

# 光大保德信量化核心证券投资基金招募说明书摘要(更新)

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，投资人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。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，并按照《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2019年2月26日，有关财务数据和净值表现截止日为2018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]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

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），6-7层、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](http://www.epf.com.cn)

联系人：殷瑞峰

### （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。

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。现任光大富尊投资有限公司总经理。

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，上海中期货经纪有限公司苏州营业部副经理、经理，上海中期货经纪有限公司副总经理，光大期货有限公司常务副总经理。现任光大期货有限公司总经理。

王俪玲女士，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，联鼎法律事务所（中国台湾）、泰运法律事务所（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，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、上海财经大学金融学院证券研究中心主任。现任上海财经大学国际金融中心研究院首席资本市场专家。

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。

颜微惠女士，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 Farenw 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，钧锋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，安徽众城高昕律师事务所律师，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。

梅雷军先生，吉林大学博士。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：

何如克先生，担任本基金基金经理时间为2004年8月27日至2005年8月5日。

常昊先生，担任本基金基金经理时间为2004年9月25日至2007年6月28日。

袁宏隆先生，担任本基金基金经理时间为2007年6月29日年至2011年4月25日。

钱钧先生，担任本基金基金经理时间为2010年12月7日年至2014年1月8日。

周炜炜先生，担任本基金基金经理时间为2014年1月9日年至2014年8月1日。

田大伟先生，担任本基金基金经理时间为2014年2月25日年至2018年3月14日。

赵大年先生，担任本基金基金经理时间为2016年4月26日年至2018年3月14日。

现任基金经理：

盛松先生，硕士，1989年毕业于北京大学数学系，并于1992年获得北京大学遥感所的硕士学位。1993年2月至1996年5月任职于中国光大国际信托投资公司证券部，担任交易部经理职务；1996年5月至2002年7月任职于光大证券有限责任公司，担任资产经营部副总经理职务；2003年6月加入光大保德信基金管理有限公司，任职筹备组人员，并于2004年4月至2014年8月担任光大保德信基金管理有限公司督察长职务；2014年8月至今担任公司副总经理、首席投资总监、量化投资部总监。现任光大保德信量化核心证券投资基金基金经理。

翟云飞先生，2005年毕业于中国科学技术大学自动化系，2010年获得中国科学技术大学统计与金融系博士学位。2010年6月至2014年3月在大成基金管理有限公司任职，其中2010年6月至2011年5月任职金融工程师（负责量化投资研究）、2011年5月至2012年7月任职产品设计师、2012年7月至2014年3月任职量化投资研究员、行业投资研究员；2014年4月加入光大保德信基金管理有限公司，担任金融工程师（负责量化投资研究）、高级量化研究员。现任光大保德信风格轮动混合型证券投资基金基金经理、光大保德信量化核心证券投资基金基金经理、光大保德信事件驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理、光大保德信创业板量化优选股票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。

林晓凤女士，现任权益投资部副总监兼光大保德信一带一路战略主题混合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、光大保德信睿鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

上述人员无近亲属关系。

## 二、基金托管人

名称：中国光大银行股份有限公司

住所及办公地址：北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心

成立日期：1992 年 6 月 18 日

批准设立机关和批准设立文号：国务院、国函[1992]7 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：466.79095 亿元人民币

法定代表人：李晓鹏

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【2002】75 号

投资与托管业务部总经理：张博

电话：（010） 63636363

传真：（010） 63639132

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

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

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），6-7 层、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. 中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

客服电话：95533

联系人：王嘉朔

网址：www.ccb.com

#### 2. 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

网址: [www.icbc.com.cn](http://www.icbc.com.cn)

### 3. 交通银行股份有限公司

办公地址: 上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人: 彭纯

客服电话: 95559

联系人: 王菁

电话: 021-58781234

传真: 021-58408483

网址: [www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

### 4. 中国邮政储蓄银行股份有限公司

注册地址: 北京市西城区金融街 3 号

办公地址: 北京市西城区金融街 3 号

法定代表人: 李国华

客户服务电话: 95580

联系人: 陈春林

传真: 010-68858117

公司网址: [www.psbc.com](http://www.psbc.com)

### 5. 中国光大银行股份有限公司

注册地址: 北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心

法定代表人: 李晓鹏

客服电话: 95595

联系人: 朱红

网址: [www.cebbank.com](http://www.cebbank.com)

### 6. 招商银行股份有限公司

注册地址: 深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行股份有限公司大厦

法定代表人: 李建红

客服电话: 95555

联系人: 邓炯鹏

电话: 0755-83198888

传真: 0755-83195109

网址: [www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

### 7. 中国民生银行股份有限公司

注册地址: 北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址: 北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人: 洪崎

客服电话: 95568

联系人: 董云巍

电话: 010-58560666

传真: 010-57092611

网址: [www.cmbc.com.cn](http://www.cmbc.com.cn)

8. 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址: 上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址: 上海市中山东一路 12 号

