光大保德信耀钱包货币市场基金招募说明书(更新)摘要

基金管理人:光大保德信基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司

光大保德信耀钱包货币市场基金（以下简称“本基金”）于2015年10月27日经中国证券监督管理委员会证监基金字[2015]2376号文核准公开募集。本基金份额于2015年11月3日发售,本基金合同于2015年11月4日生效。

重要提示

光大保德信基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”、“本基金管理人”或“本公司”)保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和政益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险,投资人申购基金时应认真阅读招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

投资者购买货币市场基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构,基金管理人不保证投资本基金一定盈利,也不保证基金的最低收益。

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《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》,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。

本更新招募说明书所载内容(除非文中另有所指)截止日为2016年5月8日,有关财务数据和净值表现截止日为2016年3月31日。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:光大保德信基金管理有限公司
设立日期:2004年4月22日
批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监基金字[2004]42号
注册地址:上海市延安东路222号外滩中心大厦46层
办公地址:上海市黄浦区中山东二路558号外滩金融中心1幢(北区3号楼)6层至10层
法定代表人:林昌
注册资本:人民币1.6亿元
股权结构:光大证券股份有限公司(以下简称“光大证券”)持55%的股权;保德信投资管理有限公司持45%的股权
电话:(021)80262888
传真:(021)80262468
客服电话:4008-202-888
网址:www.epf.com.cn
联系人:殷瑞峥

(二)主要人员情况

1、董事会成员

林昌先生,董事长,北京大学硕士,中国国籍。历任光大证券南方总部研究部总经理、投资银行一部总经理、南方总部副总经理、投资银行总部总经理、光大证券助理总裁。现任本基金管理人董事长兼代任总经理。

Glenwyn P. Baptist先生,副董事长,美国西北大学管理系硕士学位,CFA,美国国籍。历任保德信金融集团企业金融部助理副总裁、保德信金融集团研究部总监、保德信金融集团业务管理部首席运营官、保德信金融集团市场及业务管理部共同基金总监、保德信金融集团投资管理部首席投资官。现任保德信金融集团业务管理部总裁兼首席投资官。

葛新元先生,董事,北京师范大学博士、南京大学博士后,中国国籍。历任上海社会科学院研究员,湘财证券研究所金融工程研究员,国信证券研究所金融工程首席分析师、衍生品部副总经理,国信证券研究所金融工程首席分析师、副所长。现任光大富尊投资有限公司总经理。

俞大伟先生,董事,同济大学工商管理硕士,中国国籍。历任江苏东华期货有限公司苏州办交易部经纪人,上海中期期货经纪有限公司苏州交易部经理,河南鑫福期货有限公司苏州代表处经理,上海中期期货经纪有限公司苏州营业部副经理、经理,上海中期期货经纪有限公司副总经理。现任光大期货有限公司常务副总经理。

王丽玲女士,董事,美国波士顿大学硕士,曾任荷兰银行(中国台湾)的法务长,联合法律事务所(中国台湾)、泰运法律事务所(中国台湾)律师。现任保德信金融集团高级副总裁兼区域顾问(中国台湾)。

夏小华先生,独立董事,复旦大学政治经济学系学士,中国国籍。历任交通银行研究开发部经济研究处处长、研究开发部副总经理,广东发展银行上海分行常务副行长、行长、党委书记,华夏银行上海分行行长,现任华夏银行上海分行四级行员。

金德环先生,独立董事,上海财经大学硕士、教授,中国国籍。曾任上海财经大学财政金融系教研室主任、财政系副主任、证券期货学院副院长。现任上海财经大学金融学院证券研究中心主任。

郑志先生,独立董事,华东政法学院(现华东政法大学)法律史专业硕士。曾任安徽国运律师事务所上海分所律师、国浩律师集团(上海)事务所律师、上海东方华银律师事务所合伙人及律师。现任北京市大成律师事务所上海分所律师。

2、监事会成员

孙侠先生,监事长,复旦大学博士研究生。历任交通银行总行国际业务部产品策划经理,光大证券公司办公室综合处副处长、光大证券公司办公室副主任兼综合处处长。现任光大国际营运总监。

