

# 九泰泰富定增主题灵活配置混合型 证券投资基金招募说明书更新摘要

基金管理人：九泰基金管理有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

## 【重要提示】

本基金的募集申请经中国证监会 2016 年 7 月 12 日证监许可【2016】1567 号文注册。本基金的基金合同已于 2016 年 9 月 26 日正式生效。

基金管理人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价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

投资有风险，投资者认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书和基金合同等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在获得基金投资收益的同时，亦承担基金投资中出现的各类风险，可能包括：证券市场整体环境引发的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、大量赎回或暴跌导致的流动性风险、因交收违约和投资债券引发的信用风险、基金管理人在投资经营过程中产生的操作风险以及本基金特有风险等（详见本招募说明书的“风险揭示”部分）。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本基金在基金合同生效后前五年内仅对场外基金份额每年定期开放一次受限申购赎回业务，且基金管理人可采取部分确认的方式确保申购、赎回结束后本基金的总份额基本保持不变。发生申购赎回份额部分确认时，采取“按比例确认”原则。故在基金合同生效后前五年内，可能出现基金份额持有人连续提出申购赎

回申请但无法完全确认或完全无法确认的情况。基金份额持有人在受限开放期无法全部赎回或全部无法赎回时，可以将基金份额进行跨系统转托管到场内交易。在场内交易过程中，可能出现基金份额二级市场交易价格低于基金份额净值的情形，即基金折价交易，从而影响持有人收益或产生损失。

在本基金在基金合同生效后前五年内以及转为上市开放式基金（LOF）后，基金投资有明确锁定期的非公开发行股票时，按照监管机构或行业协会有关规定确定公允价值，故本基金的基金净值可能由于估值方法的原因偏离所持有股票的收盘价所对应的净值。投资者在二级市场交易或申购赎回时，需考虑该估值方式对基金净值的影响。另外，本基金可能由于持有流通受限证券而面临流动性风险以及流通受限期间内证券价格大幅下跌的风险。

本基金属于混合型证券投资基金，一般情况下其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，属于中高风险收益特征的证券投资基金品种。本基金可投资资产支持证券、股指期货和权证等金融衍生品，可能给本基金带来额外风险。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。

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。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2018年9月26日，有关财务数据和净值表现截止日为2018年6月30日（财务数据未经审计）。

## 第一部分 基金管理人

### 一、基金管理人的基本情况

名称：九泰基金管理有限公司

住所：北京市丰台区丽泽路18号院1号楼801-16室

办公地址：北京市朝阳区安立路30号仰山公园8号楼A栋101-120室、201-222室

设立日期：2014年7月3日

法定代表人：卢伟忠

组织形式：有限责任公司

注册资本：2 亿元人民币

存续期限：2014 年 7 月 3 日至长期

联系电话：010-57383999

联系人：韩炳光

股权结构：昆吾九鼎投资管理有限公司、同创九鼎投资管理集团股份有限公司、拉萨昆吾九鼎产业投资管理有限公司、九州证券股份有限公司出资分别占注册资本的 26%、25%、25%和 24%的股权。

## 二、主要人员情况

### 1、董事会成员

吴强先生，管理学硕士，董事长。曾任万联证券投行部业务经理，宏源证券资本市场部副总经理，安信证券投行部业务副总裁，国信证券投行业务部总经理助理。现任同创九鼎投资管理集团股份有限公司董事、副总经理，九州证券股份有限公司董事，九泰基金管理有限公司董事长。

吴刚先生，管理学硕士，董事。曾任闽发证券投资银行部项目经理，中国证监会机构监管部副处长、处长。现任同创九鼎投资管理集团股份有限公司董事长。

卢伟忠先生，金融学硕士，董事、法定代表人，总经理。曾任金瑞期货研究员，安信证券股指期货 IB 业务专员，安信期货办公室主任，安信期货 IB 业务部总经理，安信证券资产管理部产品总监，安信乾盛常务副总经理。现任九泰基金管理有限公司董事、法定代表人，总经理。

袁小文女士，高级管理人員工商管理硕士，独立董事。曾任广东万通期货公司副总经理，浙江金马期货公司常务副总，长城伟业期货经纪有限公司（后更名为华泰长城期货有限公司）副总经理，华泰长城期货有限公司总经理，中信证券股份有限公司下属子公司执行副董事长，中信期货有限公司董事长，现任阳富教育咨询服务（深圳）有限公司董事长职务。

徐艳女士，经济学博士，教授，独立董事。曾任长春税务学院金融系国际金融教研室主任，海国投工业开发股份有限公司投资部经理，现任海南大学经济管理学院学位委员会委员、院学术委员会委员等职务。

陈耿先生，经济学博士，教授，独立董事。曾任青岛崂山区政府(高科技开

发区)职员，重庆大学工商管理博士后科研站博士后，重庆大学经济与工商管理学院教师，现任重庆大学经济与工商管理学院 EMBA 中心主任职务。

## 2、监事会成员

徐磊磊先生，工商管理硕士，监事。曾任昆吾九鼎投资管理有限公司行政助理、行政经理，同创九鼎投资管理集团股份有限公司监事，现任同创九鼎投资管理集团股份有限公司证券事务代表。

刘开运先生，金融学硕士，监事。曾任毕马威华振会计师事务所审计师，昆吾九鼎投资管理有限公司投资经理、合伙人助理。现任九泰基金管理有限公司定增投资中心总经理、致远权益投资部总经理兼执行投资总监。

## 3、公司高级管理人员

卢伟忠先生，简历同上。

王玉女士，涉外经济本科，副总经理。曾任陕西群力子弟学校教师，北京思拓克斯商贸有限公司经理助理，太平洋人寿保险北京分公司营销业务部经理、海淀支公司总经理、分公司党委委员、副总经理，国风共创管理咨询有限公司总经理。现任九泰基金管理有限公司副总经理。

吴祖尧先生，工学硕士，副总经理。曾任中国信达信托投资公司证券研究部副经理，中国银河证券研究中心研究主管、董事总经理，中国银河证券投行内核小组成员，中国银河证券投资顾问部董事总经理，中国银河证券投资决策委员会委员。现任九泰基金管理有限公司副总经理。

陈沛先生，法学硕士，督察长。曾任广州大学松田学院教师、平安证券有限责任公司合规专员、安信证券股份有限公司董事会办公室股权管理专员、安信基金管理有限责任公司监察稽核部法律主管、泰达宏利基金管理有限公司监察稽核部负责人。现任九泰基金管理有限公司督察长。

## 4、基金经理

徐占杰，南开大学世界经济硕士，中国籍，9 年证券研究投资经验，具有基金从业资格。历任华泰证券首席交运行业研究员、湘财证券首席电子行业研究员、中国华电集团资本控股公司高级投资项目经理。2015 年 2 月加入九泰基金管理有限公司，现任定增投资中心副总经理、致远权益投资部基金经理，九泰泰富定增主题灵活配置混合型证券投资基金（2016 年 9 月 26 日至今）的基金经理。

## 5、公募投资决策委员会成员

本公司公募投资决策委员会成员包括：吴祖尧先生（委员会主席）、张勇先生、刘开运先生、刘心任先生。

吴祖尧先生，同上。

张勇先生，经济学硕士，中国籍，15年证券从业经验，9年基金经理任职经验。历任南京市商业银行信贷员、债券交易员，博时基金管理有限公司债券交易员、基金经理助理、固定收益部副总经理、固定收益总部现金管理组投资总监、博时现金收益证券投资基金基金经理（2006年7月至2015年5月）、博时策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2009年8月至2015年5月）、博时稳定价值债券投资基金基金经理（2010年8月至2014年2月）、博时安盈债券型证券投资基金基金经理（2013年4月至2015年5月）、博时宏观回报债券型证券投资基金基金经理（2014年2月至2015年5月）、博时天天增利货币市场基金（2014年8月至2015年6月）基金经理、博时现金宝货币市场基金（2014年9月至2015年6月）基金经理、博时月月盈短期理财债券型证券投资基金（2014年9月至2015年6月）基金经理、博时保证金实时交易型货币市场基金（2014年11月至2015年6月）基金经理。现任九泰基金管理有限公司总裁助理兼绝对收益部总经理。

刘开运先生，同上。

刘心任先生，北京大学、香港大学经济金融双硕士，中国籍。7年证券从业经验，具有基金从业资格。曾任广发基金管理有限公司研究员。2015年5月加入九泰基金管理有限公司任研究发展部总监兼定增投资中心副总经理。现任九泰久利灵活配置混合型证券投资基金（2016年11月15日至今）的基金经理。

6、公司董事长吴强先生与公司董事吴刚先生系兄弟关系。除此以外，上述人员之间无近亲属关系。

## 三、基金管理人的职责

1、依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

2、办理基金备案手续；

3、自基金合同生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

4、配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

5、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

6、除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

7、依法接受基金托管人的监督；

8、采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；

9、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

10、编制季度、半年度和年度基金报告；

11、严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

12、保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

13、按基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

14、按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

15、依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

16、按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

17、确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照基金合同规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；

18、组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

19、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

20、因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

21、监督基金托管人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务，基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

22、当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

23、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

24、基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，基金合同不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