法定代表人: 吉晓辉

电话: (021) 61618888

传真: (021) 63604199

联系人: 倪苏云, 虞谷云

客户服务热线: 95528

公司网站: [www.spdb.com.cn](http://www.spdb.com.cn)

9. 中信银行股份有限公司

注册地址: 北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

办公地址: 北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人: 田国立

客服电话: 95558

联系人: 丰靖

网址: <http://bank.ecitic.com>

10. 兴业银行股份有限公司

注册地址: 福州市湖东路 154 号

法定代表人: 高建平

电话: (021) 52629999

联系人: 刘玲

客服电话: 95561

网址: [www.cib.com.cn](http://www.cib.com.cn)

11. 北京银行股份有限公司

注册地址: 北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址: 北京市西城区金融大街丙 17 号

法定代表人: 闫冰竹

联系人: 谢小华

电话: 010-66223587

传真: 010-66226045

客户服务电话: 95526

公司网站: [www.bankofbeijing.com.cn](http://www.bankofbeijing.com.cn)

12. 宁波银行股份有限公司

注册地址: 宁波市鄞州区宁南南路 700 号宁波银行大楼

办公地址: 宁波市鄞州区宁南南路 700 号宁波银行大楼

法定代表人: 陆华裕

电话: 0574-89068340

传真: 0574-87050024

联系人：胡技勋

客服电话：96528（上海、北京地区 962528）

网址：[www.nbcb.com.cn](http://www.nbcb.com.cn)

13. 中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：周慕冰

客服电话：95599

联系人：贺倩

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

网址：[www.abchina.com](http://www.abchina.com)

14. 平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦

法定代表人：孙建一

客服电话：95511-3

网址：[www.pingan.com](http://www.pingan.com)

15. 华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：吴建

客服电话：95577

网址：[www.hxb.com.cn](http://www.hxb.com.cn)

16. 广发银行股份有限公司

注册地址：广东省广州市东风东路 713 号

办公地址：广东省广州市东风东路 713 号

法定代表人：董建岳

客服电话：4008308003

网址：[www.cgbchina.com.cn](http://www.cgbchina.com.cn)

17. 上海农村商业银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东大道 981 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 8 号中融碧玉蓝天大厦 15—23 层

法定代表人：胡平西

客服电话：021-962999

联系人：吴海平

电话：021-38576969

网址：[www.srcb.com](http://www.srcb.com)

18. 东莞农村商业银行股份有限公司

注册地址：东莞市南城路 2 号

办公地址：东莞市南城路 2 号

法定代表人：何沛良

客服电话：0769-961122

联系人：谭少筠

电话：0769-22118343

传真：0769-22320896

网址：[www.drcbank.com](http://www.drcbank.com)

#### 19. 浙江稠州商业银行股份有限公司

注册地址：浙江省义乌市江滨路义乌乐园东侧

办公地址：浙江省义乌市江滨路义乌乐园东侧

法定代表人：金子军

客服电话：(0571)96527、4008096527

联系人：董晓岚、邵利兵

电话：0571-87117617、87117616

传真：0571-87117616

网址：[www.czcb.com.cn](http://www.czcb.com.cn)

#### 20. 洛阳银行股份有限公司

注册地址：河南省洛阳市新区开元大道与通济街交叉口

办公地址：河南省洛阳市新区开元大道 256 号

法定代表人：王建甫

客服电话：96699

联系人：王军

电话：0379-65921977

传真：0379-65921869

网址：[www.bankofluoyang.com.cn](http://www.bankofluoyang.com.cn)

#### 21. 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闸路 1508 号

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：4008888788、10108998、95525

联系人：刘晨、李芳芳

网址：[www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

#### 22. 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：王开国

电话：021-23219000

传真：021-23219100



客服电话：95553、4008888001

联系人：金芸

网址：www.htsec.com

#### 23. 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：0755-82960223

传真：0755—82943100

客服电话：95565、4008888111

联系人：林生迎

网址：www.newone.com.cn

#### 24. 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：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：万建华

电话：021—38676666

传真：021—38670666

客服电话：4008888666

联系人：芮敏祺

网址：www.gtja.com

#### 25. 山西证券股份有限公司

地址：山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

法定代表人：侯巍

电话：（0351）8686659

传真：（0351）8686619

客服电话：400-666-1618

联系人：郭熠

网址：www.i618.com.cn

#### 26. 平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

法定代表人：杨宇翔

联系人：郑舒丽

电话：（0755）22626172

传真：（0755）82400862

客服电话：95511-8

网址：www.pingan.com

#### 27. 中信证券（浙江）有限责任公司

注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19、20 层

法定代表人：沈强  
客服电话：（0571）96598  
传真：（0571）85783771  
联系人：丁思聪  
网址：www.bigsun.com.cn

28. 广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）  
办公地址：广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、41 和 42 楼  
法定代表人：林治海  
联系人：黄岚  
客服电话：95575 或致电各地营业网点  
传真：（020）87555305  
网站：www.gf.com.cn