颜微遭女士,监事,新加坡国立大学经济和数学双学士,马来西亚国籍,香港证券业协会会员。历任新加坡Farenew Mondial投资私人有限公司分析员,DBS唯高达亚洲有限公司合规经理,香港交易所上市部副总监,富通集团亚洲区域合规总监。现任香港保德信亚洲基金管理有限公司董事及首席合规总监。

王永万先生,监事,吉林财贸学院经济管理专业学士。曾任海口会计师事务所审计员,海南省国际租赁有限公司证券营业部财务主管,湘财证券有限责任公司海口营业部、深圳营业部及南方总部财务经理,宝盈基金管理有限公司基金会计主管,摩根士丹利华鑫基金管理有限公司基金运营部总监等职务。现任本基金管理人运营部总监。

郁疆生先生,监事,澳大利亚堪培拉大学工商管理硕士。曾任湘财证券有限责任公司长沙新民路营业部营销部经理、市场总部经理及董事会办公室秘书,诺安基金管理有限公司上海分公司高级经理等职务。加入光大保德信基金管理有限公司后,先后担任销售部高级经理、广州分公司总经理。现任本基金管理人副首席市场总监兼券商业务部总监。

3、公司高级管理人员

林昌先生,现任本基金管理人董事长兼代任总经理,简历同上。

李常青先生,中欧国际工商学院EMBA。历任中国科学技术大学化学系教师,安徽众城高斯律师事务所律师,天同(万家)基金管理有限公司市场拓展部高级经理、监察稽核部总监助理、北京办事处主任,诺德基金管理有限公司监察稽核部总监等职务,2010年7月加入光大保德信基金管理有限公司,先后担任监察稽核部总监、战略发展部总监,现任本基金管理人督察长。

盛松先生,北京大学硕士,中国国籍。历任中国光大国际信托投资公司证券部交易部经理,光大证券资产管理总部总经理,2003年参加光大保德信基金管理有限公司筹备工作,2004年4月起担任光大保德信基金管理有限公司督察长。现任本基金管理人副总经理兼首席投资总监。

梅雷军先生,吉林大学机械系博士,武汉大学机械系学士。曾任深圳蛇口安达实业股份有限公司投资管理部经理,光大证券股份有限公司南方总部机构管理部总经理兼任电脑部总经理、光大证券电子商务一部总经理、信息技术部总经理兼客户服务中心总经理。2004年7月加入光大保德信基金管理有限公司,现任本基金管理人副总经理兼首席运营总监。

4、本基金拟任基金经理

蔡乐女士，金融投资学学士,2003年7月至2005年2月任方正证券固定收益部项目经理;2005年3月至2014年8月历任中再资产管理股份有限公司固定收益部研究员兼交易员、投资经理助理、自有账户投资经理。

2014年8月加入光大保德信基金管理有限公司,现任光大保德信现金宝货币市场基金基金经理、光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金基金经理、光大保德信添盛双月理财债券型证券投资基金基金经理、光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、光大保德信耀钱包货币市场基金基金经理、光大保德信欣鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、光大保德信睿鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、光大保德信尊商一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。

杨烨超先生,硕士,2007年毕业于复旦大学世界经济系,2010年获得复旦大学世界经济系的硕士学位。自2010年7月加入光大保德信基金管理有限公司,先后担任市场部产品助理、产品经理(负责产品设计研究等),2014年3月至今担任固定收益部研究员,现任光大保德信耀钱包货币市场基金基金经理,光大保德信睿鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理,光大保德信增利收益债券型证券投资基金基金经理(暂代),光大保德信信用添益债券型证券投资基金基金经理(暂代)。

5、投资决策委员会成员

林昌先生,现任本基金管理人董事长兼代任总经理。

盛松先生,现任本基金管理人副总经理兼首席投资总监。

戴奇雷先生,现任本基金管理人权益投资部总监兼光大保德信中小盘混合型证券投资基金基金经理、光大保德信均衡精选混合型证券投资基金基金经理、光大保德信动态优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、光大保德信红利混合型证券投资基金基金经理。

