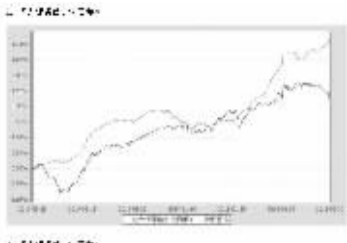


光大保德信安诚债债券型证券投资基金招募说明书摘要 (更新)



注:根据基金合同的规定,本基金建仓期为2017年3月28日至2017年9月27日。建仓期间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

- 基金管理人的种类
- 基金管理人管理费;
- 基金托管人的托管费;
- 销售服务费;
- 基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;
- 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;
- 基金份额持有人大会费用;
- 基金的证券、期货交易费用;
- 基金的银行汇划费用;
- 账户开户费用、账户维护费;
- 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。

1.基金管理人管理费
本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.3%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$$H = E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

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0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

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、休息日等,支付日期顺延。

3.销售服务费

销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金份额分为不同的类别,适用不同的销售费率。其中,A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额销售服务费年费率为0.3%。

本基金C类基金份额销售服务费的计算公式如下:

$$H = E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

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

上述“(一)基金费用的种类”中第4—10项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

3.下列费用不列入基金费用:

- 1.基金管理人及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.基金管理人及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。

在遵守相关的法律法规并履行了必要的程序的前提下,基金管理人及基金托管人可协商酌情降低销售服务费,此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2个工作日前在指定媒介上刊登公告。

(二)与基金销售有关的费用

1.本基金的申购费率见下表
本基金A类基金份额在申购时收取基金前端申购费用;C类基金份额不收取申购费用。通过直销申购申购本基金A类基金份额的养老金客户申购费率见下表:

申购金额(含申购费)	A类基金份额的申购费率
1000元以下	0.80%
1000元至10000元(含10000元)	0.60%
10000元以上(含10000元)	0.40%

其他投资者申购本基金A类基金份额申购费率见下表:

申购金额(含申购费)	A类基金份额的申购费率
1000元以下	0.80%
1000元至10000元(含10000元)	0.60%
10000元以上(含10000元)	0.40%

2.本基金的赎回费率见下表
本基金A类和C类基金份额适用相同的赎回费率,具体费率如下表所示:

持有时间	A类基金份额的赎回费率
7天以内	15%
7天(含)至30天	5%
30天以上	0%

3.赎回费用由基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。其中,对持续持有期少于7天的投资者收取的赎回费全额计入基金财产;对持续持有期大于7天(含7天)但少于30天的投资者收取的赎回费,将赎回费总额的25%归入基金财产,其余用于支付登记费和其他相关费用。

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

十四、对招募说明书更新部分的说明

基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》及《证券投资基金销售管理办法》及其他有关法律法规的要求,对本基金招募说明书进行了更新,主要内容列示如下:

- 1.在“绪言”部分,更新了招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。
- 2.在“一、重要提示”部分,根据实际情况进行了更新。
- 3.在“二、释义”部分,根据实际情况进行了更新。
- 4.在“三、基金管理人”部分,根据实际情况进行了更新。
- 5.在“四、基金托管人”部分,根据实际情况进行了更新。
- 6.在“五、相关服务机构”部分,根据实际情况进行了更新。
- 7.在“八、基金份额的申购与赎回”部分,根据实际情况进行了更新。
- 8.在“九、基金的投资”部分,根据实际情况进行了更新,并将数据部分更新至2018年6月30日。
- 9.将“十、基金的业绩”部分将数据更新至2018年6月30日。
- 10.在“十二、基金资产的估值”部分,根据实际情况进行了更新。
- 11.在“十六、基金的信息披露”部分,根据实际情况进行了更新。
- 12.在“十七、风险揭示”部分,根据实际情况进行了更新。
- 13.在“二十一、基金协议约定的内容摘要”部分,根据实际情况进行了更新。
- 14.在“二十二、其他应披露事项”部分,根据实际情况进行了更新。
- 15.在“二十二、其他应披露事项”部分,对2018年3月28日至2018年9月27日期间公司及本基金涉及的事项进行了披露。

光大保德信基金管理有限公司
2018年11月10日

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别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、盈利状况、现金流、经营稳定性等关键因素,确定最终的投资决策。

