

嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金更新招募说明书摘要 (2016年第1号)

重要提示
嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会2015年6月24日证监许可[2015]1388号《关于准予嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金注册的批复》注册募集。本基金基金合同于2015年12月7日正式生效,自该日起本基金管理人开始管理本基金。

基金有风险,投资者申购本基金时应认真阅读本招募说明书。
基金的投资业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利义务的法律文件,基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《证券投资基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务,基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不向投资者承诺最低收益。
本招募说明书已在本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2016年6月7日(特别事项注明除外),有关财务数据和净值表现截止日为2016年3月31日(未经审计)。

一、基金管理人

(一)基金管理人基本情况

名称	嘉实基金管理有限公司
注册地址	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心二期3309-11层
办公地址	北京朝阳区建国门外大街2号国贸大厦2座27层及28层
法定代表人	魏臻
总经理	赵学军
成立日期	1999年3月25日
注册资本	1.5亿元人民币
股权结构	中信建投证券股份有限公司49%、德意志资产管理(中国)有限公司30%、立信投资有限公司1%、上海浦东发展银行股份有限公司1%
存续期间	持续经营
电话	010 85215588
传真	010 65015588
联系人	胡琦

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5号文批准,于1999年3月25日成立,是中国第一批基金管理公司之一,是中外合资基金管理公司。公司注册地上海,总部设在北京并设深圳、成都、杭州、青岛、北京、福州、广州分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金资产管理人、QDII资格和特定资产管理业务资格。

(二)主要人员情况

1.基金管理人董事、监事、总经理及其他高级管理人员基本情况
魏臻先生,董事长,硕士,中共党员。1983年3月至1992年2月任物资部研究室、政策法规司副科长,1992年3月至2003年4月任中国人民银行国际司、外资金融管理处主任,银行监管一司、银行管理司副处长、处长、副巡视员,2003年5月至2010年3月任中国银监会银行监管三部副主任、四部主任,2010年4月至2014年10月任中信银行有限公司董事长、党委书记、法定代表人。2014年12月起任嘉实基金管理有限公司董事长。

赵学军先生,董事,金融学博士,中共党员。曾就职于天津通信广播公司电视设计所,外经贸部中国仪器进出口总公司,北京商品交易所,天津纺织材料交易所,商鼎期货经纪有限公司,北京证券有限公司,大成基金管理有限公司。2000年10月至今任嘉实基金管理有限公司董事、总经理。

高峰先生,董事,美国籍,美国纽约州立大学石溪分校博士。曾任所门兄弟公司利息衍生品副总监,美国友邦金融产品集团结构产品部副总监。自1996年起加入德意志银行以来,曾任德意志银行(纽约、香港、新加坡)董事,全球市场部中国区主管、上海分行行长,2008年至今任德意志银行(中国)有限公司董事长、德意志银行集团中国区总经理。

陈春艳女士,董事,硕士,研究生。曾任中诚信托有限责任公司资金信贷部,信托开发部,信托事务部,信托业务一部,投资管理部信托经理,高级经理,2010年11月至今任中诚信托有限责任公司投资管理部副负责人、副经理。

Jonathan Paul Einbeck先生,董事,美国籍,南安普顿大学学士学位。曾任Sena Consulting公司咨询顾问,JP Morgan固定收益亚太区COO,COO,JP Morgan Chase固定收益亚太区COO,COO,德意志银行资产管理与财富管理全球运营官。2008年至今任德意志银行资产管理全球运营官。

韩宗华先生,董事,1990年毕业于清华大学经济管理学院,硕士研究生。1990年2月至2000年5月历任德意志投资管理(中国)有限公司总经理,1994年至今任北京德信恒利有限公司总经理,2011年11月至今任立信投资有限责任公司董事长。

王鹏先生,独立董事,美国籍,美国哈佛大学国际商务硕士专业博士。曾任瑞士中诚信银行分行主任,曾任中国银行总行国际金融研究所助理研究员,美国中诚信银行分析师,美国世界银行国际、中国南方投资有限公司副总裁,万盟投资管理有限公司董事长,2004年至今任万盟并购集团董事长。

