

光大保德信基金管理有限公司光大保德信优势配置股票型证券投资基金变更基金类型并相应修订基金合同部分条款的公告

根据 2014 年 8 月 8 日实行的《公开募集证券投资基金运作管理办法》（证监会令第 104 号）第三十条第一项的规定，股票基金的股票资产投资比例下限由 60% 上调至 80%。光大保德信基金管理有限公司（以下简称“我司”或“公司”）现经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，决定自 2015 年 7 月 17 日起将光大保德信优势配置股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）变更为混合型证券投资基金，基金合同中的相关条款亦做相应修订。现将修订内容公告如下：

一、将本基金原合同全文中“光大保德信优势配置股票型证券投资基金”修改为“光大保德信优势配置混合型证券投资基金”。

二、对本基金原合同全文中“二、释义”的修改

将“《运作办法》：指《证券投资基金运作管理办法》”修改为：“《运作办法》：指《公开募集证券投资基金运作管理办法》”

三、对本基金原基金合同“三、基金的基本情况”的修改

“（二）基金的类别  
股票型证券投资基金”

修改为：

“（二）基金的类别  
混合型证券投资基金”。

四、对本基金原合同“五、基金备案”的修改

“（五）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

本基金合同生效后，基金份额持有人数量不满两百人，或基金资产净值低于人民币五千万元的，基金管理人应当及时向中国证监会报告；连续二十个工作日基金份额持有人数量不满两百人，或基金资产净值低于人民币五千万元的，基金管理人应当及时向中国证监会报告，说明出现上述情况的原因以及解决方案；连续六十个工作日基金份额持有人数量不满两百人或基金资产净值低于人民币五千万元的，基金管理人有权依据法律法规及合同规定的程序宣布终止本基金合同，并组织基金财产清算组对基金财产进行清算，清算报告报中国证监会备案并公告。法律法规另有规定的，从其规定办理。”

修改为：

“（五）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

本基金合同生效后,连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满两百人或基金资产净值低于人民币五千万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露。连续六十个工作日出现前述情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规或监管机构另有规定时,从其规定。”

五、对本基金原合同“八、基金份额持有人大会”的修改

“（六）议事内容与程序”项下，

“2、议事程序

（1）现场开会

在现场开会的情况下，首先由召集人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议，报经中国证监会核准或备案后生效。”

修改为

“（1）现场开会

在现场开会的情况下，首先由召集人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议，决议自表决通过之日起生效。”

“（2）通讯开会

在通讯开会的情况下，召集人公告会议通知时应当同时公布提案，在所通知的表决截止日期第二个工作日在公证机构的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议，报经中国证监会核准或备案后生效。”

修改为：

“（2）通讯开会

在通讯开会的情况下，召集人公告会议通知时应当同时公布提案，在所通知的表决截止日期第二个工作日在公证机构的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议，决议自表决通过之日起生效。”

“（七）决议形成的条件和表决”项下，“（2）特别决议”中

“转换基金运作方式、更换基金管理人、更换基金托管人、提前终止基金合同等重大事项必须以特别决议通过方为有效”

修改为：

“转换基金运作方式、更换基金管理人、更换基金托管人、提前终止基金合同、本基金与其他基金合并等重大事项必须以特别决议通过方为有效”

“（九）生效与公告”项下

“1、基金份额持有人大会表决通过的事项，召集人应当自通过之日起五日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效；”

修改为：

“1、基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效；基金份额持有人大会表决通过的事项，召集人应当自通过之日起五日内报中国证监会备案；”。

六、对本基金原合同“九、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序”的修改

“（一）基金管理人和基金托管人的更换条件”项下，

“1、有下列情形之一的，经中国证监会核准，基金管理人职责终止”修改为：“1、有下列情形之一的，基金管理人职责终止”

“2、有下列情形之一的，经中国证监会核准，基金托管人职责终止”修改为：“2、有下列情形之一的，基金托管人职责终止”。

“（二）基金管理人和基金托管人的更换程序”项下，“1、基金管理人的更换程序”中，

“（3）核准：上述基金份额持有人大会决议自通过之日起五日内，由大会召集人报中国证监会核准”修改为：“（3）备案：上述基金份额持有人大会更换基金管理人的决议须报中国证监会备案”；

