

## 光大保德信先进服务业灵活配置混合型证券投资基金 招募说明书摘要（更新）

光大保德信先进服务业灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2017 年 7 月 10 日经中国证券监督管理委员会证监基金字【2017】1200 号文核准公开募集。本基金份额于 2017 年 8 月 21 日至 9 月 15 日发售，本基金合同于 2017 年 9 月 19 日生效。

### 重要提示

光大保德信基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”、“本基金管理人”或“本公司”）保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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

投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读招募说明书。基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本更新招募说明书所载内容截止日为 2019 年 3 月 19 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2018 年 12 月 31 日。

## 一、基金管理人

### （一）基金管理人概况

名称：光大保德信基金管理有限公司

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：林昌

注册资本：人民币1.6亿元

股权结构：光大证券股份有限公司（以下简称“光大证券”）持55%的股权；  
保德信投资管理有限公司持45%的股权

电话：(021) 80262888

传真：(021) 80262468

客服电话：4008-202-888

网址：[www.epf.com.cn](http://www.epf.com.cn)

联系人：殷瑞峰

### （二）主要人员情况

#### 1、董事会成员

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

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

包爱丽女士，董事、总经理，美国哥伦比亚大学硕士，中国国籍。历任贝莱

德资产管理公司研究员、经理、业务负责人，银华基金管理有限公司战略发展部负责人，国投瑞银基金管理有限公司产品发展团队负责人、总经理助理、督察长、副总经理。现任本基金管理人董事、总经理。

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

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

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

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

金德环先生，独立董事，上海财经大学硕士、教授，中国国籍。曾任上海财经大学财政金融系教研室主任、财政系副主任、证券期货学院副院长、上海财经大学金融学院证券研究中心主任。现任上海财经大学国际金融中心研究院首席资本市场专家。

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

## **2、监事会成员**

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

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

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

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

### 3、公司高级管理人员

林昌先生，现任本基金管理人董事长，简历同上。

包爱丽女士，现任本基金管理人董事、总经理，简历同上。

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

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

梅雷军先生，吉林大学博士。曾任深圳蛇口安达实业股份有限公司投资管理

部经理，光大证券股份有限公司南方总部机构管理部总经理兼任电脑部总经理、光大证券股份有限公司电子商务一部总经理、信息技术部总经理兼客户服务中心总经理。2004年7月加入光大保德信基金管理有限公司，现任本基金管理人副总经理兼首席运营总监。

董文卓先生，中山大学金融学硕士。历任招商基金管理有限公司实习研究助理、研究员，平安资产管理有限责任公司助理投资经理、投资经理，平安养老保险股份有限公司固定收益投资总监兼固定收益部总经理、投资决策委员会委员、另类投资决策委员会委员、年金基金经理、专户投资经理、基本养老投资经理等。2017年5月加入光大保德信基金管理有限公司，现任公司副总经理兼固定收益投资总监，其中2017年9月至2019年3月担任专户投资经理。

#### **4、本基金基金经理**

历任基金经理：

黄兴亮先生，担任本基金基金经理时间为2017年9月20日至2018年10月25日。

现任基金经理：

王维诚先生，博士。2005年获得南京大学管理学硕士学位，2010年获得美国华盛顿州立大学金融学博士学位。2010年9月至2011年9月在东吴基金任职宏观策略助理分析师；2011年9月至2013年9月在中国银河证券任职策略分析师；2013年9月至2015年6月在川财证券任职宏观策略部总监，2015年6月加入光大保德信基金管理有限公司，担任策略分析师。现任光大保德信欣鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、光大保德信产业新动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理、光大保德信先进服务业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

#### **5、投资决策委员会成员**

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

董文卓先生，现任公司副总经理兼固定收益投资总监。

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

林晓凤女士，现任权益投资部副总监兼光大保德信一带一路战略主题混合型证券投资基金基金经理、光大保德信铭鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、光大保德信睿鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

上述人员无近亲属关系。

## 二、基金托管人

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO., LTD

法定代表人：彭纯

住 所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号

邮政编码：200120

注册时间：1987 年 3 月 30 日

注册资本：742.62 亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25 号

联系人：陆志俊

电 话：95559

## 三、相关服务机构

### （一）直销机构

名称：光大保德信基金管理有限公司

注册地址：上海市黄浦区中山东二路 558 号外滩金融中心 1 幢，6 层

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](http://www.epf.com.cn)