上述人员无近亲属关系。

二、基金托管人

名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)
住所:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:王洪章
成立时间:2004年09月17日
组织形式:股份有限公司
注册资本:贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
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]12号
联系人:田　青
联系电话:(010)6759 5096

三、相关服务机构

(一)直销机构

名称:光大保德信基金管理有限公司
注册地址:上海市延安东路222号外滩中心大厦46层
办公地址:上海市黄浦区中山东二路558号外滩金融中心1幢(北区3号楼)6层至10层
电话:(021)80262466,80262481
传真:(021)80262482
客服电话:4008-202-888
联系人:刘佳
网址:www.epf.com.cn

(二)其他销售机构

1.东莞农村商业银行股份有限公司
注册地址:东莞市南城路2号
办公地址:东莞市南城路2号
法定代表人:何沛良
客服电话:0769-961122
联系人:谭少筠
电话:0769-22118343
传真:0769-22320896
网址: www.drcbank.com

2.光大证券股份有限公司
注册地址:上海市静安区新闸路1508号
办公地址:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:薛峰
电话:021-22169999
传真:021-22169134
客服电话:4008888788、10108998、95525
联系人:刘晨、李芳芳
网址:www.ebscn.com

3.广州证券股份有限公司
注册地址:广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层
办公地址: 广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层
法定代表人: 邱三发
客服电话:020-961303
联系人: 梁微
电话: 020-88836999-5408
传真:020-88836920
网址: www.gzs.com.cn

4.国金证券股份有限公司
注册地址:四川省成都市青羊区东城根上街95号
办公地址:四川省成都市青羊区东城根上街95号
法定代表人:冉云
客服电话:4006600109
联系人:贾鹏
电话:028-86690058
传真:028-86690126
网址: www.gjzq.com.cn

5.海银基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区东方路1217号16楼B单元
办公地址:上海市浦东新区东方路1217号陆家嘴金融服务广场6楼
法定代表人: 刘惠
联系人: 毛林
传真:021-80133413
电话: 021-80133597
客户服务电话:400-808-1016
公司网站:www.fundhaiyin.com

6.和讯信息科技有限公司
注册地址:北京市朝外大街22号泛利大厦10层
办公地址: 北京市朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人:王莉
客服电话:400-920-0022
联系人: 周轶
电话: 021-20835789
传真: 021-20835885
网址:licaike.hexun.com

7.申万宏源证券有限公司
注册地址:上海市徐汇区长乐路989号45层
办公地址:上海市徐汇区长乐路989号45层
法定代表人:李梅
联系人:黄莹
电话:021-33388211
传真:021-33388224
客服热线:95523或4008895523??
网址:www.swhysc.com

8.中国建设银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街25 号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:王洪章
客服电话:95533
联系人:王嘉朗
网址:www.ccb.com

9.联讯证券股份有限公司
注册地址:广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼
办公地址:广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼
法定代表人: 徐刚
客服电话:95564
联系人:彭蓬
电话:13480169928
传真:0572-2119391
公司网址:http://www.lxsec.com

10.上海陆金所资产管理有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1333号14楼09单元
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号
法定代表人:郭坚
客服电话:4008219031
联系人:宁博宇
电话:021-20665952
传真:021-22066653
网址:www.lufunds.com

11.诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市金山区廊下镇漕廊公路7650号205室
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴银城中路68号时代金融中心8楼801
法定代表人: 汪静波
客服电话:400-821-5399
联系人:刘艳妮 (运营部)
电话: 021-38509606
传真: 021-38509777
网址:www.noah-fund.com

12.平安银行股份有限公司
注册地址:深圳市深南中路1099号平安银行大厦
法定代表人:孙建一
客服电话:95511-3
联系人:管群
电话:021-33388111
传真:021-33388224
客服热线:95523或4008895523??
网址:www.sfnyc.com

13.上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
办公地址:上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903~906室
法定代表人:杨文斌
客服电话:400-700-9665
联系人: 张茹
电话:021-58870011
传真:021-68596919
网址:www.ehowbuy.com

