

**(上)鹏华686**  
(108)天证证券股份有限公司

办公地址: 深圳市福田区益田路5033号平安国际金融中心37楼  
注册地址: 深圳市福田区益田路5033号平安国际金融中心37楼  
法定代表人: 马明  
电话: 027-87571071  
网址: http://www.ph.com.cn

**(09)南京普兰三德投资咨询有限公司**

办公地址: 南京市雨花台区铁心桥新城科技园1606室  
注册地址: 南京市雨花台区铁心桥新城科技园1606室  
法定代表人: 马勇  
电话: 010-83661061  
网址: http://www.ph.com.cn

**(11)上海挖财基金销售有限公司**

办公地址: 中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5层02-03室  
注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5层02-03室  
法定代表人: 李飞  
电话: 021-50810687  
网址: http://www.wacaijin.com

**(11)蚂蚁财富(杭州)基金销售有限公司**

办公地址: 浙江省杭州市西湖区文二西路121号1202室  
注册地址: 浙江省杭州市西湖区文二西路121号1202室  
法定代表人: 蒋智勇  
电话: 021-60897800  
网址: http://www.fund123.com

**(11)北京汇成基金销售有限公司**

办公地址: 北京朝阳区东三环中路1号11层1106号  
注册地址: 北京朝阳区东三环中路1号11层1106号  
法定代表人: 李勇  
电话: 010-56810688  
网址: http://www.hcfund.com

**(11)上海万得基金销售有限公司**

办公地址: 中国(上海)自由贸易试验区峨山路3199号  
注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区峨山路3199号11楼B座  
法定代表人: 王廷富  
电话: 021-68862260  
网址: http://www.wendfund.com.cn

**(11)凤凰金信(银川)基金销售有限公司**

办公地址: 宁夏回族自治区银川市凤凰街142号1412号1412室  
注册地址: 宁夏回族自治区银川市凤凰街142号1412号1412室  
法定代表人: 邢志军  
电话: 010-58160168  
网址: http://www.fundx.com

**(11)和信传承基金销售有限公司**

办公地址: 郑州市郑东新区东风东路东经三路16号6楼603号  
注册地址: 郑州市郑东新区东风东路东经三路16号6楼603号  
法定代表人: 李娜  
电话: 0371-85183939  
网址: HUGOCIB.COM

**(11)南京浦银基金销售有限公司**

办公地址: 南京市玄武区玄武大道319号-329  
注册地址: 南京市玄武区玄武大道319号-329  
法定代表人: 王磊  
电话: 025-86855900  
网址: http://www.puyinfund.com

**(11)北京肯瑞得基金销售有限公司**

办公地址: 北京市朝阳区东三环北路11号院1号楼2202-06  
注册地址: 北京市朝阳区东三环北路11号院1号楼2202-06  
法定代表人: 王晶晶  
电话: 010-81918800  
网址: http://fund.jd.com

**(11)北京蛋卷基金销售有限公司**

办公地址: 北京市朝阳区望京东园四区1号楼1002号202内1106号  
注册地址: 北京市朝阳区望京东园四区1号楼1002号202内1106号  
法定代表人: 邢志军  
电话: 010-59166968  
网址: http://www.danjuan.com

**(二)基金销售机构名称:** 基金销售机构名称  
**住所:** 上海市虹口区四川北路3999号上海国金中心二期3509-09-1单元  
**办公地址:** 北京朝阳区建国路118号15层1501-1502号  
**法定代表人:** 赵万平  
**电话:** (010) 16215888  
**联系人:** 张勇  
**网址:** www.jiaming.com

**(三)出具法律意见书的律师事务所名称:** 上海市通力律师事务所  
**住所:** 上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19层  
**办公地址:** 上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19层  
**电话:** (021) 31358666  
**传真:** (021) 31358606  
**负责人:** 吕红  
**经办律师:** 吕红、黎明

**基金销售机构名称:** 基金销售机构名称  
**住所:** 北京市西城区金融大街19号11层1101号  
**办公地址:** 北京市西城区金融大街19号11层1101号  
**法定代表人:** 赵万平  
**电话:** (010) 65215888  
**联系人:** 张勇  
**网址:** www.jiaming.com

**九泉基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”或“本公司”)**已于2018年11月2日在《证券时报》和基金管理人网站(<http://www.jiuan.com>)发布了《关于以通讯方式召开九泉久利灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》,为了便于基金份额持有人行使表决权,现将有关《关于以通讯方式召开九泉久利灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告》全文公告如下:

**九泉基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”或“本公司”)**旗下九泉久利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会证监许可[2015]1547号文批准,依据中国证监会机构部[2016]1269号文件,于2016年11月7日正式成立。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定,九泉久利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)的有关约定,经基金份额持有人事前协商一致,本基金的基金管理人决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会,会议具体事项如下:

**一、会议召开方式:**  
1.会议召集时间:自2018年11月6日09:00至2018年12月2日17:00止(纸质投票以本公告列明的收件人收到表决票时为准,短信投票以基金管理人指定接收表决票时间为准,电话投票以基金管理人电话记录时间为准);  
2.会议召集日期:自表决截止日(即2018年12月2日)起算。

**二、会议召开的程序:**  
(一)表决票的提交  
(二)短信投票形式的提交  
(三)电话投票形式的提交  
(四)纸质投票形式的提交

**三、基金份额持有人的权益登记日**  
本基金的基金份额持有人大会的权益登记日为2018年11月5日,即当天下午交易时间(15:00)结束后,在本基金注册登记机构提供的基金全体基金份额持有人均有参与本次大会的表决权。

**四、基金份额持有人的表决权**  
1.基金份额持有人大会提供纸质投票、短信投票、电话投票三种投票表决方式。  
(一)纸质投票  
2.基金份额持有人应当按照表决要求填写相关内容,其中:  
(1)个人投资者自行投票的,需在表决票上签字,并提供本人身份证件复印件(居民身份证件需提供正反两面复印件);  
(2)机构投资者自行投票的,需在表决票上加盖本机构或其授权的印章(以下称“公章”),并提供合格授权企业的营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的“有权”的授权书,开户证明或登记证书复印件等)合格境外机构投资者自行投票的,需在表决票上加盖机构公章(如有)或授权代表在表决票上签字(如无公章),并提供授权代表的有效身份证件复印件(居民身份证件需提供正反两面复印件),该合格境外机构投资者签署的授权委托书或授权代表有效身份证件复印件及合格境外机构投资者签署的授权书,以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册证明复印件和取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件;

(3)个人投资者委托他人投票的,应在表决票上签字或盖章,并提供被代理的个人投资者身份证件复印件(居民身份证件需提供正反两面复印件),以及该被代理的个人投资者姓名、身份证号码、本人、还需提供代理人的身份证件复印件(居民身份证件需提供正反两面复印件),如代理人为机构,还需提供代理人的加盖公章的企业营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的“有权”的授权书,开户证明或登记证书复印件等);  
(4)机构投资者委托他人投票的,应在表决票上签字或盖章,并提供被代理的机构投资者加盖公章的企业营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的“有权”的授权书,开户证明或登记证书复印件等);以及该被代理的机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册证明复印件和取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件(见附件);

(5)上述直接授权书指定的基金份额持有人或受托代表人出具有效的授权书,同时提供持有的基金份额的凭证,受托人出具有效的授权书,受托人提供有效的凭证及受托人的代理投票授权委托书等符合法律法规、基金合同及本公告的规定,并符合基金登记机构的相关规定,持有基金份额的凭证持有人的身份证件复印件(居民身份证件需提供正反两面复印件),加盖公章的企业营业执照复印件等证明持有人的身份的文件,此类文件所记载的信息与持有人的身份信息在表决票上签字或盖章,并提供被代理的个人投资者身份证件复印件(居民身份证件需提供正反两面复印件),以及该被代理的个人投资者姓名、身份证号码、本人、还需提供代理人的加盖公章的企业营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的“有权”的授权书,开户证明或登记证书复印件等);

(6)机构投资者委托他人投票的,应在表决票上签字或盖章,并提供被代理的机构投资者加盖公章的企业营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的“有权”的授权书,开户证明或登记证书复印件等);以及该被代理的机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册证明复印件和取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件(见附件);

(7)上述直接授权书指定的基金份额持有人或受托代表人出具有效的授权书,同时提供持有的基金份额的凭证,受托人出具有效的授权书,受托人提供有效的凭证及受托人的代理投票授权委托书等符合法律法规、基金合同及本公告的规定,并符合基金登记机构的相关规定,持有基金份额的凭证持有人的身份证件复印件(居民身份证件需提供正反两面复印件),加盖公章的企业营业执照复印件等证明持有人的身份的文件,此类文件所记载的信息与持有人的身份信息在表决票上签字或盖章,并提供被代理的个人投资者身份证件复印件(居民身份证件需提供正反两面复印件),以及该被代理的个人投资者姓名、身份证号码、本人、还需提供代理人的加盖公章的企业营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的“有权”的授权书,开户证明或登记证书复印件等);

