光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书摘要（更新）

光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）于2016年5月17日经中国证券监督管理委员会证监许可【2016】1070号文核准公开募集。本基金份额于2016年8月15日至2016年8月17日发售，本基金合同于2016年8月19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构成新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.epf.com.cn

联系人：殷瑞骊

（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，美国西北大学管理系硕士学位，CFA，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，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。

蒋新元先生，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、研究所副所长、理财工程部总经理、证券投资部总经理、光大证券资产管理有限公司总经理。现任光大证券资产管理有限公司总经理。

俞大伟先生，董事，同济大学工商管理硕士，中国国籍。历任江苏东华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。

王细玲女士，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，联勤法律事务所（中国台湾）、泰远法律事务所（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、研究开发部副总经理、产权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证券研究中心主任。

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

孙依先生，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副主任兼综合处处长。现任光大国际营运总监。

颜微谦女士，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Fairnew 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。

王永万先生，监事，吉林财贸学院经济管理专业学士。曾任海口会计师事务所审计员，海南省国际租赁有限公司证券营业部财务主管，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部总监。

赵大年先生，监事，中国科学技术大学统计与金融系学士，中国科学院数学与系统科学研究院统计学专业硕士。历任申万巴黎基金管理有限公司任职产品设计经理，钧峰投资咨询有限公司任职投资经理，2009年4月加入光大保德信基金管理有限公司，先后担任风险管理部风险控制专员、风险控制高级经理、副总监、总监（负责量化投资研究等），量化投资部总监、基金经理，现任风险管理部副总监。

3、公司高级管理人员

林昌先生，现任本基金管理人董事长，简历同上。

包爱丽女士，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，安徽众城高新律师事务所律师，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、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，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、量化投资部总监兼光大保德信量化核心证券投资基金基金经理。

梅楚军先生，吉林大学博士。曾任深圳松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机构管理部总经理兼任电脑部总经理，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中心总经理。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、专户投资经理、基本养老投资经理等。2017年5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、固定收益投资总监兼投资经理。

4、本基金基金经理

历任基金经理：

蔡钦女士，担任本基金基金经理时间为2016年8月19日至2018年3月23日。

现任基金经理：

房震先生，硕士，2007年毕业于哈尔滨工业大学获得信息与计算科学专业的学士学位，2009年获得哈尔滨工业大学概率论与数理统计专业的硕士学位。2009年6月至2013年4月在江海证券先后担任研究发展部宏观策略分析师、投资部高级研究员，2013年5月至2015年6月在平安证券担任综合研究所策略研究组组长兼平安银行私人银行投资决策委员会委员，2015年6月加入光大保德信基金管理有限公司，担任策略分析师兼研究总监助理。现任首席策略分析师兼光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、光大保德信永鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、光大保德信宏祺债券型证券投资基金基金经理、光大保德信铭鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

曾小丽女士，硕士，2009年获得天津外国语大学国际贸易专业学士学位，2011年获得中国人民大学世界经济专业硕士学位，2011年7月至2014年7月在大公国际资信评估有限公司担任分析师、处经理、技术总监/评审委员；2014年8月加入光大保德信基金管理有限公司，历任信用研究员、现任固收研究负责人一职。现任光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、光大保德信诚鑫灵活配置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总经理、固定收益投资总监兼投资经理。

戴奇雷先生，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、光大保德信动态优选灵活配置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兼投资经理。

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：1997年04月10日

批准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：伍拾亿陆仟玖佰柒拾叁万贰仟叁佰零伍人民币元

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：0574-83037171

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

电话：（021）80262466，80262481

传真：（021）80262482

客服电话：4008-202-888

联系人：王颖

网址：www.epf.com.cn

（二）代销机构

1. 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2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

网址：www.fund123.cn

客户服务电话：4000-766-123

电话：021-60897869，0571-28829790

传真：0571-26698533

联系人：周娟旻

2. 上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济发展区）

办公地址：上海市杨浦区昆明路518号A1002室

法定代表人：王翔

联系人：蓝杰

电话：021-65370077

传真：021-55085991

客户服务电话：4008-205-369

网址：www.jiyufund.com.cn

3. 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室

办公地址：上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室

法定代表人：杨文斌

客服电话：400-700-9665

联系人：张茹

电话：021-58870011

传真：021-68596919

网址：www.ehowbuy.com

4. 北京肯特瑞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：北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院A座17层。

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.jd.com/fundlist/1-11-112.htm

