光大保德信尊富18个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书摘要(更新)

光大保德信尊盈半年定期开放债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)于2016年4月22日经中国证券监督管理委员会证监许可[2016]908号文、2017年6月20日经中国证券监督管理委员会机构部函[2017]1573号文核准公开募集。本基金份额于2017年8月28日至9月22日发售,本基金合同于2017年9月26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申请的注册,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;基金的过往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《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:殷瑞皞

(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团队负责人、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。

王俪玲女士,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,联鼎法律事务所(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。

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

孙佚先生,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。

颜微漶女士,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。

赵大年先生,监事,中国科学技术大学统计与金融系学士,中国科学院数学与系统科学研究院统计学专业硕士。历任申万巴黎基金管理有限公司任职产品设计经理,钧锋投资咨询有限公司任职投资经理。2009年4月加入光大保德信基金管理有限公司,先后担任风险管理部风险控制专员、风险控制高级经理、副总监、总监(负责量化投资研究等)、量化投资部总监、基金经理,现任风险管理部副总监。

3、公司高级管理人员

林昌先生,现任本基金管理人董事长,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,安徽众城高昕律师事务所律师,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兼风险管理部总监。

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、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。

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总经理、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、基本养老投资经理等。2017年5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、固定收益投资总监兼投资经理。

4、本基金基金经理

历任基金经理:

杨烨超先生,担任本基金基金经理的时间为2017年9月27日至2018年5月25日。

现任基金经理:

沈荣先生 , 硕士,2007年获得上海交通大学工学学士学位,2011年获得上海财经大学金融学硕士学位。2007年7月至2008年9月在上海电器科学研究所(集团)有限公司任职CAD开发工程师;2011年6月至2012年3月在国金证券股份有限公司任职行业研究员;2012年3月至2014年4月在宏源证券股份有限公司任职行业分析师、固定收益分析师;2014年4月至2017年6月在平安养老保险股份有限公司任职债券助理研究经理、投资经理;2017年7月加入光大保德信基金管理有限公司,担任固定收益部基金经理。现任光大保德信货币市场基金、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、光大保德信尊盈半年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理、光大保德信多策略智选18个月定期开放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、光大保德信中高等级债券型证券投资基金基金经理、光大保德信尊富18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、光大保德信超短债债券型证券投资基金基金经理、光大保德信晟利债券型证券投资基金基金经理、光大保德信安泽债券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、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。

董文卓先生,现任本基金管理人副总经理、固定收益投资总监兼投资经理。

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。

林晓凤女士,现任本基金管理人专户投资部总监兼投资经理。

上述人员无近亲属关系。

二、基金托管人

名称:宁波银行股份有限公司

住所:浙江省宁波市宁东路345号

办公地址:浙江省宁波市宁东路345号

法定代表人:陆华裕

注册日期:1997年04月10日

批准设立机关和批准设立文号:中国银监会,银监复[2007]64号

组织形式:股份有限公司

注册资本:伍拾亿陆仟玖佰柒拾叁万贰仟叁佰零伍人民币元

存续期间:持续经营

基金托管资格批文及文号:证监许可【2012】1432号

托管部门联系人:王海燕

电话:0574-89103171

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:王颖

网址:www.epf.com.cn

(二)代销机构

1.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号宁波银行大楼

办公地址:宁波市鄞州区宁南南路700号宁波银行大楼

法定代表人:陆华裕

电话:0574-89068340

传真:0574-87050024

联系人:胡技勋

客服电话:96528(上海、北京地区962528)

网址:www.nbcb.com.cn

2.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

办公地址: 上海市徐汇区宛平南路88号东方财富大厦

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:021-64385308

网址:www.1234567.com.cn

3.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:浙江省杭州市余杭区五常街道同顺街18号同花顺大楼4层

法定代表人:凌顺平

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

4.蚂蚁(杭州)基金销售有限公司

注册地址:杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号

办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼

法定代表人:陈柏青

联系人:周嬿旻

电话: 021-60897869、0571-28829790

传真:0571-26698533

客服电话:4000-766-123

网址:www.fund123.cn

5.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

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。各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的调整销售机构的相关公告。

