（上接B85版）

客服电话:95360
公司网址:www.nesc.cn
30.东兴证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
办公地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
法定代表人:魏庆华
联系人:汤漫川
电话:010-66555316
传真:010-66555133
客服电话:4008888993
网址:www.dxzq.net
31. 上海基煜基金销售有限公司
注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济发展区）
办公地址：上海市杨浦区昆明路518号A1002室
法定代表人:王翔
联系人：蓝杰
电话：021-65370077
传真：021-55085991
客户服务电话：4008-205-369
网址：www.jiyufund.com.cn
（三）登记机构
名称:光大保德信基金管理有限公司
注册地址:上海市黄浦区中山东二路558号外滩金融中心1幢,6层至10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）80262888
传真:（021）80262483
联系人:杨静
（四）律师事务所和经办律师
名称：上海源泰律师事务所
注册地址:上海浦东南路256号华夏银行大厦1405室
办公地址:上海浦东南路256号华夏银行大厦1405室
负责人:廖海
电话:（021）51150298
传真:（021）51150398
联系人:刘佳
经办律师:廖海、刘佳
（五）会计师事务所和经办注册会计师
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:中国上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心50楼
法定代表人:吴港平
电话:（021）22288888
传真:（021）22280000
联系人:蒋燕华
经办会计师:边卓群、蒋燕华
四、基金的名称:
光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金
五、基金的类型:
契约性开放式
六、基金的投资目标:
本基金力争在股票、债券和现金等大类资产的灵活配置与稳健投资下,获取长期、持续、稳定的合理回报。
七、基金的投资方向
本基金可投资于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、固定收益类金融工具、权证、股指期货、国债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。
基金的投资组合比例为:本基金股票资产占基金资产的比例范围为0%—95%;每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货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%的现金或到期日在一年以内的政府债券。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制,以变更后的比例为准,本基金的投资比例会做相应调整。
八、基金的投资策略
1、资产配置策略
本基金将通过对宏观经济基本面及证券市场双层面的数据进行研究,并通过定性定量分析、风险测算及组合优化,最终形成大类资产配置决策。
（1）宏观经济运行的变化和国家的宏观调控政策将对证券市场产生深刻影响。本基金通过综合国内外宏观经济状况、国家财政政策、央行货币政策、物价水平变化趋势等因素,构建宏观经济分析平台;
（2）运用历史数据并结合基金管理人内部的定性和定量分析模型,确定影响各类资产收益水平的先行指标,将上一步的宏观经济分析结果量化为对先行指标的影响,进而判断对各类资产收益的影响;
（3）结合上述宏观经济对各类资产未来收益影响的分析结果和本基金投资组合的风险预算管理,确定各类资产的投资比重。
2、股票投资策略
本基金将结合自上而下行业分析与自下而上研究入库的投资理念，在以整个宏观策略为前提下,把握结构性调整机会,将行业分析与个股精选相结合,寻找出表现优异的子行业和优质个股,并将这些股票组成本基金的核心股票库。
（1）行业分析
在综合考虑行业的周期、竞争格局、技术进步、政府政策、社会习惯的改变等因素后,精选出行业地位高、行业的发展空间大的子行业。
（2）个股选择
本基金将在核心股票库的基础上,以定性和定量相结合的方式,从价值和成长等因素对个股进行选择,综合考虑上市公司的增长潜力与市场估值水平,精选估值合理且成长性良好的上市公司进行投资。同时,本基金关注国家相关政策、事件可能对上市公司的当前或未来价值产生的重大影响,本基金将在深入挖掘这类政策、事件的基础上,对行业进行优化配置和动态调整。
1）定量分析
本基金结合盈利增长指标、现金流量指标、负债比率指标、估值指标、盈利质量指标等与上市公司经营有关的重要定量指标,对目标上市公司的价值进行深入挖掘,并对上市公司的盈利能力、财务质量和经营效率进行评析,为个股选择提供依据。
2）定性分析
本基金认为股票价格的合理区间并非完全由其财务数据决定，还必须结合企业学习与创新能力、企业发展战略、技术专利优势、市场拓展能力、公司治理结构和管理水平、公司的行业地位、公司增长的可持续性等定性因素,给予股票一定的折溢价水平,并最终决定股票合理的价格区间。根据上述定性定量分析的结果,本基金进一步从价值和成长两个纬度对备选股票进行评估。对于价值被低估且成长性良好的股票,本基金将重点关注;对于价值被高估但成长性良好,或价值被低估但成长性较差的股票,本基金将通过深入的调研和缜密的分析,有选择地进行投资;对于价值被高估且成长性较差的股票,本基金不予考虑投资。
