

光大保德信量化核心证券投资基金招募说明书(更新)摘要

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日公开发售,本基金合同于2004年8月27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。

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。
投资有风险,投资者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,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并依照《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。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2009年2月27日,有关财务数据和净值表现截止日为2008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]142号
注册地址:上海市延安东路222号外滩中心46层
办公地址:上海市延安东路222号外滩中心46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67%的股权
保德信投资管理有限公司持33%的股权
电话:(021)33074700
传真:(021)63351152
客服电话:400-820-2888,(021)53524620
联系人:张弛
网址:www.epl.com.cn
(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;投资银行一部总经理;光大证券助理总裁。
Christopher Cooper(克里斯托弗·珀珀)先生,董事,美国芝加哥大学商学院工商管理硕士,美国国籍。历任保德信国际投资有限公司执行董事,保德信投资管理有限公司总裁兼首席执行官。现任保德信国际投资有限公司亚洲区总裁。
傅德修先生,董事,美国哥伦比亚大学硕士,中国(香港)国籍。曾任富达基金管理公司(Fidelity)业务总监,瑞士银行瑞银环球资产管理公司(UBS)执行董事兼中国区主管,友邦华泰基金管理有限公司总经理。现任本基金管理人的总经理。
沈涛先生,董事,东北财经大学硕士,中国国籍。历任光大证券计财部高级经理、财务处处长、计财部副总经理。现任光大证券计财部总经理。
俞忠华先生,董事,华东师范大学硕士,中国国籍。历任上海万国证券公司证券投资部经理;君安证券公司国际业务部总经理;瑞士联合银行上海代表处首席代表、副总裁;霸菱亚洲资产管理公司执行董事;今日资本集团合伙人。现任光大证券销售交易部总经理、研究所常务副所长。

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。现任华夏银行上海分行行长。

金德怀先生,独立董事,上海财经大学硕士、教授,中国国籍。曾任上海财经大学财政金融系教研室主任、财政系副主任、证券期货学院副院长。现任上海财经大学金融学院证券研究中心主任。

陈继忠先生,独立董事,北京理工大学工商管理硕士,中国国籍。曾任国家计委人事司直属单位干部处处长;国家开发银行党委组织部副部长、人事局副科长、党委办公室主任、办公厅主任、陕西分行行长、党委书记。现任国家开发银行上海分行行长、党委书记。

2. 监事会成员
傅国兵先生,监事,江西财经大学博士,中国国籍。曾任职于江西省审计厅企业审计处、外事审计处项目主任、江西省审计厅计财科、综合科主任、江西省审计厅办公室副主任。历任光大证券南方总部稽核监察部副总经理、总经理,风险管理部总经理,现任光大证券计财部总经理、稽核部总经理兼风险管理部(法律事务部)总经理。
叶世仪女士,监事,美国Holy Names College大学士,美国国籍。历任泛达投资管理(亚洲)有限公司董事,美国宏国际有限公司香港分公司中国区区域董事。现任保德信亚洲基金管理有限公司执行董事。

张力先生,监事,香港城市大学工商管理硕士,中国国籍。曾就职于普华永道中天会计师事务所有限公司,2004年初加入光大保德信基金管理有限公司并参与公司的开业工作。现任本基金管理人财务部总监。

3. 公司高级管理人员
林昌先生,现任本公司董事长,简历同上。
傅德修先生,现任本公司总经理,简历同上。
盛松显先生,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。现任本基金管理人的督察长。

梅雷军先生,吉林工业大学机械系博士,武汉大学机械系学士。基金从业人员资格。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稽核管理部总经理,兼任电脑部总经理,光大证券电子商务一部总经理,信息技术部总经理兼客户服务部总经理。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人力资源部总监。

袁宏隆先生,美国密西根大学国际商务系硕士,台北淡江大学国际贸易学系学士,CFA,台湾证券分析师人员资格。曾任国际证券投资信托股份有限公司研究部经理,台湾获多利和信宝证券投资顾问股份有限公司总经理,加拿大伦敦人寿保险有限公司权益证券投资部资深副总经理、常务董事,台北尚银证券投资信托股份有限公司执行副总裁、首席投资总监,现任本基金管理人的副总经理兼首席投资总监及本基金基金经理。