## (二) 代销机构

### 1. 交通银行股份有限公司

办公地址: 上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人: 彭纯

客服电话: 95559

联系人: 王菁

电话: 021-58781234

传真: 021-58408483

网址: [www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

### 2. 招商银行股份有限公司

注册地址: 深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行股份有限公司大厦

法定代表人: 李建红

客服电话: 95555

联系人: 邓炯鹏

电话: 0755-83198888

传真: 0755-83195109

网址: [www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

### 3. 上海天天基金销售有限公司

注册地址: 上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼

办公地址: 上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦

法定代表人: 其实

客服电话: 400-1818-188

联系人: 潘世友

电话: 021-54509988

分: 7019

传真: 021-64385308

网址: [www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

### 4. 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司

注册地址: 杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

联系人：周熾旻

电话：021-60897869、0571-28829790

传真：0571-26698533

客服电话：4000-766-123

网址：www.fund123.cn

#### 5. 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室

办公地址：浙江省杭州市余杭区五常街道同顺街 18 号同花顺大楼 4 层

法定代表人：凌顺平

联系电话：0571-88911818-8653

传真：0571-86800423

客服电话：4008-773-772

公司网站：www.5ifund.com

#### 6. 华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

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

电话：0755-82569143

传真：0755-82492962

联系人：孔晓君

客服电话：95597

网址：www.htsc.com.cn

#### 7. 中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

客服电话：95533

联系人：王嘉朔

网址：www.ccb.com



8. 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

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

客服电话：95588

网址：www.icbc.com.cn

9. 上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发展区）

办公地址：上海市杨浦区昆明路 518 号 A1002 室

法定代表人：王翔

联系人：蓝杰

电话：021-65370077

传真：021-55085991

客户服务电话：4008-205-369

网址：www.jiyufund.com.cn

10. 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区海淀东三街 2 号 4 层 401-15

办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院 A 座 17 层。

法定代表人：陈超

联系人：江卉

传真：89188000

电话：13141319110

客户服务电话：400 098 8511

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

11. 国金证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市青羊区东城根上街 95 号

办公地址：四川省成都市青羊区东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

客服电话：95310

联系人：贾鹏

电话：028-86690058

传真：028-86690126  
网址：www.gjq.com.cn

12. 深圳众禄基金销售有限公司

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  
客服电话：4006-788-887  
联系人：汤素娅  
电话：0755-33227950  
传真：0755-82080798  
网址：www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com

13. 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  
电话：(010) 85130588  
传真：(010) 65182261  
客服电话：400-8888-108  
联系人：权唐  
网址：www.csc108.com

14. 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层  
办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座  
法定代表人：陈共炎  
联系人：辛国政 电话：010-83574507  
传真：010-66568990  
客服电话：400-888-8888 或 95551  
公司网址：www.chinastock.com.cn

15. 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：韩志谦

客服电话：400-800-0562

联系人：王怀春

电话：010-88085858

传真：010-88085195

公司网址： [www.hysec.com](http://www.hysec.com)

#### 16. 申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

联系人：黄莹

电话：021-33388211

传真：021-33388224

客服热线：95523 或 4008895523

网址：[www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

#### 17. 山西证券股份有限公司

地址：山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

法定代表人：侯巍

电话：(0351) 8686659

传真：(0351) 8686619

客服电话：400-666-1618

联系人：郭熠

网址：[www.i618.com.cn](http://www.i618.com.cn)

#### 18. 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

电话：0755-82960223

传真：0755-82943100

客服电话：95565、4008888111

联系人：黄婵君

网址: [www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

19. 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

电话: 021-22169999

传真: 021-22169134

客服电话: 95525

联系人: 刘晨、李芳芳

网址: [www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

20. 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

电话: (010) 85130588

传真: (010) 65182261

客服电话: 400-8888-108

联系人: 权唐

网址: [www.csc108.com](http://www.csc108.com)

21. 中信证券(山东)有限责任公司

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

办公地址: 青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

法定代表人: 杨宝林

电话: (0532) 85022326

传真: (0532) 85022605

联系人: 吴忠超

网址: [www.citicssd.com](http://www.citicssd.com)