5. 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街11号11层A座1108号

办公地址：北京市海淀区中关村大街11号11层A座1108号

法定代表人：王伟刚

客服电话：400-619-9059

联系人：陈小满

电话：010-56251471

分机：无分机

传真：010-62680827

网址：www.hcjjin.com

（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

电话：（021）80262888

传真：（021）80262483

联系人：杨静

（四）律师事务所和经办律师

名称：上海源泰律师事务所

注册地址：上海浦东南路256号华夏银行大厦1405室

办公地址：上海浦东南路256号华夏银行大厦1405室

负责人：廖海

电话：（021）51150298

传真：（021）51150398

联系人：刘佳

经办律师：廖海、刘佳

（五）会计师事务所和经办注册会计师

公司全称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：中国上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址：中国上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

法定代表人：李丹

电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：陈腾

经办会计师：薛霞、陈腾

四、基金的名称：光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金

五、基金的类型：契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金力争在股票、债券和现金等大类资产的灵活配置与稳健投资下，获取长期、持续、稳定的合理回报。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、固定收益类金融工具（包括国债、金融债、公司债、证券公司短期公司债、企业债、地方政府债、次级债、中小企业私募债券（含可分离交易可转债）、货币市场工具、短期融资券、中期票据、资产支持证券、债券回购、央行票据、银行存款等）、权证、股指期货、国债期货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)。

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：本基金股票资产占基金资产的比例范围为0%—95%；每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货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。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做相应调整。

八、基金的投资策略

1、资产配置策略

本基金将通过对宏观经济基本面及证券市场双层面的数据进行研究，并通过定性定量分析、风险测算及组合优化，最终形成大类资产配置决策。

（1）宏观经济运行的变化和国家的宏观调控政策将对证券市场产生深刻影响。本基金通过综合国内外宏观经济状况、国家财政政策、央行货币政策、物价水平变化趋势等因素，构建宏观经济分析平台；

（2）运用历史数据并结合基金管理人内部的定性和定量分析模型，确定影响各类资产收益水平的先行指标，将上一步的宏观经济分析结果量化为对先行指标的影响，进而判断对各类资产收益的影响；

（3）结合上述宏观经济对各类资产未来收益影响的分析结果和本基金投资组合的风险预算管理，确定各类资产的投资比重。

2、股票投资策略

本基金将结合自上而下行业分析与自下而上研究入库的投资理念，在以整个宏观策略为前提下，把握结构性调整机会，将行业分析与个股精选相结合，寻找出表现优异的子行业和优质个股，并将这些股票组成本基金的核心股票库。

（1）行业分析

在综合考虑行业的周期、竞争格局、技术进步、政府政策、社会习惯的改变等因素后，精选出行业地位高、行业的发展空间大的子行业。

（2）个股选择

本基金将在核心股票库的基础上，以定性和定量相结合的方式，从价值和成长等因素对个股进行选择，综合考虑上市公司的增长潜力与市场估值水平，精选估值合理且成长性良好的上市公司进行投资。同时，本基金关注国家相关政策、事件可能对上市公司的当前或未来价值产生的重大影响，本基金将在深入挖掘这类政策、事件的基础上，对行业进行优化配置和动态调整。

1）定量分析

本基金结合盈利增长指标、现金流量指标、负债比率指标、估值指标、盈利质量指标等与上市公司经营有关的重要定量指标，对目标上市公司的价值进行深入挖掘，并对上市公司的盈利能力、财务质量和经营效率进行评析，为个股选择提供依据。

2）定性分析

本基金认为股票价格的合理区间并非完全由其财务数据决定，还必须结合企业学习与创新能力、企业发展战略、技术专利优势、市场拓展能力、公司治理结构和管理水平、公司的行业地位、公司增长的可持续性等定性因素，给予股票一定的折溢价水平，并最终决定股票合理的价格区间。根据上述定性定量分析的结果，本基金进一步从价值和成长两个维度对备选股票进行评估。对于价值被低估且成长性良好的股票，本基金将重点关注；对于价值被高估而成长性良好，或价值被低估但成长性较差的股票，本基金将通过深入的调研和缜密的分析，有选择地进行投资；对于价值被高估且成长性较差的股票，本基金不予考虑投资。

