

光大保德信中小盘混合型证券投资基金 招募说明书摘要（更新）

光大保德信中小盘股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）于2010年1月20日经中国证券监督管理委员会证监基金字2010[98]号文核准公开募集。本基金份额于2010年3月8日至4月9日发售，本基金合同于2010年4月14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，投资人申购基金时应认真阅读招募说明书、基金产品资料概要。基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金产品资料概要编制、披露与更新要求，自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。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《基金法》、《运作办法》、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。

本基金本次招募说明书的更新涉及《光大保德信中小盘混合型证券投资基金基金合同》和《光大保德信中小盘混合型证券投资基金托管协议》变更的相关内容部分、基金管理人部分、相关服务机构部分、基金份额的申购与赎回部分以及风险揭示部分，更新截止至2019年12月31日，其余所载内容截止日为2019年4月13日，有关财务数据和净值表现截止日为2019年3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

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。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。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。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。

俞大伟先生，董事，同济大学工商管理硕士。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，光大期货有限公司常务副总经理、总经理。现任光大期货有限公司董事、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（亚洲）。

孔伟先生，独立董事，甘肃政法学院法律系法学学士学位。曾任职于甘肃省经济律师事务所、史密夫律师行（伦敦、香港）、外立综合法律事务所、上海市瑛明律师事务所。现任北京市中伦（上海）律师事务所上海分所管理合伙人、中微半导体设备（上海）股份有限公司董事、通用环球医疗集团有限公司董事。

郭荣丽女士，独立董事，东北财经大学博士。曾任东北财经大学讲师，招商银行总行会计部副总经理、招商银行南山支行行长、招商银行总行会计部总经理，渤海银行董事、首席财务官，中国银联党委委员、首席财务官兼银联商务股份有限公司董事长。现任上海通华金科投资控股有限公司总裁、通联支付网络服务股份有限公司董事、上海通联金融服务有限公司董事。

王永钦先生，独立董事，复旦大学经济学博士、耶鲁大学博士后、哈佛大学富布赖特高级访问学者。曾任职山东日照纺织抽纱进出口集团公司、山东日照比特集团出口部经理、复旦大学经济学院讲师、副教授。现任复旦大学绿庭新兴金融业态研究中心主任、经济学院 985 平台副主任。

胡雅丽女士，董事，武汉大学硕士。曾任职招商证券股份有限公司家电行业分析师，中信证券股份有限公司家电行业首席分析师、MD、新三板市场首席分析师，光大证券股份有限公司研究所常务副所长。现任光大证券股份有限公司研究所所长。

2、监事会成员

陈浒先生，监事长，华东师范大学工理学士、工学硕士，美国宾夕法尼亚大学沃顿商学院 MBA。历任陆家嘴（集团）有限公司业务经理，上海市浦东新区金融服务局局长助理，光大证券股份有限公司战略发展部总经理、结构化融资部总经理。现任光大发展投资有限公司总经理。

吴庚辉先生，监事，曼尼托巴大学理学硕士。历任加拿大永明金融集团精算总监，美国国际集团国际团险管理部副总精算师，美国保德信金融集团集团副总裁兼总精算师、全球资产管理高级投资副总裁、全球审计部高级副总裁。现任美国保德信金融集团全球战略规划董事总经理。

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、风险管理部副总监，现任风险管理部总监。

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、督察长兼风险管理部总监，现任本基金管理人副总经理兼子公司执行董事。

盛松先生，北京大学硕士，中国国籍。曾就职于中国科学院空间技术中心科

利华有限公司，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月至2014年8月担任督察长，2018年3月至2019年11月兼任公司量化投资部总监。现任本基金管理人副总经理、首席投资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、首席运营总监兼首席信息官。

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，平安资产管理有限公司固定收益部投资经理，平安养老保险股份有限公司固收投资总监兼固定收益部总经理、年金投资决策委员会委员、年金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，2017年9月至2019年3月担任专户投资经理。现任本基金管理人副总经理兼固定收益投资总监。

管江女士，上海财经大学财务管理专业学士。历任普华永道（中天）会计师事务所金融组高级审计师。2006年11月加入光大保德信基金管理有限公司，先后担任监察稽核高级经理、监察稽核部副总监。现任本基金管理人督察长、董事会秘书兼监察稽核部总监。