张晖明先生,独立董事,中共党员,教授,加拿大列治文大学工商管理学博士。曾任上海交通大学动力机械工程系教师,上海交通大学管理学院副教授、副院长,1997年至今任中欧国际工商学院教授、副院长。

汤欣先生,独立董事,中共党员,法学博士,清华大学法学院教授,清华大商法研究中心主任,《清华法学》副主编,清华商法团队“中国商法”丛丛编辑委员会成员。曾任中国证监会监管委员会第一、二、三届并购重组审核委员会委员,现兼任上海证券交易所上市公司委员会委员,中国证监会上市公司独立董事。

朱蕾女士,监事,中共党员,硕士研究生。曾任首都医科大学教师,中国保监会资产管理委员会主任科员,国泰证券有限责任公司总经理,中收基金管理有限公司副总经理,北京代表处首席代表、董事兼秘书长。2007年10月至今任中诚信信托有限公司副总裁。

魏善文先生,监事,经济师,硕士研究生。曾任西安电子科技大学,长安信息产业园(集团)股份有限公司董事会秘书,北京德恒律师事务所公司财务主管。2001年11月至今任立信投资有限公司财务总监。

李先忠先生,董事,中共党员,博士研究生。2005年9月至今就职于嘉实基金管理有限公司人力资源部,历任人力资源部高级经理、副总监、总监。

曾文波先生,监事,法学硕士。1999年7月至2003年10月就职于首钢集团,2003年10月至2008年6月,为国信证券集团(北京)事务所证券部律师。2008年7月至今,就职于嘉实基金管理有限公司法律稽核部,法律部,现任法律部副总监。

宋丽娟女士,副总经理,中共党员,硕士研究生,经济师。1981年6月至1996年10月任职于中办警卫局。1996年11月至1998年7月于中国银行海外行管理培训处任职。1998年7月至1999年3月任鹏华基金管理有限公司总经理助理。1999年3月至今任职于嘉实基金管理有限公司,历任督察员和公司副总经理。

王宇女士,督察长,中共党员,法学硕士。曾就职于中国政法大学法学院,北京市陆通律师事务所律师,北京市智治律师事务所律师,新华保险股份有限公司。曾任嘉实基金管理有限公司法律部总监。

李欣先生,副总经理,硕士研究生。曾任国泰证券行业研究员,国泰君安证券行业研究员兼基金法律部副经理,嘉实基金管理有限公司总经理助理。

李林先生,副总经理,工商管理硕士。历任天元证券深圳证券营业部信息总监,南方证券深圳证券部总经理助理,南方基金运作部副总监,嘉实基金管理有限公司总经理助理。

二、基金托管人

(一)基本情况

名称:中国工商银行股份有限公司
注册地址:北京西城区复兴门内大街55号
成立时间:1984年1月1日
法定代表人:易会满
注册资本:人民币35,400,625.71万元
联系电话:010-61015799
联系人:洪渊

(二)主要人员情况

截至2016年3月末,中国工商银行托管部共有员工1198人,平均年龄30岁,95%以上员工拥有大学本科及以上学历,高级管理人员均拥有研究生以上学历或高级职称。

(三)基金托管业务运营情况

作为中国工商银行服务的先行者,中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来,秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系,规范的业务流程,先进的技术手段和完善的后台支持,严格履行资产托管职责,为境内广大资产所有者、基金管理人及托管人客户提供安全、高效、专业的托管服务,展现先进的市场形象和影响力,建立了国内银行中规模最大、最成熟的产品线,拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的资产管理产品体系,同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务,可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2016年3月,中国工商银行共托管证券投资基金555只。自2003年以来,本行连续十年获得香港《亚洲货币》、《全球托管人》、《香港财经》、《美国环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内权威财经媒体评选的49项最佳托管银行大奖,是获得奖项最多的国内托管银行,优良的服务品质获得国内权威机构的持续认可和好评。

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1.直销机构:

(1)嘉实基金管理有限公司直销中心
办公地址:北京市朝阳区建国门外大街2号国贸大厦2座27层及28层
电话:010 85215588 传真:010 85215577
联系人:赵旭

(2)嘉实基金管理有限公司上海直销中心
办公地址:上海市浦东新区世纪大道1609号上海国金中心二期25层09-11单元
电话:021 88868688 传真:021 88860251
联系人:邵琦

