

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招募说明书摘要 (更新)

光大保德信尊盈半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20日经中国证券监督管理委员会证监许可[2015]2311号文，2016年11月24日经中国证券监督管理委员会机构部函[2016]2969号文，2017年4月24日经中国证券监督管理委员会证监许可[2017]602号核准公开募集。本基金份额于2017年3月20日至5月17日发售，本基金合同于2017年5月23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申请的注册，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，投资人认购（或申购）本基金前应认真阅读本招募说明书；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本基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、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。

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1.62亿元

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

证券部总经理、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，美国西北大学管理学硕士学

位，CPA，美国国籍。历任保德信金融集团企业金融助理副总裁、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，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研发团队负责人、

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、衍生品部副经理，国信证券研究所金融

金融工程首席分析师、副所长。现任光大富尊资产管理公司总经理。

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

方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

易部副经理，河南鑫福期货有限公司苏州代办处经理，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。现任光大期货有限公司常务副总经理。

王丽杨女士，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、联顺律师事务所（中国台湾）、泰运律师事务所（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、证券期货研究所副

院长。现任上海财经大学金融学院证券研究中心主任。

郑志先生，独立董事，华东政法学院（现为华东政法大学）法律专业

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

孙铁先生，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

司办公室主任兼综合处处长。现任光大国际营运总监。

殷微女士，监事，新加坡国立大学经济和管理学双学士，马来西亚国

籍，香港证券业协会会员。历任新加坡Farenew Mondia交易所有限公司

分析师、DBS瑞嘉达亚洲有限公司合规经理、香港交易所上市部副

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。

3. 公司高级管理人员

林昌先生，现任本基金管理人董事长、简同向上。

包爱丽女士，现任本基金管理人董事、总经理，简同向上。

李常青先生，中国国际贸易工商管理EMBA。历任中国科学技术大学

化学系教师，安徽众城高新律师事务所律师，大同（万泰）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

司证券部交易经理，光大证券资产管理部副总经理，2003年加入光大保

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，吉林大学毕业。曾任深圳蛇口安达实业股份有限公司

投资管理部副经理，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

户投资理财经理、基本养老保险部负责人。2017年6月加入光大保德信基金管

理有限公司，现任基本养老保险部固定收益投资总监。

4. 本基金基金经理

历任基金经理：

蔡乐女士，担任本基金基金经理时间为2017年06月23日至2018年3

月23日。

沈荣先生，硕士，2007年获得上海交通大学工学学士学位，2011年获

得上海财经大学金融学硕士学位，2007年7月至2008年9月在上海电器科

学研究所（集团）有限公司任职CDO开发工程师；2011年6月至2012年3

月在中国证券股份有限公司任职行业研究员；2012年3月至2014年4月在

宏源证券股份有限公司任职行业分析师、固定收益分析师；2014年4月至

2017年6月在平安养老保险股份有限公司任职职务助理研究经理、投资

经理；2017年7月加入光大保德信基金管理有限公司，担任固定收益部

基金经理。现任光大保德信货币市场基金、光大保德信鼎鑫灵活配置混

合型证券投资基金基金经理，光大保德信沪宁深月度策略型证券投资基金

基金经理，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

基金经理，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

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，现任本基金管理人副权益部总监兼权益投资总监。

戴育雷先生，现任本基金管理人权益投资部总监兼光大保德信中小

盘微小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，现任本基金管理人专户投资部总监。

上述人员无近亲属关系。

二、基金托管人

名称：宁波银行股份有限公司

住所：浙江省宁波市宁东路345号

办公地址：浙江省宁波市宁东路345号

法定代表人：陆华裕

注册日期：1987年04月10日

注册设立机关和批准设立文号：中国银监会，银监复[2007]64号

组织形式：股份有限公司

注册资本：伍拾伍陆仟玖佰柒拾叁万贰仟叁佰零伍佰人民币元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：证监许可【2012】1432号

托管部门联系人：王海燕

电话：0574—89103171

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：上海市黄浦区中山山东二路558号外滩金融中心1幢（北区3

号楼）6层至10层

电话：（021）80262466、80262481

传真：（021）80262482

客服电话：4008—202—888

联系人：王丽颖

网址：www.ept.com.cn

（二）代销机构

无

（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

电话：（021）80262888

传真：（021）80262493

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

名称：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：毛建甯

电话：（021）22288888

传真：（021）22280000

联系人：蒋燕华

经办会计师：蒋燕华、王俊霞

四、基金的名称：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

五、基金的类型：契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金在控制信用风险、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。

七、基金的投资方向

本基金投资于国内依法发行和上市交易的国债、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、超级短期融资

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、国债期

货等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。

本基金不直接从事二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一

级市场新股申购和新股增发，但可持有因基金投资组合所形成的股票，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的6个

月内卖出。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人将在

履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：基金投资于债券资产的比例不低于基金资

产的90%。但应开放流动性需要，为保护基金份额持有人的利益，在每

次开放前10个工作日、开放期及开放期结束后10个工作日内期间内，基

金投资不受上述比例限制。开放期间，本基金每个交易日日终在扣除国

债期货合约需缴纳的保证金后，持有现金或到期日在一年以内的政府

债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，在封闭期内，本基金不

受上述5%的限制，但每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交

易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。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。如法律法规或中国证监会

变更上述投资品种的比例限制，以变更后的比例为准，本基金的投资比

例会相应调整。

八、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，自而上决定债券

久期和资产配置范围，在严谨固本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

本基金根据工业增加值、通货膨胀率等宏观经济指标，结合国家货币

政策和财政政策实施情况、市场收益率曲线变动情况、市场流动性状

况、综合分析债券市场的变动趋势，最终确定本基金在债券类资产中的投

资比率，构建和调整债券投资组合。

2. 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，

并对各宏观因素的分析，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，从而提高债券投资组合收益。

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投资的利率风险。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率模型，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。

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

投资策略的重要组成部分。由于影响信用债券利率水平的因素包括整体