张弛先生,CFA,英国兰卡斯特大学(Lancaster University)金融学硕士。曾任建设银行上海分行信贷员,华泰基金管理有限公司高级产品经理,战略规划部总监助理。加入光大保德信基金管理有限公司后,先后担任产品总监、市场与产品总监、代理首席市场总监、首席市场总监,现任公司副总经理兼首席市场总监。

4. 基金经理
历任基金经理:
何克先生,与常昊先生共同担任本基金基金经理时间为2004年8月27日至2005年8月6日。

常昊先生,担任本基金基金经理时间为2004年8月27日至2007年6月28日。
现任基金经理:
袁宏隆先生,简历同上。

傅德修先生,现任本基金基金管理人董事兼总经理。
袁宏隆先生,现任本基金基金管理人的副总经理、首席投资总监及本基金基金经理。

许苍茂先生,现任本基金基金管理人投资总监兼光大保德信红利股票型证券投资基金基金经理及光大保德信均衡精选股票型证券投资基金基金经理。

高宏华先生,现任光大保德信优势配置股票型证券投资基金基金经理。

钱钧先生,现任光大保德信新增市场证券投资基金基金经理。

于海颖女士,现任光大保德信货币市场基金基金经理兼光大保德信增利收益债券型证券投资基金基金经理。

李阳先生,现任本基金基金管理人交易部总监。

吴有霖先生,现任本公司QDII投资总监。

黄素霞女士,现任本公司研究总监。
上述人员无近亲属关系。

上述人员无近亲属关系。

名称:中国光大银行
设立日期:1992年8月18日
批准设立机关及批准设立文号:国函[1992]7号
基金托管资格批准文号:证监基金字[2002]75号
注册地址:北京市西城区复兴门内大街6号光大大厦
办公地址:北京市西城区复兴门内大街6号光大大厦
法定代表人:唐双宁

组织形式:股份制商业银行
存续期间:持续经营
注册资本:282.1689 亿元人民币
电话:(010)68098778
传真:(010)68560661
客服电话:95595
联系人:李伟

网址:www.cebbank.com
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上海投资理财中心
地址:上海市延安东路222号外滩中心46层
电话:(021)63352934、63352937
传真:(021)63350429
客服电话:400-820-2888,(021)53524620
联系人:刘佳

网址:www.epl.com.cn
(二)代销机构
1.招商银行股份有限公司
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人:秦晓
电话:(0755)83198888
传真:(0755)83195047
联系人:王楠
客服电话:95555
公司网址:www.cmbchina.com

2.中国光大银行
注册地址:北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦
法定代表人:唐双宁
电话:(010)68098778
传真:(010)68560661
客服电话:95595
联系人:李伟

网址:www.cebbank.com
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上海投资理财中心
地址:上海市延安东路222号外滩中心46层
电话:(021)63352934、63352937
传真:(021)63350429
客服电话:400-820-2888,(021)53524620
联系人:刘佳

网址:www.epl.com.cn
(二)代销机构
1.招商银行股份有限公司
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人:秦晓
电话:(0755)83198888
传真:(0755)83195047
联系人:王楠
客服电话:95555
公司网址:www.cmbchina.com

2.中国光大银行
注册地址:北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦
法定代表人:唐双宁
电话:(010)68098778
传真:(010)68560661
客服电话:95595
联系人:李伟

网址:www.cebbank.com
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上海投资理财中心
地址:上海市延安东路222号外滩中心46层
电话:(021)63352934、63352937
传真:(021)63350429
客服电话:400-820-2888,(021)53524620
联系人:刘佳

网址:www.epl.com.cn
(二)代销机构
1.招商银行股份有限公司
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人:秦晓
电话:(0755)83198888
传真:(0755)83195047
联系人:王楠
客服电话:95555
公司网址:www.cmbchina.com

2.中国光大银行
注册地址:北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦
法定代表人:唐双宁
电话:(010)68098778
传真:(010)68560661
客服电话:95595
联系人:李伟

网址:www.cebbank.com
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上海投资理财中心
地址:上海市延安东路222号外滩中心46层
电话:(021)63352934、63352937
传真:(021)63350429
客服电话:400-820-2888,(021)53524620
联系人:刘佳