29. 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：021-33388211  
传真：021-33388224  
客服热线：95523 或 4008895523  
网址：www.swhysc.com

30. 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：王常青  
电话：（010）85130588  
传真：（010）65182261  
客服电话：400-8888-108  
联系人：权唐  
网址：www.csc108.com

31. 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层（266061）  
办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层  
法定代表人：杨宝林  
电话：（0532）85022326  
传真：（0532）85022605  
联系人：吴忠超  
网址：www.citicssd.com

32. 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

客服电话：（021）95503

联系人：吴宇

网址：[www.dfzq.com.cn](http://www.dfzq.com.cn)

33. 湘财证券有限责任公司

地址：长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼

法定代表人：林俊波

电话：021-68634518

传真：021-68865680

联系人：钟康莺

网址：[www.xcsc.com](http://www.xcsc.com)

34. 国元证券股份有限公司

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：凤良志

电话：0551-2246298

传真：0551-2272100

联系人：李飞

客服电话：4008-888-777

网址：[www.gyzq.com.cn](http://www.gyzq.com.cn)

35. 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）38565783

客服电话：400-8888-123

联系人：谢高得

网址：[www.xyzq.com.cn](http://www.xyzq.com.cn)

36. 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 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈有安

联系人：田薇

电话：010-66568430

传真：010-66568116

客服电话：400-888-8888

网址：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

37. 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市深南大道 2028 号中国凤凰大厦 1 号楼 7 层

法定代表人：牛冠兴

联系人：陈剑虹

电话：0755-82558305

客服电话：400-800-1001

网址：[www.essence.com.cn](http://www.essence.com.cn)

38. 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市西藏中路 336 号

法定代表人：郁忠民

联系电话：021-51539888

联系人：张瑾

公司网址：[www.962518.com](http://www.962518.com)

客服电话：021-962518、4008918918（全国）

39. 中泰证券有限公司（原齐鲁证券）

注册地址：济南市市中区经七路 86 号

法定代表人：李玮

客服电话：95538

网站：[www.qlzq.com.cn](http://www.qlzq.com.cn)

40. 浙商证券有限责任公司

地址：浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座 6-7 楼

法定代表人：吴承根

电话：(0571)87901963

联系人：吴颖

客服电话：0571-87902079

网址：[www.stocke.com](http://www.stocke.com)

41. 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

联系人：齐晓燕

客服电话：95536

网址：[www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

42. 华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

办公地址：深圳市深南大道 4011 号港中旅大厦 24 层  
法定代表人：吴万善  
电话：0755-82569143  
传真：0755-82492962  
联系人：孔晓君  
客服电话：95597  
网址：www.htsc.com.cn

43. 中信证券股份有限公司  
注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 A 层  
法定代表人：王东明  
电话：（0755）83073087  
传真：（0755）83073104  
联系人：陈忠  
网址：www.cs.ecitic.com

44. 信达证券股份有限公司  
注册地址：北京市西城区三里河东路 5 号中商大厦 10 层  
办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼信达金融中心  
法定代表人：张志刚  
联系人：唐静  
联系电话：010-63081000  
传真：010-63080978  
客服电话：400-800-8899  
公司网址：www.cindasc.com

45. 天相投资顾问有限公司  
注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701  
法定代表人：林义相  
客服电话：010-66045678  
网站：www.txsec.com 或 www.jjm.com.cn

46. 华福证券有限责任公司  
注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层  
办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7---10 层  
法定代表人：黄金琳  
联系人：张腾  
联系电话：0591-87383623  
业务传真：0591-87383610  
客服电话：0591-96326  
网址：www.hfzq.com.cn

47. 中国中投证券有限责任公司  
注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层 01、02、03、

05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23 单元

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层

法定代表人：龙增来

联系人：刘毅

联系电话：0755-82023442

传真：0755-82026539

客服电话：4006008008

网址：[www.cjis.cn](http://www.cjis.cn)

#### 48. 江海证券有限公司

注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人：孙名扬

联系人：徐世旺

联系电话：0451-82336863

传真：0451-82287211

客服电话：400-666-2288

网址：[www.jhzq.com.cn](http://www.jhzq.com.cn)

#### 49. 财富证券有限责任公司

注册地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼

办公地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼

法定代表人：周晖

联系人：郭磊

联系电话：0731-84403319

传真：0731-84403439

网址：[www.cfzq.com](http://www.cfzq.com)

#### 50. 方正证券股份有限公司

注册地址：湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

办公地址：湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

法定代表人：雷杰

联系人：彭博

联系电话：0731-85832343

传真：0731-85832214

客服电话：95571

网址：[www.foundersc.com](http://www.foundersc.com)

#### 51. 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：上海市浦东新区 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](http://www.ehowbuy.com)

52. 上海天天基金销售有限公司

注册地址: 上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼  
办公地址: 上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦  
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: 021-64385308  
网址: [www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

