

光大保德信量化核心证券投资基金

招募说明书（更新）

基金管理人：光大保德信基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

重要提示

光大保德信量化核心证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2004 年 6 月 11 日经中国证券监督管理委员会证监基金字[2004]85 号文核准公开募集。本基金份额于 2004 年 7 月 20 日至 8 月 20 日发售，本基金合同于 2004 年 8 月 27 日生效。

基金管理人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收益作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，投资者申购本基金时应认真阅读本招募说明书、基金产品资料概要、基金合同等信息披露文件基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险。本基金的特定风险详见招募说明书“风险揭示”章节。

本基金为股票型基金，其预期收益和风险高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。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、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。

本更新招募说明书所载内容截止日为 2023 年 8 月 23 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2023 年 6 月 30 日（财务数据未经审计）。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

中国光大银行股份有限公司复核了本次招募说明书中与基金托管业务有关的更新内容。

目 录

一、绪言.....	1
二、释义.....	2
三、基金管理人.....	7
四、基金托管人.....	21
五、相关服务机构.....	24
六、基金的募集.....	55
七、基金合同的生效.....	56
八、基金份额的申购与赎回.....	57
九、基金的投资.....	71
十、基金的业绩.....	83
十一、基金的财产.....	86
十二、基金资产的估值.....	87
十三、基金的收益与分配.....	92
十四、基金的费用与税收.....	94
十五、基金的会计与审计.....	98
十六、基金的信息披露.....	99
十七、风险揭示.....	105
十八、基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	108
十九、基金合同的内容摘要.....	111
二十、基金托管协议的内容摘要.....	124
二十一、对基金份额持有人的服务.....	132
二十二、其他应披露事项.....	135

二十三、招募说明书的存放及查阅方式	137
二十四、备查文件	138

一、绪言

本招募说明书由光大保德信基金管理有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《光大保德信量化核心证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其它有关规定编写。

本招募说明书阐述了光大保德信量化核心证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的全部必要事项,投资人在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息,或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写,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。招募说明书主要向投资人披露与本基金相关事项的信息,是投资人据以选择及决定是否投资于本基金的要约邀请文件。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》、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。

二、释义

在本招募说明书中除非文意另有所指，下列词语或简称具有以下含义：

基金或本基金：指光大保德信量化核心证券投资基金；

基金合同或本基金合同：指《光大保德信量化核心证券投资基金基金合同》及对该合同的任何修订和补充；

中国证监会：指中国证券监督管理委员会；

中国银监会：指中国银行业监督管理委员会；

《证券法》：指 2005 年 10 月 27 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第十八次会议通过并颁布实施的《中华人民共和国证券法》及颁布机关对其不时作出的修订；

《基金法》：指 2012 年 12 月 28 日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议通过，自 2013 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订；

《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及对其不时作出的修订；

《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订；

《流动性风险规定》：指 2017 年 8 月 31 日由中国证监会颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时作出的修订；

《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订；

招募说明书或本招募说明书：指《光大保德信量化核心证券投资基金招募说明书》及其更新；

基金产品资料概要：指《光大保德信量化核心证券投资基金基金产品资料概要》及其更新；

法律法规及相关规定：指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法

解释、地方性法规、地方规章、部门规章及其他规范性文件以及对于该等法律法规及相关规定的不时修订和补充；

基金份额发售公告：指《光大保德信量化核心证券投资基金基金份额发售公告》；

托管协议：指《光大保德信量化核心证券投资基金托管协议》及对该协议的任何修订和补充；

销售代理协议：指基金管理人和各基金代理销售机构签订的《光大保德信量化核心证券投资基金销售与服务代理协议》及对该协议的任何修订和补充；

基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享受权利并承担义务的基金管理人、基金托管人和基金份额持有人；

基金管理人/本基金管理人/本公司：指光大保德信基金管理有限公司（以下简称“光大保德信”）；

基金托管人：指中国光大银行；

销售机构：指光大保德信基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议，代为办理基金销售业务的机构；

直销机构（网点）：指光大保德信基金管理有限公司；

代销机构（网点）：指依据有关销售代理协议办理本基金认购、申购、赎回和其他基金业务的代理机构；

注册登记人：指指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括基金投资者基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等；

基金销售业务：指基金的认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务；

注册登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户的建立管理、基金份额的注册登记、清算及交易确认、代理发放红利、建立保管基金份额持有人名册、基金交易的资金的清算与交收等；

基金份额持有人：指依本基金合同或依法取得并持有本基金基金份额的投资

者；

基金投资者：指个人投资者和机构投资者和合格境外机构投资者；

个人投资者：指依据中华人民共和国有关法律法规及其他有关规定可以投资于证券投资基金的自然人投资者；

机构投资者：指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资本基金的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织以及合格境外机构投资者；

合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内合法设立的开放式证券投资基金的中国境外的机构投资者；

募集期：指自基金份额发售之日起到认购截止的时间段，最长不超过3个月；募集期已在本基金的发售公告中列明；

基金合同生效日：指基金达到本基金合同规定的条件后，本基金合同由中国证监会确认备案的日期；

基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后按照基金合同规定的程序终止基金合同的日期；

存续期：指基金合同生效之日至基金合同终止之日的不定期期限；

开放日：指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日；

工作日：上海证券交易所及深圳证券交易所的正常交易日；

T日：指销售机构在规定时间受理投资者业务申请的工作日；

T+N日：指T日起（不包括T日）第N个工作日，N为自然数；

日/天：指公历日；

月：指公历月；

认购：在基金募集期内，投资者按照基金合同的规定申请购买基金份额的行为；

申购：在基金合同生效后，投资者按照基金合同的规定申请购买基金份额的行为；

赎回：在基金合同生效后，投资者按照基金合同的规定，通过基金销售机构申请将手中持有的基金份额按一定价格卖给基金管理人并收回现金的行为；

巨额赎回：开放式基金单个开放日，基金净赎回申请超过上一日该基金总份额的 10% 时，称为巨额赎回；

转换：指基金份额持有人按基金管理人规定的条件，将其持有的基金管理人管理的某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的另一只基金的基金份额的行为；

转托管：指基金份额持有人将其所持有的某一基金份额从同一个基金账户下的一个交易账户指定到另一交易账户进行交易的行为；

定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式；

基金账户：注册登记人为投资者开立的用于记录投资者持有基金份额余额及其变动情况的账户；

基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换及转托管业务而引起基金份额变动及结余情况的账户；

元：指人民币元；

投资指令：指基金管理人在运用基金资产进行投资时，向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令；

基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息及其他合法收入；

销售服务费：指本基金用于持续销售和服务基金份额持有人的费用，该笔费用从基金财产中计提，属于基金的营运费用；

基金份额分类：本基金根据申购费、赎回费和销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别；

A 类基金份额：在投资者申购时收取前端申购费的，但不从本类别基金财产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；

C 类基金份额：不收取前后端申购费，而从本类别基金财产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额；

基金资产总值：指基金购买的各类证券、银行存款本息、基金应收的申购基金款以及其他资产所形成的价值总和；

基金资产净值：指基金资产总值减去负债后的价值；

基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程；

基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日发行在外的基金份额总数；

基金份额持有人服务：指基金管理人承诺为基金份额持有人提供的一系列服务；

流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等；

指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介；

不可抗力：指任何无法预见、无法克服并无法避免的事件或因素，包括但不限于：相关法律、法规和规定的变更；国际、国内金融市场风险事故的发生；自然或人为破坏造成的交易系统或交易场所无法正常工作；战争或动乱等。

三、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

成立日期：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

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)，
6-7层、10层

法定代表人：刘翔

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：殷瑞峰

(二) 主要人员情况

1、董事会成员

王翠婷女士，董事长，中欧国际商学院工商管理硕士。曾先后就职于上海市仪表局党校(上海市仪表电子工业职工大学)、交通银行。2004年3月加入光大证券股份有限公司，曾任公司董事会秘书、董事会办公室主任、人力资源总部总经理、副总裁等职。现任光大证券股份有限公司工会主席、高级专家兼本基金管理人董事长。

孙昊先生，副董事长，上海中欧国际工商学院工商管理硕士。历任中国银行总行/香港分行/巴黎分行/法兰克福分行任职交易员/副经理/经理，德国德累斯顿银行香港分行的经理，荷兰商业银行香港分行的董事，PIMCO(太平洋投资管理

公司)香港的副总裁, 东方汇理资产管理公司香港的董事, 美国联博资产管理公司香港的董事总经理, 美盛资产管理公司上海的总经理。现任保德信投资管理(上海)有限公司董事总经理。

刘翔先生, 董事, 澳大利亚麦考瑞大学应用金融学硕士。历任深圳发展银行股份有限公司盐田支行外汇会计、国际部经理、香港代表处代表, 招商银行股份有限公司总行同业银行部境内银行室客户经理, 鹏华基金管理有限公司市场发展部渠道主管、市场发展部副总经理、华南营销中心总经理、市场发展部总经理, 前海开源基金管理有限公司合伙人、执行委员会委员、首席市场官、执行委员会联席总经理。2020年6月加入光大保德信基金管理有限公司。现任本基金管理人总经理兼子公司执行董事。

张晓武先生, 董事, 澳门科技大学人力资源管理学硕士。曾先后就职于深圳市文武会计师事务所、平安保险集团公司、平安证券有限责任公司。2010年11月加入光大证券股份有限公司, 历任深圳深南大道证券营业部总经理、深圳分公司总经理、资深业务经理。

张伟先生, 董事, 香港都会大学(前身为香港公开大学)硕士, 曾任德意志银行(前身为美国信孚银行)亚太区副总裁, 富兰克林邓普顿投资香港区负责人暨高级董事、大中华区首席执行官兼区域负责人、资深顾问。现任保德信投资亚洲区副主席。

孔伟先生, 独立董事, 甘肃政法学院法律系法学学士学位。曾任职于甘肃省经济律师事务所、史密夫律师行(伦敦、香港)、外立综合法律事务所、上海市瑛明律师事务所。现任北京市中伦(上海)律师事务所上海分所管理合伙人、中微半导体设备(上海)股份有限公司董事。

张学勇先生, 独立董事, 浙江大学国际贸易学研究生、博士学位。曾任合肥水泥研究设计院粉磨所助理工程师, 清华大学经济管理学院金融系博士后, 中央财经大学金融学院讲师、副教授、副院长、研究生院副部长/副院长、部长/院长。现任中央财经大学金融学院博士生导师、教授、院长。

王永钦先生, 独立董事, 复旦大学经济学博士、耶鲁大学博士后、哈佛大学富布赖特高级访问学者。曾任职山东日照纺织抽纱进出口集团公司、山东日照比特集团出口部经理、复旦大学经济学院讲师、副教授。现任复旦大学经济学教授、

博士生导师、绿庭新兴金融业态研究中心主任、经济学院 985 平台副主任。

龚俊涛先生，董事，厦门大学硕士。曾先后就职于中信实业银行深圳分行、北方证券资产管理部，大成基金管理有限公司。2016 年 3 月加入光大证券股份有限公司，历任上海光大证券资产管理有限公司副总经理、机构业务总部副总经理。现任光大证券股份有限公司金融产品总部总经理兼机构业务总部总经理。

2、监事会成员

黄琴女士，监事长，上海财经大学高级管理人员工商管理硕士。历任光大证券有限责任公司武汉营业部客户管理部经理、经纪业务总部风险监控岗、光大证券股份有限公司经纪业务总部风险监控岗、稽核监察部财务审计岗、稽核部总经理助理、稽核部副总经理、稽核部总经理、风险管理部总经理、风险管理与内控部总经理、风险管理与内控部总经理、内部审计部总经理、光大证券股份有限公司浙江分公司总经理。现任光大证券股份有限公司内部审计部总经理。

颜微滢女士，监事，新加坡管理学院金融管理硕士。曾任富通（欧资）金融集团亚洲区域合规总监，香港交易所上市部副总监，巴克莱投资银行（香港）合规经理，花旗私人银行合规经理，光大保德信基金管理有限公司监事（2009 年 11 月至 2019 年 4 月）。现任保德信（香港）有限公司董事、首席合规官。

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。

王斐女士，监事，上海外国语大学国际政治专业学士。曾任普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）高级审计员，中欧基金管理有限公司稽核经理。历任本基金管理人监察稽核部稽核高级经理、总监助理、副总监，现任本基金管理人监察稽核部总监。

3、公司高级管理人员

刘翔先生，现任本基金管理人总经理、董事兼子公司执行董事，简历同上。

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，平安资产管理有限公司固定收益部投资经理，平安养老保险股份有

限公司固收投资总监兼固定收益部总经理、年金投资决策委员会委员、年金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，2017年9月至2019年3月及2020年12月起担任专户投资经理。现任本基金管理人副总经理、固定收益投资总监兼专户投资经理、固收管理总部负责人及固收专户团队团队长，代任首席投资总监兼权益管理总部负责人。

贺敬哲先生，内蒙古大学电子系电子学与信息系统专业学士。历任内蒙古大学电子系教师，中国电力信托投资有限公司天津证券交易营业部电脑部经理，光大证券有限责任公司中兴路营业部电脑部经理、信息技术部技术管理经理，光大证券股份有限公司信息技术部技术管理经理、信息技术部运营维护管理处副处长、信息技术部系统运行处处长、信息技术部副总经理兼系统运行处处长、信息技术部副总经理、信用业务管理总部副总经理、资产托管部副总经理(主持工作)、资产托管部总经理。2021年2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、首席运营总监兼首席信息官。

管江女士，上海财经大学财务管理专业学士。历任普华永道（中天）会计师事务所金融组高级审计师。2006年11月加入光大保德信基金管理有限公司，先后担任监察稽核高级经理、监察稽核部副总监、监察稽核部总监。现任本基金管理人督察长兼董事会秘书。

4、本基金基金经理

历任基金经理：

何如克先生，担任本基金基金经理时间为2004年8月27日至2005年8月5日。

常昊先生，担任本基金基金经理时间为2004年9月25日至2007年6月28日。

袁宏隆先生，担任本基金基金经理时间为2007年6月29日年至2011年4月25日。

钱钧先生，担任本基金基金经理时间为2010年12月7日年至2014年1月8日。

周炜炜先生，担任本基金基金经理时间为2014年1月9日年至2014年8月

1 日。

田大伟先生，担任本基金基金经理时间为 2014 年 2 月 25 日年至 2018 年 3 月 14 日。

赵大年先生，担任本基金基金经理时间为 2016 年 4 月 26 日年至 2018 年 3 月 14 日。

盛松先生，担任本基金基金经理时间为 2017 年 1 月 16 日年至 2020 年 2 月 17 日。

金昉毅先生，担任本基金基金经理时间为 2019 年 5 月 11 日年至 2021 年 11 月 19 日。

翟云飞先生，担任本基金基金经理时间为 2016 年 12 月 9 日年至 2022 年 8 月 26 日。

赵大年先生，担任本基金基金经理时间为 2021 年 11 月 2 日年至 2023 年 8 月 21 日。

现任基金经理：

王卫林先生，北京大学软件工程专业硕士。2016 年 7 月至 2018 年 1 月在南方基金管理有限公司任职量化研究员；2018 年 1 月至 2023 年 2 月在长城基金管理有限公司任职量化与指数投资部研究员、基金经理助理、基金经理；2023 年 2 月加入光大保德信基金管理有限公司，现任权益管理总部量化投资团队基金经理，2023 年 8 月至今担任光大保德信量化核心证券投资基金、光大保德信中证 500 指数增强型证券投资基金、光大保德信创业板量化优选股票型证券投资基金、光大保德信锦弘混合型证券投资基金的基金经理。

韩羽辰先生，纽约大学金融工程专业硕士。2017 年 8 月加入光大保德信基金管理有限公司，历任研究助理、量化研究员，2020 年 9 月至 2023 年 7 月历任权益管理总部专户权益投资团队投资经理，现任权益管理总部量化投资团队基金经理，2023 年 8 月至今担任光大保德信量化核心证券投资基金、光大保德信风格轮动混合型证券投资基金、光大保德信诚鑫灵活配置混合型证券投资基金、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、光大保德信中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理。

5、投资决策委员会成员

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专户投资经理、固收管理总部负责人及固收专户团队团队长，代任首席投资总监兼权益管理总部负责人。

林晓凤女士，现任本基金管理人权益管理总部权益投资团队副团队长兼光大保德信国企改革主题股票型证券投资基金、光大保德信优势配置混合型证券投资基金的基金经理。

徐晓杰女士，现任本基金管理人权益管理总部权益投资团队副团队长兼光大保德信红利混合型证券投资基金、光大保德信健康优加混合型证券投资基金的基金经理。

詹佳先生，现任本基金管理人权益管理总部国际业务团队团队长兼光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信先进服务业灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信永鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信行业轮动混合型证券投资基金、光大保德信品质生活混合型证券投资基金、光大保德信安和债券型证券投资基金、光大保德信创新生活混合型证券投资基金、光大保德信核心资产混合型证券投资基金、光大保德信汇佳混合型证券投资基金的基金经理。

黄波先生，现任本基金管理人总经理助理、固收管理总部固收多策略投资团队团队长兼光大保德信中高等级债券型证券投资基金、光大保德信安祺债券型证券投资基金、光大保德信增利收益债券型证券投资基金、光大保德信信用添益债券型证券投资基金、光大保德信多策略精选 18 个月定期开放灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信安泽债券型证券投资基金、光大保德信安瑞一年持有期债券型证券投资基金、光大保德信安阳一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。

沈荣先生，现任本基金管理人固收管理总部固收低风险投资团队联席团队长兼光大保德信货币市场基金、光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金、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、光大保德信尊合 87 个月定期开放债券型证券投资基金、光大保德信安瑞一年持有期债券型证券投资基金、光大保德信安和债券型证券投资基金、光大保德信现金宝货币市场基金、光大保德信耀钱包货币市场基金、光大保德信中证同业存单 AAA 指数 7 天持

有期证券投资基金的基金经理。

房雷先生，现任本基金管理人权益管理总部权益投资团队团队长、首席策略分析师兼光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信动态优选灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信景气先锋混合型证券投资基金、光大保德信产业新动力灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信新机遇混合型证券投资基金的基金经理。

崔书田先生，现任本基金管理人权益管理总部股票研究团队团队长兼光大保德信中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信新增长混合型证券投资基金、光大保德信专精特新混合型证券投资基金的基金经理。

上述人员无近亲属关系。

（三）基金管理人的职责

- 1、依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- 2、办理基金备案手续；
- 3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；
- 4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、编制基金季度报告、基金中期报告和基金年度报告；
- 7、计算并公告基金净值信息，确定各类基金份额申购、赎回价格；
- 8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、召集基金份额持有人大会；
- 10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 12、中国证监会规定和本基金基金合同约定的其他职责。

（四）基金管理人的承诺

- 1、基金管理人承诺严格遵守法律、法规和基金合同，按照招募说明书列明

的投资目标、策略及限制全权处理本基金的投资；

2、基金管理人承诺严格遵守《证券法》、《基金法》、《信息披露办法》、《运作办法》、《销售办法》、《治理准则》等法律法规，建立健全内部控制制度，采取有效措施，保证基金财产不用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向本基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合本基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律、行政法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