网址:www.epl.com.cn
(二)代销机构
1.招商银行股份有限公司
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人:秦晓
电话:(0755)83198888
传真:(0755)83195047
联系人:王楠
客服电话:95555
公司网址:www.cmbchina.com

2.中国光大银行
注册地址:北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦
法定代表人:唐双宁
电话:(010)68098778
传真:(010)68560661
客服电话:95595
联系人:李伟

网址:www.cebbank.com
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上海投资理财中心
地址:上海市延安东路222号外滩中心46层
电话:(021)63352934、63352937
传真:(021)63350429
客服电话:400-820-2888,(021)53524620
联系人:刘佳

网址:www.epl.com.cn
(二)代销机构
1.招商银行股份有限公司
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人:秦晓
电话:(0755)83198888
传真:(0755)83195047
联系人:王楠
客服电话:95555
公司网址:www.cmbchina.com

2.中国光大银行
注册地址:北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦
法定代表人:唐双宁
电话:(010)68098778
传真:(010)68560661
客服电话:95595
联系人:李伟

网址:www.cebbank.com
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上海投资理财中心
地址:上海市延安东路222号外滩中心46层
电话:(021)63352934、63352937
传真:(021)63350429
客服电话:400-820-2888,(021)53524620
联系人:刘佳

网址:www.epl.com.cn
(二)代销机构
1.招商银行股份有限公司
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人:秦晓
电话:(0755)83198888
传真:(0755)83195047
联系人:王楠
客服电话:95555
公司网址:www.cmbchina.com

2.中国光大银行
注册地址:北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦
法定代表人:唐双宁
电话:(010)68098778
传真:(010)68560661
客服电话:95595
联系人:李伟

网址:www.cebbank.com
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上海投资理财中心
地址:上海市延安东路222号外滩中心46层
电话:(021)63352934、63352937
传真:(021)63350429
客服电话:400-820-2888,(021)53524620
联系人:刘佳

网址:www.epl.com.cn
(二)代销机构
1.招商银行股份有限公司
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人:秦晓
电话:(0755)83198888
传真:(0755)83195047
联系人:王楠
客服电话:95555
公司网址:www.cmbchina.com

2.中国光大银行
注册地址:北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦
法定代表人:唐双宁
电话:(010)68098778
传真:(010)68560661
客服电话:95595
联系人:李伟

网址:www.cebbank.com
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上海投资理财中心
地址:上海市延安东路222号外滩中心46层
电话:(021)63352934、63352937
传真:(021)63350429
客服电话:400-820-2888,(021)53524620
联系人:刘佳

网址:www.epl.com.cn
(二)代销机构
1.招商银行股份有限公司
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人:秦晓
电话:(0755)83198888
传真:(0755)83195047
联系人:王楠
客服电话:95555
公司网址:www.cmbchina.com

2.中国光大银行
注册地址:北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦
法定代表人:唐双宁
电话:(010)68098778
传真:(010)68560661
客服电话:95595
联系人:李伟

网址:www.cebbank.com
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上海投资理财中心
地址:上海市延安东路222号外滩中心46层
电话:(021)63352934、63352937
传真:(021)63350429
客服电话:400-820-2888,(021)53524620
联系人:刘佳

网址:www.epl.com.cn
(二)代销机构
1.招商银行股份有限公司
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人:秦晓
电话:(0755)83198888
传真:(0755)83195047
联系人:王楠
客服电话:95555
公司网址:www.cmbchina.com

2.中国光大银行
注册地址:北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦
法定代表人:唐双宁
电话:(010)68098778
传真:(010)68560661
客服电话:95595
联系人:李伟

网址:www.cebbank.com
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上海投资理财中心
地址:上海市延安东路222号外滩中心46层
电话:(021)63352934、63352937
传真:(021)63350429
客服电话:400-820-2888,(021)53524620
联系人:刘佳

网址:www.epl.com.cn
(二)代销机构
1.招商银行股份有限公司
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人:秦晓
电话:(0755)83198888
传真:(0755)83195047
联系人:王楠
客服电话:95555
公司网址:www.cmbchina.com

2.中国光大银行
注册地址:北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦
法定代表人:唐双宁
电话:(010)68098778
传真:(010)68560661
客服电话:95595
联系人:李伟