53. 深圳众禄基金销售有限公司

注册地址: 深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元  
办公地址: 深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元  
法定代表人: 薛峰  
客服电话: 4006-788-887  
联系人: 汤素娅  
电话: 0755-33227950  
传真: 0755-82080798  
网址: [www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn) 及 [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

54. 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  
联系人: 周瑾旻  
电话: 021-60897869、0571-28829790  
传真: 0571-26698533  
客服电话: 4000-766-123  
网址: [www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

55. 上海长量基金销售有限公司

注册地址: 上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室  
办公地址: 上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层  
法定代表人: 张跃伟  
联系人: 邱燕芳  
联系电话: 021-20691831  
传真: 021-20691861  
客服电话: 400-820-2899  
公司网站: [www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

56. 诺亚正行基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路 32 号 c 栋

法人代表：汪静波

客服电话：400-821-5399

联系人：曾传溢

联系电话：15521232169

网址：[www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com)

57. 北京展恒基金销售有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址：北京市朝阳区德胜门外华严北里 2 号民建大厦 6 层

法定代表人：闫振杰

客服电话：400 888 6661

联系人：张晶晶

电话：010--62020088--8105

传真：010--62020088--8802

地址：[www.myfund.com](http://www.myfund.com)

58. 包商银行股份有限公司

注册地址：内蒙古包头市青山区钢铁大街 6 号包商银行

办公地址：内蒙古包头市青山区钢铁大街 6 号包商银行

法定代表人：李镇西

客服电话：96016（内蒙、北京），967210（深圳、宁波），65558555（成都）

联系人：刘芳

电话：0472-5189051

传真：0472-5189057

网址：[www.bsb.com.cn](http://www.bsb.com.cn)

59. 和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

客服电话：400-920-0022

联系人：周轶

电话：021-20835789

传真：021-20835885

网址：[licaike.hexun.com](http://licaike.hexun.com)

60. 上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕙川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海市浦东新区东方路 989 号中达广场 201 室

法定代表人：盛大



客服电话：400-005-6355  
联系人：程毅  
电话：021-50583533  
传真：021-50583633  
网址：[www.leadfund.com.cn](http://www.leadfund.com.cn)

61. 万银财富（北京）基金销售有限公司  
注册地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 3201  
办公地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 3201  
法定代表人：李招弟  
客服电话：400-808-0069  
联系人：高晓芳  
电话：010-59393923  
传真：010-59393074  
网址：[www.wy-fund.com](http://www.wy-fund.com)

62. 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：浙江省杭州市余杭区五常街道同顺街 18 号同花顺大楼 4 层  
法定代表人：凌顺平  
联系电话：0571-88911818-8653  
传真：0571-86800423  
客服电话：4008-773-772  
公司网站：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

63. 晋商银行股份有限公司  
注册地址：山西省太原市万柏林区长风西街 1 号丽华大厦  
办公地址：山西省太原市万柏林区长风西街 1 号丽华大厦  
法定代表：阎俊生  
客服电话：95105588  
联系人：董嘉文  
电话：0351-6819926  
传真：0351-6819926  
网址：[www.jshbank.com](http://www.jshbank.com)

64. 北京增财基金销售有限公司  
注册地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208 室  
办公地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208-1209 室  
法定代表人：罗细安  
客服电话：400-001-8811  
联系人：孙晋峰  
电话：010-67000988  
传真：010-67000988-6000  
公司网址：[www.zcvc.com.cn](http://www.zcvc.com.cn)

65. 一路财富（北京）信息科技有限公司

注册地址：北京市西城区车公庄大街 9 号院 5 号楼 702（德胜园区）

办公地址：北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208

法定代表人：吴雪秀

客服电话：400-001-1566

联系人：卜石红

电话：010-88312877

传真：010-88312885

公司网址：[www.yilucaifu.com](http://www.yilucaifu.com)

66. 北京钱景财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

办公地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

法定代表人：赵荣春

客服电话：400-678-5095

联系人：魏争

电话：010-57418829

传真：010-57569671

公司网址：[www.niuji.net](http://www.niuji.net)

67. 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

办公地址：深圳市福田区福田街道民田路 178 号华融大厦 27 层 2704

法定代表人：杨懿

客服电话：400-166-1188

联系人：刘宝文

电话：0755-88394688

公司网址：[www.xinlande.com.cn](http://www.xinlande.com.cn)

68. 上海联泰基金销售有限公司

注册地址：上海市自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层

法定代表人：尹彬彬

客服电话：400-166-6788

联系人：兰敏

电话：0 21-52822063

传真：0 21-52975270

公司网址：[www.66liantai.com](http://www.66liantai.com)

69. 宜信普泽投资顾问（北京）有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C 座 1809 室

法定代表人：沈伟桦

客服电话：400-6099-200

联系人：宋欣晔

电话：010-52361860

传真 010-85894285

公司网址： [www.yixinfund.com](http://www.yixinfund.com)