3、基金管理人承诺严格遵守法律法规，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止以下禁止性行为的发生：

- (1) 将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- (2) 不公平地对待其管理的不同基金财产；
- (3) 利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- (5) 侵占、挪用基金财产；
- (6) 泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

-
- (7) 玩忽职守，不按照规定履行职责；
 - (8) 法律法规及监管机关规定禁止从事的其他行为。

4、本基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

- (1) 越权或违规经营；
- (2) 违反基金合同或托管协议；
- (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金合同当事人的合法权益；
- (4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权，不按照规定履行职责；

(7) 泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

(8) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；

- (9) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成份；
- (10) 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

5、基金经理承诺

(1) 依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

(2) 不利用职务之便为自己、代理人、受雇人或任何第三人谋取不当利益；

(3) 不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

(4) 不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

(五) 基金管理人的内部控制制度

1、内部控制概述

内部控制是指基金管理人为防范和化解风险，保证经营运作符合基金管理人发展规划，在充分考虑内外部环境的基础上，通过建立组织机制、运用管理方

法、实施操作程序与控制措施而形成的有机系统。

内部控制是由为保障业务正常运作、实现既定的经营目标、防范经营风险而设立的各种内部控制机制和一系列规范内部运作程序、描述控制措施和方法等制度构成的统一整体。

内部控制是由基金管理人的董事会、管理层和员工共同实施的合理保证。基金管理人的内部控制要达到的总体目标是：

（1）保证基金管理人的经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念；

（2）防范和化解经营风险，提高经营管理效益，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，实现基金管理人的持续、稳定、健康发展；

（3）确保基金、基金管理人财务和其他信息真实、准确、完整、及时；

（4）确保基金管理人成为一个决策科学、经营规范、管理高效、运作安全的持续、稳定、健康发展的基金管理公司。

2、内部控制的五个要素

内部控制的基本要素包括控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通和内部监控。

（1）控制环境

控制环境是内部控制其他要素的基础，它决定了基金管理人的内部控制基调，并影响着基金管理人内部员工的内控意识。为此，基金管理人从两方面入手营造一个好的控制环境。首先，从“硬控制”来看，本基金管理人遵循健全的法人治理结构原则，设置了职责明确、相互制约的组织结构，各部门有明确的岗位设置和授权分工，操作相互独立。其次，基金管理人更注重“软控制”，基金管理人的管理层牢固树立内部控制和风险管理优先的理念和实行科学高效的运行方式，培养全体员工的风险防范意识，营造一个浓厚的内控文化氛围，加强全体员工道德规范和自身素质建设，使风险意识贯穿到基金管理人的各个部门、各个岗位和各个环节。

（2）风险评估

本基金管理人的风险评估和管理分三个层次进行：一，各部门进行风险的自我评估和分析，通过制定相应的控制措施进行自我风险管理；二，管理层下属的

风险管理工作委员会负责风险管理工作，设定明确的风险管理目标，建立科学严密的风险控制评估体系，辨认和识别基金管理人内外部的重大风险，评估和分析风险的重大性、制定相应的风险控制方案和有效防范措施。风险管理工作委员会通过定期与不定期风险评估及时防范和化解风险；三，董事会专门委员会——风险管理委员会负责基金管理人的全面风险管理工作，监控和评价管理层的风险管理工作，并决策重大的风险管理事项。

（3）控制活动

本基金管理人制定了各项规章制度，通过各种预防性的、检查性的和修正性的控制措施，把控制活动贯穿于基金管理人经营活动的始终，尤其是强调对于基金资产与基金管理人的资产、不同基金的资产和其他委托资产实行独立运作，分别核算；严格岗位分离，明确划分各岗位职责，明确授权控制；对重要业务部门和岗位进行了适当的物理隔离；制订应急应变措施，危机处理机制和程序。

（4）信息沟通

本基金管理人建立清晰、有效的垂直报告制度和平行通报制度，以确保识别、收集和交换有关运营活动的关键指标，使员工了解各自的工作职责和基金管理人的各项规章制度，并建立与客户和第三方的合理交流机制。

（5）内部监控

督察长和监察稽核部负责监督检查基金和公司运作的合法合规情况、公司内部风险控制以及公司内部控制制度的执行情况，保证内部控制制度的落实。各部门必须切实协助经营管理层对日常业务管理活动和各类风险的总体控制，并协助解决所出现的相关问题。按照基金管理人内部控制体系的设置，实现一线业务岗位、各部门及其子部门根据职责与授权范围的自控与互控，确保实现内部监控活动的全方位、多层次的展开。

3、内部控制原则

（1）健全性原则：内部控制应当包括基金管理人的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并贯穿于到决策、执行、监督、反馈等各个环节；

（2）有效性原则：通过科学的内部控制手段和方法，建立合理的内部控制程序，维护内部控制制度的有效执行；

（3）独立性原则：各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立，基金资产、

自有资产、其他资产的运作应当分离；

(4) 相互制约原则：部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡；

(5) 成本效益原则：基金管理人运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

4、内部控制机制

内部控制机制是指基金管理人的组织结构及其相互之间的制约关系。内部控制机制是内部控制的重要组成部分，健全、合理的内部控制机制是基金管理人经营活动得以正常开展的重要保证。

从功能上划分，基金管理人的内部控制机制可分为“决策系统”、“执行系统”、“监督系统”三个方面。监督系统在各个内部控制层次上对决策系统和执行系统实施监督。

决策系统是指在基金管理人经营管理过程中拥有决策权力的有关机构及其之间的关系。执行系统是指具体负责将基金管理人决策系统的各项决议付诸实现的一些职能部门。

执行系统在总经理办公会的直接领导下，承担了公司日常经营管理、基金投资运作和内部管理工作。

监督系统对基金管理人的决策系统、执行系统进行全程、动态的监控，监督的对象覆盖基金管理人经营管理的全部内容。基金管理人的监督系统从监督内容划分，大致分为三个层次：

(1) 监事会——对董事、高管人员的行为及董事会的决策进行监督；

(2) 董事会专门委员会及督察长——根据董事会的授权对基金管理人的经营活动进行监督；

(3) 监察稽核部——根据总经理及督察长的安排，对基金管理人的经营活动及各职能部门进行内部监督。

5、内部控制层次

(1) 员工自律和部门主管的监控。所有员工上岗前必须经过岗位培训，签署自律承诺书，保证遵守国家的法律法规以及基金管理人的各项管理制度；保证良好的职业操守；保证诚实信用、勤勉尽责等。基金管理人的各部门主管在权限范围之内，对其管理负责的业务进行检查、监督和控制，保证业务的开展符合国

家法律、法规、监管规定、基金管理人的规章制度，并对部门的内部控制和风险管理负直接责任；

(2) 管理层的控制。管理层采取各种控制措施，管理和监督各个部门和各项业务进行，以确保基金管理人运作在有效的控制下。管理层对内部控制制度的有效执行承担责任；

(3) 董事会及其专门委员会的监控和指导。所有员工应自觉接受并配合董事会及其专门委员会对各项业务和工作行为的检查监督。合理的风险分析和管理建议应予采纳，基金管理人规定的风险控制措施必须坚决执行。董事会对内部控制负最终责任。

督察长和监察稽核部负责对基金管理人内部控制和风险控制的充分性、合理性和有效性实施独立客观的检查和评价。

6、内部控制制度

内部控制制度指规范内部控制的一系列规章制度和义务规则，是内部控制的重要组成部分。内部控制制度制订的基本依据为法律法规、中国证监会及其他主管部门有关文件的规定。内部控制制度分为四个层次：

(1) 《公司章程》——指经股东会批准的《公司章程》，是基金管理人制定各项基本管理制度和具体管理规章的指导性文件；

(2) 内部控制大纲——是对《公司章程》规定的内部控制原则的细化和展开，是各项基本管理制度的纲要和总揽；

(3) 公司基本管理制度——是基金管理人在经营管理宏观方面进行内部控制的制度依据。基本管理制度须经董事会审议并批准后实施。基本管理制度包括但不限于风险管理制度、投资管理制度、基金会计核算办法、信息披露管理办法、监察稽核制度、信息技术管理制度、固有资金投资内部控制制度、公司财务制度、档案管理制度、印章管理办法、行政管理制度、人力资源管理制度、业绩评估考核制度、员工对外兼职管理办法、员工行为规范、纪律程序和应急情况处理与业务连续制度等；

(4) 部门规章制度以及业务流程——部门规章制度以及业务流程是在公司基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、岗位职责、操作守则等的具体说明。它不仅是基金管理人的业务、管理、监督的需要，同时也是避免

工作中主观随意性的有效手段。部门制度及具体管理规章根据总经理办公会的决定进行拟订、修改，经总经理办公会批准后实施的。制定的依据包括法律法规、证监会规定和《公司章程》及公司基本管理制度。

7、基金管理人关于内部控制的声明

本基金管理人确知建立、维持、完善、实施和有效执行风险管理和内部控制制度是本基金管理人董事会及管理层的责任，董事会承担最终责任。本基金管理人特别声明以上关于内部控制的披露真实、准确、完备，并承诺将根据市场环境的变化和业务的发展不断完善内部控制制度。

四、基金托管人

（一）基金托管人基本情况

1、基金托管人概况

名称：中国光大银行股份有限公司

住所及办公地址：北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心

成立日期：1992 年 6 月 18 日

批准设立机关和批准设立文号：国务院、国函[1992]7 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：466.79095 亿元人民币

法定代表人：王江

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【2002】75 号

资产托管部总经理：李守靖

电话：（010） 63636363

传真：（010） 63639132

网址：www.cebbank.com

2、主要人员情况

董事长王江先生，自 2022 年 8 月起任本行董事长、2022 年 3 月起任本行党委书记。现任中国光大集团股份公司党委书记、董事长，兼任中国光大集团股份公司党校校长、中国光大集团有限公司董事长。曾任中国建设银行山东省分行信贷风险管理处副处长，山东省德州市分行行长，山东省分行党委副书记、副行长，湖北省分行党委书记、行长，上海市分行党委书记、行长；交通银行党委委员、副行长；江苏省副省长；中国银行党委副书记、副董事长、行长；中国建设银行党委副书记、副董事长、行长。获经济学博士学位。第十三届全国人大代表，第十四届全国政协委员。

行长王志恒先生，自 2023 年 3 月起任本行执行董事、行长，2022 年 12 月起任本行党委副书记。现任中国光大集团股份公司党委委员、执行董事。曾任中国银行总行公司业务部公司规划处副处长，总行人力资源部主管、副总经理，广东省分行党委委员、副行长，青海省分行党委书记、行长，总行党委组织部部长、

人力资源部总经理，北京市分行党委书记、行长，总行党委委员、副行长。获经济学硕士学位，经济师。

资产托管部总经理李守靖先生，曾任中国光大银行海口分行部门总经理，行长助理，副行长；中国光大银行南宁分行副行长（主持工作）、行长。现任中国光大银行资产托管部总经理。

3、基金托管业务经营情况

截至 2023 年 6 月 30 日，中国光大银行股份有限公司托管公开募集证券投资基金共 314 只，托管基金资产规模 6351.28 亿元。同时，开展了证券公司资产管理计划、基金公司客户资产管理计划、职业年金、企业年金、QDII、QFII、银行理财、保险债权投资计划等资产的托管及信托公司资金信托计划、产业投资基金、股权基金等产品的保管业务。

（二）基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

确保有关法律法规在基金托管业务中得到全面严格的贯彻执行；确保基金托管人有关基金托管的各项管理制度和业务操作规程在基金托管业务中得到全面严格的贯彻执行；确保基金财产安全；保证基金托管业务稳健运行；保护基金份额持有人、基金管理公司及基金托管人的合法权益。

2、内部控制的原则

（1）全面性原则。内部控制必须渗透到基金托管业务的各个操作环节，覆盖所有的岗位，不留任何死角。

（2）预防性原则。树立“预防为主”的管理理念，从风险发生的源头加强内部控制，防患于未然，尽量避免业务操作中各种问题的产生。

（3）及时性原则。建立健全各项规章制度，采取有效措施加强内部控制。发现问题，及时处理，堵塞漏洞。

（4）独立性原则。基金托管业务内部控制机构独立于基金托管业务执行机构，业务操作人员和内控人员分开，以保证内控机构的工作不受干扰。

3、内部控制组织结构

中国光大银行股份有限公司董事会下设风险管理委员会、审计委员会，委员会委员由相关部门的负责人担任，工作重点是对总行各部门、各类业务的风险和

内控进行监督、管理和协调，建立横向的内控管理制约体制。各部门负责分管系统内的内部控制的组织实施，建立纵向的内控管理制约体制。资产托管部建立了严密的内控督察体系，设立了投资监督与内控合规处，负责证券投资基金托管业务的内控管理。

4、内部控制制度

中国光大银行股份有限公司资产托管部自成立以来严格遵照《基金法》、《中华人民共和国商业银行法》、《信息披露管理办法》、《运作办法》、《销售办法》等法律、法规的要求，并根据相关法律法规制订、完善了《中国光大银行证券投资基金托管业务内部控制规定》、《中国光大银行资产托管部保密规定》等十余项规章制度和实施细则，将风险控制落实到每一个工作环节。中国光大银行资产托管部以控制和防范基金托管业务风险为主线，在重要岗位（基金清算、基金核算、投资监督）还建立了安全保密区，安装了录像监视系统和录音监听系统，以保障基金信息的安全。

（三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据法律、法规和基金合同等的要求，基金托管人主要通过定性和定量相结合、事前监督和事后控制相结合、技术与人工监督相结合等方式方法，对基金投资范围、投资组合比例每日进行监督；同时，对基金管理人就基金资产净值的计算、基金管理人和基金托管人报酬的计提和支付、基金收益分配、基金费用支付等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的违反法律、法规和基金合同等规定的行为，及时以邮件、电话或书面等形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对确认并以邮件或书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查。基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

五、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

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)，
6-7 层、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) 本基金 A 类基金份额的代销机构：

1. 中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：洪崎

联系人：董云巍

联系人电话：010-58560666

客服热线：95568

网址：www.cmbc.com.cn

2. 北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙 17 号

法定代表人：闫冰竹

联系人：谢小华

联系人电话：010-66223587

传真：010-66226045

客服热线：95526

网址：www.bankofbeijing.com.cn

3. 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

联系人：谭少筠

联系人电话：0769-22118343

客服热线：0769-961122

网址：www.drcbank.com

4. 广发银行股份有限公司

注册地址：广东省广州市东风东路 713 号

办公地址：广东省广州市东风东路 713 号

法定代表人：董建岳

客服热线：4008-308-003

网址：www.cgbchina.com.cn

5. 华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：吴建

客服热线：95577

网址：www.hxb.com.cn

6. 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：任德奇

联系人：高天

联系人电话：021-58781234

传真：021-58408483

客服热线：95559

网址：www.bankcomm.com

7. 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：阎俊生

联系人：董嘉文

联系人电话：0351-6819926

传真：0351-6819926

客服热线：95105588

网址：www.jshbank.com

8. 洛阳银行股份有限公司

注册地址：河南省洛阳市新区开元大道与通济街交叉口

办公地址：河南省洛阳市新区开元大道 256 号

法定代表人：王建甫

联系人：王军

联系人电话：0379-65921977

客服热线：96699

网址：www.bankofluoyang.com.cn

9. 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

联系人：胡技勋

联系人电话：0574-89068340

客服热线：96528

网址：www.nbcb.com.cn

10. 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

客服热线：95511-3

网址：www.pingan.com

11. 上海农村商业银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东大道 981 号
办公地址：上海市浦东新区银城中路 8 号中融碧玉蓝天大厦 15—23 层
法定代表人：胡平西
联系人：吴海平
联系人电话：021-38576969
客服热线：021-962999
网址： www.srcb.com

12. 上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号
办公地址：上海市中山东一路 12 号
法定代表人：吉晓辉
联系人：倪苏云
联系人电话：（021）61618888
客服热线：95528
网址： www.spdb.com.cn

13. 兴业银行股份有限公司
注册地址：福州市湖东路 154 号
法定代表人：高建平
联系人：刘玲
联系人电话：（021）52629999
客服热线：95561
网址： www.cib.com.cn

14. 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
联系人：邓炯鹏
联系人电话：0755-83198888
传真：0755-83195109
客服热线：95555
网址： www.cmbchina.com

15. 浙江稠州商业银行股份有限公司

注册地址：浙江省义乌市江滨路义乌乐园东侧
办公地址：浙江省义乌市江滨路义乌乐园东侧
法定代表人：金子军
联系人：董晓岚
联系人电话：0571-87117617
客服热线：4008-096-527/0571-96527
网址：www.czcb.com.cn

16. 中国工商银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号
法定代表人：陈四清
联系人：郭明
联系人电话：010-66105799
客服热线：95588
网址：www.icbc.com.cn

17. 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：王江
联系人：朱红
客服热线：95595
网址：www.cebbank.com

18. 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：田国立
客服热线：95533
网址：www.ccb.com

19. 中国农业银行股份有限公司
注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座
法定代表人：谷澍
联系人：贺倩

联系人电话：010-66060069

传真：010-68121816

客服热线：010-66060069

网址：www.abchina.com

20. 中国邮政储蓄银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融街3号

办公地址：北京市西城区金融街3号

法定代表人：张金良

联系人：李雪萍

传真：010-68858117

客服热线：95580

网址：www.psbc.com

21. 中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人：李庆萍

联系人：丰靖

客服热线：95558

网址：bank.ecitic.com

22. 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路119号安信金融大厦

办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35楼、28层A02单元

法定代表人：黄炎勋

联系人：陈剑虹

联系人电话：0755-82558305

客服热线：95517

网址：www.essence.com.cn

23. 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路1508号

办公地址：上海市静安区新闻路1508号

法定代表人：周健男

联系人：何耀
联系人电话：021-22169999
传真：021-22169134
客服热线：95525
网址：www.ebscn.com

24. 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
联系人：刘婧漪、贾鹏
联系人电话：028-86690057、028-86690058
传真：028-86690126
客服热线：4006-600-109/95310
网址：www.gjqz.com.cn

25. 国泰君安证券股份有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号
办公地址：上海市静安区南京西路 768 号国泰君安大厦
法定代表人：贺青
联系人：朱雅崑
联系人电话：021-38676666
传真：021-38670666
客服热线：95521/4008888666
网址：www.gtja.com

26. 山西证券股份有限公司
注册地址：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
联系人：郭熠
联系人电话：（0351）8686659
传真：（0351）8686619
客服热线：400-666-1618
网址：www.i618.com.cn

