（上接 D7 版）

第八部分 基金合同当事人及权利义务	第八部分 基金合同当事人及权利义务 一、基金管理人 （一）基金管理人简况 法定代表人：刘志刚	第七部分 基金合同当事人及权利义务 一、基金管理人 （一）基金管理人简况 法定代表人：王轶
	（二）基金管理人的权利与义务 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于： （11）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请； （12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东与债权人权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利； （13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；	（二）基金管理人的权利与义务 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于： （11）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回和转换申请； （12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使相关权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利； （13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；
	（15）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商、期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构； （16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则； （17）在法律法规和基金合同规定的范围内决定除调高基金托管费、基金管理费之外的基金费率结构和收费方式；	（15）选择、更换律师事务所、会计师事务所或其他为基金提供服务的外部机构； （16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金申购、赎回、转换、非交易过户、转托管和收益分配等业务规则；
	2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于： （1）依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；	2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于： （1）依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的申购、赎回和登记事宜；
	（8）采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；	（8）采取适当合理的措施使计算基金份额申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；
	（16）按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；	（16）按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 20 年以上；
	（24）基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；	
	二、基金托管人 （一）基金托管人简况 名称：交通银行股份有限公司 住所：上海市浦东新区银城中路 188 号（邮政编码：200120） 法定代表人：彭纯 成立时间：1987 年 3 月 30 日 批准设立机关和批准设立文号：国务院国发(1986)字第 81 号文和中国人民银行银发[1987]40 号文 组织形式：股份有限公司 注册资本：742.62 亿元人民币 存续期间：持续经营 基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25 号	二、基金托管人 （一）基金托管人简况 名称：交通银行股份有限公司 住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号 邮政编码：200120 法定代表人：任德奇 成立日期：1987 年 3 月 30 日 批准设立机关和批准设立文号：国务院国发(1986)字第 81 号文和中国人民银行银发[1987]40 号文 组织形式：股份有限公司 注册资本：742.63 亿元人民币 存续期间：持续经营
	（二）基金托管人的权利与义务 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于： （4）根据相关市场规则，为基金开设证券账户、资金账户和期货结算账户等投资所需账户，为基金办理证券、期货交易资金清算；	（二）基金托管人的权利与义务 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于： （4）根据相关市场规则，为基金开设证券、期货账户、资金账户等投资所需账户，为基金办理证券、期货交易资金清算；
	（6）按规定开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需的账户，按照《基金合同》、《托管协议》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；	（6）按规定开设基金财产的资金账户、证券／期货账户等投资所需的账户，按照《基金合同》及《托管协议》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
	（11）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；	（11）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 20 年以上；
	三、基金份额持有人 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于： （3）依法申请赎回或转让其持有的基金份额；	三、基金份额持有人 同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。本基金 A 类基金份额与 C 类基金份额由于基金份额净值的不同，基金收益分配的金额以及参与清算后的剩余基金财产分配的数量将可能有所不同。 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于： （3）依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
	（8）对基金管理人、基金托管人、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；	（8）对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
	2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于： （4）缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；	2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于： （4）缴纳基金申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
