证券代码：002200　　证券简称：云投生态　　公告编号：2018-131

云南云投生态环境科技股份有限公司
关于 2018 年第十一次临时股东大会增加临时提案暨股东大会补充通知的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

云南云投生态环境科技股份有限公司（以下简称“公司”）第六届董事会第二十三次会议决定于 2018 年 12 月 26 日（星期三）召开 2018 年第十一次临时股东大会，股权登记日为 2018 年 12 月 19 日（具体内容详见公司于 2018 年 12 月 11 日披露于《中国证券报》、《证券日报》、《证券时报》、《上海证券报》及巨潮资讯网的《关于召开 2018 年第十一次临时股东大会的通知》）。2018 年 12 月 14 日，公司董事会接到合计持有公司 23.18%股份的股东云南省投资控股集团有限公司及合计持有公司 6.7%股份的股东徐洪尧提交的《关于提议增加 2018 年第十一次临时股东大会临时提案的函》，云南省投资控股集团有限公司提请公司董事会将《关于向控股股东转让土地使用权及地上附着物暨关联交易的议案》作为临时提案提交至公司 2018 年第十一次临时股东大会审议，徐洪尧提请公司董事会将《关于向控股股东转让成都子公司 100%股权暨关联交易的议案》作为临时提案提交至公司 2018 年第十一次临时股东大会审议。上述议案已经公司第六届董事会第二十四次会议审议通过，具体内容详见 2018 年 12 月 17 日在《中国证券报》、《证券日报》、《证券时报》、《上海证券报》及巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn）披露的相关公告。

根据《中华人民共和国公司法》、《股东大会议事规则》和《公司章程》的有关规定：单独或合计持有公司 3%以上股份的普通股股东，可以在股东大会召开 10 日前提出临时提案并书面提交召集人。云南省投资控股集团有限公司及徐洪尧具有提出临时提案的法定资格，其提案内容未超出相关法律法规和《公司章程》的规定及股东大会职权范围，且提案程序亦符合《深圳证券交易所中小板股票上市规则》、《公司章程》、《公司股东大会议事规则》的相关规定，因此，公司董事会同意将上述临时提案提交至公司 2018 年第十一次临时股东大会审议。因上述临时提案的增加，且增加的提案属于 2018 年第十一次临时股东大会审议的范围，因此公司 2018 年第十一次临时股东大会审议的议案有所变动。除上述变动外，2018 年第十一次临时股东大会审议的议案不变，同时公司于 2018 年 12 月 11 日公告的公司 2018 年第十一次临时股东大会的召开时间、召开地点、召开方式、股权登记日等事项均保持不变。2018 年第十一次临时股东大会的具体补充通知如下：

一、召开会议基本情况

1.股东大会届次：2018 年第十一次临时股东大会；

2.会议召集人：公司董事会；

公司第六届董事会第二十三次会议审议通过了《关于召开 2018 年第十一次临时股东大会的通知》，定于 2018 年 12 月 26 日召开公司 2018 年第十一次临时股东大会。

3.会议召开的合法、合规性：

本次股东大会会议的召集程序符合有关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和公司章程的规定。

4.会议召开时间：

（1）现场会议召开时间：2018 年 12 月 26 日（星期三）下午 14:00 时；

（2）网络投票时间为：通过深圳证券交易所交易系统进行网络投票的具体时间为：2018 年 12 月 26 日上午 9:30－11:30，下午 13:00－15:00；通过深圳证券交易所互联网投票系统投票的具体时间为：2018 年 12 月 25 日 15:00 至 2018 年 12 月 26 日 15:00 期间的任意时间。

5.会议召开方式：本次临时股东大会采取现场投票与网络投票相结合的方式。公司将通过深圳证券交易所交易系统和互联网投票系统向公司股东提供网络形式的投票平台，公司股东可以在上述网络投票时间内通过深圳证券交易所的交易系统或互联网投票系统行使表决权。同一股份只能选择现场投票、网络投票或符合规定的其他投票方式中的一种表决方式。同一表决权出现重复表决的以第一次投票结果为准；

6. 股权登记日：本次股东大会的股权登记日为 2018 年 12 月 19 日（星期三）

7.出席对象：

（1）截止 2018 年 12 月 19 日（星期三）下午收盘时在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司登记在册的公司全体股东均有权出席股东大会。股东可以以书面形式委托代理人出席会议和参加表决，该股东代理人不必是公司的股东；