27. 信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼信达金融中心

法定代表人：张志刚

联系人：尹旭航

联系人电话：010-63081000

传真：010-63081344

客服热线：95321

网址：www.cindasc.com

28. 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座

法定代表人：张佑君

联系人电话：（0755）83073087

传真：（0755）83073104

客服热线：95548

网址：www.cs.ecitic.com

29. 财富证券有限责任公司

注册地址：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼

办公地址：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼

法定代表人：周晖

联系人：郭磊

联系人电话：0731-84403319

传真：0731-84403439

客服热线：0731-84403360

网址：www.cfzq.com

30. 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

联系人电话：0431-85096517

传真：95360

客服热线：95360
网址：www.nesc.cn

31. 东方财富证券股份有限公司

注册地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼
办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座东方财富大厦
法定代表人：陈宏
联系人：付佳
传真：暂无
客服热线：95357
网址：http://www.18.cn

32. 东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层、23 层、25 层-29 层
办公地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 13 层、21 层-23 层、25-29 层、
32 层、36 层、39 层、40 层
法定代表人：潘鑫军
联系人：孔亚楠
联系人电话：021-63325888
传真：021-63326729
客服热线：95503
网址：www.dfzq.com.cn

33. 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
联系人电话：010-66555316
传真：010-66555133
客服热线：95309
网址：www.dxzq.net

34. 方正证券股份有限公司

注册地址：湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

办公地址：湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦 22—24 层

法定代表人：雷杰

联系人：彭博

联系人电话：0731-85832343

传真：0731-85832214

客服热线：95571

网址：www.foundersc.com

35. 广发证券股份有限公司

注册地址：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室

办公地址：广东省广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦

法定代表人：林传辉

联系人：刘珂、任嘉鹏

传真：(020) 87555305

客服热线：95575

网址：www.gf.com.cn

36. 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 1010 号国际信托大厦 21 楼

法定代表人：张纳沙

联系人：李颖

联系人电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

客服热线：95536

网址：www.guosen.com.cn

37. 国元证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市寿春路 179 号

办公地址：安徽省合肥市寿春路 179 号

法定代表人：凤良志

联系人：李飞

联系人电话：0551-2246298

传真：0551-2272100

客服热线：4008-888-777

网址: www.gyzq.com.cn

38. 海通证券股份有限公司

注册地址: 上海市淮海中路 98 号

办公地址: 上海市广东路 689 号

法定代表人: 周杰

联系人: 金芸

联系人电话: 021-23219000

传真: 021-23219100

客服热线: 95553/4008-888-001

网址: www.htsec.com

39. 华福证券有限责任公司

注册地址: 福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址: 福州市五四路 157 号新天地大厦 7---10 层

法定代表人: 黄金琳

联系人: 张腾

联系人电话: 0591-87383623

传真: 0591-87383610

客服热线: 0591-96326

网址: www.hfzq.com.cn

40. 华泰证券股份有限公司

注册地址: 南京市江东中路 228 号

办公地址: 南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场

法定代表人: 周易

联系人: 庞晓芸

联系人电话: 0755-82492193

传真: 0755-82492962

客服热线: 95597

网址: www.htsc.com.cn

41. 江海证券有限公司

注册地址: 黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址: 黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人：孙名扬
联系人：徐世旺
联系人电话：0451-82336863
传真：0451-82287211
客服热线：400-666-2288
网址：www.jhzq.com.cn

42. 平安证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25
层
办公地址：深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25
层

法定代表人：何之江
联系人：周驰
联系人电话：021-38637436
传真：021-58991896
客服热线：95511-8
网址：stock.pingan.com

43. 上海证券有限责任公司
注册地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼
法定代表人：李俊杰
联系人：邵珍珍
联系人电话：021-53686888
客服热线：4008-918-918
网址：www.shzq.com

44. 申万宏源西部证券有限公司
注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大
厦 20 楼 2005 室
办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大
厦 20 楼 2005 室
法定代表人：王献军
联系人：梁丽
联系人电话：0991-2307105

传真：010-88085195
客服热线：400-800-0562
网址：www.swhysc.com

45. 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：杨玉成
联系人：陈宇
联系人电话：021-33388999
传真：021-33388224
客服热线：4008-895-523/021-95523
网址：www.swhysc.com

46. 湘财证券股份有限公司
注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼
办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼
法定代表人：孙永祥
联系人：李欣
联系人电话：021-38784580-8918
传真：021-68865680
客服热线：95351
网址：www.xcsc.com

47. 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
办公地址：福州市湖东路 268 号证券大厦
法定代表人：兰荣
联系人：夏中苏
联系人电话：(0591) 38281963
客服热线：95562
网址：www.xyzq.com.cn

48. 粤开证券股份有限公司
注册地址：广州经济技术开发区科学大道 60 号开发区金控中心 21、22、

23 层

办公地址：深圳市福田区深南中路 2002 号中广核大厦北楼 10 层

法定代表人：严亦斌

联系人：彭莲

联系人电话：0755-83331195

传真：暂无

客服热线：95564

网址：<http://www.ykzq.com>

49. 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：霍达

联系人：黄婵君

联系人电话：0755-82960167

传真：0755-83734343

客服热线：4008-888-111/95565

网址：www.newone.com.cn

50. 浙商证券有限责任公司

办公地址：浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座 6-7 楼

法定代表人：吴承根

联系人：吴颖

联系人电话：(0571)87901963

客服热线：95345

网址：www.stocke.com.cn

51. 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼 7 至 18 层 101

办公地址：北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼青海金融大厦

法定代表人：陈亮

联系人：辛国政

联系人电话：010-80928123

传真：010-66568990

客服热线：400-888-8888/95551

网址：www.chinastock.com.cn

52. 中国中金财富证券有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层 01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23 单元

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层

法定代表人：高涛

联系人：刘毅

联系人电话：0755-82023442

传真：0755-82026539

客服热线：4006-008-008

网址：www.china-invs.cn

53. 中泰证券股份有限公司

注册地址：济南市市中区经七路 86 号

法定代表人：李玮

客服热线：95538

网址：www.qlzq.com.cn

54. 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：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：权唐

联系人电话：(010) 85130588

传真：(010) 65182261

客服热线：400-8888-108

网址：www.csc108.com

55. 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 1 号楼 2001

办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层

法定代表人：姜晓林

联系人：刘晓明

联系人电话：0531—89606165

客服热线：95548

网址：sd.citics.com

56. 中信证券华南股份有限公司

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：胡伏云

联系人：陈靖

联系人电话：020-88836999

传真：020-88836984

客服热线：95396

网址：www.gzs.com.cn

57. 中邮证券有限责任公司

注册地址：陕西省西安市唐延路 5 号陕西邮政信息大厦 11 层

办公地址：北京市东城区珠市口东大街 17 号

法定代表人：于晓军

联系人：史蕾

联系人电话：4008888005

客服热线：4008888005

网址：www.cnpsec.com

58. 珠海盈米基金销售有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址：广州市海珠区阅江中路 688 号保利国际广场北塔 33 层

法定代表人：肖雯

联系人：邱湘湘

联系人电话：020-89629099

传真：020-89629011

客服热线：020-89629066

网址：www.yingmi.cn

59. 北京创金启富基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区白纸坊东街 2 号院 6 号楼 712 室

办公地址：北京市西城区白纸坊东街 2 号院 6 号楼 712 室

法定代表人：梁蓉

联系人：魏素清

联系人电话：010-66154828

传真：暂无

客服热线：010-66154828

网址：www.5irich.com

60. 北京度小满基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼 1 层 103 室

办公地址：北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼

法定代表人：葛新

联系人：孙博超

联系人电话：010-61952703

传真：010-59403027

客服热线：95055-4

网址：www.baiyingfund.com

61. 北京虹点基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元

办公地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元

法定代表人：郑毓栋

联系人：姜颖

联系人电话：13522549431

传真：010-65951887

客服热线：400-618-0707

网址：www.hongdianfund.com

62. 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 A 座 1108 号

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 A 座 1108 号

法定代表人：王伟刚

联系人：熊小满

联系人电话：010-56251471

传真：010-62680827

客服热线：400-619-9059

网址：www.hcjjjin.com

63. 北京钱景财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012

办公地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012

法定代表人：赵荣春

联系人：魏争

联系人电话：010-57418829

传真：010-57569671

客服热线：400-678-5095

网址：www.niuji.net

64. 北京雪球基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507

办公地址：北京市朝阳区创远路34号融新科技中心C座1501

法定代表人：钟斐斐

联系人：侯芳芳

联系人电话：010-57319532

传真：010-84997571

客服热线：400-159-9288

网址：<https://danjuanapp.com/>

65. 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

联系人：孙晋峰

联系人电话：010-67000988

传真：010-67000988-6000

客服热线：400-001-8811

网址：www.zcvc.com.cn

66. 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

联系人：张晶晶

联系人电话：010--62020088--8105

传真：010--62020088--8802

客服热线：400-888-6661

网址：www.myfund.com

67. 北京中植基金销售有限公司

注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址：北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 28 层

法定代表人：武建华

联系人：丛瑞丰

联系人电话：(010) 59313555

传真：(010) 56642623

客服热线：400-8180-888

网址：<https://www.zzfund.com>

68. 大连网金基金销售有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

办公地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

法定代表人：樊怀东

联系人：李鑫

联系人电话：0411-39027830

传真：0411-39027835

客服热线：4000-899-100

网址：www.yibaijin.com

69. 鼎信汇金（北京）投资管理有限公司

注册地址：北京市朝阳区霄云路 40 号院 1 号楼 3 层 306 室

办公地址：北京市朝阳区霄云路 40 号院 1 号楼 3 层 306 室

法定代表人：齐凌峰

联系人：陈臣

联系人电话：010-84489855-8011

传真：010-82086110

客服热线：400-158-5050

网址：www.t150.com

70. 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

联系人电话：021-80133597

传真：021-80133413

客服热线：400-808-1016

网址：www.fundhaiyin.com

71. 和耕传承基金销售有限公司

注册地址：郑州市郑东新区东风东路、康宁北街 6 号楼 6 楼

办公地址：郑州市郑东新区东风东路、康宁北街 6 号楼 6 楼

法定代表人：李淑慧

联系人：胡静华

客服热线：4000-555-671

网址：www.hgccpb.com

72. 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

联系人：周轶

联系人电话：021-20835789

传真：021-20835885

客服热线：400-920-0022

网址：licaike.hexun.com

73. 嘉实财富管理有限公司

注册地址：海南省三亚市天涯区三亚湾路国际客运港区国际养生度假中心

酒店 B 座(2#楼)27 楼 2714 室

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼
11 层(100020)

法定代表人：张峰

联系人：董超

联系人电话：18600864868

传真：暂无

客服热线：4000218850

网址：<https://www.harvestwm.cn>

74. 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：南京市鼓楼区中山北路 2 号绿地紫峰大厦 2005 室

法定代表人：吴言林

联系人：张宏鹤

传真：021-53086809

客服热线：025-66046166

网址：www.huilinbd.com

75. 京东肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区西三旗建材城中路 12 号 17 号平房 157

办公地址：北京市通州区亦庄经济技术开发区科创十一街 18 号院京东集团
总部 A 座 15 层

法定代表人：王苏宁

联系人：李丹

联系人电话：010-89187634

传真：010-89189566

客服热线：95118

网址：kenterui.jd.com

76. 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 室

办公地址：浙江省杭州市西湖区西溪路 556 号

法定代表人：王珺

联系人：韩爱彬

联系人电话：021-60897869、0571-28829790

传真：0571-26698533

客服热线：95188-8

网址：www.fund123.cn

77. 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

联系人电话：025-66008800-884131

传真：025-66996699-884131

客服热线：95177

网址：www.snjijin.com

78. 诺亚正行基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路 32 号 c 栋

法定代表人：汪静波

联系人：曾传溢

联系人电话：15521232169

客服热线：400-821-5399

网址：www.noah-fund.com

79. 浦领基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区望京东园四区 2 号楼 10 层 1001 号 04 室

办公地址：北京市朝阳区望京中航资本大厦 10 层

法定代表人：聂婉君

联系人：李艳

联系人电话：010-59497361

传真：010-64788016

客服热线：400-012-5899

网址：www.zscffund.com

80. 上海长量基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层

法定代表人：张跃伟

联系人：邱燕芳

联系人电话：021-20691831

传真：021-20691861

客服热线：400-089-1289

网址：www.erichfund.com

81. 上海大智慧基金销售有限公司

注册地址：中国上海市浦东新区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元

办公地址：中国上海市浦东新区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元

法定代表人：申健

联系人：张蜓

联系人电话：18017373527

传真：暂无

客服热线：021-20292031

网址：www.wg.com.cn

82. 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

联系人：张茹

联系人电话：021-58870011

传真：021-68596919

客服热线：400-700-9665

网址：www.ehowbuy.com

83. 上海华夏财富投资管理有限公司

注册地址：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

法定代表人：毛淮平

联系人：张静怡

联系人电话：010-88066326

客服热线：400-817-5666
网址：www.amcfortune.com

84. 上海汇付基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区黄河路 333 号 201 室 A 区 056 单元
办公地址：上海市徐汇区宜山路 700 号 C5 幢 1 楼
法定代表人：金佶
联系人：甄宝林
联系人电话：021-34013996*3011
传真：021-33323837
客服热线：021-34013999
网址：www.hotjijin.com

85. 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
联系人电话：021-65370077
传真：021-55085991
客服热线：4008-205-369
网址：www.jiyufund.com.cn

86. 上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室
办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼
法定代表人：陈继武
联系人：李晓明
联系人电话：021-63333319
传真：021-63332523
客服热线：4000-178-000
网址：www.lingxianfund.com

87. 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
联系人：程毅
联系人电话：021-50583533
传真：021-50583633
客服热线：400-005-6355
网址：www.leadfund.com.cn

88. 上海联泰基金销售有限公司

注册地址：上海市普陀区兰溪路 900 弄 15 号 526 室
办公地址：上海市虹口区临潼路 188 号
法定代表人：尹彬彬
联系人：陈东
联系人电话：021-52822063
传真：021-52975270
客服热线：400-118-1188
网址：www.66liantai.com

89. 上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 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 15 楼
法定代表人：王之光
联系人：宁博宇
联系人电话：021-20665952
传真：021-22066653
客服热线：4008-219-031
网址：www.lufunds.com

90. 上海陆享基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区南汇新城镇环湖西二路 888 号 1 幢 1 区 14032
室
办公地址：上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇二座 16 层
法定代表人：陈志英
联系人：韦巍

联系人电话：021-53398816

传真：021-53398801

客服热线：021-53398816

网址：www.luxxfund.com

91. 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

联系人：潘世友

联系人电话：021-54509988 分机：7019

传真：021-64385308

客服热线：400-1818-188

网址：www.1234567.com.cn

92. 上海万得基金销售有限公司

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：上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼

法定代表人：王廷富

联系人：徐亚丹

联系人电话：021-5071-2782

传真：021-5071-0161

客服热线：400-821-0203

网址：<http://www.520fund.com.cn>

93. 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：深圳市福田区福田街道民田路 178 号华融大厦 27 层 2704

法定代表人：杨懿

联系人：刘宝文

联系人电话：0755-88394688

客服热线：400-166-1188

网址：www.xinlande.com.cn

94. 深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元
办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元
法定代表人：薛峰
联系人：汤素娅
联系人电话：0755-33227950
传真：0755-82080798
客服热线：4006-788-887
网址：www.zlfund.cn

95. 泰信财富基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国路甲 92 号-4 至 24 层内 10 层 1012
办公地址：北京市朝阳区建国路乙 118 号京汇大厦 1206
法定代表人：张虎
联系人：孔安琪
联系人电话：18201874972
传真：暂无
客服热线：400-004-8821
网址：www.taixincf.com

96. 天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701
法定代表人：林义相
联系人：高舒婕
联系人电话：010-86499838
客服热线：010-66045678
网址：www.txsec.com

97. 通华财富（上海）基金销售有限公司

注册地址：上海虹口区同丰路 667 弄 107 号 201 室
办公地址：上海市浦东新区金沪路 55 号通华科技大厦
法定代表人：沈丹义
联系人电话：400-101-9301
传真：021-6081 0695
客服热线：400-101-9301
网址：<https://www.tonghuafund.com>

98. 玄元保险代理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室

法定代表人：马永谔

联系人：姜帅伯

联系人电话：021-50701003

客服热线：400-080-8208

网址：www.licaimofang.com

99. 阳光人寿保险股份有限公司

注册地址：海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层

办公地址：北京市朝阳区朝外大街 20 号联合大厦 701A 室

法定代表人：李科

联系人：王超

联系人电话：010-59053660

传真：010-8563277

客服热线：95510

网址：fund.sinosig.com

100. 一路财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区宝盛南路 1 号院 20 号楼 9 层 101-14

办公地址：北京市海淀区奥北科技园-国泰大厦 9 层

法定代表人：吴雪秀

联系人：董宣

联系人电话：010-88312877

传真：010-88312099

客服热线：400-001-1566

网址：www.yilucaifu.com

101. 宜信普泽（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C 座 1809 室

法定代表人：沈伟桦

联系人：宋欣晔

联系人电话：010-52361860

传真：010-85894285

客服热线：400-6099-200

网址：www.yixinfund.com

102. 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

联系人电话：0571-88911818-8653

传真：0571-86800423

客服热线：4008-773-772

网址：www.5ifund.com

103. 中国人寿保险股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 16 号

办公地址：北京市西城区金融大街 16 号中国人寿广场 A 座 4 层

法定代表人：王滨

联系人：杨子彤

传真：暂无

客服热线：95519

网址：www.e-chinalife.com

104. 中信期货有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层
1301-1305 室、14 层

办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层
1301-1305 室、14 层

法定代表人：张皓

联系人：李琪

联系人电话：021-80365243

传真：021-60819988

客服热线：400-990-8826

网址：www.citicsf.com

105. 中证金牛（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层

法定代表人：钱昊旻

联系人：沈晨

联系人电话：010-59336544

传真：010-59336586

客服热线：4008-909-998

网址：<http://www.jnlc.com/>

(2) 本基金C类基金份额的代销机构：无。

(3) 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，并在基金管理人网站公示。销售机构可以根据情况变化增加或减少其销售城市（网点）。

(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

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)，6-7层、10层

法定代表人：刘翔

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16楼和19楼

负责人：俞卫锋

电话：(021) 31358666

传真：(021) 31358600

联系人：陈颖华

经办律师：黎明、陈颖华

（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：李乐

经办会计师：王珊珊、李乐

六、基金的募集

本基金募集期为 2004 年 7 月 20 日至 2004 年 8 月 20 日，本次募集的净销售金额为 2,543,673,964.24 元人民币，认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计 613,251.70 元人民币。本次募集有效认购户数为 10,835 户，按照每份基金份额面值 1.00 元人民币计算，本次募集资金及其产生的利息折算成基金份额共计 2,544,287,215.94 份基金份额，已全部计入投资者基金账户，归投资者所有。

经中国证监会核准，本基金的基金合同于 2004 年 8 月 27 日正式生效。

七、基金合同的生效

根据有关规定，本基金满足基金合同生效条件，基金合同于 2004 年 8 月 27 日正式生效。自基金合同生效日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