25、执行生效的基金份额持有人大会的决议；

26、建立并保存基金份额持有人名册；

27、法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

#### 四、基金管理人的承诺

1、本基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定。

2、本基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》及有关法律法规，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：

(1) 将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

(2) 不公平地对待其管理的不同基金财产；

(3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人谋取利益；

(4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

(5) 侵占、挪用基金财产；

(6) 泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

- (7) 玩忽职守，不按照规定履行职责；
- (8) 法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

3、本基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

- (1) 越权或违规经营；
- (2) 违反基金合同或托管协议；
- (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益；
- (4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权，不按照规定履行职责；

(7) 违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

(8) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；

- (9) 贬损同行，以抬高自己；
- (10) 以不正当手段谋求业务发展；
- (11) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (13) 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

#### 4、基金管理人关于履行诚信义务的承诺

基金管理人承诺将以取信于市场、取信于社会为宗旨，按照诚实信用、勤勉尽责的原则，严格遵守有关法律法规和中国证监会发布的监管规定，不断更新投资理念，规范基金运作。

#### 5、基金经理承诺

(1) 依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

- (2) 不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益；



(3) 不违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

(4) 不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

## 五、基金管理人的内部控制体系

为保证公司规范化运作，有效地防范和化解经营风险，促进公司诚信、合法、有效经营，保障基金份额持有人利益，维护公司及公司股东的合法权益，本基金管理人建立了科学、严密、高效的内部控制体系。

### 1、公司的内部控制目标

- (1) 确保合法合规经营；
- (2) 防范和化解风险；
- (3) 提高经营效率；
- (4) 保护基金份额持有人和股东的合法权益。

### 2、公司内部控制遵循的原则

#### (1) 健全性原则

风险管理必须涵盖公司各个部门和各个岗位，并渗透到各项业务过程和业务环节，包括各项业务的决策、执行、监督、反馈等环节。

#### (2) 有效性原则

通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护风险管理制度的有效执行。

#### (3) 独立性原则

公司各机构、部门和岗位确保相对独立并承担各自的风险控制职责。公司基金资产、自有资产、其他资产的运作须分离。督察长和监察稽核部对公司风险控制制度的执行情况进行检查和监督。

#### (4) 相互制约原则

公司在制度安排、组织机构的设计、部门和岗位设置上形成权责分明、相互制约的机制，从而建立起不同岗位之间的制衡体系，消除内部风险控制中的盲点，强化监察稽核部对业务的监督检查功能。

#### （5）成本效益原则

公司将运用科学化的经营管理方法，并充分发挥各机构、部门及员工的工作积极性，尽量降低经营成本，提高经营效益，保证以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

#### （6）适时性原则

风险管理应具有前瞻性，并且必须随着国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变和公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化及时进行相应的修改和完善。

#### （7）内控优先原则

内控制度具有高度的权威性，所有员工必须严格遵守，自觉形成风险防范意识；执行内控制度不能有任何例外，任何人不得拥有超越制度或违反规章的权力；公司业务的发展必须建立在内控制度完善并稳固的基础之上。

#### （8）防火墙原则

公司在敏感岗位如：基金投资、交易执行、基金清算岗位之间，基金会计和公司会计之间、会计与出纳之间等等，在物理上和制度上设置严格的防火墙进行隔离，以控制风险。

### 3、内部控制的制度体系

公司制定了合理、完备、有效并易于执行的制度体系。公司制度体系由不同层面的制度构成。按照其效力大小分为四个层面：第一个层面是公司章程；第二个层面是公司内部控制大纲，它是公司制定各项规章制度的基础和依据；第三个层面是公司基本管理制度；第四个层面是公司各机构、部门根据业务需要制定的各种制度及实施细则等。它们的制订、修改、实施、废止遵循相应的程序，每一层面的内容不得与其以上层面的内容相违背。监察稽核部定期对公司制度、内部控制方式、方法和执行情况实行持续的检验，并出具专项报告。

### 4、内控监控防线

为体现职责明确、相互制约的原则，公司根据基金管理业务的特点，设立顺序递进、权责分明、严密有效的三道监控防线：

（1）建立以各岗位目标责任制为基础的第一道监控防线。各岗位均制定明确的岗位职责，各业务均制定详尽的操作流程，各岗位人员上岗前必须以书面形

式声明已知悉并承诺遵守，在授权范围内承担各自职责；

(2) 建立相关部门、相关岗位之间相互监督的第二道监控防线。公司在相关部门、相关岗位之间建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，后续部门及岗位对前一部门及岗位负有监督的责任；

(3) 建立以督察长、监察稽核部对各岗位、各部门、各机构、各项业务全面实施监督反馈的第三道监控防线。公司督察长和内部监察稽核部门独立于其他部门，对内部控制制度的执行情况实行严格的检查和反馈。

#### 5、关于授权、研究、投资、交易等方面的控制点

##### (1) 授权制度

公司的授权制度贯穿于整个公司活动。股东会、董事会、监事会和管理层必须充分履行各自的职权，健全公司逐级授权制度，确保公司各项规章制度的贯彻执行；各项经济经营业务和管理程序必须遵从管理层制定的操作规程，经办人员的每一项工作必须是在业务授权范围内进行。公司重大业务的授权必须采取书面形式，授权书应当明确授权内容和时效。公司授权要适当，对已获授权的部门和人员应建立有效的评价和反馈机制，对已不适用的授权应及时修改或取消授权。

##### (2) 公司研究业务

研究工作应保持独立、客观，不受任何部门及个人的不正当影响；建立严密的研究工作业务流程，形成科学、有效的研究方法；建立投资产品备选库制度，研究部门根据投资产品的特征，在充分研究的基础上建立和维护备选库。建立研究与投资的业务交流制度，保持畅通的交流渠道；建立研究报告质量评价体系，不断提高研究水平。

##### (3) 基金投资业务

基金投资应确立科学的投资理念，根据决策的风险防范原则和效率性原则制定合理的决策程序；在进行投资时应有明确的投资授权制度，并应建立与所授权限相应的约束制度和考核制度。建立严格的投资禁止和投资限制制度，保证基金投资的合法合规性。建立投资风险评估与管理制制度，将重点投资限制在规定的风险权限额度内；对于投资结果建立科学的投资管理业绩评价体系。

##### (4) 交易业务

建立集中交易室和集中交易制度，投资指令通过集中交易室完成；建立了交

易监测系统、预警系统和交易反馈系统，完善了相关的安全设施；集中交易室对交易指令进行审核，建立公平的交易分配制度，确保各基金利益的公平；交易记录应完善，并及时进行反馈、核对和存档保管；同时建立了科学的投资交易绩效评价体系。

#### （5）基金会计核算

公司根据法律法规及业务的要求建立会计制度，并根据风险控制重点建立严密的会计系统，对于不同基金、不同客户独立建账，独立核算；公司通过复核制度、凭证制度、合理的估值方法和估值程序等会计措施真实、完整、及时地记载每一笔业务并正确进行会计核算和业务核算。同时还建立会计档案保管制度，确保档案真实完整。

#### （6）信息披露

公司建立了完善的信息披露制度，保证公开披露的信息真实、准确、完整。公司设立了信息披露负责人，并建立了相应的程序进行信息的收集、组织、审核和发布工作，以此加强对信息的审查核对，使所公布的信息符合法律法规的规定，同时加强对信息披露的检查和评价，对存在的问题及时提出改进办法。

#### （7）监察稽核

公司设立督察长，对董事会负责，经董事会聘任，报中国证监会核准。根据公司监察稽核工作的需要和董事会授权，督察长可以列席公司相关会议，调阅公司相关档案，就内部控制制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能。督察长定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况，董事会对督察长的报告进行审议。

公司设立监察稽核部开展监察稽核工作，并保证监察稽核部的独立性和权威性。公司明确了监察稽核部及内部各岗位的具体职责，配备了充足的人员，严格制订了专业任职条件、操作程序和组织纪律。

监察稽核部强化内部检查制度，通过定期或不定期检查内部控制制度的执行情况，确保公司各项经营管理活动的有效运行。

公司董事会和管理层充分重视和支持监察稽核工作，对违反法律、法规和公司内部控制制度的，追究有关部门和人员的责任。

### 6、基金管理人关于内部控制制度声明书

- (1) 基金管理人承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；
- (2) 基金管理人承诺根据市场变化和基金管理人业务发展不断完善内部控制制度。

## 第二部分 基金托管人

### (一) 基本情况

#### 1、基金托管人基本情况

名称：招商证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区益田路江苏大厦A座 38-45 层

办公地址：广东省深圳市福田区益田路江苏大厦A座 38-45 层

法定代表人：霍达

成立时间：1993 年 8 月 1 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：66.99 亿元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：证监许可[2014]78 号

