光大保德信风格轮动混合型证券投资基金招募说明书更新（摘要）

光大保德信风格轮动混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)于2015年12月23日经中国证券监督管理委员会证监许可【2015】3004号文核准公开募集。本基金份额于2016年1月7日至2016年2月2日发售,本基金合同于2016年2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”)保证本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注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的投资价值和市场前景作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

投资有风险,投资人认购(或申购)本基金时应认真阅读本招募说明书、基金合同等信息披露文件,全面认识本基金产品的风险收益特征,自主判断基金的投资价值,应充分考虑投资人自身的风险承受能力,并对于认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策,自行承担投资风险。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

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《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。

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

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:殷瑞晔

(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。

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、保德信金融集团业务管理部总裁兼首席投资官。现任保德信国际投资总裁兼CIO。

包爱丽女士,董事、总经理,美国哥伦比亚大学硕士,中国国籍。历任贝莱德资产管理公司研究员、经理、业务负责人,银华基金管理有限公司战略发展部负责人,国投瑞银基金管理有限公司产品发展部负责人、总经理助理、督察长、副总经理。现任本基金管理人董事、总经理。

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。

王国玲女士,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,联勤法律事务所(中国台湾)、泰远法律事务所(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。

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

孙庆先生,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。

颜微蕙女士,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。

邹颖先生,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部销部经理、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渠道销售部总监、广州分公司总经理。

3、公司高级管理人员

林昌先生,现任本基金管理人董事长,简历同上。

包爱丽女士,现任本基金管理人董事、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、首席投资总监兼光大保德信量化核心证券投资基金基金经理。

梅雷军先生,吉林大学博士。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经理、光大证券股份有限公司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。

董文卓先生,中山大学金融学硕士。历任招商基金管理有限公司实习研究助理、研究员,平安资产管理有限责任公司助理投资经理、投资经理,平安养老保险股份有限公司固定收益投资总监兼固定收益部总经理、投资决策委员会委员、另类投资决策委员会委员、年金基金经理、专户投资经理、社保基金经理等。2017年5月加入光大保德信基金管理有限公司,现任副总经理兼固定收益投资总监。

4、本基金基金经理

历任基金经理:

现任基金经理:

赵大年先生,CFA,为中国科学院数学与系统科学研究院统计学硕士,中国科学技术大学数学学士。2007年6月至2007年10月任职于申万巴黎基金管理有限公司,任产品设计经理;2007年10月至2009年4月任职于钧锋投资咨询有限公司,任投资经理;2009年4月加盟光大保德信基金管理有限公司,历任风险控制高级经理、风险管理部副总监、总监。现任量化投资部总监兼光大保德信量化核心证券投资基金基金经理、光大保德信风格轮动混合型证券投资基金基金经理、光大保德信事件驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理、光大保德信安祺债券型证券投资基金基金经理。

翟云飞先生,2005年毕业于中国科学技术大学自动化系,2010年获得中国科学技术大学统计与金融系博士学位。2010年6月至2014年3月在大成基金管理有限公司任职,其中2010年6月至2011年5月任职金融工程师(负责量化投资研究),2011年5月至2012年7月任职产品设计师,2012年7月至2014年3月任职量化投资研究员、行业投资研究员;2014年4月加入光大保德信基金管理有限公司,担任金融工程师(负责量化投资研究)、高级量化研究员。现任光大保德信风格轮动混合型证券投资基金基金经理、光大保德信量化核心证券投资基金基金经理、光大保德信事件驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