“（6）公告：基金管理人更换后，由基金托管人在获得中国证监会核准后两日内公告”修改为：“（6）公告：基金托管人在更换基金管理人的基金份额持有人大会决议生效后两日内公告”。

“2、基金托管人的更换程序”中，

“（3）核准：上述基金份额持有人大会决议自通过之日起五日内，由大会召集人报中国证监会核准”修改为：“（3）备案：上述基金份额持有人大会更换基金托管人的决议须报中国证监会备案”

“（6）公告：基金托管人更换后，由基金管理人在获得中国证监会核准后两日内公告”修改为：“（6）公告：基金托管人更换后，由基金管理人在获得中国证监会核准后两日内公告”

“3、基金管理人和基金托管人同时更换”项下，

“（3）公告：新任基金管理人和新任基金托管人在获得中国证监会核准后两日内在指

定媒体上联合公告”修改为：“（3）公告：新任基金管理人和新任基金托管人应在更换基金管理人和基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后两日内在指定媒体上联合公告”

#### 七、对本基金原合同“十二、基金的投资”的修改

“（三）投资范围”中“本基金为股票型基金”修改为“本基金为混合型基金”

“（六）风险收益特征”中“本基金为主动操作的股票型证券投资基金”修改为“本基金为主动操作的混合型证券投资基金”

“（八）投资限制”项下，

“1、基金持有一家上市公司的股票市值不得超过本基金资产净值的 10%”修改为：“1、基金持有一家公司发行的证券，其市值不得超过本基金资产净值的 10%”；增加“6、基金总资产不得超过基金净资产的百分之一百四十”，并调整后续序号；“9、因证券市场变化、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合第 1、2、4、5 项规定的比例或者基金合同约定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内调整完毕。”修改为：“9、本基金投资运作不得违反基金合同关于投资策略的约定；因证券市场变化、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合第 1、2、4、5、6 项规定的比例或者基金合同约定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内调整完毕，但中国证监会规定的特殊情形除外。”

#### 八、对本基金原合同“十三、基金的财产”的修改

“（三）基金财产的账户

本基金以基金名义开立银行存款账户，以基金托管人的名义开立基金托管专户和证券交易资金结算账户用于基金的资金结算业务，并以基金托管人和“光大保德信优势配置股票型证券投资基金”联名的方式开立基金证券账户、以“光大保德信优势配置股票型证券投资基金”的名义开立银行间债券托管账户，并报中国证监会备案。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金注册登记人自有的资产账户以及其他基金财产账户相独立。”

修改为：

“（三）基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。如账户名称需变更，则变更完成前沿用原有账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金注册登记人自有的资产账户以及其他基

金财产账户相独立。”

## 九、对本基金原合同“十四、基金资产的估值”的修改

### “（三）估值方法

#### 1、股票估值方法

（1）上市流通股股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。

#### （2）未上市股票的估值

1) 首次公开发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2) 送股、转增股、配股和公开增发新股等方式发行的股票，按估值日证券交易所上市的同一种股票的市价进行估值。

3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日证券交易所上市的同一种股票的市价进行估值。

#### 4) 非公开发行有明确锁定期的股票按如下方法进行估值：

①估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票初始取得成本时，应采用在证券交易所上市交易的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

②估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票初始取得成本时应按下列公式确定估值日该非公开发行股票的价值：

$$FV=C+(P-C)\times(DI-Dr)/DI$$
 (FV 为估值日该非公开发行股票的价值；C 为该非公开发行股票的初始取得成本（因权益业务导致市场价格除权时，应于除权日对其初始取得的成本作相应调整）；P 为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价；DI 为该非公开发行股票锁定期所含的交易所的交易天数；Dr 为估值日剩余锁定期，即估值日至锁定期结束所含的交易所的交易天数，不含估值日当天)。