网址:www.cebbank.com
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上海投资理财中心
地址:上海市延安东路222号外滩中心46层
电话:(021)63352934、63352937
传真:(021)63350429
客服电话:400-820-2888,(021)53524620
联系人:刘佳

网址:www.epl.com.cn
(二)代销机构
1.招商银行股份有限公司
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人:秦晓
电话:(0755)83198888
传真:(0755)83195047
联系人:王楠
客服电话:95555
公司网址:www.cmbchina.com

2.中国光大银行
注册地址:北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦
法定代表人:唐双宁
电话:(010)68098778
传真:(010)68560661
客服电话:95595
联系人:李伟

电话:(021)52629999
联系人:苏健
客服电话:95561
网址:www.eib.com.cn
6.中国邮政储蓄银行
注册地址:北京市西城区宣武门西大街131号
办公地址:北京市西城区宣武门西大街131号
法定代表人:李海帆
联系人:陈春林
电话:(010)66415205
传真:(010)66428824
客户服务热线:95580、010-66419837
公司网址:www.psbc.com

7.交通银行
注册地址:上海市仙霞路18号
总行地址:上海市银城中路188号
法定代表人:蒋超良
电话:(021)58781234
传真:(021)58408842
客服电话:95559
联系人:曹榕
网址:www.bankcomm.com

8.中国民生银行
注册地址:北京市东城区正义路4号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人:董文标
电话:(010)58351666-8233
传真:(010)83914283
联系人:吴杰
服务电话:95568
网址:www.cmbc.com.cn

9.北京银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街17号北京银行大厦
办公地址:北京市西城区金融大街17号北京银行大厦
法定代表人:闫冰竹
电话:010-66223236
传真:010-66223314
联系人:王光伟
客户服务统一咨询电话:010-96169(北京)021-53599688(上海)

10.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
联系人:中国工商银行客户服务中心
网址:www.icbc.com.cn

11.光大证券股份有限公司
注册地址:上海市南京路528号上海证券大厦南塔15-16楼
办公地址:上海市浦东新区浦东南路528号上海证券大厦南塔14楼
法定代表人:徐浩明
电话:(021)68816000
传真:(021)68815009
客服电话:4008888788
联系人:刘晨
网址:www.ebscn.com

12.国泰君安证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区商城路618号
办公地址:上海市银城中路168号上海银行大厦29楼
法定代表人:祝幼一
电话:021-3867 6161
传真:021-3867 0666
客服电话:4008888666
联系人:芮敬祺
网址:www.gtja.com

13.海通证券股份有限公司
注册地址:上海市广东路689号海通证券大厦10楼1001A
办公地址:上海市
法定代表人:王浩
电话:(021)53594556
传真:(021)53594066
客服电话:95553、4008888001
联系人:金芸
网址:www.htsec.com

14.招商证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层
法定代表人:宫少林
电话:(0755)82943666
传真:(0755)82943100
客服热线:95565、4008888111
联系人:黄健
网址:www.newone.com.cn

15.山西证券有限责任公司
注册地址:太原市府西街69号国贸大厦A座30层
法定代表人:魏敬
电话:(0351)8686709
传真:(0351)8686709
客服电话:400-666-1618
联系人:张治国
网址:www.jl18.com.cn

16.平安证券股份有限公司
办公地址:深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦三楼
法定代表人:陈敬达
联系人:袁月
电话:(0755)82450826
传真:(0755)82433794
全国统一客户服务热线:95511
网址:www.pa18.com

17.中信金通证券股份有限公司
地址:杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座
法定代表人:刘军
客服电话:(0571)96598
传真:(0571)85737771
联系人:王勤
电话:(0576)95598
网址:www.citicom.com.cn

18.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
法定代表人:李伟
电话:(010)66568613、66568587
传真:(010)66568532
联系人:李洋
网址:www.chinastock.com.cn

19.广发证券股份有限公司
注册地址:广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心26楼2611室
法定代表人:王志伟
电话:(020)87555888
传真:(020)87557987
客服电话:(020)87555888
联系人:肖梅
网址:www.gf.com.cn

20.银华国际证券股份有限公司
注册地址:上海市常熟路171号
法定代表人:丁国荣
联系人:胡洁静
电话:(021)54033888
传真:(021)54035333
客服热线:962505
网址:www.sygw.com.cn