14.上海天天基金销售有限公司
注册地址:浦东新区峨山路613号6幢551室
办公地址: 上海市徐汇区龙田路190号2号楼
法定代表人:其实
客服电话:400-1818-188
联系人: 潘世友
电话:021-54509988分机7019
传真:021-64383798
网址:www.1234567.com.cn

15.上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法定代表人:张跃伟
联系人:沈雯斌
联系电话:021-58788678-8201
传真:021-58787698
客服电话:400-089-1289
公司网站: www.erichfund.com

16.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1033室
办公地址:上海市浦东新区东方路989号中达广场201室
法定代表人: 盛大
客服电话:400-005-6355
联系人: 程毅
电话: 021-50583533
传真: 021-50583633
网址:www.leadfund.com.cn

17.深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
办公地址:北京市西城区金融大街35号 国际企业大厦C座9层
法定代表人:杨懿
客服电话:400-166-1188
联系人:刘宝文
电话:010-58325395
传真:010-58325282
公司网址: http://8.jrj.com

18.浙江金观诚财富管理有限公司
注册地址:浙江省杭州市拱墅区登云路45号(锦昌大厦)1幢10单元1001室
办公地址:浙江省杭州市拱墅区登云路55号(锦昌大厦)1号楼1楼金观诚财富大厅
法定代表人:徐黎云
客服电话:400-068-0058
联系人:宋舒岚
电话:0571-88337888
传真:0571-88337666

19.阳光人寿保险股份有限公司
注册地址:海南省三亚市河东区三亚河东路海康商务12、13层
办公地址:北京市朝阳区朝外大街乙12号1号楼昆泰国际大厦12层
法定代表人: 李科
联系人: 高晓芳
传真 :010-59053700
电话: 010-59053566
客户服务电话: 95510
公司网站: fund.sinosig.com

20.浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室
办公地址:浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2号楼2楼
法定代表人:凌顺平
联系电话:0571-88911818-8565
传真:0571-86800423
客服电话:0571-88920897、4008-773-772
公司网站:www.5ifund.com

基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

(三)登记机构

名称:光大保德信基金管理有限公司
注册地址:上海市延安东路222号外滩中心大厦46层
办公地址:上海市黄浦区中山东二路558号外滩金融中心1幢(北区3号楼)6层至10层
法定代表人:林昌
电话:(021)80262461
传真:(021)80262483
联系人:杨静

(四)出具法律意见书的律师事务所

名称:上海市通力律师事务所
注册地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:俞卫锋
电话:021-31358666
传真:021-31358600
联系人:孙睿
经办律师:黎明、孙睿

(四)审计基金财产的会计师事务所

公司全称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
注册地址:中国北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼(东三办公楼)16层
办公地址:上海市世纪大道100号环球金融中心50楼
法定代表人:葛明
电话:(021)22288888
传真:(021)22280000
联系人:徐艳
经办会计师:徐艳、蒋燕华

四、基金的名称和类型

基金的名称:光大保德信耀钱包货币市场基金
基金的类型:契约型开放式

五、基金的投资目标

本基金力争保持基金资产的流动性和安全性,追求高于业绩比较基准的稳定收益。

六、基金的投资方向

本基金的投资范围包括:现金;通知存款;短期融资券(包含超级短期融资券);剩余期限在397天以内(含397天)的债券(包含证券公司短期公司债券); 1年以内(含1年)的银行定期存款、大额存单;

期限在1年以内(含1年)的债券回购;剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券;期限在1年以内(含1年)的中央银行票据(以下简称“央行票据”);剩余期限在397天以内(含397天)中期票据;中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

七、基金的投资策略

本基金将综合考虑各类投资品种的收益和风险特征，在保证基金资产安全性的基础上力争为投资人创造稳定的收益。同时,本基金将关注宏观经济走势、货币政策和财政政策的变化,结合对货币市场利率变动的预测,对投资组合进行管理。

1、久期策略

本基金将在对宏观经济环境深入研究的基础上,预期未来市场利率的变化趋势,确定本基金的久期。若预测未来利率将上升,则本基金将通过缩短组合平均剩余期限的办法规避利率风险;若预测未来利率下降,则本基金将延长组合平均剩余期限,获取利率下降带来的回报。