（2）公司董事、监事和高级管理人员；

（3）公司聘请的见证律师；

（4）董事会邀请的其他嘉宾。

8.现场会议地点：昆明经济技术开发区经浦路 6 号公司总部五楼会议室

二、会议审议事项

1.《关于债权转让暨关联交易的议案》；

2.《关于向控股股东转让土地使用权及地上附着物暨关联交易的议案》；

3.《关于向控股股东转让成都子公司 100%股权暨关联交易的议案》。

根据《上市公司股东大会规则》的要求，本次股东大会审议的议案对中小投资者的表决单独计票，中小投资者是指持股 5%（不含 5%）以下的股东。

2018 年第十一次临时股东大会所有提案内容详见刊登在 2018 年 12 月 11 日、2018 年 12 月 17 日《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》、《中国证券报》、巨潮资讯网上的《第六届董事会第二十三次会议决议公告》、《第六届董事会第二十四次会议决议公告》及相关公告。

三、提案编码

提案编码	提案名称	备注 该列打钩的栏目可以投票
100	总议案：所有议案	√
1.00	关于债权转让暨关联交易的议案	√
2.00	关于向控股股东转让土地使用权及地上附着物暨关联交易的议案	√
3.00	关于向控股股东转让成都子公司 100%股权暨关联交易的议案	√

四、会议登记等事项

（一）登记方方法：

1.登记方式

（1）自然人股东须持本人身份证和证券账户卡进行登记；委托代理人出席会议的，须持本人身份证、授权委托书和委托人证券账户卡进行登记；

（2）法人股东由法定代表人出席会议的，需持营业执照复印件、法定代表人身份证明和持股凭证进行登记；由法定代表人委托的代理人出席会议的，需持本人身份证、营业执照复印件、授权委托书和持股凭证进行登记；

（3）异地股东可以书面信函或传真办理登记，以信函或传真抵达本公司的时间为准。

2.登记时间：2018 年 12 月 20 日上午 9:00-11:30、下午 13:30-17:00

3.登记地点：公司董事会办公室

信函登记地址：公司董事会办公室，信函上请注明“股东大会”字样。

通讯地址：昆明经济技术开发区经浦路 6 号

邮政编码：650217

传真号码：0871-67279185

4.受托人在登记和表决时提交文件的要求

（1）自然人股东委托代理人出席会议的，代理人应出示本人有效身份证件、股东授权委托书。

（2）法定代表人委托代理人出席会议的，代理人应出示本人身份证、法人股东单位的法定代表人依法出具的书面授权委托书。

（3）委托人为法人的，由其法定代表人或者董事会、其他决策机构决议授权的人作为代表出席公司的股东大会。

授权委托书应当注明在委托人不作具体指示的情况下，委托人或代理人是否可以按自己的意思表决。

（二）会议联系方式

1.会务联系人：熊艳芳；

2.联系电话：0871-67279185；传真：0871-67279185；

3.与会股东的食宿及交通费用自理。

五、参与网络投票的具体操作流程

本次股东大会向股东提供网络投票平台，股东可以通过深交所交易系统和互联网投票系统（http://wltp.cninfo.com.cn）参加投票。网络投票的具体操作流程见附件一。

云南云投生态环境科技股份有限公司

董　事　会

2018 年 12 月 17 日

附件一：

参加网络投票的具体操作流程

一、网络投票的程序

1.投票代码和投票简称：投票代码为：“362200”；投票简称为：“云投投票”。

2.填报意见

本次股东大会议案的表决意见为“同意”、“反对”或“弃权”。

3.股东对总议案进行投票，视为对除累积投票提案外的其他所有提案表达相同意见。股东对总议案与具体提案重复投票时，以第一次有效投票为准。如股东先对具体提案投票表决，再对总议案投票表决，则以已投票表决的具体提案的表决意见为准，其他未表决的提案以总议案的表决意见为准；如先对总议案投票表决，再对具体提案投票表决，则以总议案的表决意见为准。

