

(上接B27版)

办公地址：北京市朝阳区朝外大街20号联合大厦701A室
 法定代表人：李科
 联系人：王延本
 电话：010-85332773
 传真：010-59053633
 电话：010-59053633
 客户服务热线：95510
 官方网站：fund.sinooc.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。销售机构将根据实际情况增加或减少其销售机构（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L6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（即3区3楼），6-7层、10层

法定代表人：林晶
 电话：(021) 80620888
 传真：(021) 80620483
 联系人：杨静
 (四) 律师事务所和经办律师
 名称：国浩律师集团(上海)事务所
 注册地址：上海市南京西路580号南汇大厦45、46层
 办公地址：上海市南京西路580号南汇大厦45、46层
 负责人：倪俊霞
 电话：(021) 35216468
 传真：(021) 35207690
 联系人：霍佳佳
 经办律师：霍佳佳、孙静

(五) 会计师事务所(或审计)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：中国北京东城区东长安街1号东方广场东三座办公楼A座(三办)16层
 办公地址：上海市世纪大道100号环球金融中心50楼
 法定代表人：吴港平
 电话：021-22288888
 传真：021-22288000

联系人：蒋蔚琦
 经办会计师：徐海、蒋燕华
四、基金的投资目标
四、基金的投资目标
 光大保德信中小盘混合型证券投资基金
五、基金的投资范围
 基金管理人可投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票、债券、资产支持证券、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

基金管理人可投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票、债券、资产支持证券、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。基金资产组合中股票资产的比例范围为50%-60%，投资于中小企业资产的比例范围为0%-30%，本基金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，但现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；本基金投资于中小盘上市公司股票占股票资产的比例不低于80%。

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层面的数据进行分析，并通过对定性定量分析、风险测算及组合优化，最终形成资产配置决策。

首先，建立宏观指标监测体系。本基金将通过分析宏观经济运行的各项指标及证券市场指标，以求把握宏观经济形势的未来走向和节奏，进而为本基金的资产配置提供依据。

其次，建立宏观经济运行指标主要特征。本基金将通过对宏观经济运行指标的主要特征进行分析，包括GDP、CPI、PPI、PMI、规模以上工业企业增加值及利润和失业率等，投资者将据此及其变化等。

其次，对上述指标与各类资产收益率数据进行相关性分析，把握其联系及规律。本基金将运用光大保德信内部开发的定性定量分析模型，将上述宏观经济指标（包括经济基本面及证券市场两个方面）的历史数据及各类资产收益率历史数据进行相关性分析及回归分析，确定各类资产收益率与各类宏观经济指标和成分之间的影响模式，包括关联方向及关联度等方面。

再次，通过风险测算及组合优化，形成最终资产配置决策。本基金在确立上述宏观经济指标和证券市场指标与各类资产预期收益率的影响模式后，再结合对上述宏观经济指标的分析预测，运用金融工程的各类资产风险测算及优化，最终确定各大类资产的配置比例。

2. 股票投资策略
 本基金将主要投资于具备高成长性或者潜力的中小盘上市公司股票，以求获取高成长带来的资本增值回报，其中成长型股票资产不低于80%投资于中小盘股票。

(1) 中小盘上市公司的定义
 本基金所指中小盘上市公司是指以下三类上市公司：
 1) 在深圳创业板上市的公司；
 2) 在创业板上市的公司；
 3) 在沪深证券交易所主板上市，按股票总市值从小到大排序并相加得到累计总市值达到主板总市值40%的上市公司。

(2) 本基金将采用“自下而上”的策略精选中小盘个股。具体说来，本基金将通过以下定量及定性两个层面进行中小盘公司价值的挖掘：
 1) 本基金将利用光大保德信中小企业价值评估模型对中小盘上市公司的价值进行初步排序。