22. 平安证券股份有限公司

注册地址: 深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

办公地址: 深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

法定代表人：曹实凡  
联系人：周一涵  
电话：(0755) 22626172  
传真：(0755) 82400862  
客服电话：95511-8  
网址：stock.pingan.com

23. 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元  
办公地址：深圳市深南大道 2028 号中国凤凰大厦 1 号楼 7 层  
法定代表人：王连志  
联系人：陈剑虹  
电话：0755-82558305  
客服电话：400-800-1001  
网址：www.essence.com.cn

24. 中泰证券有限公司（原齐鲁证券）

注册地址：济南市市中区经七路 86 号  
法定代表人：李玮  
客服电话：95538  
网站：www.qlzq.com.cn

25. 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层  
办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层  
法定代表人：何如  
电话：0755-82130833  
传真：0755-82133952  
联系人：齐晓燕  
客服电话：95536  
网址：www.guosen.com.cn

26. 信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区三里河东路 5 号中商大厦 10 层  
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：唐静  
联系电话：010-63081000  
传真：010-63080978  
客服电话：400-800-8899  
公司网址：www.cindasc.com

27. 长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦  
法定代表人：尤习贵  
联系人：奚博宇  
电话：027-65799999  
传真：027-85481900  
客户服务热线：95579 或 4008-888-999  
公司网址：www.95579.com

28. 广州证券股份有限公司

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

39. 国金证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市青羊区东城根上街95号  
办公地址：四川省成都市青羊区东城根上街95号  
法定代表人：冉云  
客服电话：4006600109  
联系人：贾鹏  
电话：028-86690058

传真：028-86690126  
网址：www.gjq.com.cn

30. 联讯证券股份有限公司

注册地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、  
四楼

办公地址：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：徐刚

客服电话：95564

联系人：彭莲

电话：13480169928

传真：0572-2119391

公司网址：<http://www.lxsec.com>

31. 东兴证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层

法定代表人：魏庆华

联系人：汤漫川

电话：010-66555316

传真：010-66555133

客服电话：4008888993

网址：[www.dxzq.net](http://www.dxzq.net)

32. 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

电话：021-23219000

传真：021-23219100

客服电话：95553、4008888001

联系人：金芸

网址：[www.htsec.com](http://www.htsec.com)

33. 深圳众禄基金销售有限公司

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

客服电话：4006-788-887

联系人：汤素娅

电话：0755-33227950

传真：0755-82080798

网址：www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com

#### 34. 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

法定代表人：杨文斌

客服电话：400-700-9665

联系人：张茹

电话：021-58870011

传真：021-68596919

网址：www.ehowbuy.com

#### 35. 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

客服电话：400-619-9059

联系人：熊小满

电话：010-56251471

分机：无分机

传真：010-62680827

网址：www.hc jijin.com

#### 36. 珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼

B1201-1203

法定代表人：肖雯



客服电话：020-89629066

联系人：黄敏嫦

电话：020-89629099

传真：020-89629011

网址：www.yingmi.cn

37. 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

传真：010-85632773

电话：010-59053660

客户服务电话：95510

公司网站：fund.sinosig.com

38. 北京百度百盈基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区上地十街 10 号 1 幢 1 层 101

办公地址：北京市海淀区信息路甲 9 号奎科大厦

法定代表人：张旭阳

联系电话：010-61952703

传真：010-61951007

联系人：杨琳

公司网站：www.baiyingfund.com

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。销售机构可以根据情况变化增加或减少其销售城市（网点），并另行公告。