3、固定收益类品种投资策略
本基金投资于固定收益类品种的目的是在保证基金资产流动性的基础上，使基金资产得到更加合理有效的利用,从而提高投资组合收益。为此,本基金固定收益类资产的投资将在限定的投资范围内,根据国家货币政策和财政政策实施情况、市场收益率曲线变动情况、市场流动性情况来预测债券市场整体利率趋势,同时结合各具体品种的供需情况、流动性、信用状况和利率敏感度等因素进行综合分析,在严格控制风险的前提下,构建和调整债券投资组合。在确定固定收益投资组合的具体品种时,本基金将根据市场对于个券的市场成交情况,对各个目标投资对象进行利差分析,包括信用利差,流动性利差,期权调整利差（OAS）,并利用利率模型对利率进行模拟预测,选出定价合理或被低估,到期期限符合组合构建要求的固定收益品种。
4、股指期货投资策略
本基金将在风险可控的前提下,以套期保值为目的,根据对现货和期货市场的分析,充分考虑股指期货的风险收益特征,通过多头或空头的套期保值策略,以改善投资组合的投资效果,实现股票组合的超额收益。
5、国债期货投资策略
基金管理人可运用国债期货,以提高投资效率。本基金在国债期货投资中将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与国债期货的投资,以管理投资组合的利率风险,改善组合的风险收益特性。
6、中小企业私募债投资策略
与传统的信用债相比,中小企业私募债券采取非公开方式发行和交易,整体流动性相对较差,而且受到发债主体企业产规模较小、经营波动性较高、信用基本面稳定性较差的影响,整体的信用风险相对较高。因此,对于中小企业私募债券的投资应采取更为谨慎的投资策略。本基金认为,投资该类债券的核心要点是对个券信用资质进行详尽的分析,并综合考虑发行人的企业性质、所处行业、资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性等关键因素,确定最终的投资决策。
7、证券公司短期公司债券投资策略
本基金通过对证券公司短期公司债券发行人基本面的深入调研分析，结合发行人资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性以及债券流动性、信用利差、信用评级、违约风险等的综合评估结果,选取具有价格优势和套利机会的优质信用债券进行投资。
8、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。
9、权证及其他品种投资策略
本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究，结合期权定价量化模型估算权证价值,主要考虑运用的策略有:价值挖掘策略、杠杆策略、双向权证策略、获利保护策略和套利策略等。
同时,法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,本基金若认为有助于基金进行风险管理和组合优化的，可依据法律法规的规定履行适当程序后，运用金融衍生产品进行投资风险管理。
九、基金的业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为:一年期银行定期存款收益率（税后）+ 3%。
十、基金的风险收益特征
本基金为混合型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。
十一、基金的投资组合报告
本投资组合报告所载数据截止2017年3月31日。
1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	126,576,833.17	12.68
	其中:股票	126,576,833.17	12.68
2	固定收益投资	752,916,500.00	75.44
	其中:债券	752,916,500.00	75.44
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	100,000,390.00	10.02
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	6,919,667.94	0.69
7	其他各项资产	11,675,321.68	1.17
8	合计	998,088,712.79	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	59,825,193.24	6.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	26,646,896.92	2.93
E	建筑业	25,029.52	0.00
F	批发和零售业	74,088.00	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	131,314.89	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	32,154,310.60	3.53
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	7,720,000.00	0.85
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	126,576,833.17	13.91