二、通过深交所交易系统投票的程序

1. 投票时间：2018 年 12 月 26 日的交易时间，即 9:30—11:30 和 13:00—15:00。

2.股东可以登录证券公司交易客户端通过交易系统投票。

三、通过深交所互联网投票系统投票的程序

1. 互联网投票系统投票的时间为 2018 年 12 月 25 日下午 15：00 至 12 月 26 日下午 15：00。

2.股东通过互联网投票系统进行网络投票，需按照《深圳证券交易所投资者网络服务身份认证业务指引（2016 年 4 月修订）》的规定办理身份认证，取得“深交所数字证书”或“深交所投资者服务密码”。具体的身份认证流程可登录互联网投票系统 http://wltp.cninfo.com.cn 规则指引栏目查阅。

3.股东根据获取的服务密码或数字证书，可登录 http://wltp.cninfo.com.cn 在规定时间内通过深交所互联网投票系统进行投票。

附件二：

授权委托书

____本人（本单位）作为云南云投生态环境科技股份有限公司的股东，兹委托_____先生 / 女士代表出席云南云投生态环境科技股份有限公司 2018 年第十一次临时股东大会，并于本次股东大会按照以下指示就下列议案投票，如没有做出指示，代理人有权按照自己的意愿表决。

提案编码	提案名称	备注 该列打钩的栏目可以投票	同意	反对	弃权
1	关于债权转让暨关联交易的议案	√			
2	关于向控股股东转让土地使用权及地上附着物暨关联交易的议案	√			
3	关于向控股股东转让成都子公司 100%股权暨关联交易的议案	√			

委托人姓名（签字 / 盖章）：

委托人身份证号码或营业执照：

委托人股东账号：

委托人持股数量：

受托人（签字）：

受托人身份证号码：

委托日期：　　年　　月　　日

本委托有效期：自本委托书签署之日至本次股东大会结束。

说明：1.授权委托人为自然人股东由委托人本人签字，法人股东加盖单位公章并由法定代表人签字。

2.授权委托人对上述审议事项应在签署授权委托书时在相应表格内填写“同意”、“反对”、“弃权”，只能选其一，多选或未选择的，视为对该审议事项的授权委托无效。

3.授权委托书剪报、复印或按以上格式自制均有效。

证券代码：002200　　证券简称：云投生态　　公告编号：2018-130

云南云投生态环境科技股份有限公司关于向控股股东转让成都子公司 100%股权暨关联交易的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

特别提示：

本次交易能否在 2018 年 12 月 31 日前完成存在不确定性。

为盘活公司资产，提高资产效益，经公司第六届董事会第十八次会议审议，同意对外转让成都子公司 51%股权，并同意授权经营班子开展对拟出售股权的审计、评估工作，并授权经营班子在不低于评估价格的基础上，通过产权交易中心挂牌公开选择交易对手方，并根据最终摘牌结果，按照董事会、股东大会的决策权限，提交相关决策机构进行决策。

结合公司实际情况，公司拟对外转让成都子公司 100%股权，且公司控股股东愿意收购，经公司第六届董事会第二十四次会议审议，同意公司通过协议转让方式向控股股东云投集团转让成都子公司 100%股权。

一、向控股股东转让成都子公司 100%股权概况

1.为盘活公司资产，提高资产效益，公司拟以评估价格 3,007.11 万元（最终以评估备案结果为准）向控股股东云投集团出售成都子公司 100%股权。

2.云投集团持有公司 23.18%股份，为公司的控股股东，本次交易构成关联交易。根据《深圳证券交易所股票上市规则》、《深圳证券交易所中小板上市公司规范运作指引》的相关规定，本次关联交易金额为 3,007.11 万元（最终以评估备案结果为准）。

3.根据《公司章程》规定，本次关联交易需提交董事会审议，关联董事张清、林纪良、申毅、谭仁力回避表决。因交易金额超过公司最近一期经审计净资产的 5%，本议案还需提交公司股东大会审议。本次关联交易未构成《上市公司重大资产重组管理办法》规定的重大资产重组，不需经过其他有关部门批准。