3、固定收益类品种投资策略

本基金投资于固定收益类品种的目的是在保证基金资产流动性的基础上，使基金资产得到更加合理有效的利用，从而提高投资组合收益。为此，本基金固定收益类资产的投资将在限定的投资范围内，根据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、市场流动性情况来预测债券市场整体利率趋势，同时结合各品种品种的供需情况、流动性、信用状况和利率敏感度等因素进行综合分析，在严格控制风险的前提下，构建和调整债券投资组合。在确定固定收益投资组合的具体品种时，本基金将根据市场对于不久的将来的市场成交情况，对各个目标投资对象进行利差分析，包括信用利差、流动性利差、期权调整利差（OAS），并利用利率模型对利率进行模拟预测，选出定价合理或被低估，到期期限符合组合构建要求的固定收益品种。

4、股指期货投资策略

本基金将在风险可控的前提下，以套期保值为目的，根据对现货和期货市场的分析，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。

5、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。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。

6、中小企业私募债投资策略

与传统的信用债相比，中小企业私募债券采取非公开方式发行和交易，整体流动性相对较差，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券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、盈利能力、现金流、经营稳定性等关键因素，确定最终的投资决策。

7、证券公司短期公司债券投资策略

本基金通过对证券公司短期公司债券发行人基本面的深入调研分析，结合发行人资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性以及债券流动性、信用利差、信用评级、违约风险等的综合评估结果，选取具有价格优势和套利机会的优质信用债券进行投资。

8、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风险、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。

9、权证及其他品种投资策略

本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究，结合期权定价量化模型估算权证价值，主要考虑运用的策略有：价值挖掘策略、杠杆策略、双向权证策略、获利保护策略和套利策略等。

同时，法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，本基金若认为有助于基金进行风险管理和组合优化的，可依据法律法规的规定履行适当程序后，运用金融衍生产品进行投资风险管理。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%。

十、基金的风险收益特征

本基金为混合型基金，其风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

十一、基金的投资组合报告

本投资组合报告所载数据截至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	129,649,766.80	72.17
	其中：债券	129,649,766.80	72.17
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	44,044,125.02	24.52
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	2,843,356.27	1.58
7	其他各项资产	3,102,722.15	1.73
8	合计	179,639,970.24	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	央行票据	-	-
3	金融债券	11,033,000.00	8.16
	其中：政策性金融债	11,033,000.00	8.16
4	企业债券	28,211,860.00	20.87
5	企业短期融资券	31,122,700.00	23.02
6	中期票据	49,970,000.00	36.96
7	可转债（可交换债）	344,606.80	0.25
8	同业存单	8,967,600.00	6.63
9	其他	-	-
10	合计	129,649,766.80	95.90

5.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	180201	18国开01	110,000	11,033,000.00	8.16
2	011800996	18蓝星SCP004	110,000	10,996,700.00	8.13
3	143674	18临债01	110,000	10,994,500.00	8.13
4	101464029	14新余钢铁MTN001	100,000	10,336,000.00	7.65
5	1280137	12西宁城投债	500,000	10,185,000.00	7.53

6.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名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

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易成本较低的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

10、投资期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

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、投资组合报告附注

11.1报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的情况。

11.2本基金投资的前十名股票未超出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	248,877.53
2	应收证券清算款	47,755.75
3	应收股利	-
4	应收利息	2,803,090.72
5	应收申购款	2,998.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,102,722.15

11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128016	雨虹转债	109,011.00	0.08
2	128032	双环转债	89,525.80	0.07

11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

十二、基金的业绩

（一）基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

光大保德信吉鑫混合A：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2016年	-1.70%	0.10%	-1.45%	0.36%	-0.25%	-0.26%
2017年	10.78%	0.21%	10.30%	0.32%	0.48%	-0.11%
2018年	-2.70%	0.37%	-4.46%	0.58%	1.76%	-0.21%
合同成立至今	5.96%	0.25%	3.86%	0.41%	2.10%	-0.16%

光大保德信吉鑫混合C：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2016年	-1.70%	0.10%	-1.45%	0.36%	-0.25%	-0.26%
2017年	9.56%	0.20%	10.30%	0.32%	-0.74%	-0.12%
2018年	-2.73%	0.37%	-4.46%	0.58%	1.73%	-0.21%
合同成立至今	4.76%	0.24%	3.86%	0.41%	0.90%	-0.17%

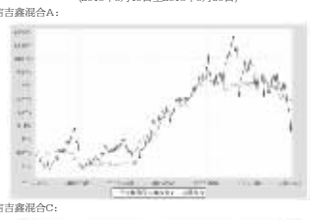
（二）基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金