联系人：秦湘

联系电话：0755-26951111

招商证券是百年招商局旗下金融企业，经过二十多年创业发展，已成为拥有证券市场业务全牌照的一流券商，并经中国证券监督管理委员会评定为 A 类 AA 级券商。招商证券具有稳定的持续盈利能力、科学合理的风险管理架构、专业的服务能力。公司拥有多层次客户服务渠道，在北京、上海、广州、深圳等城市拥有 243 家批准设立的证券营业部和 12 家证券经纪业务管理分公司，同时在香港设有分支机构，全资拥有招商证券国际有限公司、招商期货有限公司、招商致远资本投资有限公司、招商证券投资有限公司、招商证券资产管理有限公司，参股博时基金管理公司、招商基金管理公司、广东金融高新区股权交易中心有限公司及证通股份有限公司，构建起国内国际业务一体化的综合证券服务平台。招商证券致力于“全面提升核心竞争力，打造中国最佳投资银行”。公司将以卓越的金融服务实现客户价值增长，推动证券行业进步，立志打造产品丰富、服务一流、能力突出、品牌卓越的国际化

金融机构，成为客户信赖、社会尊重、股东满意、员工自豪的优秀金融企业。

## 2、主要人员情况

招商证券托管部员工多人拥有证券投资基金业务运作经验、会计师事务所审计经验，以及大型IT公司的软件设计与开发经验，人员专业背景覆盖了金融、会计、经济、计算机等各领域，其中本科以上学历占比 100%，高级管理人员均拥有硕士研究生或以上学历。

## 3、基金托管业务经营情况

招商证券是国内首批获得证券投资基金托管业务的证券公司，可为各类公开募集资金设立的证券投资基金提供托管服务。托管部拥有独立的安全监控设施，稳定、高效的托管业务系统，完善的业务管理制度。招商证券托管部本着“诚实信用、谨慎勤勉”的原则，为基金份额持有人利益履行基金托管职责。除此之外，招商证券于 2012 年 10 月获得了证监会准许开展私募基金综合托管服务试点的正式批复，成为业内首家可从事私募托管业务的券商，经验丰富，服务优质，业绩突出。截至 2018 年二季度，招商证券共托管 29 只公募基金。

### （二）基金托管人的内部控制制度

#### 1、内部控制目标

招商证券作为基金托管人：

（1）托管业务的经营运作遵守国家有关法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念。

（2）建立科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系，保持托管业务内部控制制度健全、执行有效。

（3）防范和化解经营风险，提高经营管理效益，使托管业务稳健运行和受托资产安全完整，实现托管业务的持续、稳定、健康发展。

（4）不断改进和完善内控机制、体制和各项业务制度、流程，提高业务运作效率和效果。

#### 2、内部控制组织结构

招商证券股份有限公司经营管理层面设立了风险管理委员会。作为公司内部最高风险决策机构，风险管理委员会负责审议公司风险管理政策、风险

偏好、容忍度和经济资本等风险限额配置方案，拥有公司重大风险业务和创新业务项目的最终裁量权。风险管理部、法律合规部及稽核部为公司的风险管理职能部门。

资产托管部内部设置专门负责稽核工作的内控稽核岗，配备专职稽核人员，在托管部总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使监督稽核职权。

### 3、内部控制制度及措施

招商证券托管部制定了各项管理制度和操作规程，建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系，保持托管业务健全、有效执行；安全保管基金财产，保持基金财产的独立性；实行经营场所封闭式管理，并配备录音和录像监控系统；有独立的综合托管服务系统；业务管理实行复核和检查机制，建立了严格有效的操作制约体系；托管部树立内控优先和风险管理的理念，培养部门全体员工的风险防范和保密意识。

#### （三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

##### 1、监督方法

基金托管人根据《基金法》、《运作办法》等法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对基金合同生效之后所托管基金的投资范围、投资比例、投资限制等进行监督，并及时提示基金管理人违规风险。

##### 2、监督程序

基金托管人发现基金管理人投资指令或实际投资运作违反法律法规、基金合同和托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在限期内及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

## 第三部分 相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

#### 1、场外销售机构

##### (1) 直销机构

##### 1) 九泰基金管理有限公司北京直销中心

住所：北京市丰台区丽泽路 18 号院 1 号楼 801-16 室

办公地址：北京市朝阳区安立路 30 号仰山公园 8 号楼 A 栋 109 室

法定代表人：卢伟忠

联系人：潘任会

电话：010-57383818

传真：010-57383894

邮箱：service@jtamc.com

公司网址：<http://www.jtamc.com/>

##### 2) 九泰基金管理有限公司电子交易

投资者可以通过本公司网上交易系统办理基金的申购、赎回等业务，具体业务办理情况及业务规则请登录本公司网站查询。

网址：<http://www.jtamc.com/>

##### (2) 代销机构

##### 1) 上海天天基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

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：其实

联系人：潘世友

客户服务电话：95021

公司网址：<http://www.1234567.com.cn/>

##### 2) 浙江同花顺基金销售有限公司

住所：浙江省杭州市文二西路 1 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路 18 号

法定代表人：凌顺平



联系人：吴强

客户服务电话：4008-773-772

公司网址：<http://www.5ifund.com/>

3) 上海好买基金销售有限公司

住所：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 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

客户服务电话：400-700-9665

公司网址：<https://www.ehowbuy.com/>

4) 上海利得基金销售有限公司

住所：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法定代表人：李兴春

联系人：曹怡晨

客服电话：400-921-7755

电话：86-021-50583533

公司网址：<http://leadfund.com.cn/>

5) 上海联泰资产管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易区富特北路 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 楼

法定代表人：燕斌

联系人：兰敏

客户服务电话：400-166-6788

公司网址：<http://www.66liantai.com/>

6) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

住所：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 16 层

法定代表人：张彦

联系人：文雯

客户服务电话：400-166-1188

公司网址：<http://www.new-rand.cn/>

7) 北京增财基金销售有限公司

住所：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208

办公地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208

法定代表人：罗细安

联系人：李皓

客户服务电话：010-67000988

公司网址：<http://www.zcvc.com.cn/>

8) 一路财富（北京）信息科技有限公司

住所：北京市西城区阜成门外大街 2 号 1 幢 A 座 2208

办公地址：北京市西城区阜成门外大街 2 号万通新世界 A 座 2208

法定代表人：吴雪秀

联系人：段京璐

客户服务电话：400-001-1566

公司网址：<https://www.yilucaifu.com/>

9) 诺亚正行基金销售有限公司

住所：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：张裕

客户服务电话：400-821-5399

公司网址：<https://www.noah-fund.com/>

10) 北京钱景财富投资管理有限公司

住所：北京市海淀区丹棱街丹棱 SOHO 1008

办公地址：北京市海淀区丹棱街丹棱 SOHO 1008

法定代表人：赵荣春

联系人：陈剑炜

客户服务电话：400-893-6885

公司网址：<http://www.qianjing.com/>

11) 上海陆金所基金销售有限公司

住所：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：鲍东华

联系人：宁博宇

客户服务电话：4008-219-031

公司网址：<https://www.lufunds.com/>

12) 上海凯石财富基金销售有限公司

住所：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：王哲宇

客户服务电话：4006-433-389

公司网址：<https://www.vstonewealth.com/>

13) 湘财证券股份有限公司

住所：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：林俊波

联系人：李欣

客户服务电话：400-888-1551

公司网址：<http://www.xcsc.com/>

14) 大泰金石基金销售有限公司

住所：南京市建邺区江东中路 222 号南京奥体中心现代五项馆 2105 室

办公地址：上海市浦东新区峨山路 505 号东方纯一大厦 15 层

法定代表人：袁顾明

联系人：朱真卿

客户服务电话：400-928-2266

公司网址：<http://www.dtfunds.com/>

15) 上海汇付基金销售有限公司

住所：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

办公地址：上海市虹梅路 1801 号凯科国际大厦 7 楼

法定代表人：金佶

联系人：陈云卉

客户服务电话：400-820-2819

公司网址：<http://www.chinapnr.com/>

16) 上海大智慧财富管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102、1103 单元

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102、1103 单元

法定代表人：申健

联系人：胡旦

客户服务电话：021-20292031

公司网址：<http://www.gw.com.cn>

17) 深圳富济基金销售有限公司

住所：深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦 35 层 01B、02、03、04 单元

办公地址：深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦 35 层 01B、02、03、04 单元

法定代表人：刘鹏宇

联系人：刘勇

客户服务电话：0755-83999907

公司网址：<http://www.fujiwealth.cn/>

18) 中证金牛（北京）投资咨询有限公司

住所：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 A 座 5 层

法定代表人：钱昊旻

联系人：孙雯

客户服务电话：4008909998

公司网址：<http://www.jnlc.com/>

19) 珠海盈米财富管理有限公司

住所：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：黄敏嫦

客户服务电话：020-89629066

公司网址：<https://www.yingmi.cn/>

20) 深圳众禄基金销售股份有限公司

住所：深圳市罗湖区梨园路1号物资控股置地大厦8楼

办公地址：深圳市罗湖区梨园路1号物资控股置地大厦8楼

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

客户服务电话：4006-788-887

公司网址：<https://www.zlfund.cn/>

21) 和讯信息科技有限公司

住所：北京市朝阳区朝外大街22号1002室

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

联系人：刘洋

客户服务电话：4009200022

公司网址：<http://www.hexun.com/>

22) 北京汇成基金销售有限公司

住所：北京市海淀区中关村大街11号11层1108

办公地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108

法定代表人：王伟刚

联系人：丁向坤

客户服务电话：4006199059

公司网址：<http://www.hcjjjin.com/>

23) 北京肯特瑞财富管理有限公司

住所：北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06

办公地址：北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街十八号院京东集团总部

法定代表人：江卉

联系人：熊彦清

客户服务电话：95118

公司网址：<http://fund.jd.com>

24) 上海基煜基金销售有限公司

住所：上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济开发区）

办公地址：上海市昆明路 518 号北美广场 A1002 室

法定代表人：王翔

联系人：吴鸿飞

客户服务电话：4008-205-369

公司网址：<https://www.jiyufund.com.cn/>

25) 凤凰金信（银川）基金销售有限公司

住所：宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路 142 号 14 层 1402

办公地址：北京市朝阳区紫月路 18 号院朝来高科技产业园 18 号楼

法定代表人：程刚

联系人：张旭

客服服务电话：400-810-5919

公司网址：<http://www.fengfd.com/>

26) 上海万得基金销售有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址：上海市浦东新区福山路 33 号 8 楼