盛松先生,现任本基金管理人副总经理、首席投资总监兼光大保德信量化核心证券投资基金基金经理。

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。

董文卓先生,现任本基金管理人副总经理兼固定收益投资总监。

林晓凤女士,现任本基金管理人专户投资部总监。

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

电话:(021)80262466、80262481

传真:(021)80262482

客服电话:4008-202-888

联系人:孙荣伟

网址:www.epf.com.cn

(二)代销机构

1) 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

联系人:王嘉明

客服电话:95533

网址:www.ccb.com

2) 招商银行股份有限公司

注册地址:深圳市福田区深南大道7088 号招商银行股份有限公司大厦

法定代表人:李建红

客服电话:95555

联系人:邓炯鹏

电话:0755-83198888

传真:0755-83195109

网址:www.cmbchina.com

3) 招商证券股份有限公司

注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层

法定代表人:宫少林

电话:0755-82960223

传真:0755-82943100

客服电话:95565、4008888111

联系人:林生迎

网址:www.newone.com.cn

4) 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

网址:www.pingan.com

5) 平安证券有限责任公司

注册地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼

办公地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼

法定代表人:杨宇翔

联系人:郑舒丽

电话:(0755)22626172

传真:(0755)82400862

客服电话:95511-8

网址:www.pingan.com

6) 深圳众禄金融控股股份有限公司

注册地址:深圳市罗湖区梨园路1号物资控股置地大厦8楼

办公地址:深圳市罗湖区梨园路1号物资控股置地大厦8楼

法定代表人:薛峰

客服电话:4006-788-887

联系人:汤素娅

电话:0755-33227950

传真:0755-82080798

网址:www.zlfund.cn及www.jjmmw.com

7) 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:谭少哲

电话:0769-22118343

传真:0769-22320896

网址: www.drcbank.com

8) 广发证券股份有限公司

注册地址:广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316房)

办公地址:广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、41和42楼

法定代表人:林治海

联系人:黄岚

客服电话:95575或致电各地营业网点

传真:(020)87555305

网站:www.gf.com.cn

9) 国信证券股份有限公司

注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人:何如

电话:0755-82130833

传真:0755-82133952

联系人:齐晓燕

客服电话:95536

网址:www.guosen.com.cn

10) 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

11) 长江证券股份有限公司

注册地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人:杨泽柱

客服电话:95579

联系人:奚博宇

电话:021-68751860

传真:021-51062920

网址: www.cjsc.com

12) 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

13) 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:黄雪

电话:021-33389888

传真:021-33388224

客服热线:95523或4008895523

网址:www.swhysc.com

14) 兴业证券股份有限公司

注册地址:福州市湖东路268号证券大厦

法定代表人:兰荣

电话:0591-38507950

客服电话:95562

联系人:何延昭

网址: www.xyzq.com.cn

15) 宁波银行股份有限公司

注册地址:宁波市鄞州区宁南南路700号

办公地址:宁波市鄞州区宁南南路700号

法定代表人:陆华裕

电话:0574-87068340

传真:0574-87050024

联系人:胡技勤

客服电话:95574

网址:www.nbcb.com.cn

16) 海通证券股份有限公司

注册地址:上海市广东路689号

办公地址:上海市广东路689号

法定代表人:王开国

电话:021-23219000

传真:021-23219100

客服电话:95553、4008888001

联系人:李奚鸣

网址:www.htsec.com

17) 上海天天基金销售有限公司

注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层

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: 许云婷

电话:021-54509988-7029

传真:021-64383798

网址:www.1234567.com.cn

18) 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

联系人:汪林林

联系电话:0571-88911818-8653

传真:0571-86800423

客服电话:4008-773-772

公司网站:www.5ifund.com

19) 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楼1001室

办公地址:浙江省杭州市拱墅区登云路55号锦昌大厦一楼金观诚财富

法定代表人:徐黎云

客服电话:400-068-0058

联系人:孙成岩

电话:0571-88337717

传真:0571-88337666

20) 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: 刘英

电话: 021-20835785

传真: 021-20835885

网址:licaike.hexun.com

21) 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:021-20613600

传真:021-68596919

网址: www.howbuy.com

22) 诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司

注册地址:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724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:张裕