(3)嘉实基金管理有限公司成都分公司
办公地址:成都高新区交子大道177号中海国际中心B座22层02-01A-01单元
电话:028 36221100 传真:028 36221000
联系人:王鹏

(4)嘉实基金管理有限公司深圳分公司
办公地址:深圳市福田区莲花路155号国际商会大厦3楼03A室
电话:0755 25787966 传真:0755 25787663
联系人:周路

(5)嘉实基金管理有限公司青岛分公司
办公地址:青岛市市南区香港中路107号国信大厦10层1002室
电话:0532 86777666 传真:0532 86777676
联系人:周路

(6)嘉实基金管理有限公司杭州分公司
办公地址:杭州市西湖区天目山路158号国信国际大厦3楼03A室
电话:0571 87393228 传真:0571 87393331
联系人:王鹏

(7)嘉实基金管理有限公司福州分公司
办公地址:福州市鼓楼区五四路158号领世国际二期A座1604单元
电话:0591 88013573 传真:0591 88013670
联系人:赵旭

(8)嘉实基金管理有限公司南京分公司
办公地址:南京市白下区中山东路288号新亚大酒店A座4202室
电话:025 66671118 传真:025 66671100
联系人:魏臻

(9)嘉实基金管理有限公司广州分公司
办公地址:广州市天河区珠江东路6号广州国际金融中心4601-601A单元
电话:020 87551618 传真:020 81552120
联系人:魏臻

2.代销机构

(1)中国工商银行股份有限公司

办公地址:北京西城区复兴门内大街2号
法定代表人:姜建清
联系人:梁岩
电话:010 61047914 传真:010 61047914
网址:www.icbc.com.cn 客服电话:95588

(2)中国银行股份有限公司

办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人:李礼辉
联系人:魏鹏
电话:010 65956688 传真:010 65959466
网址:www.boc.cn 客服电话:95566

(3)中国建设银行股份有限公司

办公地址:北京市西城区金融大街25号
法定代表人:王洪章
联系人:张静
电话:010 65956688 传真:010 65959466
网址:www.ccb.com 客服电话:95533

(4)招商银行股份有限公司

办公地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行总行大厦
法定代表人:李建强
联系人:董建一
电话:0755 83198888 传真:0755 83195050
网址:www.cmbchina.com 客服电话:95555

(5)中信银行股份有限公司

办公地址:北京市朝阳区朝阳门北大街127号
法定代表人:常明
联系人:魏佳
电话:bank.citic.com 客服电话:95558

(6)中国民生银行股份有限公司

办公地址:北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人:董文标
联系人:张耀
电话:010 58308666 传真:010 57098211
网址:www.cmbc.com.cn 客服电话:95568

(7)北京农村商业银行股份有限公司

办公地址:北京市西城区德胜门内大街2号
法定代表人:董和生
联系人:张燕
电话:010 65585066 传真:010 67092611
网址:www.brcb.com.cn 客服电话:95568

(8)徽商银行股份有限公司

办公地址:安徽省合肥市庐阳大道799号徽商银行大厦
法定代表人:李学伟
联系人:李俊
电话:0551 82606753 传真:0551 82607884
网址:www.hsbcbank.com 客服电话:400808558

(9)江苏银行股份有限公司

办公地址:南京市中华路55号
法定代表人:夏平
联系人:周海平
电话:025 58857018 传真:025 58853708
网址:www.jsbcb.com 客服电话:025 96088998

(10)乌鲁木齐齐商银行股份有限公司

办公地址:乌鲁木齐市新疆北路2号齐商银行大厦
法定代表人:李强
联系人:王娟
电话:0991 3823667 传真:0991 3823667
网址:www.uccb.com.cn 客服电话:0991 385118

(11)烟台银行股份有限公司

办公地址:山东省烟台市芝罘区海港路55号
法定代表人:尹叶群
联系人:王淑华
电话:0535 6996600 传真:0535 6998884
网址:www.yantaibank.com 客服电话:4008-311-777

(12)苏州银行股份有限公司

办公地址:江苏省苏州市姑苏区观前街72号
法定代表人:王兰凤
联系人:郝志远
电话:0512 69868370 传真:0512 69868370
网址:www.suzhoubank.com 客服电话:0512-96007