法定代表人：王延福

联系人：徐亚丹

客户服务电话：400-821-0203

公司网址：<https://www.520fund.com.cn/>

27) 上海华夏财富投资管理有限公司

住所：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

法定代表人：毛淮平

联系人：仲秋玥

客户服务电话：400-817-5666

公司网址：<https://www.amcfortune.com/>

28) 宜信普泽投资顾问（北京）有限公司

住所：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

法定代表人：戎兵

联系人：张得仙

客户服务电话：400-6099-200

公司网址：<http://www.yixinfund.com/>

29) 中山证券有限责任公司

住所：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼 7 层、8 层

办公地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼 7 层、8 层

法定代表人：黄扬录

联系人：罗艺琳

客户服务电话：95329

公司网址：<http://www.zszq.com/>

30) 招商证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

办公地址：广东省深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

法定代表人：霍达

联系人：黄婵君

客户服务电话：4008888111；95565

公司网址：<http://www.newone.com.cn/>

31) 国金证券股份有限公司

住所：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：刘靖漪

客户服务电话：95310

公司网址：<http://www.gjzq.com.cn/>

32) 华泰证券股份有限公司

住所：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、深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 18 楼

法定代表人：周易

联系人：庞晓芸

客户服务电话：95597

公司网址：<http://www.htsc.com.cn>

33) 国海证券股份有限公司

住所：广西桂林市辅星路 13 号

办公地址：广西壮族自治区南宁市滨湖路 46 号国海大厦

法定代表人：何春梅

联系人：宋志海

客户服务电话：95563

公司网址：<http://www.ghzq.com.cn/>

34) 山西证券股份有限公司

住所：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

办公地址：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍



联系人：郭熠

客户服务电话：95573

公司网址：<http://www.i618.com.cn/>

35) 万联证券有限责任公司

住所：广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 座 18、19 楼

办公地址：广东省广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 座 18、19 层

法定代表人：张建军

联系人：甘蕾

客户服务电话：95322

公司网址：<http://www.wlzq.com.cn/>

36) 北京电盈基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区呼家楼（京广中心）1 号楼 36 层 3603 室

办公地址：北京市朝阳区呼家楼（京广中心）1 号楼 36 层 3603 室

法定代表人：程刚

联系人：赵立芳

客户服务电话：400-100-3391

公司网址：<http://www.dianyinfund.com/>

37) 华西证券股份有限公司

住所：四川省成都市高新区天府二街 198 号

办公地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号

法定代表人：杨炯洋

联系人：谢国梅

客户服务电话：95584/4008-888-818

公司网址：<http://www.hx168.com.cn/>

38) 杭州科地瑞富基金销售有限公司

住所：杭州市下城区武林时代商务中心 1604 室

办公地址：杭州市下城区武林时代商务中心 1604 室

法定代表人：陈刚

联系人：胡璇

客户服务电话：0571-86655920

公司网址：<https://www.cd121.com/>

39) 中泰证券股份有限公司

住所：济南市经七路 86 号

办公地址：上海市花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 18 层

法定代表人：李玮

联系人：许曼华

客户服务电话：95538

公司网址：<http://www.zts.com.cn/>

40) 深圳盈信基金销售有限公司

住所：深圳市福田区莲花街道商报东路英龙商务大厦 8 楼 A-1 (811-812)

办公地址：大连市中山区南山路 155 号南山 1910 小区 A3-1

法定代表人：苗宏升

联系人：王清臣

客户服务电话：4007-903-688

公司网址：<http://www.fundying.com/>

41) 长江证券股份有限公司

住所：湖北省武汉市江汉区新华路特 8 号

办公地址：湖北省武汉市江汉区新华路特 8 号

法定代表人：尤习贵

联系人：奚博宇

客户服务电话：95579

公司网址：<https://www.95579.com/>

42) 济安财富（北京）基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307

办公地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307

法定代表人：杨健

联系人：李海燕

客户服务电话：400—673—7010

公司网址：<http://www.jianfortune.com/>

43) 民生证券股份有限公司

住所：北京市东城区建国门大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层

办公地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层

法定代表人：冯鹤年

联系人：李微

客户服务电话：400-619-8888

公司网址：<http://www.msza.com/>

44) 西南证券股份有限公司

住所：重庆市江北区桥北苑 8 号

办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

法定代表人：吴坚

联系人：张煜

客户服务电话：95355

公司网址：<http://www.swsc.com.cn/>

45) 武汉市伯嘉基金销售有限公司

住所：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城（一期）第七幢 23 层 1 号 4 号

办公地址：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城（一期）第七幢 23 层 1 号 4 号

法定代表人：陶捷

联系人：陆锋

客户服务电话：400-027-9899

公司网址：<http://www.buyfunds.cn/>

46) 北京新浪仓石基金销售有限公司

住所：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期（西扩）N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室

办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期（西扩）N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室

法定代表人：李昭琛

联系人：吴翠

客户服务电话：010-62675369

公司网址：<https://trade.xincai.com/>

47) 上海朝阳永续基金销售有限公司

住所：浦东新区上丰路 977 号 1 幢 B 座 812 室

办公地址：上海市浦东新区碧波路 690 号 4 号楼 2 楼

法定代表人：廖冰

联系人：陆纪青

客户服务电话：400-699-1888

公司网址：<http://www.998fund.com/>

48) 海银基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 8 号 4 楼

办公地址：上海市浦东新区银城中路 8 号 4 楼

法定代表人：刘惠

联系人：毛林

客户服务电话：400-808-1016

公司网址：<http://www.fundhaiyin.com/>

49) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

住所：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：张佳琳

客户服务电话：400-820-2899

公司网址：<http://www.erichfund.com/>

50) 光大证券股份有限公司

住所：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：郁疆

客户服务电话：95525

公司网址：<http://www.ebscn.com/>

51) 世纪证券有限责任公司

住所：深圳市福田区深南大道招商银行大厦 40/42 层

办公地址：深圳市福田区深南大道招商银行大厦 40/42 层

法定代表人：姜味军

联系人：王雯

客户服务电话：4008323000

公司网址：<http://www.csco.com.cn/>

52) 北京蛋卷基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

办公地址：北京市朝阳区阜通东大街望京 SOHO T3 A 座 19 层

法定代表人：钟斐斐

联系人：袁永姣

客户服务电话：400-061-8518

公司网址：<https://danjuanapp.com/>

53) 上海云湾基金销售有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 27 号 13 号楼 2 层

办公地址：上海市浦东新区新金桥路 27 号 1 号楼 1 层

法定代表人：桂水发

联系人：范泽杰

客户服务电话：400-820-1515

公司网址：<http://www.zhengtongfunds.com/>

54) 中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：刘芸

客户服务电话：95587/4008-888-108

公司网址：<https://www.csc108.com/>

55) 厦门市鑫鼎盛控股有限公司

住所：厦门市思明区鹭江道 2 号厦门第一广场西座 1501-1504 室

办公地址：厦门市思明区鹭江道 2 号厦门第一广场西座 1501-1504 室

法定代表人：陈洪生

联系人：陈承智

客户服务电话：400-918-0808

公司网址：<http://www.xds.com.cn/>

56) 开源证券股份有限公司

住所：西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层

办公地址：西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层

法定代表人：李刚

联系人：袁伟涛

客户服务电话：95325 或 400-860-8866

公司网址：<http://www.kysec.cn/>

57) 上海有鱼基金销售有限公司

住所：上海自由贸易试验区浦东大道 2123 号 3 层 3E-2655 室

办公地址：上海市徐汇区桂平路 391 号 B 座 19 层

法定代表人：林琼

联系人：徐海峥

客户服务电话：021-60907378

公司网址：<http://www.youyufund.com/>

58) 北京恒天明泽基金销售有限公司

住所：北京市经纪技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 39 号第一上海中心 C 座 6 层

