

光大保德信尊尚一年定期开放债券型证券投资基金招募说明书摘要(更新)

光大保德信尊尚一年定期开放债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)于2015年10月13日经中国证监会证监许可【2015】2281号文核准公开募集。本基金份额于2015年11月23日至2015年12月4日发售,本基金合同于2015年12月8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”、“本公司”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的注册,并不表示其对本基金的投资价值和市场前景作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

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

投资有风险,投资人认购(或申购)本基金时应认真阅读本招募说明书,基金合同等信息披露文件,全面认识本基金产品的风险收益特征,自主判断基金的投资价值,应充分考虑投资人自身的风险承受能力,并对于认购(或申购)基金的投资意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策,自行承担投资风险。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。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不代表本基金业绩表现的保证。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况
名称:光大保德信基金管理有限公司
设立日期:2004年4月22日
批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监基金字[2004]42号

注册地址:上海市黄浦区中山东二路558号外滩金融中心1幢,6层至10层

办公地址:上海市黄浦区中山东二路558号外滩金融中心1幢(北区3号楼)6层至10层

法定代表人:林昌
注册资本:人民币1.6亿元

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

电话:(021)80262888
传真:(021)80262468
客服电话:4008-202-888
网址:www.ept.com.cn
联系人:殷瑞麟

(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,投资银行总部总经理、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. Baptista先生,副董事长,美国西北大学管理系硕士生,CFPA,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发展部营运官,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。

包丽丽女士,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。现任光大尊尚投资有限公司总经理。

俞伟先生,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理,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常务副总经理。现任光大期货有限公司常务副总经理。

王丽玲女士,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,联席执行法律事务所(中国台湾),泰运法律师事务所(中国台湾)的律师。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、研究开发部副经理,广东发展银行上海分行常务副行长、行长、党委书记,华夏银行上海分行行长。

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

郑志先生,独立董事,华东政法学院(现华东政法大学)法律史专业硕士。曾任安徽国运律师事务所上海分所律师、国浩律师集团(上海)事务所律师、上海东方万邦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。

顾徵女士,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Parecon 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。

王永先生,监事,吉林财经学院经济管理专业学士。曾就海口会计师事务所审计员,海南省国际租赁有限公司证券部财务主管,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管理部总监。

郁疆先生,监事,澳大利亚堪培拉大学工商管理硕士。曾任湘财证券有限责任公司长沙新民路营业部营销部经理,市场总部经理及董事会办公室秘书,诺基亚基金管理有限公司上海分公司高级经理等职务。加入光大保德信基金管理有限公司后,先后担任销售部高级经理,广州分公司总经理,现任本基金管理人副首席市场总监兼渠道销售部总监,广州分公司总经理。

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。

包丽丽女士,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,安徽徽商律师事务所律师,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,光大保德信基金管理有限公司,现任本基金管理人运营管理部总监。

董文卓先生,监事,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长沙新民路营业部营销部经理,市场总部经理及董事会办公室秘书,诺基亚基金管理有限公司上海分公司高级经理等职务。加入光大保德信基金管理有限公司后,先后担任监察稽核部总监,光大保德信基金管理有限公司,现任本基金管理人运营管理部总监。

4、本基金基金经理

蔡乐女士,金融投资学学士,2003年7月至2005年2月任方正证券固定收益部项目经理,2005年3月至2014年8月任中资资产管理股份有限公司固定收益部研究员兼交易员,投资经理助理,自有账户投资经理。

2014年5月加入光大保德信基金管理有限公司,现任光大保德信现金宝货币市场基金基金经理,光大保德信添溢天盈货币理财型证券投资基金基金经理,光大保德信货币基金份额基金经理,光大保德信欣鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理,光大保德信一年定期开放债券型证券投资基金基金经理,光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理,光大保德信安祺债券型证券投资基金基金经理,光大保德信多策略智选18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理,光大保德信尊尚半年定期开放债券型证券投资基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