二、拟出售标的资产基本情况

（一）基本信息

公司名称：成都云投生态园林景观工程有限公司

统一社会信用代码：91510115777745866XC

类型：有限责任公司（非自然人投资或控股的法人独资）

住所：成都市温江区天乡路二段

法定代表人：陈兴红

注册资本：人民币 1000.00 万元

营业期限：2005 年 07 月 13 日至 2055 年 07 月 12 日

营业范围：苗木及花卉的研发、种植、销售、租赁、养护及技术咨询服务；园林绿化工程、市政工程的设计、施工；水污染治理、生态监测、水土保持技术咨询服务；生物技术的开发、应用及推广服务；企业管理咨询服务；企业营销策划；农业技术咨询服务；机械设备研发、安装与销售；农副产品网上销售。（依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动）。

股权结构：云南云投生态环境科技股份有限公司 100%持股。

（二）资产状况

2017 年 12 月 31 日，成都子公司总资产为 44,686,587.61 元，总负债 39,700,519.02 元，所有者权益 4,986,068.59 元。

2018 年 8 月 31 日，成都子公司总资产 63,613,306.84 元，总负债 58,760,427.35 元，所有者权益 4,825,879.49 元。

（三）根据公司第六届董事会第十八次会议决议，公司已聘请中和资产评估有限公司对成都公司 100%股权进行评估，评估价值为 3,007.11 万元。

三、关联方基本情况

关联方名称：云南省投资控股集团有限公司；

成立日期：1997 年 9 月 5 日；

统一社会信用代码：91530000291996273 5；

注册资本：贰佰贰拾壹万玖仟玖佰叁拾万元正；

法定代表人：孙赟；

住所：昆明市拓东路 15 号；

公司类型：国有独资有限责任公司；

经营范围：经营和管理省级基本建设资金和省级专项建设基金，对省安排的基础产业、基础设施、优势产业项目以及国务院各部门在我省的重要投资项目，采取参股和根据国家批准的融资业务等方式进行投资和经营管理。（以上经营范围中涉及国家法律、行政法规规定的专项审批，按审批的项目和时限开展经营活动）。

云投集团主要财务数据：经审计，截止 2017 年 12 月 31 日，总资产为 25,728,791.36 万元，净资产为 8,288,458.28 万元；2017 年度营业收入为 8,951,740.60 万元，净利润为 86,948.91 万元。

云投集团持有本公司 23.18%的股份，为公司的控股股东。

四、拟签订的合同的主要内容

1.经甲乙双方协商，甲方（云投生态）将其拥有的成都云投生态园林景观工程有限公司 100%股权以协议方式转让乙方（云投集团）。

2.转让价款。本合同资产转让金额大写人民币叁仟零柒万壹仟零陆拾柒元壹角八分（小写：人民币 30,071,067.18 元）。

3.付款方式。本合同付款方式如下：自合同签订生效之日起，乙方于 5 个工作日内一次性向甲方支付全额转让价款。

4.受让方承诺。乙方承诺本次受让目标公司的存货完成销售及在手订单合同（包括与甲方签订的合同）履行完毕后，目标公司不经营与甲方主营业务相关的业务，不存在同业竞争的情形。目标公司如涉及资金占用，将及时予以归还。

5.违约责任

（1）甲方违反本合同约定的，应承担以下违约责任：向乙方支付转让价款总额 5%的违约金。

（2）乙方违反本合同约定的，应承担以下违约责任：向甲方支付转让价款总额 5%的违约金。

6.本合同经双方签章后生效。

五、关联交易主要内容及定价依据

本公司就此次关联交易聘请了中和资产评估有限公司（以下简称“中和评估”）就关联交易标的的价值进行了评估，并出具了评估报告。根据评估报告显示，截至评估基准日 2018 年 8 月 31 日止，成都子公司全部权益价值为 3,007.11 万元人民币。本次交易以评估结果作为公司向云投集团转让成都子公司 100%股权暨关联交易的定价依据。

六、本次关联交易目的和对公司影响

1.关联交易的目的。公司成都子公司自设立以来，经营效益不高，净资产已出现较大亏损，处置资产有利于回收资金。成都公司现有土地等资产，整体出售将有利于公司资产的盘活，收回资金投入到主营业务中，有助于改善公司资金状况、提高经营效益。

