关于浦银安盛科技创新一年定期开放混合型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会的公告

一、召开会议基本情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定和《浦银安盛科技创新一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)的约定,浦银安盛科技创新一年定期开放混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)的基金管理人浦银安盛基金管理有限公司(以下简称“本基金管理人”)经与基金托管人交通银行股份有限公司协商一致,决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会,会议的具体安排如下:

1、会议召开方式:通讯方式。

2、会议投票表决起止时间:自2025年4月2日起,至2025年5月1日17:00时(以本基金管理人收到表决票时间/系统记录时间为准)。

3、会议表决票的提交

(1)会议纸质表决票的送达地点:

基金管理人:浦银安盛基金管理有限公司

地址:中国上海市浦东新区滨江大道5189号S2座 客户服务中心

电话:(021)23212899

传真:(021)23212890

客服电话:400-8828-999;(021)33079999

网址:www.py-axa.com

联系人:张欣立

邮政编码:200127

请在信封表面注明:“浦银安盛科技创新一年定期开放混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

(2)网络表决票的提交(仅适用于个人投资者)

通过网络表决方式参与的基金份额持有人应通过基金管理人网站平台进行投票,网络表决票在公证机关的监督下进行统计。

(3)电话表决票的提交(仅适用于个人投资者)

通过电话表决方式参与的基金份额持有人应按本公告规定的方式进行投票,电话表决票在公证机关的监督下进行统计。

二、会议审议事项

关于浦银安盛科技创新一年定期开放混合型证券投资基金转型有关事项的议案(详见附件一)。

三、基金份额持有人大会的权益登记日

本次大会的权益登记日为2025年4月1日,即2025年4月1日交易时间结束后在本基金注册登记机构登记在册的本基金的基金份额持有人均有权参加本次基金份额持有人大会。

四、投票方式

(一)纸质表决票的填写和寄交方式

1、本次会议表决票详见附件二,基金份额持有人可通过从相关报纸上剪裁、复印本次会议表决票或登录本基金管理人网站(www.py-axa.com)下载并打印表决票。

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容,其中:

(1)个人投资者自行投票的,需在表决票上签字,并提供本人身份证件正反面复印件;

(2)机构投资者自行投票的,需在表决票上加盖本单位公章或大会召集人认可的业务预留印鉴,并提供加盖公章或大会召集人认可的业务预留印鉴的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等);合格境外机构投资者自行投票的,需在表决票上加盖本单位公章(如有)或由授权代表在表决票上签字(如无公章),并提供该授权代表的身份证件、护照或其他身份证明文件的复印件,该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件,以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件,以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件;

(3)个人投资者委托他人投票的,应由代理人在表决票上签字或盖章,并提供个人投资者身份证件复印件,以及填妥的授权委托书原件(详见附件三)。如代理人为个人,还需提供代理人的身份证件复印件;如代理人为机构,还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件);

(4)机构投资者委托他人投票的,应由代理人在表决票上签字或盖章,并提供机构投资者的加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件),以及填妥的授权委托书原件(详见附件三)。如代理人为个人,还需提供代理人的身份证件复印件;如代理人为机构,还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件)。合格境外机构投资者委托他人投票的,应由代理人在表决票上签字或盖章,并提供该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件和证券账户卡复印件,以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件和填妥的授权委托书原件。如代理人为个人,还需提供代理人的身份证件复印件;如代理人为机构,还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件)。

3、基金份额持有人或其代理人可通过专人送交、邮寄表决票方式表决。基金份额持有人需自2025年4月2日起,至2025年5月1日17:00时以前(以基金管理人收到表决票时间为准)将表决票通过专人送交、邮寄方式送至本基金管理人如下地址,采用邮寄方式的请在信封表面注明:“浦银安盛科技创新一年定期开放混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

本基金管理人的办公地址及联系办法如下:

基金管理人:浦银安盛基金管理有限公司

地址:中国上海市浦东新区滨江大道5189号S2座 客户服务中心

电话:(021)23212899

传真:(021)23212890

客服电话:400-8828-999;(021)33079999

网址:www.py-axa.com

联系人:张欣立

邮政编码:200127

(二)网络表决

为方便基金份额持有人参与大会投票,自2025年4月2日起,至2025年5月1日17:00以前(以基金管理人系统记录时间为准),基金份额持有人可登录本基金管理人网站(www.py-axa.com),通过网站开设的本次基金持有人大会投票专区进行网络表决。

通过基金管理人网站平台进行投票的基金份额持有人,应使用其预留的查询密码进行登录,基金份额持有人在通过本基金管理人投票专区进行投票时,需核实基金份额持有人的身份确保基金份额持有人权益。

基金份额持有人通过网络表决的方式仅适用于个人投资者,对机构投资者暂不开通。

(三)电话表决

为方便基金份额持有人参与大会投票,自2025年4月2日起,至2025年5月1日17:00以前(以基金管理人系统记录时间为准),基金份额持有人可拨打本基金管理人客服电话(4008828999,021-33079999)并按提示转入工坐席进行表决。本基金管理人也将主动与预留联系方式的基金份额持有人取得联系。

通话过程中将以回答提问方式核实基金份额持有人身份,身份核实后由工坐席根据客户意愿进行投票记录从而完成表决。为保护基金份额持有人利益,整个通话过程将被录音。

基金份额持有人通过电话表决的方式仅适用于个人投资者,对机构投资者暂不开通。

五、计票

1、本次通讯会议的计票方式为:在会议通知的表决截止日期后下一工作日由本基金管理人授权的两名监督员在基金托管人(交通银行股份有限公司)授权代表的监督下进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证。

2、基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。

3、表决票效力的认定如下:

1)纸质表决票

(1)纸面表决票填写完整清晰,所提供文件符合本会议通知规定,且在会议投票表决规定期间内送达本公告规定的收件人的,为有效表决票;有效表决票按表决意见计入相应的表决结果,其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

(2)如纸面表决票上的表决意见未选或表决意见空白、多选、模糊不清或相互矛盾的,但其他各项符合会议通知规定的,视为弃权表决,计入有效表决票;并按“弃权”计入对应的表决结果,其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

(3)如纸面表决票上的表决意见签字或盖章部分填写不完整、不清晰的,或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的,或未能在截止时间之前送达本公告规定的收件人的,均为无效表决票;无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

2)网络表决票

在会议投票表决规定期间内提交网络表决票,为有效表决票;有效表决票按表决意见计入相应的表决结果,其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

3)电话表决票

在会议投票表决规定期间内拨打客服热线进行电话表决或在会议投票表决规定期间内由基金管理人主动与预留联系方式的基金份额持有人电话联系,该等通话内容形成录音资料,录音内容完整涵盖基金份额持有人身份确认及对所有议题进行的明确表决意见,为有效表决票;有效表决票按表决意见计入相应的表决结果,其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

基金份额持有人重复或多途径提交表决票的,如各表决票表决意见相同,则视为同一表决票;如各表决票表决意见不相同,则按如下原则处理:

①送达时间不是同一天的,以最后送达的填写有效的表决票为准,先送达的表决票视为被撤回;

②送达时间为同一天的,如果能判断收到时间先后的,以最后送达的填写有效的表决票为准,先送达的表决票视为被撤回;若无法判断收到时间先后的,则视为在同一表决票上做出了不同表决意见,计入弃权表决票;

③送达时间按如下原则确定:专人送达的以实际递交时间为准,邮寄的以本公告规定的收件人收到的时间为准,网络表决票提交的时间以系统记录时间为准;电话表决票以电话录音系统记录时间为准。

六、决议生效条件与备案

1、本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的,基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一(含二分之一);

2、本次议案应当由提交有效表决票的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方为有效;

3、本次基金份额持有人大会决议通过的事项,本基金管理人自通过之日起五日内报中国证监会备案,基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。

七、二次召集基金份额持有人大会

根据《基金法》的规定及《基金合同》的约定,本次基金份额持有人大会需要本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额达到权益登记日基金总份额的二分之一以上(含二分之一)方可举行。如果本次基金份额持有人大会不符合前述要求而不能成功召开,根据《基金法》的规定,基金管理人可在规定的时间内就同一议案重新召集基金份额持有人大会。