#### （3）国家有最新规定的，按其规定进行估值。

#### 2、债券估值办法

（1）在证券交易所市场挂牌交易的实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值

日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。

(2) 在证券交易所市场挂牌交易的未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值，估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日债券收盘价减去所含的最近交易日债券应收利息后的净价进行估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价（净价）及重大变化因素，调整最近交易日收盘价（净价），确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价（净价）不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价(净价)进行调整，确定公允价值进行估值。

(3) 首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(4) 在银行间债券市场交易的债券根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。

(5) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

### 3、权证估值方法

(1) 上市流通权证按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。

(2) 首次发行未上市的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(3) 停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

(4) 因持有股票而享有的配股权证，以配股除权日起到配股确认日止，若收盘价高于配股价，则按收盘价和配股价的差额进行估值，若收盘价低于配股价，则估值为零。

(5) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

### 4、资产支持证券的估值方法

(1) 交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估

值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(2) 全国银行间市场交易的资产支持证券，根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。

(3) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

#### 5、其他资产的估值方法

其他资产按国家有关规定进行估值。”

修改为：

### “（三）估值方法

#### 1、证券交易所上市的非固定收益品种的估值

交易所上市的非固定收益品种（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

#### 2、交易所市场交易的固定收益品种的估值

(1) 对在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

(2) 对在交易所市场上市交易的可转换债券，按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含债券应收利息后得到的净价进行估值；

(3) 对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

3、银行间市场交易的固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

(2) 首次公开发行未上市的股票和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的

同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值；

(4) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

(5) 对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，按成本估值。

6、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

7、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。”

“（六）基金份额净值的确认

基金份额净值是按照每个开放日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第四第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。”

修改为：

“（六）基金份额净值的确认

基金份额净值是按照每个开放日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。”

“（七）估值错误的处理”项下，

“4、特殊情形的处理

基金管理人或基金托管人按股票与权证估值方法的第（5）项或债券估值方法的第（5）项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。”

修改为：

“4、特殊情形的处理

基金管理人或基金托管人按估值方法的第（4）项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。”

十、对本基金原文合同“十五、基金的费用与税收”的修改

“（二）基金费用计提方式、计提标准和支付方式”项下“1、基金管理人的管理费”中

“基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付，由基金管理人于次月首日起三个工作日内向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人在收到计算结果当日完成复

核，并于当日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。”

修改为

“基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前3个工作日内从基金财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。”

“2、基金托管人的托管费”中“基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付，由基金管理人于次月首日起三个工作日内向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人在收到计算结果当日完成复核，并于当日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。”

修改为：

“基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。”

十一、对本基金原文合同“十八、基金的信息披露”的修改

“（六）基金份额持有人大会决议”项下，

“基金份额持有人大会按照《基金法》的规定表决通过的事项，召集人应当自通过之日起五日内报中国证监会核准或者备案”修改为：“基金份额持有人大会按照《基金法》的规定表决通过的事项，召集人应当自通过之日起五日内报中国证监会备案”

十二、对原文合同“十九、基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的修改

“（一）基金合同的变更”项下，

“变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。”

修改为：

“变更基金合同的基金份额持有人大会决议须报中国证监会备案，自表决通过之日起生效，并自决议生效后两日内公告。”

“（二）基金合同的终止”项下，

“有下列情形之一的，经中国证监会批准后，基金合同将终止”修改为：“有下列情形之一的，在履行相关程序后，基金合同将终止”

此外，本公司根据上述修订及实际情况对本基金基金合同“一、前言”、“二、释义”、“十四、基金资产的估值”及“二十五、基金合同摘要”中相关内容进行了更新。本基金《托管协议》涉及前述内容的章节也将同时修改；本公司将在更新的《光大保德信优势配置混合型证券投资基金招募说明书》中，对上述内容进行相应修改。

投资者可拨打光大保德信基金管理有限公司客户服务电话：021-53524620，400-820-2888，或登录公司网站 [www.epf.com.cn](http://www.epf.com.cn)，了解详情。

特此公告。

光大保德信基金管理有限公司

二〇一五年七月十七日