光大保德信中小企业价值评估模型着重考察以下几个并行进行量化赋值：
 ①中小企业市盈率(P/E)，包括市盈率及预测未来两年的动态市盈率；
 ②上市公司基本面指标：
 A. 盈利质量指标：主营业务收入增长率(Δs)、盈利增长率(ΔE)；
 B. 财务质量指标：财务杠杆(A/E)；
 C. 经营效率指标：股权回报率(ROE)。

首先，市盈率是模型最重要的考察指标。本基金非常重视以合理的价格买入中小盘的高成长，故选用该指标作为价值评估模型的首要考察指标；其次，加入基本面指标以控制投资风险。本基金非常重视以合理的价格买入中小盘的高成长，故选用该指标作为价值评估模型的首要考察指标；其次，加入基本面指标以控制投资风险。本基金非常重视以合理的价格买入中小盘的高成长，故选用该指标作为价值评估模型的首要考察指标；其次，加入基本面指标以控制投资风险。

同时，中小企业相对于大型企业的财务风险更大，模型构建了上述财务质量指标以控制中小企业的财务风险。此外，经营效率指标也将纳入模型以区分中小企业的经营效率差异。主营业务收入增长率和盈利增长率数据采用未来两年盈利预测数据；其余指标采用上市公司披露的最近一个年度数据。

②同时，我们将从定性的角度对中小上市公司的价值进行进一步挖掘。具体来说，本基金将着重从以下几个方面挖掘具有成长性或者潜力的中小上市公司：
 ①处于行业生命周期早期或上升阶段
 ②中国是世界上最大的新兴市场国家，现有的产业规划布局不尽合理，政府着眼于长期可持续发展的目标，已经出台了并还将出台众多引导“产业发展方向”的新政策、新规划。

本基金已经挖掘出那些在新兴产业中赢得先机，并且经过企业初创阶段的考验，已经具备相对较为成熟的生产机制和风险抵御能力的中小上市公司。对于还未完全符合国家政策，但本基金判断也处于行业生命周期上升阶段，且公司治理规范、管理优秀、技术创新能力强、产品品质过硬的优质上市公司，本基金也将对其进行重点投资。

拥有较好的技术应用前景
 科技创新始终是促进现代社会不断进步的强大力量，中国已经涌现了众多科技创新型企业，随着技术进步的叠加效应增强，制度环境的逐步完善以及资本市场的不完善，中国必将涌现更多此类企业。

本基金将着重选取技术创新能力较强的上市公司，且其技术在应用的广度或深度上具有较大潜力的公司。从广度上主要考察该技术是否具有多个行业应用或多个行业，从产业链的某个环节上考察整个链条，从多限制制到少限制制的应用等，从而可以判断其业务增长潜力；从深度上考察该技术是否具有高的进入壁垒，操作的精细化程度及效果等方面，从而判断其业务增长的被认可度和持续性。

③传统的商业模式
 商业模式创新带来巨大的商机，本基金将针对创新商业模式的可复制性、可持续性、盈利性等角度对具有独特商业模式的中上市公司进行评估，选取那些具备领先优势、高利润、高成长性、管理团队优秀的上市公司。

④主导区域/细分市场
 某些中小上市公司虽然处在传统产业或者产业周期的成熟阶段，但它们在区域市场或细分行业中具有较强的竞争能力和发展潜力。区域龙头企业往往在地区实力、区域文化认同、市场营销等方面具有突出的竞争力，而细分市场龙头公司拥有该细分领域的优先入场、上下游资源优越或者低成本等，投资于该类上市公司也将为本基金带来稳健的回报。

⑤并购、重组逻辑
 中小企业天然具备并购重组的良好标的，本基金也将从行业竞争者、产业链结构等方面入手，结合本公司的信息优势对具备并购、重组预期的中小企业进行投资，在承担一定风险的前提下获取超额回报。