二次召集基金份额持有人大会时,除非授权文件另有载明,本次基金份额持有人大会授权期间基金份额持有人做出的各类授权依然有效,但如果授权方式发生变化或者基金份额持有人重新做出授权,则以最新方式或最新授权为准,详细说明见届时发布的二次召集基金份额持有人大会的通知。

八、本次大会相关机构

1、召集人(基金管理人):浦银安盛基金管理有限公司

2、基金托管人:交通银行股份有限公司

3、公证机关:上海市静安公证处(地址:江宁路418号801室,电话:021-32170327,联系人:高淑娟)

4、见证律所:上海市通力律师事务所

九、重要提示

1、请基金份额持有人在提交表决票时,充分考虑邮寄在途时间,提前寄出表决票。

2、本次基金份额持有人大会有关公告可通过本基金管理人网站查阅,投资者如有任何疑问,可致电本基金管理人客户服务电话400-8828-999咨询。

3、如本次基金份额持有人大会不能成功召开或未能通过本次大会审议的议案,根据《基金法》的规定及《基金合同》的约定,本基金可能会重新召开基金份额持有人大会。

4、本通知的有关内容由浦银安盛基金管理有限公司负责解释。

浦银安盛基金管理有限公司

二〇二五年三月二十八日

附件一:《关于浦银安盛科技创新一年定期开放混合型证券投资基金转型有关事项的议案》

附件二:《浦银安盛科技创新一年定期开放混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决票》

附件三:《授权委托书》

附件四:《浦银安盛科技创新一年定期开放混合型证券投资基金转型方案说明书》

附件五:《浦银安盛科技创新一年持有期混合型证券投资基金基金合同》

附件一:

关于浦银安盛科技创新一年定期开放混合型证券投资基金转型有关事项的议案

浦银安盛科技创新一年定期开放混合型证券投资基金基金份额持有人:

为更好地满足投资者实际需求并顺应资本市场状况和未来资本市场发展趋势,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》(以下简称“《运作办法》”)等法律法规的规定和《浦银安盛科技创新一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)的约定,浦银安盛科技创新一年定期开放混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)的基金管理人浦银安盛基金管理有限公司经与基金托管人交通银行股份有限公司协商一致,提议将本基金转型为浦银安盛科技创新一年持有期混合型证券投资基金。《浦银安盛科技创新一年定期开放混合型证券投资基金转型方案说明书》见附件四。

为实施浦银安盛科技创新一年定期开放混合型证券投资基金转型方案,提议授权基金管理人办理本次浦银安盛科技创新一年定期开放混合型证券投资基金转型的有关具体事宜,并根据现时有效的法律法规的规定和《浦银安盛科技创新一年定期开放混合型证券投资基金转型方案说明书》的有关内容对《浦银安盛科技创新一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》、《浦银安盛科技创新一年定期开放混合型证券投资基金托管协议》及《浦银安盛科技创新一年定期开放混合型证券投资基金招募说明书》进行修改和补充。

根据《运作办法》的规定,基金管理人将在修订后的《浦银安盛科技创新一年持有期混合型证券投资基金基金合同》正式生效前预留不少于二十个工作日供基金份额持有人做出选择。选择期间,本基金开放赎回、转换等业务,具体时间安排详见基金管理人届时发布的相关公告。选择期结束后,投资者未赎回的本基金A类基金份额、C类基金份额将相应变更为浦银安盛科技创新一年持有期混合型证券投资基金A类基金份额、C类基金份额。在选择期结束日的次一工作日,本基金将转型为浦银安盛科技创新一年持有期混合型证券投资基金,《浦银安盛科技创新一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》失效且《浦银安盛科技创新一年持有期混合型证券投资基金基金合同》生效。

以上议案,请予审议。

基金管理人:浦银安盛基金管理有限公司

2025年3月28日

附件二:

浦银安盛科技创新一年定期开放混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决票

基金份额持有人名称:

证件号码(身份证件号/统一社会信用代码):

基金账号:

审议事项:《关于浦银安盛科技创新一年定期开放混合型证券投资基金转型有关事项的议案》

表决意见: 同意□反对□弃权□

基金份额持有人/代理人签名或盖章:

2025年月日

说明:

1、请以打“√”方式在审议事项后“□”内注明表决意见。持有人必须选择一种且只能选择一种表决意见。表决意见代表基金份额持有人所持全部基金份额(以权益登记日所登记的基金份额为准)的表决意见。

2、未选或表决意见空白、多选、模糊不清或相互矛盾的(且其他各项符合会议通知规定)的表决票均视为投票人放弃表决权利,其所持全部基金份额的表决结果均计为“弃权”。签字/盖章部分不完整、不清晰的,将视为无效表决。

3、本表决票可剪报、复印或登录本基金管理人网站(www.py-axa.com)下载并打印,在填写完整并签字盖章后均为有效。

4、证件号码或基金账号不填写/填写错误不影响持有人身份认定的,不影响表决票效力。

附件三:

授权委托书

兹委托先生/女士/公司代表本人(或本机构)参加投票截止日为2025年5月1日的以通讯方式召开的浦银安盛科技创新一年定期开放混合型证券投资基金基金份额持有人大会,并代为全权行使对所有议案的表决权。

委托人(签字/盖章):

委托人身份证号或统一社会信用代码:

委托人基金账户号:

受托人签字/盖章:

受托人身份证号:

委托日期: 年 月 日

附注:此授权委托书剪报、复印或按以上格式自制、在填写完整并签字盖章后均为有效。

附件四:

浦银安盛科技创新一年定期开放混合型证券投资基金转型方案说明书

一、重要提示

1、为更好地满足投资者实际需求并顺应资本市场状况和未来资本市场发展趋势,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》等法律法规的规定和《浦银安盛科技创新一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)的约定,浦银安盛科技创新一年定期开放混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)的基金管理人浦银安盛基金管理有限公司经与基金托管人交通银行股份有限公司协商一致,提议将本基金转型为浦银安盛科技创新一年持有期混合型证券投资基金。本基金转型后,本基金管理人交通银行股份有限公司将继续担任本基金的基金托管人,基金合同、托管协议等法律文件将根据转型后的实际情况进行修订,修订后的基金合同、托管协议将在本基金转型生效日起生效。

2、本次《关于浦银安盛科技创新一年定期开放混合型证券投资基金转型有关事项的议案》需经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过,因此转型方案存在无法获得相关基金份额持有人大会表决通过的可能。

3、基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。在选择期结束日的次一工作日,本基金将转型为浦银安盛科技创新一年持有期混合型证券投资基金,《浦银安盛科技创新一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》失效且《浦银安盛科技创新一年持有期混合型证券投资基金基金合同》生效。中国证监会对浦银安盛科技创新一年定期开放混合型证券投资基金的变更注册以及对本次基金份额持有人大会决议的备案,均不表明其对浦银安盛科技创新一年持有期混合型证券投资基金的投资价值、市场前景或投资者的收益做出实质性判断或保证。

二、转型方案要点

(一)基金名称

原“浦银安盛科技创新一年定期开放混合型证券投资基金”变更为“浦银安盛科技创新一年持有期混合型证券投资基金”。

(二)基金的运作方式

基金的运作方式由“一年定期开放”变更为“一年持有期”。

即变更为“契约型开放式

本基金每笔份额的最短持有期为一年,最短持有期内,投资者不能就该份额提出赎回申请,期满后(含到期日)投资者可就该份额提出赎回申请。

申购份额的“一年持有期限起始日”为申购申请确认日;“一年持有期限到期日”为申购申请确认日的一年对日,若一年后无对日的,则该月最后一个工作日为到期日,若该对日为非工作日,则到期日顺延至下一工作日。因不可抗力或基金合同约定的其他情形致使基金管理人无法在该基金份额的持有期到期日办理该基金份额的赎回业务的,该基金份额的持有期到期日顺延至不可抗力或基金合同约定的其他情形的影响因素消除之日起的下一个工作日。