70. 上海汇付金融服务有限公司

注册地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

办公地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

法定代表人：冯修敏

客服电话：400-820-2819

联系人：陈云卉

电话：021-33323999\*5611

传真：021-33323837

71. 阳光人寿保险股份有限公司

注册地址：海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层

办公地址：北京市朝阳区朝外大街乙 12 号 1 号楼昆泰国际大厦 12 层

法定代表人：李科

联系人：王超

传真：010-59053700

电话：010-59053660

客户服务电话：95510

公司网站：[fund.sinosig.com](http://fund.sinosig.com)

72. 上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 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 15 楼

法定代表人：王之光

客服电话：4008219031

联系人：宁博宇

电话：021-20665952

传真：021-22066653

网址：[www.lufunds.com](http://www.lufunds.com)

73. 北京百度百盈基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区上地十街 10 号 1 幢 1 层 101

办公地址：北京市海淀区信息路甲 9 号奎科大厦

法定代表人：张旭阳

联系电话：010-61952703

传真：010-61951007

联系人：杨琳

公司网站：[www.baiyingfund.com](http://www.baiyingfund.com)

74. 大泰金石基金销售有限公司

注册地址：南京市建邺区江东中路 359 号国睿大厦一号楼 B 区 4 楼 A506 室

办公地址：（上海）上海市长宁区虹桥路 1386 号文广大厦 15 楼

法定代表人：袁顾明

客服电话：021-22267995

联系人：何庭宇

电话：021-22267987

传真：021-22268089

网址：[www.dtfunds.com](http://www.dtfunds.com)

75. 北京虹点基金销售有限公司（原乐融多源）

注册地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元

办公地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元

法定代表人：郑毓栋

客服电话：400-618-0707

联系人：姜颖

电话：13522549431

传真：010-65951887

网址：[www.hongdianfund.com](http://www.hongdianfund.com)

76. 上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼

法定代表人：陈继武

客服电话：4000-178-000

联系人：李晓明

电话：021-63333319

传真：021-63332523

网址：[www.lingxianfund.com](http://www.lingxianfund.com)

77. 北京加和基金销售有限公司（原中经北证）

注册地址：北京市西城区金融大街 11 号 703 室

办公地址：北京市西城区金融大街 11 号 703 室

法定代表人：曲阳

联系人：王晨

联系电话：13811685981 010-50866170

传真电话：010-5086 6173

客服电话：400-803-1188

网址：[www.bzfunds.com](http://www.bzfunds.com)

78. 珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203

法定代表人：肖雯

客服电话：020-89629066

联系人：黄敏嫦

电话：020-89629099

传真：020-89629011

网址：[www.yingmi.cn](http://www.yingmi.cn)

#### 79. 广州证券股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层

办公地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层

法定代表人：邱三发

客服电话：020-961303

联系人：梁微

电话：020-88836999-5408

传真：020-88836920

网址：[www.gzs.com.cn](http://www.gzs.com.cn)

#### 80. 国金证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市青羊区东城根上街95号

办公地址：四川省成都市青羊区东城根上街95号

法定代表人：冉云

客服电话：4006600109

联系人：贾鹏

电话：028-86690058

传真：028-86690126

网址：[www.gjq.com.cn](http://www.gjq.com.cn)

#### 81. 联讯证券股份有限公司

注册地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼

办公地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼

法定代表人：徐刚

客服电话：95564

联系人：彭莲

电话：13480169928

传真：0572-2119391

公司网址：<http://www.lxsec.com>

#### 82. 海银基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区东方路1217号16楼B单元

办公地址：上海市浦东新区东方路1217号陆家嘴金融服务广场6楼

法定代表人：刘惠

联系人：毛林

传真：021-80133413

电话：021-80133597

客户服务电话：400-808-1016

公司网站: [www.fundhaiyin.com](http://www.fundhaiyin.com)

83. 和耕传承基金销售有限公司

注册地址: 郑州市郑东新区东风东路、康宁北街 6 号楼 6 楼

办公地址: 郑州市郑东新区东风东路、康宁北街 6 号楼 6 楼

法定代表人: 李淑慧

客服电话: 4000-555-671

联系人: 胡静华

网址: [www.hgccpb.com](http://www.hgccpb.com)

84. 南京苏宁基金销售有限公司

注册地址: 南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

办公地址: 南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表: 钱燕飞

联系人: 喻明明

传真: 025-66008800-884131

电话: 025-66996699-884131

客服电话: 95177

网址: [www.snjijin.com](http://www.snjijin.com)

85. 上海万得基金销售有限公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址: 上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼

法定代表人: 王廷富

联系人: 徐亚丹

传真: 021-5071-0161

电话: 021-5071-2782

客服电话: 400-821-0203

86. 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](http://list.jr.jd.com/fundlist/1-11-112.htm)