⑥其他
 未来出现不属于或者不完全属于上述五个层面的业务驱动因素时，本基金亦将及时纳入研究范围，并选择在流动性因素下最具成长性的上市公司进行投资。

(3) 在完成中小盘上市公司定量及定性两个方面的基本分析后，进行投资组合构建时，本基金将把握宏观经济周期性运行规律的基础上，分析市场形态变化以及未来各个行业的发展趋势，运用金融工程方法，合理调整投资组合行业行业的配置。同时，本基金还将定期采用行业偏差度和跟踪误差指标对投资组合的行业配置及风险进行控制。

(4) 在完成行业配置的优化及风险控制后，本基金还将充分考察上市公司的流动性及股价历史波动情况，利用金融工程工具对整个投资组合的行业收益及分散化程度，予以积极的优化，降低组合的整体风险敞口。

(5) 在每个股的买卖策略上，本基金将结合动量策略的研究，力争把握股票交易的买卖时机，从而增强本基金的投资收益。动量策略主要研究上市公司公开股价变化、历史成交量、换手率等指标以分析股价涨跌与成交量变化的规律，通过分析股价变化的规律，判断个股未来阶段性投资或者减持，从而优化本投资组合在低位买入上市公司的买入时机及对估值已经反映投资价值或者优势的中小公司的卖出时机。

3. 固定收益类品种投资策略
 本基金固定收益类品种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、市场收益率变动情况、市场流动性状况来调整债券市场整体配置趋势，同时结合各具体品种的供需情况、流动性、信用风险和利率敏感程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。

在宏观分析、期限选择方面，本基金将结合宏观经济的各个要素，主要包括宏观经济运行态势、货币政策取向、市场利率变动情况等，通过对宏观经济形势、利率政策、货币政策、利率传导、信用风险和流动性分析，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。

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各个市场的成交情况，对各个目标投资对象进行利差分析，包括信用风险、流动性风险、利率调整利差(OAS)等，并利用利率模型对品种进行模拟预测，选出定价合理或被低估、到期期限与投资组合构建要求相匹配的固定收益品种。

(1) 类属资产配置策略
 对类属资产配置进行决策的主要依据是对不同债券资产收益与风险的估计和判断。我们基于对未来的宏观经济利率环境的研究和预测，根据国债、金融债等不同品种的信用利率变动情况以及各品种的市场容量和流动性情况，通过比较分析的方法，判断各债券资产类属的相对期限，在不同债券品种之间进行配置。具体考量指标包括收益分析、利率、信用风险和流动性分析，以此确定各类资产的相对收益和风险因素，并以此进行投资组合判断依据。

(2) 组合久期调整策略
 在确定了组合的整体久期后，组合将基于对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进行情景分析，从而根据非同步性的收益率变动情况，在长期、中期和短期债券间进行配置，以期在收益与风险调整的过程中获得较好收益。

(3) 信用利差策略
 随着债券市场的发展，企业债和公司债的发行将快速中小盘企业大批优质企业

在交易所或者银行间市场发行债券。在这种情况下，本基金将通过对宏观经济周期、发行主体信用评级和市场利率分析等判断，加强对企业债、资产抵押债券等新品种的投资，并通过对信用利差的分析和管理，获取超额收益。

(4) 利率套利策略
 目前国内的债券市场分交易所和银行间两个投资市场，其与主体、资金量、交易频率等方面均存在较大的差异，本基金将关注银行间市场和交易所市场之间的利率波动情况，以捕捉跨市场的套利机会。

4. 权证及其他品种投资策略
 本基金在权证投资方面对标的证券的价格将进行跟踪，结合期权定价量化模型和投资价值，主要考虑运用的策略有：价值投资策略、杠杆策略、双向投资策略、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，如股指期货、期权等衍生品等，本基金如有有利于基金进行风险管理和组合优化的，可依据法律法规的有关规定进行适当操作后，运用金融衍生产品进行投资风险管理。