(13)浙江温州龙湾农村合作银行有限公司

办公地址:浙江省温州市龙湾区永中街道555号
法定代表人:李强
联系人:李强
电话:0577-86602223 传真:0577-86602620
网址:www.jwbk.com 客服电话:4008295956

(14)上海外高桥基金融销售有限公司

办公地址:上海市浦东新区川沙新镇川沙路111号外高桥金融大厦303-306C
法定代表人:杨文勇
联系人:张勇
电话:021-2613999 传真:021-6859916
网址:www.shwbj.com 客服电话:400709665

(15)上海利得基金销售有限公司

办公地址:上海市虹口区四川北路1488号1403室
法定代表人:李琦
联系人:李琦
电话:021-50583633 传真:021-50583633
网址:www.lidifund.com 客服电话:400-667-6286

(16)嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金

办公地址:上海市浦东新区世纪大道1609号上海国金中心二期25层09-11单元
法定代表人:赵学军
联系人:魏臻
电话:021-38796588 传真:021-68808203
网址:www.harvestwm.com 客服电话:400-021-8800

(17)上海富荣资产管理股份有限公司

办公地址:上海市浦东新区世纪大道1333号14089室
法定代表人:李强
联系人:李强
电话:021-2666992 传真:021-2266653
网址:www.furongfund.com 客服电话:400210011

(18)大泰金石投资管理有限公司

办公地址:上海市浦东新区世纪大道1500号大泰金融大厦1508室
法定代表人:李强
联系人:李强
电话:021-20612785 传真:021-20321190
网址:info@wz-fund.com 客服电话:400-58-2386

(19)珠海盈米财富管理有限公司

办公地址:广东省广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203
法定代表人:肖雯
联系人:肖雯
电话:020-89629019 传真:020-89620011
网址:www.yingmi.com 客服电话:020-89620666

(20)光大证券股份有限公司

办公地址:上海市静安区新闻路1588号
法定代表人:薛峰
联系人:李勇
电话:021 22169999 传真:021 22169134
网址:www.ebsc.com.cn 客服电话:4008888788,10108898

(21)国金证券股份有限公司

办公地址:成都市东城根上街15号
法定代表人:冉启荣
联系人:冉启荣
电话:028 36660257 028 36660258 传真:028 36660216
网址:www.gq.com.cn 客服电话:9510

(22)联讯证券股份有限公司

办公地址:广东省惠州市惠城区江北三新南路2号惠州联讯证券中心3-12楼
法定代表人:李强
联系人:李强
电话:0752-2119700 传真:0752-2119700
网址:www.lxsec.com 客服电话:4007096655

(三)登记机构

名称:嘉实基金管理有限公司
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心二期3309-11层
法定代表人:魏臻
联系人:李强
电话:010 85215588 传真:010 65015588
网址:www.jsfund.com

(四)出具法律意见书的律师事务所

名称:上海市锦天城律师事务所
办公地址:上海市浦东新区银城中路28号金茂大厦1404室
负责人:廖海
联系人:廖海
电话:021 81150028-427 传真:021 75115088
网址:www.lawtochina.com

(五)审计会计师事务所

名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
法定代表人:李强
联系人:李强
电话:021 22123888 传真:021 22123888
网址:www.pwcc.com.cn

四、基金的投资

1.基金的投资目标

本基金名称:嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金

本基金类型:股票型证券投资基金,契约型开放式

2.基金的投资目标

本基金以腾讯自选股大数据为基础构建量化投资策略,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。

3.基金的投资范围

本基金投资于依法发行上市的股票、债券等金融工具及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括:股票(包含中小板、创业板及其他依法发行上市的公司股票)、股指期货、权证、国债、金融债、企业(公司)债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债等。资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产以及现金,以及法律法规和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)。

4.基金的投资策略

本基金通过中小型企业私募融资平台,力争获得长期、持续的超额收益。

5.基金资产配置

本基金资产配置策略为:股票资产占基金资产的比例为80%-95%;在扣除股指期货合约所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%;股指期货、权证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。

6.基金的投资组合

本基金将通过对中小型企业私募融资平台,力争获得长期、持续的超额收益。

7.基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准:中证800指数收益率*60%+沪深300指数收益率*40%