**（三）登记机构**

名称：光大保德信基金管理有限公司

注册地址：上海市黄浦区中山东二路 558 号外滩金融中心 1 幢，6 层

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：林昌

电话：(021) 80262888

传真：(021) 80262483

联系人：杨静

#### **（四）律师事务所和经办律师**

名称：上海源泰律师事务所

注册地址：上海浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室

办公地址：上海浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 层

负责人：廖海

电话：(021) 51150298

传真：(021) 51150398

联系人：刘佳

经办律师：刘佳、姜亚萍

#### **（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：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层

办公地址：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：毛鞍宁

电话：021-22288888

传真：021-22280000

联系人：蒋燕华

经办会计师：蒋燕华、王俊丽

**四、基金的名称： 光大保德信先进服务业灵活配置混合型证券投资基金**

**五、基金的类型： 契约型开放式**

**六、基金的投资目标**

本基金将精选受益于先进服务业主题的相关证券，在严格控制风险前提下，力求超越业绩比较基准的投资回报，争取实现基金资产的长期稳健增值。

## 七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、公司债、证券公司短期公司债券、企业债、地方政府债、次级债、中小企业私募债券、可转换公司债券（含可分离交易可转债）、中期票据、央行票据及其他经中国证监会允许投资的债券）、货币市场工具、资产支持证券、债券回购、银行存款、权证、股指期货、股票期权、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

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

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%—95%；其余资产投资于债券、货币市场工具、中期票据、资产支持证券、债券回购、央行票据、银行存款、权证、股指期货、股票期权、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。每个交易日日终在扣除国债期货合约、股指期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金以先进服务业主题的相关证券为主要投资对象，投资于先进服务业主题相关证券的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%。

## 八、基金的投资策略

### 1、资产配置策略

本基金将通过对宏观经济基本面及证券市场双层面的数据进行研究，并通过定性定量分析、风险测算及组合优化，最终形成大类资产配置决策。

（1）宏观经济运行的变化和国家的宏观调控政策将对证券市场产生深刻影响。本基金通过综合国内外宏观经济状况、国家财政政策、央行货币政策、物价水平变化趋势等因素，构建宏观经济分析平台；

(2) 运用历史数据并结合基金管理人内部的定性和定量分析模型，确定影响各类资产收益水平的先行指标，将上一步的宏观经济分析结果量化为对先行指标的影响，进而判断对各类资产收益的影响；

(3) 结合上述宏观经济对各类资产未来收益影响的分析结果和本基金投资组合的风险预算管理，确定各类资产的投资比重。

## 2、股票投资策略

### (1) “先进服务业”涉及上市公司的界定

“先进服务业”是指为满足人们高层次需求应用而生的新兴服务业和通过技术进步、机制创新等方式顺应了人们需求高端化发展趋势的传统服务业。

“先进服务业”应主要具备以下特征：

人类社会的发展经历了三个阶段，分别为农业时代、工业时代及后工业时代。对应于服务业的发展，可以将其分为四个阶段：

阶段一：在农业时代，由于生产效率低下、剩余劳动力多而且质量较差，服务业以个人服务为主，例如饮食、服饰、维修等小型商店；

阶段二：在工业时代的前半段，农业生产占 GDP 的比重逐步下降，而工业生产占比则稳步提升，此时服务业以传统服务业为主，例如大型餐饮、纺织服装、商业贸易、交通运输等行业。

阶段三：在工业时代的后半段，随着工业化和城镇化的进程加快，服务业也逐渐从传统服务业向现代服务业转化，此时人们对房地产业、通信业、金融业的需求不断增加，该类服务业取得较快发展。

阶段四：在后工业时代，随着国民生活水平的提高，人们对于物质方面的需求逐渐向非物质方面转移，知识密集度高、产出附加值高的现代服务业蓬勃发展，其中包括例如文体休闲产业、教育业、旅游业、医疗保健业等。

根据以上服务业发展的阶段划分，本基金所指“先进服务业”投资主题相关证券的上市公司界定与行业选择如下：

I、公司业务涉及服务业发展第四阶段的产业，该阶段人们的需求逐步高端化，该类服务产业具有智力要素密集度高、产出附加值高、资源消耗少、环境污染少等特性；具体到行业分类上，包括休闲服务、医药生物、传媒、通信、电子、计算机等行业。

II、公司业务涉及服务业发展的第一至第三阶段的产业，依次为农业时代的个人服务业、工业时代前半段的传统服务业和工业时代后半段的现代服务业，以上行业通过技术创新、管理优化、产品升级等方式使得自身发展契合了人们需求高端化的发展趋势。尤其是在原有业态基础上引入互联网、人工智能等先进技术，并将这些先进技术应用到传统产业的各个环节，从而在融合先进技术的过程中派生出新型服务模式的服务业，包括电子商务、互联网金融、在线教育、智能物流、智能交通、智能家居、智能安防等，上述产业均为相关服务行业在应用先进技术后催生的新型业态。