(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:陆奇

经办律师:黎明、陆奇

(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:陈腾

经办会计师:薛竞、陈腾

四、基金的名称: 光大保德信尊富 18 个月定期开放债券型证券投资基金

五、基金的类型: 契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金在控制信用风险、谨慎投资的前提下,力争在获取持有期收益的同时,实现基金资产的长期稳定增值。

七、基金的投资方向

本基金投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具,包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、资产支持证券、次级债、中小企业私募债、证券公司短期公司债券、可转换债券(含可分离交易可转债)、债券回购、货币市场工具、银行存款等固定收益类品种、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具, 但须符合中国证监会的相关规定。

本基金不直接买入股票、权证等权益类资产,但可持有因可转债转股所形成的股票、因持有该股票所派发的权证以及因投资分离交易可转债而产生的权证等。因上述原因持有的股票和权证等资产,本基金将在其可交易之日起的10个交易日内卖出。

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。

基金的投资组合比例为:基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%。但应开放期流动性需要,为保护基金份额持有人利益,在每次开放期前三个月、开放期及开放期结束后三个月的期间内,基金投资不受上述比例限制。开放期内,本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后, 持有现金或者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%,在封闭期内,本基金不受上述5%的限制,但每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金。前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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

(一)封闭期投资策略

本基金将在控制信用风险、谨慎投资的前提下,力争在获取持有期收益的同时,实现基金资产的长期稳定增值。基于此目标,本基金将充分发挥基金管理人的研究优势,将规范的宏观研究、严谨的个券分析与积极主动的投资风格相结合,在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上, 动态调整固定收益类资产配置比例,自上而下决定债券组合久期及债券类属配置;在严谨深入的基本面分析和信用分析基础上,综合考量各类债券的流动性、供求关系、风险及收益率水平等,自下而上地精选个券。

1、资产配置策略

本基金根据工业增加值、通货膨胀率等宏观经济指标,结合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,综合分析债券市场的变动趋势。最终确定本基金在债券类资产中的投资比率,构建和调整债券投资组合。

2、目标久期策略及凸性策略

在组合的久期选择方面,本基金将综合分析宏观面的各个要素,主要包括宏观经济所处周期、货币财政政策动向、市场流动性变动情况等,通过对各宏观变量的分析,判断其对市场利率水平的影响方向和程度, 从而确定本基金固定收益投资组合久期的合理范围。 并且动态调整本基金的目标久期, 即预期利率上升时适当缩短组合久期,在预期利率下降时适当延长组合久期,从而提高债券投资收益。

由于债券价格与收益率之间往往存在明显的非线性关系, 所以通过凸性管理策略为久期策略补充,可以更好地分析债券的利率风险。凸性越大,利率上行引起的价格损失越小,而利率下行带来的价格上升越大;反之亦然。本基金将通过严格的凸性分析,对久期策略做出适当的补充和修正。

3、收益率曲线策略

在确定了组合的整体久期后,组合将基于宏观经济研究和债券市场跟踪,结合收益率曲线的拟合和波动模拟模型,对未来的收益率曲线移动进行情景分析,从而根据不同期限的收益率变动情况, 在期限结构配置上适时采取子弹型、哑铃型或者阶梯型等策略,进一步优化组合的期限结构,增强基金的收益。

4、信用债投资策略

信用类债券是本基金的重要投资对象, 因此信用策略是本基金债券投资策略的重要部分。由于影响信用债券利差水平的因素包括市场整体的信用利差水平和信用债自身的信用情况变化, 因此本基金的信用债投资策略可以具体分为市场整体信用利差曲线策略和单个信用债信用分析策略。

(1)市场整体信用利差曲线策略

本基金将从经济周期、市场特征和政策因素三方面考量信用利差曲线的整体走势。在经济周期向上阶段,企业盈利能力增强,经营现金流改善,则信用利差可能收窄,反之当经济周期不景气,企业的盈利能力减弱,信用利差扩大。同时本基金也将考虑市场容量、信用债结构以及流动性之间的相互关系,动态研究信用债市场的主要特征,为分析信用利差提供依据。另外,政策因素也会对信用利差造成很大影响。这种政策影响集中在信用债市场的供给方面和需求方面。本基金将从供给和需求两方面分别评估政策对信用债市场的作用。