3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600681	百川能源	1,621,844.00	26,646,896.92	2.93
2	002236	大华股份	1,109,900.00	17,725,103.00	1.95
3	300196	长海股份	436,685.00	16,318,918.45	1.79
4	600837	海通证券	700,000.00	10,220,000.00	1.12
5	601377	兴业证券	1,299,910.00	9,957,310.60	1.09
6	002531	天顺风能	1,329,950.00	9,735,234.00	1.07
7	600690	青岛海尔	660,000.00	8,038,800.00	0.88
8	000035	中国天楹	1,000,000.00	7,720,000.00	0.85
9	600109	国金证券	500,000.00	6,850,000.00	0.75
10	000776	广发证券	300,000.00	5,127,000.00	0.56

4 报告期末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	49,998,000.00	5.50
	其中:政策性金融债	49,998,000.00	5.50
4	企业债券	197,699,000.00	21.73
5	企业短期融资券	74,970,500.00	8.24
6	中期票据	380,034,000.00	41.77
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	50,215,000.00	5.52
10	合计	752,916,500.00	82.75

5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	101453021	14粤城建MTN001	600,000	61,986,000.00	6.81
2	118910	14东北债	500,000	50,215,000.00	5.52
3	136523	16广新03	500,000	47,510,000.00	5.22
4	101659051	16国能源MTN003	500,000	46,345,000.00	5.09
5	160211	16国开11	400,000	39,976,000.00	4.39