法定代表人：周斌

联系人：张晔

客户服务电话：4008-980-618

公司网址：<https://www.chtfund.com/>

59) 东海证券股份有限公司

住所：江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：赵俊

联系人：王一彦

客户服务电话：95531

公司网址：<http://www.longone.com.cn/>

60) 天风证券股份有限公司

住所：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦 4 楼

办公地址：湖北省武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 38 楼

法定代表人：余磊

联系人：杨晨

客户服务电话：95391/4008005000

公司网址：<http://www.tfzq.com>

61) 嘉实财富管理有限公司

住所：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 53 层 5312-15

单元

办公地址：北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层

法定代表人：赵学军

联系人：贾一夫

客户服务电话：400-021-8850

公司网址：<http://www.harvestwm.cn>

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销售本基金，并及时履行公告义务。

2、场内销售机构：本基金办理场内认购业务的发售机构为具有基金销售业务资格并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员。本基金认购期结束前获得基金销售业务资格的会员单位经深圳证券交易所确认后也可代理场内基金份额的发售。

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销售本基金，并及时履行公告义务。

## 二、登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

电话：010-59378982

传真：010-58598907

联系人：程爽

## 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：北京市天元律师事务所

住所：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 10 层

负责人：朱小辉

电话：010-57763888

传真：010-57763777

经办律师：吴冠雄、李晗

联系人：李晗

## 四、审计基金财产的会计师事务所

名称：德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼

负责人：曾顺福

联系人：杨婧

联系电话：021-61418888

传真电话：021-63350003

经办注册会计师：文启斯、杨丽

## 第四部分 基金的名称

九泰泰富定增主题灵活配置混合型证券投资基金



## 第五部分 基金份额的运作方式、申购与赎回

### 一、基金份额的运作方式

本基金在基金合同生效后前五年内，场内份额不开放申购、赎回业务，但可上市交易。场外份额每年定期开放一次申购、赎回业务，此开放期为受限开放期，共包含五个受限开放日。受限开放日基金管理人可采取部分确认的方式确保申购、赎回结束后本基金的总份额基本保持不变。基金合同生效后第五个年度对日起，本基金转为上市开放式基金（LOF），并更名为九泰泰富灵活配置混合型证券投资基金（LOF），接受场内、场外申购与赎回等业务，并继续上市交易。

受限开放期为基金合同生效之日起每个年度对日的前五个工作日，受限开放期内的每个工作日均为受限开放日。在每一个受限开放日，基金管理人收到的基金赎回申请与基金申购申请“按比例确认”，以确保申购与赎回后基金总份额基本保持不变。在受限开放期结束后，本基金基金总份额基本保持不变。

受限开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准，且基金管理人最迟应于受限开放期开始前2日进行公告。如在受限开放日发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购与赎回业务的，受限开放日中止开放，在不可抗力或其他情形影响因素消除之日次日起，继续计算该受限开放日时间，直到满足受限开放日的时间要求。

本基金基金合同生效后第五个年度对日起，本基金按照基金合同约定转为上市开放式基金（LOF），并更名为九泰泰富灵活配置混合型证券投资基金（LOF），开放场内与场外份额的申购与赎回业务。本基金在转型前后可根据情况暂停上市与交易，恢复时间以本基金管理人公告为准。

### 二、申购和赎回场所

投资者办理本基金场外申购、赎回业务的场所为基金管理人的直销网点和其它销售机构的销售网点；投资者办理本基金场内申购、赎回业务的场所为具有基金销售业务资格且符合深圳证券交易所有关风险控制要求的深圳证券交易所会员单位。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

### 三、申购和赎回的开放日及时间

## 1、开放日及开放时间

投资者在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，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、赎回时除外。

本基金转为上市开放式基金（LOF）后，若出现新的证券/期货交易市场、证券/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。

## 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日办理基金份额申购、赎回的价格。

本基金自转为上市开放式基金（LOF）之日起，不超过 30 天开始办理场内与场外份额的申购、赎回业务，具体业务办理时间在相关公告中规定。

## 四、申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算。

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请。

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销。

4、在基金合同生效后前五年内，场外份额赎回遵循“按比例确认原则”，即每个受限开放日均按照“有效申购扣费后预成交份额数量”与“有效赎回申请份额数量”比例，对赎回和申购进行确认，具体规则见“五、申购和赎回的程序”；本基金赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资者认购、申购的先后次序进行顺序赎回，以确定被赎回基金份额的持有期限和所适用的赎回费率。

5、投资者通过深圳证券交易所交易系统办理基金份额的场内申购、赎回业务时，需遵守深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则。

若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，按新规定执行。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

## 五、申购和赎回的程序

### 1、申购和赎回的申请方式

基金投资者需根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回申请。投资者在提交申购申请时，须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资者在提交赎回申请时，应确保账户内有足够的基金份额余额，否则申购、赎回申请不成立。

### 2、申购和赎回的款项支付

投资者申购采用全额缴款方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成立。投资者在规定时间内全额交付申购款项，申购成立；基金份额登记机构确认基金份额时，申购生效。

若申购不成立或无效，申购款项本金将退回投资者账户，由此产生的利息等损失由投资者自行承担。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；基金份额登记机构确认赎回时，赎回生效。基金份额持有人赎回确认后，基金管理人将在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项，将款项通过销售机构划往基金份额持有人账户。在发生巨额赎回或基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法按基金合同有关规定处理。如遇证券/期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行交换系统故障或其他非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响了业务流程，则赎回款项划付时间顺延。

### 3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T 日），在正常情况下，本基金登记机构在 T+1 日（包括该日）内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资者应在 T+2 日后（包括该日）及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项退还给投资者。

#### 4、受限开放日申购和赎回申请的确认

在每个受限开放日，申购和赎回申请的确认需遵循如下规定：

(1) “有效赎回申请份额数量”大于“有效申购扣费后预成交份额数量”，则对申购的有效申请全部予以确认，同时将按照“赎回申请份额”和“有效申购扣费后预成交份额”基本相等的原则对所有有效的赎回申请份额进行部分确认。

(2) “有效赎回申请份额数量”小于“有效申购扣费后预成交份额数量”，则对赎回的有效申请全部予以确认，同时将按照“赎回申请份额”和“有效申购扣费后预成交份额”基本相等的原则对所有有效的申购申请份额进行部分确认。

(3) “有效赎回申请份额数量”等于“有效申购扣费后预成交份额数量”，则对申购和赎回的有效申请全部予以确认。

基金管理人可在法律法规允许的范围内，依法对上述申购和赎回申请的确认时间进行调整，并必须在调整实施日前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申购、赎回申请。申购、赎回申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询。

#### 六、申购和赎回的数额限制

##### 1、申购金额的限制

通过本基金指定代理销售机构场外申购基金，单笔申购的最低金额为 1,000 元；通过基金管理人直销中心的首次最低申购金额为 50,000 元，追加申购单笔最低申购金额为 10,000 元，不设级差限制（具体规定请至基金管理人网站查询）。

通过具有基金销售业务资格且符合深圳证券交易所有关风险控制要求的深圳证券交易所会员单位场内申购基金，单笔申购最低金额为 1,000 元或其整数倍。

本基金存续期间对单个基金份额持有人不设置最高累计申购金额限制。

##### 2、赎回份额的限制

基金份额持有人办理基金份额场外赎回时，赎回的最低份额为 5 份基金份额；基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回，但某笔赎回导致单个交易账户的基金份额余额少于 5 份时，剩余基金份额将与该次赎回份额一起全部赎回。

基金份额持有人办理基金份额场内赎回时，赎回份额必须是整数份额。

3、本基金转为上市开放式基金（LOF）后，当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，也可采取上述措施对基金规模予以控制。具体请参见相关公告。

4、对于场内申购、赎回及持有场内基金份额的数量限制，深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则有规定的，从其最新规定办理。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额、赎回份额和最低基金份额余额等数量限制，或者新增基金规模控制措施。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

#### 七、申购和赎回的价格、费用及其用途

1、本基金份额净值的计算，保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

#### 2、申购费率和赎回费率

##### （1）申购费率

基金份额的申购费用由基金申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

基金份额的申购费率具体如下表：

费用项	单笔金额（M）	收费标准
申购费（场外）	M < 50 万元	1.5%
	50 万元 ≤ M < 100 万元	1.0%
	100 万元 ≤ M < 500 万元	0.5%
	M ≥ 500 万元	每笔 1000 元
申购费（场内）	深圳证券交易所会员单位应按照本基金招募说明书约定的场外申购费率设定投资者的场内申购费率。	

申购费用由投资者承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销

售、注册登记等各项费用。场内证券经营机构同时是场外基金销售机构时，其场内申购费率优先取其场外申购费率。

## （2）赎回费率

投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。

基金份额的赎回费率具体如下表：

费用项	持有期限（Y）	收费标准
赎回费（场外）	Y<7 日	1.50%
	7 日≤Y<30 日	0.75%
	30 日≤Y<365 日	0.50%
	365 日≤Y<730 日	0.25%
	Y≥730 日	0
赎回费（场内）	Y<7 日	1.50%
	Y≥7 日	0.50%

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对场外持有期少于30日（不含）的基金份额持有人所收取赎回费用全额计入基金财产；对场外持有期在30日以上（含）且少于90日（不含）的基金份额持有人所收取赎回费用总额的75%计入基金财产；对场外持有期在90日以上（含）且少于180日（不含）的基金份额持有人所收取赎回费用总额的50%计入基金财产；对场外持续持有期180日以上（含）的投资者所收取赎回费用总额的25%计入基金财产；其余用于支付市场推广、注册登记费和其他手续费。投资者通过场内赎回时，赎回费将全额归入基金财产。