对于本基金基金合同生效前投资者持有的浦银安盛科技创新一年定期开放混合型证券投资基金基金份额,在本基金基金合同生效后自动转为本基金基金份额,其持有期限为基金合同生效的持有期限加上基金合同生效后的持有期限,投资者份额持有时间记录规则以登记机构最新业务规则为准。

对于收益分配方式为红利再投资的基金份额,每份基金份额(即原份额)红利再投资获得的基金份额的持有期限,按原份额的持有期限计算,即红利再投资获得的基金份额的“一年持有期限到期日”与原份额“一年持有期限到期日”相同。”

(三)巨额赎回的认定

巨额赎回认定比例由“20%”变更为“10%”。

原“若本基金开放期内单个开放日内的基金份额净赎回申请(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)超过前一工作日的基金总份额20%,即认为是发生了巨额赎回。”

变更为“若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(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)超过前一工作日的基金总份额10%,即认为是发生了巨额赎回。”。

(四)基金的投资

1、投资范围

投资范围新增“存托凭证、股票期权、国债期货、融资业务”,并删除“中小板上市股票”。

即变更为“本基金的投资对象包括国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、存托凭证、港股通标的股票、股指期货、股票期权、国债期货、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金可根据相关法律法规的规定,参与融资业务。

本基金的投资组合比例为:股票占基金资产的比例为60%-95%,其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%;本基金投资于科技创新主题相关证券资产的比例不低于非现金基金资产的80%;本基金每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后,保持现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,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。”。

2、投资策略

投资策略删除原“封闭期、开放期投资策略”表述,增加“存托凭证投资策略、国债期货交易策略、股票期权投资策略、参与融资业务的投资策略”。

即变更为“(一)资产配置策略

资产配置策略采用浦银安盛资产配置模型,通过宏观经济、估值水平、流动性和市场政策等四个因素的分析框架,动态把握不同资产类别的投资价值、投资时机以及其风险收益特征的相对变化,进行股票、固定收益证券和现金等大类资产的合理配置,在严格控制投资风险的基础上追求基金资产的长期持续稳定增长。

(二)股票投资策略

1、本基金在股票投资方面主要采用主题投资策略,通过重点投资受益于代表科技创新主题的相关股票,并保持对中国经济发展的趋势对相关行业及上市公司影响的密切跟踪和研究分析,投资于具备高成长性的上市公司。

本基金所界定的科技创新企业主要是指坚持面向世界科技前沿、面向经济主战场、面向国家重大需求,主要服务于符合国家战略、突破关键核心技术、市场认可度高的科技创新企业,属于新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保以及生物医药等高新技术产业和战略性新兴产业的科技创新企业,属于互联网、大数据、云计算、人工智能和制造业深度融合的科技创新企业。

本基金将重点关注以下六大领域的科技创新企业:

(1)新一代信息技术领域,主要包括半导体和集成电路、电子信息、下一代信息网络、人工智能、大数据、云计算、新兴软件、互联网、物联网和智能硬件等;

(2)高端装备领域,主要包括智能制造、航空航天、先进轨道交通、海洋工程装备及相关技术服务等;

(3)新材料领域,主要包括先进钢铁材料、先进有色金属材料、先进石化化工新材料、先进无机非金属材料、高性能复合材料、前沿新材料及相关技术服务等;

(4)新能源领域,主要包括先进核电、大型风电、高效光电光热、高效储能及相关技术服务等;

(5)节能环保领域,主要包括高效节能产品及设备、先进环保技术装备、先进环保产品、资源循环利用、新能源汽车整车、新能源汽车关键零部件、动力电池及相关技术服务等;