盛松先生,现任本基金管理人副经理、首席投资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,光大保德信动态优化配置混合型证券投资基金基金经理,光大保德信红利混合型证券投资基金基金经理。

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长沙新民路营业部营销部经理,市场总部经理及董事会办公室秘书,诺基亚基金管理有限公司上海分公司高级经理等职务。加入光大保德信基金管理有限公司后,先后担任监察稽核部总监,光大保德信基金管理有限公司,现任本基金管理人运营管理部总监。

5、本基金基金经理

蔡乐女士,金融投资学学士,2003年7月至2005年2月任方正证券固定收益部项目经理,2005年3月至2014年8月任中资资产管理股份有限公司固定收益部研究员兼交易员,投资经理助理,自有账户投资经理。

2014年5月加入光大保德信基金管理有限公司,现任光大保德信现金宝货币市场基金基金经理,光大保德信添溢天盈货币理财型证券投资基金基金经理,光大保德信货币基金份额基金经理,光大保德信欣鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理,光大保德信一年定期开放债券型证券投资基金基金经理,光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理,光大保德信安祺债券型证券投资基金基金经理,光大保德信多策略智选18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理,光大保德信尊尚半年定期开放债券型证券投资基金基金经理。

6、投资决策委员会成员

盛松先生,现任本基金管理人副经理、首席投资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,光大保德信动态优化配置混合型证券投资基金基金经理,光大保德信红利混合型证券投资基金基金经理。

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长沙新民路营业部营销部经理,市场总部经理及董事会办公室秘书,诺基亚基金管理有限公司上海分公司高级经理等职务。加入光大保德信基金管理有限公司后,先后担任监察稽核部总监,光大保德信基金管理有限公司,现任本基金管理人运营管理部总监。

7、基金的投资方向

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

本基金不直接买入股票、权证等权益类资产,但可持有因可转债转股所形成的股票,因持有该股票所派发的权证以及因投资分离交易可转债而产生的权证等。因上述原因持有的股票和权证等资产,本基金将在其可交易之日起6个月内卖出。

8、基金的投资策略

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

1、资产配置策略

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

2、目标久期策略及属性策略

在组合的长期选择方面,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、货币政策动向、市场流动性变动情况等,通过对各宏观经济变量的分析,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。并且动态调整基金的标的久期,即预期利率上升时适当缩短组合久期,在预期利率下降时适当延长组合久期,从而提高债券投资收益。

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

3、收益率曲线策略

在确定了组合的整体久期后,组合将基于宏观经济研究和债券市场跟踪,结合收益率曲线的拟合和波动模拟模型,对未来的收益率曲线移动进行情景分析,从而根据不同的收益率的变动情况,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。

4、信用债投资策略

信用类债券是本基金的重要投资对象,因此信用策略是本基金债券投资策略的

办公地址:上海市静安区新闸路1508号

法定代表人:薛峰

电话:021-22169999

传真:021-22169134

客服电话:4008887788、10108998、95525

联系人:刘晨

网址:www.ebscn.com

3、北京乐融多源投资咨询有限公司

注册地址:北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603室

办公地址:北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603室

法定代表人:董浩

客服电话:400-068-1176

联系人:张婷婷

电话:185104580202

传真:010-56580660

网址:www.jiumufund.com

4、上海陆金所资产管理有限公司

注册地址:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路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

法定代表人:郭坚

客服电话:400-1818-188

联系人:宁博宇

电话:021-20665952

传真:021-22066653

网址:www.lufunds.com

5、上海天天基金销售有限公司

注册地址:浦东新区峨山路613号6楼651室

办公地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼

法定代表人:其实

客服电话:400-1818-188

联系人:潘世友

电话:021-54509988分机7019

传真:021-64383798

网址:www.1234567.com.cn

6、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:021-33289211

传真:021-33368224

客服热线:95523或4008895523

网址:www.swhysc.com

7、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:浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2号楼2楼

法定代表人:凌顺平

联系人:赵丽

电话:0571-83820897、4008-777-772

公司网站:www.5ifund.com

8、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