八、基金份额的申购与赎回

（一）申购和赎回场所

本基金合同生效后,基金的申购和赎回将通过本基金管理人的直销网点及基金代销机构的(网点)进行(代销机构名称和住所等信息请见前文)。基金管理人可指定其他具有相应条件的基金代销机构办理基金份额申购与赎回业务,并在基金管理人网站公示。

同时,在国内的电子支付与结算和其他相关技术成熟后,基金投资者可通过本基金管理人或者指定的基金代销机构进行电话、传真或互联网等形式的申购与赎回。

本基金已开通网上交易业务,相关公告见 2006 年 1 月 16 日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站的《光大保德信基金管理有限公司关于推出开放式基金网上交易业务的公告》。

（二）申购和赎回的开放日及时间

本基金已经开始办理日常申购和赎回等基金业务,办理申购与赎回等基金业务的时间(即开放日)为上海证券交易所、深圳证券交易所的交易日。开放日具体业务办理时间为:每个基金开放日的 9:30—15:00,交易日 15:00 以后接受的交易申请均作为下一个交易日的申请处理。

投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回申请的,其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况,基金管理人将视情况对前述开放日及具体业务办理时间进行相应的调整,但此项调整不应影响投资者利益造成实质影响,基金管理人将有关调整的公告最迟在实施日前 2 日在中国证监会指定媒介公告。

（三）申购与赎回的数额限制

1. 代销网点每个账户每次申购的最低金额为人民币 1,000 元;
2. 投资理财中心每个账户每次申购的最低金额为人民币 1 元;

3. 本基金对单个基金份额持有人持有基金份额的比例或数量不设限制，法律另有规定的除外；

4. 赎回的最低份额为 100 份基金份额，基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回，但某笔赎回导致单个交易账户的基金份额余额少于 100 份时，余额部分基金份额将由注册登记人发起强制赎回；

5. 基金管理人可根据市场情况，调整申购金额和赎回份额的数量限制，基金管理人最迟在调整前 2 日在中国证监会指定媒介上刊登公告；

6. 申购份额、余额的处理方式：申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以当日该类基金份额净值为基准计算，以四舍五入的方法保留到小数点后两位；

7. 赎回金额的处理方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额净值为基准并扣除相应的费用，以四舍五入的方法保留到小数点后两位；

8. 当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。

（四）申购与赎回的原则

1. “未知价”原则，即基金申购与赎回以申请当日的该类基金份额净值为基准进行交易；

2. “金额申购，份额赎回”原则，即本基金申购以金额申请，基金赎回以基金份额申请；

3. 申购费用按单笔申购确认金额对应的费率和单笔确认的申购金额以“外扣法”计算而得；

4. 当日的申购和赎回申请可以在当日交易结束时间前撤消，在当日交易时间结束后不得撤消；

5. 基金管理人可根据基金运作的实际情况在不损害基金份额持有人利益的前提下更改上述原则。基金管理人最迟于新规则开始实施日的 2 日前在中国证监会指定媒介上刊登公告。

（五）申购与赎回的程序

1. 申请方式：基金投资者须按照基金销售机构的规定，在开放日的业务办理时间提出申购或赎回的申请，并办理有关手续。投资者提交申购申请时，须按销售机构规定的方式备足申购资金；提交赎回申请时，其在销售机构（网点）必须有足够的基金份额余额。否则，所提交的申购、赎回的申请无效，不予成交。

2. 申购、赎回的确认与通知：对在 T 日规定时间内受理的申请，在正常情况下，基金份额持有人可在 T+2 个工作日内到其办理申请业务的销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申购与赎回的确认情况。

3. 申购、赎回款项的支付的方式与时间：基金申购采用全额缴款方式，若资金在规定时间内未能全额到账，则申购不成功。若申购不成功或无效，基金管理人或基金管理人指定的代理人将投资者已缴付的申购款项本金退还给投资者。基金份额持有人赎回申请确认后，赎回款项通常在 T+7 日内划往赎回人预留的银行帐户。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照有关巨额赎回的条款处理。

4. 若投资者进行申购申请后，基金管理人发生灾害导致无法对申购人及其份额进行准确确认时，基金管理人会将所有申购款项退还至各销售机构，投资者可在基金管理人相关能力恢复后再次提交申购申请。

T 日的各类基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

5. 申购和赎回的注册登记：基金投资者申购本基金成功后，基金注册登记人在 T+1 日为基金份额持有人登记权益并办理注册登记手续，基金投资者在 T+2 日（含该日）后有权赎回该部分基金。基金份额持有人赎回本基金成功后，基金注册登记人在 T+1 日为基金份额持有人扣除权益并办理登记结算手续。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述注册与过户登记办理时间进行调整，但不得实质影响基金份额持有人的合法权益，并最迟于开始实施前 2 日在中国证监会指定媒介上公告。

（六）申购和赎回的费用

1、本基金的申购费率：

（1）A类基金份额的申购费率见下表：

申购金额（含申购费）	A类基金份额申购费率
1000万元以下	1.5%
1000万元以上（含1000万元）	每笔交易1000元人民币

A类基金份额的申购费用由申购A类基金份额的投资人承担，不计入基金财产，用于基金的市场推广及销售等各项费用。

（2）C类基金份额不收取申购费。

2、A类基金份额的赎回费用由赎回A类基金份额的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。其中，对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。其他情形下，A类基金份额的赎回费中归入基金财产的比例不得低于赎回费总额的25%，其余部分用于支付注册登记费等手续费用。对于C类基金份额，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。

A类基金份额的赎回费率设置如下表所示：

持续持有期	A类基金份额赎回费率
7日以内	1.5%
7日至1年（含7日）	0.5%
1年至2年（含1年）	0.2%
2年及以上	0%

注：赎回费的计算中1年指365个公历日。

C类基金份额赎回费率设置如下表所示：

持续持有期	C类基金份额赎回费率
7日以内	1.5%
7日至30日（含7日）	0.5%
30日及以上（含30日）	0%

基金份额持有期限自基金合同生效日（对认购份额而言）或登记机构申购申请确认日（对申购份额而言）或登记机构转入申请确认日（对转入份额而言）起开始计算，自该部分基金份额赎回/转出申请确认日止，且基金份额赎回/转出申请确认日不计入持有期限。

（七）申购与赎回的数额和价格

1. 基金申购份额的计算：

（1）本基金 A 类基金份额的申购金额包括申购费用和净申购金额，计算公式如下：

1) 申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方法如下：

净申购金额=申购金额/（1+申购费率）

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/申购当日 A 类基金份额净值

2) 申购费用为固定金额时，申购份额的计算方法如下：

申购费用=固定金额

净申购金额=申购金额-申购费用

申购份额=净申购金额/申购当日 A 类基金份额净值

（2）本基金的 C 类基金份额申购份额的计算方法如下：

申购份额=申购金额/申购当日 C 类基金份额净值

（3）基金份额按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

例 1：某投资人在 T 日投资 5,000.00 元申购本基金 A 类基金份额，对应费率为 1.50%，申购当日的 A 类基金份额净值为 1.2000 元，则其可得到的 A 类基金份额为：

净申购金额=5,000.00/（1+1.50%）=4,926.11 元

申购费用=5,000.00-4,926.11=73.89 元

申购份额=4,926.11/1.2000=4,105.09 份

即投资人在 T 日投资 5,000.00 元申购本基金 A 类基金份额，可得到 4,105.09 份 A 类基金份额。

例 2：某投资人在 T 日投资 5,000.00 元申购本基金 C 类基金份额，申购当日的 C 类基金份额净值为 1.2000 元，则其可得到的 C 类基金份额为：

申购份额=5,000.00/1.2000=4,166.67 份

即投资人在 T 日投资 5,000.00 元申购本基金 C 类基金份额，可得到 4,166.67 份 C 类基金份额。

2. 基金赎回金额的计算：

基金的净赎回金额为赎回金额扣减赎回费用，计算公式如下：

赎回价格=申请日该类基金份额净值

赎回金额=赎回份额×赎回价格

赎回费用=赎回金额×赎回费率

净赎回金额=赎回金额-赎回费用

例 3：假定某投资者在 T 日赎回 10,000 份本基金 A 类基金份额，持有期限为 10 日，对应赎回费率为 0.5%，该日 A 类基金份额净值为 1.1500 元，则其获得的净赎回金额计算如下：

赎回金额=10,000×1.1500=11,500.00 元

赎回费用=11,500.00×0.5%=57.50 元

净赎回金额=11,500.00-57.50=11,442.50 元

即投资者在 T 日赎回 10,000 份本基金 A 类基金份额，持有期限为 10 日，净赎回金额为 11,442.50 元。

例 4：假定某投资者在 T 日赎回 10,000 份本基金 C 类基金份额，持有期限满 30 日，对应赎回费率为 0%，该日 C 类基金份额净值为 1.1500 元，则其获得的净赎回金额计算如下：

赎回金额=10,000×1.1500=11,500.00 元

赎回费用=11,500.00×0%=0.00 元

净赎回金额=11,500.00-0.00=11,500.00 元

即投资者在 T 日赎回 10,000 份本基金 C 类基金份额，持有期限满 30 日，净赎回金额为 11,500.00 元。

3. 本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码，分别计算和公告各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。本基金各类基金份额净值的计算，均保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。申请日（T 日）的各类基金份额净值在当天证券交易所收市后计算，并在下一交易日（T+1 日）公告。遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

基金份额净值的计算公式为：

某类基金份额净值=该类基金资产净值总额/发行在外的该类基金份额总数。

(八) 拒绝或暂停申购的情形

出现以下情况之一时，基金管理人可以拒绝或暂停接受、办理申购申请：

- (1) 不可抗力原因导致基金无法正常工作；
- (2) 证券交易所交易时间内非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- (3) 因技术故障或人员伤亡导致基金销售系统或基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行；
- (4) 基金管理人认为接受某笔或某些申购可能会损害已有基金份额持有人利益；
- (5) 基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形；
- (6) 申请超过基金管理人设定的单笔申购的最高金额、单个投资人单日申购金额上限、本基金单日净申购比例上限、本基金总规模上限的；
- (7) 当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施；
- (8) 法律、法规规定或中国证监会认定的其他拒绝或暂停接受申购申请的情形。

发生上述（1）至（3）项或（7）、（8）项情形时，基金管理人应及时在指定媒介上刊登暂停申购的公告。

如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项将退还给投资人。

(九) 拒绝、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

出现以下情况之一时，基金管理人可以暂停接受或办理赎回申请：

- (1) 不可抗力的原因导致基金无法正常工作；

(2) 证券交易场所在交易时间内非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

(3) 因市场剧烈波动或其他原因，基金连续两个开放日以上（含本数）发生巨额赎回或在 10 个工作日内发生 3 次以上（含本数）巨额赎回；

(4) 当前一估值日基金资产净值 50% 以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施；

(5) 法律、法规、规章规定的其他情形或其他在基金合同、招募说明书中已载明并获中国证监会批准的特殊情形。

发生上述情形之一的，基金管理人将在当日立即向中国证监会备案并及时在指定媒介上刊登暂停赎回的公告。已接受的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能支付的，将按每个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分在后续工作日予以兑付。

(十) 巨额赎回的情形及处理方式

1. 巨额赎回的认定

基金单个开放日，基金净赎回申请份额（净赎回申请份额 = 赎回申请份额 + 转出申请份额 - 申购申请份额 - 转入申请份额）超过上一日基金总份额的 10% 时，为巨额赎回。

2. 巨额赎回的处理方式

巨额赎回申请发生时，基金管理人可以根据本基金当时的现金情况决定全额赎回、部分延期赎回或者暂停赎回；

(1) 全额赎回：按正常的赎回程序办理；

(2) 部分延期赎回：巨额赎回申请发生时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于基金总份额的 10% 的前提下，可以对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；未受理部分可延迟至下一个开放日办理，并以该开放日当日的基金资产净值为依据计算赎回金额，但基金份额持有人可在申请赎回时选择将当日未获受理部分予以撤销。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权并将以下一个开放日的该类基金份额净值为基准计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。

若本基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过基金总份额 30%以上（“大额赎回申请人”）的赎回申请的情形下，基金管理人可以延期办理赎回申请。基金管理人应当按照保护其他赎回申请人（“小额赎回申请人”）利益的原则，优先确认小额赎回申请人的赎回申请。具体为：如小额赎回申请人的赎回申请在当日被全部确认，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一工作日基金总份额的 10%的前提下，在仍可接受赎回申请的范围内对该等大额赎回申请人的赎回申请按比例确认，对该等大额赎回申请人当日未予确认的部分延期办理。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该类基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直至全部赎回。如小额赎回申请人的赎回申请在当日未被全部确认，则对全部未确认的赎回申请（含小额赎回申请人的其余赎回申请与大额赎回申请人的全部赎回申请）延期办理。延期办理的具体程序，按照本条规定的延期赎回或取消赎回的方式办理。基金管理人应当对延期办理赎回申请的事宜在指定媒介上刊登公告。

发生巨额赎回并延期支付时，基金管理人应在 3 个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方式，并在 2 日内在中国证监会指定媒介公告。

暂停赎回：本基金连续两个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过正常支付时间的 20 个工作日，并应当在中国证监会指定媒介上进行公告。

（十一）暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

发生基金合同或招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人有关正当理由认为需要暂停基金申购、赎回申请的，应当报经中国证监会批准；经批准后，基金管理人应当按规定在指定媒介上刊登暂停公告。暂停期间，基金管理人将每 2 周至少刊登提示性公告一次；暂停期间结束，基金重新开放时，基金管理人应按规定在中国证监会指定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个工作日的各类基金份额净值。

1. 如果发生暂停的时间为 1 天，基金管理人应于重新开放日在指定媒介刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并公布最新的各类基金份额净值。

2. 如果发生暂停的时间超过 1 天但少于两周, 基金管理人应于重新开放申购或赎回日前按规定在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回的公告, 并于重新开放申购或赎回日公告最新的各类基金份额净值。

3. 如果发生暂停的时间超过两周, 基金管理人应在暂停期间每两周至少重复刊登暂停公告一次。暂停结束基金重新开放申购或赎回时, 基金管理人应按规定在指定媒介连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告, 并在重新开放申购或赎回日公告最新的各类基金份额净值。

(十二) 基金转换

1. 基金转换业务适用投资者范围

已持有本公司管理的基金中任一只基金的投资者。

2. 销售机构

投资者可通过光大保德信直销平台及相关代销机构办理本基金与公司管理的其他基金之间的基金转换业务。

3. 基金转换办理时间

投资者可在基金开放日申请办理基金转换业务, 具体办理时间与基金申购、赎回业务办理时间相同。

4. 基金转换费率

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的申购费率视为 0;

基金在完成转换后不连续计算持有期;转入的基金份额持有期限自登记机构转入申请确认之日起开始计算,自该部分基金份额赎回或转出申请确认日止,且基金份额赎回或转出申请确认日不计入持有期限。

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

5. 基金转换规则

1. 基金转换只能在同一销售机构办理,且该销售机构须同时代理拟转出基金及拟转入基金的销售。

2. 基金转换采取“未知价”法,即以申请受理当日各转出、转入基金的单位资产净值为基础进行计算。

3. 基金转换遵循“份额转换”的原则,转换申请份额精确到小数点后两位,单笔转换申请份额不得低于 100 份,当单个交易账户的基金份额余额少于 100 份时,必须一次性申请转换。

4. 当日的基金转换申请可以在当日交易结束时间前撤销,在当日的交易时间结束后不得撤销。

5. 转换费用实行外扣法收取,基金转换费用由基金持有人承担。

6. 基金转换的注册登记

1. 基金投资者提出的基金转换申请,在当日交易时间结束前可以撤销,交易时间结束后即不得撤销。

2. 基金份额持有人的基金转换成功后,基金注册登记机构在 T+1 工作日为基金份额持有人申请进行确认,确认成功后为基金持有人办理相关的注册登记手续。

3. 本公司可在法律法规允许的范围内,对上述注册登记办理时间进行调整,并按规定予以公告。

7. 暂停基金转换的情形及处理

出现下列情况之一时,基金管理人可以暂停接受基金持有人的基金转换申请:

1. 不可抗力的原因导致基金无法正常工作;
2. 证券交易所在交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值;
3. 因市场剧烈波动或其它原因而出现连续巨额赎回,基金管理人认为有必要暂停接受该基金份额的转出申请;
4. 法律、法规、规章规定的其他情形或其他在基金合同、招募说明书已载明并获中国证监会批准的特殊情形。

发生上述情形之一的,基金管理人应于规定期限内在中国证监会指定媒介上刊登暂停公告。重新开放基金转换时,基金管理人应按规定予以公告。

(十三) 基金份额的转让

无

(十四) 基金的非交易过户

非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式,将一定数量的基金份额按照一定规则从某一基金份额持有人基金账户转移到另一基金份额持有人基金账户的行为。

基金注册登记人只受理继承、捐赠、司法强制执行等情况下的非交易过户。其中继承是指基金份额持有人死亡,其持有的基金份额由其合法的继承人继承;捐赠是指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体;司法强制执行是指司法机关依据生效的司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制判决划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。

办理非交易过户时必须提供注册登记机构要求提供的相关资料并按基金注册登记人规定的标准支付费用。

(十五) 基金的转托管

基金份额持有人可以以同一基金账户在多个销售机构申购(认购)基金份额,但在赎回的情况下,必须向原申购(认购)的销售机构申请办理相应部分基金份额的赎回手续。

投资者申购(认购)基金份额后可以向原申购(认购)基金的销售机构发出转托管指令,缴纳转托管手续费,转托管完成后投资者方可以在转入的销售机构赎回其基金份额。

(十六) 定期定额投资计划

开放式基金定期定额申购业务是指投资者可通过基金销售机构提交申请,约定每期申购时间和申购金额,由销售机构于每期约定申购日在投资者指定资金账户内自动完成扣款和基金申购申请的一种投资方式。

1. 定期定额申购业务适用投资者范围

符合基金合同规定的所有个人投资者和机构投资者。

2. 办理时间

投资者可在基金开放日申请办理定期定额申购业务,具体办理时间与基金申购、赎回业务办理时间相同。

3. 销售机构

投资者可通过光大保德信直销平台及相关代销机构办理本基金的定期定额申购业务。

4. 办理方式

1. 申请办理定期定额申购业务的投资者须拥有光大保德信基金管理有限公司开放式基金账户,具体开户程序请遵循各销售机构规定;

2. 投资者开立基金账户后携带本人有效身份证件和有关凭证到指定的各销售机构网点申请办理光大保德信开放式基金的定期定额申购业务,具体办理程序请遵循各销售机构的有关规定。

5. 扣款金额

光大保德信量化核心证券投资基金投资者可与代销机构约定每期固定扣款金额,每期扣款金额不得低于人民币 100 元(含 100 元),不设金额级差。光大保德信量化核心证券投资基金投资者可与本公司网上直销交易平台约定每期固定扣款金额,每期扣款金额不得低于人民币 1 元(含 1 元),不设金额级差。

6. 扣款日期

1. 投资者应遵循销售机构的规定并与销售机构约定每期固定扣款日期；
2. 如果在约定的扣款日前投资者开办定期定额业务的申请得到成功确认，则首次扣款日为当期，否则为次期。

