(19)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(20)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(21)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(22)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(23)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(24)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(25)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(26)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(27)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(28)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(29)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(30)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(31)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(32)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(33)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(34)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(35)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(36)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(37)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(38)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(39)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(40)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(41)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(42)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(43)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(44)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(45)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(46)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(47)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(48)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(49)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(50)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(51)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(52)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(53)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(54)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(55)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(56)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(57)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(58)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(59)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(60)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(61)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(62)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(63)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(64)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(65)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(66)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(67)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(68)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(69)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(70)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(71)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(72)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(73)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(74)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(75)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(76)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(77)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(78)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(79)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(80)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(81)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(82)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(83)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(84)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(85)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(86)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(87)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(88)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(89)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(90)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(91)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(92)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(93)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(94)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(95)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(96)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(97)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(98)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(99)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(100)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(101)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(102)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(103)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(104)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(105)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(106)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(107)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(108)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(109)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(110)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(111)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(112)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(113)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(114)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(115)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(116)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(117)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(118)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(119)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(120)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(121)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(122)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(123)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(124)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(125)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(126)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(127)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(128)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(129)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(130)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(131)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(132)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(133)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(134)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(135)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(136)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(137)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(138)本基金在股指期货和国债期货交易中,持仓量不得超过其持仓限额;
(139)本基金在股指期货和