本基金管理人将以构建投资组合合法合规为原则，根据证券市场实际情况对上述投资策略及投资组合构建进行非实质性的调整，此类变更不需要经过基金份额持有人大会通过。

九、基金的业绩比较标准
 本基金的业绩比较基准为75%×中证700指数收益率+25%×中证全债指数收益率。

十、基金的风险收益特征
 本基金为混合型基金，主要具有较高成长性或者潜力的中小盘上市公司股票为投资对象，其预期收益和风险高于平均水平的证券市场。

十一、基金的投资组合报告
 本基金投资组合报告截止日期2019年5月31日。
 1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	567,078,996.71	89.92
2	固定收益投资	567,078,996.71	89.92
3	金融资产投资	28,617,055.80	4.54
4	买入返售金融资产	--	--
5	其他资产	--	--
6	银行存款和结算备付金	19,422,152.80	3.11
7	其他各项资产	15,633,207.93	2.43
8	合计	630,641,413.24	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	--	--
B	采矿业	48,966,695.40	7.95
C	制造业	356,466,917.58	57.90
D	电力、热力、燃气及生产供应业	--	--
E	建筑业	--	--
F	批发零售业	13,601,690.00	2.21
G	交通运输、仓储和邮政业	--	--
H	住宿餐饮业	--	--
I	信息技术、软件和信息技术服务业	139,394,270.73	22.64
J	房地产业	134,330.00	0.02
K	金融业	--	--
L	租赁和商务服务业	--	--
M	科学研究和技术服务业	8,515,080.00	1.38
N	水利、环境和公共设施管理业	--	--
O	医药制造业、医药和医疗器械业	--	--
P	教育	--	--
Q	卫生和社工作	--	--
R	文化、体育和娱乐业	--	--
S	综合	--	--
合计		567,078,996.71	92.11

3. 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	603986	燕尾高湿	499,383	50,732,318.97	8.24
2	000666	山东铝业	48,966,695	48,966,695.40	7.95
3	600886	国联环保	1,277,741	41,520,190.98	7.60
4	002230	科大讯飞	1,182,363	42,009,947.67	6.97
5	600491	沪兴电力	2,693,553	41,920,914.36	6.81
6	600063	中兴通讯	1,148,498	41,423,140.16	6.73
7	600319	中钢国际	648,881	39,966,422.68	6.35
8	300369	绿盟科技	1,788,522	24,438,758.32	3.91
9	300253	宁波银行	1,558,340	23,722,856.00	3.80
10	002371	北方创业	320,340	22,577,947.00	3.67

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	国债债券	3,213,714.00	0.52
2	央行票据	--	--
3	金融债	24,420,441.80	3.97
4	其中：政策性金融债	24,420,441.80	3.97
5	企业债	--	--
6	中期票据	--	--
7	可转债(含可交换债)	982,900.00	0.16
8	同业存单	--	--
9	其他	--	--
10	合计	28,617,055.80	4.65

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	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	19国开02	2,999,999.99	0.48
2	19国开03	2,999,999.99	0.48
3	19国开04	2,999,999.99	0.48
4	19国开05	2,999,999.99	0.48
5	19国开06	2,999,999.99	0.48

2月及2017年11月)，HL CORPUSA 董事(2004年10月迄今)，深圳信康科技有限公司董事(2004年11月迄今)，信康实业(香港)有限公司董事(2004年11月迄今)，信康健康产业发展有限公司董事(2005年4月至2017年11月)，福成车辆(昆山)科技有限公司董事(2008年4月至2013年9月)，天津信康实业有限公司董事(2010年3月迄今)，信康汽车工业股份有限公司监事(1976年10月迄今)，MAYWOOD HOLDINGS LTD 董事长(2002年1月迄今)，信康健康产业(大连)有限公司董事(2013年1月迄今)，WATFORD INC 董事长(2008年1月迄今)，信康健康产业(大连)有限公司董事(2015年6月迄今)，Best Motion Limited 董事(2018年1月19日迄今)，武汉兴源材料科技有限公司董事(2018年8月27日迄今)，信友实业(越南)有限责任公司董事长(2018年9月25日迄今)。