7. 扣款方式

1. 销售机构将按照投资者申请时所约定的每期固定扣款日和扣款金额进行自动扣款，若遇非基金开放日则顺延到下一基金开放日；
2. 投资者须指定一个销售机构认可的资金账户作为每期固定扣款账户；
3. 投资者账户余额不足则不扣款，请投资者于每期扣款日前在账户内按约定存足资金，以保证业务申请的成功受理。

8. 申购费率

如无另行公告，定期定额申购费率及计费方式等同于对应类别基金份额一般的申购业务。

9. 交易确认

每期实际扣款日与基金申购申请日为同一日，以该日（T日）的基金单位资产净值为基准计算申购份额，申购份额将在 T+1 工作日确认成功后直接计入投资者的基金账户。投资者可自 T+2 工作日起查询定期定额申购成交情况。

10. 变更与解约

如果投资者想变更每期扣款金额和扣款日期，可提出变更申请；如果投资者想终止定期定额申购业务，可提出解除申请，具体办理程序请遵循相关销售机构的规定。

（十七）基金的冻结、解冻与质押

基金注册登记人只受理司法机构及其他有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻。基金份额的冻结手续、冻结方式按照基金注册登记机构的相关规定办理。

在有关法律法规有明确规定的情况下，本基金将可以办理基金份额的质押业务或其他业务，基金管理人将制定、公布、实施相应的业务规则。

九、基金的投资

(一) 基金的投资

(一) 投资目标

追求长期持续稳定超出业绩比较基准的投资回报。

(二) 投资理念

以量化投资为核心的理性投资管理

以控制风险为前提的积极投资管理

以稳健收益为目标的长期投资管理

(三) 投资方向

本基金的投资方向为具有良好流动性的金融工具,包括在国内依法公开发行的股票、存托凭证、法律法规及证监会允许基金投资的其它金融工具。其中股票投资对象重点为基本面良好且具有持续增长潜力,股价处于合理区间的优质股票。

(四) 投资策略

本基金借鉴了外方股东保德信投资的量化投资管理理念和长期经验,结合中国市场现行特点加以改进,形成光大保德信独特的量化投资策略;正常市场情况下不作主动资产配置,采用自下而上与自上而下相结合的方式选择股票;并通过投资组合优化器构建并动态优化投资组合,确保投资组合风险收益特征符合既定目标。

本基金在正常市场情况下不作主动资产配置,股票及存托凭证资产的基准比例为基金资产净值的 90%,浮动范围为 85—95%;现金的基准比例为基金资产净值的 10%,浮动范围为 5—15%。

本基金建仓时间为 6 个月,基金在合同生效后 6 个月内达到上述比例限制。

针对开放式基金申购/赎回的异常流动性需求,资产配置可不受上述比例限制,但基金管理人将在合理期限内调整投资组合,使基金资产配置比例恢复至正常市场情况下的水平,上述合理期限指 10 个交易日,法律法规另有规定时,从其规定。

本基金通过光大保德信特有的以量化投资为核心的多重优化保障体系构建处于或接近有效边际曲线的投资组合。该体系在构建投资组合时综合考量收益因素及风险因素,一方面通过光大保德信独特的多因素数量模型对所有股票的预期收益率进行估算,个股预期收益率的高低直接决定投资组合是否持有该股票;另

一方面投资团队从风险控制的角度出发，重点关注数据以外的信息，通过行业分析和个股分析对多因素数量模型形成有效补充，由此形成的行业评级和个股评级将决定行业及个股权重相对业绩基准的偏离范围；然后由投资组合优化器通过一定的量化技术综合考虑个股预期收益率，行业评级和个股评级等参数，根据预先设定的风险目标构建投资组合，并对投资组合进行动态持续优化，使投资组合风险收益特征符合既定目标；最后由交易员根据具体投资方案进行交易。具体流程如下图所示：

1. 多因素数量模型的运用

本基金借鉴保德信投资的量化投资管理经验，根据中国市场运行特征从股票估值，成长趋势及数据质量三方面选取对 A 股股价波动具有较强解释度的共同指标作为多因素数量模型的参数，通过一定的量化技术估算出共同指标的收益贡献率，并按一定权重加总得出个股预期收益率，作为投资组合构建的重要依据。估值类指标主要判断股票价格是否正确反映了公司基本面状况；趋势类指标说明股票现有估值是否能够持续；质量类指标判断是否存在暗示现行基本面趋势可能逆转的警戒信号。同时数量小组还将根据市场变化趋势定期或不定期地对模型参数及相关系数进行复核，并做相应调整以确保参数的有效性。

2. 行业评级

行业评级首先根据行业特性的不同对行业进行划分，我们将行业划分为周期性行业，防御性行业及增长性行业，并根据行业动向和实际发展状况对行业划分

进行动态调整；在此基础上通过行业景气定位图对行业的周期性变化特征进行分析，并判断每个行业目前所处的景气阶段；然后通过树状集群行业评价体系对行业进行系统性评价；最终确定行业评级及行业权重相对业绩基准的偏离范围，为投资组合优化提供行业层面的决策建议。

3. 个股评级

研究团队采用定量分析与定性分析相结合的股票评估模型对上市公司进行综合评级，为投资组合优化提供个股层面的决策建议。研究团队着重关注上市公司数据可靠性及消息面对股价的潜在影响，从财务评分模型及公司质量评分模型两方面着手对公司基本面进行全面系统的分析和判断，得出股票综合评级，并根据股票评级确定投资组合中单个股票相对业绩基准的偏离范围。

4. 投资组合优化器的运用

投资组合优化器以风险收益配比原则为核心，通过一定的量化技术综合考虑个股预期收益率，行业评级和个股评级等参数，对投资组合进行前瞻性的风险配置，根据预先设定的风险目标构建符合参数设置并处于有效边际曲线上的投资组合，即一定风险水平下收益最高的投资组合。投资组合优化器还通过量化模型预测投资组合整体风险程度，对投资组合进行动态持续优化。如果由于股价波动等因素造成事前跟踪误差超出我们预先设定的风险区域，投资团队将在优化器中根据风险归因分析对边际风险贡献率最大的股票进行调整，以降低事前跟踪误差，使投资组合所承担的风险程度符合既定目标，并使风险尽量集中分布在投资团队对该风险因素的把握具有高置信度的区域。

5. 权证的投资

(1) 权证的投资策略

在控制投资风险和保障基金财产安全的前提下，本公司对权证进行积极主动投资，获取较高的投资组合收益水平。权证投资策略主要包括以下几个方面：

A. 本公司主要采用 Black-Scholes 定价公式和二叉树模型对权证进行定价，并根据市场实际情况，调整权证定价模型及其参数，得到权证的理论价值，作为权证投资的价值基准。

B. 权证价格的对于决定其风险因素的敏感度，本基金通过风险参数的形式进行衡量。

C. 本基金通过权证与证券的组合投资，进行基金财产的止损保护。

D. 本基金通过采取现金套利（Cash extraction）策略，兑现投资收益，保留未来获利空间。

E. 同时，本基金还将采用二叉树模型对美式权证以及各类复杂型权证进行理论定价。

F. 基金经理通过对理论价格和隐含波动率的合理性分析，基于对证券价格的未来表现和预期波动率变化的分析判断，主动投资于价值被市场低估的权证品种。

（2）权证的投资决策流程

A. 权证的投资研究过程

研究人员对于基础股票进行深入的调研和分析，并将结果通过定量化模型，对股票进行估值；数量分析小组负责构建和维护权证定价模型，在股票估值的基础上，对于权证的价值进行分析。投资组合委员会在研究分析的基础上，结合基金的实际状况确定投资策略。风险分析小组则通过独立的系统，对权证的风险进行测算，在各种可能的情景下，对权证进行估价，从而确定权证的投资风险，为投资组合委员会的投资策略确定提供参考。

B. 权证的投资决策过程

a. 权证投资方案的制定

投资组合委员会在研究人员和数量分析人员的工作基础上，结合基金的实际状况确定投资方案。

b. 权证投资的授权和审批

凡单个品种累计投资额度不超过基金资产净值的 5%（暂定）的权证投资，可由基金经理自主执行，并向投资总监备案。

凡单个品种累计投资额度超过基金资产净值的 5%（暂定）的权证投资，由投资组合委员会向公司投资决策委员会申请审批。投资方案得到批准后，由基金经理在授权的范围内实施。

c. 投资计划调整

投资组合委员会根据市场变化、投资计划的实施情况和执行效果、投资分析报告（包括投资表现评估报告、风险分析报告）等，进一步分析判断，并据此进行调整。如果遇有重大变化需要修改投资方案，须按相应程序批准后方可实施。

（五）业绩比较基准

$90\% \times \text{沪深 300 指数} + 10\% \times \text{同业存款利率}$

如果今后证券市场中出现其它代表性更强，更适合投资的指数，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。

本基金由于上述原因变更业绩比较基准应经投资决策委员会批准后报中国证监会核准，基金管理人必须在调整前按规定在中国证监会指定媒介上刊登公告。

(六) 风险收益特征

本基金为股票型基金，其预期收益和风险高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。按照风险收益配比原则对投资组合进行严格的风险管理，在风险限制范围内追求收益最大化。本基金通过光大保德信特有的风险管理及绩效评估体系 EPPIC (Everbright Pramerica Portfolio Insight Computation) 对投资风险进行全程嵌入式风险管理，通过风险预算管理及实时监控对投资风险进行事前监测，事中监控，事后监察，将风险水平控制在既定目标之内，并使风险尽量集中分布在置信度高的区域。

(七) 投资决策

1. 投资依据

本基金管理人将主要依据下述因素决定基金资产配置和具体证券的买卖：

符合基金份额持有人利益最大化的原则

国家有关法律法规，基金合同及公司章程的有关规定

国家宏观经济环境及其对证券市场的影响；

国家货币政策、产业政策以及证券市场政策；

各行业、地区发展状况；

上市公司财务状况、行业环境、市场需求状况及其当前市场价格；

证券市场资金供求状况及未来走势。

2. 投资管理程序

本基金强调团队式的投资管理机制，是国际成熟投资理念及本土长期投资经验的有效组合。在强调团队式管理机制的同时，各层次的投资决策主体各司其职，明确权限设置及分工，对投资决策过程进行严格的风险管理。

(1) 投资决策委员会是公司负责宏观投资决策和投资监督的机构，确定投资原则和投资范围；制定投资决策流程及权限设置；决定对基金经理的投资授权并审核批准超出基金经理投资权限的投资项目；定期对投资流程及投资决定进行审查。投资决策委员会由总经理、副总经理、投资总监、基金经理、研究主管和主要研究人员等人员组成。投资决策委员会的主任委员由总经理担任，一般每季度召开例会，如发生重大事宜，投资决策委员会召开临时会议作出相应决策；

(2) 投资总监负责投资组合委员会的日常管理，投资组合委员会每周召开例会，决定资产配置和投资组合构建的具体方案，对日常投资流程和投资决策进行审查；评估投资流程中的各个因素以便进一步优化整个流程，及时适应市场环境

的变化。投资组合委员会由首席投资总监、投资总监、基金经理以及其他相关研究人员组成；

(3) 数量分析员着重关注量化研究，关注证券估值及预期收益率预测，每日将股票基本数据导入多因素数量模型，由数量模型预估股票预期收益率，作为投资组合构建的重要依据；

(4) 基金经理主要负责投资组合的日常管理，使投资组合的风险收益特征符合既定目标。基金经理着重关注行业景气状况及未来变动趋势，对行业进行评级，为投资组合优化提供行业选择的投资建议。此外，基金经理还负责研究新股及股票增发策略，并作出相应的投资决策；

(5) 研究员着重评估数据质量及可靠度，通过走访公司，对上市公司商业运营模式，公司治理情况，盈利状况及成长性，管理者能力和诚信度等基本面因素进行综合评估，并结合定量分析与定性分析对上市公司进行评级，为投资组合优化提供个股选择的建议；

(6) 数量分析员将多因素数量模型估算的股票预期收益率及投资团队设置的投资组合优化参数导入投资组合优化器，产生经优化的投资组合备选方案，报投资组合委员会审议批准；

(7) 投资组合方案经投资总监负责的投资组合委员会批准后，由基金经理制定具体的建仓平仓计划，并决定买卖时机，以投资指令的形式下达至集中交易室。基金经理还应依据基金申购和赎回的情况控制投资组合的流动性风险；

(8) 集中交易室依据投资指令制定交易策略，统一执行投资交易计划，进行具体交易，并将指令的执行情况反馈给基金经理。投资组合决定权必须与交易下单权严格分离；

(9) 风险控制委员会根据市场变化对投资组合计划提出风险防范措施。监察稽核部对计划的执行过程进行日常监督和实时风险控制，投资组合方案执行完毕，基金经理负责向风险控制委员会，投资决策委员会及投资组合委员会提出总结报告；

(10) 数量小组定期和不定期对基金进行投资表现绩效分析及风险评估，并提供相关报告，帮助投资团队和风险控制委员会及时了解基金收益主要来源及投资策略实施效果，投资组合风险水平及风险来源，从而及时调整投资组合，使其风险收益水平符合既定目标。

基金管理人有权在确保基金份额持有人利益的前提下根据实际情况对上述投资程序进行调整。

(八) 投资限制

1. 本基金持有一家上市公司的股票，不得超过基金资产净值的 10%；
2. 本基金持有一家上市公司发行的证券，不得超过该证券发行总量的 10%；

3. 本基金与本基金管理公司管理的其它基金持有一家公司发行的证券总量不得超过该证券的 10%；

4. 本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

5. 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合本款所规定比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

6. 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

7. 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行；

8. 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 5%。

9. 本基金持有的全部权证，其市值不超过基金资产净值的 3%。

10. 公司管理的全部基金持有的同一权证不超过该权证的 10%。

11. 中国证监会规定的其它比例限制。

本基金在基金合同生效后六个月内应达到上述比例限制。因基金规模变动，市场剧烈变化或其它不可抗力因素导致投资组合不符合上述规定比例不在限制之内，但基金管理人应在合理期限内尽快进行调整，以使投资组合符合上述规定。法律法规另有规定时，从其规定。

（九）禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

1. 投资于其他基金；
2. 以本基金的名义使用不属于本基金名下的资金买卖证券；
3. 将基金资产用于非法抵押、担保、资金拆借或者贷款；
4. 以基金资产进行房地产投资；
5. 从事可能使基金资产承担无限责任的投资；
6. 从事证券信用交易；
7. 将基金资产投资于与基金托管人或者基金管理人有利害关系的公司所发行的证券；
8. 内幕交易、操纵市场、通过关联交易损害基金份额持有人的利益；
9. 配合基金管理人的发起人及其他任何机构的证券投资业务；

10. 故意维持或抬高基金管理人的发起人及其他任何机构所承销股票的价格；

11. 进行证券承销；

12. 通过关联交易、利益输送等损害基金份额持有人的利益；

13. 法律、法规、中国证监会及基金合同禁止从事的其他行为。

(十) 基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则

基金管理人接受基金份额持有人的委托，履行法律、法规、中国证监会及基金合同规定的义务，按照国家有关规定代表本基金独立行使股东权利，恪尽职守、合法合规行使股东权利，充分维护基金份额持有人的利益。基金管理人在代表基金行使股东权利时应遵守以下原则：

1. 不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
2. 不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益；
3. 有利于基金资产的安全和增值；
4. 独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；
5. 基金管理人按照国家有关规定代表本基金行使股东权利。

(二) 基金投资组合报告

本投资组合报告所载数据截至 2023 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	1,148,895,024.78	89.89
	其中：股票	1,148,895,024.78	89.89
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	128,842,010.52	10.08
7	其他各项资产	320,974.16	0.03
8	合计	1,278,058,009.46	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	21,236,349.21	1.67
C	制造业	771,558,226.68	60.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	45,847,263.04	3.60
E	建筑业	3,732,036.67	0.29
F	批发和零售业	39,026,243.45	3.07
G	交通运输、仓储和邮政业	31,167,992.67	2.45
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,525,189.63	2.01
J	金融业	83,989,573.67	6.60
K	房地产业	29,270,641.12	2.30
L	租赁和商务服务业	32,373,943.07	2.54
M	科学研究和技术服务业	42,753,531.39	3.36
N	水利、环境和公共设施管理业	18,535,631.45	1.46
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,850,912.65	0.30
R	文化、体育和娱乐业	27,490.08	0.00
S	综合	-	-
	合计	1,148,895,024.78	90.25

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	601328	交通银行	3,168,000	18,374,400.00	1.44
2	601398	工商银行	3,784,000	18,238,880.00	1.43
3	002032	苏泊尔	351,000	17,550,000.00	1.38
4	603369	今世缘	298,947	15,784,401.60	1.24
5	600015	华夏银行	2,794,280	15,117,054.80	1.19
6	300661	圣邦股份	174,758	14,352,874.54	1.13
7	601888	中国中免	128,400	14,192,052.00	1.11
8	002068	黑猫股份	990,800	11,760,796.00	0.92
9	601021	春秋航空	197,300	11,338,831.00	0.89

10	300946	恒而达	294,340	11,190,806.80	0.88
----	--------	-----	---------	---------------	------

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

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

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

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持有国债期货。

11、投资组合报告附注

11.1 前十名证券中，交通银行(601328 SH)，交通银行股份有限公司于2022年11月4日收到中国银行保险监督管理委员会出具的银保监罚决字(2022)46号。主要内容为：一、个人经营贷款挪用至房地产市场二、个人经营贷款“三查”不到位三、总行对分支机构管控不力承担管理责任。处罚结果：罚款500万。

工商银行(601398 SH)，中国工商银行股份有限公司于2023年4月4日中国银行间市场交易商协会开展的自律调查，主要内容为：工商银行股份主承销的多期债务融资工具发行定价严重偏离市场合理水平，干扰了市场秩序，涉嫌违反银行间债券市场自律管理相关规定。

基金管理人按照内部研究工作规范对以上证券进行分析后将其列入基金投资对象备选库并跟踪研究。以上处罚事件发生后，基金管理人密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

除上述证券外，本基金本报告期末投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的情况。

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	306,909.78
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	14,064.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	320,974.16