8.基金的风险收益特征

本基金为股票型基金,预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

9.基金的投资组合

本基金投资于依法发行上市的股票、债券等金融工具及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括:股票(包含中小板、创业板及其他依法发行上市的公司股票)、股指期货、权证、国债、金融债、企业(公司)债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债等。资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产以及现金,以及法律法规和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)。

10.基金的投资组合

本基金通过中小型企业私募融资平台,力争获得长期、持续的超额收益。

11.基金的投资组合

本基金通过中小型企业私募融资平台,力争获得长期、持续的超额收益。

12.基金的投资组合

本基金通过中小型企业私募融资平台,力争获得长期、持续的超额收益。

13.基金的投资组合

本基金通过中小型企业私募融资平台,力争获得长期、持续的超额收益。

14.基金的投资组合

本基金通过中小型企业私募融资平台,力争获得长期、持续的超额收益。

基金管理人:嘉实基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

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

基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为80%-95%;在扣除股指期货合约所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%;股指期货、权证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范。

八、基金的投资策略

本基金将腾讯自选股大数据和行内金融模型相结合,构建大数据量化投资策略模型,在此基础上生成股票投资组合,力争获得长期、持续的超额收益。

1.大类资产配置

本基金重点配置股票资产,同时从宏观政策、基本面和资金面等多个维度进行综合研判,在严格控制投资组合风险的前提下,确定和调整投资组合中股票、债券、货币市场工具和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他品种的投资比例。

2.股票投资策略

在具体的选股策略上,本基金以腾讯自选股大数据为基础,结合行业金融模型并运用量化手段分析互联网用户行为为二级市场建立数据驱动模型的关键性,选取对价格变动具有较强解释能力的用户行为指标建立大数据量化投资策略,力争实现稳定超额回报。同时,本基金将根据市场化趋势,定期或不定期对量化策略模型进行优化,并做相应调整,以不断改善模型的有效性。

3.债券投资策略

本基金在债券投资方面,通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类别的固定收益品种,流动性及信用风险等因素,以久期控制和结构分布策略为主,以收益率曲线策略、利差策略等为辅,构建能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合。

4.中小企业私募债券投资策略

本基金通过中小型企业私募融资平台,力争获得长期、持续的超额收益。

5.衍生品投资策略

本基金的衍生品投资将严格遵守法律法规及监管机构的规定,合理利用股指期货、权证等衍生工具,利用数量化方法捕捉可能的套利机会。投资原则为有利于基金资产增值,控制下风险,实现保值和避险。

6.资产支持证券投资策略

本基金将密切跟踪市场变化,在严格控制投资风险的前提下,进行适当的资产支持证券投资。

7.风险管理策略

本基金将借鉴国外风险管理成功经验如Barra多因子模型、风险预算模型等,并结合公司现有的风险管理流程,在各个投资环节中实时监控、度量和控制投资风险,并通过调整投资组合的风险结构,来优化基金的风险收益配比。

8.投资决策依据和决策程序

(1)投资决策依据
①法律法规和基金合同。本基金的投资将严格遵守国家有关法律、法规和基金合同的相关规定。
②宏观经济和上市公司的基本面数据。
③投资对象的预期收益和预期风险的匹配关系。本基金将在承受适度风险的前提下,选择预期收益大于预期风险的品种进行投资。
(2)投资决策程序
①研究部门通过内部独立研究,并借鉴其他机构的研究成果,形成宏观、政策、投资策略、行业和上市公司等分析报告,为投资决策委员会和基金经理提供决策依据。
②投资决策委员会定期和不定期召开会议,根据本基金投资目标和对市场的判断决定本计划的总体投资策略,审核并批准基金经理提出的资产配置方案或重大投资决定。
③在既定的投资目标与原则下,由基金经理制定投资计划,根据大数据选股模型构建投资组合。
④独立的投资执行。本基金管理人将严格的交易制度和制度的一线监控功能,确保基金经理的投资指令在合法、合规的前提下得到高效地执行。
⑤动态的组合调整。基金经理将根据证券市场整体走势及本基金资产的变化,结合本基金的现实情况,以组合风险和流动性的评估结果,对投资组合进行动态的调整,使之不断得到优化。
风险管理部根据市场变化对本基金投资组合进行风险评估