(6)生物医药领域,主要包括生物制品、高端化学药、高端医疗设备与器械及相关技术服务等。

本基金定义的科技创新相关公司的研发支出金额占营业收入比例或研发支出金额处于所属行业前三分之一。

未来由于经济增长方式转变、产业结构升级、人口红利变化等因素,从事或受益于上述投资主题的外延将会逐渐扩大,本基金视实际情况对上述界定进行调整和修订。

2、行业精选策略

本基金主要考察行业在产业链上的位置、行业定价能力、行业发展趋势、行业景气程度、行业成熟程度、行业内竞争格局等因素,来构造本基金选股策略。

(1)基于行业定位和定价能力的分析和判断

本基金将通过毛利率的变化情况深入分析各个相关行业的定位与定价能力,重点关注那些可顺利将上游成本转化、产品提价能力强,保持较高毛利率的行业。

(2)基于全球视野下的行业发展潜力和行业景气程度的分析和判断

本基金着眼于全球视野,借鉴全球范围内各国家在经济结构调整中相关行业发展的国际经验,结合对国内宏观经济、行业政策、产业发展规律、居民收入支出变化等经济因素的分析,从而判到国内各行业产业链传导的内在机制,并从中找出最具发展潜力以及处于高景气中的行业。

(3)基于行业竞争结构的分析

本基金重点通过波特的竞争理论考察各行业的竞争结构:a.成本控制能力;b.现有竞争状况;c.产品定价能力;d.新进入者的威胁;e.替代品的威胁等。本基金重点投资那些行业内竞争规范、行业中上市公司具有一定市场份额集中度的行业。

3、个股选择策略

本基金将采取精选个股的策略,并辅之以公司特有的数量化公司财务研究模型基本面财务对拟投资的上市公司加以甄别。具体策略上,主要从定量分析、定性分析和估值水平三个层面对上市公司进行考察。

(1)定量分析

主要通过运用特有的数量化公司财务研究模型基本面财务,结合上市公司的财务数据,从上市公司的盈利能力、增长趋势、运营能力、偿债能力和现金流指标等5个方面对相关上市公司进行量化筛选,挖掘财务健康度很高,数据可以信赖的上市公司,这些公司作为进一步选择的目标。主要指标包括有:盈利能力指标、增长趋势指标、运营能力指标、偿债能力指标、现金流指标。

(2)定性分析

①公司所处的行业特征和在行业中的地位

主要包括公司所处行业的周期特征、行业景气度和行业集中度等内容,同时关注公司在所处行业或是子行业中的地位。

②公司的核心竞争力

主要体现在公司是否在经营许可、规模、资源、技术、品牌、创新能力和成本控制等方面具有竞争对手在中长期时间内难以模仿的显著优势,并重点关注公司的中长期持续增长能力或阶段性高速增长的能力,内容包括上市公司的主营产品或服务是否具有良好的市场前景,在产品或服务提供方面是否具有成本优势,是否拥有出色的销售机制、体系及团队,是否具备较强的技术创新能力并保持足够的研发投入以推动企业的持续发展等。

③公司的管理能力和治理结构

关注公司是否具有诚信、优秀的公司管理层和良好的公司治理结构。诚信、优秀的公司管理层能牵领公司不断制定和调整发展战略,把握住正确的发展方向,以保证企业资源的最佳配置和自身优势的充分发挥;同时良好的治理结构能促使公司管理层诚信尽职、融洽稳定、重视股东利益并使得管理水平能充分适应企业规模的不断扩大。

④公司的历史表现

我们关注有良好历史盈利记录和管理能力的公司,同时也关注和历史表现相比,各方面情况正在得到改善的上市公司。本基金认为,通过定量指标和定性指标可筛选出那些财务健康、获利能力强、核心竞争优势明显、成长性高、公司治理完善的上市公司,再将筛选出的上市公司纳入估值指标进行考察,结合深入的基本面分析和实地调查研究,选择出最具有估值吸引力的股票,结合行业配置计划精选个股构建组合。

4、科创板股票投资策略

科创板企业主要是服务于符合国家战略、突破关键核心技术、市场认可度高的科技创新企业,包括新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保以及生物医药等高新技术产业和战略性新兴产业。科创企业多为具有发展潜力的新兴科技企业,具有良好发展前景,可投资性较强,但也需要识别公司在发展中面临的风险。