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

十、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

光大保德信量化股票 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
2004年8月27日 -2004年12月31 日	-5.44%	0.68%	-2.45%	1.05%	-2.99%	-0.37%
2005年	-7.36%	1.15%	-7.11%	1.12%	-0.25%	0.03%
2006年	122.98%	1.32%	111.41%	1.24%	11.57%	0.08%
2007年	155.61%	2.13%	127.74%	2.06%	27.87%	0.07%
2008年	-64.75%	2.95%	-61.28%	2.71%	-3.47%	0.24%
2009年	90.61%	1.93%	80.20%	1.84%	10.41%	0.09%
2010年	-3.20%	1.59%	-10.67%	1.40%	7.47%	0.19%
2011年	-21.07%	1.28%	-20.81%	1.16%	-0.26%	0.12%
2012年	8.31%	1.19%	8.55%	1.12%	-0.24%	0.07%
2013年	13.07%	1.35%	-8.02%	1.26%	21.09%	0.09%
2014年	16.91%	1.06%	44.17%	1.09%	-27.26%	-0.03%
2015年	50.27%	2.56%	5.82%	2.24%	44.45%	0.32%
2016年	-6.74%	1.69%	-9.95%	1.26%	3.21%	0.43%
2017年	-8.35%	0.76%	19.54%	0.57%	-27.89%	0.19%
2018年	-27.42%	1.22%	-22.89%	1.20%	-4.53%	0.02%
2019年	37.04%	1.15%	32.26%	1.12%	4.78%	0.03%
2020年	36.88%	1.36%	24.53%	1.29%	12.35%	0.07%
2021年	-0.20%	1.22%	-4.51%	1.05%	4.31%	0.17%
2022年	-25.27%	1.22%	-19.53%	1.15%	-5.74%	0.07%
2023年1月1日 至2023年6月30 日	7.04%	0.72%	-0.62%	0.76%	7.66%	-0.04%
自基金合同生效 至今	412.34%	1.58%	210.30%	1.45%	202.04%	0.13%

光大保德信量化股票 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

2023年4月21日 -2023年6月30日	4.46%	0.73%	-4.23%	0.75%	8.69%	-0.02%
自基金合同生效至今	4.46%	0.73%	-4.23%	0.75%	8.69%	-0.02%

(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

光大保德信量化核心证券投资基金

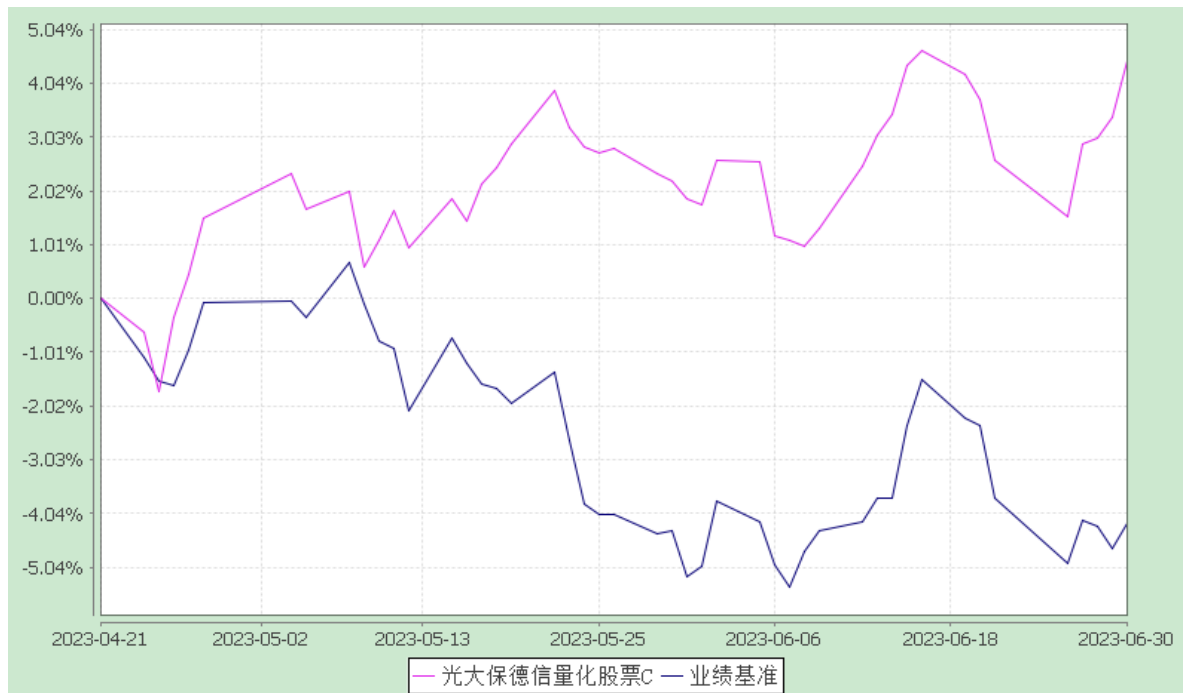
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2004年8月27日至2023年6月30日)

1. 光大保德信量化股票 A:



2. 光大保德信量化股票 C:



注：本基金 C 类份额设立于 2023 年 4 月 21 日。

为更好地反映债券市场整体运行情况和本基金管理人旗下相关基金投资组合的运作情况，经与基金托管人中国光大银行股份有限公司协商一致，自 2014 年 4 月 1 日起，将本基金的业绩比较基准由原“90%×富时中国 A200 指数+10%×同业存款利率”变更为“90%×沪深 300 指数+10%×同业存款利率”。

十一、基金的财产

（一）基金资产总值

基金资产总值包括基金所拥有的各类有价证券、银行存款本息、应收基金申购款及其他投资所形成的价值总和。

（二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

（三）基金财产的账户

本基金以托管人和基金联名的方式开设证券账户，以基金托管人名义开立基金托管专户和证券交易资金账户，以基金的名义开立银行间债券托管账户。本基金的专用账户与基金管理人、基金托管人、基金代销机构自有的资产账户以及其它基金资产账户相互独立。

（四）基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归入基金财产。基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。除依据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定处分外，基金财产不得被处分。

十二、基金资产的估值

(一) 估值日

基金合同生效后每个工作日对基金资产进行估值。

(二) 估值对象

本基金按照《证券投资基金会计核算办法》的估值原则，以及基金合同和招募说明书载明的估值事项对基金所拥有的股票、债券、权证、资产支持证券、股息红利、债券利息和银行存款本息等资产进行估值。

(三) 估值方法

1、股票估值方法

(1) 上市流通股股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，使潜在影响证券价格的所有投资品种的估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值；当投资品种不再存在活跃市场，且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值；对于长期停牌的股票的估值方法，采用指数收益法对长期停牌的股票进行估值，即在估值日，以该股票所上市的交易所行业分类指数中对应的行业指数的日收益率作为该股票的收益率，根据上述所得的收益率计算该股票当日的公允价值。上证行业分类指数由上海证券交易所提供，行情由上海证券交易所发布。深证行业分类指数由深圳证券交易所提供，行情由深圳证券交易所发布。

(2) 未上市股票的估值

1) 首次公开发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2) 送股、转增股、配股和公开增发新股等方式发行的股票，按估值日证券交易所上市的同一股票的市价进行估值。

3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日证券交易所上市的同一股票的市价进行估值。

4) 非公开发行有明确锁定期的股票按如下方法进行估值：

①估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票初始取得成本时，应采用在证券交易所上市交易的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

②估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票初始取得成本时应按下列公式确定估值日该非公开发行股票的价值：

$FV=C+(P-C)\times(D1-Dr)/D1$ (FV 为估值日该非公开发行股票的价值；C 为该非公开发行股票的初始取得成本（因权益业务导致市场价格除权时，应于除权日对其初始取得的成本作相应调整）；P 为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价；D1 为该非公开发行股票锁定期所含的交易所的交易天数；Dr 为估值日剩余锁定期，即估值日至锁定期结束所含的交易所的交易天数，不含估值日当天)。

(3) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

2、存托凭证估值办法

本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票进行。

3、权证估值方法

(1) 上市流通权证按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。

(2) 首次发行未上市的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(3) 停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

(4) 因持有股票而享有的配股权证，以配股除权日起到配股确认日止，若收盘价高于配股价，则按收盘价和配股价的差额进行估值，若收盘价低于配股价，则估值为零。

(5) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

4、资产支持证券的估值方法

(1) 交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(2) 全国银行间市场交易的资产支持证券，根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。

(3) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

5、其他资产的估值方法

其他资产按国家有关规定进行估值。

6、自 2015 年 3 月 30 日起，本公司已公告对旗下证券投资基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）的估值方法进行调整，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

(四) 估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。各类基金份额净值是按照每个工作日闭市后，该类基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值。基金资产净值及各类基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式报给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核；基金托管人复核无误后签字返回给基金管理人；月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

(五) 估值错误的处理

各类基金份额净值的计算均采用四舍五入方法保留到小数点后第四位。国家另有规定的，从其规定。当基金资产的估值导致某一类基金份额净值小数点后四位以内（含第四位）发生差错时，视为该类基金资产估值错误。

基金管理人、基金托管人和注册登记人应采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性和及时性。当发生估值错误时，基金管理人应当立即公告、予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。估值错误偏差达到该类基金份额净值 0.5% 时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案。

因基金管理人的过错导致基金份额净值计算错误给基金份额持有人造成损失的，基金管理人应当承担赔偿责任。赔偿原则如下：

1. 赔偿仅限于因差错而导致的直接损失；且仅赔偿在单次交易中给单一当事人造成 10 元以上的损失。

2. 基金管理人代表基金保留要求返还不当得利的权利；

3. 计算的某一类基金份额净值低于正确的该类基金份额净值时的处理：

(1) 申购确认份额大于实际应确认份额，由基金管理人向投资者追偿少付的申购金额，不能追偿的由基金管理人赔付给基金资产；

(2) 赎回确认金额小于实际应确认金额，不足部分由基金管理人赔付给投资者。

4. 计算的某一类基金份额净值高于正确的该类基金份额净值时的处理：

(1) 申购确认份额小于实际应确认份额，少计基金份额部分的申购资金由基金管理人退还给投资者；

(2) 赎回确认金额大于实际应确认金额，多付部分由基金管理人赔付给基金资产。

5. 差错期间因差错造成的基金管理人的策略性错误，如巨额赎回比例确定，均以当日决定为准，不予纠正。

6. 基金管理人在赔偿投资者或基金的损失后，有权向有关责任方追偿不当得利。

(六) 暂停估值的情形

1. 基金投资涉及的证券交易所因法定节假日或其他原因暂停营业时；

2. 因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3. 当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停基金估值。

(七) 基金净值的确认

无。

(八) 特殊情形的处理

1. 如遇国家颁布的有关基金会计制度的变化造成的误差，不作为基金份额净值错误处理。

2. 基金管理人按估值方法中股票估值方法的第（4）项和权证估值方法的第（3）项估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

3. 由于证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人可以免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

十三、基金的收益与分配

（一）基金利润的构成

1. 基金投资所得红利、股息、债券利息；
2. 买卖证券的价差收入；
3. 银行存款利息；
4. 已实现的其他合法收入。

基金资产运作成本或费用的节约计入基金收益。

（二）基金可供分配利润

计算期基金净收益为基金本期收入扣除本期基金管理费、基金托管费等基金运作过程中发生的各项费用后的余额。

（三）基金收益分配原则

1. 基金收益分配的比例按有关规定制定；
2. 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，本基金默认的收益分配方式是现金分红。投资人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的该类基金份额净值自动转为同一类别的基金份额进行再投资；
3. 在符合基金分配条件的前提下，基金收益分配每年至少一次，但若基金合同生效不满 3 个月，收益可不分配，年度分配在基金会计年度结束后的 4 个月内完成；
4. 基金当年收益须先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；
5. 如果基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；
6. 红利分配时所发生的银行转账或其他手续费用由基金份额持有人自行承担。当基金份额持有人的现金红利不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记人可将投资者的现金红利按红利发放日的该类基金份额净值自动转为同一类别的基金份额。自动再投资的计算方法，依照《光大保德信基金管理有限公司开放式基金注册登记业务规则》及相关制度的有关规定执行；
7. 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；

8. 由于本基金 C 类基金份额收取销售服务费，而 A 类基金份额不收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权；

9. 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

（四）收益分配方案

基金收益方案中应载明基金收益的范围、基金收益的分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式及有关手续费等内容。

（五）收益分配方案的确定、公告与实施

基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人核实后确定，在 2 日内在指定媒介公告。

（六）基金收益分配中发生的费用

1. 收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用；采用现金分红方式，则可从分红现金中提取一定的数额或者一定的比例用于支付注册登记作业手续费，如收取该项费用，具体提取标准和方法在招募说明书或招募说明书更新中规定。

2. 收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担；如果基金份额持有人所获现金红利不足支付前述银行转账等手续费用，注册登记人自动将该基金份额持有人的现金红利按分红实施日的该类基金份额净值转为同一类别的基金份额。

十四、基金的费用与税收

(一) 基金费用的种类

(一) 与基金运作有关的费用

1. 基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。

计算方法如下：

每日应付的基金管理费=前一日的基金资产净值×年管理费率÷当年天数

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付指令，由基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

基金管理人可以降低基金管理费率，无须召开基金份额持有人大会通过。如降低基金管理费率，基金管理人最迟于新的费率开始实施前 2 日在中国证监会指定媒介公告。

2. 基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。

计算方法如下：

每日应付的基金托管费=前一日的基金资产净值×年托管费率÷当年天数

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付指令，由基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素协商酌情调低基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。如降低基金托管费率，基金管理人最迟于新的费率开始实施前 2 日在中国证监会指定媒介公告。

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 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方法如下：

每日应付的基金销售服务费=前一日 C 类基金份额的基金资产净值×年销售
服务费率÷当年天数

基金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基金
销售服务费划付指令，由基金托管人复核后于次月首日起两个工作日内从基金资
产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

(二)与基金销售有关的费用

1. 申购费

本基金 A 类基金份额的申购费由申购 A 类基金份额的投资人承担，不记入基
金资产，用于基金的市场推广及销售等各项费用。本基金 C 类基金份额不收取申
购费。

2. 赎回费

A 类基金份额的赎回费由赎回 A 类基金份额的基金份额持有人承担，赎回费
在扣除手续费及注册登记费后，余额部分全部归入基金资产，其中对持续持有期
少于 7 日的投资者收取 1.5%的赎回费，并将赎回费全额计入基金财产，其他情
形下，A 类基金份额的赎回费归入基金资产的比例不得低于赎回费总额的 25%，
其余部分用于支付注册登记费等手续费用。对于 C 类基金份额，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。

3. 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的申购费率视为 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

4. 经报中国证监会批准，基金管理人可以在上述范围内调整申购费率和赎回费率，并最迟于新费率开始实施前按规定在中国证监会指定媒介上予以公告。如果调高申购或赎回费率，则须经基金份额持有人大会通过。

(三) 其他费用

其他费用包括证券交易费用；基金合同生效后的基金信息披露费用；基金份额持有人大会费用；基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费；按照国家有关规定可以列入的其他费用。上述费用由基金托管人根据其他有关法规及相关协议规定，按费用实际支出金额列入当期基金费用，由基金托管人从基金资产中支付。

基金合同生效前的会计师费、律师费、信息披露费用，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资产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

(四) 基金管理费、基金托管费和销售服务费的调整

基金管理人与基金托管人可根据市场和基金发展情况磋商酌情降低基金管理费、基金托管费和销售服务费，经中国证监会核准后公告，无须召开基金份额持有人大会通过。

(五) 基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律、法规的规定履行纳税义务。



十五、基金的会计与审计

（一）基金会计政策

1. 基金管理人为本基金的基金会计责任方，基金管理人也可以委托基金托管人或具有证券从业资格的独立的会计师事务所担任基金会计，但该会计事务所不能同时从事本基金的审计业务；

2. 基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；基金首次募集的会计年度报告义务，如果基金合同生效至12月31日之间少于3个月，可以并入下一个会计年度；

3. 基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；

4. 会计制度执行国家有关会计制度；

5. 基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；

6. 基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

7. 本基金独立建账、独立核算；

8. 上述规定因国家法律、法规或政策变化而发生调整时，经中国证监会核准后公告，无须召开基金份额持有人大会。

（二）基金的年度审计

1. 本基金管理人聘请安永华明会计师事务所及其注册会计师对基金年度财务报表进行审计。安永华明会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立，并具有证券、期货相关业务资格。

2. 会计师事务所更换经办注册会计师，须事先征得基金管理人和基金托管人的同意。

3. 基金管理人（或基金托管人）认为有充足理由更换会计师事务所，须经基金托管人（或基金管理人）同意后予以更换。更换会计师事务所需在2日内在指定媒介公告。

十六、基金的信息披露

（一）信息披露的形式

本基金的信息披露将严格按照《暂行办法》、《试点办法》、《证券投资基金信息披露指引》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定进行。本基金的信息披露事项将在中国证监会指定媒介上公告。

（二）信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。

本基金信息披露义务人以保护基金份额持有人利益为根本出发点，按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性、完整性、及时性、简明性和易得性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）和指定互联网网站（以下简称“指定网站”，包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照基金合同约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

（三）本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；
- 5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

(四) 本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证不同文本的内容一致。不同文本之间发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

(五) 公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

1. 《招募说明书》、基金合同、基金托管协议、基金产品资料概要

基金合同是界定基金合同当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。基金合同生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。基金合同生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。

2. 《基金份额发售公告》

基金管理人将按照《暂行办法》、《试点办法》和《基金合同》编制并发布《基金份额发售公告》。

3. 基金净值信息

基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在指定网站披露一次各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点，披露开放日的各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日的各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

4. 基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

5. 定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

(1) 年度报告：基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

(2) 中期报告：基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。

(3) 季度报告：基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在指定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。

(4) 基金管理人应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

(5) 报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者权益，基金管理人至少应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告文件中“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

6. 临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，并登载在指定报刊和指定网站上。

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：

- (1) 基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- (2) 终止基金合同、基金清算；
- (3) 转换基金运作方式、基金合并；
- (4) 更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- (5) 基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- (6) 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- (7) 基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
- (8) 基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- (9) 基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过 50%；基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过 30%；
- (10) 涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或者仲裁；
- (11) 基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- (12) 基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；
- (13) 基金收益分配事项；
- (14) 基金管理费、基金托管费、申购费、赎回费、销售服务费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- (15) 某一类基金份额净值估值错误达该类基金份额净值百分之零点五；
- (16) 本基金开始办理申购、赎回；

-
- (17) 基金发生巨额赎回并延期办理；
 - (18) 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；
 - (19) 基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
 - (20) 基金资产估值方法变更；
 - (21) 基金转换等业务的推出；
 - (22) 基金或为基金提供服务的相关机构出现有关事项，可能影响投资者对基金风险和未来表现的评估；
 - (23) 暂停申购和赎回期间需要公告的事项；
 - (24) 发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其他事项。

7. 澄清公告

在基金合同存续期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或引起较大波动，以及可能损害基金份额持有人权益的，相关的信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

8. 清算报告

基金合同终止的，基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

(六) 信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专门部门及高级管理人员负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则等法规规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和基金合同的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、各类基金份额净值、基金份额申购赎回价格、

基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于指定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

基金管理人、基金托管人除按法律法规要求披露信息外，也可着眼于为投资者决策提供有用信息的角度，在保证公平对待投资者、不误导投资者、不影响基金正常投资操作的前提下，自主提升信息披露服务的质量。具体要求应当符合中国证监会及自律规则的相关规定。前述自主披露如产生信息披露费用，该费用不得从基金财产中列支。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到基金合同终止后 10 年。

（七）信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于公司住所，供社会公众查阅、复制。

（八）本基金信息披露事项以法律法规规定及本章节约定的内容为准。

十七、风险揭示

(一) 投资于本基金的风险

1. 市场风险

本基金主要投资于证券市场，而证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而产生波动，从而导致基金收益水平发生变化，产生潜在风险。主要包括：