4、本基金基金经理

历任基金经理：

袁宏隆先生，担任本基金基金经理时间为2010年4月14日至2011年4月25日。

李阳先生，担任本基金基金经理时间为2010年7月22日至2013年5月20日。

现任基金经理：

戴奇雷先生，1995年毕业于华中理工大学生物医学工程专业，1998年获得华中理工大学生物技术专业硕士学位，2002年获得中欧国际工商学院工商管理

专业硕士学位。2002年11月至2004年4月在上海融昌资产管理有限公司先后担任行业研究员、研究总监助理；2004年5月至2006年5月在广州金骏资产管理有限公司先后担任研究副总监、研究总监；2006年6月至2010年4月在诺德基金管理有限公司先后担任行业研究员、基金经理助理、投资研究部经理、基金经理；2010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、光大保德信优势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兼固定收益投资总监。

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、光大保德信优势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

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO., LTD

法定代表人：彭纯

住 所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号

办公地址：中国（上海）长宁区仙霞路18号

邮政编码：200336

注册时间：1987年3月30日

注册资本：742.63亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25号

联系人：陆志俊

电话：95559

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

联系人：董云巍

联系人电话：010-58560666

客服热线：95568

网址：www.cmbc.com.cn

2. 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

联系人：刘芳

联系人电话：0472-5189051

客服热线：96016（内蒙、北京），967210（深圳、宁波），65558555（成都）

网址：www.bsb.com.cn

3. 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

联系人电话：010-66223587

传真：010-66226045

客服热线：95526

网址：www.bankofbeijing.com.cn

4. 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

联系人：谭少筠

联系人电话：0769-22118343

客服热线：0769-961122

网址：www.drcbank.com

5. 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

客服热线：4008-308-003

网址：www.cgbchina.com.cn

6. 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

客服热线：95577

网址：www.hxb.com.cn

7. 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

联系人：王菁

联系人电话：021-58781234

传真：021-58408483

客服热线：95559

网址：www.bankcomm.com

8. 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

法定代表人：阎俊生

联系人：董嘉文

联系人电话：0351-6819926

传真：0351-6819926

客服热线：95105588

网址：www.jshbank.com

9. 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

联系人：王军

联系人电话：0379-65921977

客服热线：96699

网址：www.bankofluoyang.com.cn

10. 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

联系人：胡技勋

联系人电话：0574-89068340

客服热线：96528

网址：www.nbcb.com.cn

11. 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

客服热线：95511-3

网址：www.pingan.com

12. 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

联系人：吴海平

联系人电话：021-38576969

客服热线：021-962999

网址：www.srcb.com

13. 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

联系人：倪苏云

联系人电话：(021) 61618888

客服热线：95528

网址：www.spdb.com.cn

14. 上海银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

法定代表人：范一飞

联系人：张萍

联系人电话：021-68475888

客服热线：021-962888

网址：www.bankofshanghai.com

15. 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

联系人：刘玲

联系人电话：(021) 52629999

客服热线：95561

网址：www.cib.com.cn

16. 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

联系人：邓炯鹏

联系人电话：0755-83198888

传真：0755-83195109

客服热线：95555

网址：www.cmbchina.com

17. 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

联系人：董晓岚

联系人电话：0571-87117617

客服热线：4008-096-527/0571-96527

网址：www.czcb.com.cn

18. 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

法定代表人：陈四清

联系人：郭明

联系人电话：010-66105799

客服热线：95588

网址：www.icbc.com.cn

19. 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

联系人：朱红

客服热线：95595

网址：www.cebbank.com

20. 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：田国立

客服热线：95533

网址：www.ccb.com

21. 中国农业银行股份有限公司

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

联系人：贺倩

联系人电话：010-66060069

传真：010-68121816

客服热线：010-66060069

网址：www.abchina.com

22. 中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：刘连舸

客服热线：95566

网址：www.boc.cn

23. 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

联系人：陈春林

传真：010-68858117

客服热线：95580

网址：www.psbc.com

24. 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：李庆萍

联系人：丰靖

客服热线：95558

网址：bank.ecitic.com

25. 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路1508号

办公地址：上海市静安区新闻路1508号

法定代表人：周健男

联系人：何耀

联系人电话：021-22169999

传真：021-22169134

客服热线：95525

网址：www.ebscn.com

26. 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

联系人：刘婧漪、贾鹏

联系人电话：028-86690057、028-86690058

传真：028-86690126

客服热线：4006-600-109/95310

网址：www.gjq.com.cn

27. 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 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：杨德红