87. 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

法定代表人: 李福春

联系人: 安岩岩

联系电话：0431-85096517

客服电话：95360

公司网址：www.nesc.cn

88. 东兴证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层

办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层

法定代表人：魏庆华

联系人：汤漫川

电话：010-66555316

传真：010-66555133

客服电话：4008888993

网址：www.dxzq.net

89. 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

90. 江苏汇林保大基金销售有限公司

注册地址：南京市高淳区砖墙集镇78号

办公地址：江苏省南京市中山东路9号天时国际商贸大厦11楼E座

法定代表人：吴言林

客户服务电话：025-56663409

联系人：张宏鹤

传真：021-53086809

公司网址：www.huilinbd.com

91. 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：熊小满

电话：010-56251471

分机：无分机

传真：010-62680827

网址：www.hcjijin.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）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

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），6-7 层、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：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

负责人：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（特殊普通合伙）

注册地址：中国北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼（东三办公楼）16 层

办公地址：中国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：吴港平

电话：（021）22288888

传真：（021）22280000

联系人：蒋燕华

经办会计师：边卓群、蒋燕华

四、基金的名称：光大保德信量化核心证券投资基金

五、基金的类型：契约型开放式

六、基金的投资目标

追求长期持续稳定超出业绩比较基准的投资回报。

七、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增长潜力，股价处于合理区间的优质股票。



## 八、基金的投资策略

本基金借鉴了外方股东保德信投资的量化投资管理理念和长期经验，结合中国市场现行特点加以改进，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，采用自下而上与自上而下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/赎回的异常流动性需求，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，上述合理期限指 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优化保障体系构建处于或接近有效边际曲线的投资组合。该体系在构建投资组合时综合考量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；另一方面投资团队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多因素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相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个股预期收益率，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了公司基本面状况；趋势类指标说明股票现有估值是否能够持续；质量类指标判断是否存在暗示现行基本面趋势可能逆转的警戒信号。同时数量小组还将根据市场变化趋势定期或不定期地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，防御性行业及增长性行业，并根据行业动向和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，为投资组合优化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股价的潜在影响，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配比原则为核心，通过一定的量化技术综合考虑个股预期收益率，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参数设置并处于有效边际曲线上的投资组合，即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。如果由于股价波动等因素造成事前跟踪误差超出我们预先设定的风险区域，投资团队将在优化器中根据风险归因分析对边际风险贡献率最大的股票进行调整，以降低事前跟踪误差，使投资组合所承担的风险程度符合既定目标，并使风险尽量集中分布在投资

团队对该风险因素的把握具有高置信度的区域。

## 5. 权证的投资

### (1) 权证的投资策略

在控制投资风险和保障基金财产安全的前提下，本公司对权证进行积极主动投资，获取较高的投资组合收益水平。权证投资策略主要包括以下几个方面：

- A. 本公司主要采用 Black-Scholes 定价公式和二叉树模型对权证进行定价，并根据市场实际情况，调整权证定价模型及其参数，得到权证的理论价值，作为权证投资的价值基准。
- B. 权证价格的对于决定其风险因素的敏感度，本基金通过风险参数的形式进行衡量。
- C. 本基金通过权证与证券的组合投资，进行基金财产的止损保护。
- D. 本基金通过采取现金套利（Cash extraction）策略，兑现投资收益，保留未来获利空间。
- E. 同时，本基金还将采用二叉树模型对美式权证以及各类复杂型权证进行理论定价。
- F. 基金经理通过对理论价格和隐含波动率的合理性分析，基于对证券价格的未来表现和预期波动率变化的分析判断，主动投资于价值被市场低估的权证品种。

### (2) 权证的投资决策流程

#### A. 权证的投资研究过程

研究人员对于基础股票进行深入的调研和分析，并将结果通过量化模型，对股票进行估值；数量分析小组负责构建和维护权证定价模型，在股票估值的基础上，对于权证的价值进行分析。投资组合委员会在研究分析的基础上，结合基金的实际情况确定投资策略。风险分析小组则通过独立的系统，对权证的风险进行测算，在各种可能的情景下，对权证进行估价，从而确定权证的投资风险，为投资组合委员会的投资策略确定提供参考。

#### B. 权证的投资决策过程

##### a. 权证投资方案的制定

投资组合委员会在研究人员和数量分析人员的工作基础上，结合基金的实际情况确定投资方案。

##### b. 权证投资的授权和审批

凡单个品种累计投资额度不超过基金资产净值的千分之五（暂定）的权证投资，可由基金经理自主执行，并向投资总监备案。

凡单个品种累计投资额度超过基金资产净值的千分之五（暂定）的权证投资，由投资组合委员会向公司投资决策委员会申请审批。投资方案得到批准后，由基金经理在授权的范围内实施。

##### c. 投资计划调整

投资组合委员会根据市场变化、投资计划的实施情况和执行效果、投资分析报告（包括投资表现评估报告、风险分析报告）等，进一步分析判断，并据此进行调整。如果遇有重大变化需要修改投资方案，须按相应程序批准后方可实施。

## 九、基金的业绩比较标准

$90\% \times \text{沪深 300 指数} + 10\% \times \text{同业存款利率}$

## 十、基金的风险收益特征

本基金为股票型基金，其预期收益和风险高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。按照风险收益配比原则对投资组合进行严格的风险管理，在风险限制范围内追求收益最大化。