(8)机构投资者委托他人投票的,应在表决票上签字或盖章,并提供被代理的机构投资者加盖公章的企业营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的“有权”的授权书,开户证明或登记证书复印件等);以及该被代理的机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册证明复印件和取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件(见附件);

(9)上述直接授权书指定的基金份额持有人或受托代表人出具有效的授权书,同时提供持有的基金份额的凭证,受托人出具有效的授权书,受托人提供有效的凭证及受托人的代理投票授权委托书等符合法律法规、基金合同及本公告的规定,并符合基金登记机构的相关规定,持有基金份额的凭证持有人的身份证件复印件(居民身份证件需提供正反两面复印件),加盖公章的企业营业执照复印件等证明持有人的身份的文件,此类文件所记载的信息与持有人的身份信息在表决票上签字或盖章,并提供被代理的个人投资者身份证件复印件(居民身份证件需提供正反两面复印件),以及该被代理的个人投资者姓名、身份证号码、本人、还需提供代理人的加盖公章的企业营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的“有权”的授权书,开户证明或登记证书复印件等);

(10)机构投资者委托他人投票的,应在表决票上签字或盖章,并提供被代理的机构投资者加盖公章的企业营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的“有权”的授权书,开户证明或登记证书复印件等);以及该被代理的机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册证明复印件和取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件(见附件);

(11)上述直接授权书指定的基金份额持有人或受托代表人出具有效的授权书,同时提供持有的基金份额的凭证,受托人出具有效的授权书,受托人提供有效的凭证及受托人的代理投票授权委托书等符合法律法规、基金合同及本公告的规定,并符合基金登记机构的相关规定,持有基金份额的凭证持有人的身份证件复印件(居民身份证件需提供正反两面复印件),加盖公章的企业营业执照复印件等证明持有人的身份的文件,此类文件所记载的信息与持有人的身份信息在表决票上签字或盖章,并提供被代理的个人投资者身份证件复印件(居民身份证件需提供正反两面复印件),以及该被代理的个人投资者姓名、身份证号码、本人、还需提供代理人的加盖公章的企业营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的“有权”的授权书,开户证明或登记证书复印件等);

**七、基金的投资范围**  
本基金以目标ETF基金份额,标的指数成份股及其备选成份股为主要投资对象,本基金投资于目标ETF资产的比例不低于基金资产净值的90%(已申购尚未赎回的目标ETF份额计入在内),持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%,但不包括现金等价物、存保证金、应收申购款等。此外,为更好地实现投资目标,本基金还可投资于部分中小股股(包括中小盘、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、一级市场股权投资、衍生品(包括权证、股指期货等)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、可转债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、中小企业债、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行承兑票据、信用衍生品、资产证券化产品以及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的相关规定)。

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,待本基金参与股指期货业务的相关规定颁布后,基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险特征并控制风险的前提下,参与股指期货业务及通过证券投资基金间接参与股指期货业务,以更好地实现投资目标,进行风险管理,同时本基金参与股指期货业务等金融衍生品的投资,应符合中国证监会的相关规定,并符合基金合同及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行,无需召开基金份额持有人大会决议。

**八、基金的投资策略**  
本基金以目标ETF为联接基金,主要通过投资于目标ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪,本基金相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年化跟踪误差不得超过4%。标的指数的编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度超过上述范围,基金管理人应采取合理措施降低跟踪误差,力争将跟踪偏离度控制在约定范围之内,基金管理人应采取在投资运作过程中,本基金将综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上,决定采用一级市场申购的方式或证券二级市场买回的方式为目标ETF的买卖,本基金还将通过参与目标ETF基金份额申购赎回,申购赎回的组合套利,以摊薄成本收益。

此外,为更好地实现投资目标,本基金可投资于股指期货等中国证监会允许进行的衍生品金融工具,本基金股指期货投资将遵循风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股票期货合约,本基金力争利用股指期货交易手段,降低股指期货仓位调整的交易成本,达到有效对冲的目的。此外,本基金还可根据法律法规的规定,参与股指期货和融资融券等(更新)等新兴投资品种,包括股指期货、国债期货、商品期货、期权等,并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合约定的投资政策和投资目标。

基金管理人股票期权、期货等金融衍生品工具,须经环境及投资决策委员会的批准。  
本基金依据《基金合同》中约定的标的指数相关规定是基金管理人运用基金资产的投资依据。本基金管理人实行投资决策委员会为核心的基金投资决策机制,投资决策委员会负责决定有关本基金重大调整的事项,其他重要调整的事项须经投资决策委员会审议通过,基金管理人决定日常指数跟踪维护过程中指数的调整以及调仓决策。