联系人：芮敏祺

联系人电话：021-38676666

传真：021-38670666

客服热线：95521

网址：www.gtja.com

28. 信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

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：尹旭航

联系人电话：010-63081000

传真：010-63081344

客服热线：95321

网址：www.cindasc.com

29. 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

法定代表人：张佑君

联系人电话：（0755）83073087

传真：(0755) 83073104

客服热线：95548

网址：www.cs.ecitic.com

30. 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

联系人电话：0731-84403319

传真：0731-84403439

客服热线：0731-84403360

网址：www.cfzq.com

31. 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

联系人电话：0431-85096517

传真：95360

客服热线：95360

网址：www.nesc.cn

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 22 层、23 层、25 层-29 层

办公地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 13 层、21 层-23 层、25-29 层、32 层、36 层、39 层、40 层

法定代表人：潘鑫军

联系人：孔亚楠

联系人电话：021-63325888

传真：021-63326729

客服热线：95503

网址：www.dfzq.com.cn

33. 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

联系人电话：010-66555316

传真：010-66555133

客服热线：95309

网址：www.dxzq.net

34. 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

联系人电话：0731-85832343

传真：0731-85832214

客服热线：95571

网址：www.foundersc.com

35. 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

传真：(020) 87555305

客服热线：95575

网址：www.gf.com.cn

36. 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：胡伏云

联系人：梁微

联系人电话：020-88836999-5408

传真：020-88836920

客服热线：020-961303

网址：www.gzs.com.cn

37. 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 1010 号国际信托大厦 21 楼

法定代表人：何如

联系人：李颖

联系人电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

客服热线：95536

网址：www.guosen.com.cn

38. 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

联系人：李飞

联系人电话：0551-2246298

传真：0551-2272100

客服热线：4008-888-777

网址：www.gyzq.com.cn

39. 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：周杰

联系人：金芸

联系人电话：021-23219000

传真：021-23219100

客服热线：95553/4008-888-001

网址：www.htsec.com

40. 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

联系人电话：0591-87383623

传真：0591-87383610

客服热线：0591-96326

网址：www.hfzq.com.cn

41. 华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场

法定代表人：周易

联系人：庞晓芸

联系人电话：0755-82492193

传真：0755-82492962

客服热线：95597

网址：www.htsc.com.cn

42. 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

联系人电话：0451-82336863

传真：0451-82287211

客服热线：400-666-2288

网址：www.jhzq.com.cn

43. 平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层

办公地址：深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层

法定代表人：何之江

联系人：周驰

联系人电话：021-38637436

传真：021-58991896

客服热线：95511-8

网址：stock.pingan.com

44. 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

法定代表人：李俊杰

联系人：邵珍珍

联系人电话：021-53686888

客服热线：4008-918-918

网址：www.shzq.com

45. 申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦
20 楼 2005 室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦
20 楼 2005 室