本基金将综合各种因素,分析信用利差曲线整体及分行业走势,确定信用债券总的投资比例及分行业的投资比例。

(2)单个信用债信用分析策略

信用债的收益率水平及其变化很大程度上取决于其发行主体自身的信用水平,本基金将对不同信用类债券的信用等级进行评估,深入挖掘信用债的投资价值,增强本基金的收益。

本基金主要通过发行主体偿债能力、抵押物质量、契约条款和公司治理情况等方面分析和评估单个信用债券的信用水平:

信用债作为发行主体的一种融资行为, 发行主体的偿债能力是首先需要考虑的重要因素。本基金将从行业和企业两个层面来衡量发行主体的偿债能力。A)行业层面:包括行业发展趋势、政策环境和行业运营竞争状况;B)企业层面:包括盈利指标分析、资产负债表分析和现金流分析等。

抵押物作为信用债发行时的重要组成部分, 是债券持有人分析和衡量该债券信用风险的关键因素之一。对于抵押物质量的考察主要集中在抵押物的现金流生成能力和资产增值能力。抵押物产生稳定现金流的能力越强、资产增值的潜力越大,则抵押物的质量越好,从而该信用债的信用水平也越高。

契约条款是指在信用债发行时明确规定的,约束和限制发行人行为的条款内容。具体包含承诺性条款和限制性条款两方面, 本基金首先分析信用债券中契约条款的合理性和可实施性,随后对发行人履行条款的情况进行动态跟踪与评估,发行人对契约条款的履行情况越良好,其信用水平也越高。

对于通过发行债券开展融资活动的企业来说, 该发行人的公司治理情况是该债券维持高信用等级的重要因素。本基金关注的公司治理情况包括持有人结构、股东权益与员工关系、运行透明度和信息披露、董事会结构和效率等。

5、可转换债券投资策略

本基金在分析宏观经济运行特征和证券市场趋势判断的前提下, 在综合分析可转换债券的债性特征、股性特征等因素的基础上,选择其中安全边际较高、股性活跃并具有较高上涨潜力的品种进行投资。结合行业分析和个券选择,对成长前景较好的行业和上市公司的可转换债券进行重点关注,选择投资价值较高的个券进行投资。

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。

7、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。

8、证券公司短期公司债券投资策略

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,分析证券公司短期公司债券的违约风险及合理的利差水平,对证券公司短期公司债券进行独立、客观的价值评估。

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。

9、杠杆投资策略

在本基金的日常投资中,还将充分利用组合的回购杠杆操作,在严格头寸管理的基础上,在资金相对充裕的情况下进行风险可控的杠杆投资策略。

10、国债期货投资策略

基金管理人可运用国债期货,以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。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。

(二)开放期投资策略

开放期内,本基金为保持较高的组合流动性,方便投资人安排投资,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将主要投资于高流动性的投资品种,减小基金净值的波动。

九、基金的业绩比较标准

本基金的业绩比较基准为:中债总全价指数收益率。

十、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金,其预期收益和风险高于货币市场基金,但低于股票型基金和混合型基金。

十一、基金的投资组合报告

本投资组合报告所载数据截止2018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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	1,883,734,498.62	96.68
	其中:债券	1,883,734,498.62	96.68
	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	19,938,882.51	1.02
7	其他各项资产	44,660,974.62	2.29
8	合计	1,948,334,355.75	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	102,510,000.00	9.31
	其中:政策性金融债	102,510,000.00	9.31
4	企业债券	872,755,048.90	79.23
5	企业短期融资券	494,187,200.00	44.86
6	中期票据	367,098,000.00	33.33
7	可转债(可交换债)	47,184,249.72	4.28
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,883,734,498.62	171.01

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

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	180204	18国开04	1,000,000	102,510,000.00	9.31
2	101453008	14鲁能源MTN001	500,000	50,650,000.00	4.60
3	041759024	17天业CP002	500,000	50,245,000.00	4.56
4	011800903	18宿迁水务SCP002	500,000	49,980,000.00	4.54
5	101656014	16鞍钢MTN001	500,000	49,915,000.00	4.53

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投资股指期货。

9.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。根据本基金基金合同,本基金不能投资于股指期货。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资有国债期货。基金管理人可运用国债期货,以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。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。

10.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

11、投资组合报告附注

11.1本基金投资的前十名证券的发行主体本期未被监管部门立案调查, 且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