本基金将通过自下而上研究入库的方式，对以上各个行业中涉及“先进服务业”投资主题的上市公司进行深入研究，挖掘企业的投资价值，分享“先进服务业”发展所带来的投资机会，并将这些股票组成本基金的核心股票库。

未来，由于经济增长方式转变、服务业结构升级等因素，“先进服务业”投资主题的外延扩大，本基金将视实际情况调整上述对行业的识别及认定。若出现其他受益于“先进服务业”投资主题的行业或者上市公司，本基金也会在深入研究的基础上，将其列入核心股票库。

## （2）个股选择

本基金将通过自下而上研究入库的方式，对以上各个行业中涉及“先进服务业”投资主题的上市公司进行深入研究，挖掘企业的投资价值，分享“先进服务业”发展所带来的投资机会，并将这些股票组成本基金的核心股票库。在核心股票库的基础上，本基金以定性和定量相结合的方式、从价值和成长等因素对个股进行选择，综合考虑上市公司的增长潜力与市场估值水平，精选估值合理且成长性良好的上市公司进行投资。

未来，由于经济增长方式转变、服务业结构升级等因素，“先进服务业”投资主题的外延扩大，本基金将视实际情况调整上述对行业的识别及认定。若出现其他受益于“先进服务业”投资主题的行业或者上市公司，本基金也会在深入研究的基础上，将其列入核心股票库。

### 1) 定量分析

本基金结合盈利增长指标、现金流量指标、负债比率指标、估值指标、盈利质量指标等与上市公司经营有关的重要定量指标，对目标上市公司的价值进行深

入挖掘，并对上市公司的盈利能力、财务质量和经营效率进行评析，为个股选择提供依据。

## 2) 定性分析

本基金认为股票价格的合理区间并非完全由其财务数据决定，还必须结合企业学习与创新能力、企业发展战略、技术专利优势、市场拓展能力、公司治理结构和管理水平、公司的行业地位、公司增长的可持续性 etc 等定性因素，给予股票一定的折溢价水平，并最终决定股票合理的价格区间。根据上述定性定量分析的结果，本基金进一步从价值和成长两个纬度对备选股票进行评估。对于价值被低估且成长性良好的股票，本基金将重点关注；对于价值被高估但成长性良好，或价值被低估但成长性较差的股票，本基金将通过深入的调研和缜密的分析，有选择地进行投资；对于价值被高估且成长性较差的股票，本基金不予考虑投资。

## 3、债券投资策略

### (1) 目标久期策略及凸性策略

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

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

### (2) 收益率曲线策略

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

### (3) 信用债投资策略

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

#### 1) 市场整体信用利差曲线策略

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

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

#### 2) 单个信用债信用分析策略

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

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

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

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

契约条款是指在信用债发行时明确规定的，约束和限制发行人行为的条款内容。具体包含承诺性条款和限制性条款两方面，本基金首先分析信用债券中契约

条款的合理性和可实施性，随后对发行人履行条款的情况进行动态跟踪与评估，发行人对契约条款的履行情况越良好，其信用水平也越高。

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

#### （4）可转换债券投资策略

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

#### （5）中小企业私募债券投资策略

与传统的信用债相比，中小企业私募债券采取非公开方式发行和交易，整体流动性相对较差，而且受到发债主体资产规模较小、经营波动性较高、信用基本面稳定性较差的影响，整体的信用风险相对较高。因此，对于中小企业私募债券的投资应采取更为谨慎的投资策略。本基金认为，投资该类债券的核心要点是对个券信用资质进行详尽的分析，并综合考虑发行人的企业性质、所处行业、资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性等关键因素，确定最终的投资决策。

#### （6）证券公司短期公司债券投资策略

本基金将通过证券行业分析、证券公司资产负债分析、公司现金流分析等调查研究，分析证券公司短期公司债券的违约风险及合理的利差水平，对证券公司短期公司债券进行独立、客观的价值评估。

基金投资证券公司短期公司债券，基金管理人将根据审慎原则，制定严格的投资决策流程、风险控制制度，并经董事会批准，以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