法定代表人：韩志谦

联系人：王怀春

联系人电话：010-88085858

传真：010-88085195

客服热线：400-800-0562

网址：www.hysec.com

46. 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：陈飙

联系人电话：021-33389888

传真：021-33388224

客服热线：4008-895-523/021 新市区) 北京南网址：www.swhysc.com

47. 西藏东方财富证券股份有限公司

注册地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座东方财富大厦

法定代表人：陈宏

联系人：付佳

客服热线：95357

网址：<http://www.18.cn>

48. 湘财证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

法定代表人：孙永祥

联系人：李欣

联系人电话：021-38784580-8918

传真：021-68865680

客服热线：95351

网址：www.xcsc.com

49. 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号证券大厦

办公地址：福州市湖东路 268 号证券大厦

法定代表人：兰荣

联系人：夏中苏

联系人电话：(0591) 38281963

客服热线：95562

网址：www.xyzq.com.cn

50. 粤开证券股份有限公司

注册地址：惠州市江北东江三路 55 号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、
四层

办公地址：深圳市福田区深南中路 2002 号中广核大厦北楼 10 层

法定代表人：严亦斌

联系人：彭莲

联系人电话：0755-83331195

客服热线：95564

网址：<http://www.ykzq.com>

51. 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 地址：层

法定代表人：霍达

联系人：黄婵君

联系人电话：0755-82960167

传真：0755-83734343

客服热线：4008-888-111/95565

网址：www.newone.com.cn

52. 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 2-6 层

办公地址：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：陈共炎

联系人：辛国政

联系人电话：010-83574507

传真：010-66568990

客服热线：400-888-8888/95551

网址：www.chinastock.com.cn

53. 中国中金财富证券有限公司

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：高涛

联系人：刘毅

联系人电话：0755-82023442

传真：0755-82026539

客服热线：4006-008-008

网址：www.china-invs.cn

54. 中泰证券股份有限公司

注册地址：济南市市中区经七路 86 号

法定代表人：李玮

客服热线：95538

网址：www.qlzq.com.cn

55. 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

联系人：权唐

联系人电话：(010) 85130588

传真：(010) 65182261

客服热线：400-8888-108

网址：www.csc108.com

56. 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 1 号楼 2001

办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层

法定代表人：姜晓林

联系人：刘晓明

联系人电话：0531—89606165

传真：暂无

客服热线：95548

网址：www.zxwt.com.cn

57. 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

58. 珠海盈米基金销售有限公司

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

联系人：邱湘湘

联系人电话：020-89629099

传真：020-89629011

客服热线：020-89629066

网址：www.yingmi.cn

59. 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

联系人：杨琳

联系人电话：010-61952703

传真：010-61951007

客服热线：95055-4

网址：www.baiyingfund.com

60. 北京虹点基金销售有限公司

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

联系人：姜颖

联系人电话：13522549431

传真：010-65951887

客服热线：400-618-0707

网址：www.hongdianfund.com

61. 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

联系人：熊小满

联系人电话：010-56251471

传真：010-62680827

客服热线：400-619-9059

网址: www.hcjjjin.com

62. 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

联系人电话: 89188000

传真: 13141319110

客服热线: 400-098-8511

网址: list.jr.jd.com/fundlist/1-11-112.htm

63. 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

联系人: 魏争

联系人电话: 010-57418829

传真: 010-57569671

客服热线: 400-678-5095

网址: www.niuji.net

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

联系人: 孙晋峰

联系人电话: 010-67000988

传真: 010-67000988-6000

客服热线：400-001-8811

网址：www.zcvc.com.cn

65. 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

联系人：张晶晶

联系人电话：010--62020088--8105

传真：010--62020088--8802

客服热线：400-888-6661

网址：www.myfund.com

66. 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

联系人：何庭宇

联系人电话：021-22267987

传真：021-22268089

客服热线：021-22267995

网址：www.dtfunds.com

67. 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

联系人电话：021-80133597

传真：021-80133413

客服热线：400-808-1016

网址：www.fundhaiyin.com

68. 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

联系人：胡静华

客服热线：4000-555-671

网址：www.hgccpb.com

69. 和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区大街22号泛利大厦10层

办公地址：北京市朝阳区大街22号泛利大厦10层

法定代表人：王莉

联系人：周轶

联系人电话：021-20835789

传真：021-20835885

客服热线：400-920-0022

网址：licaikexun.com

70. 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：南京市鼓楼区中山北路2号绿地紫峰大厦2005室

法定代表人：吴言林

联系人：张宏鹤

传真：021-53086809

客服热线：025-66046166

网址: www.huilinbd.com

71. 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: 周嫵旻

联系人电话: 021-60897869、0571-28829790

传真: 0571-26698533

客服热线: 4000-766-123

网址: www.fund123.cn

72. 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

法定代表人: 钱燕飞

联系人: 喻明明

联系人电话: 025-66008800-884131

传真: 025-66996699-884131

客服热线: 95177

网址: www.snjijin.com

73. 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

法定代表人: 汪静波

联系人: 曾传溢

联系人电话: 15521232169

客服热线: 400-821-5399

网址: www.noah-fund.com

74. 浦领基金销售有限公司

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

联系人: 高晓芳

联系人电话: 010-59393923

传真: 010-59393074

客服热线: 400-012-5899

网址: www.zscffund.com

75. 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

联系人电话: 021-20691831

传真: 021-20691861

客服热线: 400-089-1289

网址: www.erichfund.com

76. 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

联系人: 张茹

联系人电话: 021-58870011

传真: 021-68596919

客服热线：400-700-9665

网址：www.ehowbuy.com

77. 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

联系人：陈云卉

联系人电话：021-33323999*5611

传真：021-33323837

客服热线：400-820-2819

网址：<http://fund.bundtrade.com>

78. 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

联系人电话：021-65370077

传真：021-55085991

客服热线：4008-205-369

网址：www.jiyufund.com.cn

79. 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

联系人：李晓明

联系人电话：021-63333319
传真：021-63332523
客服热线：4000-178-000
网址：www.lingxianfund.com

80. 上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路 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
联系人：程毅
联系人电话：021-50583533
传真：021-50583633
客服热线：400-005-6355
网址：www.leadfund.com.cn