6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。
7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。
8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有股指期货。
10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货。
11 投资组合报告附注
11.1
1、报告期内本基金投资的前十名证券中，兴业证券（601377）的发行主体于2016年7月9日发布公告称收到中国证券监督管理委员会下发的《行政处罚及市场禁入事先告知书》（处罚字〔2016〕70号），该告知书主要内容为:兴业证券在推荐欣泰电气申请首次公开发行股票并在创业板上市过程中,未遵守业务规则和行业规范,未勤勉尽责地对欣泰电气IPO申请文件进行审慎核查,出具的发行保荐书、《兴业证券股份有限公司关于丹东欣泰电气股份有限公司之2012年度财务报告专项检查自查工作报告》等文件存在虚假记载;在欣泰电气公开发行股票过程中,公司作为主承销商,未审慎核查公开发行募集文件的真实性和准确性,未发现《招股意向书》和《招股说明书》中涉及欣泰电气应收账款、流动资产和经营活动产生的现金流量净额等项目的财务数据存在虚假记载。
对该股票投资决策程序的说明：投资研究部按照内部研究工作规范对该股票进行分析后将其列入基金投资对象备选库并跟踪研究，在此基础上本基金的基金经理根据具体市场情况独立作出投资决策。该行政处罚事件发生后,本基金管理人对该股票的发行主体进行了进一步了解与分析,认为此事件未对该股票投资价值判断产生重大的实质性影响。本基金投资于该股票的投资决策过程符合制度规定的投资权限范围与投资决策程序。
2、报告期内本基金投资的前十名证券中,海通证券（600837）的发行主体于2016年11月29日发布公告称收到中国证券监督管理委员会下发的《行政处罚决定书》（［2016］127号），该告知书主要内容为：海通证券上海建国西路营业部和杭州解放路营业部对杭州恒生网络技术服务有限责任公司HOMS系统（以下简称HOMS系统）开放专线接入，其中第一条专线于2014年3月由零售与网络金融部、信息技术管理部、合规与风险管理总部平行审核后接入上线。第二条专线于2015年2月由零售与网络金融部、合规与风险管理总部、信息技术管理部平行审核后接入上线。对于上述外部接入第三方交易终端软件,海通证券未进行软件认证许可,未对外部系统接入实施有效管理,对相关客户身份情况缺乏了解。截止调查日,海通证券客户中,有120个使用HOMS系统接入的主账户。对上述客户,海通证券未按要求采集客户交易终端信息,未能确保客户交易终端信息的真实性、准确性、完整性、一致性、可读性。未采取可靠措施采集、记录与客户身份识别有关的信息。海通证券通过添加白名单方式允许客户使用HOMS系统进行交易,缺少实质性审核。在客户回访方面,海通证券虽然对客户进行了回访,但在回访时没有对客户交易委托电话、IP、MAC等与客户进行全面核对。使用HOMS系统进行分仓交易的账户由于操作子账户多,主账户的交易较为频繁、异常,明显不同于其他普通账户,但海通证券没有对该等账户重点关注,缺少有效监督。海通证券在未采集、上送客户身份识别信息的情况下,未实施有效的了解客户身份的回访、检查等程序。综上,海通证券未按照《证券登记结算管理办法》第二十四条,《关于加强证券期货经营机构客户交易终端信息等客户信息管理的规定》第六条、第八条、第十三条,《中国证监会关于加强证券经纪业务管理的规定》第三条第（四）项,《中国证券登记结算有限责任公司证券账户管理规则》第五十条的规定对客户的身份信息进行审查和了解,违反了《证券公司监督管理条例》第二十八条第一款的规定,构成《证券公司监督管理条例》第八十四条第（四）项所述的行为,获利2865.3万元。时任海通证券零售与网络金融部总经理丁学清及邹二海、信息技术管理部总经理沈云明、合规与风险管理总部副总经理宋世浩是直接负责的主管人员,宁波百丈东路营业部前台负责人高宏杰、宁波百丈东路营业部总经理方贤明、杭州解放路营业部副总经理汪峥为其他直接责任人员。
对该股票投资决策程序的说明：投资研究部按照内部研究工作规范对该股票进行分析后将其列入基金投资对象备选库并跟踪研究，在此基础上本基金的基金经理根据具体市场情况独立作出投资决策。该行政处罚事件发生后,本基金管理人对该股票的发行主体进行了进一步了解与分析,认为此事件未对该股票投资价值判断产生重大的实质性影响。本基金投资于该股票的投资决策过程符合制度规定的投资权限范围与投资决策程序。
3、报告期内本基金投资的前十名证券中，广发证券（000776）的发行主体于2016年11月28日发布公告称收到中国证券监督管理委员会下发的《行政处罚决定书》（［2016］128号），该告知书主要内容为： 2014年9月，广发证券对杭州恒生网络技术服务有限责任公司HOMS系统（以下简称HOMS系统）开放接入。同年12月,广发证券上海分公司对该系统开放专线接入,2015年5月19日,专线连通。2015年3月30日,广发证券上海分公司为上海铭创软件技术有限公司系统（以下简称铭创系统）安装第三个交易网关。对于上述外部接入的第三方交易终端软件,广发证券未进行软件认证许可,未对外部系统接入实施有效管理,对相关客户身份情况缺乏了解。截止调查日,广发证券客户中有123个使用HOMS系统、铭创系统接入的主账户。对上述客户,广发证券未采集客户交易终端信息,未能确保客户交易终端信息的真实性、准确性、完整性、一致性、可读性,未采取可靠措施采集、记录与客户身份识别有关的信息。2015年5月25日，广发证券已知悉并关注HOMS系统等系统存在引发违规配资及违反账户实名制管理有关规定等问题，广发证券在未采集上述客户身份识别信息的情况下,未实施有效的了解客户身份的回访、检查等程序。综上,广发证券未按照《证券登记结算管理办法》第二十四条,《关于加强证券期货经营机构客户交易终端信息等客户信息管理的规定》第六条、第八条、第十三条,《中国证监会关于加强证券经纪业务管理的规定》第三条第（四）项,《中国证券登记结算有限责任公司证券账户管理规则》第五十条的规定对客户的身份信息进行审查和了解,违反了《证券公司监督管理条例》第二十八条第一款的规定,构成《证券公司监督管理条例》第八十四条第（四）项所述的行为,获利6,805,135.75元。时任广发证券经纪业务总部总经理王新栋、信息技术部总经理林建何为直接负责的主管人员,广发证券上海分公司总经理梅纪元、上海分公司电脑部主管周翔为其他直接责任人员。
对该股票投资决策程序的说明：投资研究部按照内部研究工作规范对该股票进行分析后将其列入基金投资对象备选库并跟踪研究，在此基础上本基金的基金经理根据具体市场情况独立作出投资决策。该行政处罚事件发生后,本基金管理人对该股票的发行主体进行了进一步了解与分析,认为此事件未对该股票投资价值判断产生重大的实质性影响。本基金投资于该股票的投资决策过程符合制度规定的投资权限范围与投资决策程序。
11.2本基金未投资超出基金合同规定的备选股票库。
11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	160,013.00
2	应收证券清算款	346,646.90
3	应收股利	-
4	应收利息	11,168,661.78
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,675,321.68