2.本次交易对公司的影响。本次股权转让事项将导致公司合并报表范围发生变化，交易完成后，成都子公司将不再纳入本公司合并报表范围。本公司没有为该子公司提供担保、委托该子公司理财。截止 2018 年 8 月 31 日，公司应付该子公司款项 2,855.37 万元，该子公司应付公司款项 2,637.31 万元。本次交易完成后，公司将及时履行相关交易决策程序。如涉及非经营性资金占用，将及时予以归还。

经公司财务部门初步测算，本次交易完成后，扣除相应税费及成本，本次交易完成后将增加当期或期后利润约 2,000 万元，有利于盘活公司资产，收回部分资金，改善资金状况。此关联交易不存在损害上市公司及全体股东利益的行为，不影响公司的独立性。

3.风险提示。

（1）本次交易尚需提交公司股东大会审议，能否获得股东大会审议通过仍具有不确定性；交易完成尚需签订协议，完成资金交付等程序，能否在 2018 年完成具有不确定性。

（2）本次交易预计将增加公司本期或期后利润约为 2,000 万元，对利润的影响金额以最终交易金额扣除缴纳的税费及相关成本后确定。

（3）公司于 2018 年 10 月 24 日对外披露的 2018 年第三季度报告全文中披露的对 2018 年全年业绩预测区间为亏损 25,000 万元至 16,000 万元，该预测区间未包括本次资产出售收益。目前，由于股东大会的审议及转让协议的签署及执行未完成，暂不存在对公司 2018 年度业绩预告进行修正的情形。对公司 2018 年度利润的具体影响，最终以公司聘请的审计机构出具的审核意见为准，对全年的利润及盈亏影响尚不确定。敬请广大投资者谨慎决策，注意风险。

七、2018 年年初至披露日与关联人累计已发生的各类关联交易的总金额

2018 年年初本公告披露日，公司与云投集团发生的各类关联交易总金额累计为 12,935.43 万元。

八、独立董事事前认可意见及独立意见

根据中国证监会《关于在上市公司建立独立董事制度的指导意见》、《深圳证券交易所股票上市规则》、《公司章程》的有关规定，独立董事对《关于向控股股东转让成都子公司 100%股权暨关联交易的议案》进行了事前审查。经认真的审查、核对，认为上述关联交易遵循了公平、公正、公允的原则，不存在损害公司及中小股东利益的情形。我们同意《关于向控股股东转让成都子公司 100%股权暨关联交易的议案》提交公司第六届董事会第二十四次会议审议。并发表如下独立意见：公司本次向控股股东转让成都子公司 100%股权，有利于盘活公司资产，收回部分资金，改善资金状况，符合公司整体发展战略需要。本次交易以资产评估价格作为计价依据，定价公允、合理，不存在损害公司及广大股东特别是中小股东利益的情形。该关联交易的决策程序符合《公司法》、《深圳证券交易所股票上市规则》及《公司章程》等有关规定，公司董事会在审议此项关联交易时，关联董事张清先生、林纪良先生、申毅先生、谭仁力先生回避表决，表决程序符合有关法律法规的规定。我们一致同意公司向云投集团转让成都子公司 100%股权，并同意将该议案提交公司股东大会审议。

九、备查文件

1.公司第六届董事会第二十四次会议决议；

2.独立董事对相关事项的独立意见；

3.独立董事对相关事项的事前认可意见。

云南云投生态环境科技股份有限公司

董事会

2018 年 12 月 17 日

（上接 D1 版）

（15）开放期内，本基金与本基金管理人管理的其他全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；开放期内，本基金与本基金管理人管理的其他全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

（16）开放期内，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；

因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

（17）在封闭期内，本基金总资产不得超过基金净资产的 200%；在开放期内，本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

（18）本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应制定严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险；

（19）本基金参与股指期货交易，则需遵守下列投资比例限制：

1）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；

2）开放期内的每个交易日日终，本基金持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

3）本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；

4）本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

5）本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关规定；

（20）开放期内，本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与本基金合同约定的投资范围保持一致；

（21）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

本基金在开始进行股指期货投资之前，应与基金托管人、期货公司三方一同就股指期货开户、清算、估值、交收等事宜另行签署协议。

除上述第（2）、（12）、（16）、（20）项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。期间，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