#### （7）杠杆投资策略

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

### 4、资产支持证券投资策略



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

#### 5、衍生品投资策略

为更好地实现投资目标，本基金在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，适度运用股指期货、股票期权、国债期货等金融衍生品。本基金利用金融衍生品合约流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，提高投资组合的运作效率。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其理估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，参与股票期权的投资。本基金将在有效控制风险的前提下，选择流动性好、交易活跃的期权合约进行投资。本基金将基于对证券市场的预判，并结合股票期权定价模型，选择估值合理的期权合约。基金管理人将根据审慎原则，建立股票期权交易决策部门或小组，按照有关要求做好人员培训工作，确保投资、风控等核心岗位人员具备股票期权业务知识和相应的专业能力，同时授权特定的管理人员负责股票期权的投资审批事项，以防范期权投资的风险。

在国债期货投资时，本基金将首先分析国债期货各合约价格与最便宜可交割券的关系，选择定价合理的国债期货合约，其次考虑国债期货各合约流动性情况最终确定与现货组合的合适匹配，以达到风险管理的目标。

#### 6、权证及其他品种投资策略

本基金在权证投资中将权证标的证券的基本面进行研究，结合期权定价量化模型估算权证价值，主要考虑运用的策略有：价值挖掘策略、杠杆策略、双向权证策略、获利保护策略和套利策略等。

同时，法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，本基金若认为有助于基金进行风险管理和组合优化的，可依据法律法规的规定履行适当程序后，运用金融衍生产品进行投资风险管理。

## 九、基金的业绩比较标准

本基金的业绩比较基准为：50%×中证服务业指数收益率+50%×中证全债指数收益率。

## 十、基金的风险收益特征

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

## 十一、基金的投资组合报告

本投资组合报告所载数据截止 2018 年 12 月 31 日。

### 1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	75,504,158.07	53.31
	其中：股票	75,504,158.07	53.31
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	65,973,135.06	46.58
7	其他各项资产	157,189.68	0.11
8	合计	141,634,482.81	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	3,294,768.00	2.34
B	采矿业	6,148,164.00	4.37

C	制造业	12,096,628.85	8.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,444,671.90	1.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,221,832.00	7.97
J	金融业	39,199,697.12	27.85
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,081,816.20	1.48
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	11,320.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	5,260.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	75,504,158.07	53.65

### 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	600030	中信证券	519,000.00	8,309,190.00	5.90
2	601336	新华保险	137,600.00	5,812,224.00	4.13
3	300059	东方财富	463,900.00	5,613,190.00	3.99
4	600570	恒生电子	107,900.00	5,608,642.00	3.99
5	601166	兴业银行	353,418.00	5,280,064.92	3.75
6	600036	招商银行	205,932.00	5,189,486.40	3.69
7	601318	中国平安	85,706.00	4,808,106.60	3.42
8	600547	山东黄金	147,000.00	4,446,750.00	3.16
9	300122	智飞生物	110,900.00	4,298,484.00	3.05
10	300274	阳光电源	382,505.00	3,411,944.60	2.42

### 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

**6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细**  
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**  
本基金本报告期末未持有贵金属。

**8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细**  
本基金本报告期末未持有权证。

## **9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

### **9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

### **9.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

## **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**

基金管理人可运用国债期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在国债期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与国债期货的投资，以管理投资组合的利率风险，改善组合的风险收益特性。

### **10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有国债期货。

## **11、投资组合报告附注**

11.1 招商银行（600036）的发行主体于2018年5月4日收到中国银行保险监督管理委员会的行政处罚（银监罚决字〔2018〕1号），具体内容为

主要违法违规事实为：（一）内控管理严重违反审慎经营规则；（二）违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款；（三）同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保；（四）

销售同业非保本理财产品时违规承诺保本；（五）违规将票据贴现资金直接转回出票人账户；（六）为同业投资业务违规提供第三方金融机构信用担保；（七）未将房地产企业贷款计入房地产开发贷款科目；（八）高管人员在获得任职资格核准前履职；（九）未严格审查贸易背景真实性办理银行承兑业务；（十）未严格审查贸易背景真实性开立信用证；（十一）违规签订保本合同销售同业非保本理财产品；（十二）非真实转让信贷资产；（十三）违规向典当行发放贷款；（十四）违规向关系人发放信用贷款。