2、类属资产配置策略

类属配置指组合在各类短期金融工具如央行票据、国债、金融债、企业短期融资券以及现金等投资品种之间的配置比例。本基金将通过分析各类属的相对收益、利差变化、流动性风险、信用风险等因素来确定类属配置比例,寻找具有投资价值的投资品种,力争取得较高的回报。

3、银行存款投资策略

银行存款一般具有收益稳定、风险低等基本特征,特别是机构投资者在投资银行存款时,往往能获得比普通投资者更高的收益率。本基金在投资银行存款时将对不同银行的银行存款收益率做深入的分析,同时结合各银行的信用等级、存款期限等因素的研究,综合考量整体利率市场环境及其变动趋势,在严格控制风险的前提下决定各银行存款的投资比例。

4、个券选择策略

在个券选择层面,将首先考虑安全性因素,优先选择央票、短期国债等高信用等级的债券品种以规避违约风险。在具体的券种选择上,基金管理人将在正确拟合收益率曲线的基础上,找出收益率出现明显偏离的券种,并客观分析收益率出现偏离的原因。若出现因市场原因所导致的收益率高于公允水平,则该券种价格出现低估,本基金将对此类低估品种进行重点关注。此外,鉴于收益率曲线可以判断出定价偏高或偏低的期限段,从而指导相对价值投资,这也可以帮助基金管理人选择投资于定价低估的短期债券品种。

5、资产支持证券投资策略

资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上,对资产支持证券的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析,采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略,投资于资产支持证券。

6、证券公司短期公司债券投资策略

对于证券公司短期公司债券,本基金将通过对证券行业分析、证券公司资产负债分析、公司现金流分析等调查研究,对拟投资或已投资的证券公司短期公司债券进行流动性分析和监测,尽量选择流动性相对较好的品种进行投资,并适当控制债券投资组合整体的久期,保证本基金的流动性。为防范大额赎回可能引发的流动性风险,本基金将尽量选择可回售给发行方的证券公司短期公司债券进行投资;同时,紧急情况下,为保护基金份额持有人的利益,基金管理人还将启用风险准备金防范流动性风险。基金投资证券公司短期公司债券,基金管理人将根据审慎原则,制定严格的投资决策流程、风险控制制度,并经董事会批准,以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

7、回购策略

基金管理人将密切关注短期资金需求激增的机会,通过逆回购的方式融出资金以分享短期资金利率陡升的投资机会。

八、基金的业绩比较标准

本基金的业绩比较基准为人民币活期存款利率(税后)。

九、风险收益特征

本基金属于证券投资基金中的风险较低的品种,其预期收益和风险低于债券型基金、混合型基金和股票型基金。

十、基金的投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年12月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

报告期末基金资产组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	149,965,647.25	35.14
	其中:债券	149,965,647.25	35.14
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	70,000,345.00	16.40
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	205,132,175.22	48.06
4	其他各项资产	1,683,817.04	0.39
5	合计	426,781,984.51	100.00

2. 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	0.79	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	金额
2	报告期末债券回购融资余额		
	其中:买断式回购融资	-	-

备注:上表中,报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的情况

备注:报告期内不存在债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的情况。

3. 基金投资组合平均剩余期限

(1)投资组合平均剩余期限基本情况

项 目	天 数
报告期末投资组合平均剩余期限	87
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	105
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	43

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

报告期内投资组合平均剩余期限未有违规超过180天的情况

(2)期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	48.08	
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	2.34	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	18.75	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	11.73	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	18.74	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.64	

4. 报告期末债券投资组合

(1)按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,028,473.91	11.73
	其中:政策性金融债	50,028,473.91	11.73
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	99,937,173.34	23.42
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	149,965,647.25	35.15
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