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
1	存出保证金	24,527.91
2	应收证券清算款	500,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	44,136,446.71
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	44,660,974.62

11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128021	兄弟转债	3,589,342.80	0.33
2	128016	雨虹转债	26,970,151.96	2.45
3	128032	双环转债	5,600,970.16	0.51

11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

十二、基金的业绩

(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

光大保德信尊富18个月定期开放债券A:

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
过去三个月	-0.54%	0.08%	1.76%	0.15%	-2.30%	-0.07%

光大保德信尊富18个月定期开放债券C:

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
过去三个月	-0.63%	0.08%	1.76%	0.15%	-2.39%	-0.07%

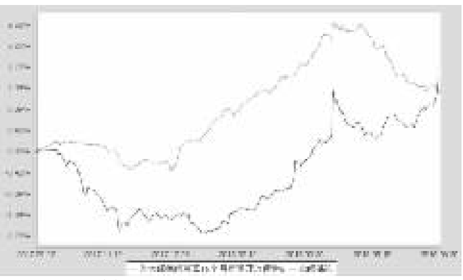
(二)基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

光大保德信尊富 18 个月定期开放债券型证券投资基金

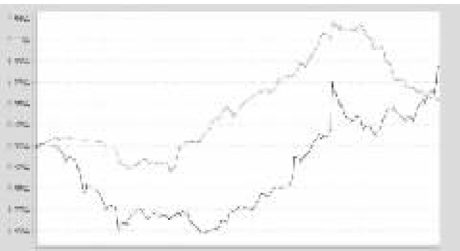
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2017年9月27日至2018年6月30日)

1. 光大保德信尊富18个月定期开放债券A:



2. 光大保德信尊富18个月定期开放债券C:



注:根据基金合同的规定,本基金建仓期为2017年9月27日至2018年3月26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)与基金运作有关的费用

1、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、期货交易费用;

8、基金的银行汇划费用;

9、账户开户费用、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。

2、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,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前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0.1%的年费率计提。基金托管费的计算方法如下:

H=E×0.1%÷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,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前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、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0.4%。

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×0.4%÷当年天数

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令,经基金托管人复核后于次月前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当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

3、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。

4、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可协商酌情降低销售服务费,此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒介上刊登公告。

(二)与基金销售有关的费用

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申购费用;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
100万元以下	0.06%
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
100万元以下	0.60%
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、A类和C类基金份额适用相同的赎回费率。对于持有满一个封闭期的基金份额,在赎回时不收取赎回费。对于基金份额在申购生效后进入封闭期前申请赎回,则按下表所示规则收取赎回费:

持续持有期	A类基金份额赎回费率
N<7日	1.5%
7日≤N<一个封闭期	0.5%
N≥一个封闭期	0

3、赎回费用由基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取,对持续持有期少于7日的投资人收取的赎回费全额计入基金财产;对持续持有期大于等于7日但持有不满一个封闭期的投资人收取的赎回费, 赎回费总额的25%归入基金资产,其余用于支付登记费和其他必要的手续费。

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,按相关监管部门要求履行必要手续后, 基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金销售服务费率。

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》、《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“一、绪言”部分,根据实际情况进行了更新。

3. 在“二、释义”部分,根据实际情况进行了更新。

4. 在“三、基金管理人”部分,根据实际情况进行了更新。

5. 在“四、基金托管人”部分,根据实际情况进行了更新。

6. 在“五、相关服务机构”部分,根据实际情况进行了更新。

7. 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。

8. 在“九、基金的投资”部分,根据实际情况进行了更新,并将数据部分更新至2018年6月30日。

9. 将“十、基金的业绩”部分将数据更新至2018年6月30日。

10. 在“十二、基金资产的估值”部分,根据实际情况进行了更新。

11. 在“十六、基金的信息披露”部分,根据实际情况进行了更新。

12. 在“十七、风险揭示”部分,根据实际情况进行了更新。

13. 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。

14. 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。

15.在 “二十二、其他应披露事项”部分,对2018年3月27日至2018年9月26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