## 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 12 月 31 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 1,671,981,693.44 86.70  
 其中：股票 1,671,981,693.44 86.70  
 2 固定收益投资 --  
 其中：债券 --  
 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 --  
 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 255,858,920.13 13.27  
 7 其他各项资产 659,846.23 0.03  
 8 合计 1,928,500,459.80 100.00

## 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	--	
B	采矿业	102,746,729.30	5.42
C	制造业	569,017,023.52	30.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,601,215.00	0.82
E	建筑业	106,648,475.59	5.62
F	批发和零售业	64,189,820.25	3.39
G	交通运输、仓储和邮政业	39,534,526.64	2.08
H	住宿和餐饮业	--	
I	信息传输、软件和信息技术服务业	35,721,932.80	1.88
J	金融业	541,308,042.21	28.55
K	房地产业	126,600,410.33	6.68
L	租赁和商务服务业	25,339,680.00	1.34
M	科学研究和技术服务业	--	
N	水利、环境和公共设施管理业	--	
O	居民服务、修理和其他服务业	--	
P	教育	--	
Q	卫生和社会工作	41,012,377.80	2.16
R	文化、体育和娱乐业	4,261,460.00	0.22
S	综合	--	
	合计	1,671,981,693.44	88.18

## 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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

1	601398	工商银行	13,146,105	69,542,895.45	3.67
2	603288	海天味业	904,370	62,220,656.00	3.28
3	600585	海螺水泥	2,011,806	58,905,679.68	3.11
4	002142	宁波银行	3,518,691	57,073,168.02	3.01
5	000568	泸州老窖	1,385,011	56,314,547.26	2.97
6	002475	立讯精密	3,980,864	55,970,947.84	2.95
7	600016	民生银行	9,730,055	55,753,215.15	2.94
8	600383	金地集团	5,704,000	54,872,480.00	2.89
9	000001	平安银行	5,752,500	53,958,450.00	2.85
10	601998	中信银行	9,762,940	53,208,023.00	2.81

#### 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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投资股指期货。

##### 9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于股指期货。

#### 10、报告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

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

##### 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投资国债期货。

#### 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中，民生银行（600016）的发行主体于2018年12月7日收到中国银行保险监督管理委员会的行政处罚（银保监银罚决字（2018）5号和银保监银罚决字（2018）8号），具体内容为：

主要违法违规事实为：银保监银罚决字（2018）5号：贷款业务严重违反审慎经营规则。

银保监银罚决字（2018）8号：（一）内控管理严重违反审慎经营规则；（二）同业投资违规接受担保；（三）同业投资、理财资金违规投资房地产，用于缴交或置换土地出让金及土地储备融资；（四）本行理财产品之间风险隔离不到位；（五）个人理财资金违规投资；（六）票据代理未明示，增信未簿记和计提资本占用；（七）为非保本理财产品提供保本承诺。

行政处罚决定为：银保监银罚决字（2018）5号：罚款200万元。银保监银罚决字（2018）8号：罚款3160万元。

基金管理人按照内部研究工作规范对该股票进行分析后将其列入基金投资对象备选库并跟踪研究。该行政处罚事件发生后，基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

中信银行（601998）的发行主体于2018年12月7日收到中国银行保险监督管理委员会的行政处罚（银保监银罚决字（2018）14号），具体内容为：

主要违法违规事实为：（一）理财资金违规缴纳土地款；（二）自有资金融资违规缴纳土地款；（三）为非保本理财产品提供保本承诺；（四）本行信贷资金为理财产品提供融资；（五）收益权转让业务违规提供信用担保；（六）项目投资审核严重缺位。

行政处罚决定为：罚款2280万元。

基金管理人按照内部研究工作规范对该股票进行分析后将其列入基金投资对象备选库并跟踪研究。该行政处罚事件发生后，基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

报告期内本基金投资的前十名证券的其他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 本基金未投资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 536,099.03

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 47,733.71

5 应收申购款 76,013.49

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 659,846.23

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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

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

2004年 -5.44% 0.68% -2.45% 1.05% -2.99% -0.37%

2005 年 -7.36% 1.15% -7.11% 1.12% -0.25% 0.03%  
2006 年 122.98% 1.32% 111.41% 1.24% 11.57% 0.08%  
2007 年 155.61% 2.13% 127.74% 2.06% 27.87% 0.07%  
2008 年 -64.75% 2.95% -61.28% 2.71% -3.47% 0.24%  
2009 年 90.61% 1.93% 80.20% 1.84% 10.41% 0.09%  
2010 年 -3.20% 1.59% -10.67% 1.40% 7.47% 0.19%  
2011 年 -21.07% 1.28% -20.81% 1.16% -0.26% 0.12%  
2012 年 8.31% 1.19% 8.55% 1.12% -0.24% 0.07%  
2013 年 13.07% 1.35% -8.02% 1.26% 21.09% 0.09%  
2014 年 16.91% 1.06% 44.17% 1.09% -27.26% -0.03%  
2015 年 50.27% 2.56% 5.82% 2.24% 44.45% 0.32%  
2016 年 -6.74% 1.69% -9.95% 1.26% 3.21% 0.43%  
2017 年 -8.35% 0.76% 19.54% 0.57% -27.89% 0.19%  
2018 年 -27.42% 1.22% -22.89% 1.20% -4.53% 0.02%  
自基金合同生效至今 242.16% 1.68% 146.71% 1.54% 95.45% 0.14%