如果法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

法律法规或监管部门对上述组合限制政策作出强制性调整的，本基金应当按照法律法规或监管部门的规定执行；如法律法规或监管部门对上述组合限制政策的调整或修改对本基金的效力并非强制性的，则基金管理人与基金托管人协商一致后，可按照法律法规或监管部门调整或修改后的组合限制政策执行，而无需基金份额持有人大会审议决定，但基金管理人在执行法律法规或监管部门调整或修改后的组合限制政策前，应向投资者履行信息披露义务并向监管机关报告或备案。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

（1）承销证券；

（2）违反规定向他人贷款或者提供担保；

（3）从事承担无限责任的投资；

（4）向基金管理人、基金托管人出资；

（5）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（6）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合本基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。

（五）业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%

1、沪深 300 指数是中证指数公司依据国际指数编制标准并结合中国市场的实际情况编制的沪深两市统一指数，科学地反映了我国证券市场的整体业绩表现，具有一定的权威性和市场代表性，业内也普遍采用。因此，沪深 300 指数是衡量本基金股票投资业绩的理想基准。

2、上证国债指数由上交所编制，具有较长的编制和发布历史，以及较高的知名度和市场影响力，适合作为本基金债券投资部分的基准。

如果业绩比较基准中所使用的指数停止发布或变更名称，或者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，经与基金托管人协商一致，本基金可在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，不需要召开基金份额持有人大会。

（六）风险收益特征

本基金为混合型基金，属于证券投资基金中预期风险与预期收益中等的投资品种，其风险收益水平高于货币基金和债券型基金，低于股票型基金。

（七）基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；

2、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

3、有利于基金财产的安全与增值；

4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

八、基金的投资组合报告

基金管理人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。

基金托管人交通银行股份有限公司复核了本次更新招募说明书中的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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

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

本投资组合报告期截止至 2018 年 9 月 30 日。本报告中财务资料未经审计。以下金额单位均为人民币元。

一）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	723,988.00	0.99
	其中：股票	723,988.00	0.99
2	基金投资	－	－
3	固定收益投资	69,796,750.00	95.31
	其中：债券	69,796,750.00	95.31
	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	－	－
	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	1,558,129.16	2.13
8	其他资产	1,155,300.19	1.58
9	合计	73,234,167.35	100.00

二）期末按行业分类的股票投资组合

1、报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	－	－
C	制造业	351,772.00	0.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	32,460.00	0.06
E	建筑业	34,140.00	0.06
F	批发和零售业	2,988.00	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	26,336.00	0.05
H	住宿和餐饮业	－	－
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,128.00	0.02
J	金融业	173,618.00	0.30
K	房地产业	46,320.00	0.08
L	租赁和商务服务业	32,326.00	0.06
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	12,900.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	－	－
S	综合	－	－
	合计	723,988.00	1.27

2、报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

三）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	300122	智飞生物	800	39,168.00	0.07
2	600016	民生银行	6,000	38,040.00	0.07
3	601166	兴业银行	2,200	35,090.00	0.06
4	601688	华泰证券	2,200	34,650.00	0.06
5	600705	中航资本	7,400	34,558.00	0.06
6	002008	大族激光	800	33,896.00	0.06
7	603288	海天味业	400	31,680.00	0.06
8	601818	光大银行	8,000	31,280.00	0.05
9	000338	潍柴动力	3,600	30,780.00	0.05
10	600606	绿地控股	4,800	30,720.00	0.05

四）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	－	－
2	央行票据	－	－
3	金融债券	－	－
	其中：政策性金融债	－	－
4	企业债券	1,518,750.00	2.66
5	企业短期融资券	－	－
6	中期票据	－	－
7	可转债（可交换债）	－	－
8	同业存单	68,278,000.00	119.69
9	其他	－	－
10	合计	69,796,750.00	122.35

五）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

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	111819365	18 恒丰银行 CD365	500,000	49,150,000.00	86.16
2	111891192	18 杭州银行 CD004	200,000	19,128,000.00	33.53
3	122691	PR 武清债	50,000	1,010,000.00	1.77
4	122557	PR 株高科	25,000	508,750.00	0.89

六）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资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

七）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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

八）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明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

九）报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1、报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IF1810	沪深 300 股指期货 1810 合约	2	2,063,640.00	4,485.44	－
公允价值变动总额合计（元）					4,485.44
股指期货投资本期收益（元）					4,077.67
股指期货投资本期公允价值变动（元）					4,485.44