(1) 政策风险

货币政策、财政政策、产业政策、地区发展政策等国家宏观经济政策的变化对证券市场产生一定影响，从而导致市场价格波动，影响基金收益而产生的风险。

(2) 经济周期风险

证券市场受宏观经济运行的影响，而经济运行具有周期性的特点，而宏观经济运行状况将对证券市场的收益水平产生影响，从而对基金收益产生影响。

(3) 利率风险

金融市场利率的波动会导致股票市场及债券市场的价格和收益率的变动，同时也影响到上市公司的融资成本和利润水平，上述变化将直接影响本基金的收益。

(4) 上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等都会导致公司盈利发生变化。从而影响基金投资收益。

(5) 购买力风险

本基金投资的目的是使基金资产保值增值，如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的保值增值。

2. 信用风险

指基金在交易过程中可能发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或者上市公司信息披露不真实、不完整，都可能导致基金资产损失和收益变化。

3. 管理风险

在基金管理运作过程中，基金管理人的投资管理水平，会影响其对信息的占有分析以及对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平；同时，

基金管理人的投资管理制度，风险管理和内部控制制度是否健全，能否有效防范道德风险和其它合规性风险，以及本基金管理人和基金托管人的管理手段和管理技术等因素的变化也会影响基金收益水平。

4. 流动性风险

开放式基金要随时应对投资者的赎回，如果基金资产不能迅速转变成现金，或者变现为现金时使资产净值产生不利的影响，都会影响基金运作和收益水平。尤其是在发生巨额赎回时，如果基金资产变现能力差，可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，从而影响基金份额净值。

5. 存托凭证的风险

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外证券交易机制、法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

6. 基金产品的风险

(1) 本基金是一只积极投资的股票基金，主要通过数量模型选择股票并构建投资组合，由于上市公司财务数据的可靠性及透明度存在一定的不确定性，可能导致数量模型对股票收益率的预期产生偏差，从而给本基金的股票选择带来风险。

(2) 由于本基金资产配置比例相对固定，且股票资产比例较高，在股票市场发生较大波动时，本基金系统性风险较大，可能对基金的净值产生较大影响。

7. 其他风险

(1) 资金前端控制风险

上海证券交易所、深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司对本基金租用的交易单元实施当日净买入申报金额总量前端控制制度。当相关交易单元买入申报金额不符合资金前端控制自设额度限制的、或因不可抗力等原因导致资金前端控制出现异常的，上海证券交易所、深圳证券交易所和中国证券登记结算

有限责任公司将拒绝接受本基金的买入申报或申报受限限制，在该等情形下，本基金的投资可能受到不利影响。

(2) 因技术系统故障或差错等因素而产生的风险，如电脑系统不可靠产生的风险，这种技术风险可能来自基金管理人、注册登记人、销售机构等。

(3) 因金融市场危机、行业竞争压力可能产生的风险。

(4) 战争，自然灾害等不可抗力可能导致基金资产损失，从而产生风险。

(5) 其他意外导致的风险。

(二) 声明

1. 本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。投资人自愿投资于本基金，须自行承担投资风险。

2. 基金并不是销售机构的存款或负债，也没有经销售机构担保或者背书，销售机构并不能保证其收益或本金安全。

十八、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

（一）基金合同的变更

无

（二）基金合同的终止事由

有下列情形之一的，基金经中国证监会批准后将终止：

1. 在基金的存续期间内，基金份额持有人数量连续 60 个工作日达不到 200 人，或基金资产净值连续 60 个工作日低于人民币 5000 万元，基金管理人依照法律法规及基金合同规定的程序宣布该基金终止；
2. 基金经基金份额持有人大会表决终止的；
3. 因重大违法、违规行为，基金被中国证监会责令终止的；
4. 基金管理人因解散、破产、撤销、丧失基金管理资格等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而无其他适当的基金管理公司承接其原有权利及义务；
5. 由于投资方向变更引起的基金合并、撤销；
6. 基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而无其他适当的托管机构承接其原有权利及义务；
7. 法律、法规和中国证监会规定的其他终止事由。

自基金终止之日，与基金有关的所有交易应立即停止。在基金清算小组组成并接管基金资产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金资产安全的职责。

（三）基金财产的清算

1. 基金清算小组

(1) 自基金终止之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金清算小组必须在中国证监会的监督下进行基金清算。在基金清算小组接管基金资产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金资产安全的职责。

(2) 基金清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券、期货相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金管理人、基金托管人以及上述会计师事务所和律师事务所应在基金终止之日起 15 个工作日内将本方参加清算小组的具体人员名单函告其他各方。基金清算小组可以聘请必要的工作人员。

(3) 基金清算小组负责基金资产的保管、清理、估价、变现和分配。基金清算小组可以依法进行必要的民事活动。

2. 基金清算程序

- (1) 基金终止后，发布基金清算公告；
- (2) 由基金清算小组统一接管基金资产，其他任何人不得处理和处置；
- (3) 对基金资产进行清理、核查和确认；
- (4) 对基金资产进行估值；
- (5) 对基金资产进行变现；
- (6) 将基金清算结果报告中国证监会；
- (7) 以自身名义参加与基金有关的民事诉讼；
- (8) 发布基金清算结果公告；
- (9) 进行基金剩余资产的分配。

（四）清算费用

清算费用是指清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由清算小组优先从基金资产中支付。

（五）基金财产清算剩余资产的分配

基金清算后，基金资产按下列顺序清偿：

- (1) 支付清算费用；
- (2) 交纳所欠税款；
- (3) 清偿基金债务；
- (4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

（六）基金财产清算的公告

清算小组成立后 2 日内应就清算小组的成立进行公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金清算报告由基金财产清算小组报中国证监会备案后 2 日内公告。

（七）基金财产清算账册及文件的保存

基金清算帐册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

十九、基金合同的内容摘要

(一) 基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

1. 基金份额持有人的权利和义务

(1) 基金份额持有人的权利

- A. 分享基金财产收益；
- B. 按照规定出席或者委派代表出席基金份额持有人大会并行使表决权；
- C. 监督基金经营情况；
- D. 获得基金业务及财务状况的资料；
- E. 因基金管理人、基金托管人、基金份额销售机构或基金注册登记人的过错导致基金份额持有人损失时，基金份额持有人对此具有求偿权，可对损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- F. 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
- G. 参与分配清算后的剩余基金财产；
- H. 法律法规及《基金合同》规定的其他权利。

(2) 基金份额持有人的义务

- A. 遵守《基金合同》及相关业务规则；
- B. 缴纳基金认购、申购款项，承担规定的费用；
- C. 在所持有的基金份额范围内承担基金亏损或者终止的有限责任；
- D. 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人利益的活动；
- E. 法律法规及《基金合同》规定的其他义务。

2. 基金管理人的权利和义务

(1) 基金管理人的权利

- A. 自本基金成立之日起，根据法律、法规和《基金合同》的规定独立管理和运作基金资产；
- B. 遵照有关法律法规和《基金合同》的规定，制订和调整开放式基金业务规则，决定基金的费率结构和收费方式；
- C. 依据有关法律法规和《基金合同》的规定，获得基金管理费和其他约定和法定的收入；

D. 依照《暂行办法》、《试点办法》等有关法律法规及《基金合同》的规定，代表基金行使因基金投资而获得的任何权利；

E. 依据有关法律法规及《基金合同》规定决定基金收益的分配方案；

F. 根据《基金合同》的规定提议召开基金份额持有人大会；

G. 选择、更换基金代销机构，对基金代销机构的相关行为进行监督。如认为基金代销机构违反《基金合同》、《基金销售代理协议》或国家法律、法规的有关规定，应呈报中国证监会或其他监管部门，并采取必要措施保护基金份额持有人的利益；

H. 监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》或国家法律、法规有关规定，应呈报中国证监会和中国银监会，并采取必要措施保护基金份额持有人的利益。除非法律法规、《基金合同》及《托管协议》另有规定，否则基金管理人对于基金托管人的行为不承担任何责任；

I. 在基金存续期内，依据有关的法律法规和《基金合同》的规定，拒绝或暂停受理赎回申请；

J. 提名新的基金托管人；

K. 选择和更换注册登记人，并对其注册登记代理行为进行监督；

L. 基金终止时，参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；

M. 以基金的名义依法为基金进行融资，并以基金资产履行偿还融资和支付利息的义务；

N. 基金托管人或其他第三人造成基金资产损失的，基金管理人可代表基金进行索赔；

O. 法律、法规和《基金合同》规定的其他权利。

(2) 基金管理人的义务

A. 自基金成立之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产；

B. 设置相应的部门，并配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策、交易、销售和监察稽核，以专业化的经营方式管理和运作基金资产；

C. 依法募集基金，设置相应的部门并配备足够的专业人员办理或者委托经中国证监会认定的其他机构办理基金份额的认购、申购、赎回事宜；

-
- D. 设置相应的部门并配备足够的专业人员办理基金的注册与登记过户工作或委托其他机构代理该项业务；
- E. 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金资产和管理人的自有资产相互独立，保证不同基金在资产运作、财务管理等方面相互独立；
- F. 除法律法规和《基金合同》另有规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金资产；
- G. 接受基金托管人依据法律法规、《基金合同》和《托管协议》进行的监督；
- H. 按规定计算并公告基金净值信息；
- I. 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告，并严格按照《暂行办法》、《试点办法》、《基金合同》及其他有关规定，履行其他信息披露及报告义务；
- J. 保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等。除《暂行办法》、《试点办法》、《基金合同》及其他有关法律法规另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
- K. 依据有关法律、法规及《基金合同》决定基金收益分配方案，并按规定及时向基金份额持有人分配基金收益；
- L. 按照有关法律法规和《基金合同》的规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回、分红款项；
- M. 不谋求对上市公司的控股和直接管理；
- N. 依据《暂行办法》、《试点办法》等有关法律法规和《基金合同》的规定召集基金份额持有人大会，执行基金份额持有人大会的决议；
- O. 保存基金的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；
- P. 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出；并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，或得到有关资料的复印件；
- Q. 参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；
- R. 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

S. 因过错导致基金资产的损失，应承担赔偿责任，采取适当、合理的方式向基金份额持有人进行赔偿，该过错责任不因其退任而免除；因估值错误导致基金份额持有人的损失，应承担赔偿责任，采取适当、合理的方式向基金份额持有人进行赔偿，该过错责任不因其退任而免除；

T. 监督基金托管人按《基金合同》的规定履行自己的义务，因基金托管人的过错造成基金资产损失时，应代表基金向基金托管人追偿；

U. 不得从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

V. 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

W. 办理基金备案手续；

X. 遵守《基金合同》；

Y. 法律、法规和《基金合同》规定的其他义务。

3. 基金托管人的权利与义务

(1) 基金托管人的权利

A. 根据法律、法规和本《基金合同》的规定持有并保管基金资产，监督本基金的投资运作；

B. 依据本《基金合同》约定获得基金托管费、其它法定收入和其它法律法规允许或监管部门批准的约定收入；

C. 监督基金管理人，如认为基金管理人违反了本《基金合同》及国家有关法律法规，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金份额持有人的利益。除非法律法规、本《基金合同》及《托管协议》另有规定，否则，基金托管人对基金管理人的行为不承担任何责任；

D. 有权对基金管理人的违法、违规投资指令不予执行，并向中国证监会报告；

E. 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

F. 法律、法规和本《基金合同》规定的其他权利。

(2) 基金托管人的义务

A. 依法持有基金资产；

B. 以诚实信用、勤勉尽责的原则保管基金资产；

C. 设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金资产托管事宜；

D. 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金资产的安全，保证其托管的基金资产与托管人的资产以及不同的基金资产财产相互独立；对所托管的不同基金资产分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

E. 除《暂行办法》、《试点办法》等有关法律法规及本《基金合同》及其他有关规定另有规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金资产；基金托管人违反此义务，利用基金资产为自己及任何第三方谋取利益，所得利益归于基金资产，造成基金资产损失的，承担赔偿责任；

F. 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

G. 根据有关规定以托管人和基金联名的方式为基金开设证券帐户，以基金托管人的名义开立基金托管专户和证券交易资金账户，以基金的名义开立银行间债券托管账户，负责基金投资于证券的清算交割，执行基金管理人的投资指令，负责基金名下的资金往来；

H. 保守基金商业秘密，除《暂行办法》、《试点办法》等有关法律法规及本《基金合同》另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

I. 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和各类基金份额净值；

J. 采取适当、合理的措施，使本基金份额的认购、申购、赎回等事项符合法律、法规和本《基金合同》等有关法律文件的规定；

K. 采取适当、合理的措施，使本基金管理人用以计算各类基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合法律、法规和本《基金合同》等有关法律文件的规定；

L. 按照规定监督基金管理人的投资运作，并采取适当、合理的措施，使基金投资和融资的条件符合法律、法规、本《基金合同》或其他有关法律文件的规定；

M. 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项，按规定出具基金业绩和基金托管情况报告，并呈报中国证监会和中国银监会；

N. 在基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告等定期报告出具托管人意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照本《基金合同》

的规定进行；如果基金管理人未执行本《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

O. 按有关规定，建立并保存基金份额持有人名册；

P. 按有关规定，保存基金托管业务活动的会计账册、报表和记录等 15 年以上；

Q. 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

R. 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

S. 参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；

T. 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，应及时报告中国证监会和中国银监会，并通知基金管理人；

U. 因过错导致基金资产的损失，应承担赔偿责任，该过错责任不因其退任而免除；

V. 监督基金管理人按本《基金合同》的规定履行自己的义务，因基金管理人过错造成基金资产损失时，应为基金向基金管理人追偿，除法律法规和本《基金合同》规定之处，基金托管人不对基金管理人承担连带责任；

W. 按照规定召集基金份额持有人大会；

X. 不得从事任何有损基金及其它基金当事人利益的活动；

Y. 遵守本《基金合同》；

Z. 法律、法规和本《基金合同》规定的其他义务。

(二) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人合法的授权代表共同组成。

1. 召开事由

有下列情形之一的，应召开基金份额持有人大会：

(1) 终止《基金合同》；

(2) 转换基金运作方式；

(3) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费率；

(4) 更换基金管理人、基金托管人；

-
- (5) 与其他基金合并；
 - (6) 变更基金类别；
 - (7) 变更基金投资目标、范围或策略；
 - (8) 变更基金份额持有人大会程序；
 - (9) 法律、法规、和中国证监会规定的其他情形。

2. 召集方式

- (1) 正常情况下，基金份额持有人大会由基金管理人召集；

(2) 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

(3) 代表基金份额 10%以上（含 10%，该比例以提出提议之日提请人所持有的基金份额与基金总份额之比例计算，下同）的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。

基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。

基金托管人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开。

基金管理人和基金托管人都不召集基金份额持有人大会的，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人可以自行召集基金份额持有人大会。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

基金份额持有人自行召集基金份额持有人大会的，应当至少提前三十日向中国证监会备案。

- (4) 基金份额持有人大会的会议时间、地点及权益登记日由召集人选择确定。

3. 通知

召开基金份额持有人大会，召集人应在会议召开前 30 天，在指定媒介公告通知。基金份额持有人大会通知至少应载明以下内容：

- (1) 会议召开的时间、地点和方式；
- (2) 会议拟审议的事项；
- (3) 会议的议事程序以及表决方式；
- (4) 有权出席基金份额持有人大会的权益登记日；
- (5) 代理投票授权委托书的内容要求（包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- (6) 会务常设联系人姓名、电话；
- (7) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- (8) 召集人需要通知的其他事项。

采取通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见的寄交、收取方式和截止时间。

4. 会议的召开方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式召开。会议的召开方式由召集人确定，但更换基金管理人和基金托管人必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

(1) 现场开会

由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托书委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

A. 亲自出席会议者应持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书应符合法律、法规、《基金合同》和会议通知的规定；

B. 参加会议的基金份额持有人或其授权代表所代表的基金份额超过权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）。

(2) 通讯方式开会

通讯方式开会应以书面方式进行表决。

在符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

A. 召集人已经按《基金合同》的规定公告了会议通知；

B. 召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；

C. 召集人收到的出具书面表决意见书的基金份额持有人（包括其授权代表）所代表的基金份额达到权益登记日基金总份额的 50% 以上（含 50%）。

D. 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书应符合法律、法规、《基金合同》和会议通知的规定；

(3) 采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决；表决意见模糊不清或相互矛盾的视为无效表决。

5. 议事内容与程序

(1) 议事内容

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如决定终止基金、转换基金运作方式、提高基金管理人或基金托管人报酬标准、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、变更基金类别、变更基金投资目标、范围或策略、变更基金份额持有人大会程序以及召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

(2) 议事程序

A. 现场开会

如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人以所代表的基金份额 50% 以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。

B. 通讯方式开会

在通讯开会的情况下，公告会议通知时应当同时公布提案，在所通知的表决截止日期第二天统计全部有效表决，在公证机构监督下形成决议。

6. 表决

(1) 基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

(2) 在现场开会之情形下，亲自参加会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书应符合法律、法规、《基金合同》和会议通知的规定，否则其所代表的表决权不计入有效表决权份数。

(3) 在通讯开会之情形下，直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书应符合法律、法规、《基金合同》和会议通知的规定，否则其所代表的表决权不计入有效表决权份数。

(4) 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

A. 一般决议。一般决议须经出席会议的基金份额持有人所持表决权的 50% 以上（含 50%）通过方为有效；除下列（2）所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

B. 特别决议。特别决议须经参加会议的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效。转换基金运作方式、更换基金管理人、更换基金托管人、终止《基金合同》等重大事项必须以特别决议通过方为有效。

(5) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

(6) 采取通讯方式进行表决时，除非有充分相反证据证明，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效表决。表决意见模糊或相互矛盾的视为无效表决。

(7) 基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

7. 计票

(1) 现场开会

A. 如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基

金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金份额持有人大会主持人为召集人出席大会代表。

B. 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

C. 如果会议主持人或基金份额持有人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

D. 计票过程应由公证机关予以公证。

(2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）授权代表的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

8. 生效与公告

基金份额持有人大会表决通过的事项，召集人应当自通过之日起五日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有法律约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决定。

基金份额持有人大会决议自生效之日起2日内由相关信息披露义务人按照本基金合同的规定进行公告。

9. 不可抗力

由于地震、洪水等自然灾害或不可抗力，导致基金份额持有人大会不能按时或按规定方式召开或会议中断，大会召集人应依照法律法规和《基金合同》的规定采取必要措施及时通知或尽快召开。

(三) 基金合同解除和终止的事由、程序

1. 基金的终止

有下列情形之一的，基金经中国证监会批准后将终止：

(1) 在基金的存续期间内，基金份额持有人数量连续 60 个工作日达不到 200 人，或基金资产净值连续 60 个工作日低于人民币 5000 万元，基金管理人依照法律法规及《基金合同》规定的程序宣布该基金终止；