注：为更好地反映债券市场整体运行情况和本基金管理人旗下相关基金投资组合的运作情况，经与基金托管人中国光大银行股份有限公司协商一致，自 2014 年 4 月 1 日起，将本基金的业绩比较基准由原“90%×富时中国 A200 指数+10%×同业存款利率”变更为“90%×沪深 300 指数+10%×同业存款利率”。

## （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

光大保德信量化核心证券投资基金

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

(2004 年 8 月 27 日至 2018 年 12 月 31 日)

注：1、为更好地反映债券市场整体运行情况和本基金管理人旗下相关基金投资组合的运作情况，经与基金托管人中国光大银行股份有限公司协商一致，自 2014 年 4 月 1 日起，将本基金的业绩比较基准由原“90%×富时中国 A200 指数+10%×同业存款利率”变更为“90%×沪深 300 指数+10%×同业存款利率”。

2、根据基金合同的规定，本基金建仓期为 2004 年 8 月 27 日至 2005 年 2 月 26 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.基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。计算方法如下：

每日应付的基金管理费=前一日的基金资产净值×年管理费率÷当年天数

基金管理费每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，由基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

基金管理人可以降低基金管理费率，无须召开基金份额持有人大会通过。如降低基金管理费率，基金管理人最迟于新的费率开始实施前 2 日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。



## 2.基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

每日应付的基金托管费=前一日基金资产净值×年托管费率÷当年天数

基金托管费每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，由基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素协商酌情调低基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。如降低基金托管费率，基金管理人最迟于新的费率开始实施前2日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

### (二)与基金销售有关的费用

#### 1.申购费

本基金的申购费由申购人承担，不记入基金资产，用于基金的市场推广及销售等各项费用。

#### 2.赎回费

赎回费由赎回人承担，赎回费在扣除手续费及注册登记费后，余额部分全部归入基金资产，其中对持续持有期少于7日的投资者收取1.5%的赎回费，并将赎回费全额计入基金财产，其他情形下，赎回费归入基金资产的比例不得低于赎回费总额的25%。

#### 3.转换费

基金转换费用由转出和转入基金的申购费补差和转出基金的赎回费两部分构成，具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率和赎回费率的差异情况而定。基金转换费用由申请办理该项业务的基金投资者承担。具体公式如下：

##### (1) 转出金额：

转出金额=转出基金份额×转出基金当日基金单位资产净值

##### (2) 转换费用：

如果转入基金的申购费率) 转出基金的申购费率：

转换费用=转出金额×转出基金赎回费率+转出金额×(1-转出基金赎回费率)×转出基金与转入基金的申购费率差/(1+转出基金与转入基金的申购费率差)

如果转出基金的申购费率≥转入基金的申购费率：

转换费用=转出金额×转出基金赎回费率

各基金在转换过程中转出金额对应的转出基金或转入基金申购费用为固定费用时，则该基金计算补差费率时的转出基金的原申购费率或转入基金的申购费率视为0；

基金在完成转换后不连续计算持有期；

转出基金与转入基金的申购费率差为基金转换当日转出金额对应得转出基金和转入基金的申购费率之差。

具体赎回费率以及各基金申购费率差请参照相应的基金合同或相关公告。

##### (3) 转入金额与转入份额：

转入金额=转出金额-转换费用

转入份额=转入金额÷转入基金当日基金单位资产净值

4.经报中国证监会批准，基金管理人可以在上述范围内调整申购费率和赎回费率，并最迟于新费率开始实施前2日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上予以公告。如果调高申购或赎回费率，则须经基金份额持有人大会通过。

### (三)其他费用

其他费用包括证券交易费用；基金合同生效后的基金信息披露费用；基金份额持有人大会费用；基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费；按照国家有关规定可以列入的其他费用。上述费用由基金托管人根据其他有关法规及相关协议规定，按费用实际支出金额列入当期基金费用，由基金托管人从基金资产中支付。

基金合同生效前的会计师费、律师费、信息披露费用，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资产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

#### 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“三、基金管理人”部分，根据实际情况进行了更新。
3. 在“四、基金托管人”部分，根据实际情况进行了更新。
4. 在“五、相关服务机构”部分，根据实际情况进行了更新。
5. 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。
6. 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 12 月 31 日。
7. 将“十、基金的业绩”部分将数据更新至 2018 年 12 月 31 日。
8. 在“二十二、其他应披露事项”部分，对 2018 年 8 月 27 日至 2019 年 2 月 26 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

二〇一九年四月十一日