行政处罚决定为：罚款 6570 万元，没收违法所得 3.024 万元，罚没合计 6573.024 万元。

基金管理人按照内部研究工作规范对该股票进行分析后将其列入基金投资对象备选库并跟踪研究。该行政处罚事件发生后，基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

新华保险（601336）的发行主体于 2018 年 10 月 18 日收到中国银行保险监督管理委员会的行政处罚（银保监保罚决字〔2018〕1 号），具体内容为：

主要违法违规事实为：一、欺骗投保人，新华人寿市场部制作的培训课件表述存在夸大保险责任、与产品保险条款规定不一致、没有明确说明保单利益的不确定等情况，课件均为内网下发，供公司内外勤及销售人员使用；二、编制提供虚假资料，人寿业务系统中个险和银代业务承保数据存在信息不真实的问题，人寿报送的 2016 年个人医疗理赔数据存在不真实问题；三、未按照规定使用经批准或者备案的保险费率

行政处罚决定为：分别罚款 30 万元，罚款 50 万元和罚款 30 万元。

基金管理人按照内部研究工作规范对该股票进行分析后将其列入基金投资对象备选库并跟踪研究。该行政处罚事件发生后，基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

兴业银行（601166）的发行主体于 2018 年 5 月 4 日收到中国银行保险监督管理委员会的行政处罚（银保监银罚决字〔2018〕1 号），具体内容为：

主要违法违规事实为：（一）重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告；（二）非真实转让信贷资产；（三）无授信额度或超授信额度办理同业业务；（四）内控管理严重违反审慎经营规则，多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合规；（五）同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保；（六）债券卖出回购业务违规出表；（七）个人理财资金违规投资；（八）提供日期倒签的材料；（九）部分非现场监管统计数据与事实不符；（十）个别董事未经任职资格核准即履职；（十一）变相批量转让个人贷款；（十二）向四证不全的房地产项目提供融资。

行政处罚决定为：罚款 5870 万元。

基金管理人按照内部研究工作规范对该股票进行分析后将其列入基金投资对象备选库并跟踪研究。该行政处罚事件发生后，基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

报告期内本基金投资的其他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受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的情况。

11.2 本基金投资的前十名股票未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	143,902.31
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	12,869.04
5	应收申购款	418.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	157,189.68

### 11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600030	中信证券	8,309,190.00	5.90	重大事项

## 十二、基金的业绩

### (一) 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

阶段	净值增	净值增长率	业绩比较	业绩比较基	①-③	②-④
----	-----	-------	------	-------	-----	-----

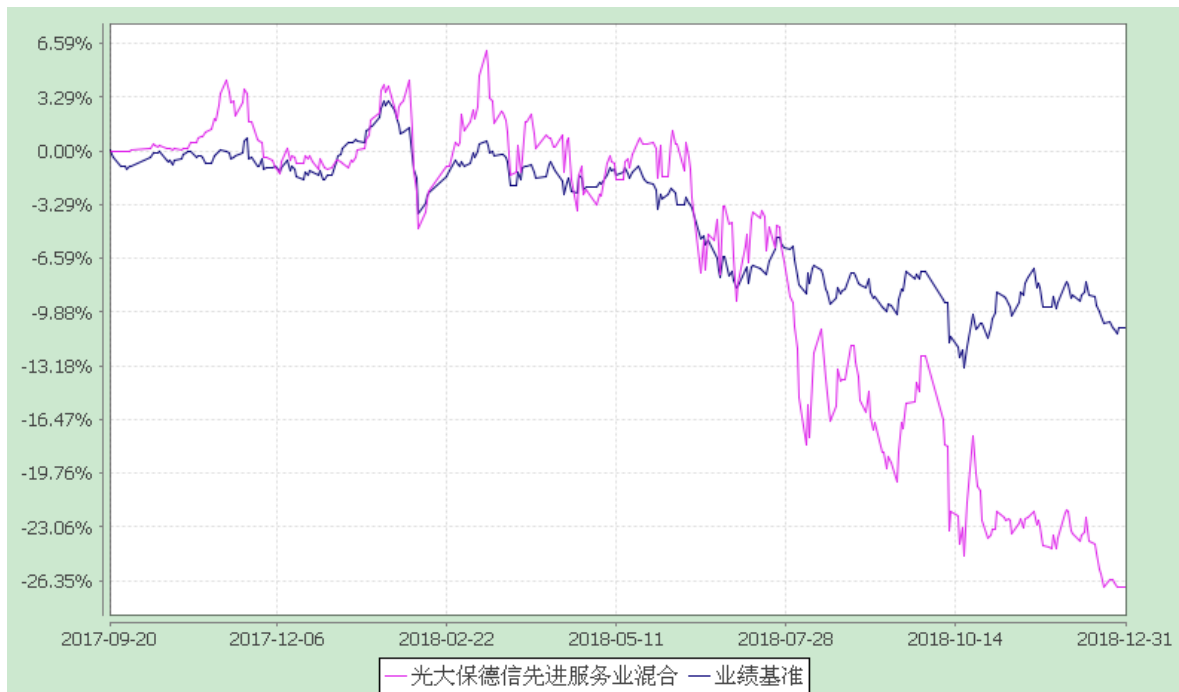
	长率①	标准差②	基准收益率③	准收益率标准差④		
2017年	-1.07%	0.45%	-1.45%	0.33%	0.38%	0.12%
2018年	-25.98%	1.51%	-9.50%	0.65%	-16.48%	0.86%
合同成立至今	-26.77%	1.35%	-10.81%	0.59%	-15.96%	0.76%