研究、决策、组合构建、交易、评估、组合再衡量的有机结合共同构成了本基金的投资管理程序,严格的投资管理程序可以保证投资运作的正确执行,避免重大风险的发生。  
(1)研究:指数投资策略小组依托研究平台,综合国内外信息以及券商等外部研究机构的研究报告,及时捕捉市场投资机会,参与投资决策,寻找具有投资价值的标的,并跟踪标的成份股和权重信息的搜集与分析,作为基金投资决策的重要依据。  
(2)投资:投资决策委员会依据指数投资策略研究小组提供的研究报告,定期召开或不定期的投资决策委员会会议,决策有关事项,基金管理人根据投资决策委员会的决议,每日进行基金投资组合的调整。

(3)交易执行:集中交易负责基金的交易执行,同时执行一级市场的申购。  
(4)投资组合管理:跟踪标的指数,定期和不定期地对基金投资组合进行调整,并提供投资建议,使投资组合始终跟踪标的指数,并控制跟踪误差。  
(5)风险监控与调整:基金跟踪偏离度跟踪误差跟踪误差分析,并出具分析报告。基金跟踪偏离度跟踪误差分析,包括投资组合跟踪误差跟踪误差分析,并出具分析报告。  
(6)投资组合管理:跟踪标的指数,定期和不定期地对基金投资组合进行调整,并提供投资建议,使投资组合始终跟踪标的指数,并控制跟踪误差。

基金管理人确保基金份额持有人利益的前提下,有权根据环境及实际情况对本投资组合进行申购赎回,并在基金招募说明书及其更新中公告。  
**(四)投资组合的建立**  
在基金建仓期,为避免可能因二级市场造成价格冲击,基金经理将主要采取一级市场申购的方式完成基金建仓期的跟踪投资。  
**九、基金的投资组合报告**  
(一)投资组合报告  
(1)本基金根据投资决策委员会的指导意见调整资产配置方案。  
(2)本基金经理每日根据本基金申购赎回情况以及已有持仓情况,在符合基金合同、风险、效率、成本等因素的基础上,决定采用一级市场申购的方式或证券二级市场买回的方式为目标ETF的买卖。  
(3)通常情况下,联接基金的投资组合主要持有目标ETF基金份额,对于目标ETF暂时停牌,停牌期间其原因导致基金投资组合中出现的股票,基金经理将根据市场情况按照本基金的投资策略买入其他股票品种进行投资。

**九、基金的投资组合报告**  
本基金的投资组合报告于2018年6月30日(“报告期末”),本报告所列财务报表数据未经审计。  
**1. 报告期末基金资产组合情况**

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	32,909,164.11	3.71
	其中:股票	32,909,164.11	3.71
2	基金投资	796,435,883.81	90.27
3	固定收益投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	金融资产公允价值变动	-	-
6	其他资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	90,763,387.77	5.73
8	其他资产	2,824,616.63	0.25
9	合计	826,933,052.32	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	医药生物_制造业	332,123.43	0.04
B	银行_金融业	765,815.74	0.09
C	计算机_信息技术	19,251,013.07	2.31
D	电力、热力、燃气及水利生产和供应业_公用事业	1,396,350.38	0.16
E	国防军工_国防军工	831,794.20	0.09
F	农林牧渔_农林牧渔	1,701,877.72	0.19
G	交通运输_交通运输	1,290,232.32	0.15
H	有色金属_有色金属	173,645.03	0.02
I	信息技术_软件和信息技术服务业	3,032,441.84	0.34
J	金融保险_保险	71,208.47	0.009
K	房地产业_房地产业	1,706,482.49	0.19
L	租赁和商务服务业_租赁和商务服务业	887,833.23	0.07
M	科学研究和技术服务业_软件和信息技术服务业	53,119.08	0.006
N	水利、环境和公共设施管理业_水利、环境和公共设施管理业	209,346.41	0.02
O	国防军工_国防军工	71,208.47	0.009
P	医药生物_医药生物	227,114.00	0.02
Q	医药生物_医药生物	45,263.00	0.005
R	医药生物_医药生物	667,801.00	0.08
S	合计	416,511.60	0.05
T	合计	32,909,164.11	3.74