第九部分 基金份额持有人大会	第九部分 基金份额持有人大会 本基金份额持有人大会不设日常机构。 一、召开事由 1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会（法律法规、中国证监会及基金合同另有规定的除外）： （5）调整基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规要求提高该等报酬标准除外；	第八部分 基金份额持有人大会 本基金份额持有人大会不设日常机构。若将来法律法规对基金份额持有人大会另有规定的，以届时有效的法律法规为准。 一、召开事由 1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会（法律法规、中国证监会及基金合同另有规定的除外）： （5）调整基金管理人、基金托管人的报酬标准；
	（12）对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；	（12）对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
	2、在法律法规规定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，以下情况可经由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会： （2）在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；	2、在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可经由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会： （2）调整本基金的申购费率、调低赎回费率或销售服务费、调整收费方式；
	（5）基金管理人、基金登记机构、基金销售机构，在法律法规规定或中国证监会许可的范围内调整有关认购、申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管、转让、质押等业务规则；	（5）基金管理人、销售机构、登记结算机构在法律法规规定或中国证监会许可的范围内调整有关申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管、转让、质押等业务规则；
	（7）在对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下，增加或减少份额类别，或调整基金份额分类办法及规则；	（7）增加或减少份额类别，或调整基金份额分类办法及规则；
	（9）在对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下，基金管理人经与基金托管人协商一致，调整基金收益的分配原则和支付方式； （10）在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人经与基金托管人协商一致，对基金份额进行折算；	（9）基金管理人经与基金托管人协商一致，调整基金收益的分配原则和支付方式；
	二、会议召集人及召集方式 5、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金份额持有人召集机构、基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。	二、会议召集人及召集方式 5、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。
	四、基金份额持有人出席会议的方式 基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式以及法律法规或监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定，基金管理人、基金托管人须为基金份额持有人行使投票权提供便利。	四、基金份额持有人出席会议的方式 基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。
	（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。参加基金份额持有人大会的持有人的基金份额低于前款规定比例的，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上基金份额的持有人参加，方可召开。	（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。
	2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。	2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或基金合同约定的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或基金合同约定的其他方式进行表决。
	（3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，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）；若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小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见；	（3）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）；若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小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见； （5）会议通知公布前报中国证监会备案。
		九、实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定 若本基金实施侧袋机制，则相关基金份额或表决权的比例指主袋份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例，但若相关基金份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的，则仅指主袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例： 1、基金份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关基金份额 10%以上（含 10%）； 2、现场开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）； 3、通讯开会的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相关基金份额的二分之一（含二分之一）； 4、在参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一、召集人在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内就原定审议事项重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票； 5、现场开会由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人； 6、一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过； 7、特别决议应当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。 同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。