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

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

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

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

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

11.股票投资策略
本基金将采取“自下而上”的方式精选个股。本基金将全面考察上市公司所处行业的产业竞争格局、业务发展模式、盈利增长模式、公司治理结构等基本面的特征,同时综合利用市盈率(P/E)、市净率(P/B)和折现现金流(DCF)等估值方法对公司的投资价值进行分析和比较,挖掘具备中长期持续增长的上市公司股票库,以获得较高投资回报。

12.权证投资策略
本基金的投资组合以权证的市场价值分析为基础,配以权证定价模型寻求其合理估值水平,以主动式的科学投资管理为手段,充分考虑权证的投资性、流动性及风险性特征,通过资产配置、品种与类属选择,追求基金资产稳定的当期收益。

9.基金的业绩比较基准为:中债综合财富(总值)指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%。

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

十二、基金的投资组合报告
本报告期末投资组合报告截止2018年6月30日。

1.报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	26,180,000.00	97.20
	其中:债券	26,180,000.00	97.20
3	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	应收利息	4,831,114.90	1.28
7	银行存款和结算备付金合计	4,841,544.90	1.36
8	其他	362,460,767.88	100.00

2.报告期末按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。

3.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
本基金本报告期末未持有股票。

4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	金融债券	26,180,000.00	97.20
3	其中:政策性金融债	26,180,000.00	97.20
4	企业债券	-	-
5	中期票据	26,180,000.00	97.20
6	短期融资券	-	-
7	可转换债券(可交换债)	-	-
8	其他	-	-
9	合计	278,280,100.00	76.81
10	合计	26,542,544.90	97.48

5.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1720042	17华融债二期	360,000	38,178,500.00	97.1
2	1720009	17国开金融债二期	360,000	34,866,000.00	96.2
3	1720020	17国开债二期	360,000	34,772,500.00	88.0
4	1720030	17国开债三期	360,000	34,741,000.00	95.9
5	1720026	17国开债二期	340,000	33,381,000.00	93.8

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

9.报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
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本基金国债期货投资政策
本基金本报告期末未投资国债期货。基金管理人可运用国债期货,以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在国债期货投资中将根据风险管理的原则,以套期保

值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与国债期货的投资,以管理投资组合的利率风险、改善组合的风险收益特性。

10.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

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

11.2本基金未投资涉及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	2,780.17
2	应收利息	-
3	应收股利	-
4	应收款项	4,830,760.02
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	待摊费用	-
8	其他	4,841,544.90
9	合计	-

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
本基金本报告期末未持有股票。

十二、基金的业绩
(一)基金业绩净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较
光大保德信安诚债券A:

期间	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	23.6%	0.05%	0.72%	0.14%	1.41%	-1.61%	-0.05%

光大保德信安诚债券C:

期间	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	23.7%	0.05%	0.72%	0.14%	1.41%	-1.61%	-0.05%

(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
光大保德信安诚债券型证券投资基金历史走势图对比图
(2017年3月28日至2018年6月30日)

3.其他需要提示的事项
周华先生,2009年获得中山大学金融学学士学位,2013年获得香港大学金融学硕士学位,2009年7月至2011年5月在第一创业证券股份有限公司担任证券交易员;2011年6月至2014年9月在鹏华基金管理有限公司担任证券交易员、信用研究员;2014年9月至2018年6月在泰康资产管理有限责任公司担任固定收益投资总监;2018年6月加入光大保德信基金管理有限公司,任副固定收益部投资副总监。2018年8月至今担任光大保德信债券型证券投资基金、光大保德信永利纯债债券型证券投资基金、光大保德信安诚债券型证券投资基金的基金经理,2018年10月至今担任光大保德信安诚债券型证券投资基金、光大保德信永利纯债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的基金经理。