(2)基金投资前十名债券明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150215	15国开15	400,000	40,026,104.43	9.38
2	011699515	16凤传媒SCP001	200,000	19,990,743.72	4.69
3	011699509	16京控SCP001	200,000	19,989,266.01	4.69
4	011699514	16华润医药SCP002	200,000	19,971,251.93	4.68
5	150206	15国开06	100,000	10,002,369.48	2.34
6	011598145	15山部SCP009	100,000	9,998,533.72	2.34
7	011699257	16能交控SCP001	100,000	9,997,020.94	2.34
8	011699505	16国航股SCP002	100,000	9,996,486.95	2.34
9	041658004	16鲁宏桥CP001	100,000	9,993,870.07	2.34

5. 影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项 目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%(含)-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.0793%
报告期内偏离度的最低值	-0.0323%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0451%

6. 投资组合报告附注

(1)基金计价方法说明

①本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内摊销,每日计提损益。

② 为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按市场利率和交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释和不公平的结果,基金管理人于每一估值日,采用市场利率或交易价格,对基金持有的估值对象进行重新评估,即“影子定价”。当基金资产净值与影子定价的偏离达到或超过基金资产净值的一定幅度时,或基金管理人认为发生了其他的重大偏离时,基金管理人可以与基金托管人商定后进行调整,使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值,确保以摊余成本法计算的基金资产净值不会对基金持有人造成实质性的损害。

③ 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的方法估值。

④ 如有新增事项或变更事项,按国家最新规定估值。

(2)本报告期内不存在剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

(3)本基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(5)其他资产的构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	1,593,761.46
4	应收申购款	90,055.58
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
	合计	1,683,817.04

十一、基金的业绩

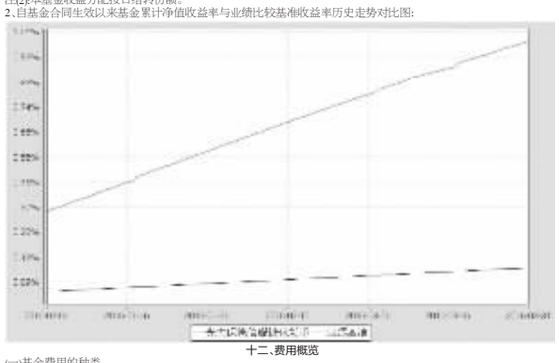
1、历史各时间段收益率与同期业绩比较基准收益率比较:

阶段	基金净值收益率①	基金净值收益率标准差②	比较基准收益率③	比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2015年11月3日-2015年12月31日	0.3460%	0.0024%	0.0574%	0.0000%	0.2886%	0.0024%
2016年1月1日-2016年3月31日	0.6318%	0.0015%	0.0885%	0.0000%	0.5433%	0.0015%
自成立以来	0.9799%	0.0020%	0.1458%	0.0000%	0.8341%	0.0020%

注(1):本基金合同生效日为2005年6月9日。

注(2):本基金收益分配按日结转份额。

2、自基金合同生效以来基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图:



十二、费用概览

(一)基金费用的种类

1、基金管理人的管理费;
2、基金托管人的托管费;
3、销售服务费;
4、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;
5、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费;
6、基金份额持有人大会费用;
7、基金的证券交易费用;
8、基金的银行汇划费用;
9、证券账户开户费用、银行间账户维护费;
10、按照国家有关规定和基金合同约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.27%年费率计提。基金管理费的计算方法如下:

H=E×0.27%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付,于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等致使无法按时支付的,支付日期顺延至最近可支付日支付。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.08%的年费率计提。基金托管费的计算方法如下:

H=E×0.08%÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付,于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等致使无法按时支付的,支付日期顺延至最近可支付日支付。

3.基金销售服务费

本基金的年销售服务费率为0.25%,销售服务费计提的计算公式具体如下:

H=E×年销售服务费率÷当年天数
H为每日应计提的基金销售服务费
E为前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付,于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付基金管理人的资金清算账户。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等致使无法按时支付的,支付日期顺延至最近可支付日支付。

上述《一)基金费用的种类”中第4-10项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入或摊入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

当出现巨额赎回时,为保护投资者利益,本基金管理人与基金托管人协商一致后,有权不计提巨额赎回日下一个工作日的基金管理费和销售服务费,相关事项无需另行公告。

(三)不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
3、基金合同生效前的相关费用;
4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