作为新生事物,科创板公司相比现有板块的绝大部分公司在行业属性、发展趋势、估值定价等方面存在较大的差异。因此,本基金在筛选投资标的时,更加突出“个性化”的选股逻辑。具体而言,本基金的研究包括但不限于以下一些维度:

1)对科技创新与研发投入的分析,包括:公司的技术壁垒与护城河,专利及研发成果的市场化,公司对于研发的重视程度及投入的持续性,研发投入金额及占营业收入的比重,研发团队的能力及稳定性、研发人员数量规模及激励机制等。

2)对成长性的分析,包括:分析公司成长的驱动因素,行业前景与公司地位,主营业务收入与利润的可持续性,行业与公司面临的“天花板”,跟踪经营活动产生的现金流量等。

3)对商业模式与经营效率的分析,包括:创新的业态和产品能否适应市场趋势,能否敏锐的把握市场需求和变化趋势,公司战略、管理、营销等方面的核心竞争力,管理层高效运营能力。

4)对盈利能力的分析:所有的能力集中到最后体现在为股东创造回报的能力,需要尽快将技术、创新、客户、资源等转化为现金流,提升变现的能力。

5)对估值水平的分析:考虑到科技创新型企业的行业属性与所处生命周期的差别,本基金在投资过程中,要以动态和发展的眼光来考察。通过评估公司成长性、研发成果转化、技术迭代、产品生命周期等因素,综合考虑多种估值方法,合理确定公司价值。具体来说,涉及的主要指标包括:市盈率指标(PE)、市净率指标(PB)、市销率指标(PS)、市盈率/盈利增长比率指标(PEG)、市值/标准化的净现金流指标(MV/NormalizedNCF)、经济价值/息税折旧摊销前利润指标(EV/EBITDA)等。具体而言,对于处于早期或者尚未盈利的公司,基金在投资中,着眼于未来空间与目标市值,可以采用市净率指标(PB)、市销率指标(PS)、企业价值/销售收入(EV/SALES)等估值方法。对于已经盈利的企业,重点关注盈利的增长性和盈利质量,采用市盈率法(P/E)、市盈率/盈利增长比率指标(PEG)等估值方法。

在此基础上,本基金还将做好深度财务分析,包括:盈利能力与收益质量、资本结构与偿债能力、成长能力、营运能力、现金流量等方面。

通过以上多个维度的分析,结合估值分析,挖掘出具备研发创新优势、成长动力强劲、商业模式优异等特征的投资标的。

5、港股通标的股票投资策略

本基金从公司主营业务、公司财务报表和损益表、公司未来的盈利增长预测状况对公司的基本面进行综合分析和合理定价,并结合投资者的情绪和未来成长的可持续性对未来基本面的演变进行研究,以及港股通标的股票中科技创新相关行业的发展前景,遵循自下而上的选股策略,精选符合本基金投资目标的港股通标的股票。

(三)存托凭证投资策略

对于存托凭证投资,本基金将在深入研究的基础上,通过定性分析、定量分析等方式,筛选相应的存托凭证投资标的。

(四)债券类资产投资策略

1、久期与期限结构管理策略

利率风险是债券投资最主要的风险来源和收益来源之一,衡量债券利率风险的核心指标是久期。本基金通过对宏观经济状况和货币政策的分析,对债券市场走势作出判断,并形成对未来市场利率变动方向的预期,动态调整债券组合的久期。在久期确定的基础上,根据对收益率曲线形状变化情景的分析,分别采用子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略,进一步组合的期限结构,使本基金获得较好的收益。

2、类属配置策略

在保证流动性的基础上,本基金将通过国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、分离交易可转债、资产支持证券、回购和银行存款等资产的合理组合实现稳定的投资收益。