2018年11月10日

证券代码:601058 证券简称:赛轮轮胎 公告编号:临2018-105

赛轮集团股份有限公司监事会关于公司2018年限制性股票激励计划激励对象名单的审核及公示情况说明

本公司及监事会全体成员保证公告内容不存在虚假记载、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。

赛轮集团股份有限公司(以下简称“公司”)依据《上市公司股权激励管理办法》(以下简称“《管理办法》”)的相关规定,对《赛轮集团股份有限公司2018年限制性股票激励计划(草案)》(以下简称“《激励计划(草案)》”或“激励计划”)中确定的激励对象的姓名和职务在公司内部进行了公示。根据《管理办法》及《公司章程》的规定,公司监事会充分听取公示意见并对激励对象名单进行了审核,相关公示情况及监事会核查情况如下:

一、公示情况及核查方式

1、公司于2018年10月31日在上海证券交易所网站(www.sse.com.cn)披露了《2018年限制性股票激励计划激励对象名单》。同时在公司内部进行了公示,相关情况如下:

(1)公示内容:《激励计划(草案)》激励对象姓名及职务。

(2)公示时间:2018年10月31日至2018年11月9日,共计10日。

(3)公示方式:公司内部网站。

(4)反馈方式:以设立反馈电话和邮箱的方式进行反馈,并对相关反馈进行记录。

(5)公示结果:公司内部员工对于本次激励计划拟激励对象名单无异议。

2、公司监事会对拟激励对象的核查方式

公司监事会核查了本次拟激励对象的名单、身份证件、拟激励对象与公司(含分公司、全资子公司及控股子公司)签订的劳动合同、拟激励对象在公司担任的职务及其任职文件。

二、监事会核查意见

根据《管理办法》、《中华人民共和国公司法》(以下简称“《公司法》”)、《公司章程》的相关规定及公司对拟激励对象名单和职务的公示情况,并结合监事会的核查结果,监事会发表核查意见如下:

1、列入公司本次激励计划激励对象名单的人员具备《公司法》等法律、法规和规范性文件及《公司章程》规定的任职资格。

2、激励对象不存在《管理办法》第八条规定的不得成为激励对象的情形:

(1)最近12个月内被证券交易所认定为不适当人选;

(2)最近12个月内被中国证监会及其派出机构认定为不适当人选;

(3) 最近12个月内因重大违法违规行为被中国证监会及其派出机构行政处罚或者采取市场禁入措施;

(4)具有《公司法》规定的不得担任公司董事、高级管理人员情形的;

(5)法律法规规定不得参与上市公司股权激励的;

(6)中国证监会认定的其他情形。

3、列入本次激励计划激励对象名单的人员符合《管理办法》等文件规定的激励对象条件,本激励计划的激励对象不包括公司监事、独立董事,单独或合计持有公司5%以上股份的股东或实际控制人及其配偶、父母、子女未参与本激励计划。

综上所述,公司监事会认为:本次列入激励计划的激励对象均符合相关法律所规定的条件,其作为公司2018年限制性股票激励计划的激励对象合法、有效。

特此公告。

赛轮集团股份有限公司监事会

2018年11月10日

证券代码:002174 证券简称:游族网络 公告编号:2018-111

游族网络股份有限公司关于公司员工持股计划完成股票过户的公告

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

游族网络股份有限公司 (以下简称 “公司”) 第四届董事会第六次会议、2018年第二次临时股东大会审议通过《关于公司第一期员工持股计划(草案)及其摘要的议案)》、《关于提请股东大会授权董事会办理公司第一期员工持股计划有关事项的议案》,具体内容详见 2018年6月30日、2018年8月9日刊登在《证券时报》和巨潮资讯网上披露的相关公告。

根据中国证券监督管理委员会《关于上市公司实施员工持股计划试点的指导意见》及深圳证券交易所《深圳证券交易所中小板信息披露业务备忘录第7号:员工持股计划》相关要求,现将公司员工持股计划的股票非交易过户情况公告如下:

按照公司第一期员工持股计划的规定, 公司将回购的股票14,109,630股以零元价格赠与“游族网络股份有限公司-第一期员工持股计划”用于公司第一期员工持股计划。

上述股份过户登记手续已在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司办理完毕,公司赠与的回购股票14,109,630股已于2018年11月7日过户至资管计划账户。