投资者份额持有时间记录规则以登记结算机构最新业务规则为准，具体持有时间以登记结算机构系统记录为准。

（3）基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

（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，针对以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，

基金管理人可以按相关监管部门要求履行必要手续后，适当调低基金申购费率，并进行公告。

### 3、申购份额与赎回金额的计算及处理方式

#### (1) 申购份额与赎回金额的处理方式

##### 1) 申购份额、余额的处理方式

场外申购时，基金份额的有效申购份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以有效申请当日基金份额净值为基准计算，四舍五入保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

场内申购时，基金份额的有效申购份额由申购金额扣除申购费用后除以申购申请当日的基金份额净值确定。先按四舍五入的原则保留到小数点后两位，再按截位法保留到整数位，小数部分对应的剩余金额由场内证券经营机构退还投资者。

##### 2) 赎回金额的处理方式

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以有效申请当日基金份额净值并扣除相应的费用，四舍五入保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

#### (2) 申购份额的计算

基金份额以申购金额为基数采用比例费率计算申购费用。基金份额的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中：

当申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方法如下：

$$\text{申购费} = \text{有效申购金额} \times \text{申购费率} / (1 + \text{申购费率})$$

申购份额 = (有效申购金额 - 申购费) / 基金份额净值  
当申购费用为固定金额时，申购份数的计算方法如下：

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

$$\text{申购份额} = (\text{有效申购金额} - \text{申购费}) / \text{基金份额净值}$$

例：某投资者投资10万元场外申购本基金，对应申购费率为1.5%，假设申购当日基金份额净值为1.628元，若投资者选择场外申购，则其可得到的申购份额为：

$$\text{申购费} = 100,000 \times 1.5\% / (1 + 1.5\%) = 1,477.83 \text{元}$$

$$\text{申购份额} = (100,000 - 1,477.83) / 1.628 = 60,517.30 \text{份}$$

即：若该投资者选择场外申购，则投资10万元，假设申购当日基金份额净值为1.628元，可得到60,517.30份本基金份额。

若投资者选择场内申购，场内申购份额保留至整数份，故投资者申购所得份额为60,517份，整数位后小数部分的申购份额对应的资金返还投资者。退款金额为：

$$\text{实际净申购金额} = 60,517 \times 1.628 = 98,521.68 \text{元}$$

$$\text{退款金额} = 100,000 - 98,521.68 - 1,477.83 = 0.49 \text{元}$$

### (3) 赎回金额的计算

场外基金份额以赎回总额为基数采用比例费率计算赎回费用，场内基金份额以赎回总额为基数采取固定赎回费率计算赎回费用。基金份额的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中，

$$\text{赎回确认份额} = \text{赎回申请份额} \times \text{赎回确认比例}$$

$$\text{赎回费} = \sum (\text{赎回明细确认份额} \times \text{基金份额净值} \times \text{赎回费率})$$

$$\text{赎回惩罚性费用} = \sum (\text{赎回明细确认份额} \times \text{基金份额净值} \times \text{惩罚性费用费率})$$

$$\text{赎回确认金额} = \text{赎回确认份额} \times \text{基金份额净值} - \text{赎回费} - \text{赎回惩罚性费用}$$

$$\text{赎回确认金额} = \text{赎回确认份额} \times \text{基金份额净值} - \text{赎回费} - \text{赎回惩罚性费用}$$

赎回惩罚性费用仅适用于场外份额赎回申请，不适用于场内份额赎回申请。

例：某投资者场外一笔赎回本基金10万份，持有时间2年以上，对应的赎回费率为0%，假设赎回当日基金份额净值是1.528元，且当日赎回全部确认成功，则其可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回总额} = 100,000 \times 1.528 = 152,800.00 \text{元}$$

$$\text{赎回费用} = 152,800.00 \times 0\% = 0 \text{元}$$

$$\text{赎回金额} = 152,800.00 - 0 = 152,800.00 \text{元}$$

即：投资者在场外赎回本基金10万份，持有时间2年以上，假设赎回当日基金份额净值是1.528元，则其可得到的赎回金额为152,800.00元。

例：某投资者场内一笔赎回本基金10万份，对应的赎回费率为0.50%，假设赎回当日基金份额净值是1.528元，且当日赎回全部确认成功，则其可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回总额} = 100,000 \times 1.528 = 152,800.00 \text{元}$$



赎回费用=152,800.00×0.50%=764.00元

赎回金额=152,800.00-764.00=152,036.00元

即：投资者在场内赎回本基金10万份，对应的赎回费率为0.5%，假设赎回当日基金份额净值是1.528元，则其可得到的赎回金额为152,036.00元。

4、本基金转为上市开放式基金（LOF）后，当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性，具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

#### 八、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

1、因不可抗力导致基金无法正常运作或者因不可抗力导致基金管理人无法接受投资者的申购申请。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资者的申购申请。当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停基金估值，并采取暂停接受基金申购申请的措施。

3、证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、基金管理人接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。

6、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、登记系统或基金会计系统无法正常运行。

7、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%，或者变相规避50%集中度的情形时。基金管理人使用固有资金、公司高级管理人员及基金经理等人员持有的基金份额除外。

8、某笔或某些申购申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单一投资者单日或单笔申购金额上限的。

9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、6、9 项情形之一且基金管理人决定暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资者。当发生上述第 7 项、第 8 项情形时，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资者的申购申请进行限制，基金管理人有权拒绝该笔全部或部分申购申请。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### 九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项，以及因不可抗力导致基金管理人无法接受基金份额持有人的赎回申请。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项。当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停基金估值，并采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。

3、证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，基金管理人可暂停接受投资者的赎回申请。

6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，对于已接受的赎回申请，未支付部分可延期支付。若出现上述第 4 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请场外赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。对于场内赎

回部分，按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

#### 十、巨额赎回的情形及处理方式

本基金巨额赎回的情形及处理方式仅适用于本基金转为上市开放式基金（LOF）后的情况。在基金合同生效后前五年内，不存在巨额赎回的情形，具体的申购赎回情形及处理方式，参照基金合同约定的申购赎回原则与申购赎回程序执行。

##### 1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过前一开放日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

##### 2、巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。当本基金出现巨额赎回且现金不足以支付赎回款项时，基金管理人应当在充分评估基金组合资产变现能力、投资比例变动与基金单位份额净值波动的基础上，审慎接受、确认赎回申请，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。

（1）全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资者的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为因支付投资者的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10% 的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资者在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资者在提交赎回申请时未作明确选择，投资者未能赎回

部分作自动延期赎回处理。

若基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人的赎回申请超过基金总份额40%以上的情形下，基金管理人可以对该单个基金份额持有人超过前述约定比例的赎回申请实施延期办理。

对于未能赎回部分，投资者在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回区别处理。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，如单个基金份额持有人被延期的赎回申请份额在下一开放日仍超过基金总份额的40%，则仍按上述规则办理，以此类推，直到全部赎回为止。如投资者在提交赎回申请时未作明确选择，投资者未能赎回部分作自动延期赎回处理。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

对该单个基金份额持有人未超过前述比例的赎回申请，基金管理人有权根据上述“(1) 全额赎回”或“(2) 部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。

(3) 暂停赎回：连续2个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过20个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。

3、当出现巨额赎回时，场内赎回申请按照深圳证券交易所和登记机构的有关业务规则办理，基金转换中转出份额的申请的处理方式遵照相关的业务规则及届时开展转换业务的公告。

#### 4、巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在3个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒介上刊登公告。

#### 十一、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并在规定期限内指定媒介上刊登暂停申购或赎回的公告。

2、基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的

有关规定，最迟于重新开放日在指定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告，并公布最近 1 个开放日或最近 1 个工作日（暂停时间超过 1 日时适用）的基金份额净值；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间和基金份额净值的确定方式，届时不再另行发布重新开放的公告。

## 十二、基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

## 十三、定期定额投资计划

基金管理人可以为投资者办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人另行规定。投资者在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

## 十四、基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资者。

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理，并按基金登记机构规定的标准收费。

## 十五、基金的转托管

基金份额持有人可根据登记机构的相关规定办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，包括系统内转托管和跨系统转托管，基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。募集期内本基金不得办理系统内转托管和跨系统转

托管。

#### 十六、基金份额的冻结、解冻和质押

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益根据有权机关要求及登记机构业务规则决定是否一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配与支付。

如相关法律法规允许基金管理人办理基金份额的质押业务或其他基金业务，基金管理人将制定和实施相应的业务规则。

## 第六部分 基金的投资目标

基于对宏观经济、资本市场的深入分析和理解，在基金合同生效后前五年内，深入挖掘并充分理解国内经济增长和结构转型所带来的定向增发投资机会，力争在参与定增项目的基础上，提升流动性和收益水平，获取超越业绩比较基准的收益，追求基金资产的长期稳定增值。本基金转为上市开放式基金（LOF）后，通过深入挖掘国内经济增长和结构转型所带来的投资机会，精选具有估值优势和成长优势的公司股票进行投资，力争获取超越各阶段业绩比较基准的收益，追求基金资产的长期稳定增值。