21.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:张佑君
电话:(010)85130588
传真:(010)65182261
客服电话:400-8888-108(免长途费)
联系人:魏明
网址:www.csc108.com

22.中信万通证券股份有限公司
注册地址:青岛市市南区香港东路316号
办公地址:青岛市市南区东海西路28
法定代表人:史津民
电话:(0532)85020206
传真:(0532)85020206
联系人:丁韶杰
网址:www.zwtv.com.cn

23.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21层—29层
办公地址:上海市中山南路318号2号楼21层—29层
法定代表人:王益民
电话:(021)63325888
传真:(021)63327888
客户服务热线:(021)95503
联系人:刘方
网址:http://www.dfzq.com.cn

24.湘财证券有限责任公司
注册地址:湖南长沙长沙县载兴中路63号中山国际大厦12楼
办公地址:上海市浦东新区银城东路139号华能大厦18楼
法定代表人:陈学军
客服电话:021-68634518
传真:021-68663953
联系人:钟康霞
公司网站:www.xcsc.com

25.华泰证券股份有限公司
地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人:吴万善
电话:(025)84457777-950
客服热线:95597、4008895997
电话:(025)84579778
联系人:季金龙
网址:www.htsc.com.cn

26.上海证券有限责任公司
注册地址:上海市九江路111号
办公地址:上海市临平北路19号
法定代表人:陈学军
电话:(021)65081063
传真:(021)65217206
客户服务热线:(021)962518
联系人:谢秀峰
网址:www.962518.com

27.国元证券有限责任公司
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:吴良志
电话:(0551-2207929
传真:(0551-2207965
联系人:李纯刚
客服电话:4008-888-777
网址:www.gyzq.com.cn

28.兴业证券股份有限公司
注册地址:福州市湖东路99号标力大厦
法定代表人:兰荣
电话:(021)68419974
客户服务热线:400-8888-123
联系人:杨盛芳
网址:www.xyzq.com.cn

29.中信证券有限责任公司
注册地址:深圳市罗湖区湖贝路1030号海龙王大厦
法定代表人:王东明
电话:(010)84864818
传真:(010)84865560
联系人:陈忠
网址:www.ccitc.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)注册登记机构
名称:光大保德信基金管理有限公司
注册地址:上海市延安东路222号外滩中心46层
法定代表人:林昌
电话:(021)63350651
传真:(021)63352652
联系人:田晓岚

(四)律师事务所和经办律师
名称:北京市金杜律师事务所
注册地址:北京市朝阳区东三环中路39号建外SOHO A座31层
办公地址:深圳市深南东路5002号信兴广场地王商业中心4708-4715室
法定代表人:王玲
电话:(0755)82125533
传真:(0755)82125580
联系人:宋萍萍
经办律师:靳庆军、宋萍萍

(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有限责任公司
注册地址:上海市崧山路146号
办公地址:上海市市长路989号世纪商贸广场23楼(200031)
法定代表人:李炘文
电话:(021-24052000
传真:(021-54075507
联系人:徐敏
经办会计师:徐敏、蒋燕华

四、基金的投资目标:追求长期持续稳定超出业绩比较基准的投资回报。

五、基金的投资范围:追求长期持续稳定超出业绩比较基准的投资回报。

六、基金的投资方向
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上市

的股票、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成长潜力、股价处于合理区间的优质股票。

八、基金的投资策略
本基金借鉴了国内外保德信投资的量化投资管理理念和长期经验,结合中国

市场运行特点加以改进,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,采用自下而上与自下而上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持续流动性需求,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,上述合理期限不得超过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阳化保障体系构建处于或接近有效边界的投资组合。该体系在构建投资组合时综合考虑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;另一方面投资组合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对投资组合收益、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。

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

正确反映上市公司基本面状况;趋势类指标说明股票现有价值是否能够持续;质量类指标判断是否存在低估或高估现象,并可能逆转的信号数;同时数量小组还将根据市场变化趋势定期或不定期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、防御性行业及成长性行业,并根据行业动向及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度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,为投资组合的潜在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投资组合的影响,从财务评分模型及公司质量评分模型两方面着手对公司的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匹配原则为核心,通过一定的量化技术综合考虑个股预期收益、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资产配置并处于有效边界上的投资组合,则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。