2、本基金投资股指期货的投资政策

本基金在股指期货的投资中主要遵循避险和有效管理两项策略和原则。即在市场风险大幅累计时的避险操作，减小基金投资组合因市场下跌而遭受的市场风险；同时利用股指期货流动性好、交易成本低等特点，通过股指期货对投资组合的仓位进行及时调整，提高投资组合的运作效率。

十）报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1、本期国债期货投资政策

注：本基金未参与投资国债期货。

2、报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

3、本期国债期货投资评价

注：本基金未参与投资国债期货。

十一）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报告期内被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形及相关投资决策程序说明。

（1）中航资本（600705）

中航资本于 2017 年 11 月 21 日发布公告，其子公司中航工业集团财务有限责任公司收到北京银监局行政处罚意见告知书的公告，主要内容为：“中航财务违规为集团外单位办理票据贴现业务，违规授权分公司开展对成员单位产品的消费信贷、买方信贷和对成员单位的履约保函业务，存在违反规定从事未经批准或者备案业务的违法违规行为。”北京银监局做出处罚规定，责令中航财务改正，并给予 50 万元罚款的行政处罚。同时，责令中航财务对相关直接责任人员给予纪律处分。

基金管理人认为，在收到处罚决定后，公司要求中航财务落实处罚措施、积极整改。公司及子公司决心以此为戒，进一步加强日常管理，依法合规的开展各项业务。目前中航财务经营情况正常。基金管理人经审慎分析，认为本次处罚预计不会对公司经营和业绩造成重大影响。

（2）18 恒丰银行 CD365（111819365）

恒丰银行于 2018 年 4 月 28 日收到中国银行间市场交易商协会自律处分信息，主要内容为：“恒丰银行作为债务融资工具主承销商，在债务融资工具承销工作中存在以下违反银行间市场相关自律规则指引的行为：一、在扬州化工产业投资发展有限公司永续票据项目承销工作中，尽职调查阶段未发现其转让下属子公司事项，尽职调查工作不充分。二、部分债务融资工具项目尽职调查底稿中的访谈纪要信息不完备，部分专项尽职调查报告未体现主承销商必要的核查和判断过程。”依据相关自律规定，经 2018 年第 4 次自律处分会议审议，协会给予恒丰银行诫勉谈话处分。

基金管理人分析认为，公司在收到交易商协会处分后，充分认识到业务管理上的不足，对本次事件中暴露出的问题进行全面深入的整改。基金管理人经审慎分析，认为该处分对公司经营和相关资产价格不会构成重大影响。

除中航资本（600705）、18 恒丰银行 CD365（111819365）外，其余的本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2、本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

3、其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	333,924.77
2	应收证券清算款	－
3	应收股利	－
4	应收利息	821,375.42
5	应收申购款	－
6	其他应收款	－
7	其他	－
8	合计	1,155,300.19

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末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在在流通受限情况的说明

注：报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

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，分项之和与合计项可能存在尾差。

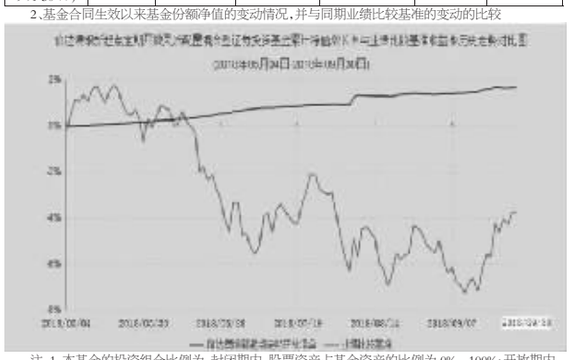
九、基金的业绩

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责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预示其未来表现。投资有风险，投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同。

1、截至 2018 年 9 月 30 日，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	净值收益率①	净值收益率标准差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
2018 年（2018 年 5 月 4 日至 2018 年 9 月 30 日）	1.68%	0.04%	-3.76%	0.64%	5.44%	-0.60%
自基金合同生效起至今（2018 年 5 月 4 日至 2018 年 9 月 30 日）	1.68%	0.04%	-3.76%	0.64%	5.44%	-0.60%

2、基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准的变动的比较



注：1、本基金的投资组合比例为：封闭期内