81. 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
联系人：兰敏
联系人电话：021-52822063
传真：021-52975270
客服热线：400-118-1188
网址：www.66liantai.com

82. 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

联系人：宁博宇
联系人电话：021-20665952
传真：021-22066653
客服热线：4008-219-031
网址：www.lufunds.com

83. 上海陆享基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区南汇新城镇环湖西二路 888 号 1 幢 1 区 14032 室
办公地址：上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇二座 16 层
法定代表人：陈志英
联系人：韦巍
联系人电话：021-53398816
传真：021-53398801
客服热线：021-53398816
网址：www.luxxfund.com

84. 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
联系人：潘世友
联系人电话：021-54509988 分机：7019
传真：021-64385308
客服热线：400-1818-188
网址：www.1234567.com.cn

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
联系人电话：021-5071-2782
传真：021-5071-0161
客服热线：400-821-0203
网址：<http://www.520fund.com.cn>

86. 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
联系人：刘宝文
联系人电话：0755-88394688
客服热线：400-166-1188
网址：www.xinlande.com.cn

87. 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
联系人：汤素娅
联系人电话：0755-33227950
传真：0755-82080798
客服热线：4006-788-887
网址：www.zlfund.cn

88. 腾安基金销售（深圳）有限公司

注册地址：广东省深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室
办公地址：深圳市南山区海天二路 33 号腾讯滨海大厦 15 楼

法定代表人：刘明军
联系人：赵晨
联系人电话：18621730132
客服热线：95017
网址：www.tenganxinxi.com

89. 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
客服热线：010-66045678
网址：www.txsec.com

90. 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 20 号联合大厦 701A 室
法定代表人：李科
联系人：王超
联系人电话：010-59053660
传真：010-8563277
客服热线：95510
网址：fund.sinosig.com

91. 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
联系人：卜石红
联系人电话：010-88312877
传真：010-88312885

客服热线：400-001-1566

网址：www.yilucaifu.com

92. 宜信普泽（北京）基金销售有限公司

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

联系人：宋欣晔

联系人电话：010-52361860

传真：010-85894285

客服热线：400-6099-200

网址：www.yixinfund.com

93. 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

联系人电话：0571-88911818-8653

传真：0571-86800423

客服热线：4008-773-772

网址：www.5ifund.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，并在基金管理人网站公示。销售机构可以根据情况变化增加或减少其销售城市（网点）。

（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：国浩律师集团(上海)事务所

注册地址：上海市南京西路 580 号南证大厦 45、46 层

办公地址：上海市南京西路 580 号南证大厦 45、46 层

负责人：倪俊骥

电话：(021) 52341668

传真：(021) 62676960

联系人：宣伟华

经办律师：宣伟华、孙翀

(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：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：021-22280000

联系人：蒋燕华

经办会计师：徐艳、蒋燕华

四、基金的名称： 光大保德信中小盘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

本基金通过深入挖掘具有高成长特性或者潜力的中小盘上市公司股票，以求获取基金资产的长期增值。

七、基金的投资方向

本基金可投资于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、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。

本基金为混合型基金，股票资产占基金资产的比例范围为 60%–95%，其他资产占基金资产的比例范围为 5%–40%，权证资产占基金资产净值的比例范围为 0–3%，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者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；本基金投资于中小盘上市公司的股票占股票资产的比例不得低于 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。

首先，建立宏观指标监测体系。

本基金将通过资产配置小组，严密跟踪分析反映宏观经济运行的各项指标及证券市场层面的指标，以求把握整个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决策提供支持。