	九、本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。	十、本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。
第十部分 基金管理人、基金托管人的更换条件和程序	二、基金管理人和基金托管人的更换程序 （一）基金管理人的更换程序 6、交接：基金管理人职责终止的，基金管理人应妥善保管基金管理业务资料，及时向临时基金管理人或新任基金管理人办理基金管理业务的移交手续，临时基金管理人或新任基金管理人应及时接收。新任基金管理人应与基金托管人核对基金资产总值；	二、基金管理人和基金托管人的更换程序 （一）基金管理人的更换程序 6、交接：基金管理人职责终止的，基金管理人应妥善保管基金管理业务资料，及时向临时基金管理人或新任基金管理人办理基金管理业务的移交手续，临时基金管理人或新任基金管理人应及时接收。临时基金管理人或新任基金管理人应与基金托管人核对基金资产总值和净值；
	（二）基金托管人的更换程序 6、交接：基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时办理基金财产和基金托管业务的移交手续，新任基金托管人或者临时基金托管人应当及时接收。新任基金托管人与基金管理人核对基金资产总值；	（二）基金托管人的更换程序 6、交接：基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时办理基金财产和基金托管业务的移交手续，新任基金托管人或者临时基金托管人应当及时接收。新任基金托管人或者临时基金托管人应与基金管理人核对基金资产总值和净值；
第十二部分 基金份额的登记	第十二部分 基金份额的登记 一、基金的份额登记业务本基金的登记业务本基金的登记业务指本基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资者基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等。	第十一部分 基金份额的登记 一、基金份额登记业务 本基金的登记业务指本基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资者基金账户及深圳证券账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等。
	二、基金登记业务办理机构 本基金的登记业务由基金管理人或基金管理人委托的其他符合条件的机构办理，但基金管理人依法应当承担的责任不因委托而免除。	二、基金登记业务办理机构 本基金的登记业务由基金管理人或基金管理人委托的其他符合条件的机构办理。 本基金 A 类基金份额的登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司，C 类基金份额的登记结算机构为金鹰基金管理有限公司。基金管理人也可以自行或委托其他机构担任登记结算机构。 本基金的基金份额采用分系统登记的原则。场外 A 类基金份额登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下；场内 A 类基金份额登记在证券登记系统基金份额持有人深圳证券账户下。C 类基金份额登记在金鹰基金管理有限公司注册登记系统基金账户下。
	三、基金登记机构的权利 基金登记机构享有以下权利： 2、建立和管理投资者基金账户；	三、基金登记结算机构的权利 基金登记结算机构享有以下权利： 2、建立和管理投资者基金账户及深圳证券账户；
	4、对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查情形及法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他情形除外；	4、对基金份额持有人的基金账户及深圳证券账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查情形及法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他情形除外；
第十三部分 基金的投资	第十三部分 基金的投资 一、投资目标 运用多种量化模型方法，精选股票进行投资，力争有效控制风险的基础上，实现基金资产的长期稳定增值。	第十三部分 基金的投资 一、投资目标 本基金主要投资于推动制造业升级和新兴产业发展所需的行业，通过精选股票和严格的风险控制，力争实现超过业绩比较基准的长期回报。
	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（包括创业板、中小板以及其他经中国证监会批准上市的股票）、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。	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、创业板、存托凭证及其他中国证监会允许基金投资的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、可转换债、可交换债、可分离交易可转债、可交换私募债、资产支持证券、债券回购、银行存款（含协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、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的相关规定）。 本基金可根据法律法规的规定参与融资业务。
	基金的投资组合比例为：本基金投资组合中股票资产占基金资产的 80%-95%；权证投资占基金资产净值的比例不高于 3%；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，基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；股指期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。 当法律法规的相关规定变更时，基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。	本基金股票资产占基金资产的比例为 80%-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%），投资于本基金界定的“先进制造”主题相关证券资产的比例不低于非现金基金资产的 80%。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，本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。 如法律法规或监管机构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调整上述投资品种的投资比例。
	三、投资策略 （一）资产配置策略 本基金投资组合中股票资产占基金资产的比例不低于 80%，大类资产配置不作为本基金的核心策略，一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考量宏观面、政策面、基本面、资金面、系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。	三、投资策略 （一）资产配置策略 本基金为股票型基金，股票资产占基金资产的比例超过 80%，基金管理人将综合考虑对宏观经济走势、政策走势、证券市场环境等因素，确定投资组合中各类资产的具体配置比例。