11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600681	百川能源	26,646,896.92	2.93	重大事项

十二、基金的业绩
本基金管理人承诺以诚实信用、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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。基金业绩数据截至2017年3月31日。
（一）基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表
1. 光大保德信鼎鑫灵活配置混合A类

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2015年6月11日至2015年12月31日	1.30%	0.14%	2.64%	0.00%	-1.34%	0.14%
2016年1月1日至2016年12月31日	1.48%	0.16%	4.51%	0.00%	-3.03%	0.16%
2017年1月1日至2017年3月31日	0.10%	0.12%	1.09%	0.00%	-0.99%	0.12%
自基金合同生效日至今	2.90%	0.15%	8.45%	0.00%	-5.55%	0.15%

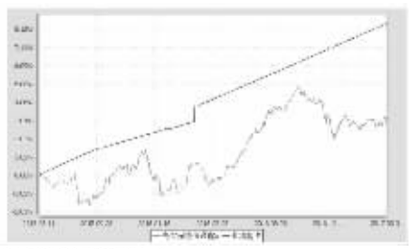
2. 光大保德信鼎鑫灵活配置混合C类

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2015年11月11日至2015年12月31日	0.80%	0.19%	0.62%	0.00%	0.18%	0.19%
2016年1月1日至2016年12月31日	0.20%	0.17%	4.51%	0.00%	-4.31%	0.17%
2017年1月1日至2017年3月31日	0.00%	0.11%	1.09%	0.00%	-1.09%	0.11%
自基金合同生效日至今	1.00%	0.16%	6.30%	0.00%	-5.30%	0.16%

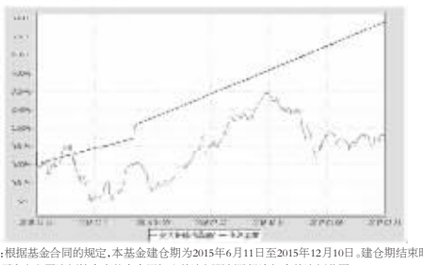
（二）自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
（2015年6月11日至2017年3月31日）

1. 光大保德信鼎鑫灵活配置混合A类



2. 光大保德信鼎鑫灵活配置混合C类



注:根据基金合同的规定,本基建仓期为2015年6月11日至2015年12月10日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。
十三、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、基金的销售服务费;
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、期货交易费用;
8、基金的银行汇划费用;
9、证券、期货账户开户费用和银行间账户维护费;
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0.6%年费率计提。基金管理费的计算方法如下:
H＝E×0.6%÷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,按月支付,由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。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0.15%的年费率计提。基金托管费的计算方法如下:
H＝E×0.15%÷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,按月支付,由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。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、基金的销售服务费
销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金份额分为不同的类别,适用不同的销售服务费率。其中,A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额销售服务费年费率为0.25%。
本基金C类基金份额销售服务费计提的计算公式如下:
H＝E×0.25%÷当年天数
H为C类基金份额每日应计提的基金销售服务费
E为前一日C类基金份额的基金资产净值
C类基金份额的销售服务费每日计提,按月支付,由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。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当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。
（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。
（四）基金费用的调整
在遵守相关的法律法规并履行了必要的程序的前提下，基金管理人和基金托管人协商一致后可酌情降低基金管理费、基金托管费、销售服务费。此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须于新的费率实施日前按照《信息披露办法》的规定在指定媒介上刊登公告。
（五）申购和赎回的费用
1、本基金的申购费率见下表:
本基金A类基金份额在申购时收取基金前端认购费用;C类基金份额不收取申购费用。
通过直销机构申购本基金A类基金份额的养老金客户申购费率见下表:

申购金额（含申购费）	A类基金份额申购费率
50万元以下	0.08%
50万元（含50万元）到100万元	0.05%
100万元（含100万元）到500万元	0.03%
500万元以上（含500万元）	每笔交易1000元

其他投资者申购本基金A类基金份额申购费率见下表:

申购金额（含申购费）	A类基金份额申购费率
50万元以下	0.80%
50万元（含50万元）到100万元	0.50%
100万元（含100万元）到500万元	0.30%
500万元以上（含500万元）	每笔交易1000元

2、本基金的A类基金份额赎回费率见下表:

持续持有期	A类基金份额赎回费率
7天以内	1.5%
7天（含7天）到30天	0.75%
30天（含30天）到6个月	0.5%
6个月以上（含6个月）	0

本基金的C类基金份额赎回费率见下表:

持续持有期	C类基金份额赎回费率
30天以内	0.5%
30天以上（含30天）	0

对持续持有期少于30日的投资人收取的赎回费全额计入基金财产;对持续持有期少于3个月的投资人收取的赎回费,将不低于赎回费总额的75%计入基金财产;对持续持有期长于3个月但少于6个月的投资人收取的赎回费,将不低于赎回费总额的50%计入基金财产,未计入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。
（六）转换费
基金转换费用由转出和转入基金的申购费补差和转出基金的赎回费两部分构成，具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率和赎回费率的差异情况而定。基金转换费用由申请办理该项业务的基金投资者承担。具体公式如下:
(1).转出金额:
转出金额＝转出基金份额×转出基金当日基金单位资产净值
(2).转换费用:
如果转入基金的申购费率≥转出基金的申购费率:
转换费用＝转出金额×转出基金赎回费率＋转出金额×（1－转出基金赎回费率）×转出基金与转入基金的申购费率差/（1＋转出基金与转入基金的申购费率差）
如果转出基金的申购费率＜转入基金的申购费率:
转换费用＝转出金额×转出基金赎回费率
各基金在转换过程中转出金额对应的转出基金或转入基金申购费用为固定费用时，则该基金计算补差费率时的转出基金的原申购费率或转入基金申购费率视为0;
基金在完成转换后不连续计算持有期;
转出基金与转入基金的申购费率差为基金转换当日转出金额对应得转出基金和转入基金的申购费率之差。
具体赎回费费率以及各基金申购费率差请参照相应的基金合同或相关公告。
(3).转入金额与转入份额:
转入金额＝转出金额－转换费用
转入份额＝转入金额÷转入基金当日基金单位资产净值
十四、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》、《证券投资基金管理公司治理准则（试行）》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.在“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“八、基金份额的申购与赎回”部分,根据实际情况进行了更新。
6.在“九、基金的投资”部分,将“（十二）基金投资组合报告”内容更新至2017年3月31日。
7.将“十、基金的业绩”部分将数据更新至2017年3月31日。
8.在“十三、基金的费用与税收”部分,根据实际情况进行了更新。
9.在“十六、基金的信息披露”部分,根据实际情况进行了更新。
10.在“二十一、对基金份额持有人的服务”部分,根据实际情况进行了更新。
11.“二十二、其它应披露事项”部分,对2016年12月11日至2017年6月10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
2017年7月25日

证券代码:002537　证券简称:海立美达　公告编号:2017-089

青岛海立美达股份有限公司关于联动优势电子商务有限公司使用部分闲置自有资金进行结构性存款的进展公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