具体来说，宏观经济运行指标主要包括：

(1) 宏观经济先行指标，如狭义货币供应量(M1)、广义货币供应量(M2)、财政预算、制造业采购经理指数(PMI)、大宗商品库存及价格变化等；

(2) 宏观经济状态指标，如 GDP、CPI、PPI、规模以上工业企业增加值及利润和失业率等。

证券市场指标主要包括：

(1) 股票市场：估值水平及历史估值波动区间、资金供求状况、成交量及换手率等、投资者结构数据及其变化等；

(2) 债券市场：债券收益率水平、收益率曲线历史变动、流动性和资金供求状况等。

其次，对上述数据与大类资产收益率数据进行分析研究，把握其联系及规律。

本基金将运用光大保德信内部的定性和定量分析模型，将上述宏观指标（包括经济基本面及证券市场两个方面）的历史数据及大类资产收益率历史数据进行对比分析及量化回归分析，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，形成最终大类资产配置决策。

本基金在确立上述宏观经济指标和证券市场指标对各类资产预期收益率的影响模式后，再结合对上述宏观指标的分析预测，运用金融工程的大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特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，其中基金投资的股票资产中至少 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) 在深圳中小板上市的公司；
- 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的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。具体来说，本基金将通过以下定量及定性两个层面进行中小上市公司价值的挖掘：

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方面并进行量化赋权：

①中小企业公司市盈率（P/E），包括静态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. 盈利能力指标：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企业的高成长，故选用该指标作为价值评估模型的首要控制指标；

其次，加入基本面指标以控制所投资上市公司的经营风险。

具体来说，主营业务收入及盈利的边际增长率对于提升中小企业的价值非常重要，故模型加入了盈利能力指标以控制投资标的的盈利能力；

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，经营效率指标也将进入模型以区分中小企业的经营效率的差异。

主营业务收入增长率和盈利增长率增长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季度末的数据。

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拥有高成长特性或潜力的中小上市公司：

①处于行业生命周期早期或者上升阶段

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目标，已经出台了并且还将出台众多引导产业发展方向的新政策、新规划。

本基金即将挖掘那些在新兴产业发展中赢得先机，并且经受住企业初创阶段的考验，已经具备相对较为成熟的运作机制和风险抵御能力的中小企业。

对于虽未受国家政策扶植，但本基金判断也处于行业生命周期上升阶段，且公司治理规范透明、管理优秀、企业创新能力强、产品需求比较广泛的上市公司，本基金也将对其进行投资。

②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益的增强，制度环境的逐步改善以及资本供给的不断充实，中国必将涌现更多此类公司。

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备从单个行业拓展

到多个行业，从产业链的某个环节衍生至整个链条，从多限制性到少限制性的应用等，从而可以判断其业务增长潜能；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可认可度和持续性。

③独特的商业模式

商业模式的创新将带来巨大的商机。本基金将从创新商业模式的复制性，可持续性、可盈利性等角度对具有独特商业模式的中小上市公司进行评估，选取那些具备先发优势，盈利的可持续性较强，管理团队优秀的上市公司。

④主导区域/细分领域

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者细分行业中具有较强的竞争能力和发展能力。区域龙头企业往往在股东实力、区域文化认同、市场营销等方面具有突出的竞争力，而细分领域的龙头公司拥有该细分领域的先入优势、上下游资源优势或者低成本等。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、重组潜力

中小企业天然就是并购重组的优良标的。本基金也将从行业竞争者，产业链结构方面入手，结合本公司的信息优势对具备较强并购、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，本基金亦将其及时纳入研究范围，并选择在驱动因素下最具成长潜力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面分析，进行投资组合构建时，本基金将在把握宏观经济周期性运行规律的基础上，分析市场形势变化以及未来各个行业的发展趋势，运用金融工程方法，合理调整投资组合在行业间的配置。同时，本基金还将定期采用行业偏离度和跟踪误差指标对组合的行业配置风险进行控制。

(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性，利用金融工程工具进行整个投资组合的风险/收益优化及分散化投资，力图以最优的价格，承担最优的风险获得最优的回报。

(5) 在个股的买卖策略上，本基金将结合动量策略的研究，力争把握股票较佳的买卖时机，从而增强本基金的投资收益。动量策略主要研究上市公司股价

变化、历史成交量、换手率等指标以求把握股价涨跌与成交量变化的规律，通过分析量价的配合情况，判断个股未来阶段性运行趋势，从而强化本基金对价值低估上市公司的买入时机及对估值已经反映投资价值或者高估的上市公司的卖出时机。

