（上接B059版）

第七部分 基金合同当事人及权利义务	一、管理人 （一）管理人简况 名称：上海光大证券资产管理有限公司 住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号3号楼26层 法定代表人：熊国民 设立日期：2012年5月9日 批准设立机关及批准设立文号：中国证监会，证监许可[2011]1886号 注册资本：2亿元人民币 联系电话：021-22169999 （二）管理人的权利与义务 1.根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，管理人的权利包括但不限于： （11）在《资产管理合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请； （12）依照法律法规为集合计划的利益对被投资公司行使股东权利，为集合计划的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利； （15）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为集合计划提供服务的外部机构； （16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关集合计划申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则； 2.根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，管理人的义务包括但不限于： （2）办理资产管理合同变更申请或变更注册为公募基金手续； （12）保守集合计划商业秘密，不泄露集合计划投资计划、投资意向等。除《基金法》、《资产管理合同》及其他有关规定另有规定外，在集合计划信息公开披露前应予保密，不向他人泄露，但因监管机构、司法机关等有权机关的要求，或向审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外； （16）按规定保存集合计划财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上； （26）委托境外证券服务机构代理买卖证券的，应当严格履行受信责任，并按照有关规定对投资交易的流程、信息披露、记录保存进行管理； （27）与境外证券服务机构之间的证券交易和研究服务安排，应当严格按照《试行办法》第三十条规定的原则进行； 二、托管人 （二）托管人的权利与义务 1.根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，托管人的权利包括但不限于： （4）根据相关市场规则，为集合计划开设资金账户、证券账户、期货结算账户等投资所需账户，为集合计划办理证券/期货交易资金清算； 2.根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，托管人的义务包括但不限于： （6）按规定开设基金财产的资金账户、证券账户、期货结算账户等投资所需账户，按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜； （7）保守集合计划商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，但因监管机构、司法机关等有权机关的要求，或向审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外； （7）保守集合计划商业秘密，除《基金法》、《资产管理合同》及其他有关规定另有规定外，在集合计划信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，但因监管机构、司法机关等有权机关的要求，或向审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外； （11）除第（27）项所述资料外，保存集合计划托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料15年以上； （12）建立并保存集合计划份额持有人名册； （21）执行生效的集合计划份额持有人大会的决议； （28）法律法规及中国证监会和外管局规定的和《资产管理合同》约定的其他义务。 三、集合计划份额持有人 投资者持有本集合计划份额的行为即视为对《资产管理合同》的承认和接受，投资者自依照《资产管理合同》取得集合计划份额，即成为集合计划份额持有人和《资产管理合同》的当事人，直至其不再持有本集合计划的份额。集合计划份额持有人作为《资产管理合同》当事人并不以在《资产管理合同》上书面签章或签字为必要条件。 同一类别每份集合计划份额具有同等的合法权益。 2.根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，集合计划份额持有人的义务包括但不限于： （7）执行生效的集合计划份额持有人大会的决定；	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 名称：光大保德信基金管理有限公司 住所：上海市黄浦区中山东二路558号外滩金融中心1幢，6层 法定代表人：刘翔 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 注册资本：人民币1.6亿元 联系电话：021-80262888 （二）基金管理人的权利与义务 1.根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于： （11）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回与转换申请； （12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利； （13）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券/期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构； （16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关集合计划申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则； （17）选择、更换或撤销境外投资顾问（如有）； 2.根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于： （2）办理基金备案手续； （12）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露，但因监管机构、司法机关等有权机关的要求，或向审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外； （16）按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料，保存期限不少于法律法规规定； 二、基金托管人 （二）基金托管人的权利与义务 1.根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于： （4）根据相关市场规则，为基金开设资金账户、证券账户等投资所需账户，为基金办理证券/期货交易资金清算； 2.根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于： （6）按规定开设基金财产的资金账户、证券账户等投资所需账户，按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜； （7）保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，但因监管机构、司法机关等有权机关的要求，或向审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外； （11）保存基金会计账簿、报表、记录和其他相关资料15年以上；	一、投资目标 通过积极进行资产配置和组合管理，在深入研究、控制和分散投资组合风险的前提下，力争实现基金计划资产的长期稳健增值。 