廖学湖先生从事行业内部技术研发30多年，管理企业生产技术研发与导入，产品设计研发等工作，开展及ERP管理建设、IT系统升级改造、KPI绩效考核管理系统的建设、实施、运行。

廖学湖先生不存在以下情形：(1)《公司法》第一百四十六条规定的情形之一；(2)被中国证监会采取证券市场禁入措施；(3)被证券交易所公开认定为不适合担任上市公司董事、监事和高级管理人员；(4)最近三年内未受到中国证监会行政处罚；(5)最近三年内未受到证券交易所公开谴责或两次以上通报批评；(6)因涉嫌违法犯罪被司法机关立案侦查或者涉嫌违法违规被中国证监会立案调查。

廖学湖先生为公司控股股东“利田发展有限公司”股东“MAYWOOD HOLDINGS LTD.”的实际控制人，与持有公司5%以上股份的股东FERNANDO CORPORATION 无关联关系。陈丽秋女士与现任公司董事长陈女士为同母异父姐妹，陈女士为廖学湖先生之母亲，与现任董事长陈女士为父女关系；与现任公司董事廖学湖先生之父亲陈先生，与现任董事廖学湖先生为父子关系。

廖学湖先生直接持有公司股份8.9437%，其本人未直接持有公司股份。
 廖学湖先生于2019年6月7日，中国国籍，籍贯台湾，大学本科学历金融系毕业，曾任美国通用电气公司信用风险管理，上海商业保理银行国际业务经理，旭子有限公司总经理助理，2000年进入本公司，历任从事手工业部门销售经理，现任本公司资深副总经理、财务总监。

廖学湖先生持有公司股份，未在公司股东、实际控制人等单位担任任何职务，与公司控股股东、实际控制人、其他持有公司5%以上股份的股东及实际控制人不存在关联关系，亦不存在持有公司股份146股的情形。不存在被中国证监会认定为不适合担任上市公司董事、监事和高级管理人员；最近三年内未受到中国证监会行政处罚；最近三年内未受到证券交易所公开谴责或两次以上通报批评；不存在因涉嫌违法犯罪被司法机关立案侦查或者涉嫌违法违规被中国证监会立案调查的情况。

陈丽秋女士，出生于1956年11月，中国国籍，籍贯台湾，大学本科经济系毕业，曾任隆兴汽车零部件股份有限公司业务副经理、总经理助理，信康实业(深圳)有限公司国外业务部经理，现任本公司资深副总经理、董事会秘书、HL CORPUSA 董事，与公司控股股东、实际控制人、其他持有公司5%以上股份的股东及实际控制人不存在关联关系，亦不存在持有公司股份146股的情形。不存在被中国证监会认定为不适合担任上市公司董事、监事和高级管理人员；最近三年内未受到中国证监会行政处罚；最近三年内未受到证券交易所公开谴责或两次以上通报批评；不存在因涉嫌违法犯罪被司法机关立案侦查或者涉嫌违法违规被中国证监会立案调查的情况。

陈丽秋女士具备良好的管理、财务、金融、计算机应用等专业知识，具有良好的职业道德和职业操守，参加过证券交易所培训，经考核合格取得《董事会秘书资格证书》。
 周奕夫先生，1980年11月，中国国籍，籍贯江苏，山东大学工商管理专业本科学历，曾任深圳鹏源会计师事务所审计三部审计主任、项目经理，2008年进入本公司，现任本公司会计部副经理、财务负责人。

周奕夫先生持有公司股份5%以上，与公司控股股东、实际控制人不存在关联关系，亦不存在持有公司股份146股的情形。不存在被中国证监会认定为不适合担任上市公司董事、监事和高级管理人员；最近三年内未受到中国证监会行政处罚；最近三年内未受到证券交易所公开谴责或两次以上通报批评；不存在因涉嫌违法犯罪被司法机关立案侦查或者涉嫌违法违规被中国证监会立案调查的情况。