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，同时结合各具体品种的供需情况、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。

在组合的久期选择方面，本基金将综合分析宏观面的各个要素，主要包括宏观经济所处周期、货币财政政策取向、市场流动性变动情况等，通过对各宏观变量的分析，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个券的市场成交情况，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。

（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类收益与风险的估计和判断。我们基于对未来的宏观经济和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差变动情况，以及各品种的市场容量和流动性情况，通过情景分析的方法，判断各个债券资产类属的预期回报，在不同债券品种之间进行配置。具体考量指标包括收益率分析、利差分析、信用等级分析和流动性分析，以此确定各类属资产的相对收益和风险因素，并以此进行投资判断依据。

（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模拟模型，对未来的收益率曲线移动进行情景分析，从而根据不同期限的收益率变动情况，在长期、中期和短期债券间进行配置，以期在收益率曲线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发展，我们预计大批优质企业将在交易所或者银行间市场发行债券。在这种情况下，本基金将通过对行业经济周期、发行主体内外部评级和市场利差分析等判断，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) 跨市场套利投资策略

目前我国的债券市场分成交易所和银行间两个投资市场，其参与主体、资金量、交易模式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差波动情况，以博取跨市场的套利机会。

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，如股指期货、期权等衍生品等，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。

本基金管理人可以依据维护投资人合法权益的原则，根据证券市场实际情况对上述投资策略及投资组合构建流程进行非实质性的调整，此类变更不需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 $75\% \times \text{中证 700 指数收益率} + 25\% \times \text{中证全债指数收益率}$ 。

十、基金的风险收益特征

本基金为混合型基金，主要以具有高成长特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债券型基金及货币市场基金。

十一、基金的投资组合报告

本投资组合报告所载数据截止 2019 年 3 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	567,078,996.71	89.92
	其中：股票	567,078,996.71	89.92
2	固定收益投资	28,617,055.80	4.54
	其中：债券	28,617,055.80	4.54
	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	19,622,152.80	3.11
7	其他各项资产	15,343,207.93	2.43
8	合计	630,661,413.24	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、渔业	-	-
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、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	13,601,690.00	2.21
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	139,394,270.73	22.64
J	金融业	134,343.00	0.02
K	房地产业	-	-
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	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	-	-
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	603986	兆易创新	499,383	50,732,318.97	8.24
2	600547	山东黄金	1,575,505	48,966,695.40	7.95
3	600588	用友网络	1,271,741	43,112,019.90	7.00
4	002230	科大讯飞	1,182,393	42,909,041.97	6.97
5	600419	天润乳业	2,600,553	41,920,914.36	6.81
6	000063	中兴通讯	1,418,498	41,420,141.60	6.73
7	603019	中科曙光	648,581	39,096,462.68	6.35
8	300369	绿盟科技	1,728,522	23,438,758.32	3.81
9	300253	卫宁健康	1,556,360	22,722,856.00	3.69
10	002371	北方华创	320,300	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	国家债券	3,213,714.00	0.52
2	央行票据	-	-
3	金融债券	24,420,441.80	3.97
	其中：政策性金融债	24,420,441.80	3.97
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（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	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	018005	国开1701	244,180	24,420,441.80	3.97
2	019611	19国债01	32,150	3,213,714.00	0.52

3	127011	中鼎转 2	9,829	982,900.00	0.16
---	--------	-------	-------	------------	------

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

本基金报告期末未投资国债期货。

11、投资组合报告附注

11.1 2018年4月中旬，美国商务部处罚事件对中兴通讯（000063）的发行主体属于难以预测的“黑天鹅”事件。截止目前，中兴通讯已与美国商务部于2018年6月8日签署了和解协议并将支付合计14亿美元民事罚款。根据协议，若中兴通讯遵守协议约定的监察条件，美国商务部新拒绝令在监察期（自其签发2018年6月8日命令起为期十年）内将被暂缓执行，并在监察期届满后予以豁免。此前，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。该处罚事件发生后，基金管理人密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

除上述股票之外，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	469,408.02
2	应收证券清算款	13,271,640.67
3	应收股利	-
4	应收利息	931,327.89
5	应收申购款	670,831.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,343,207.93