	（二）股票投资策略 本基金主要采用多种量化模型进行股票的选择。基于模型结果，基金管理人结合市场环境和股票特性，精选个股构建投资组合，以追求超越业绩比较基准表现的业绩水平。在实际运行过程中，将定期或不定期的进行修正，优化股票投资组合。本基金采用的量化投资策略主要有： （1）多因子选股模型 多因子选股模型由本基金管理人根据中国资本市场的实际情况开发的具有针对性和实用性的数量化选股模型。模型首先综合考虑经济因素、流动性因素、行业发展轨迹等大的市场环境，其次细致评估个股的估值情况、成长情况、动量情况、交易行为情况等进行多维度的筛选。模型按照多维因子，并经过数量量化模型进行筛选，选出符合模型的个股组成一篮子投资组合，并定期更新投资组合。 （2）事件驱动模型 通过研究发现，有较多事件驱动策略在中国 A 股市场有效或阶段性有效。如一致预期变动策略、上市公司业绩超市场预期策略、管理层增持策略、大股东减持策略、指数成份股调整策略等。我们将在适当的时机选用合适的策略，用于捕捉阶段性的超额收益或绝对收益。 （3）行业轮动模型 本基金通过把握经济周期变化，依据对宏观经济、产业政策、行业景气度及市场波动、市场情绪轮动等因素的综合判断，识别出当阶段影响行业股价收益率的关键因素，判断行业是否在估值修复、触底回升等阶段，并计算各行业的绝对、相对上涨趋势强度，以实现各行业的合理和优化的配置。 （4）评级反转策略 评级反转策略综合利用证券分析师提供的研究报告信息，以及股票的市场交易信息进行选股。该策略倾向于选择具有以下特征的股票：在一段时期内，某个股票的多个研究报告均给出较正面的信息，即大部分的证券分析师看好该股的后市走势，然而在二级市场上，该股票的表现却滞后于行业指数的表现。当分析师已获取的信息和预期被市场进一步验证时，该类股票有望获得超额收益。	（二）股票投资策略 1、先进制造主题界定 本基金指的“先进制造”主题相关行业是指推动制造业升级和新兴产业发展所需的行业，具有技术先进、知识密集、信息密集等特征，具备较高技术附加值，能够引领产业发展方向的企业。“先进制造”主题涉及的行业主要包括新能源、新材料、汽车、国防军工、交通运输、机械设备、电气设备、医药制造业、化工、食品制造业、轻工制造、电子、通讯、计算机、传媒等行业。 本基金所指的“先进制造”主题相关公司主要包括以下两类公司： （1）主营业务所属行业为上述定义范围，且产品或服务具有较高技术含量、较高附加值等特点，具有较强的行业竞争力、较强的盈利能力的公司； （2）对于当前未被归入前述行业，但后续通过引入技术创新、变革运营模式、实施资产并购或重组以及其他途径实现业务转型，使其转型后提供的产品或服务隶属于上述行业，且这些产品或服务具有较高技术含量、较高附加值等特点，未来有望成为主要收入或利润来源的公司。 未来由于市场需求变化、经济增长方式转变、产业结构升级等因素，“先进制造”主题涉及的行业外延可能相应扩大或改变，基金管理人在履行适当程序后，可对上述界定进行调整。 2、投资策略 本基金在主要投向于“先进制造”主题公司的前提下，通过定量与定性相结合的方法精选具有核心竞争力、未来成长空间大、持续经营能力强的优质个股。 在定性分析方面，深入研究上市公司所处产业链位置、商业模式、核心竞争力、公司治理结构、管理团队、创新能力、长期发展前景等；定量分析方面，将对较缺上市公司质量和增长潜力的成长性指标、财务指标、估值指标等进行定量分析，以挑选具有成长优势、财务优势和估值优势的个股。成长性指标包括营业利润增长率、净利润增长率和收入增长率等；财务指标包括毛利率、营业利润率、净资产收益率、净利率、经营活动净现金流／利润总额等；估值指标包括市盈率（PE）、市净率（PB）、市盈率相对盈利增长比率（PEG）、市销率（PS）和总市值等。
	（三）债券投资策略 基金管理人将秉承稳健优先的原则，在保证投资低风险的基础上谨慎投资债券市场，力图获得良好的收益。本基金以经济基本面变化趋势分析为基础，结合货币、财政宏观政策，以及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，判断利率和债券市场走势；运用久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属配置策略等多种积极管理策略，深入研究挖掘价值被低估的债券和市场投资机会，构建收益稳定、流动性良好的债券组合。	（五）债券投资策略 基金管理人将秉承稳健优先的原则，在保证投资低风险的基础上谨慎投资债券市场，力图获得良好的收益。 本基金以长期利率趋势分析为基础，结合经济变化趋势、货币政策、投资主题及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，运用久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属配置策略等多种积极管理策略，深入研究挖掘价值被低估的债券和市场投资机会，构建收益稳定、流动性良好的债券组合。
	（四）中小企业私募债券投资策略 本基金将运用基本面研究结合公司财务分析方法，对债券发行人信用风险进行分析和度量，选择风险与收益相匹配的更优品种进行投资。深入研究债券发行人基本面信息，分析企业的长期运作风险；对债券发行人进行财务风险评估；利用历史数据、市场价格以及资产质量等信息，估算私募债券发行人的违约率及违约损失率并考察债券发行人的增信措施。综合上述分析结果，确定信用利差的合理水平，利用市场的相对失衡，确定具有投资价值的债券品种。 （五）衍生品投资策略 本基金的衍生品投资将严格遵守证监会及相关法律法规的约束，在充分评估衍生产品的风险和收益的基础上，谨慎地进行投资。本基金将合理利用股指期货、权证等衍生工具发掘可能的投资机会，稳健投资，实现基金资产的保值增值。	（三）港股投资策略 本基金开投资香港市场股票标的除适用上述股票投资策略外，还将关注： 1、香港股票市场制度与大陆股票市场存在的差异对股票投资价值的影响，比如行业分布、交易制度、市场流动性、投资者结构、市场波动性、涨跌停限制、估值与盈利回报等方面； 2、港股通每日额度应用情况； 3、人民币与港币之间的汇兑比率变化情况。 （四）存托凭证投资策略 （二）上市公司存托凭证的策略依照上述境内上市交易的股票投资策略执行，选择投资价值高的存托凭证进行投资。 （六）可转换债券、可交换债券投资策略 可转换债券和可交换债券的价值主要取决于其股权价值、债券价值和内嵌期权价值，本基金将在对发债公司基本面进行深入分析的基础上，对可转换债券和可交换债券的价值进行评估，选择具有较高投资价值的可转换债券、可交换债券进行投资。此外，本基金还将根据新发可转换债券、可交换债券的预计中签率、模型定价结果，积极参与可转换债券、可交换债券新券的申购。
	（六）资产支持证券投资策略 本基金将分析资产支持证券的资产特征，估计违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。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。	（七）资产支持证券投资策略 本基金将综合运用资产配置、久期管理、收益率曲线、信用管理和个券 α 策略等策略积极主动进行资产支持证券产品投资。本基金管理人将原持风险调整后收益最大化的原则，通过信用资质研究和流动性管理，遵守法律法规和基金合同的约定，严格控制投资风险，确保本金相对安全和基金资产具有良好流动性，以期获得长期稳定收益。