**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	000061	长春高新	1,200	273,280.00	0.03
2	000009	深宝安	38,400	287,240.00	0.03
3	002216	三旺通信	58,750	251,820.00	0.03
4	000099	华谊九天	8,800	249,900.00	0.03
5	600765	中航证券	27,800	206,832.00	0.02
6	603085	中研股份	12,900	191,543.00	0.02
7	603019	中利科技	4,100	188,700.00	0.02
8	000098	华工科技	13,000	187,850.00	0.02
9	600521	华海药业	6,840	182,560.00	0.02
10	002091	顺络电子	16,400	181,540.00	0.02

**4. 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债券投资明细**

报告期末,本基金未持有债券。  
**5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资**  
报告期末,本基金未持有资产支持证券。  
**6. 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**  
报告期末,本基金未持有贵金属。  
**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权证投资**  
报告期末,本基金未持有权证。  
**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权证投资**  
报告期末,本基金未持有权证。  
**9. 期末投资资产组合明细**

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	鹏华中心	货币型	契约型开放式	鹏华基金管理有限公司	796,435,883.81	90.40

**10. 报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明**  
**11. 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明**

代码	名称	持仓量(张)	合约市值(元)	公允价值(元)	损益情况
IC1812	IC1812	3	3,000,000.00	-284,000.00	-
IC1808	IC1808	1	1,028,400.00	39,200.00	-
IC1809	IC1809	1	1,028,400.00	-244,800.00	-
IF1809	IF1809	1	1,028,400.00	171,600.00	-
IF1812	IF1812	1	1,028,400.00	-604,520.00	-

**12. 投资组合报告附注**  
(1)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的投资主体未受到公开谴责、处罚。  
(2)本基金投资的前十名证券中,没有出现在中国证监会公布的违法违规证券发行主体的名单。  
(3)其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存保证金	900,123.71
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	10,687.68
5	其他应收款	1,338,234.60
6	其他	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,249,051.63

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细  
报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。  
(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明  
报告期末,本基金前十名股票中不存在流通受限情况。  
**十三、投资组合报告附注**  
基金管理人恪尽职守,诚实守信,谨慎勤勉,切实履行受托人和受托基金管理人义务,但本基金在做出投资决策时,对基金总体风险的影响较小,并不存在既定的投资政策和投资目标。  
1. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
2. 报告期末本基金参与的国债期货交易  
3. 投资组合报告附注

序号	名称	金额(元)
1	存保证金	900,123.71
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	10,687.68
5	其他应收款	1,338,234.60
6	其他	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,249,051.63

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细  
报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。  
(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明  
报告期末,本基金前十名股票中不存在流通受限情况。  
**十三、投资组合报告附注**  
基金管理人恪尽职守,诚实守信,谨慎勤勉,切实履行受托人和受托基金管理人义务,但本基金在做出投资决策时,对基金总体风险的影响较小,并不存在既定的投资政策和投资目标。  
1. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
2. 报告期末本基金参与的国债期货交易  
3. 投资组合报告附注

序号	名称	金额(元)
1	存保证金	900,123.71
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	10,687.68
5	其他应收款	1,338,234.60
6	其他	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,249,051.63

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细  
报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。  
(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明  
报告期末,本基金前十名股票中不存在流通受限情况。  
**十三、投资组合报告附注**  
基金管理人恪尽职守,诚实守信,谨慎勤勉,切实履行受托人和受托基金管理人义务,但本基金在做出投资决策时,对基金总体风险的影响较小,并不存在既定的投资政策和投资目标。  
1. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
2. 报告期末本基金参与的国债期货交易  
3. 投资组合报告附注

序号	名称	金额(元)
1	存保证金	900,123.71
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	10,687.68
5	其他应收款	1,338,234.60
6	其他	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,249,051.63

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细  
报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。  
(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明  
报告期末,本基金前十名股票中不存在流通受限情况。  
**十三、投资组合报告附注**  
基金管理人恪尽职守,诚实守信,谨慎勤勉,切实履行受托人和受托基金管理人义务,但本基金在做出投资决策时,对基金总体风险的影响较小,并不存在既定的投资政策和投资目标。  
1. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
2. 报告期末本基金参与的国债期货交易  
3. 投资组合报告附注

序号	名称	金额(元)
1	存保证金	900,123.71
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	10,687.68
5	其他应收款	1,338,234.60
6	其他	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,249,051.63

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细  
报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。  
(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明  
报告期末,本基金前十名股票中不存在流通受限情况。  
**十三、投资组合报告附注**  
基金管理人恪尽职守,诚实守信,谨慎勤勉,切实履行受托人和受托基金管理人义务,但本基金在做出投资决策时,对基金总体风险的影响较小,并不存在既定的投资