公司将持续关注员工持股计划的实施进展情况,并按照相关规定及时履行信息披露义务。

特此公告。

游族网络股份有限公司

董事会

2018年11月9日

证券代码:000939 证券简称:*ST凯迪 编号:2018-199

凯迪生态环境科技股份有限公司关于对深圳证券交易所年报问询函延期回复的公告

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

凯迪生态环境科技股份有限公司(以下简称“公司”)于2018年7月18日收到了深圳证券交易所公司部发来的《关于对凯迪生态环境科技股份有限公司的年报问询函》(公司部年报问询函〔2018〕第250号)(以下简称“年报问询函”),公司已联系相关业务单位、保荐机构、律师、会计师事务所等单位进行核查并回复相关问题,因年报涉及内容复杂,核查及回复工作量较大,公司于2018年7月26日、2018年8月2日、2018年8月9日、2018年8月16日、2018年8月23日、2018年8月30日、2018年9月6日、2018年9月14日、2018年9月21日、2018年10月16日、2018年10月27日、2018年11月3日发布了《关于对深圳证券交易所问询函延期回复的公告》,经公司向深圳证券交易所申请,目前公司对年报问询函的回复延期至2018年11月16日前。

公司指定的信息披露媒体为《上海证券报》、《证券时报》及巨潮资讯网(www.cninfo.com.cn)。公司所有信息均以上述指定报刊及网站刊登的信息为准。敬请广大投资者关注公司公告,注意投资风险。

特此公告。

凯迪生态环境科技股份有限公司董事会

2018年11月9日

证券代码:000939 证券简称:*ST凯迪 编号:2018-200

凯迪生态环境科技股份有限公司关于对深交所公司部第206号关注函延期回复的公告

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

凯迪生态环境科技股份有限公司(以下简称“凯迪生态”或“公司”)于2018年10月11日收到了深圳证券交易所公司部发来的《关于对凯迪生态环境科技股份有限公司的关注函》(公司部关注函〔2018〕第206号)(以下简称“206号关注函”),因涉及2017年度报告中相关事项,公司需要进一步核实,公司于2018年10月16日、2018年10月27日、2018年11月3日发布了《关于对深交所公司部第206号关注函延期回复的公告》,经公司向深圳证券交易所申请,目前对206号关注函的回复延期至2018年11月16日前。

公司指定的信息披露媒体为《上海证券报》、《证券时报》及巨潮资讯网(www.cninfo.com.cn)。公司所有信息均以上述指定报刊及网站刊登的信息为准。敬请广大投资者关注公司公告,注意投资风险。

特此公告。

凯迪生态环境科技股份有限公司董事会

2018年11月9日

证券代码:000885 证券简称:城发环境 公告编号:2018-045

河南城发环境股份有限公司关于全资子公司完成工商注册登记的公告

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

一、董事会会议审议情况

河南城发环境股份有限公司(以下简称“公司”)第六届董事会第五次会议于 2018 年10 月25 日审议通过了《关于投资成立全资子公司的议案》。具体内容详见《河南城发环境股份有限公司第六届董事会第五次会议决议公告》(公告编号:2018-042)和《河南城发环境股份有限公司关于投资成立全资子公司的公告》(公告编号:2018-043)。

二、工商注册登记情况

2018年11月7日,全资子公司河南城发环保能源有限公司已完成工商注册登记手续,并取得了河南省工商行政管理局颁发的《营业执照》,具体工商注册登记信息如下:

1.公司名称:河南城发环保能源有限公司

2.统一社会信用代码:91410000MA4602152D(1-2)

3.类 型:有限责任公司(非自然人投资或控股的法人独资)

4.住 所:郑州市金水区农业路东41号投资大厦A座4楼

5.法定代表人:朱红兵

6.注册资本:壹亿圆整

7.成立日期:2018年11月07日

8.营业期限:长期

9.经营范围:静脉产业园的投资建设运营管理(含垃圾焚烧发电厂),城乡生活垃圾、餐厨垃圾、城市污泥无害化处置和资源化利用,汽车、电子拆解、医疗废物处置,建筑垃圾和工业废弃物资源化利用。(依法须经批准的项目,经相关部门批准后方可开展经营活动)

三、备查文件

河南城发环保能源有限公司营业执照

特此公告。

河南城发环境股份有限公司

董事会

2018年11月9日