		（八）股指期货投资策略 本基金参与股指期货交易，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，采用流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素，结合定性因素和定量方法，确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模，以及中国证监会的相关限定和要求，确定参与股指期货交易的投资比例。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险、如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。
		（九）参与融资业务的投资策略 为了更好地实现投资目标，在综合考虑预期风险、收益、流动性等因素的基础上，本基金可参与融资业务。
	四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （1）本基金投资组合中股票资产占基金资产净值的比例为 80%-95%； （3）本基金持有一家公司的证券，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%； （8）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%； （9）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%； （10）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%； （18）基金投资产不得超过基金净资产的百分之一百四十；	四、投资限制 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 80%-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%），投资于本基金界定的“先进制造”主题相关证券资产的比例不低于非现金基金资产的 80%； （3）本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），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（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%； （12）本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；
	（19）本基金在任何交易日日终，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%； （20）本基金在任何交易日日终，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（不含质押式回购）等； （21）本基金在任何交易日日终，持有的卖出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个交易日基金资产净值的 20%； （22）本基金所持有的股票市值、买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产净值的比例为 80%-95%； （23）本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过本基金资产净值的 10%； 基金管理人运用基金财产投资证券衍生品种的，应当根据风险管理的原则，并制定严格的授权管理制度和投资决策流程。基金管理人运用基金财产投资证券衍生品种的具体比例，应当符合中国证监会的有关规定。 因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整（除（2）、（7）、（15）、（24）外），但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。 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。 法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制，但须提前公告。	（17）本基金参与股指期货交易，应当遵守下列要求： 1）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%； 2）在任何交易日日终，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）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等； 3）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%； 4）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）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定； 5）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个交易日基金资产净值的 20%； （18）本基金参与融资业务后，在任何交易日日终，持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%； （19）本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算； 因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，除上述第（2）、（9）、（15）、（16）项规定的情况外，基金管理人应当在 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。法律法规另有规定的，从其规定。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，本基金的投资范围、投资策略应当符合本基金合同的约定。 法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行。
	2、禁止行为 （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；	2、禁止行为 （4）买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
	如法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。	法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。
	五、业绩比较基准 沪深 300 指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20% 沪深 300 指数对 A 股市场总体走势具有较强代表性，适合作为本基金股票部分的业绩比较基准。中证全债指数能够反映债券市场总体走势，适合作为本基金固定收益部分的业绩比较基准。此外，本基金还参考预期的大类资产配置比例设置了业绩比较基准的权重。	五、业绩比较基准 中证高端装备制造指数收益率×60%+中证港股通综合指数收益率×20%+中债总财富（总值）指数收益率×20% 中证高端装备制造指数从通信设备、电气部件与设备、重型电气设备、工业机械、建筑、航空航天与国防等行业的公司中选取代表性的 200 只股票构成样本股，能够反映上市公司中高端装备制造产业股票的走势，本基金的投资主题与该产业密切相关，因此，该指数适宜作为本基金 A 股投资的业绩比较基准。中证港股通综合指数由中证指数有限公司发布的指数，选取符合港股通资格的普通股作为样本股，采用自由流通市值加权计算，是反映港股通范围内上市公司的整体状况和走势的一种股价指数。中债总财富（总值）指数收益率是反映境内利