(2) 基金经基金份额持有人大会表决终止的；

(3) 因重大违法、违规行为，基金被中国证监会责令终止的；

(4) 基金管理人因解散、破产、撤销、丧失基金管理资格等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而无其他适当的基金管理公司承接其原有权利及义务；

(5) 由于投资方向变更引起的基金合并、撤销；

(6) 基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而无其他适当的托管机构承接其原有权利及义务；

(7) 法律、法规和中国证监会规定的其他终止事由。

自基金终止之日，与基金有关的所有交易应立即停止。在基金清算小组组成并接管基金资产之前，基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》和《托管协议》的规定继续履行保护基金资产安全的职责。

2. 本《基金合同》的终止

基金终止后，应依据法律、法规和本《基金合同》的规定对基金进行清算。中国证监会对清算结果批准并予以公告之日起，本《基金合同》终止。

(四) 争议的处理

本《基金合同》各方当事人因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，可以通过协商或调解解决。本《基金合同》当事人不愿通过协商、调解解决或协商、调解不成的，可向中国国际贸易仲裁委员会上海分会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

(五) 基金合同存放地点和查询办法

本《基金合同》可印制成册，供基金投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构的办公场所和营业场所查阅；基金投资者也可按工本费购买本《基金合同》印制件或复印件；如涉及争议事项需协商、仲裁或诉讼的，应以本《基金合同》正本为准。



二十、基金托管协议的内容摘要

（一）基金托管协议当事人

1. 基金管理人（或简称“管理人”）

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

法定代表人：刘翔

成立日期：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

注册资本：人民币 1.6 亿元

电话：（021）80262888

网址：www.epf.com.cn

2. 基金托管人（或简称“托管人”）

名称：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：王江

成立日期：1992 年 6 月 18 日

注册资本：人民币 466.79095 亿元

电话：（010）63636363

网址：www.cebbank.com

（二）基金托管人与基金管理人之间的业务监督、核查

1. 根据《暂行办法》、《试点办法》、《基金合同》和有关法律、法规的规定，托管人应对基金管理人就基金资产的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

(1) 基金托管人定期对基金管理人在基金投资、运作等方面的运作是否严格按照《暂行办法》、《试点办法》、《基金合同》和有关法律、法规的规定进行

监督和核查，对因基金管理人的过错导致基金资产灭失、减损、或处于危险状态的，基金托管人应立即以书面的方式要求基金管理人予以纠正和采取必要的补救措施。基金托管人有权要求基金管理人赔偿基金因此所遭受的损失。

(2)基金托管人发现基金管理人违反《暂行办法》、《试点办法》、《基金合同》和有关法律、法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

(3)如基金托管人认为基金管理人的作为或不作为违反了法律法规、《基金合同》或本托管协议，基金托管人应呈报中国证监会和其他监管部门，有权利并有义务行使法律法规、《基金合同》或本托管协议赋予、给予、规定的基金托管人的任何及所有权利和救济措施，以保护基金资产的安全和基金投资者的利益，包括但不限于就更换基金管理人事宜召集基金份额持有人大会、代表基金对因基金管理人的过错造成的基金资产的损失向基金管理人索赔。

2. 根据《暂行办法》、《试点办法》、《基金合同》及其他有关规定，基金管理人就基金托管人是否及时执行基金管理人的投资指令、是否将基金资产和自有资产分账管理、是否擅自动用基金资产、是否按时将分配给基金份额持有人的收益划入基金管理人清算账户等事项，对基金托管人进行监督和核查。

(1)基金管理人定期对基金托管人保管的基金资产进行核查。基金管理人发现基金托管人未对基金资产实行分账管理、擅自挪用基金资产、因基金托管人的过错导致基金资产灭失、减损、或处于危险状态的，基金管理人应立即以书面的方式要求基金托管人予以纠正和采取必要的补救措施。基金管理人有权要求基金托管人赔偿基金因此所遭受的损失。

(2)基金管理人发现基金托管人的行为违反《暂行办法》、《试点办法》、《基金合同》和有关法律、法规的规定，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。

(3)如基金管理人认为基金托管人的作为或不作为违反了法律法规、《基金合同》或本托管协议，基金管理人应呈报中国证监会和其他监管部门，有权利并有义务行使法律法规、《基金合同》或本托管协议赋予、给予、规定的基金管理人的任何及所有权利和救济措施，以保护基金资产的安全和基金投资者的利益，包括但不限于就更换基金托管人事宜召集基金份额持有人大会、代表基金对因基金托管人的过错造成的基金资产的损失向基金托管人索赔。

3. 基金管理人和基金托管人有义务配合和协助对方依照本协议对基金业务执行监督、核查。基金管理人或基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经监督方提出警告仍不改正的，监督方应报告中国证监会。

(三) 基金财产的保管

1. 基金资产保管的原则

基金托管人应安全保管基金的全部资产。

基金资产应独立于基金托管人和基金管理人的资产。

(1)本基金所有资产的保管责任，由基金托管人承担。基金托管人将遵守《暂行办法》、《试点办法》、《基金合同》及其他有关规定，为基金份额持有人的最大利益处理基金事务。基金托管人保证恪尽职守，依照诚实信用、勤勉尽责的原则，安全、完整、谨慎、有效地持有并保管基金资产。

(2)基金托管人应当设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金资产托管事宜；建立健全内部风险监控制度，对负责基金资产托管的部门和人员的行为进行事先控制和事后监督，防范和减少风险。

(3)基金托管人应当购置并保持对于基金资产的托管所必要的设备和设施（包括硬件和软件），并对设备和设施进行维修、维护和更换，以保持设备和设施的正常运行。

(4)除依据《暂行办法》、《试点办法》、《基金合同》及其他有关规定外，不为自己及任何第三人谋取利益，基金托管人违反此义务，利用基金资产为自己及任何第三方谋取利益，所得利益归于基金资产；

(5)基金托管人不得将基金资产转为其自有资产，不得将自有资产与基金资产进行交易，或将不同基金资产进行相互交易；违背此款规定的，将承担相应的责任，包括但不限于恢复基金资产的原状、承担赔偿责任。

(6)基金托管人必须将基金资产与自有资产严格分开，将本基金资产与其托管的其他基金资产严格分开；基金托管人应当为基金设立独立的账户，建立独立的帐簿，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理，保证不同基金之间在名册登记、帐户设置、资金划拨、帐册记录等方面相互独立。

(7)除依据《暂行办法》、《试点办法》、《基金合同》及其他有关规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金资产。

(8)未经基金管理人的正当指令，基金托管人不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。

2. 基金成立时募集资金的验证

基金设立募集期满或基金发起人(即本基金的基金管理人)宣布停止募集时，基金发起人(即本基金的基金管理人)应将设立募集的全部资金存入其指定的验资专户；由基金发起人(即本基金的基金管理人)聘请具有从事证券业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的2名以上(含2名)中国注册会计师签字有效。验资报告出具后，基金成立。

如果基金不能成立，按《暂行办法》、《试点办法》及基金合同的规定处理。

3. 基金的银行账户的开设和管理

(1)基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。

(2)基金托管人以本基金的名义在其营业机构开设本基金的银行账户。本基金的银行预留印鉴，由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的银行账户进行。

(3)本基金银行账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用基金的任何银行账户进行本基金业务以外的活动。

(4)基金银行账户的管理应符合中国人民银行、中国银监会以及其他监管机构的有关规定。

4. 基金证券账户和资金账户的开设和管理

(1) 基金托管人应当代表基金以托管人和本基金的名义为本基金在中国证券登记结算有限公司上海和深圳分公司开立证券帐户。

(2) 本基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和未经另一方同意擅自转让本基金的任何证券账户；亦不得使用本基金的任何证券账户进行本基金业务以外的活动。

(3) 基金托管人应当按规定在中国证券登记结算有限责任公司开立清算备付金账户，并通过该帐户完成本基金的证券交易和资金清算。

(4) 若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许本基金从事其他投资品种的投资业务，则基金托管人应当以本基金的名义开设从事该投资业务的账户，并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

5. 基金资产投资的有关实物证券的保管

实物证券由基金托管人存放于托管银行的保管库，但要与非本基金的其他实物证券分开保管；也可存入中央国债登记结算有限责任公司或中国证券登记结算有限责任公司的代保管库。保管凭证由基金托管人持有。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。

6. 与基金资产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别由基金托管人、基金管理人保管。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应当保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。如上述合同只有一份正本且该正本首先由基金管理人取得，则基金管理人应及时将该正本送达基金托管人处。

7. 国债托管专户的开设和管理

(1) 基金成立后，基金管理人负责代表基金向中国证监会和中国银监会申请进入全国银行间同业拆借市场，并代表基金进行交易。由基金托管人以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设国债托管帐户，并代表基金进行银行间债券和回购交易的资金清算。

(2) 基金管理人和基金托管人同时代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议，协议正本由基金托管人保管，协议副本由基金管理人保存。

8. 因为登记结算模式转换，关于账户开设、超头寸交易等处理，需要双方共同签署《补充托管协议》或《资金结算协议》，待新文本确定后，双方补充签署。

《补充托管协议》或《资金结算协议》中如有与本协议相关条款冲突或不一致的内容，以《补充托管协议》或《资金结算协议》为准。如国家法规或监管机构有新的规定，以新的规定为准。

如监管机构有新的规定，以监管机构的规定为准，参照执行。

（四）基金资产净值计算与复核

1. 基金资产净值的计算和复核

(1) 基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。各类基金份额净值是按照每个工作日闭市后，该类基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值。

(2) 基金管理人应于每个工作日对基金资产估值。估值原则应符合《基金合同》的规定。基金资产净值和各类基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日结束后计算得出当日的基金资产净值及各类基金份额净值，并在盖章后以加密传真方式发送给基金托管人。基金托管人应在收到上述传真后马上对净值计算结果进行复核，并在盖章后以加密传真方式将复核结果传送给基金管理人；如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，基金管理人有权按照其对基金净值的计算结果对外予以公布，基金托管人有权将相关情况报中国证监会备案。

2. 基金账册的建账和对账

(1) 基金管理人和基金托管人在本基金成立后，应按照财政部《证券投资基金会计核算办法》规定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登录和保管本基金的全套账册，对双方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金资产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，原则上以基金管理人的处理方法为准。

(2) 双方应每日核对账目，如发现双方的账目存在不符的，基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正，保证双方平行登录的账册记录完全相符。

3. 基金财务报表与报告的编制和复核

(1) 基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 日内完成。基金合同生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载

在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。基金管理人在每个季度结束之日起 15 个工作日内完成季度报告编制并公告；中期报告在会计年度半年终了后 40 日内编制完毕并于会计年度半年终了后两个月内予以公告；年度报告在会计年度结束后 60 日内编制完毕并于会计年度终了后三个月内予以公告。

(2) 基金管理人在月度报表完成当日，将报表盖章后提供基金托管人复核；基金托管人在收到后应及时进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在中期报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人应在收到后 20 日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人应在收到后 30 日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以加密传真的方式进行。

(3) 基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准；若双方无法达成一致以基金管理人的账务处理为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖公章或进行电子确认，双方各自留存一份。如果基金管理人于基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报证监会备案。

(五) 基金份额持有人名册的登记与保管

基金份额持有人名册，包括基金设立募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册、每月最后一个交易日的基金份额持有人名册，由基金管理人和基金托管人分别负责保管。

(六) 争议解决方式

基金管理人、基金托管人之间因本协议产生的或与本协议有关的争议可首先通过友好协商解决，自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内如果争议未能

以协商方式解决，则任何一方有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会北京分会根据提交仲裁时该会的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。除提交仲裁的争议之外，各方当事人仍应履行本协议的其他规定。争议处理期间，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

（七）托管协议的修改与终止

1. 本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。修改后的新协议，报中国证监会批准后生效。

2. 发生以下情况，本托管协议终止：

- （1）基金或《基金合同》终止；
- （2）本基金更换基金托管人；
- （3）本基金更换基金管理人；
- （4）发生《暂行办法》、《试点办法》或其他法律法规规定的终止事项。

二十一、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。以下是主要的服务内容，基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加、修改这些服务项目：

（一）资讯服务

基金管理人通过客服热线、在线客服、公司网站、电话语音等方式为投资者提供信息资讯服务，投资人如果了解申购、赎回、分红等交易情况、基金账户余额、基金对账单、基金产品与服务等信息，可拨打基金管理人客户服务电话、登录公司网站、公司移动端平台或通过销售机构进行咨询、查询。

1、客户服务电话

全国统一客户服务号码：4008-202-888

传真：（021）80262468

2、官方网站

公司网址：www.epf.com.cn

电子信箱：epfservice@epf.com.cn

3、官方移动端平台

微信服务号：



APP：



4、销售机构

登录及查询方式详询基金销售机构。

（二）信息发送服务

1、投资人电子对账单服务

基金份额持有人可通过公司网站、在线客服、客服电话等方式向本基金管理人定制电子对账单。基金管理人根据基金份额持有人的对账单定制情况，向账单期内发生交易或账单期末仍持有本公司旗下基金份额的持有人发送电子对账单，但由于基金份额持有人未详实填写或未及时更新相关信息（包括手机号码、电子邮箱等）导致基金管理人无法送达的除外。

电子对账单形式及服务方式具体如下：

(1) 月度电子邮件对账单：每月结束后 10 个工作日内，本公司将以电子邮件方式，向当月进行基金交易或当月最后一个交易日仍持有基金份额，并成功定制电子对账单的投资者发送月度电子对账单。内容包括：截至月度末的基金份额持有概况及当月交易明细。

(2) 月度短信对账单：每月度结束后 10 个工作日内，本公司将以手机短信方式，向当月最后一个交易日仍持有基金份额，并成功定制手机短信对账单的投资者发送月度短信对账单。内容包括：截至月度末的基金份额持有概况及参考市值。

(3) 通过光大保德信直销系统持有本公司基金份额的持有人如暂未订阅月度电子邮件或短信对账单，每个会计年度结束后 20 个工作日内，本基金管理人将以电子邮件及手机短信的方式，向上一会计年度最后一个交易日仍持有基金份额的投资者发送上述信息。内容包括：截至年度末的基金份额持有概况、参考市值及年度交易明细。

2、其他相关的信息服务

指以不定期的方式向投资者发送的基金资讯材料，如基金新产品或新服务的相关材料、开放式基金运作情况回顾、客户服务问答等。

(三) 在线服务

通过本公司官网及移动端平台，投资者可获得如下服务：

- 1、投资者可登录本公司官网及移动端平台查询系统，查询基金账户情况、交易明细情况、更改个人信息、订制邮件短信发送等服务。
- 2、投资者可通过官网、移动端平台的“在线客服”功能，进行咨询或留言。
- 3、投资者可通过本公司官网及移动端平台获取基金和基金管理人各类信息，包括基金法律文件、基金管理人最新动态、基金产品净值、热点问题等。

公司网址：www.epf.com.cn

电子信箱：epfservice@epf.com.cn

官方移动端平台：



(四) 网上交易

基金管理人已经开通快速便捷的网上交易,投资者可以通过本公司官网及移动端平台的网上交易系统进行基金开户、认购、申购、赎回、基金转换、信息查询等各项业务。具体业务办理情况及业务规则请登录本公司网站查询。

(五) 投诉处理服务

投资者可以通过基金管理人提供的客服电话人工服务、客服电话语音留言、在线客服、书信、电子邮件、传真等渠道对基金管理人和销售机构所提供的服务进行投诉或提出建议。

如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容,请通过上述方式联系基金管理人。请确保投资前,您/贵机构已经全面理解了本招募说明书。

二十二、其他应披露事项

(一) 2022年2月27日至2023年4月21日相关公告事宜列示如下, 下列公告刊登在上海证券报及光大保德信基金管理有限公司网站上。本基金其他信息披露事项详见基金管理人发布的相关公告。

披露时间	公告内容
2022-03-28	光大保德信量化核心证券投资基金基金产品资料概要更新
2022-03-28	光大保德信量化核心证券投资基金招募说明书(更新)
2022-03-31	光大保德信量化核心证券投资基金2021年年度报告
2022-03-31	光大保德信量化核心证券投资基金暂停机构投资者大额申购、转换转入、定期定额投资的公告
2022-04-22	光大保德信量化核心证券投资基金2022年第1季度报告
2022-04-26	光大保德信量化核心证券投资基金分红公告
2022-04-27	光大保德信量化核心证券投资基金恢复机构投资者大额申购、转换转入、定期定额投资的公告
2022-06-11	光大保德信基金管理有限公司关于终止与北京植信基金销售有限公司销售合作关系的公告
2022-07-01	光大保德信基金管理有限公司旗下基金2022年6月30日基金份额净值及累计净值公告
2022-07-21	光大保德信量化核心证券投资基金2022年第2季度报告
2022-08-12	光大保德信基金管理有限公司关于暂停与深圳市金海九州基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告
2022-08-18	关于微信公众号直销交易升级维护公告
2022-08-18	光大保德信基金管理有限公司关于旗下基金参与中信建投证券股份有限公司费率优惠活动的公告
2022-08-24	光大保德信基金管理有限公司关于警惕不法分子冒用本公司名义进行诈骗活动的提示公告
2022-08-27	光大保德信量化核心证券投资基金基金经理变更公告
2022-08-31	光大保德信量化核心证券投资基金2022年中期报告
2022-08-31	光大保德信量化核心证券投资基金基金产品资料概要

	更新
2022-08-31	光大保德信量化核心证券投资基金招募说明书（更新）
2022-10-26	光大保德信量化核心证券投资基金 2022 年第 3 季度报告
2022-11-03	光大保德信基金管理有限公司高级管理人员变更公告
2022-12-06	光大保德信基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金投资北交所上市股票的风险提示性公告
2022-12-22	光大保德信基金管理有限公司高级管理人员变更公告
2023-01-03	光大保德信基金管理有限公司旗下基金 2022 年 12 月 31 日基金份额净值及累计净值公告
2023-01-20	光大保德信量化核心证券投资基金 2022 年第 4 季度报告
2023-03-27	光大保德信量化核心证券投资基金基金产品资料概要更新
2023-03-27	光大保德信量化核心证券投资基金招募说明书（更新）
2023-03-31	光大保德信量化核心证券投资基金 2022 年年度报告
2023-04-20	关于光大保德信量化核心证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同的公告
2023-04-20	光大保德信基金管理有限公司关于光大保德信量化核心证券投资基金基金合同的提示性公告
2023-04-20	光大保德信量化核心证券投资基金基金合同
2023-04-20	光大保德信量化核心证券投资基金托管协议
2023-04-21	光大保德信量化核心证券投资基金 2023 年第 1 季度报告

二十三、招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书可印制成册，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将招募说明书置备于公司住所，供社会公众查阅、复制；基金投资者也可按工本费购买本招募说明书印制件或复印件。

二十四、备查文件

本基金备查文件包括以下文件：

- (一)中国证监会核准基金募集的文件
- (二)基金合同
- (三)销售代理协议
- (四)托管协议
- (五)法律意见书
- (六)基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- (七)基金托管人业务资格批件和营业执照
- (八)代销机构业务资格批件、营业执照
- (九)中国证监会要求的其他文件