电话: 021-38509606

传真: 021-38509777

网址:www.noah-fund.com

23) 中国光大银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心

法定代表人:唐双宁

客服电话:95595

联系人:薛军丽

电话:010-63636150

传真:010-63639709

网址:www.cebbank.com

24) 晋商银行股份有限公司

注册地址:山西省太原市万柏林区长风西街1号丽华大厦

办公地址:山西省太原市万柏林区长风西街1号丽华大厦

法定代表人:上官永清

客服电话:95105588

联系人:杨瑞

电话:0351-6819926

传真:0351-6819926

公司网址:www.jshbank.com

25) 北京展恒基金销售有限公司

注册地址: 北京市顺义区后沙峪镇安富街6号

办公地址: 北京市朝阳区德胜门外华严北里2号民建大厦6层

法定代表人: 闫振杰

客服电话: 400 888 6661

联系人: 张晶晶

电话: 010---62020088---8105

传真: 010---62020088---8802

地址: www.myfund.com

26) 万银财富(北京)基金销售有限公司

注册地址: 北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观3201

办公地址: 北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观3201

法定代表人: 李招弟

客服电话:400-808-0069

联系人: 高晓芳

电话: 010-59393923

传真: 010-59393074

网址:www.wy-fund.com

27) 山西证券股份有限公司

地址:山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼

法定代表人:侯巍

电话:(0351)8686659

传真:(0351)8686619

客服电话:400-666-1618

联系人:郭熠

网址:www.i618.com.cn

28) 中国银河证券股份有限公司

注册地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人:陈有安

联系人:田薇

电话:010-66568430

传真:010-66568116

客服电话: 400-888-8888

网址:www.chinastock.com.cn

29) 北京增财基金销售有限公司

注册地址: 北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室

办公地址: 北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208-1209室

法定代表人: 罗细安

客服电话:400-001-8811

联系人: 孙晋峰

电话: 010-67000988

传真: 010-67000988-6000

公司网址:www.zcvc.com.cn

30) 一路财富(北京)信息科技有限公司

注册地址:北京市西城区车公庄大街9号院5号楼702(德胜园区)

办公地址:北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208

法定代表人:吴雪秀

客服电话:400-001-1566

联系人:卜石红

电话:010-88312877

传真:010-88312885

公司网址:www.yilucaifu.com

31) 中信证券股份有限公司

注册地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦A层

法定代表人:王东明

电话:0755)83073087

传真:0755)83073104

联系人:陈忠

网址: www.cs.ecitic.com

32) 中信证券(山东)有限责任公司

注册地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层(266061)

办公地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层

法定代表人:杨宝林

电话:(0532)85022326

传真:(0532)85022605

联系人:吴忠超

网址: www.citicssd.com

33) 中泰证券有限公司(原齐鲁证券)

注册地址:济南市市中区经七路86号

法定代表人:李玮

客服电话:95538

网站:www.qlzq.com.cn

34) 中信建投证券股份有限公司

注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址:北京市朝阳门内大街188号

法定代表人:王常青

电话:(010)85130588

传真:(010)65182261

客服电话:400-8888-108

联系人:权唐

网址: www.csc108.com

35) 中经北证(北京)资产管理有限公司

注册地址:北京市西城区车公庄大街4号5号楼1层

办公地址:北京市西城区车公庄大街4号5号楼1层

法定代表人:徐福星

联系人:李美

客服电话:400-600-0030

网址:www.bzfunds.com

36) 上海利得基金销售有限公司

注册地址: 上海市宝山区淞川路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

37) 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

38) 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:刘昌、李芳芳

网址:www.ebscn.com

39) 南京苏宁基金销售有限公司

注册地址:南京市玄武区苏宁大道1-5号

办公地址:南京市玄武区苏宁大道1-5号

法定代表人:钱燕飞

联系人:喻明明

传真:025-66008800-884131

电话:025-66996699-884131

客服电话:95177

网址:www.snjijin.com

40) 上海万得投资顾问有限公司

注册地址:中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座

办公地址:上海市浦东新区福山路33号8楼

法定代表人: 王廷富

联系人:孙敬

传真:021-5071 0161

电话:021-5132 7185

客户服务电话:400-821-0203

41) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

注册地址: 北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15

办公地址:北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院A座17层。

法定代表人: 陈超

联系人: 江卉

传真:89188000

电话:13141319110

客户服务电话:400 098 8511

网址:list.jr.jd.com/fundlist/1-11-112.htm

42) 珠海盈米财富管理有限公司

注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

办公地址: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

客服电话:020-89629066

联系人:黄敏嫦

电话:020-89629099

传真:020-89629011

网址: www.yingmi.cn

43) 东北证券股份有限公司

注册地址:长春市生态大街6666号

办公地址:吉林省长春市生态大街6666号

法定代表人:李福春

联系人:安岩岩

联系电话:0431-85096517

客服电话:95360

公司网址:www.nesc.cn

44) 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

45) 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

46) 江苏汇林保大基金销售有限公司

注册地址:南京市高淳区砖墙集镇78号

办公地址:江苏省南京市中山东路9号天时国际商贸大厦11楼E座

法定代表人:吴言林

客户服务电话:025-56663409

联系人:张宏鹤

传真:021-53086809

公司网址:www.huilinbd.com

基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他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:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