## 第七部分 基金的投资范围

本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票（包括创业板、中小板股票及其他经中国证监会核准发行的股票），债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产，权证，股指期货，货币市场工具，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。

本基金的投资组合比例为：

基金合同生效后前五年内，股票资产占基金资产的比例为 0%-95%；非公开发行股票资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；每个交易日日终在扣除股指

期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保持现金或到期日在一年以内的政府债券比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金转为上市开放式基金（LOF）后，股票资产占基金资产的比例为 0%-95%；非公开发行股票资产占基金资产的比例不超过 20%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保持现金或者到期日在一年以内的政府债券比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

## 第八部分 基金的投资策略

本基金在基金合同生效后前五年内，通过对宏观经济、资本市场的深入分析和理解，深入挖掘并充分理解国内经济增长和结构转型所带来的定向增发投资机会，在行业分析轮动效应与定向增发项目优势的深入研究的基础上，利用定向增发项目的事件性特征与折价优势，优选能够改善、提升企业基本面与经营状况的定向增发主题相关证券进行投资。将定向增发改善企业基本面与产业结构作为投资主线，形成以定向增发为核心的投资策略。

### 1、大类资产配置策略

本基金通过对宏观经济环境、财政及货币政策、资金供需情况等因素的综合分析以及对资本市场趋势的判断，结合主要大类资产的相对估值，合理确定基金在股票、债券、现金等各类资产类别上的投资比例，并在基金合同投资范围约定的范围下适时进行动态调整。

### 2、定向增发股票投资策略

本基金从估值水平和发展前景两个角度出发，分析不同类别的定向增发项目对企业基本面与所处行业的影响。采取定性和定量分析相结合的方法对影响上市公司定向增发项目未来的价值进行全面的分析，精选股价受益或未能充分体现定向增发项目发展潜力的股票，在严格掌控投资组合风险与收益的前提下，对行业进行优化配置和动态调整。

本基金的股票定量分析方法将在现有定向增发项目的基础之上，分析市场现

有定向增发项目中各行业公司的估值指标（如 PE、PB、PE/G、PS、股息率等）、成长性指标（主营业务收入增长率、净利润增长率、毛利率增长率、净利润现金保障倍数等）、现金流量指标和其他财务指标，从中选出价值相对低估、成长性确定、现金流量状况好、盈利能力和偿债能力强的公司，作为本基金的备选定向增发股票；再通过分析备选股票所代表的公司的资产收益率、资产周转率等变量的时间序列，以及通过对市场整体估值水平、行业估值水平、主要竞争对手估值水平的比较，并参考国际市场估值水平来评估其投资价值。

在定量分析的基础上，本基金的股票定性分析方法采用深度价值挖掘和多层面立体投资分析体系，从定向增发项目目的，定向增发对象结构，定向增发项目类别，并结合基金管理人的股票研究平台和产业投资平台，多层面地分析备选定向增发项目所对应的公司的业务环节的竞争优势和劣势，分析定向增发项目对公司未来的影响，公司管理方面的优势和劣势，分析定向增发项目对所处行业的波特五力结构与上下游产业的影响。

经过严格的定量分析和定性分析，最终确定股票投资组合，并适时进行投资组合调整。

本基金将定向增发根据其本身的性质，发行对象，项目类别，对企业的实际影响细化为如下几个方面：

#### （1）大股东主导的定向增发投资

大股东主导的定向增发项目包括集团公司整体上市，实际控制人资产注入，公司间资产置换重组中发行对象包含大股东或者大股东关联方，以及融资收购资产中收购大股东资产的几种定向增发项目。从根本上来说，此类项目不仅直接改变公司的资产结构，同时也会对企业未来在生产、经营、管理等多个方面产生影响。本基金通过定性和定量方法对大股东的增资目的、增发资产的质量等方面，对定向增发项目可能带来的影响进行模拟分析，挑选具有绝对或相对估值吸引力的公司股票，再通过分析和评估股权变化，结合预期盈利水平和成长潜力，择优选取安全边际较高、成长性较好的公司进行投资。

#### （2）项目融资类定向增发投资

项目融资类的定向增发项目为定向增发项目中最常见的类别，目前市场上近一半的定向增发项目为项目融资类。



项目融资类的定向增发项目的特点在于公司在融资项目完成后，无法在短期显现其盈利能力。在项目完工后，公司的财务绩效逐步体现，公司盈利能力逐步改善。同时，募集资金的规模，机构投资者的认购比例对公司财务表现有一定的影响。

本基金对项目融资类定向增发项目将详细评估项目具体投资方向，预测其对企业基本面指标的影响，将通过筛选与分析业绩变化情况，自下而上评估，结合公司基本面情况，择优选取成长性好，安全边际高的公司进行投资。

### （3）非大股东方参与资产重组的定向增发投资

通过定向增发项目实现资产重组是企业与其他主体对企业资产的分布状态进行重新组合、调整、配置的过程，或对设在企业资产上的权利进行重新配置的过程。重组前后公司的估值往往会有明显的改变。

由于此类资产重组为非大股东方参与，通常会对公司带来正面影响，本基金将关注资产重组类定向增发项目对增发公司业务范围、行业地位与市场份额的变化，通过定量与定性分析在市场上收集公开的事件信息，对事件影响中的公司进行分析与估值，挑选具有吸引力的公司股票。

### （4）融资收购非大股东方资产的定向增发投资

对于融资收购非大股东方资产的定向增发项目，长期来看，公司能够通过定向增发项目中收归的资产实现企业基本面指标的优化，通过上下游产业并购、合并同业竞争对手或跨行业并购实现公司主营业务的拓展，减少公司运营成本或大幅提升市场占有率来重组企业现有资源，提升经营业绩。重组前后公司的估值往往会有明显的改变。

本基金将着重关注此类定向增发项目对增发公司业务范围、行业地位与市场份额的变化，通过定量与定性分析在市场上收集公开的事件信息，对事件影响中的公司进行分析与估值，挑选具有吸引力的公司股票。

### （5）壳公司重组的定向增发投资

由于 A 股市场上市公司的稀缺性，壳公司重组类的定向增发对壳公司的基本面产生重大改变。其具体运作模式为非上市公司购买壳收购目标成为上市公司，本基金在投资壳公司重组的定向增发项目时，会考察借壳公司过往业绩，股东情况，业务前景，壳公司资产负债剥离情况等一系列财务与基本面指标，并结合行

业分析与估值，挑选具有吸引力能够带来长期稳定收益的股票。

本基金将深入研究不同类别的定向增发项目在不同期限内对公司基本面的影响，分析基本面变化，根据定向增发项目类别择优参加，尽可能获取定向增发项目给投资者带来的超额收益。

### 3、债券投资策略

本基金通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类属的收益率水平、流动性和信用风险等因素的基础上，构建债券投资组合。本基金将运用多种策略配置非投资于定向增发项目的基金资产，在保持久期匹配的情况下，尽可能提高闲置资金的收益率。

### 4、资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利差分析和公司基本面分析、把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后的收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

### 5、权证投资策略

本基金将按照相关法律法规通过利用权证进行套利、避险交易，控制基金组合风险，获取超额收益。本基金进行权证投资时，将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上，结合股价波动率等参数，运用数量化定价模型，确定其合理内在价值，构建交易组合。

### 6、股指期货的投资策略

基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指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，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将运用股指期货来对冲诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。

(二) 本基金转为上市开放式基金(LOF)后，通过深入挖掘国内经济增长和结构转型所带来的投资机会，精选具有估值优势和成长优势的公司股票进行投资，力争获取超越各阶段业绩比较基准的收益，追求基金资产的长期稳定增值。

### 1、大类资产配置策略

本基金主要通过对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析，在评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率的基础上，动态优化调整权益类、固定收益类大类资产的配置。在严格控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的绝对回报。

## 2、股票投资策略

股票投资策略方面，本基金采用定性分析方法和定量分析方法相结合的策略进行股票投资。

本基金的股票定性分析方法采用深度价值挖掘和多层面立体投资分析体系。在灵活的类别资产配置的基础上，本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司，严选其中安全边际较高的个股构建投资组合：自上而下地分析行业的成长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会；自下而上地评判企业的产品、核心竞争力、管理层、治理结构等；并结合企业基本面和估值水平进行综合的研判，严选安全边际较高的个股。

在定性分析的基础上，本基金的股票定量分析方法将分析备选股票的估值指标（如 PE、PB、PE/G、PS、股息率等）、成长性指标（主营业务收入增长率、净利润增长率、毛利率增长率、净利润现金保障倍数等）、现金流量指标和其他财务指标，再通过比较市场整体估值水平、行业估值水平、主要竞争对手估值水平，并参考国际市场估值水平，来评估备选股票价值提升带来的投资机会。

## 3、固定收益投资策略

本基金通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类属的收益率水平、流动性和信用风险等因素的基础上，构建债券投资组合。本基金运用久期控制策略、期限结构配置策略、类属配置策略、骑乘策略、杠杆放大策略等多种策略进行债券投资。

## 4、资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利差分析和公司基本面分析、把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后的收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