周奕夫先生持有公司股份，未在公司股东、实际控制人等单位担任任何职务，与公司控股股东、实际控制人、其他持有公司5%以上股份的股东及实际控制人不存在关联关系，亦不存在持有公司股份146股的情形。不存在被中国证监会认定为不适合担任上市公司董事、监事和高级管理人员；最近三年内未受到中国证监会行政处罚；最近三年内未受到证券交易所公开谴责或两次以上通报批评；不存在因涉嫌违法犯罪被司法机关立案侦查或者涉嫌违法违规被中国证监会立案调查的情况。

周奕夫先生持有公司股份，未在公司股东、实际控制人等单位担任任何职务，与公司控股股东、实际控制人、其他持有公司5%以上股份的股东及实际控制人不存在关联关系，亦不存在持有公司股份146股的情形。不存在被中国证监会认定为不适合担任上市公司董事、监事和高级管理人员；最近三年内未受到中国证监会行政处罚；最近三年内未受到证券交易所公开谴责或两次以上通报批评；不存在因涉嫌违法犯罪被司法机关立案侦查或者涉嫌违法违规被中国证监会立案调查的情况。

周奕夫先生持有公司股份，未在公司股东、实际控制人等单位担任任何职务，与公司控股股东、实际控制人、其他持有公司5%以上股份的股东及实际控制人不存在关联关系，亦不存在持有公司股份146股的情形。不存在被中国证监会认定为不适合担任上市公司董事、监事和高级管理人员；最近三年内未受到中国证监会行政处罚；最近三年内未受到证券交易所公开谴责或两次以上通报批评；不存在因涉嫌违法犯罪被司法机关立案侦查或者涉嫌违法违规被中国证监会立案调查的情况。

周奕夫先生持有公司股份，未在公司股东、实际控制人等单位担任任何职务，与公司控股股东、实际控制人、其他持有公司5%以上股份的股东及实际控制人不存在关联关系，亦不存在持有公司股份146股的情形。不存在被中国证监会认定为不适合担任上市公司董事、监事和高级管理人员；最近三年内未受到中国证监会行政处罚；最近三年内未受到证券交易所公开谴责或两次以上通报批评；不存在因涉嫌违法犯罪被司法机关立案侦查或者涉嫌违法违规被中国证监会立案调查的情况。

周奕夫先生持有公司股份，未在公司股东、实际控制人等单位担任任何职务，与公司控股股东、实际控制人、其他持有公司5%以上股份的股东及实际控制人不存在关联关系，亦不存在持有公司股份146股的情形。不存在被中国证监会认定为不适合担任上市公司董事、监事和高级管理人员；最近三年内未受到中国证监会行政处罚；最近三年内未受到证券交易所公开谴责或两次以上通报批评；不存在因涉嫌违法犯罪被司法机关立案侦查或者涉嫌违法违规被中国证监会立案调查的情况。

周奕夫先生持有公司股份，未在公司股东、实际控制人等单位担任任何职务，与公司控股股东、实际控制人、其他持有公司5%以上股份的股东及实际控制人不存在关联关系，亦不存在持有公司股份146股的情形。不存在被中国证监会认定为不适合担任上市公司董事、监事和高级管理人员；最近三年内未受到中国证监会行政处罚；最近三年内未受到证券交易所公开谴责或两次以上通报批评；不存在因涉嫌违法犯罪被司法机关立案侦查或者涉嫌违法违规被中国证监会立案调查的情况。

周奕夫先生持有公司股份，未在公司股东、实际控制人等单位担任任何职务，与公司控股股东、实际控制人、其他持有公司5%以上股份的股东及实际控制人不存在关联关系，亦不存在持有公司股份146股的情形。不存在被中国证监会认定为不适合担任上市公司董事、监事和高级管理人员；最近三年内未受到中国证监会行政处罚；最近三年内未受到证券交易所公开谴责或两次以上通报批评；不存在因涉嫌违法犯罪被司法机关立案侦查或者涉嫌违法违规被中国证监会立案调查的情况。