注册地址:中国上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址:中国上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

法定代表人:李丹

电话:(021)23238888

传真:(021)23238800

联系人:周祎

经办会计师:薛竞、周祎

四、基金的名称:

光大保德信风格轮动混合型证券投资基金

五、基金的类型:

契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金将把握不同时期风格轮动带来的投资机会,在有效控制风险前提下,力求超越业绩比较基准的投资回报,争取实现基金资产的长期稳健增值。

七、基金的投资方向

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(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、固定收益类金融工具(包括国债、金融债、公司债、企业债、地方政府债、次级债、中小企业私募债券、可转换公司债券(含可分离交易可转债)、货币市场工具、短期融资券、中期票据、资产支持证券、债券回购、央行票据、银行存款等)、权证、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相关规定)。

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

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

我国A股市场具有独特的风格轮动特征,具体表现为强势行情在大盘、中盘、小盘板块的股票中进行切换。本基金的股票投资策略将主要采用风格轮动的投资策略,即通过量化模型的方式来跟踪、预测A股市场的风格轮动规律,在不同时期从大中小盘板块中选择出未来表现相对强势的,并集中投资于该板块,从而分享大中小盘轮动带来的超额收益。同时,在各板块内部,通过定量和定性相结合的方式选择优质股票来构建最终组合,从而进一步提升本基金的整体收益。

(1)风格板块的集中投资

本基金将采用基金管理人自主开发的风格轮动识别模型对我国A股市场的风格轮动进行预测。我们将A股市场的风格板块分为以下三种股票库:

大盘风格股票库:属于沪深300指数成分股的全部股票。

中盘风格股票库:除沪深300指数成分股及深圳证券交易所创业板上市股票之外的其余股票。

小盘风格股票库:在深圳证券交易所创业板上市的全部股票。

本基金应将至少60%的非现金资产集中投资于以上三种股票库中的一个股票库。

(2)个股选择

本基金将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。

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

A. 价值和成长性

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。

B.事件性因素分析

本基金所涉及的行业受政策扶持、产业升级、行业内重大事件的影响比较明显,往往会对整个行业内个股的估值水平有大范围的影响,具体包括重大行业政策变化、行业限制的放松或收紧等。

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、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,而且受到发债主体资产规模较小、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。

6、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。

7、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、基金的业绩比较标准

本基金的业绩比较基准为:25%×沪深300指数收益率+25%×中证500指数收益率+25%×创业板指数收益率+25%×中证全债指数收益率。

十、基金的风险收益特征

本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金,属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。

十一、基金的投资组合报告

本投资组合报告所载数据截至2017年6月30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	50,086,330.58	86.81
	其中:股票	50,086,330.58	86.81
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	-	-
	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	7,571,241.60	13.12
7	其他各项资产	35,608.15	0.06
8	合计	57,693,180.33	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	1,182,370.00	2.07
B	采矿业	2,091,074.00	3.66
C	制造业	29,807,862.78	52.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,020,990.00	1.79
E	建筑业	1,063,643.00	1.86
F	批发和零售业	3,000,856.80	5.25
G	交通运输、仓储和邮政业	1,156,028.00	2.02
H	住宿和餐饮业	288,459.00	0.50
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,877,352.00	3.29
J	金融业	2,815,362.00	4.93
K	房地产业	3,994,477.00	6.99
L	租赁和商务服务业	894,013.00	1.56
M	科学研究和技术服务业	32,975.00	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	216,292.00	0.38
S	综合	644,576.00	1.13
	合计	50,086,330.58	87.67

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	300486	东杰智能	42,800.00	968,564.00	1.70
2	002076	雪莱特	110,000.00	777,700.00	1.36
3	300092	科新机电	57,900.00	735,330.00	1.29
4	300423	鲁亿通	19,800.00	672,210.00	1.18
5	300461	田中精机	10,100.00	648,925.00	1.14
6	601225	陕西煤业	74,000.00	523,180.00	0.92
7	600188	兖州煤业	42,000.00	514,080.00	0.90
8	600180	瑞茂通	28,100.00	394,524.00	0.69
9	002595	豪迈科技	17,600.00	391,248.00	0.68
10	002191	劲嘉股份	41,500.00	388,440.00	0.68

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十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名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

9.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

9.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。