二、投资范围 本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括境外投资品种与境内投资品种。其中， 境外投资品种包括已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证，房地产信托凭证；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金（以下无特别说明，均包括交易型开放式指数基金（ETF））；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、短期政府债券等货币市场工具；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品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。 境内投资品种包括：国内依法发行上市的股票（含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票（下同））、港股通标的股票、存托凭证、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债纯债部分））及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权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）。 本基金投资于香港证券市场挂牌交易的股票时，在法律法规允许的前提下，既可通过合格境内机构投资者（QDII）的额度进行投资，也可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制进行投资。 本基金可以进行境外证券借贷交易、境外正回购交易、逆回购交易。有关证券借贷交易的内容以专门签署的三方或多方协议约定为准。 本基金投资境外投资品种，所称银行应当是中资商业银行在境外设立的分行或在最近一个会计年度达到中国证监会认可的信用评级机构评级的境外银行。 如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，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：本基金的股票及存托凭证投资比例为基金资产的80%-95%，其投资于港股及港股通标的股票的比例不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除金融衍生品合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券；其中现金不包括结算备付金、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，基金管理人在履行适当程序后以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。 二、投资策略 1、资产配置策略 本基金通过定性与定量研究相结合的方法，确定投资组合中权益类资产和固定收益类资产的配置比例。本基金通过动态跟踪海内外主要经济体的GDP、CPI、利率等宏观经济指标，以及估值水平、盈利预期、流动性等市场指标，确定未来市场变动趋势。本基金通过全面评估上述各种关键指标的变动趋势，对股票、债券等大类资产的风险和收益特征进行预测。根据上述结论和定量指标的分析结果，运用资产配置优化模型，在目标收益条件下，追求风险最小化目标，最终确定大类资产投资权重，实现资产合理配置。 2、股票投资策略 （1）行业配置策略 本基金主要从所属行业的主要股票市场指数的成分股中，精选市值排名靠前、质地优异、经营稳健、品牌突出、具备行业领先性的代表性上市公司进行投资，以期获得良好的收益回报。基金管理人将跟踪各行业整体的收入增速、利润增速、毛利率变动幅度、ROIC变动情况，依此来判断各行业的景气度，再根据行业整体的估值情况、市场的预期，目前机构配置的比例来综合考虑各行业在组合中的配置比例。 （2）个股投资策略 本基金将先通过行业发展前景及竞争格局考察，公司竞争力分析，公司可持续成长潜力评估及投资价值评估等四个层面的综合比较初步筛选出投资备选股票。然后，以全球市场为参照，通过对经济发展新段、行业发展新段和前景、公司综合竞争能力的递层分解，形成对公司的相对估值判断。最后，由研究员通过调研、财务分析及量化估值等方法，筛选出质地优良、盈利持续增长、估值具备吸引力和市场预期持续发育的公司构建股票投资组合。 本集合计划将重点关注在估值环境上市、具有行业优势和核心竞争力的优质公司，关注港股市场在行业结构、估值、AH股折溢价、股息率等方面具有吸引力的投资标的。 （三）固定收益类品种投资策略 本计划将根据对利率走势的预测、债券等级、债券的期限结构、风险结构、不同品种间收益的高低等因素，构造债券组合。 （四）资产支持证券投资策略 本集合计划将重点对区域经济、市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并结合对证券模型、评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。 （五）衍生品投资策略 1）股指期货投资策略 ①在符合法律法规规定的前提下，本集合计划在遵守相关法律法规、监管机构、证券交易所、期货交易所、证券登记结算机构、期货结算机构等机构的规定的原则下，为了有效地进行风险管理，本集合计划可以在股指期货上进行交易。 ②股指期货交易的目的是为了在股票市场出现较大的系统性风险时，能够迅速、有效地对股票组合进行对冲，锁定股票组合的价值，减少因大盘下跌造成的损失。 ③本集合计划在股指期货上的交易原则是： a.在正常情况下，本集合计划在股指期货上的日均持仓不得超过前一个交易日基金资产净值的10%； b.本集合计划在股指期货上的交易遵循成本有效原则，力求以较小的成本实现较大的对冲效果； c.本集合计划在股指期货上的交易遵循风险对冲原则，力求通过期货交易对冲掉大部分的系统性风险； d.本集合计划在股指期货上的交易遵循流动性原则，力求保证期货交易的顺利开仓和平仓； e.本集合计划在股指期货上的交易遵循谨慎原则，力求在控制风险的前提下，实现期货交易的盈利。 2）国债期货投资策略 ①在国债期货上的交易原则是： a.在正常情况下，本集合计划在国债期货上的日均持仓不得超过前一个交易日基金资产净值的30%； b.本集合计划在国债期货上的交易遵循成本有效原则，力求以较小的成本实现较大的对冲效果； c.本集合计划在国债期货上的交易遵循风险对冲原则，力求通过期货交易对冲掉大部分的系统性风险； d.本集合计划在国债期货上的交易遵循流动性原则，力求保证期货交易的顺利开仓和平仓； e.本集合计划在国债期货上的交易遵循谨慎原则，力求在控制风险的前提下，实现期货交易的盈利。 ②国债期货交易的具体投资策略将根据有关法律法规、监管机构、证券交易所、期货交易所、证券登记结算机构、期货结算机构等机构的规定的原则，结合国债期货的特性，在充分考虑国债期货的流动性、交易成本、杠杆效应、保证金要求、交割方式、交割成本、交割品种、交割时间、交割风险、市场情况、基差、久期、凸性、利率期限结构、利率波动率、利率水平、利率预期、国债现货市场情况、国债期货市场情况、国债现货与国债期货的联动关系、国债期货的定价模型、国债期货的套利机会、国债期货的风险收益特征、国债期货的流动性、国债期货的交易成本、国债期货的交割成本、国债期货的交割品种、国债期货的交割时间、国债期货的交割风险、国债期货的交易保证金、国债期货的杠杆效应、国债期货的交易方式、国债期货的交易时间、国债期货的交易风险、国债期货的交易品种