周奕夫先生持有公司股份，未在公司股东、实际控制人等单位担任任何职务，与公司控股股东、实际控制人、其他持有公司5%以上股份的股东及实际控制人不存在关联关系，亦不存在持有公司股份146股的情形。不存在被中国证监会认定为不适合担任上市公司董事、监事和高级管理人员；最近三年内未受到中国证监会行政处罚；最近三年内未受到证券交易所公开谴责或两次以上通报批评；不存在因涉嫌违法犯罪被司法机关立案侦查或者涉嫌违法违规被中国证监会立案调查的情况。

周奕夫先生持有公司股份，未在公司股东、实际控制人等单位担任任何职务，与公司控股股东、实际控制人、其他持有公司5%以上股份的股东及实际控制人不存在关联关系，亦不存在持有公司股份146股的情形。不存在被中国证监会认定为不适合担任上市公司董事、监事和高级管理人员；最近三年内未受到中国证监会行政处罚；最近三年内未受到证券交易所公开谴责或两次以上通报批评；不存在因涉嫌违法犯罪被司法机关立案侦查或者涉嫌违法违规被中国证监会立案调查的情况。

周奕夫先生持有公司股份，未在公司股东、实际控制人等单位担任任何职务，与公司控股股东、实际控制人、其他持有公司5%以上股份的股东及实际控制人不存在关联关系，亦不存在持有公司股份146股的情形。不存在被中国证监会认定为不适合担任上市公司董事、监事和高级管理人员；最近三年内未受到中国证监会行政处罚；最近三年内未受到证券交易所公开谴责或两次以上通报批评；不存在因涉嫌违法犯罪被司法机关立案侦查或者涉嫌违法违规被中国证监会立案调查的情况。

在交易所或者银行间市场发行债券。在这种情况下，本基金将通过对宏观经济周期、发行主体信用评级和市场利率分析等判断，加强对企业债、资产抵押债券等新品种的投资，并通过对信用利差的分析和管理，获取超额收益。

(4) 利率套利策略
 目前国内的债券市场分交易所和银行间两个投资市场，其与主体、资金量、交易频率等方面均存在较大的差异，本基金将关注银行间市场和交易所市场之间的利率波动情况，以捕捉跨市场的套利机会。

4. 权证及其他品种投资策略
 本基金在权证投资方面对标的证券的价格将进行跟踪，结合期权定价量化模型和投资价值，主要考虑运用的策略有：价值投资策略、杠杆策略、双向投资策略、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，如股指期货、期权等衍生品等，本基金如有有利于基金进行风险管理和组合优化的，可依据法律法规的有关规定进行适当操作后，运用金融衍生产品进行投资风险管理。

本基金管理人将以构建投资组合合法合规为原则，根据证券市场实际情况对上述投资策略及投资组合构建进行非实质性的调整，此类变更不需要经过基金份额持有人大会通过。

九、基金的业绩比较标准
 本基金的业绩比较基准为75%×中证700指数收益率+25%×中证全债指数收益率。

十、基金的风险收益特征
 本基金为混合型基金，主要具有较高成长性或者潜力的中小盘上市公司股票为投资对象，其预期收益和风险高于平均水平的证券市场。

十一、基金的投资组合报告
 本基金投资组合报告截止日期2019年5月31日。
 1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	567,078,996.71	89.92
2	固定收益投资	567,078,996.71	89.92
3	金融资产投资	28,617,055.80	4.54
4	买入返售金融资产	--	--
5	其他资产	--	--
6	银行存款和结算备付金	19,422,152.80	3.11
7	其他各项资产	15,633,207.93	2.43
8	合计	630,641,413.24	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	--	--
B	采矿业	48,966,695.40	7.95
C	制造业	356,466,917.58	57.90
D	电力、热力、燃气及生产供应业	--	--
E	建筑业	--	--
F	批发零售业	13,601,690.00	2.21
G	交通运输、仓储和邮政业	--	--