十三、对招募说明书更新部分的说明

基金管理人依据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,对本基金招募说明书进行了更新,主要更新内容列示如下:

1.在“重要提示”中,更新了招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。
2.“三、基金管理人”部分,根据实际情况进行了更新。
3.在“四、基金托管人”部分,根据实际情况进行了更新。
4.在“五、相关服务机构”部分,根据实际情况进行了更新。
5.在“六、基金的募集”部分,根据实际情况进行了更新。
6.在“七、基金合同的生效”部分,根据实际情况进行了更新。
7.在“八、定期定额申购业务”部分,更具实际情况进行了更新,并更新了《十一)基金转换、(十五)定期定额投资计划”中销售机构”的相关信息。
8.在“基金的投资”部分,将《九)基金投资组合报告”内容更新至2016年3月31日。
9.将“十、基金的业绩”部分将数据更新至2016年3月31日。
10.在“二十、基金托管协议的内容摘要”部分,根据实际情况进行了更新。
11.在“二十二、其它应披露事项”部分,对2015年11月4日至2016年5月8日期间公司及本基金涉及的事项进行了披露。

光大保德信基金管理有限公司
2016年6月17日

证券代码:600661　证券简称:新南洋　公告编号:2016-022

上海新南洋股份有限公司2015年年度股东大会决议公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

重要内容提示:

●本次会议是否有否决议案:无

一、会议召开和出席情况

(一)股东大会召开的时间:2016年6月16日

(二)股东大会召开的地点:上海市广元西路55号浩然高科技大厦1楼会议室

(三)出席会议的普通股股东和恢复表决权的优先股股东及其持有股份情况:

1、出席会议的股东和代理人人数	18
2、出席会议的股东所持有表决权的股份总数(股)	130,329,381
3、出席会议的股东所持有表决权股份数占公司有表决权股份总数的比例(%)	50.3054

(四)表决方式是否符合《公司法》及《公司章程》的规定,大会主持情况等。

本次股东大会采取现场记名投票与网络投票相结合的表决方式,本次会议由董事长刘玉文主持,会议符合《公司法》及《公司章程》等的规定。

(五)公司董事、监事和董事会秘书的出席情况

1、公司在任董事10人,出席8人,董事苏文骏、独立董事陈伟志因故未出席;

2、公司在任监事5人,出席4人,监事张路因故未出席;

3、董事会秘书杨夏出席会议;公司其他高管(董事兼总经理吴竹平、董事兼副总经理林涛、副总经理宋培林、总会计师刘江萍)出席会议。

二、议案审议情况

(一)非累积投票议案

1、议案名称:审议《公司2015年度董事会工作报告》

审议结果:通过

表决情况:

股东类型	同意		反对		弃权	
	票数	比例(%)	票数	比例(%)	票数	比例(%)
A股	130,264,781	99.9504	0	0.0000	64,600	0.0496

2、议案名称:审议《公司2015年度监事会工作报告》

审议结果:通过

表决情况:

股东类型	同意		反对		弃权	
	票数	比例(%)	票数	比例(%)	票数	比例(%)
A股	130,264,781	99.9504	0	0.0000	64,600	0.0496

3、议案名称:审议《公司2015年度财务决算及2016年度财务预算的报告》

审议结果:通过

表决情况:

股东类型	同意		反对		弃权	
	票数	比例(%)	票数	比例(%)	票数	比例(%)
A股	130,264,781	99.9504	0	0.0000	64,600	0.0496

4、议案名称:审议《关于公司续聘会计师事务所的议案》

审议结果:通过

表决情况:

股东类型	同意		反对		弃权	
	票数	比例(%)	票数	比例(%)	票数	比例(%)
A股	130,264,781	99.9504	0	0.0000	64,600	0.0496

5、议案名称:审议《关于公司2015年度利润分配预案的议案》

审议结果:通过

表决情况:

股东类型	同意		反对		弃权	
	票数	比例(%)	票数	比例(%)	票数	比例(%)
A股