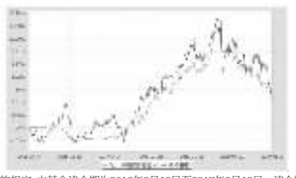
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2016年8月19日至2018年6月30日）

1. 光大保德信吉鑫混合A：



2. 光大保德信吉鑫混合C：



注：根据基金合同的规定，本基金建仓期为2016年8月19日至2017年2月18日。建仓期结束时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

1、基金费用的种类

1.基金管理人的管理费；

2.基金托管人的托管费；

3.基金的销售服务费；

4.基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；

5.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；

6.基金份额持有人大会费用；

7.基金的证券、期货交易费用；

8.基金的银行汇划费用；

9.证券、期货账户开户费用和银行间账户维护费；

10.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。

2.基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1.基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.6%年费率计提。基金管理费的计算方法如下：

H＝E×0.6%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

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，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

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0.1%的年费率计提。基金托管费的计算方法如下：

H＝E×0.1%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

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，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

3.基金的销售服务费

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，适用不同的销售服务费率。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0.1%。

本基金C类基金份额销售服务费计提的计算公式如下：

H＝E×0.1%÷当年天数

H为C类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E为前一日C类基金份额的基金资产净值

C类基金份额的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，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

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.不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1.基金管理人和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.基金管理人和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。

4.基金费用的调整

在遵守相关的法律法规并履行了必要的程序的前提下，基金管理人和基金托管人协商一致后可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。基金管理人必须于新的费率实施日前按照《信息披露办法》的规定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。

通过直销机构申购本基金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类基金份额申购费率
50万元以下	0.08%
50万元（含50万元）到100万元	0.05%
100万元（含100万元）到500万元	0.03%
500万元以上（含500万元）	每笔交易1000元

其他投资者申购本基金基金份额申购费率见下表：

申购金额（含申购费）	A类基金份额申购费率
50万元以下	0.80%
50万元（含50万元）到100万元	0.50%
100万元（含100万元）到500万元	0.30%
500万元以上（含500万元）	每笔交易1000元

2.本基金的赎回费率见下表

本基金的A类基金份额赎回费率见下表：

持续持有期	A类基金份额赎回费率
7天以内	1.5%
7天（含7天）到30天	0.75%
30天（含30天）到6个月	0.5%
6个月以上（含6个月）	0

本基金的C类基金份额赎回费率见下表：

持续持有期	C类基金份额赎回费率
7天以内	1.5%
7天（含7天）到30天	0.5%
30天以上（含30天）	0

3.对持续持有期少于30日的投资人收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期长于30日少于3个月的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的75%计入基金财产；对持续持有期长于3个月但少于6个月的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的50%计入基金财产，未计入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

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、基金赎回费率和基金销售服务费率。

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》、《证券投资基金管理公司治理准则（试行）》及其它有关法律法规的要求，对本基金招募说明书进行了更新，主要更新内容列示如下：

1. 在“重要提示”中，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、绪言”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、基金托管协议的内容摘要”部分，根据实际情况进行了更新。

14. 在“二十一、对基金份额持有人的服务”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2月19日至2018年8月18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9月29日

光大保德信安泽债券型证券投资基金基金开放日常申购（赎回、转换、定期定额投资）业务公告

公告送出日期：2018年9月29日

1.公告基本信息

基金名称	光大保德信安泽债券型证券投资基金
基金简称	光大保德信安泽债券
基金主代码	005656
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年9月6日
基金管理人名称	光大保德信基金管理有限公司
基金托管人名称	中国光大银行股份有限公司
基金注册登记机构名称	光大保德信基金管理有限公司
公告依据	《光大保德信安泽债券型证券投资基金基金合同》、《光大保德信安祥债券型证券投资基金招募说明书》
申购起始日	2018年10月9日
赎回起始日	2018年10月9日
转换转入起始日	2018年10月9日
转换转出起始日	2018年10月9日
定期定额投资起始日	2018年10月9日
下属分级基金的基金简称	光大保德信安泽债券A	光大保德信安祥债券C
下属分级基金的交易代码	005656	005657
该分级基金是否开放申购、赎回（转换、定期定额投资）	是	是

2.日常申购、赎回（转换、定期定额投资）业务的办理时间

本基金为投资者办理日常申购及赎回等业务的时间即开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所的交易日，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购及赎回时除外。具体业务办理时间以销售机构公布时间为准。基金合同生效后，若出现新的证券或期货交易市场、证券或期货交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

3.日常申