类属配置主要策略包括研究国债与金融债之间的利差、交易所与银行间的市场利差、企业债与国债的信用利差等,寻找价值相对低估的投资品种。

3、个券选择策略

(1)流动性策略

通过对各类流动性指标的设置与监控,管理由于基金的申购、赎回或个券的交易难易程度而引致的潜在损失风险。

(2)信用分析策略

为了确保本金安全的基础上获得稳定的收益,本基金对企业债、公司债、金融债、短期融资券等信用债券进行信用分析。此分析主要通过三个角度完成:①独立第三方的外部评级结果;②第三方担保情况;③基于基金管理人自有的数量化公司财务研究模型的内部评价。该模型在信用评价方面的主要作用在于通过对部分关键的财务指标分析判断债券发行企业未来出现偿债风险的可能性,从而确定该企业发行债券的信用等级与利率水平。主要关键的指标包括:NET DEBT/EBITDA、EBIT/I、资产负债率、流动资产/流动负债、经营活动现金流/总负债。其中资产负债率、流动资产/流动负债主要分析企业债务水平与结构,其他的指标主要分析企业经营效益对未来偿债能力的支持能力。

4、回购策略

该策略在资金相对充裕的情况下是风险较低的投资策略。即在基础组合的基础上,使用基础组合持有的债券进行回购融入短期资金滚动操作,同时选择适宜期限的交易所和银行间品种进行投资以获取骑乘及短期债券与货币市场利率的利差。

5、中期票据投资策略

投资策略通过消极安全信用分析系统,遴选收益风险平衡或被市场错误定价的中期票据,兼顾流动性,以持有到期为主,波段操作结合的方式进行中期票据的投资。

6、可转换债券投资策略

本基金可投资可转债,本基金将采用专业的分析和计算方法,综合考虑债券的久期、票面利率、信用风险等债券因素以及期权价值,力求选择被市场低估的品种,增强基金投资组合收益。

(五)股指期货交易策略

本基金在进行股指期货交易时,将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,选择流动性好、交易活跃的期货合约,并根据对股票市场和期货市场运行趋势的研判,以及对股指期货合约的估值定价,与股票现货资产进行匹配,实现多头或空头的套期保值操作,以对冲风险资产组合的系统性风险和流动性风险。

(六)国债期货交易策略

本基金在进行国债期货交易时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究,结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征,运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险等,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

(七)股票期权投资策略

本基金投资股票期权,将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,充分考虑股票期权的流动性和风险收益特征。

(八)资产支持证券投资策略

本基金通过分析资产支持证券对应资产池的资产特征,来估计资产违约风险和提前偿付风险,根据资产证券化的收益结构安排,模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流支付,并利用合理的收益率曲线对资产支持证券进行估值。同时还将充分考虑该投资品种的风险补偿收益和市场流动性,控制资产支持证券投资的风险,以获取较高的投资收益。

(九)参与融资业务的投资策略

本基金在参与融资交易时将根据风险管理的原则,在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下,本着审慎原则,参与融资交易。本基金参与融资交易,将基于对市场行情和组合风险收益的分析,确定投资时机、标的证券以及投资比例。”。

3、投资限制

修改开放期、封闭期的相关投资比例限制,增加国债期货、股票期权、存托凭证、融资业务等投资限制。

即变更为:“1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

(1)本基金股票资产占基金资产的比例为60%-95%,其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%;本基金投资于与科技创新主题相关证券资产的比例不低于非现金基金资产的80%;

(2)本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权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5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等;

(3)本基金持有一家公司发行的证券,其市值(同一家公司在境内和香港同时上市的A+H股合计计算)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(同一家公司在境内和香港同时上市的A+H股合计计算),不超过该证券的10%;

(5)本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的10%;

(6)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%;

(7)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%;

(8)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%;

(9)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;

(10)基金财产参与股票发行申购,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拟发行股票公司本次发行股票的总量;

(11)在任何交易日日终,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%;在任何交易日内交易(不包括平仓)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%;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)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定;

(12)在任何交易日日终,持有的买入国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;在任何交易日日终,持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%;本基金所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买入、卖出国债期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定;在任何交易日内交易(不包括平仓)的国债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30%;

(13)本基金参与股指期货交易、国债期货交易后,本基金任何交易日日终,持有的买入国债期货和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)、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;

(14)本基金参与股票期权交易后,则需遵守下列投资比例限制:

1)基金因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的10%;

2)开仓卖