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
2010年4月14日 -2010年12月31 日	27.63%	1.67%	1.24%	1.41%	26.39%	0.26%
2011年1月1日 -2011年12月31 日	-31.38%	1.45%	-24.37%	1.10%	-7.01%	0.35%
2012年1月1日 -2012年12月31 日	2.86%	1.38%	2.06%	1.11%	0.80%	0.27%
2013年1月1日 -2013年12月31 日	6.62%	1.47%	7.67%	1.06%	-1.05%	0.41%
2014年1月1日 -2014年12月31 日	7.68%	1.16%	31.38%	0.89%	-23.70%	0.27%

2015年1月1日 -2015年12月31日	75.28%	2.57%	27.81%	2.09%	47.47%	0.48%
2016年1月1日 -2016年12月31日	-0.40%	1.54%	-12.40%	1.36%	12.00%	0.18%
2017年1月1日 -2017年12月31日	-3.16%	0.67%	2.45%	0.63%	-5.61%	0.04%
2018年1月1日 -2018年12月31日	-19.18%	1.26%	-23.64%	1.10%	4.46%	0.16%
2019年1月1日 -2019年3月31日	30.28%	1.73%	24.70%	1.26%	5.58%	0.47%
自基金合同生效 起至今	84.09%	1.54%	20.73%	1.25%	63.36%	0.29%

(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

光大保德信中小盘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

(2010年4月14日至2019年3月31日)



注：根据基金合同的规定，本基金建仓期为2010年4月14日至2010年10月13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) 基金的证券交易费用；
- (4) 基金合同生效以后的与基金相关的信息披露费用；
- (5) 基金份额持有人大会费用；
- (6) 基金合同生效以后的与基金相关的会计师费和律师费；
- (7) 基金财产中列支的银行汇划费用；
- (8) 按照国家有关规定可以列入的其他费用。

上述费用从基金财产中支付。

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

本基金的管理费率为年费率 1.5%。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

(2) 基金托管人的基金托管费

本基金的托管费率为年费率 0.25%。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每个月月末，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，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

(3) 本条第（一）款第 3 至第 8 项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入或摊入当期基金费用。

3、不列入基金费用的项目

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，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。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产中列支。

4、基金费用的调整

在符合相关法律法规和履行了必备的程序的条件下，基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 日在中国证监会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：

申购金额（含申购费）	申购费率
50 万元以下	1.5%
50 万元（含 50 万元）到 500 万元	0.9%
500 万元（含 500 万元）以上	每笔交易 1000 元

2、本基金的赎回费率见下表

持续持有期	赎回费率
7 天以内	1.5%
7 天（含 7 天）到 1 年以内	0.5%
1 年（含 1 年）至 2 年	0.2%
2 年（含 2 年）及以上	0%

注：赎回费的计算中 1 年指 365 个公历日。

3、基金管理人可以在法律法规和本基金合同规定范围内调低申购费率和赎回费率。费率如发生变更，基金管理人应在调整实施 2 日前在至少一种中国证监会指定媒体和基金管理人网站上刊登公告。

4、基金管理人可以在不违背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，在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行相关手续后基金管理人可以对促销活动范围内的基金投资人调低基金申购费率和基金赎回费率。

基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下对以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资者采用低于柜台费率的申购费率。

5、申购费用由申购基金份额的基金投资人承担，不列入基金财产，用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

6、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，其中，对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。其他情形下，赎回费总额的 25%应归入本基金财产，其余部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

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》、《公开募集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）》及其它有关法律法規的要求,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。
2. 在“三、基金管理人”部分,根据实际情况进行了更新。
3. 在“五、相关服务机构”部分,根据实际情况进行了更新。
4. 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。
5. 在“十七、风险揭示”部分,根据实际情况进行了更新。
6. “重要提示”、“一、绪言”、“二、释义”、“三、基金管理人”、“五、相关服务机构”、“八、基金份额的申购与赎回”、“十二、基金资产的估值”、“十三、基金的收益与分配”、“十四、基金的费用与税收”、“十五、基金的会计与审计”、“十六、基金的信息披露”、“十八、基金合同的变更、终止与基金财产的清算”、“十九、基金合同的内容摘要”、“二十、基金托管协议的内容摘要”、“二十三、招募说明书的存放及查阅方式”中对涉及《光大保德信中小盘混合型证券投资基金基金合同》和《光大保德信中小盘混合型证券投资基金托管协议》变更的相关内容部分进行了更新。

光大保德信基金管理有限公司

二〇二〇年一月六日