何奇先生,2010年获得武汉大学法学学士学位、法学双学士学位,2012年获得武汉大学经济学硕士学位,2012年7月至2014年5月在长江证券担任分析师、高级分析师;2014年5月加入光大保德信基金管理有限公司,担任投资研究部研究员、高级研究员、光大保德信优势配置混合型证券投资基金的基金经理助理,2015年8月至今担任光大保德信优势配置混合型证券投资基金的基金经理,2016年2月至今担任光大保德信中国智造2025灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信裕鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2017年5月至今担任光大保德信多策略精选18个月定期开放混合型证券投资基金的基金经理,2018年3月至今担任光大保德信多策略精选18个月定期开放混合型证券投资基金的基金经理。

光大保德信基金管理有限公司
2018年11月10日

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基金经理变更公告

公告送出日期:2018年11月10日

1.公告基本信息

基金名称	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
基金代码 <td>004844</td>	004844
基金管理人名称 <td>光大保德信基金管理有限公司</td>	光大保德信基金管理有限公司
公告依据 <td>《证券投资基金信息披露管理办法》</td>	《证券投资基金信息披露管理办法》
基金信息披露更新前 <td>曹博</td>	曹博
新任基金经理姓名 <td>曹博</td>	曹博
助理基金经理姓名(如有) <td>-</td>	-

2.新任基金经理的相关信息

新任基金经理姓名	曹博
任职日期	2018年11月10日
证券从业年限	-
投资研究从业年限	9

3.其他需要提示的事项
周华先生,2009年获得中山大学金融学学士学位,2013年获得香港大学金融学硕士学位,2009年7月至2011年5月在第一创业证券股份有限公司担任证券交易员;2011年6月至2014年9月在鹏华基金管理有限公司担任证券交易员、信用研究员;2014年9月至2018年6月在泰康资产管理有限责任公司担任固定收益投资总监;2018年6月加入光大保德信基金管理有限公司,任副固定收益部投资副总监。2018年8月至今担任光大保德信债券型证券投资基金、光大保德信永利纯债债券型证券投资基金、光大保德信安诚债券型证券投资基金的基金经理,2018年10月至今担任光大保德信安诚债券型证券投资基金、光大保德信永利纯债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的基金经理。

何奇先生,2010年获得武汉大学法学学士学位、法学双学士学位,2012年获得武汉大学经济学硕士学位,2012年7月至2014年5月在长江证券担任分析师、高级分析师;2014年5月加入光大保德信基金管理有限公司,担任投资研究部研究员、高级研究员、光大保德信优势配置混合型证券投资基金的基金经理助理,2015年8月至今担任光大保德信优势配置混合型证券投资基金的基金经理,2016年2月至今担任光大保德信中国智造2025灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信裕鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2017年5月至今担任光大保德信多策略精选18个月定期开放混合型证券投资基金的基金经理,2018年3月至今担任光大保德信多策略精选18个月定期开放混合型证券投资基金的基金经理。

光大保德信基金管理有限公司
2018年11月10日

光大保德信基金管理有限公司关于光大保德信耀钱包货币市场基金份额升级相关规则的公告

光大保德信基金管理有限公司根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《光大保德信耀钱包货币市场基金基金合同》、《光大保德信耀钱包货币市场基金招募说明书》等法律法规和基金法律文件的规定,并与基金托管人光大保德信银行股份有限公司协商一致,决定自2018年11月14日起,若投资者通过该机构购买的光大保德信耀钱包货币市场基金A类基金份额不参与自动升级为B类基金份额的判断和处理。

如有疑问,请拨打客户服务热线:4008-202-888,或登陆基金管理人网站www.ept.com.cn获取相关信息。

风险提示:
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。敬请投资者留意投资风险。

光大保德信基金管理有限公司
2018年11月10日

联系电话:0571-88911818-8653

传真:0571-86900423

客服电话:4008-773-772

公司网站:www.5ifund.com

3、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:周雯雯

电话:021-60697869,0571-28829790

传真:0571-26698533

客服电话:4000-766-123

网址:www.tund123.cn

4、北京肯特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: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: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.com/fundlist/1-11-112.htm

5、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

客服电话:4008219031

联系人:宁博宇

电话:021-20669522

网址:www.lufunds.com

6、上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区吴淞路685弄37号4号楼449室

办公地址:上海市浦东新区国际大厦903-906室

法定代表人:杨文斌

客服电话:400-700-9666

联系人:张凯

电话:021-58870011

传真:021-68596919

网址:www.ehowbuy.com

7、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-