(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

光大保德信先进服务业灵活配置混合型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2017年9月20日至2018年12月31日)



注：根据基金合同的规定，本基金建仓期为2017年9月20日至2018年3月19日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

### 十三、费用概览

#### (一) 与基金运作有关的费用

##### 1、基金费用的种类

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

## 2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。基金管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日、不可抗力等，支付日期顺延。

### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提。基金托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日、不可抗力等，支付日期顺延。



上述“（一）基金费用的种类”中第3—9项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人根据基金管理人指令并参照行业惯例从基金财产中支付。

### 3、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、基金合同生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### 4、基金费用的调整

在遵守相关的法律法规并履行了必要的程序的前提下，可酌情调整基金管理费、基金托管费。基金管理人必须于新的费率实施日前按照《信息披露办法》的规定在指定媒介上刊登公告。

#### （二）与基金销售有关的费用

1、本基金的申购费率见下表：

通过直销机构申购本基金基金份额的养老金客户申购费率见下表：

申购金额（含申购费）	申购费率
50万元以下	0.15%
50万元（含50万元）到100万元	0.12%
100万元（含100万元）到500万元	0.08%
500万元以上（含500万元）	每笔交易1000元

其他投资者申购本基金基金份额申购费率见下表：

申购金额（含申购费）	申购费率
50万元以下	1.50%
50万元（含50万元）到100万元	1.20%
100万元（含100万元）到500万元	0.80%
500万元以上（含500万元）	每笔交易1000元

## 2、本基金的赎回费率见下表

持续持有期	赎回费率
7天以内	1.5%
7天（含7天）到30天	0.75%
30天（含30天）到1年	0.5%
1年（含1年）到2年	0.2%
2年以上（含2年）	0

注：赎回费的计算中1年指365个公历日。

3、对持续持有期少于30日的投资人收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期长于30日但少于3个月的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的75%计入基金财产；对持续持有期长于3个月但少于6个月的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的50%计入基金财产；对持续持有期长于6个月的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的25%计入基金财产，未计入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

4、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

5、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，在不违反法律法规且在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率、基金赎回费率。

## 十四、对招募说明书更新部分的说明

基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金管理公司治理准则（试行）》及其它有关法律法规的要求，对本基金招募说明书进行了更新，主要更新内容列示如下：

1. 在“重要提示”中，更新了招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。

2. 在“三、基金管理人”部分，根据实际情况进行了更新。
3. 在“四、基金托管人”部分，根据实际情况进行了更新。
4. 在“五、相关服务机构”部分，根据实际情况进行了更新。
5. 在“八、基金份额的申购与赎回”部分，根据实际情况进行了更新。
6. 在“九、基金的投资”部分，根据实际情况进行了更新,并将数据部分更新至2018年12月31日。
7. 将“十、基金的业绩”部分将数据更新至2018年12月31日。
8. 在“二十二、其他应披露事项”部分，对2018年9月20日至2019年3月19日期间公司及本基金涉及的事项进行了披露。

光大保德信基金管理有限公司

二〇一九年四月三十日