## 5、权证投资策略

本基金将按照相关法律法规通过利用权证进行套利、避险交易，控制基金组合风险，获取超额收益。本基金进行权证投资时，将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上，结合股价波动率等参数，运用数量化定价模型，确定其合理内在价值，构建交易组合。

#### 6、股指期货的投资策略

基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指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，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将运用股指期货来对冲诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。

## 第九部分 基金的业绩比较基准

1、本基金业绩比较基准为：

沪深300指数收益率×60%+中债总指数（总值）财富指数收益率×40%

本基金股票投资部分选取沪深300指数作为业绩比较基准，该指数能够较为全面地反映中国股票市场的状况；债券投资部分选择中债总指数（总值）财富指数作为业绩比较基准，该指数能够较为全面地反映中国固定收益市场的状况，具有广泛的市场代表性。

2、如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准时，本基金管理人与基金托管人协商一致，可以变更业绩比较基准，在履行适当程序后报中国证监会备案，并在中国证监会指定媒介及时公告，无需召开基金份额持有人大会。

## 第十部分 基金的风险收益特征

本基金属于混合型证券投资基金，一般情况下其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，属于中高风险收益特征的证券投资基金品种。

## 第十一部分 基金投资组合报告

本公司的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或

重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人根据本基金合同规定，复核了本报告中的净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2018 年 6 月 30 日。

## 1.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	177,825,283.67	56.02
	其中：股票	177,825,283.67	56.02
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	100,000,000.00	31.50
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	39,477,871.98	12.44
8	其他各项资产	120,546.20	0.04
9	合计	317,423,701.85	100.00

## 1.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	10,253,722.66	3.24
C	制造业	136,669,771.70	43.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,500,711.05	0.79
E	建筑业	9,389,515.80	2.97
F	批发和零售业	586,000.00	0.19
G	交通运输、仓储和邮政业	280,991.28	0.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,320,358.61	1.05

J	金融业	1,486,141.00	0.47
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	574,200.00	0.18
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	12,051,634.48	3.81
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	712,237.09	0.22
	合计	177,825,283.67	56.17

### 1.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票投资组合。

### 1.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002050	三花智控	1,533,333	26,779,661.43	8.46
2	600498	烽火通信	1,131,648	26,016,587.52	8.22
3	603799	华友钴业	266,792	23,429,673.44	7.40
4	603889	新澳股份	2,305,918	23,197,535.08	7.33
5	300347	泰格医药	191,318	11,242,802.27	3.55
6	600339	中油工程	2,479,286	10,253,722.66	3.24
7	002709	天赐材料	213,528	7,683,805.08	2.43
8	300457	赢合科技	261,210	5,404,434.90	1.71
9	002475	立讯精密	230,000	5,184,200.00	1.64
10	002310	东方园林	358,680	5,139,884.40	1.62
11	000065	北方国际	574,986	4,249,631.40	1.34
12	002463	沪电股份	1,100,000	4,114,000.00	1.30
13	000901	航天科技	412,500	3,889,875.00	1.23
14	000555	神州信息	271,083	3,320,358.61	1.05
15	000519	中兵红箭	411,282	2,924,215.02	0.92
16	000862	银星能源	853,485	2,500,711.05	0.79
17	300213	佳讯飞鸿	375,814	2,209,786.32	0.70
18	002611	东方精工	170,723	1,011,534.02	0.32
19	603868	飞科电器	18,500	894,845.00	0.28

20	002281	光迅科技	39,000	826,800.00	0.26
21	300015	爱尔眼科	25,049	808,832.21	0.26
22	002508	老板电器	26,000	796,120.00	0.25
23	300003	乐普医疗	20,200	740,936.00	0.23
24	000909	数源科技	99,893	712,237.09	0.22
25	603816	顾家家居	8,583	630,936.33	0.20
26	601688	华泰证券	40,100	600,297.00	0.19
27	600297	广汇汽车	100,000	586,000.00	0.19
28	002027	分众传媒	60,000	574,200.00	0.18
29	000333	美的集团	10,000	522,200.00	0.16
30	002142	宁波银行	27,600	449,604.00	0.14
31	601398	工商银行	82,000	436,240.00	0.14
32	002157	正邦科技	106,576	412,626.56	0.13
33	002040	南京港	33,692	280,991.28	0.09

#### 1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 1.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300457	赢合科技	5,999,993.70	1.79
2	603868	飞科电器	1,015,392.00	0.30
3	002508	老板电器	997,148.00	0.30
4	002281	光迅科技	970,386.00	0.29
5	600297	广汇汽车	670,330.00	0.20
6	002027	分众传媒	573,000.00	0.17
7	000333	美的集团	549,000.00	0.16
8	002463	沪电股份	420,000.00	0.13

##### 1.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	603799	华友钴业	17,471,169.00	5.21

2	000065	北方国际	15,256,613.79	4.55
3	600339	中油工程	13,351,085.00	3.98
4	002475	立讯精密	6,910,045.26	2.06
5	000862	银星能源	3,483,152.08	1.04
6	000519	中兵红箭	3,301,591.00	0.98
7	000555	神州信息	1,440,546.00	0.43
8	000909	数源科技	1,010,452.51	0.30
9	000651	格力电器	549,584.00	0.16
10	300394	天孚通信	446,026.00	0.13
11	002040	南京港	387,469.50	0.12
12	002157	正邦科技	317,000.00	0.09

### 1.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	11,195,249.70
卖出股票收入（成交）总额	63,924,734.14

注：本项中 1.4.1、1.4.2 和 1.4.3 表中的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 1.5 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。

### 1.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

### 1.8 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。

### 1.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。



## 1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 1.10.1 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。

### 1.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

## 1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 1.11.1 本期国债期货投资政策

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

### 1.11.2 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。

### 1.11.3 本期国债期货投资评价

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

## 1.12 投资组合报告附注

### 1.12.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

### 1.12.2

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

### 1.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	64,172.93
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	56,373.27
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	
9	合计	120,546.20

#### 1.12.4 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。

#### 1.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002050	三花智控	26,779,661.43	8.46	非公开发行流通受限
2	600498	烽火通信	26,016,587.52	8.22	非公开发行流通受限
3	603799	华友钴业	23,429,673.44	7.40	非公开发行流通受限
4	603889	新澳股份	23,197,535.08	7.33	非公开发行流通受限
5	300347	泰格医药	5,324,379.94	1.68	非公开发行流通受限
6	600339	中油工程	10,075,725.59	3.18	非公开发行流通受限
7	002709	天赐材料	7,683,805.08	2.43	非公开发行流通受限
8	300457	赢合科技	5,404,434.90	1.71	非公开发行流通受限
9	002310	东方园林	5,139,884.40	1.62	非公开发行流通受限

#### 1.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 第十二部分 基金的业绩

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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较：

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
自成立以来 -2016.12.31	-0.34%	0.08%	-0.07%	0.46%	-0.27%	-0.38%
2017.01.01-2	0.29%	0.69%	12.15%	0.39%	-11.86%	0.30%

017.12.31						
2018.1.1- 2018.6.30	-5.62%	1.09%	-5.96%	0.69%	0.34%	0.40%
自成立以来 -2018.6.30	-5.67%	0.78%	5.39%	0.50%	-11.06%	0.28%

### 第十三部分 基金费用与税收

#### 一、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、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、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；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券、期货交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、证券/期货等账户开户费用、账户维护费用；
- 9、基金的上市费和年费；
- 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。

#### 二、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 2.0%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 2.0\% \div \text{当年天数}$$

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，经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，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

##### 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 0.25%的年费率计提。托管费的计

算方法如下：

$$H=E\times 0.25\%\div\text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，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取，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

上述“一、基金费用的种类中第 3—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。

### 三、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，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；
- 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。

### 四、费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售费率等相关费率。

调整基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议。

基金管理人必须依照《信息披露办法》的有关规定于新的费率实施日前 2 日在至少一种指定媒介上公告。

### 五、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执

行。

#### 第十四部分 对招募说明书更新部分的说明

- 1、更新了“重要提示”的内容；
- 2、更新了“前言”的内容；
- 3、更新了“释义”的内容；
- 4、在“三、基金管理人”中，对基金管理人的内容进行了更新；
- 3、在“四、基金托管人”中，对基金托管人的内容进行了更新；
- 4、在“五、相关服务机构”中，更新了相关服务机构的内容；
- 5、在“八、基金份额的运作方式、申购与赎回”中更新了基金份额的运作方式、申购与赎回相关内容；
- 6、在“九、基金的投资”中，更新了投资范围、投资限制、投资组合报告相关内容；
- 7、在“十、基金的业绩”部分，更新了基金业绩；
- 8、在“十二、基金资产估值”部分，更新了基金估值方法等内容；
- 9、在“十七、基金的信息披露”部分，更新了公开披露的基金信息相关内容。
- 10、在“二十一、基金托管协议的内容摘要”部分，更新了基金托管协议的内容摘要的相关内容；
- 11、在“二十三、其他应披露事项”部分，根据相关公告的内容进行了更新。

上述内容仅为本基金更新招募说明书的摘要，详细资料须以本基金招募说明书更新正文所载内容为准。欲查询本招募说明书更新详细内容，可登陆九泰基金管理有限公司网站。

九泰基金管理有限公司

2018年11月10日