2017年4月5日,青岛海立美达股份有限公司（以下称“公司”或“本公司”）召开的第三届董事会第十八次会议审议通过了《关于公司及子公司进行现金管理的议案》,同意公司在确保资金安全、操作合法合规、保证日常经营以及募投项目实施不受影响的前提下,利用部分闲置自有资金及募集资金进行现金管理，公司董事会同意授权公司总裁行使该项投资决策权并办理相关事项，每次投资金额不超过50,000万元，合计在授权时间内投资金额不超过180,000万元,以上资金额度在授权有效期内可滚动使用,具体内容详见公司2017年4月7日披露于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》和公司指定信息披露网站巨潮资讯网http://www.cninfo.com.cn的《关于公司及子公司进行现金管理的公告》（公告编号:2017-036）,该议案已经公司2016年度股东大会审议通过。

一、本次认购产品基本内容

近日,公司三级全资子公司联动优势电子商务有限公司（下称“联动商务”）根据上述决议与中国民生银行股份有限公司北京分行签订了《中国民生银行理财产品协议书》,使用部分闲置自有资金进行结构性存款合计 15,000 万元,具体情况如下:

认购主体	产品种类	产品类型	金额（万元）	预期收益率（年化）	产品期限	利息起止日	投资范围/挂钩标的
联动商务	结构性存款	保本浮动收益型	15,000	4.0%	40天	2017/7/21—2017/8/30	USD3M-LIBOR

二、关联关系说明

公司及联动商务与中国民生银行股份有限公司北京分行无关联关系。

三、风险控制措施

1、董事会授权公司总裁签署相关法律文件,公司或子公司财务负责人负责组织实施并及时分析和跟踪,如发现存在可能影响公司资金安全的风险因素,将及时采取相应措施,控制投资风险。

2、公司内部审计部负责理财资金使用与保管情况的审计与监督,每个季度末应对所有理财产品投资项目进行全面检查,并根据谨慎性原则,合理的预计各项投资可能发生的收益和损失,并向审计委员会报告。

3、独立董事、监事会有权对资金使用情况进行监督与检查,必要时可以聘请专业机构进行审计。

4、公司将根据深圳证券交易所的有关规定,及时履行信息披露义务。

四、对公司经营的影响

公司本次使用自有资金进行结构性存款，是在确保公司正常经营所需流动资金的前提下进行的,不会影响公司正常业务的开展,并且可以提高资金使用效率,降低财务费用。

五、公司累计委托理财及结构性存款情况

截至本公告作出之日,公司及子公司累计以自有资金进行现金管理的金额为121,800万元,以闲置募集资金购买银行理财产品的金额为360,896万元,均在公司董事会及股东大会审批额度内。

截至目前,前述121,800万元现金管理中的93,800万元资金本金及收益已收回;360,896万元银行理财产品中的284,000万元资金本金及收益已收回。具体情况如下:

类型	签订单位	起息日	到期日	天数	资金来源	金额(万元)	情况
结构性存款	联动商务	2016.10.20	2016.11.24	35	自有资金	10,000	已收回
银行理财	海立美达	2016.12.19	2017.03.15	86	募集资金	20,000	已收回
银行理财	海立美达	2016.12.16	2017.01.16	31	募集资金	20,000	已收回
银行理财	海立美达	2016.12.16	2017.01.16	31	募集资金	43,000	已收回
银行理财	海立美达	2016.12.20	2017.2.20	62	募集资金	16,000	已收回
银行理财	海立美达	2016.12.20	2017.2.6	48	募集资金	7,000	已收回
银行理财	联动商务	2016.12.22	2016.12.29	7	募集资金	10,000	已收回
银行理财	联动商务	2017.01.06	2017.01.19	滚动	募集资金	10,000	已收回
结构性存款	联动商务	2017.01.06	2017.02.15	40	自有资金	19,000	已收回
结构性存款	联动优势	2017.01.06	2017.02.15	40	自有资金	5,000	已收回
结构性存款	联动优势	2017.01.10	2017.03.13	31	自有资金	5,000	已收回
结构性存款	联动商务	2017.01.09	2017.02.20	42	自有资金	10,000	已收回
结构性存款	联动优势	2017.01.16	2017.02.19	35	自有资金	8,000	已收回
银行理财	海立美达	2017.01.19	2017.02.20	32	募集资金	15,000	已收回
银行理财	海立美达	2017.01.19	2017.03.31